【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長　殿
【提出日】	2020年9月8日提出
【発行者名】	大和アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長　松下　浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇　保宏 連絡場所　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用） ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用） 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） ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用） ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用） 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） 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） ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用） ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用） ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で100兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部　【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）

ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）

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）

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）

ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）

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）

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）

ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）

ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）

ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）

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

ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	：ＴＯＰＩＸインデックス
ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	：日経２２５インデックス
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）	：外国株式インデックス（為替ヘッジあり）
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	：外国株式インデックス（為替ヘッジなし）
ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	：日本債券インデックス
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）	：外国債券インデックス（為替ヘッジあり）
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）	：外国債券インデックス（為替ヘッジなし）
ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	：Ｊ－ＲＥＩＴインデックス
ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）	：外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）
ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	：外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位

の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で100兆円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

各ファンドについて1万口当たり次のとおりとします。

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

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

(5) 【申込手数料】

① 取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212
（営業日の9:00～17:00）

② 申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

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

(7) 【申込期間】

2020年9月9日から2021年3月8日まで（継続申込期間）
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

大和証券株式会社　　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

大和証券株式会社　　東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。
株式会社　証券保管振替機構

(12) 【その他】

① 当ファンドは、投資者と販売会社が締結する投資一任契約に基づいて、資産を管理する口座の資金を運用するためのファンドです。受益権の取得申込者は、販売会社に投資一任契約の資産を管理する口座を開設した者に限るものとします。受益権の取得申込者は、販売会社と投資一任契約の資産を管理する口座に関する契約および投資一任契約を締結する必要があります。

② 下表に掲げる各ファンドについて、下表に掲げる該当日のいずれかと同じ日付の日を申込受付日とする受益権の取得および換金の申込みの受付けは行ないません。

ファンド名	該当日

外国株式インデックス（為替ヘッジあり） 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	ニューヨーク証券取引所の休業日
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
外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり） 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	ニューヨーク証券取引所または オーストラリア証券取引所の休業日

※申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

③　委託会社の各営業日（※）の午後3時までに受付けた取得および換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日（※）の取扱いとなります。
（※）前②の申込受付中止日を除きます。

④　金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止（「ＴＯＰＩＸインデックス」、「日経２２５インデックス」、「日本債券インデックス」および「Ｊ－ＲＥＩＴインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消すことができるものとします。

⑤　取得申込金額に利息は付きません。

⑥　振替受益権について
ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。
ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（参考）
◆投資信託振替制度とは、
ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。
・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません

記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

第二部　【ファンド情報】

第１　【ファンドの状況】

１　【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

＜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

＜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

＜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））

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

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

＜日本債券インデックス＞

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

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

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

＜Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	国内
	投資対象資産(収益の源泉)	不動産投信（リート）
	補足分類	インデックス型

属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（不動産投信））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	日本
	投資形態	ファミリーファンド
	対象インデックス	その他の指数（東証ＲＥＩＴ指数（配当込み））

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

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

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	海外
	投資対象資産(収益の源泉)	不動産投信（リート）
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

※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

＜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	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

＜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	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

＜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	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

＜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	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

＜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	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

＜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	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

＜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	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

＜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	特殊型
	内　外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

＜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（　　）
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

＜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）
単位型投信	国　内	株　式
追加型投信	海　外	債　券
	内　外	不動産投信
		その他資産（　　）
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

＜信託金の限度額＞

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

ファンド名	限度額
ＴＯＰＩＸインデックス	2,500億円

日経２２５インデックス	各ファンドについて5,000億円
外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	
外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	
日本債券インデックス	
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	
外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	
Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	各ファンドについて1,000億円
外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）	
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 当ファンドは、投資者と販売会社が締結する投資一任契約に基
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。

●当ファンド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
契約および投資一任契約を締結する必要があります。

2 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
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
（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
ファンドで行なう仕組みです。

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

●各ファンドの基本情報

特定の有価証券	各ファンド	特定の指数	マザーファンド
わが国の株式	TOPIXインデックス	東証株価指数（TOPIX）	トピックス・インデックスマザーファンド
	日経225インデックス	日経平均株価（日経225）	ストックインデックス225マザーファンド
海外の株式	外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファ
	外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	MSCIコクサイ指数（円ベース）	外国株式インデックスマザーファンド
わが国の債券	日本債券インデックス	ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数	日本債券インデックスマザーファンド
海外の債券	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド
	外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）	外国債券インデックスマザーファンド
わが国のリート	J-REITインデックス	東証REIT指数（配当込み）	ダイワJ-REITマザーファンド
海外のリート	外国REITインデックス（為替ヘッジあり）(注1)	S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）	ダイワ・グローバルREITマザーファンド
		—	先進国REITマザーファン
	外国REITインデックス（為替ヘッジなし）	S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）	ダイワ・グローバルREITマザーファンド
		—	先進国REITマザーファン

※各ファンド（「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

●各ファンドの運用方針

TOPIXインデックス

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

◆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
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。

⒜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。

⒝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
指数との連動性を維持するよう構築します。

⒞株式の組入比率は、高位を保ちます。

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

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をめざして運用を行ない

◆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
ます。

⒜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。

⒝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
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

外国株式インデックス（為替ヘッジあり）

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

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル(注1)を用います。
MSCIコクサイ指数（円ベース）への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォ
リ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・ヘ
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
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
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

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をめざして運用を行
ます。**

◆ポートフォリオの作成にあたっては、リスクモデル(注1)を用います。
MSCIコクサイ指数（円ベース）への連動性を随時チェックし、必要があればポートフォ
リ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。

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ます。

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

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ことをめざして運用を行ないます。

◆ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、リスクモデル(注3)を用い債券価格変動への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、債券の組ならびに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。

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）に連動する投資成あげることをめざして運用を行ないます。

◆ファンドの通貨別構成比率を同インデックスに近づけ、リスクモデル(注3)を用い債券価格変動への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。

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

◆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
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
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
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
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
ことがあります。

外国REITインデックス（為替ヘッジあり）
外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

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。

◆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指数は以下のとおりです。

マザーファンド	連動する投資成果をめざす指数
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	S&P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）
先進国REITマザーファンド	−

※先進国REITマザーファンドにおいて、運用の効率化を図るため、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引
することがあります。このため、リートおよびETFの組入総額ならびにリート指数先物取引の買建玉の時価総額の合
信託財産の純資産総額を超えることがあります。

外国REITインデックス（為替ヘッジあり）

◆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

※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
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
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

外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

◆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
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

●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
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、
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
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
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、
株式時価総額をベースに合成したものです。

◆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
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
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
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
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。

◆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
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
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
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
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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少
には、分配を行なわないことがあります。

主な投資制限

●TOPIXインデックス
●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。

●外国株式インデックス（為替ヘッジあり／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。

●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ます
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
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。

●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ます
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
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。

●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ます
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
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。

●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。

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

●基準価額の動きに関する留意点

各ファンド*は、特定の指数の動きに連動する投資成果をあげることをめざして運用を行ないま
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。

＊「外国REITインデックス（為替ヘッジあり）」および「外国REITインデックス（為替ヘッジなし）」を除きます。

TOPIXインデックス　日経225インデックス　外国株式インデックス（為替ヘッジあり）　外国株式インデックス（為替

- 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

＊「TOPIXインデックス」および「日経225インデックス」を除きます。

日本債券インデックス　外国債券インデックス（為替ヘッジあり）　外国債券インデックス（為替ヘッジなし）

- 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

＊「日本債券インデックス」を除きます。

J-REITインデックス

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

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

●各マザーファンドが連動対象とする指数の著作権等について

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

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
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
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
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
はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

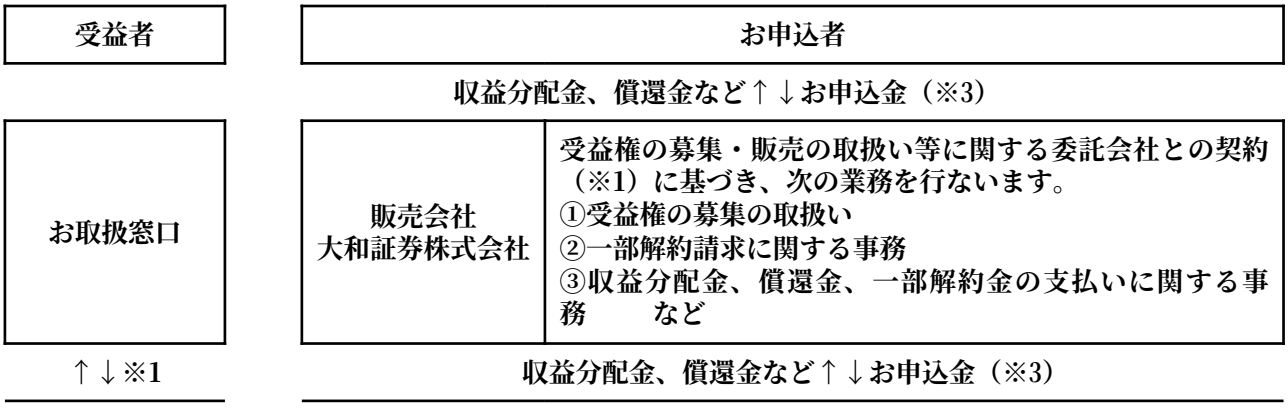
•東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標は、㈱東京証券取引所の知的財産であり、東証REIT指数
指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標
すべての権利は㈱東京証券取引所が有します。
• ㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出もしくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数
もしくは公表の停止または東証REIT指数の商標の変更もしくは使用の停止を行なうことができます。
• ㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値および東証REIT指数の商標の使用に関して得られる結果
特定日の東証REIT指数の指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
• ㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証する
ありません。また、㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延また
対し、責任を負いません。
• 「J－REITインデックス」は、㈱東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
• ㈱東京証券取引所は、「J－REITインデックス」の購入者または公衆に対し、「J－REITインデックス」
投資のアドバイスをする義務を負いません。
• ㈱東京証券取引所は、当社または「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
する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
• 以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は「J－REITインデックス」の設定、販売および販売促進活動に
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
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
されています。Standard & Poor's®およびS&P®はStandard & Poor's Financial Services LLC
の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商
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
ジメント株式会社にそれぞれ付与されています。「外国REITインデックス（為替ヘッジあり／為替ヘッジな
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
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
当インデックスの誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

(2) 【ファンドの沿革】

2017年2月16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】



委託会社	大和アセットマネジメント株式会社	当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（※2）の委託者であり、次の業務を行ないます。 ①受益権の募集・発行 ②信託財産の運用指図 ③信託財産の計算 ④運用報告書の作成　など

↓運用指図　↑↓※2　　損益↑↓信託金（※3）

受託会社	＜日経２２５インデックス＞ みずほ信託銀行株式会社 再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など
	＜上記以外の各ファンド＞ 三井住友信託銀行株式会社 再信託受託会社：株式会社日本カストディ銀行	信託契約（※2）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき株式会社日本カストディ銀行に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。 ①委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 ②信託財産の計算　など

損益↑↓投資

投資対象	ファミリーファンド方式で運用を行ないます。 ＜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 ＜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 ＜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 ＜日本債券インデックス＞ わが国の公社債　など ＜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 ＜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 ＜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

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

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

＜委託会社の概況（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。（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	%
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	2,608,525	100.00

2　【投資方針】

(1)　【投資方針】

①　主要投資対象

ファンド名	主要投資対象
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
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
外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの受益証券
外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券
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
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの受益証券
外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
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

外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券および先進国ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券
外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	

※以下、各ファンドにおいて（「外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）」および「外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）」は総称して）「マザーファンド」といいます。

② 投資態度

＜ＴＯＰＩＸインデックス＞

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

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

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

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

＜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。

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

ハ．マザーファンドにおいて、保有する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。

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。

＜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。

＜日本債券インデックス＞

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

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

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

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

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

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

＜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。

＜Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

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

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

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

＜投資先ファンドについて＞

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

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

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

＜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を通じて、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．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。

ハ．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。

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。

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

ハ．為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。

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

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

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

(2) 【投資対象】

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

① 当ファンドにおいて投資の対象とする資産（「ＴＯＰＩＸインデックス」、「日経２２５インデックス」および「日本債券インデックス」は本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
イ．有価証券
ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)⑧、⑨、⑩、⑪および⑫に定めるものに限ります。）
ハ．約束手形
ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
イ．為替手形

② 委託会社は、信託金を、主として、大和アセットマネジメント株式会社を委託者とし、「日経２２５インデックス」は、みずほ信託銀行株式会社、「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。

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

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

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

＜ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜日本債券インデックス＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．コマーシャル・ペーパー

11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの

13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14．投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）

17．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18．外国法人が発行する譲渡性預金証書

19．受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）

20．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

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

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

1．預金

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

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

5．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6．外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

※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。

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）

6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．コマーシャル・ペーパー

8．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの

9．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

10．投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

11．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

12．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）

13．預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

14．外国法人が発行する譲渡性預金証書

15．受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）

16．抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

17．外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって前15.の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券ならびに前10.の証券のうち投資法人債券ならびに前8.および前13.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（新投資口予約権証券および投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

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

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

＜Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

①　当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
イ．有価証券
ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(5)⑧に定めるものに限ります。）
ハ．約束手形
ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2．次に掲げる特定資産以外の資産
イ．為替手形

②　委託会社は、信託金を、主として、大和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。）

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

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

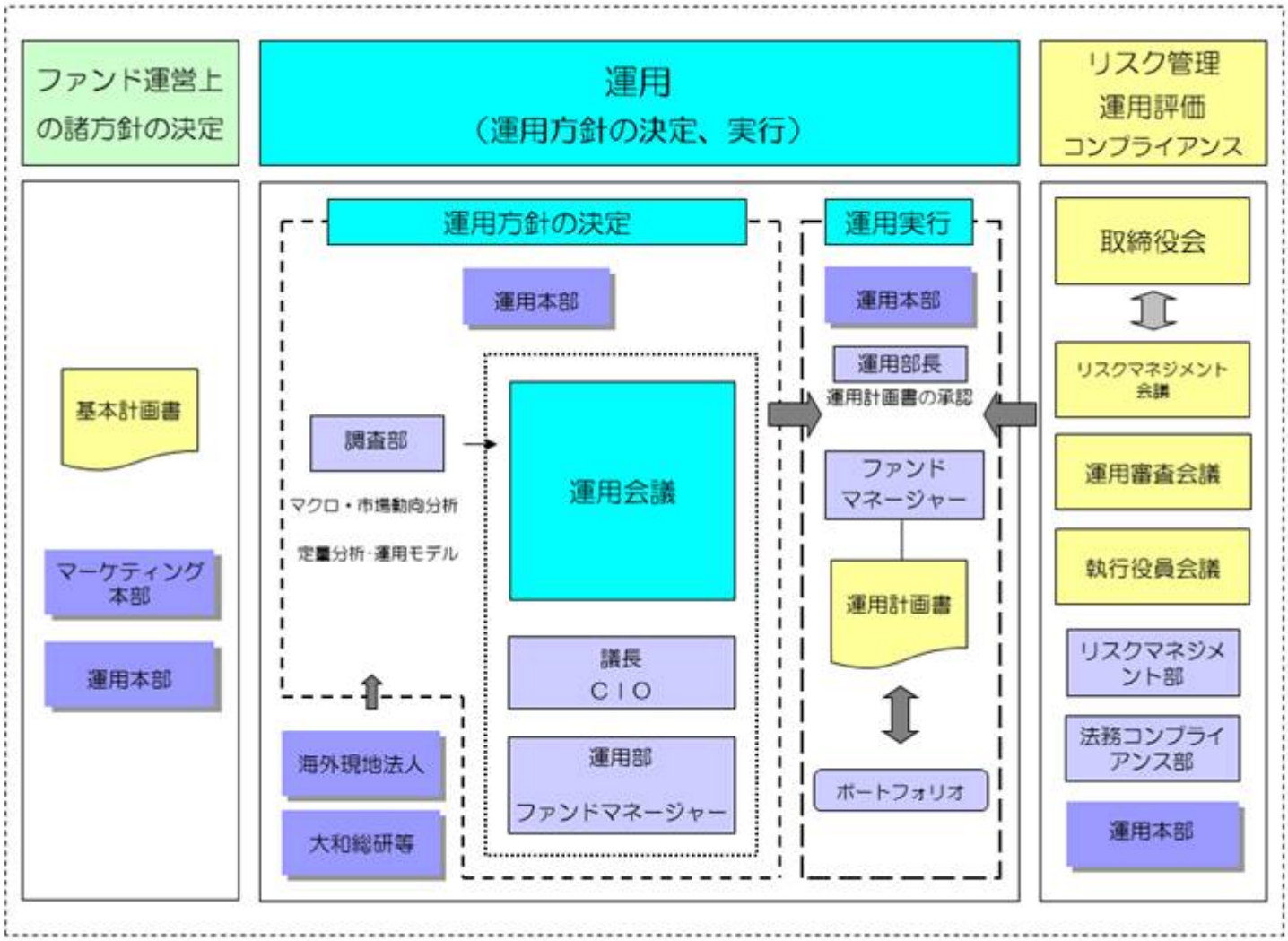
※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、＜ファンドの特色＞をご参照下さい。

(3) 【運用体制】

＜各ファンド共通＞

① 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



② 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を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。

③　職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（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。

④　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。

⑤　受託会社に対する管理体制

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

※　上記の運用体制は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＞

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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

③　留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5)【投資制限】

①　マザーファンドの受益証券（信託約款）

＜各ファンド共通＞

マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。

②　株式（信託約款）

＜ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜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。

＜日本債券インデックス＞

＜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す。

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

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

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

＜Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

株式への直接投資は、行ないません。

③　新株引受権証券等（信託約款）

＜ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜日本債券インデックス＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

④　投資信託証券（信託約款）

＜ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜日本債券インデックス＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜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。

＜Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

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

⑤　投資する株式等の範囲（信託約款）

＜ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜日本債券インデックス＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜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。

＜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。

＜Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

（規定なし）

⑥　同一銘柄の新株引受権証券等（信託約款）

＜ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜日本債券インデックス＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑦　信用取引（信託約款）

＜ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

＜日本債券インデックス＞

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

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑧　先物取引等（信託約款）

＜ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

＜日本債券インデックス＞

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

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

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

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

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

＜Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

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

⑨　スワップ取引（信託約款）

＜ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

＜日本債券インデックス＞

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

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

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

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

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

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

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

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

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

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

＜Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

（規定なし）

⑩　金利先渡取引（信託約款）

＜ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

＜日本債券インデックス＞

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

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

ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ハ．において「保有金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が保有金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．前ハ．においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割

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

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑪　金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

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

ホ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ．において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下本ホ．において「保有外貨建資産の時価総額の合計額」

といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

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

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑫　直物為替先渡取引（信託約款）

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

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

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

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑬　デリバティブ取引等（信託約款）

＜各ファンド共通＞

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

⑭　有価証券の貸付け（信託約款）

＜ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜日本債券インデックス＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜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。

＜Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

（規定なし）

⑮　外貨建資産（信託約款）

＜ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

＜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。

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜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。

＜Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

⑯　特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑰　外国為替予約取引（信託約款）

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

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

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

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

＜上記以外の各ファンド＞

（規定なし）

⑱　信用リスク集中回避（信託約款）

＜各ファンド共通＞

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

⑲　資金の借入れ（信託約款）

＜各ファンド共通＞

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、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．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

＜参　考＞ マザーファンドの概要

トピックス・インデックス・マザーファンド

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

主な投資制限	①　株式 株式への投資には、制限を設けません。 ②　先物取引等 イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。 ロ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。 ③　スワップ取引 イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。 ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。 ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

ストックインデックス２２５・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、日経平均株価をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場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。
投資態度	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。 1．上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行ないます。 2．株式の組入比率は、高位を保ちます。 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。

主な投資制限	①　株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　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。 ③　スワップ取引 イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。 ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。 ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
投資態度	①　主として海外の株式（預託証券を含みます。）に投資し、投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ②　保有外貨建資産については、ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして為替ヘッジを行ないます。 ③　運用の効率化を図るため、株式指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式等の組入総額ならびに株式指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ④　当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

主な投資制限	①　株式 株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　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。 ③　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。 ④　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。 ⑤　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。 ⑥　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。 ⑦　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。 ⑧　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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。 ⑨　金利先渡取引および為替先渡取引 イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。 ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。 ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。 ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。 ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

外国株式インデックスマザーファンド

運用の基本方針	投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の株式（預託証書を含みます。）を主要投資対象とします。
投資態度	イ．主として外国の株式（預託証書を含みます。）に投資し、投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ロ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、配当金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。 ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	①　株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

日本債券インデックスマザーファンド

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

主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	イ．主としてわが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 ロ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 ②　株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ③　同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④　外貨建資産への投資は、行ないません。

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

主な投資制限	①　株式 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　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。 ③　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。 ④　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。 ⑤　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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。 ⑥　金利先渡取引および為替先渡取引

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

外国債券インデックスマザーファンド

運用の基本方針	投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
投資態度	イ．主として外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。 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。 ハ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 ②　株式および株式を組入可能な投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ③　同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

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

主要投資対象	わが国の金融商品取引所（※）上場（上場予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 ※金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下当マザーファンドについて同じ。
投資態度	イ．東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 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。 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。 ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、「東証REIT指数」が改廃されたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	①　株式 株式への直接投資は、行ないません。 ②　投資信託証券 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ③　同一銘柄の投資信託証券 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、当該同一銘柄の「東証REIT指数」における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 ④　外貨建資産 外貨建資産への直接投資は、行ないません。 ⑤　先物取引 委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

運用の基本方針	Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所（※）上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。 ※金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下当マザーファンドについて同じ。

投資態度	イ．主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、ベンチマーク（Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）をいいます。以下同じ。）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 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。 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。 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。 ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が生じたとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	①　株式への直接投資は、行ないません。 ②　投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ③　同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。ただし、「投資態度」で定めた指数における時価の構成割合が30%を超える場合には、当該指数における構成割合の範囲で組入れることができるものとします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤　先物取引 委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。）および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

先進国ＲＥＩＴマザーファンド

運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	イ．先進国（日本を除きます。以下同じ。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）または店頭登録（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および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。） ロ．先進国のリート指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券） ハ．先進国のリートを対象としたリート指数先物取引 ニ．国内の債券
投資態度	ｲ. 主として、先進国のリート、先進国のリート指数を対象指数としたＥＴＦ、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引および残存期間の短いわが国の債券に投資し、先進国のリート市場の中長期的な値動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行ないます。 ※　一部日本のリートを含む指数を対象とするＥＴＦを組入れる場合があります。 ﾛ. 運用の効率化を図るため、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引を利用することがあります。このため、リートおよびＥＴＦの組入総額ならびにリート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。 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。

主な投資制限	①　株式 株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　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。 ③　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。 ④　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。 ⑤　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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。 ⑥　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（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)③の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。以下同じ。）の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。 ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。 ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。 ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

３　【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

＜ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

②　その他

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

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

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

（ＴＯＰＩＸインデックスおよび日経２２５インデックスの①と同内容）

②　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

③　その他

（ＴＯＰＩＸインデックスおよび日経２２５インデックスの②と同内容）

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

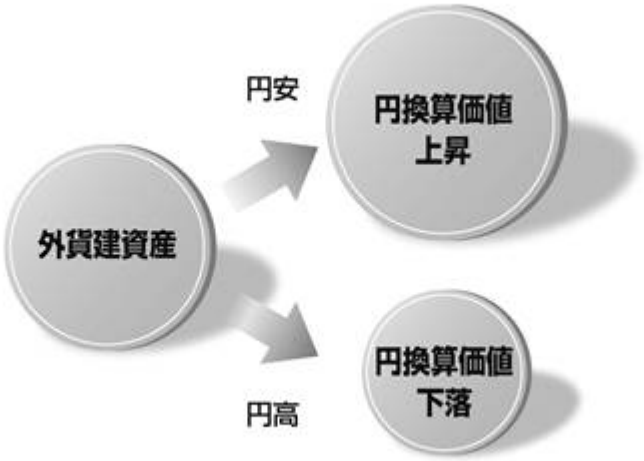
①　株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

（ＴＯＰＩＸインデックスおよび日経２２５インデックスの①と同内容）

②　外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

③　その他

（ＴＯＰＩＸインデックスおよび日経２２５インデックスの②と同内容）

＜日本債券インデックス＞

①　公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉

※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

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

②　その他

（ＴＯＰＩＸインデックスおよび日経２２５インデックスの②と同内容）

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

①　公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

（日本債券インデックスの①と同内容）

②　外国証券への投資に伴うリスク

（外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の②と同内容）

③　その他

（ＴＯＰＩＸインデックスおよび日経２２５インデックスの②と同内容）

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

①　公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

（日本債券インデックスの①と同内容）

②　外国証券への投資に伴うリスク

（外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の②と同内容）

③　その他

（ＴＯＰＩＸインデックスおよび日経２２５インデックスの②と同内容）

＜Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

①　リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。

・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

ハ．リートに関する法制度（税制、会計制度等）が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。
・その他、不動産を取巻く法制度や規制（建築規制、環境規制等）に変更があった場合も、リートの価格や配当が影響を受けることが考えられます。
・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもあります。

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

② その他
（ＴＯＰＩＸインデックスおよび日経２２５インデックスの②と同内容）

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞
① リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク
（Ｊ－ＲＥＩＴインデックスの①と同内容）
② 外国証券への投資に伴うリスク
（外国株式インデックス（為替ヘッジあり）の②と同内容）
③ その他
（ＴＯＰＩＸインデックスおよび日経２２５インデックスの②と同内容）

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞
① リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク
（Ｊ－ＲＥＩＴインデックスの①と同内容）
② 外国証券への投資に伴うリスク
（外国株式インデックス（為替ヘッジなし）の②と同内容）
③ その他
（ＴＯＰＩＸインデックスおよび日経２２５インデックスの②と同内容）

(2) 換金性等が制限される場合
通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。
① 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「ＴＯＰＩＸインデックス」、「日経２２５インデックス」、「日本債券インデックス」および「Ｊ－ＲＥＩＴインデックス」を除きます。）そ

の他やむを得ない事情が発生した場合には、お買付けの申込みの受付けを中止すること、すでに受付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

② 金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「ＴＯＰＩＸインデックス」、「日経２２５インデックス」、「日本債券インデックス」および「Ｊ－ＲＥＩＴインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

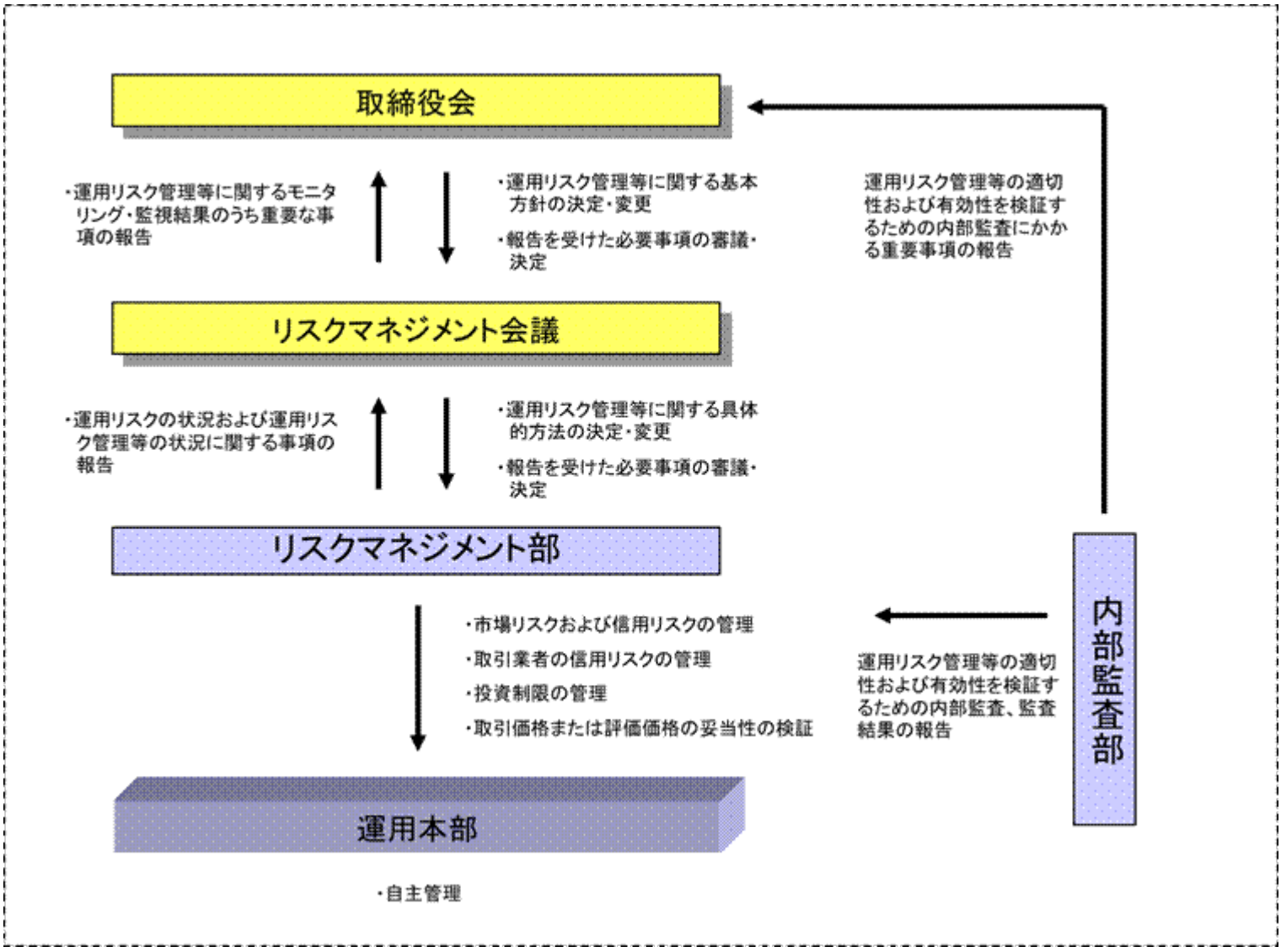
(3) その他の留意点

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

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（※）は、以下のとおりとなっています。



※　流動性リスクに対する管理体制

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

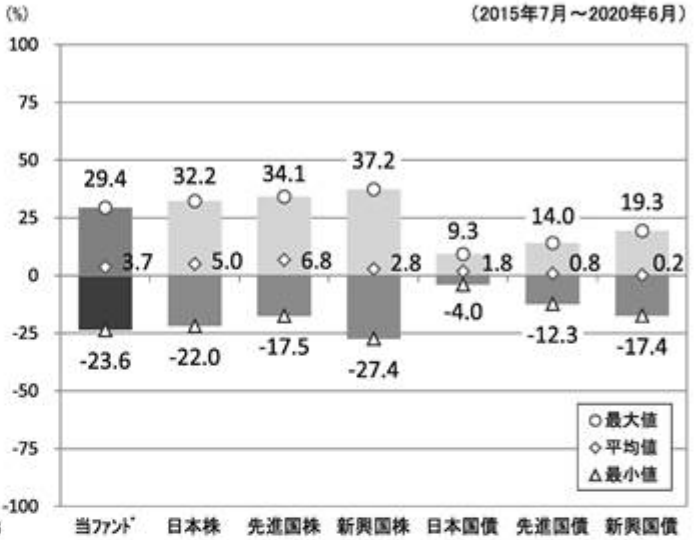
参考情報

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

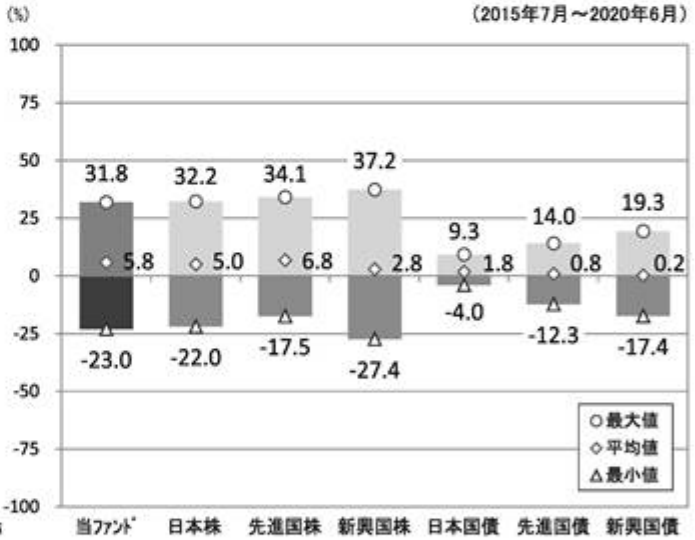
ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

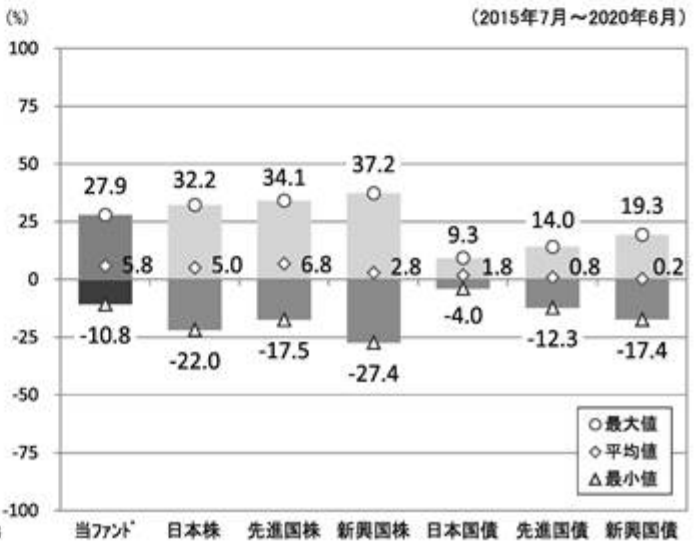
[TOPIXインデックス]



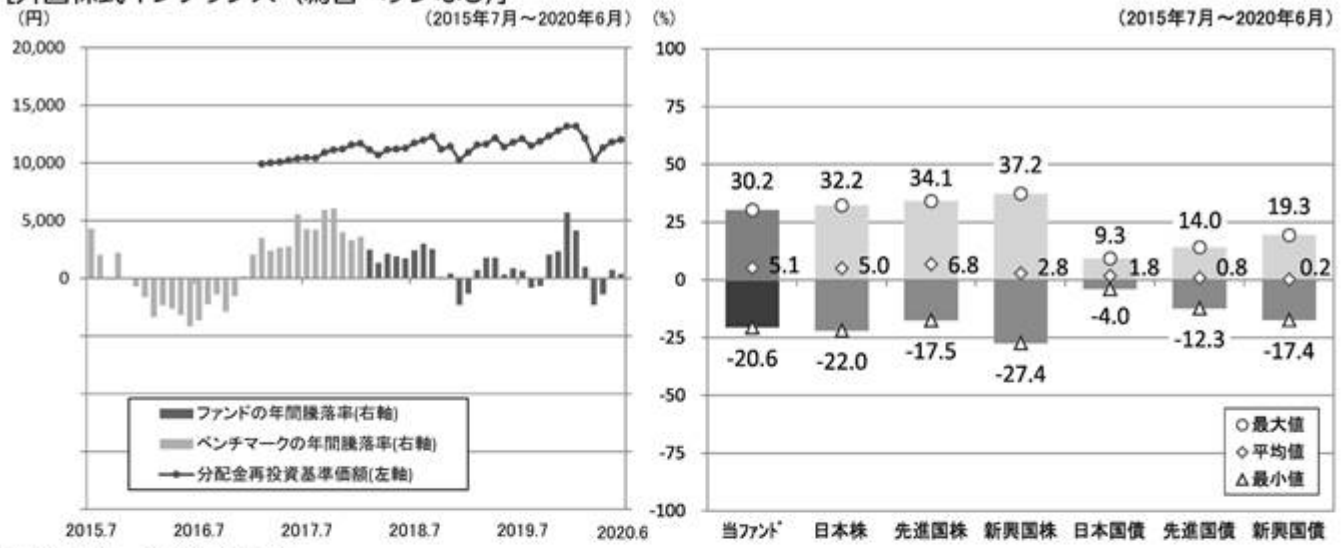
[日経225インデックス]



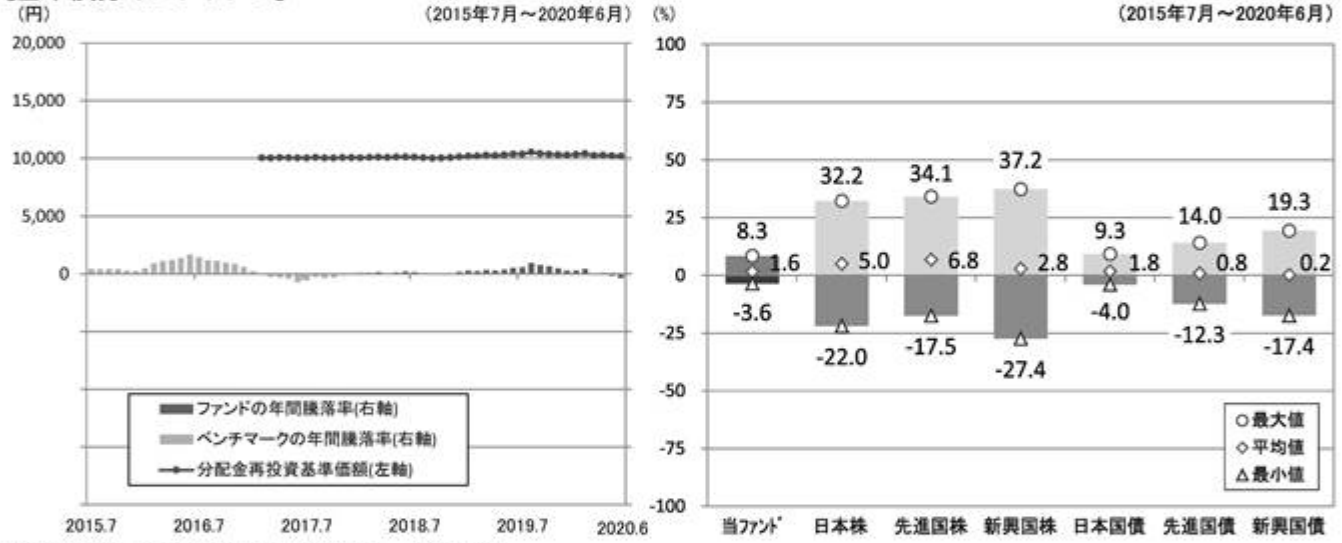
[外国株式インデックス（為替ヘッジあり）]



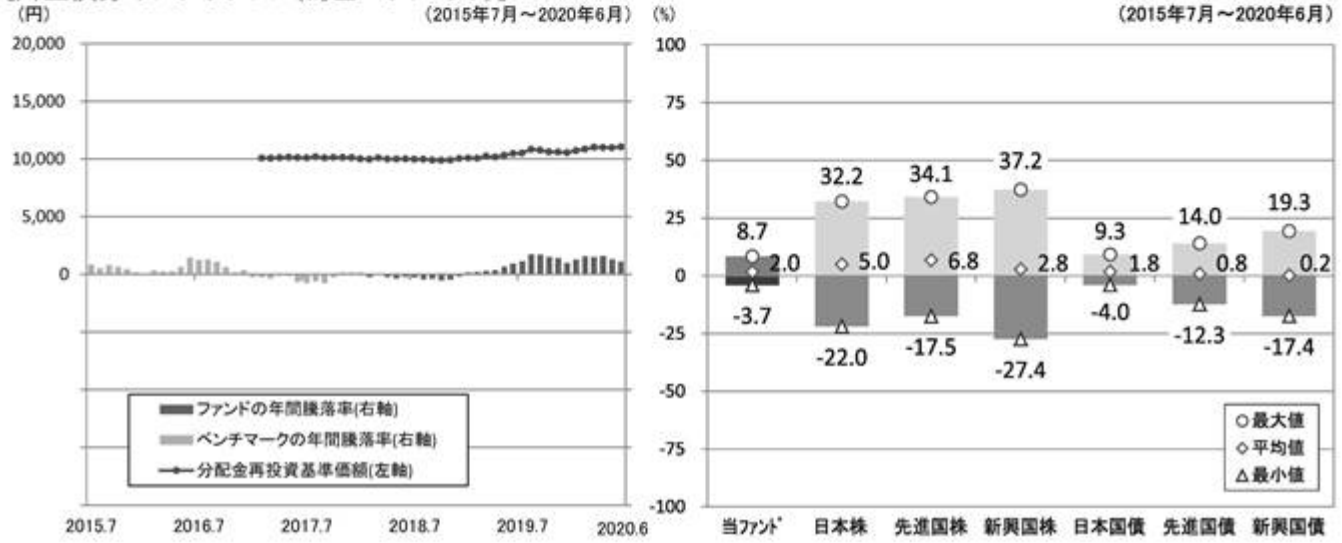
[外国株式インデックス（為替ヘッジなし）]



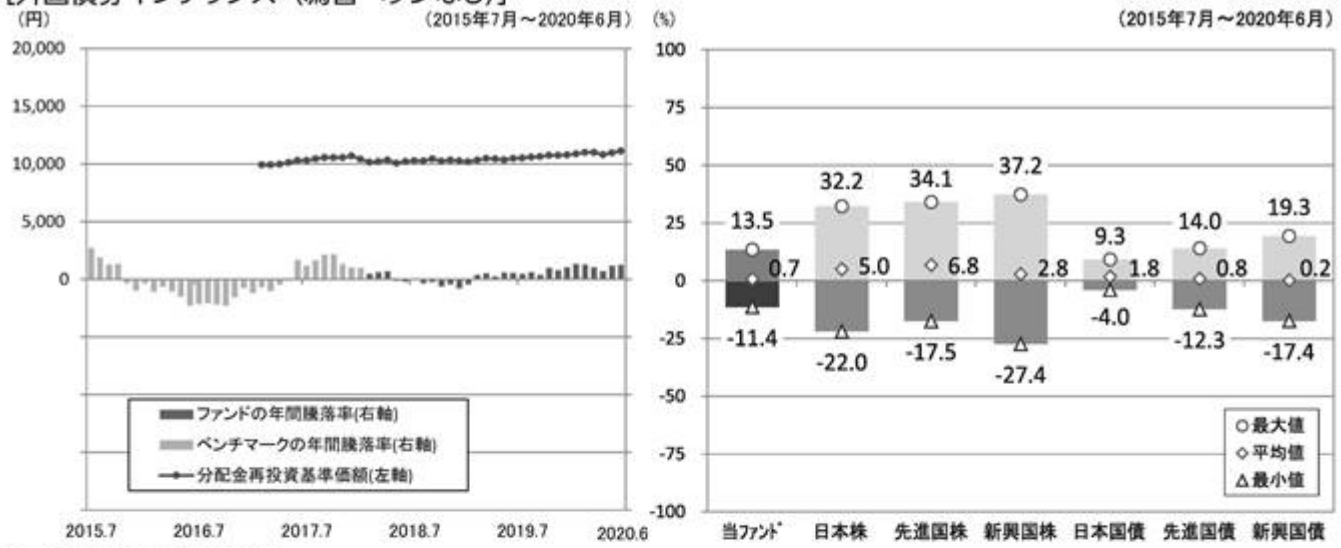
[日本債券インデックス]



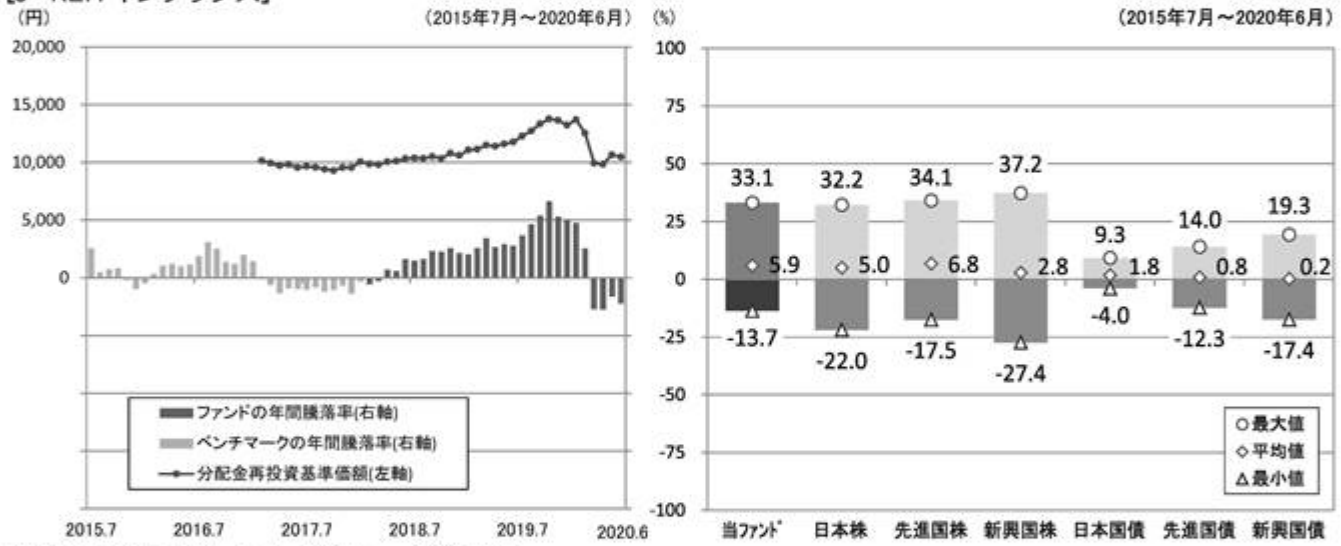
[外国債券インデックス（為替ヘッジあり）]



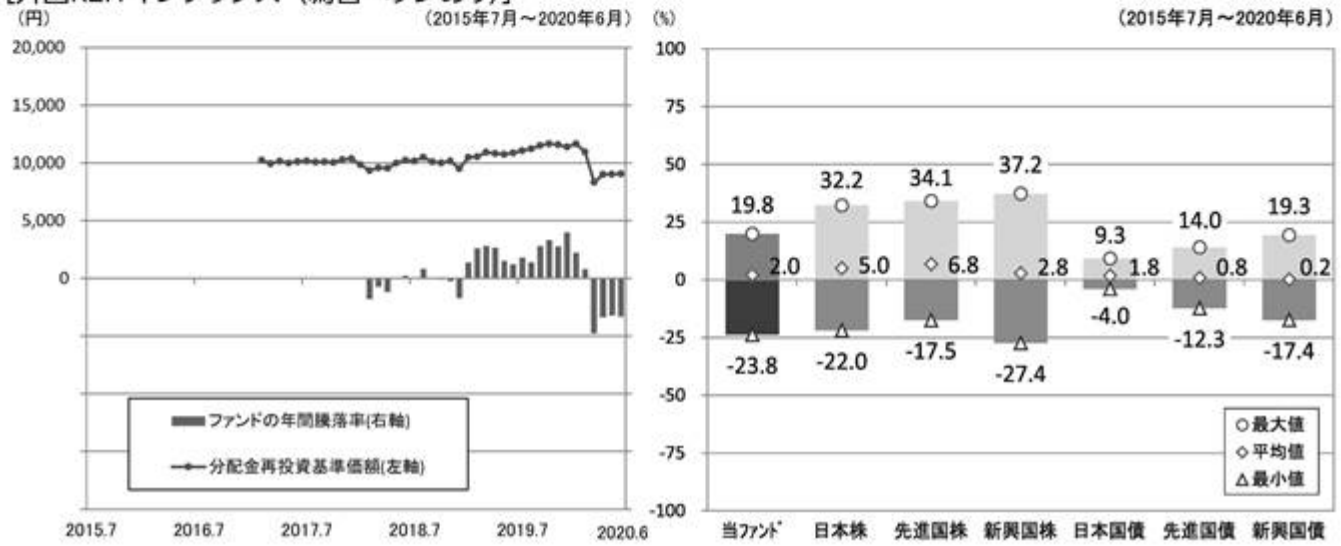
[外国債券インデックス（為替ヘッジなし)]



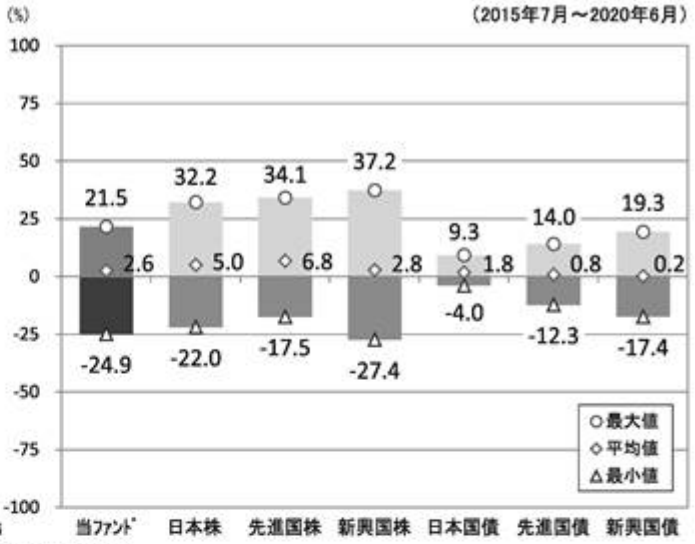
[J-REITインデックス]



[外国REITインデックス（為替ヘッジあり)]



[外国REITインデックス（為替ヘッジなし）]



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

※資産クラスについて

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

※指数について

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

４　【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

①　取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

②　申込手数料には、消費税等が課されます。

(2) 【換金(解約)手数料】

①　換金手数料

ありません。

②　信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

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

ファンド名	信託報酬率
ＴＯＰＩＸインデックス	年率0.341%（税抜0.31%）
日経２２５インデックス	
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%）
外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	
日本債券インデックス	年率0.3355%（税抜0.305%）以内（※）
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%）
外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	
Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	年率0.341%（税抜0.31%）
外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）	年率0.4345%（税抜0.395%）
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)(当初設定日から2017年3月10日(休業日の場合翌営業日)までの期間については当初設定日の前営業日)における新発10年国債の利回り(日本相互証券株式会社発表の終値)に応じて、純資産総額に対して以下の率とします。

（新発10年国債利回りが）

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%)

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

③　信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

＜ＴＯＰＩＸインデックス＞

＜日経２２５インデックス＞

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

＜外国株式インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国株式インデックス（為替ヘッジなし）＞

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

＜日本債券インデックス＞

	委託会社	販売会社	受託会社
前①ｲ.の場合	年率0.075%(税抜)	年率0.05%(税抜)	年率0.01%(税抜)
前①ﾛ.の場合	年率0.185%(税抜)	年率0.10%(税抜)	年率0.02%(税抜)

＜外国債券インデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国債券インデックス（為替ヘッジなし）＞

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

＜Ｊ－ＲＥＩＴインデックス＞

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

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）＞

＜外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）＞

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

※上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4)【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

＜マザーファンドより支弁する手数料等＞

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

(5)【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

①　個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

② 法人の投資者に対する課税

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

※源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

＜注1＞個別元本について

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

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

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

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

＜注2＞収益分配金の課税について

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

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

（※）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ＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）】

(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	5,144,310,828	99.99
内 日本	5,144,310,828	99.99
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	310,352	0.01
純資産総額	5,144,621,180	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)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	トピックス・インデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,995,446,522	1.0097 5,043,902,357	1.0298 5,144,310,828	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額(分配落)(円)	純資産総額(分配付)(円)	1口当たりの純資産額(分配落)(円)	1口当たりの純資産額(分配付)(円)
第1計算期間末(2017年6月15日)	4,156,052	4,168,187	1.0274	1.0304
第2計算期間末(2018年6月15日)	99,679,256	100,618,182	1.1678	1.1788
第3計算期間末(2019年6月17日)	1,892,823,205	1,898,380,433	1.0218	1.0248
2019年6月末日	1,925,454,761	－	1.0308	－
7月末日	6,652,460,642	－	1.0399	－
8月末日	6,980,992,215	－	1.0046	－
9月末日	2,799,702,837	－	1.0649	－
10月末日	8,822,643,866	－	1.1178	－
11月末日	14,198,075,737	－	1.1393	－
12月末日	8,658,705,111	－	1.1554	－
2020年1月末日	9,194,463,137	－	1.1304	－
2月末日	8,960,459,647	－	1.0139	－
3月末日	9,122,312,478	－	0.9532	－
4月末日	5,012,114,170	－	0.9941	－
5月末日	5,275,272,140	－	1.0614	－
第4計算期間末(2020年6月15日)	5,083,506,949	5,183,291,476	1.0189	1.0389
6月末日	5,144,621,180	－	1.0390	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0030
第2計算期間	0.0110
第3計算期間	0.0030
第4計算期間	0.0200

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	3.0
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	3,045,067	0
第2計算期間	81,311,932	0
第3計算期間	2,042,744,740	275,692,237
第4計算期間	20,581,650,630	17,444,833,751

(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）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ﾄﾖﾀ自動車	日本	株式	輸送用機器	729,700	7,330.12 5,348,794,957	6,762.00 4,934,231,400	3.37
2	ソ ニ ー	日本	株式	電気機器	409,800	6,380.14 2,614,581,478	7,384.00 3,025,963,200	2.07
3	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報･通信業	510,100	4,539.51 2,315,607,546	5,450.00 2,780,045,000	1.90
4	キーエンス	日本	株式	電気機器	59,300	33,481.59 1,985,458,565	45,030.00 2,670,279,000	1.83
5	日本電信電話	日本	株式	情報･通信業	858,100	2,625.25 2,252,731,969	2,515.50 2,158,550,550	1.48
6	武田薬品	日本	株式	医薬品	544,100	3,750.10 2,040,429,818	3,848.00 2,093,696,800	1.43
7	任 天 堂	日本	株式	その他製品	40,100	41,698.66 1,672,116,355	48,010.00 1,925,201,000	1.32
8	三菱UFJﾌｨﾅﾝｼｬﾙG	日本	株式	銀行業	4,409,700	557.70 2,459,304,712	421.60 1,859,129,520	1.27
9	ﾘｸﾙｰﾄﾎｰﾙﾃﾞｨﾝｸﾞｽ	日本	株式	サービス業	448,900	3,420.82 1,535,610,079	3,682.00 1,652,849,800	1.13
10	第一三共	日本	株式	医薬品	187,400	7,064.75 1,323,935,920	8,806.00 1,650,244,400	1.13
11	KDDI	日本	株式	情報･通信業	468,300	2,884.55 1,350,835,362	3,234.00 1,514,482,200	1.04
12	ダイキン工業	日本	株式	機械	83,400	14,426.65 1,203,183,223	17,335.00 1,445,739,000	0.99
13	本田技研	日本	株式	輸送用機器	514,500	2,864.95 1,474,020,613	2,755.50 1,417,704,750	0.97
14	信越化学	日本	株式	化学	109,900	11,741.89 1,290,433,885	12,595.00 1,384,190,500	0.95
15	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	446,100	3,734.05 1,665,761,225	3,032.00 1,352,575,200	0.92
16	花 王	日本	株式	化学	156,500	7,988.98 1,250,275,828	8,540.00 1,336,510,000	0.91
17	HOYA	日本	株式	精密機器	130,000	8,917.79 1,159,313,102	10,260.00 1,333,800,000	0.91
18	NTTﾄﾞｺﾓ	日本	株式	情報･通信業	458,400	2,832.04 1,298,210,069	2,882.00 1,321,108,800	0.90

19	村田製作所	日本	株式	電気機器	192,100	5,108.27 981,299,821	6,316.00 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 1,242,360,299	19,260.00 1,186,416,000	0.81
21	中外製薬	日本	株式	医薬品	204,900	2,749.71 563,416,764	5,765.00 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 1,452,921,091	132.20 1,158,455,380	0.79
23	日本電産	日本	株式	電気機器	157,700	7,583.60 1,195,934,371	7,196.00 1,134,809,200	0.78
24	SMC	日本	株式	機械	20,500	45,540.76 933,585,779	55,180.00 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	20,809.91 863,611,621	26,440.00 1,097,260,000	0.75
26	東京海上HD	日本	株式	保険業	228,200	5,827.20 1,329,768,685	4,698.00 1,072,083,600	0.73
27	日 立	日本	株式	電気機器	314,200	4,027.26 1,265,365,439	3,403.00 1,069,222,600	0.73
28	伊 藤 忠	日本	株式	卸売業	450,300	2,294.79 1,033,345,381	2,321.50 1,045,371,450	0.71
29	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	566,700	1,543.55 874,731,263	1,799.50 1,019,776,650	0.70
30	三菱商事	日本	株式	卸売業	422,700	2,758.62 1,166,071,535	2,270.00 959,529,000	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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	日本	TOPIX先物 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

●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	10,390円
純資産総額	51億円

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	7.6%

※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：　200円　　設定来分配金合計額：　370円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月
分配金	30円	110円	30円	200円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内株式	2,116	97.8%
国内株式先物	1	2.1%
不動産投資信託等	−	−
コール・ローン、その他		2.2%
合計	2,117	−

株式 市場・上場別構成	比率
一部(東証・名証)	97.8%
二部(東証・名証)	−
新興市場他	−
その他	−
合計	97.8%

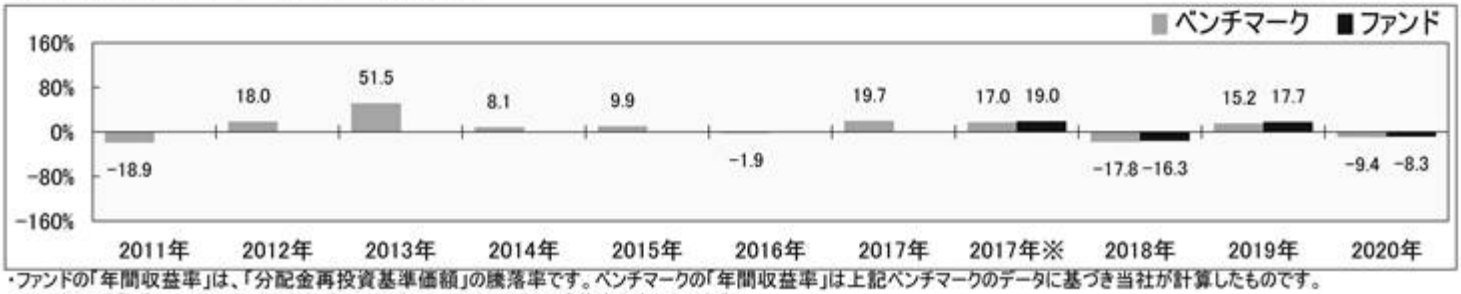
株式東証33業種別構成	比率
電気機器	14.8%
情報・通信業	9.7%
化学	7.1%
輸送用機器	7.1%
医薬品	6.8%
機械	5.2%
サービス業	5.2%
小売業	4.9%
銀行業	4.8%
その他	32.2%
合計	97.8%

組入上位10銘柄	業種名	比率
トヨタ自動車	輸送用機器	3.4%
TOPIX先物 0209月	−	2.1%
ソニー	電気機器	2.1%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.9%
キーエンス	電気機器	1.8%
日本電信電話	情報・通信業	1.5%
武田薬品	医薬品	1.4%
任天堂	その他製品	1.3%
三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.3%
リクルートホールディングス	サービス業	1.1%
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。
・2017年※は設定日（2月16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。

【ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）】

－

(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	394,528,203	99.98
内 日本	394,528,203	99.98
コール･ローン、その他の資産（負債控除後）	64,429	0.02
純資産総額	394,592,632	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)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ストックインデックス２２５・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	138,324,172	2.7528 380,791,624	2.8522 394,528,203	99.98

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額(分配落)(円)	純資産総額(分配付)(円)	1口当たりの純資産額(分配落)(円)	1口当たりの純資産額(分配付)(円)
第1計算期間末(2017年6月15日)	1,020,073	1,027,073	1.0201	1.0271
第2計算期間末(2018年6月15日)	27,240,569	27,447,452	1.1850	1.1940
第3計算期間末(2019年6月17日)	33,941,230	34,498,119	1.0971	1.1151
2019年6月末日	34,233,618	－	1.1065	－
7月末日	34,616,613	－	1.1189	－
8月末日	44,316,388	－	1.0769	－
9月末日	26,206,645	－	1.1401	－
10月末日	27,614,182	－	1.2013	－
11月末日	28,051,483	－	1.2203	－
12月末日	28,465,260	－	1.2383	－
2020年1月末日	186,531,804	－	1.2143	－
2月末日	170,110,886	－	1.1074	－
3月末日	416,632,136	－	1.0011	－
4月末日	356,586,670	－	1.0680	－
5月末日	386,184,248	－	1.1567	－
第4計算期間末(2020年6月15日)	376,011,783	380,018,315	1.1262	1.1382
6月末日	394,592,632	－	1.1673	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0070
第2計算期間	0.0090
第3計算期間	0.0180
第4計算期間	0.0120

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.7

第2計算期間	17.0
第3計算期間	△5.9
第4計算期間	3.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	0	0
第2計算期間	21,987,038	0
第3計算期間	816,750,378	808,799,125
第4計算期間	1,970,995,928	1,668,056,539

(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）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	262,000	63,175.03 16,551,859,640	61,700.00 16,165,400,000	9.79
2	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	1,572,000	4,566.86 7,179,112,080	5,450.00 8,567,400,000	5.19
3	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	262,000	20,765.58 5,440,583,040	26,440.00 6,927,280,000	4.19
4	ＫＤＤＩ	日本	株式	情報・通信業	1,572,000	2,891.14 4,544,875,920	3,234.00 5,083,848,000	3.08
5	ファナック	日本	株式	電気機器	262,000	19,855.94 5,202,258,720	19,260.00 5,046,120,000	3.05
6	ダイキン工業	日本	株式	機械	262,000	14,372.99 3,765,724,120	17,335.00 4,541,770,000	2.75
7	中外製薬	日本	株式	医薬品	786,000	2,809.96 2,208,631,320	5,765.00 4,531,290,000	2.74
8	テ ル モ	日本	株式	精密機器	1,048,000	3,322.94 3,482,450,880	4,081.00 4,276,888,000	2.59
9	信越化学	日本	株式	化学	262,000	11,695.32 3,064,174,160	12,595.00 3,299,890,000	2.00
10	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	524,000	4,680.51 2,452,587,760	6,120.00 3,206,880,000	1.94
11	京 セ ラ	日本	株式	電気機器	524,000	6,720.38 3,521,482,880	5,865.00 3,073,260,000	1.86
12	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	786,000	3,409.10 2,679,557,400	3,682.00 2,894,052,000	1.75
13	エムスリー	日本	株式	サービス業	628,800	2,624.42 1,650,241,474	4,585.00 2,883,048,000	1.75
14	ＴＤＫ	日本	株式	電気機器	262,000	9,490.00 2,486,380,000	10,680.00 2,798,160,000	1.69
15	セコム	日本	株式	サービス業	262,000	9,581.62 2,510,384,560	9,423.00 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 2,011,007,800	1,799.50 2,357,345,000	1.43
17	第一三共	日本	株式	医薬品	262,000	7,059.43 1,849,572,840	8,806.00 2,307,172,000	1.40
18	エーザイ	日本	株式	医薬品	262,000	5,669.40 1,485,385,200	8,546.00 2,239,052,000	1.36

19	花 王	日本	株式	化学	262,000	7,954.51 2,084,081,880	8,540.00 2,237,480,000	1.35
20	オリンパス	日本	株式	精密機器	1,048,000	1,439.92 1,509,039,840	2,075.50 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 2,736,389,600	1,849.00 1,937,752,000	1.17
22	ソ ニ ー	日本	株式	電気機器	262,000	6,383.48 1,672,474,240	7,384.00 1,934,608,000	1.17
23	オムロン	日本	株式	電気機器	262,000	5,783.72 1,515,335,360	7,220.00 1,891,640,000	1.15
24	資 生 堂	日本	株式	化学	262,000	8,413.18 2,204,253,840	6,835.00 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 1,910,192,280	6,762.00 1,771,644,000	1.07
26	塩野義製薬	日本	株式	医薬品	262,000	5,776.81 1,513,524,280	6,750.00 1,768,500,000	1.07
27	日東電工	日本	株式	化学	262,000	5,308.10 1,390,722,800	6,100.00 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 1,369,485,520	6,020.00 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 1,819,275,000	1,199.00 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 1,636,199,640	5,667.00 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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	日本	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

●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	11,673円
純資産総額	3.9億円

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	6.6%
3年間	17.1%
5年間	−
設定来	21.6%

※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：　120円　　設定来分配金合計額：　460円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月								
分配金	70円	90円	180円	120円								

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
国内株式	225	98.1%
国内株式先物	1	1.9%
不動産投資信託等	−	−
コール・ローン、その他		1.9%
合計	226	−

株式　市場・上場別構成	比率
一部(東証・名証)	98.1%
二部(東証・名証)	−
新興市場他	−
その他	−
合計	98.1%

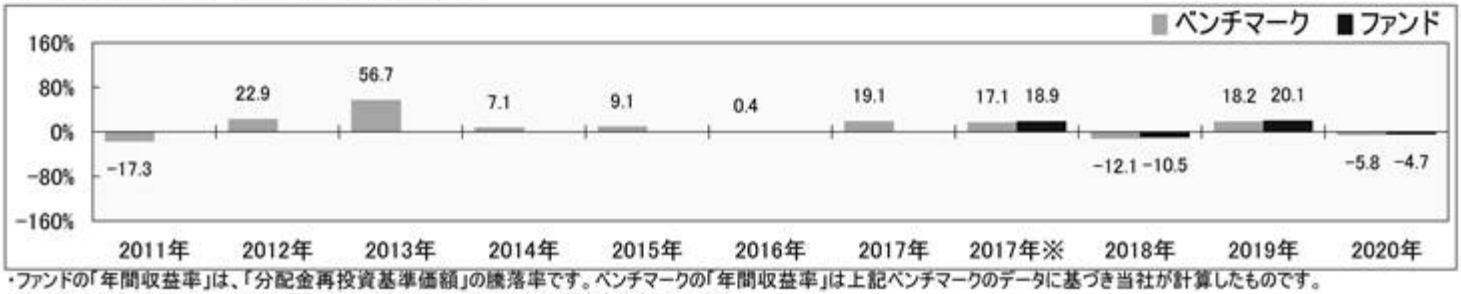
株式東証33業種別構成	比率
電気機器	19.6%
小売業	12.4%
情報・通信業	11.0%
医薬品	10.0%
化学	8.1%
サービス業	5.9%
機械	4.7%
輸送用機器	4.1%
精密機器	4.1%
その他	18.1%
合計	98.1%

組入上位10銘柄	業種名	比率
ファーストリテイリング	小売業	9.8%
ソフトバンクグループ	情報・通信業	5.2%
東京エレクトロン	電気機器	4.2%
KDDI	情報・通信業	3.1%
ファナック	電気機器	3.1%
ダイキン工業	機械	2.7%
中外製薬	医薬品	2.7%
テルモ	精密機器	2.6%
信越化学	化学	2.0%
アドバンテスト	電気機器	1.9%
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。
・2017年※は設定日（2月16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。

【ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）】

－

(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	7,964,714,171	99.99
内 日本	7,964,714,171	99.99
コール･ローン、その他の資産（負債控除後）	601,455	0.01
純資産総額	7,965,315,626	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)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,993,138,560	1.9760 7,890,488,357	1.9946 7,964,714,171	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	3,609,633	3,630,431	1.0413	1.0473
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,333,520,140	1,345,180,653	1.1436	1.1536
第3計算期間末 (2019年6月17日)	3,003,717,900	3,053,452,707	1.1475	1.1665
2019年6月末日	3,011,964,234	－	1.1616	－
7月末日	5,635,320,154	－	1.1885	－
8月末日	5,914,081,790	－	1.1536	－
9月末日	3,447,692,791	－	1.1730	－
10月末日	5,912,526,536	－	1.1991	－
11月末日	6,370,145,992	－	1.2375	－
12月末日	6,857,654,550	－	1.2651	－
2020年1月末日	7,559,925,764	－	1.2741	－
2月末日	7,409,652,481	－	1.1706	－
3月末日	8,585,604,300	－	1.0064	－
4月末日	7,704,360,209	－	1.1216	－
5月末日	7,875,007,691	－	1.1588	－
第4計算期間末 (2020年6月15日)	7,959,510,896	8,070,496,281	1.1475	1.1635
6月末日	7,965,315,626	－	1.1581	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0060
第2計算期間	0.0100
第3計算期間	0.0190
第4計算期間	0.0160

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	4.7

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	2,466,456	0
第2計算期間	1,162,584,923	0
第3計算期間	3,354,512,466	1,902,942,421
第4計算期間	12,869,207,903	8,550,242,735

(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）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

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

1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	57,864	32,859.40 1,901,381,286	38,978.17 2,255,433,246	4.09
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	95,607	17,516.04 1,674,661,545	21,379.92 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 1,164,478,883	288,784.14 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	22,905.84 727,698,065	23,771.75 755,204,840	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	149,499.26 603,528,648	150,294.06 606,737,152	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	150,853.77 601,756,021	150,531.09 600,468,541	1.09
7	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	34,816	15,640.29 544,535,640	14,980.16 521,549,585	0.94
8	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	39,217	11,683.28 458,187,121	11,879.04 465,860,406	0.84
9	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	22,553	20,494.19 462,207,088	20,619.28 465,026,649	0.84
10	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	33,011	13,246.09 437,268,483	12,676.68 418,470,161	0.76
11	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	40,457	14,265.42 577,138,684	10,019.82 405,371,858	0.73
12	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	12,499	31,196.44 389,925,402	31,218.74 390,203,061	0.71
13	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	14,403	23,824.33 343,143,157	26,516.96 381,923,902	0.69
14	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	11,821	32,570.01 385,010,328	31,560.27 373,074,049	0.68
15	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	56,300	6,368.51 358,550,483	6,278.00 353,451,952	0.64

16	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	9,391	36,238.09 340,312,466	37,526.76 352,413,888	0.64
17	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	18,048	23,898.99 431,329,160	19,090.45 344,544,452	0.62
18	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	8,107	26,855.81 217,720,349	39,648.32 321,428,930	0.58
19	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	54,342	6,297.72 342,235,854	5,892.30 320,199,399	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	4,063.73 383,082,405	3,222.50 303,778,951	0.55
21	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	6,341	36,364.40 230,587,082	45,703.30 289,804,676	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	14,974.02 359,347,711	12,015.16 288,339,925	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	36,945.66 214,802,488	48,185.63 280,151,297	0.51
24	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	55,739	5,012.92 279,415,973	4,972.20 277,145,512	0.50
25	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	33,538	9,466.25 317,479,978	8,201.16 275,050,799	0.50
26	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	56,834	7,087.46 402,811,806	4,775.03 271,384,441	0.49
27	PAYPAL HOLDINGS INC	アメリカ	株式	情報技術	14,645	11,935.11 174,790,544	18,138.02 265,631,435	0.48
28	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	28,050	10,369.36 290,861,338	9,439.15 264,768,197	0.48
29	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	103,493	3,644.09 377,147,426	2,520.03 260,806,355	0.47
30	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	18,309	14,422.29 264,059,097	14,122.55 258,569,936	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。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.50%
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。

ハ．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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	ｱﾒﾘｶ	S&P500 E-MINI FUTURE 2020年9月	買建	50	823,893,167	820,911,463	1.49%
	ｲｷﾞﾘｽ	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月	買建	6	65,262,046	64,353,174	0.12%
	ｶﾅﾀﾞ	S&P/TSE 60 INDEX 2020年9月	買建	2	28,930,396	29,096,112	0.05%
	ﾄﾞｲﾂ	SMI 2020年9月	買建	5	56,477,108	56,796,813	0.10%

		EURO STOXX 50 2020年9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・シュケル売/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

●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	11,581円
純資産総額	79億円

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	21.1%

※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:　160円　　設定来分配金合計額:　510円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月								
分配金	60円	100円	190円	160円								

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国株式・先物	1,204	97.7%
外国リート	65	2.5%
外国投資証券	6	0.1%
コール・ローン、その他		1.9%
合計	1,275	−

国・地域別構成	比率
アメリカ	71.1%
イギリス	4.9%
その他	24.3%
合計	100.3%

通貨別構成	比率
日本円	98.8%
米ドル	0.7%
ユーロ	0.3%
香港ドル	0.1%
スイス・フラン	0.0%
カナダ・ドル	0.0%
スウェーデン・クローネ	0.0%
デンマーク・クローネ	0.0%
シンガポール・ドル	0.0%
その他	−0.0%
合計	100.0%

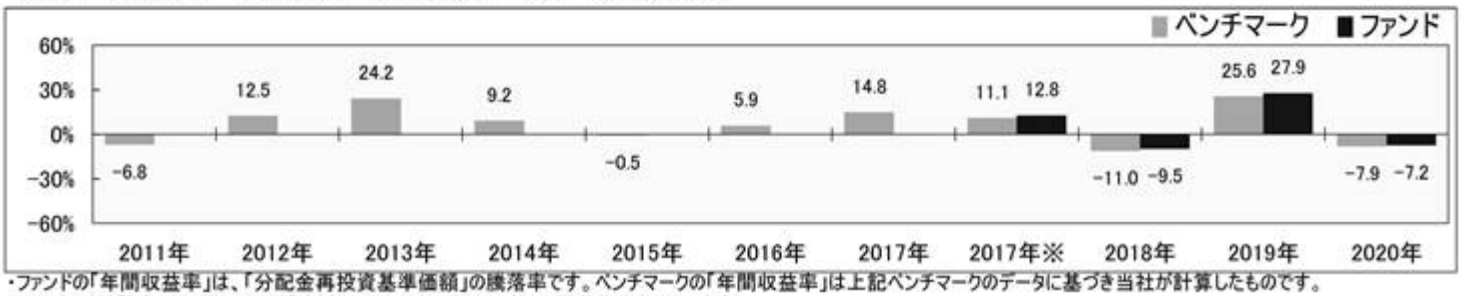
株式業種別構成	比率
情報技術	21.4%
ヘルスケア	14.0%
金融	12.7%
一般消費財・サービス	10.2%
資本財・サービス	9.0%
コミュニケーション・サービス	8.5%
生活必需品	8.2%
素材	4.2%
公益事業	3.4%
エネルギー、他	3.8%
合計	95.5%

組入上位10銘柄	国・地域名	比率
APPLE INC	アメリカ	4.1%
MICROSOFT CORP	アメリカ	3.7%
AMAZON.COM INC	アメリカ	2.9%
S&P500 EMINI FUT 202009	アメリカ	1.5%
FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	1.4%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.1%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.1%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
NESTLE SA-REG	スイス	0.8%
VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	0.8%
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欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）です。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2017年※は設定日（2月16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。

【ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）】

(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		221,875,154	99.99
	内 日本	221,875,154	99.99
コール･ローン、その他の資産（負債控除後）		19,207	0.01
純資産総額		221,894,361	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)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	85,679,315	2.5551 218,919,224	2.5896 221,875,154	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,009,377	1,019,377	1.0094	1.0194
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,127,308	1,149,308	1.1273	1.1493
第3計算期間末 (2019年6月17日)	16,536,717	16,580,596	1.1306	1.1336
2019年6月末日	16,696,914	－	1.1416	－
7月末日	3,163,639,157	－	1.1722	－
8月末日	3,278,751,359	－	1.1137	－
9月末日	62,759,812	－	1.1497	－
10月末日	6,042,065,433	－	1.1951	－
11月末日	7,236,230,926	－	1.2390	－
12月末日	4,489,355,669	－	1.2761	－
2020年1月末日	4,768,885,544	－	1.2770	－
2月末日	8,260,449,562	－	1.1758	－
3月末日	6,169,589,813	－	0.9986	－
4月末日	639,499,986	－	1.0961	－
5月末日	301,493,661	－	1.1427	－
第4計算期間末 (2020年6月15日)	223,479,606	223,479,606	1.1489	1.1489
6月末日	221,894,361	－	1.1642	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0100
第2計算期間	0.0220
第3計算期間	0.0030
第4計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)

第1計算期間	1.9
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	0	0
第2計算期間	0	0
第3計算期間	13,626,454	0
第4計算期間	15,442,007,002	15,262,119,439

(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）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

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

1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	139,200	28,909.01 4,024,137,214	38,978.17 5,425,762,266	4.10
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	230,000	16,534.53 3,802,960,957	21,379.92 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 2,662,349,332	288,784.14 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 1,654,879,612	23,771.75 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 1,379,165,337	150,294.06 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 1,346,854,012	150,531.09 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 1,249,014,844	14,980.16 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 1,128,134,264	11,879.04 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 1,082,052,644	20,619.28 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 1,032,633,547	12,676.68 997,870,881	0.75
11	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	98,070	14,008.35 1,373,805,259	10,019.82 982,643,747	0.74
12	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	30,226	30,050.94 908,320,129	31,218.74 943,617,708	0.71
13	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	34,800	23,806.44 828,468,023	26,516.96 922,790,514	0.70
14	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	28,550	31,504.14 899,444,388	31,560.27 901,045,943	0.68
15	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	136,400	6,262.60 854,229,896	6,278.00 856,320,537	0.65

16	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	22,630	35,143.48 795,298,726	37,526.76 849,230,782	0.64
17	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	株式	金融	44,150	23,313.21 1,029,280,569	19,090.45 842,843,394	0.64
18	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	131,704	6,448.02 849,241,583	5,892.30 776,039,558	0.59
19	NVIDIA CORP	アメリカ	株式	情報技術	19,500	24,900.86 485,568,773	39,648.32 773,142,240	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	228,791	3,991.98 913,335,207	3,222.50 737,279,775	0.56
21	ADOBE INC	アメリカ	株式	情報技術	15,350	33,805.25 518,911,502	45,703.30 701,545,778	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	57,562	15,910.82 915,862,990	12,015.16 691,616,916	0.52
23	NETFLIX INC	アメリカ	株式	コミュニケーション･サービス	13,970	34,778.04 485,850,373	48,185.63 673,153,357	0.51
24	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	135,250	4,862.84 657,704,271	4,972.20 672,490,185	0.51
25	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	80,821	9,328.02 753,902,654	8,201.16 662,826,664	0.50
26	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	69,200	10,328.60 714,741,355	9,439.15 653,189,277	0.49
27	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	135,005	7,101.25 958,711,154	4,775.03 644,653,843	0.49
28	PAYPAL HOLDINGS INC	アメリカ	株式	情報技術	35,450	11,750.77 416,568,360	18,138.02 642,993,128	0.49
29	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	250,101	3,549.38 887,725,510	2,520.03 630,264,174	0.48
30	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必需品	44,300	14,624.19 647,852,310	14,122.55 625,629,373	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。

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	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。

ハ．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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
株価指数先物取引	アメリカ	S&P500 E-MINI FUTURE 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月	買建	5	53,481,547	53,627,645	0.04%
	カナダ	S&P/TSE 60 INDEX 2020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 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

●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	11,642円
純資産総額	2.2億円

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	-8.8%
1年間	2.0%
3年間	15.8%
5年間	-
設定来	20.2%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　350円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月
分配金	100円	220円	30円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国株式・先物	1,219	97.6%
外国リート	65	2.4%
外国投資証券	6	0.1%
コール・ローン、その他		1.1%
合計	1,290	-

国・地域別構成	比率
アメリカ	71.0%
イギリス	4.9%
その他	24.2%
合計	100.1%

通貨別構成	比率
米ドル	71.3%
ユーロ	11.0%
英ポンド	4.9%
スイス・フラン	3.5%
カナダ・ドル	3.4%
豪ドル	2.3%
香港ドル	1.1%
スウェーデン・クローネ	1.1%
デンマーク・クローネ	0.8%
その他	0.6%
合計	100.0%

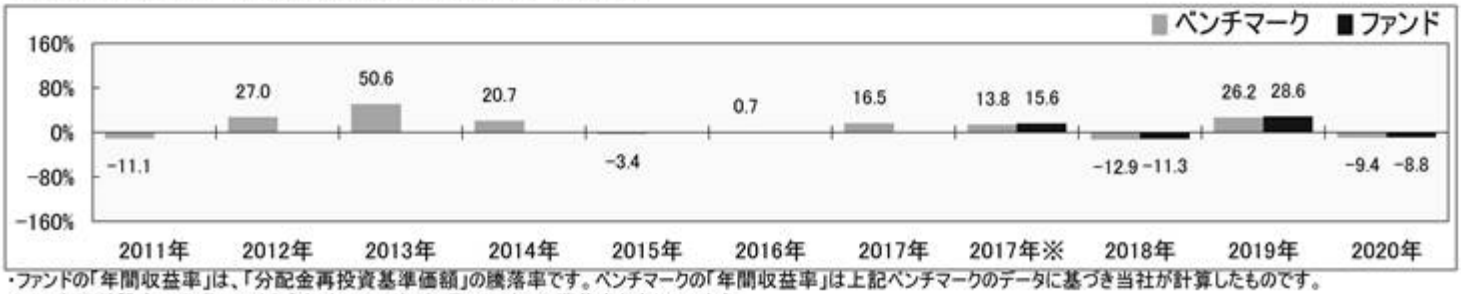
株式業種別構成	比率
情報技術	21.6%
ヘルスケア	14.2%
金融	12.8%
一般消費財・サービス	10.2%
資本財・サービス	9.1%
コミュニケーション・サービス	8.6%
生活必需品	8.2%
素材	4.3%
公益事業	3.4%
エネルギー、他	3.9%
合計	96.3%

組入上位10銘柄	国・地域名	比率
APPLE INC	アメリカ	4.1%
MICROSOFT CORP	アメリカ	3.7%
AMAZON.COM INC	アメリカ	2.9%
FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	1.4%
ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.1%
ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.1%
S&P500 EMINI FUT 202009	アメリカ	1.0%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.0%
NESTLE SA-REG	スイス	0.9%
VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	0.8%
合計		18.0%

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

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはMSCIコクサイ指数（円ベース）です。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。
・2017年※は設定日（2月16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。

【ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）】

－

(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		18,447,434,845	99.90
	内 日本	18,447,434,845	99.90
コール･ローン、その他の資産（負債控除後）		18,179,802	0.10
純資産総額		18,465,614,647	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)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	13,022,331,530	1.4219 18,516,453,597	1.4166 18,447,434,845	99.90

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	24,087,488	24,087,488	1.0065	1.0065
第2計算期間末 (2018年6月15日)	279,326,560	279,326,560	1.0124	1.0124
第3計算期間末 (2019年6月17日)	5,116,892,737	5,116,892,737	1.0363	1.0363
2019年6月末日	5,099,145,309	―	1.0380	―
7月末日	1,904,885,194	―	1.0390	―
8月末日	2,176,934,511	―	1.0535	―
9月末日	13,436,174,554	―	1.0417	―
10月末日	4,086,506,973	―	1.0368	―
11月末日	4,319,053,613	―	1.0330	―
12月末日	4,806,637,139	―	1.0297	―
2020年1月末日	5,463,241,377	―	1.0343	―
2月末日	6,263,560,572	―	1.0426	―
3月末日	3,853,566,140	―	1.0255	―
4月末日	18,734,383,035	―	1.0288	―
5月末日	18,493,963,238	―	1.0239	―
第4計算期間末 (2020年6月15日)	18,594,655,554	18,594,655,554	1.0235	1.0235
6月末日	18,465,614,647	―	1.0196	―

② 【分配の推移】

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

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)

第1計算期間	0.7
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	22,931,206	0
第2計算期間	251,969,341	0
第3計算期間	8,652,065,532	3,990,278,317
第4計算期間	32,014,941,813	18,784,692,054

(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）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	135 5年国債	日本	国債証券	2,820,000,000	100.78 2,842,163,700	100.66 2,838,837,600	0.100000 2023/03/20	2.89
2	410 2年国債	日本	国債証券	2,000,000,000	100.44 2,008,960,000	100.42 2,008,500,000	0.100000 2022/03/01	2.04
3	142 5年国債	日本	国債証券	1,750,000,000	101.04 1,768,370,500	100.96 1,766,905,000	0.100000 2024/12/20	1.80
4	341 10年国債	日本	国債証券	1,500,000,000	102.42 1,536,371,200	102.25 1,533,840,000	0.300000 2025/12/20	1.56
5	131 5年国債	日本	国債証券	1,170,000,000	100.64 1,177,534,800	100.43 1,175,031,000	0.100000 2022/03/20	1.20
6	409 2年国債	日本	国債証券	1,100,000,000	100.69 1,107,601,000	100.41 1,104,554,000	0.100000 2022/02/01	1.12
7	342 10年国債	日本	国債証券	1,080,000,000	101.58 1,097,131,600	101.20 1,093,046,400	0.100000 2026/03/20	1.11
8	117 20年国債	日本	国債証券	900,000,000	120.94 1,088,510,800	120.11 1,081,035,000	2.100000 2030/03/20	1.10
9	349 10年国債	日本	国債証券	1,050,000,000	101.99 1,070,937,000	101.39 1,064,605,500	0.100000 2027/12/20	1.08
10	357 10年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	101.06 1,010,643,400	100.80 1,008,030,000	0.100000 2029/12/20	1.03
11	347 10年国債	日本	国債証券	950,000,000	101.62 965,449,500	101.36 962,996,000	0.100000 2027/06/20	0.98
12	136 5年国債	日本	国債証券	950,000,000	101.13 960,814,000	100.73 956,935,000	0.100000 2023/06/20	0.97
13	343 10年国債	日本	国債証券	920,000,000	101.85 937,045,400	101.26 931,601,200	0.100000 2026/06/20	0.95
14	141 5年国債	日本	国債証券	920,000,000	101.18 930,904,500	100.95 928,776,800	0.100000 2024/09/20	0.94
15	334 10年国債	日本	国債証券	900,000,000	103.50 931,527,000	102.91 926,217,000	0.600000 2024/06/20	0.94
16	138 5年国債	日本	国債証券	900,000,000	101.03 909,351,600	100.80 907,218,000	0.100000 2023/12/20	0.92
17	132 5年国債	日本	国債証券	880,000,000	100.71 886,292,000	100.48 884,250,400	0.100000 2022/06/20	0.90
18	345 10年国債	日本	国債証券	850,000,000	101.79 865,235,500	101.30 861,067,000	0.100000 2026/12/20	0.88

19	139 5年国債	日本	国債証券	850,000,000	101.12 859,523,500	100.85 857,301,500	0.100000 2024/03/20	0.87
20	344 10年国債	日本	国債証券	820,000,000	101.72 834,166,600	101.28 830,520,600	0.100000 2026/09/20	0.84
21	147 20年国債	日本	国債証券	700,000,000	119.40 835,817,800	118.59 830,186,000	1.600000 2033/12/20	0.84
22	351 10年国債	日本	国債証券	800,000,000	101.89 815,192,000	101.32 810,568,000	0.100000 2028/06/20	0.82
23	340 10年国債	日本	国債証券	760,000,000	103.29 785,021,600	102.67 780,352,800	0.400000 2025/09/20	0.79
24	134 20年国債	日本	国債証券	650,000,000	119.98 779,905,900	119.48 776,626,500	1.800000 2032/03/20	0.79
25	355 10年国債	日本	国債証券	760,000,000	101.44 771,006,400	100.98 767,501,200	0.100000 2029/06/20	0.78
26	353 10年国債	日本	国債証券	750,000,000	101.73 763,009,500	101.19 758,925,000	0.100000 2028/12/20	0.77
27	333 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	103.31 723,213,000	102.72 719,089,000	0.600000 2024/03/20	0.73
28	346 10年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.91 713,426,000	101.35 709,464,000	0.100000 2027/03/20	0.72
29	335 10年国債	日本	国債証券	690,000,000	103.21 712,183,500	102.65 708,298,800	0.500000 2024/09/20	0.72
30	137 5年国債	日本	国債証券	700,000,000	101.05 707,357,000	100.76 705,320,000	0.100000 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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

－

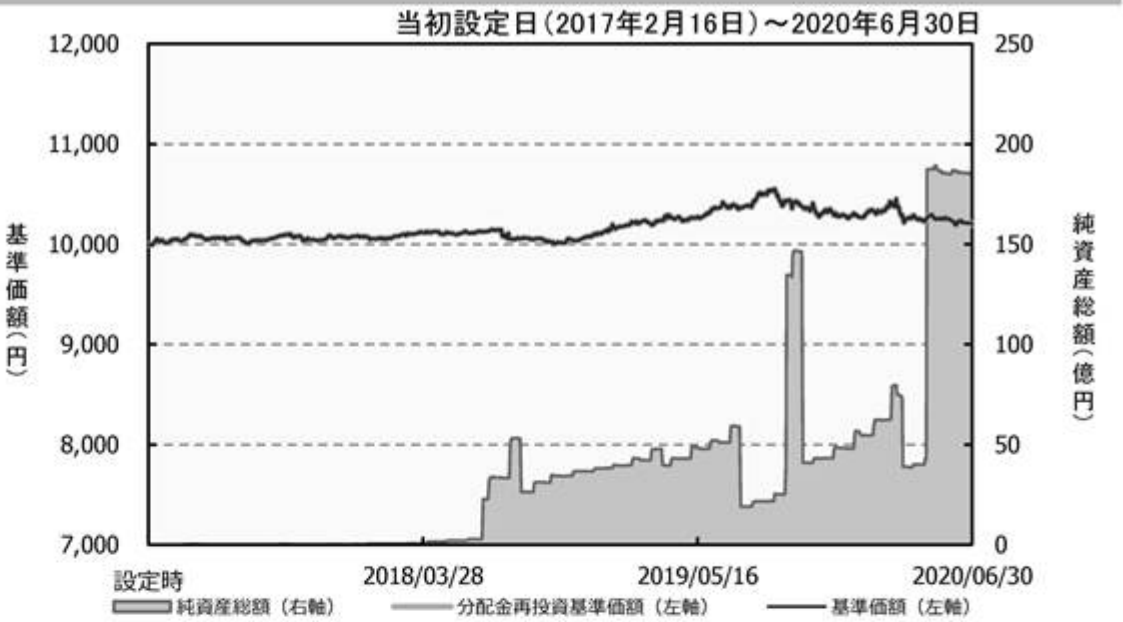
（参考情報）運用実績

●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	10,196円
純資産総額	184億円



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	2.0%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 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
国内債券	350	99.4%
国内債券先物	-	-
コール・ローン、その他		0.6%
合計	350	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	0.8
最終利回り(%)	0.1
修正デュレーション	9.5
残存年数	10.3

債券種別構成	比率
国債	88.7%
地方債	5.4%
事業債	3.3%
政府保証債	1.7%
その他	0.3%
合計	99.4%

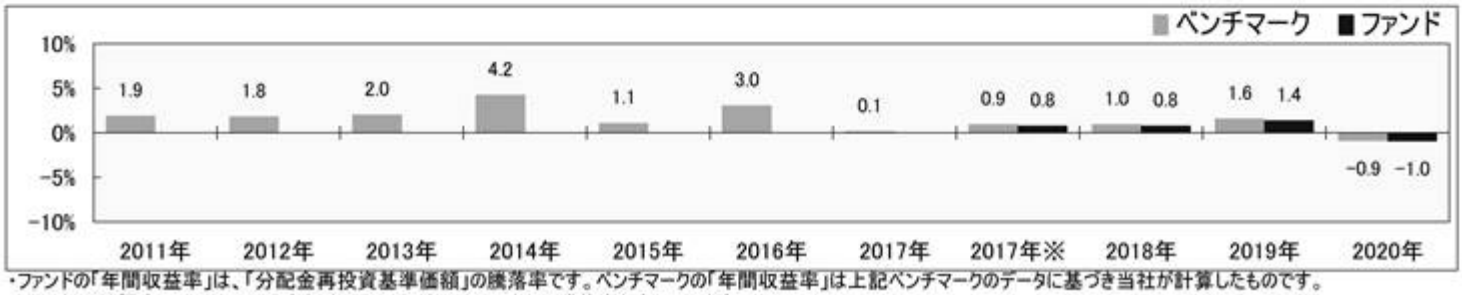
格付別構成	比率
AAA	91.7%
AA	3.8%
A	2.3%
BBB	-
BB以下・無格付	2.1%
合計	100.0%

組入上位10銘柄	利率(%)	償還日	比率
135　5年国債	0.100	2023/03/20	2.9%
410　2年国債	0.100	2022/03/01	2.0%
142　5年国債	0.100	2024/12/20	1.8%
341　10年国債	0.300	2025/12/20	1.6%
131　5年国債	0.100	2022/03/20	1.2%
409　2年国債	0.100	2022/02/01	1.1%
342　10年国債	0.100	2026/03/20	1.1%
117　20年国債	2.100	2030/03/20	1.1%
349　10年国債	0.100	2027/12/20	1.1%
357　10年国債	0.100	2029/12/20	1.0%
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。
・2017年※は設定日（2月16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ている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。

【ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）】

－

(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		22,295,049,650	99.91
	内 日本	22,295,049,650	99.91
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		20,691,771	0.09
純資産総額		22,315,741,421	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)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	20,893,121,217	1.0612 22,171,780,237	1.0671 22,295,049,650	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。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額(分配落)(円)	純資産総額(分配付)(円)	1口当たりの純資産額(分配落)(円)	1口当たりの純資産額(分配付)(円)
第1計算期間末(2017年6月15日)	20,274,657	20,274,657	1.0212	1.0212
第2計算期間末(2018年6月15日)	1,398,757,675	1,398,757,675	0.9966	0.9966
第3計算期間末(2019年6月17日)	12,750,079,921	12,750,079,921	1.0418	1.0418
2019年6月末日	13,084,606,431	－	1.0474	－
7月末日	4,876,636,751	－	1.0515	－
8月末日	4,649,468,462	－	1.0838	－
9月末日	12,868,178,846	－	1.0753	－
10月末日	5,591,499,461	－	1.0615	－
11月末日	5,903,430,869	－	1.0605	－
12月末日	6,557,056,118	－	1.0535	－
2020年1月末日	7,613,988,924	－	1.0723	－
2月末日	8,534,596,343	－	1.0840	－
3月末日	9,828,713,622	－	1.1005	－
4月末日	22,473,392,801	－	1.0987	－
5月末日	22,199,017,363	－	1.0977	－
第4計算期間末(2020年6月15日)	22,300,327,697	22,300,327,697	1.0992	1.0992
6月末日	22,315,741,421	－	1.1051	－

② 【分配の推移】

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

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)

第1計算期間	2.1
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	18,852,947	0
第2計算期間	1,383,614,307	0
第3計算期間	14,932,722,296	4,098,050,663
第4計算期間	31,728,087,266	23,677,730,208

(注)　当初設定数量は1,000,000口です。

（参考）マザーファンド

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

(1) 投資状況（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）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

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

14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,500,000	109.10 1,234,317,384	109.21 1,235,459,967	2.750000 2024/02/15	1.08
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,500,000	129.75 1,048,501,438	131.35 1,061,381,755	2.875000 2043/05/15	0.93
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	9,020,000	108.38 1,053,272,316	108.62 1,055,633,826	2.000000 2025/08/15	0.92
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,470,000	111.45 1,017,073,044	111.81 1,020,349,127	2.250000 2027/02/15	0.89
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,800,000	120.61 1,013,631,495	121.06 1,017,371,150	3.125000 2028/11/15	0.89
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,300,000	108.71 972,130,478	108.92 974,088,868	2.125000 2025/05/15	0.85
20	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	6,770,000	112.30 920,601,703	112.37 921,150,910	5.500000 2022/11/01	0.80
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,810,000	108.53 913,300,764	108.71 914,806,958	2.250000 2024/11/15	0.80
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	102.73 885,484,892	102.67 884,941,883	1.875000 2022/01/31	0.77
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,900,000	109.95 817,397,199	110.57 822,043,486	1.750000 2029/11/15	0.72
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	106.64 804,257,552	106.83 805,728,203	1.875000 2024/08/31	0.70
25	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	6,100,000	108.78 803,458,184	108.96 804,831,957	1.000000 2025/08/15	0.70
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,040,000	135.39 735,202,417	137.16 744,813,687	3.125000 2044/08/15	0.65
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,750,000	140.85 720,826,120	141.25 722,868,062	6.125000 2027/11/15	0.63
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,980,000	132.04 708,465,012	133.72 717,500,434	2.875000 2046/11/15	0.63
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,850,000	109.59 690,741,664	109.89 692,664,015	2.000000 2026/11/15	0.60
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,000,000	106.73 689,971,269	107.06 692,091,592	1.625000 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。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	97.80%
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。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	豪ドル売/円買 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 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7月	売建	56,651,000	7,596,332,590	7,506,257,500	△6.55%
		イスラエル・シュケル売/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・リンギット売/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/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/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 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

●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	11,051円
純資産総額	223億円

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	10.5%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　0円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 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
外国債券	470	97.7%
コール・ローン、その他		2.3%
合計	470	100.0%

債券種別構成	比率
国債	97.7%
合計	97.7%

通貨別構成	比率
日本円	99.3%
ユーロ	0.4%
米ドル	0.1%
マレーシア・リンギット	0.0%
英ポンド	0.0%
カナダ・ドル	0.0%
メキシコ・ペソ	0.0%
デンマーク・クローネ	0.0%
スウェーデン・クローネ	0.0%
その他	-0.0%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	2.1
最終利回り(%)	0.4
修正デュレーション	8.2
残存年数	10.1

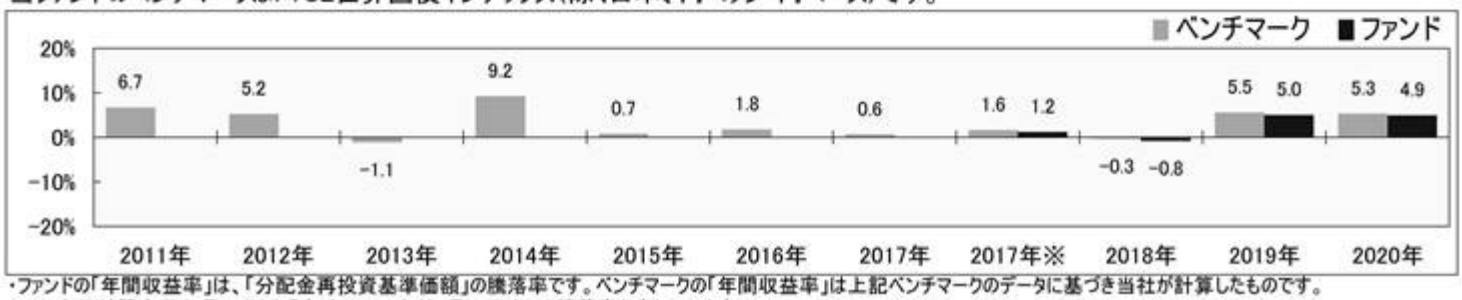
格付別構成	比率
AAA	80.4%
AA	8.6%
A	10.9%
BBB	－
BB	－
合計	100.0%

組入上位10銘柄	償還日	比率
United States Treasury Note/Bond	2021/09/30	3.0%
United States Treasury Note/Bond	2022/02/28	2.2%
United States Treasury Note/Bond	2021/06/30	2.0%
United States Treasury Note/Bond	2022/09/30	1.6%
United States Treasury Note/Bond	2022/11/15	1.5%
United States Treasury Note/Bond	2021/11/15	1.3%
United States Treasury Note/Bond	2023/11/15	1.3%
United States Treasury Note/Bond	2024/05/15	1.3%
United States Treasury Note/Bond	2024/07/31	1.2%
United States Treasury Note/Bond	2023/08/15	1.1%
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。
・2017年※は設定日（2月16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。

【ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）】

－

(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		56,103,791	99.93
	内 日本	56,103,791	99.93
コール･ローン、その他の資産（負債控除後）		37,504	0.07
純資産総額		56,141,295	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)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	外国債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	18,798,389	2.9588 55,620,673	2.9845 56,103,791	99.93

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.93%
合計	99.93%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	1,006,543	1,009,043	1.0065	1.0090
第2計算期間末 (2018年6月15日)	1,002,760	1,014,760	1.0028	1.0148
第3計算期間末 (2019年6月17日)	11,002,175	11,110,214	1.0184	1.0284
2019年6月末日	11,052,740	―	1.0230	―
7月末日	2,201,985,717	―	1.0257	―
8月末日	2,427,202,081	―	1.0322	―
9月末日	41,707,799	―	1.0379	―
10月末日	3,569,757,716	―	1.0477	―
11月末日	3,777,512,490	―	1.0479	―
12月末日	4,219,113,681	―	1.0523	―
2020年1月末日	4,702,356,872	―	1.0604	―
2月末日	6,334,884,188	―	1.0725	―
3月末日	3,677,327,050	―	1.0736	―
4月末日	18,960,409	―	1.0539	―
5月末日	37,607,950	―	1.0690	―
第4計算期間末 (2020年6月15日)	55,667,910	55,667,910	1.0764	1.0764
6月末日	56,141,295	―	1.0856	―

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0025
第2計算期間	0.0120
第3計算期間	0.0100
第4計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)

第1計算期間	0.9
第2計算期間	0.8
第3計算期間	2.6
第4計算期間	5.7

(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	0	0
第2計算期間	0	0
第3計算期間	83,995,237	74,191,315
第4計算期間	9,243,518,976	9,202,608,333

（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）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

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

14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,900,000	103.71 659,300,061	112.44 714,774,633	2.250000 2027/08/15	0.36
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,650,000	107.65 655,335,445	116.79 710,973,458	2.750000 2028/02/15	0.36
16	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,730,000	102.17 708,879,980	102.05 708,073,503	－ 2023/04/14	0.36
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,287,000	101.11 684,927,506	104.42 707,307,526	2.000000 2022/11/30	0.36
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,700,000	117.11 593,034,877	138.70 702,361,477	3.000000 2049/02/15	0.36
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,921,000	102.85 656,115,882	108.71 693,543,150	2.250000 2024/11/15	0.35
20	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,840,000	103.11 648,813,813	110.21 693,493,419	2.250000 2025/11/15	0.35
21	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,448,000	165.72 691,891,860	164.46 686,598,098	5.500000 2031/01/04	0.35
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,650,000	114.37 573,008,456	135.94 681,072,214	2.875000 2049/05/15	0.34
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,788,000	102.32 638,116,507	108.92 679,280,285	2.125000 2025/05/15	0.34
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,250,000	105.66 671,676,467	106.73 678,495,087	0.500000 2029/05/25	0.34
25	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,387,000	126.39 671,390,052	126.88 673,958,595	2.500000 2030/05/25	0.34
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	101.75 629,622,271	108.62 672,118,078	2.000000 2025/08/15	0.34
27	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,500,000	103.78 614,975,071	112.78 668,306,371	2.250000 2027/11/15	0.34
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,743,000	101.71 629,380,959	107.99 668,201,385	2.000000 2025/02/15	0.34
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,900,000	111.23 587,233,206	121.06 639,117,774	3.125000 2028/11/15	0.32
30	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,200,000	119.31 539,896,344	140.78 637,045,287	3.125000 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。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.20%
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。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 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 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8月	買建	326,000	43,185,356	43,185,220	0.02%
		米ドル買/円売 2020年8月	買建	2,689,000	289,660,881	289,578,410	0.15%
		メキシコ・ペソ買/円売 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/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/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月	買建	5,642,000	605,854,696	607,812,660	0.31%

		英ポンド買/円売 2020年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

●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	10,856円
純資産総額	56百万円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.6%
3カ月間	1.1%
6カ月間	3.2%
1年間	6.1%
3年間	8.0%
5年間	－
設定来	11.2%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　245円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月
分配金	25円	120円	100円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国債券	787	98.1%
コール・ローン、その他		1.9%
合計	787	100.0%

債券種別構成	比率
国債	98.1%
合計	98.1%

通貨別構成	比率
米ドル	45.4%
ユーロ	40.3%
英ポンド	6.5%
豪ドル	2.2%
カナダ・ドル	1.9%
メキシコ・ペソ	0.8%
ポーランド・ズロチ	0.6%
デンマーク・クローネ	0.5%
マレーシア・リンギット	0.5%
その他	1.3%
合計	100.0%

債券ポートフォリオ特性値	
直接利回り(%)	2.0
最終利回り(%)	0.4
修正デュレーション	8.1
残存年数	9.9
合計	100.0%

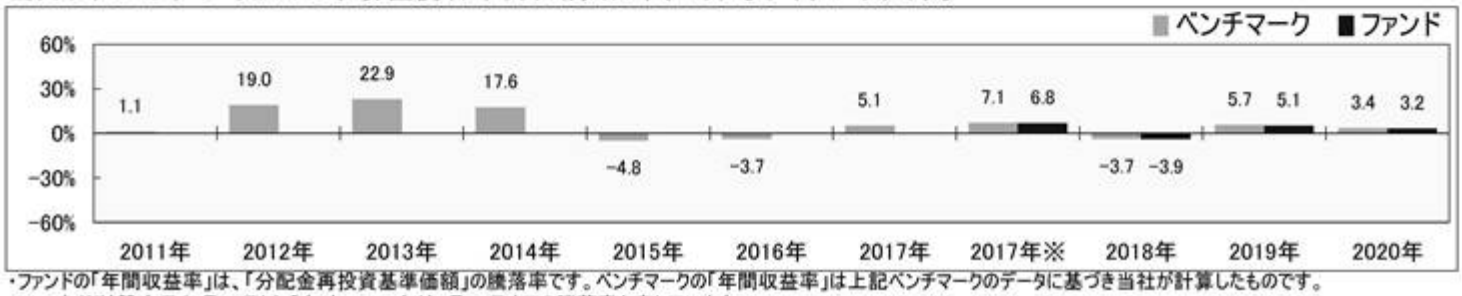
格付別構成	比率
AAA	80.3%
AA	8.7%
A	11.1%
BBB	－
BB	－
合計	100.0%

組入上位10銘柄	償還日	比率
United States Treasury Note/Bond	2028/08/15	0.4%
FRENCH GOVERNMENT BOND	2041/04/25	0.4%
United States Treasury Note/Bond	2029/02/15	0.4%
United States Treasury Note/Bond	2028/05/15	0.4%
United States Treasury Note/Bond	2029/08/15	0.4%
GERMAN GOVERNMENT BOND	2027/02/15	0.4%
United States Treasury Note/Bond	2027/05/15	0.4%
United States Treasury Note/Bond	2029/11/15	0.4%
GERMAN GOVERNMENT BOND	2037/01/04	0.4%
United States Treasury Note/Bond	2022/11/15	0.4%
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。
・2017年※は設定日（2月16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Ｊ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）】

－

－

(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		583,467,328	99.96
	内 日本	583,467,328	99.96
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		249,556	0.04
純資産総額		583,716,884	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)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ダイワJ－REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	223,259,864	2.5570 570,883,954	2.6134 583,467,328	99.96

(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	99.96%
合計	99.96%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (2017年6月15日)	3,456,480	3,474,147	0.9782	0.9832
第2計算期間末 (2018年6月15日)	321,051,059	322,484,783	1.0077	1.0122
第3計算期間末 (2019年6月17日)	1,249,306,029	1,280,156,651	1.1339	1.1619
2019年6月末日	1,248,515,009	－	1.1375	－
7月末日	2,188,926,642	－	1.1868	－
8月末日	2,430,390,491	－	1.2311	－
9月末日	1,531,679,512	－	1.2887	－
10月末日	3,427,049,812	－	1.3308	－
11月末日	3,554,577,590	－	1.3185	－
12月末日	3,672,481,286	－	1.2796	－
2020年1月末日	4,173,589,612	－	1.3247	－
2月末日	4,113,977,295	－	1.2120	－
3月末日	3,033,268,730	－	0.9607	－
4月末日	564,512,459	－	0.9517	－
5月末日	610,728,659	－	1.0296	－
第4計算期間末 (2020年6月15日)	569,353,890	587,148,598	0.9599	0.9899
6月末日	583,716,884	－	0.9810	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0050
第2計算期間	0.0045
第3計算期間	0.0280
第4計算期間	0.0300

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)

第1計算期間	△1.7
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	2,533,441	0
第2計算期間	315,071,967	0
第3計算期間	1,083,924,855	300,722,332
第4計算期間	3,863,471,660	4,372,122,644

(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）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	36,777	687,310.78 25,277,228,847	614,000.00 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 23,588,317,306	553,000.00 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 15,389,933,105	328,000.00 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 15,350,725,539	129,400.00 15,865,216,400	4.72
5	GLP投資法人	日本	投資証券	98,281	113,954.31 11,199,544,239	156,500.00 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 12,867,735,601	254,000.00 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 9,938,530,652	321,500.00 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 11,636,358,651	141,400.00 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 10,174,386,047	115,800.00 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 10,555,265,567	134,500.00 9,654,141,000	2.87
11	産業ファンド	日本	投資証券	48,911	133,107.06 6,510,399,651	173,600.00 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 8,395,610,306	316,000.00 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 7,010,205,720	624,000.00 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 7,142,997,470	69,200.00 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 5,330,154,575	292,800.00 7,265,539,200	2.16
16	API投資法人	日本	投資証券	19,030	364,119.04 6,929,185,452	371,500.00 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 6,850,500,712	601,000.00 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 5,723,560,777	136,200.00 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 4,564,507,224	166,200.00 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 4,921,309,134	44,500.00 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 4,468,155,617	322,000.00 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 5,182,550,335	597,000.00 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 4,269,604,951	480,500.00 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 3,982,077,529	114,400.00 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 3,874,679,481	100,400.00 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 4,924,525,193	27,790.00 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 3,645,942,863	186,100.00 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 4,108,145,687	340,500.00 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 4,309,072,660	125,200.00 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 4,383,373,449	134,000.00 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。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
不動産投信指数先物取引	日本	東証REIT指数先物 2020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

●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	9,810円
純資産総額	5.8億円

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	4.7%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　300円　　設定来分配金合計額：　675円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月								
分配金	50円	45円	280円	300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

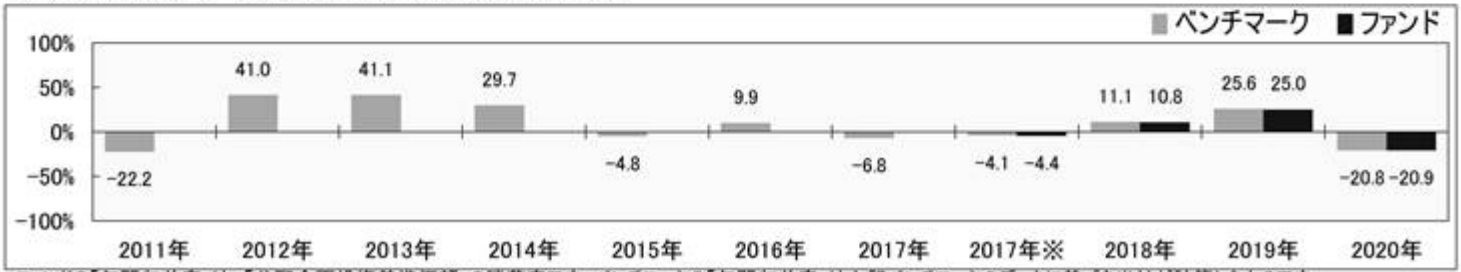
※比率は、純資産総額に対するものです。

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	28.9%	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%			日本リテールファンド	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。
・2017年※は設定日（2月16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。

【ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）】

－

(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	130,996,246	100.30
内 日本	130,996,246	100.30
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	△385,493	△0.30
純資産総額	130,610,753	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)	130,414,650	△99.85
内 日本	130,414,650	△99.85

(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)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	65,156,054	2.0682 134,755,750	2.0105 130,996,246	100.30

(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	100.30%
合計	100.30%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
為替予約取引	日本	豪ドル売/円買 2020年7月	売建	117,600	8,587,152	8,687,112	△6.65%
		カナダ・ドル売/円買 2020年7月	売建	30,600	2,405,772	2,410,974	△1.85%
		ユーロ売/円買 2020年7月	売建	51,000	6,154,680	6,175,080	△4.73%
		英ポンド売/円買 2020年7月	売建	51,700	6,932,453	6,850,250	△5.24%
		米ドル売/円買 2020年7月	売建	910,100	97,553,619	98,035,972	△75.06%
		イスラエル・シュケル売/円買 2020年7月	売建	3,100	95,604	96,689	△0.07%
		ニュージーランド・ドル売/円買 2020年7月	売建	8,600	590,734	594,088	△0.45%
		シンガポール・ドル売/円買 2020年7月	売建	67,500	5,185,350	5,217,075	△3.99%
		香港ドル売/円買 2020年7月	売建	169,000	2,337,270	2,347,410	△1.80%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額(分配落)(円)	純資産総額(分配付)(円)	1口当たりの純資産額(分配落)(円)	1口当たりの純資産額(分配付)(円)

第1計算期間末 (2017年6月15日)	10,195,310	10,275,310	1.0195	1.0275
第2計算期間末 (2018年6月15日)	279,933,693	283,060,364	0.9848	0.9958
第3計算期間末 (2019年6月17日)	695,159,967	714,215,108	1.0580	1.0870
2019年6月末日	673,311,675	－	1.0371	－
7月末日	1,148,635,087	－	1.0574	－
8月末日	1,259,455,848	－	1.0716	－
9月末日	863,805,838	－	1.0987	－
10月末日	2,742,572,305	－	1.1131	－
11月末日	2,870,782,853	－	1.1057	－
12月末日	3,024,013,166	－	1.0874	－
2020年1月末日	3,634,141,935	－	1.1133	－
2月末日	3,696,874,748	－	1.0466	－
3月末日	1,908,118,791	－	0.7948	－
4月末日	129,665,335	－	0.8593	－
5月末日	130,001,476	－	0.8616	－
第4計算期間末 (2020年6月15日)	134,966,460	134,966,460	0.8945	0.8945
6月末日	130,610,753	－	0.8656	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0080
第2計算期間	0.0110
第3計算期間	0.0290
第4計算期間	0.0000

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	2.8
第2計算期間	△2.3
第3計算期間	10.4
第4計算期間	△15.5

(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	0	0

第2計算期間	275,571,977	1,329,127
第3計算期間	644,244,585	271,413,599
第4計算期間	4,068,922,456	4,575,108,293

(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 ガーンジィ	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）

① 投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	150,619	9,786.45 1,474,038,356	9,822.65 1,479,478,594	6.10
2	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	18,000	62,371.33 1,122,685,191	74,224.24 1,336,036,334	5.51
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	54,778	13,540.54 741,729,113	15,097.60 827,016,672	3.41
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	30,700	22,654.81 695,503,363	20,589.11 632,085,800	2.61
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	28,700	22,514.21 646,157,937	16,484.22 473,097,114	1.95
6	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	85,300	8,652.38 738,054,770	5,522.75 471,090,780	1.94
7	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	62,147	15,413.17 957,883,304	7,340.32 456,179,252	1.88
8	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	70,117	7,946.79 557,211,489	6,440.69 451,602,366	1.86
9	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	25,800	17,368.76 448,115,246	17,414.01 449,281,618	1.85
10	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	71,400	8,901.26 635,553,972	6,213.36 443,634,318	1.83
11	LINK REIT	香港	投資証券	429,700	1,090.41 468,554,626	884.73 380,170,630	1.57

12	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	339,810	1,079.68 366,898,569	1,110.41 377,330,597	1.56
13	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	13,367	32,913.49 439,955,025	24,395.56 326,095,560	1.34
14	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	111,097	3,235.97 359,511,380	2,918.67 324,256,214	1.34
15	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	109,900	3,606.16 396,320,243	2,928.37 321,828,215	1.33
16	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	75,479	6,070.07 458,166,773	3,954.05 298,448,344	1.23
17	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	20,100	17,199.72 345,714,517	14,484.56 291,139,769	1.20
18	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	29,500	14,524.96 428,488,929	9,661.04 285,000,851	1.17
19	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	238,460	1,168.07 278,545,263	1,182.78 282,046,735	1.16
20	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	75,200	3,775.74 283,942,898	3,725.64 280,168,820	1.15
21	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	23,128	14,447.39 334,139,781	12,015.16 277,886,731	1.15
22	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	26,200	11,366.78 297,810,318	9,893.76 259,216,622	1.07
23	WP CAREY INC	アメリカ	投資証券	34,900	8,812.80 307,567,123	7,204.57 251,439,626	1.04
24	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	36,900	7,851.01 289,705,749	6,642.17 245,096,110	1.01
25	UDR INC	アメリカ	投資証券	60,200	5,069.27 305,175,285	3,963.75 238,618,027	0.98
26	VANGUARD REAL ESTATE ETF	アメリカ	投資信託受益証券	27,500	8,343.70 229,454,417	8,361.70 229,946,789	0.95
27	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	アメリカ	投資証券	107,900	2,220.84 239,630,869	1,986.72 214,367,692	0.88
28	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	95,700	2,634.78 252,154,319	2,154.80 206,214,360	0.85
29	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	19,900	11,817.56 235,170,886	9,684.74 192,726,497	0.79
30	CYRUSONE INC	アメリカ	投資証券	23,500	6,802.70 159,865,689	8,023.39 188,549,848	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。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	0.95%
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。

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/売建	数量	簿価	時価	投資比率
不動産投信指数先物取引	アメリカ	DJ US REIT IDXFTRS 2020年9月	買建	115	393,286,016	378,765,357	1.56%
	ドイツ	STOXX600 REIT IDXFTR 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月	買建	1,000,000	120,059,830	121,080,000	0.50%
		米ドル買/円売 2020年7月	買建	2,140,000	230,043,249	230,542,200	0.95%
		カナダ・ドル買/円売 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月	買建	30,000	2,208,963	2,216,100	0.01%
		ニュージーランド・ドル買/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

●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	8,656円
純資産総額	1.3億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.5%
3カ月間	8.9%
6カ月間	−20.4%
1年間	−16.5%
3年間	−10.4%
5年間	−
設定来	−9.4%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：　0円　　設定来分配金合計額：　480円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月
分配金	80円	110円	290円	0円

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国リート・先物	309	99.3%
外国投資信託等	3	1.1%
コール・ローン、その他		2.1%
合計	312	−

国・地域別構成	比率
アメリカ	75.3%
オーストラリア	6.4%
イギリス	4.8%
シンガポール	4.4%
その他	9.4%
合計	100.4%

通貨別構成	比率
日本円	99.4%
米ドル	0.3%
ユーロ	0.2%
香港ドル	0.2%
シンガポール・ドル	0.1%
カナダ・ドル	0.1%
韓国ウォン	0.1%
ニュージーランド・ドル	−0.0%
イスラエル・シュケル	−0.0%
その他	−0.3%
合計	100.0%

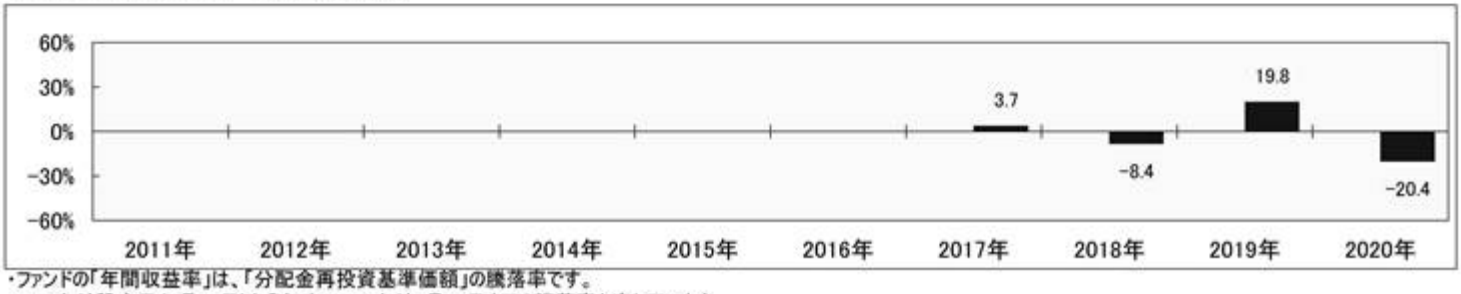
リート用途別構成	比率
産業施設	15.5%
商業施設	15.4%
住宅	14.9%
特殊用途施設	13.2%
オフィス	11.1%
ヘルスケア	9.3%
各種不動産	9.2%
貸倉庫	5.8%
ホテル/リゾート	2.3%
その他	0.0%
合計	96.8%

組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	6.1%
EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	5.5%
DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	3.4%
PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	2.6%
AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	2.0%
WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	1.9%
SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	1.9%
REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	1.9%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	オフィス	アメリカ	1.9%
EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	1.8%
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欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2017年は設定日（2月16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。

【ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）】

－

(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	412,865,192	99.99
内 日本	412,865,192	99.99
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	37,060	0.01
純資産総額	412,902,252	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)

① 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 または 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資比率 (%)
1	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	205,354,485	2.0682 424,714,152	2.0105 412,865,192	99.99

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

② 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③ 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

① 【純資産の推移】

	純資産総額(分配落)(円)	純資産総額(分配付)(円)	1口当たりの純資産額(分配落)(円)	1口当たりの純資産額(分配付)(円)
第1計算期間末(2017年6月15日)	9,896,754	9,996,754	0.9897	0.9997
第2計算期間末(2018年6月15日)	9,693,791	10,023,791	0.9694	1.0024
第3計算期間末(2019年6月17日)	518,637,200	534,240,737	1.0304	1.0614
2019年6月末日	506,523,935	－	1.0063	－
7月末日	518,987,336	－	1.0311	－
8月末日	515,068,752	－	1.0233	－
9月末日	536,406,956	－	1.0657	－
10月末日	554,398,824	－	1.1014	－
11月末日	552,563,805	－	1.0978	－
12月末日	546,774,503	－	1.0863	－
2020年1月末日	556,491,509	－	1.1056	－
2月末日	523,338,320	－	1.0397	－
3月末日	391,726,674	－	0.7783	－
4月末日	418,591,283	－	0.8316	－
5月末日	422,998,773	－	0.8404	－
第4計算期間末(2020年6月15日)	424,828,364	439,928,561	0.8440	0.8740
6月末日	412,902,252	－	0.8203	－

② 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0100
第2計算期間	0.0330
第3計算期間	0.0310
第4計算期間	0.0300

③ 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	△0.0

第2計算期間	1.3
第3計算期間	9.5
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	0	0
第2計算期間	0	0
第3計算期間	493,339,911	0
第4計算期間	0	0

(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「ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）」の記載と同じ。

－

（参考情報）運用実績

●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	8,203円
純資産総額	4.1億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.1%
3カ月間	9.1%
6カ月間	−21.8%
1年間	−15.6%
3年間	−9.4%
5年間	−
設定来	−8.6%

※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：　300円　　設定来分配金合計額：　1,040円

決算期	第1期 17年6月	第2期 18年6月	第3期 19年6月	第4期 20年6月								
分配金	100円	330円	310円	300円								

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

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率
外国リート・先物	309	99.0%
外国投資信託等	3	1.1%
コール・ローン、その他		2.4%
合計	312	−

国・地域別構成	比率
アメリカ	75.1%
オーストラリア	6.4%
イギリス	4.8%
シンガポール	4.4%
その他	9.4%
合計	100.1%

通貨別構成	比率
米ドル	75.1%
豪ドル	6.5%
英ポンド	5.1%
ユーロ	4.9%
シンガポール・ドル	4.1%
香港ドル	2.0%
カナダ・ドル	1.9%
ニュージーランド・ドル	0.4%
韓国ウォン	0.1%
その他	−0.1%
合計	100.0%

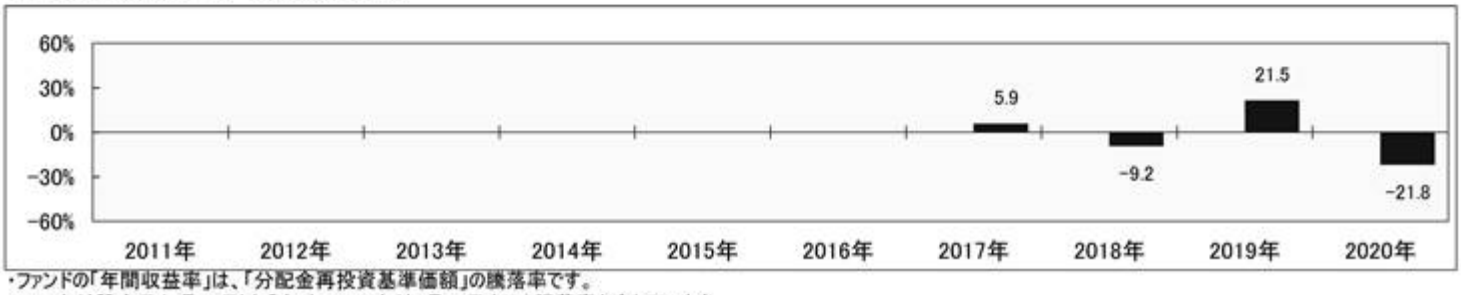
リート用途別構成	比率
産業施設	15.5%
商業施設	15.4%
住宅	14.9%
特殊用途施設	13.2%
オフィス	11.0%
ヘルスケア	9.2%
各種不動産	9.2%
貸倉庫	5.8%
ホテル/リゾート	2.3%
その他	0.0%
合計	96.5%

組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	6.1%
EQUINIX INC	特殊用途施設	アメリカ	5.5%
DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	3.4%
PUBLIC STORAGE	貸倉庫	アメリカ	2.6%
AVALONBAY COMMUNITIES INC	住宅	アメリカ	1.9%
WELLTOWER INC	ヘルスケア	アメリカ	1.9%
SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	1.9%
REALTY INCOME CORP	商業施設	アメリカ	1.9%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	オフィス	アメリカ	1.9%
EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	1.8%
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欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2017年は設定日（2月16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。

第２ 【管理及び運営】

１ 【申込(販売)手続等】

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

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

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

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。

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

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「ＴＯＰＩＸインデックス」、「日経２２５インデックス」、「日本債券インデックス」および「Ｊ－ＲＥＩＴインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消すことができるものとします。

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

２ 【換金(解約)手続等】

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

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

＜一部解約＞

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

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

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

解約価額は、各ファンドについて後掲の別表Ｂに掲げる価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止（「ＴＯＰＩＸインデックス」、「日経２２５インデックス」、「日本債券インデックス」および「Ｊ－ＲＥＩＴインデックス」を除きます。）その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして、上記に準じて算出した価額とします。

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

ファンド名	解約代金支払開始日
ＴＯＰＩＸインデックス 日経２２５インデックス 日本債券インデックス	4営業日目
外国株式インデックス（為替ヘッジあり） 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） Ｊ－ＲＥＩＴインデックス 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり） 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	5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。

※「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
外国株式インデックス（為替ヘッジあり） 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	ニューヨーク証券取引所の休業日
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
外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり） 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	ニューヨーク証券取引所または オーストラリア証券取引所の休業日

［別表Ｂ］

ファンド名	価額
ＴＯＰＩＸインデックス 日経２２５インデックス 日本債券インデックス Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	申込受付日の基準価額
外国株式インデックス（為替ヘッジあり） 外国株式インデックス（為替ヘッジなし） 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） 外国債券インデックス（為替ヘッジなし） 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり） 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。

***「Ｊ－ＲＥＩＴインデックス」を除きます。**

（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（「ＴＯＰＩＸインデックス」、「日経２２５インデックス」、「日本債券インデックス」および「Ｊ－ＲＥＩＴインデックス」を除きます。）。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター）　0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年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、2017年2月16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】

① 信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合、特定の指数が改廃された場合（「外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）」および「外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）」を除きます。）、もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 前2.から前4.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前2.から前4.までの手続きを行なうことが困難な場合も同じとします。
6. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
7. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、②の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
8. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

② 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本②の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとします。

2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1. の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。

3. 前2.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。

6. 前2.から前5.までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。

7. 前1.から前6.までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

③ 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

④ 運用報告書

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

2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス　https://www.daiwa-am.co.jp/

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

⑤ 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

https://www.daiwa-am.co.jp/

2. 前1. の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

⑥　関係法人との契約の更改

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

4　【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

①　収益分配金および償還金にかかる請求権

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

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

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

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

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

②　換金請求権

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

第３　【ファンドの経理状況】

【ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）】

(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ＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,300,709	13,890,167
親投資信託受益証券	1,898,250,982	5,183,020,961
未収入金	26,390,000	140,000
流動資産合計	1,925,941,691	5,197,051,128
資産合計	1,925,941,691	5,197,051,128
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	5,557,228	99,784,527
未払解約金	26,307,286	－
未払受託者報酬	79,577	873,593
未払委託者報酬	1,154,487	12,667,710
その他未払費用	19,908	218,349
流動負債合計	33,118,486	113,544,179
負債合計	33,118,486	113,544,179
純資産の部		
元本等		
元本	※1 1,852,409,502	※1 4,989,226,381
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	40,413,703	94,280,568
（分配準備積立金）	940,978	2,031,455
元本等合計	1,892,823,205	5,083,506,949
純資産合計	1,892,823,205	5,083,506,949
負債純資産合計	1,925,941,691	5,197,051,128

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 至　2020年6月15日
営業収益		
受取利息	―	47
有価証券売買等損益	△ 109,443,572	△ 289,790,021
営業収益合計	△ 109,443,572	△ 289,789,974
営業費用		
支払利息	48	2,909
受託者報酬	104,429	1,596,138
委託者報酬	1,515,290	23,145,103
その他費用	25,951	400,341
営業費用合計	1,645,718	25,144,491
営業損失（△）	△ 111,089,290	△ 314,934,465
経常損失（△）	△ 111,089,290	△ 314,934,465
当期純損失（△）	△ 111,089,290	△ 314,934,465
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△ 22,676,997	△ 162,040,844
期首剰余金又は期首欠損金（△）	14,322,257	40,413,703
剰余金増加額又は欠損金減少額	153,662,128	1,529,649,089
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	153,662,128	1,529,649,089
剰余金減少額又は欠損金増加額	33,601,161	1,223,104,076
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	33,601,161	1,223,104,076
分配金	※1 5,557,228	※1 99,784,527
期末剰余金又は期末欠損金（△）	40,413,703	94,280,568

(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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2019年6月15日及びその翌日が休日のため、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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1．※1　期首元本額	85,356,999円	1,852,409,502円
期中追加設定元本額	2,042,744,740円	20,581,650,630円
期中一部解約元本額	275,692,237円	17,444,833,751円
2．計算期間末日における受益権の総数	1,852,409,502口	4,989,226,381口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 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（3,652,907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（71,755,566円）及び分配準備積立金（66,685円）より分配対象額は75,475,158円（1万口当たり407.44円）であり、うち5,557,228円（1万口当たり30円）を分配金額としております。	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（101,743,256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（190,904,707円）及び分配準備積立金（72,726円）より分配対象額は292,720,689円（1万口当たり586.71円）であり、うち99,784,527円（1万口当たり200円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第4期 自　2019年6月18日 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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第3期 2019年6月17日現在	第4期 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	△87,358,555	△144,591,954
合計	△87,358,555	△144,591,954

（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 2019年6月17日現在	第4期 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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0218円 (10,218円)	1.0189円 (10,189円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	トピックス・インデックス・マザーファンド	5,133,228,644	5,183,020,961	
親投資信託受益証券　合計			5,183,020,961	
合計			5,183,020,961	

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	22,442,306,208
株式	※3※4	134,161,291,380	140,637,428,520
派生商品評価勘定		3,346,000	－
未収入金		24,540,100	976,345,455
未収配当金		1,086,024,213	1,161,108,607
未収利息		720,429	943,490
前払金		－	61,213,200
その他未収収益	※5	37,436,485	33,685,116
差入委託証拠金		－	45,600,000
流動資産合計		156,539,860,130	165,358,630,596
資産合計		156,539,860,130	165,358,630,596
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		1,281,740	116,007,900
前受金		8,460,000	－
未払金		－	5,856,600
未払解約金		50,779,400	130,214,650
受入担保金		20,323,222,856	21,959,179,861
その他未払費用		－	59,262
流動負債合計		20,383,743,996	22,211,318,273
負債合計		20,383,743,996	22,211,318,273
純資産の部			
元本等			
元本	※1	137,575,273,801	141,769,254,313
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2	△1,419,157,667	1,378,058,010
元本等合計		136,156,116,134	143,147,312,323
純資産合計		136,156,116,134	143,147,312,323
負債純資産合計		156,539,860,130	165,358,630,596

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2019年6月18日 至　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 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)新株予約権証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3．収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年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		
ファンド名		
トピックス・インデックスファンド	4,064,718,502円	3,431,880,768円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	7,831,019,610円	7,031,041,815円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドＶＡ２	28,922,843円	2,678,796円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	60,746,661円	49,608,551円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	970,087,745円	725,117,589円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	49,591,649円	40,741,510円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	1,345,886,376円	1,079,559,180円
日本株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	17,407,313円	93,444,117円
Ｄ－Ｉ's ＴＯＰＩＸインデックス	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・ターゲットイヤー2050	1,811,311円	21,174,600円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	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クス	65,593,800,212円	65,610,936,766円
ダイワ・ライフ・バランス３０	2,830,723,893円	2,891,908,692円
ダイワ・ライフ・バランス５０	3,174,079,892円	3,733,714,207円
ダイワ・ライフ・バランス７０	2,924,490,418円	3,281,143,353円

年金ダイワ日本株式インデックス	4,901,290,488円	5,113,096,051円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	15,661,912円	14,119,485円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	51,776,914円	53,875,091円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	18,724,906円	32,163,043円
ダイワつみたてインデックス日本株式	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ンド１５ＶＡ	370,487円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	380,895円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ（国内株式型）	748,462円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	4,378,927円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	4,332,378円	－円
ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ（国内株式型）	8,522,639円	－円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	171,234,737円	153,610,897円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	171,314,178円	155,742,680円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	9,583,310,698円	8,889,004,308円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	2,950,347円	－円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	825,721,462円	735,977,487円
ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	127,351,633円	121,831,903円

	ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）	223,926,223円	199,527,738円
	ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	164,247,771円	183,644,716円
	ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸ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イン ＴＯＰＩＸインデックス	2,518,767,124円	2,052,886,383円
	ダイワ・インデックスセレクト 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・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	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本総額を下回っており、その差額は1,419,157,667円であります。	――――――
4. ※3	貸付有価証券	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 19,310,988,920円	株券貸借取引契約により、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 株式 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金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 482,520,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 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）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2019年6月18日 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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年6月17日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（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 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買　建	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 （1万口当たり純資産額）	0.9897円 (9,897円)	1.0097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		
ホウスイ	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ＧＰ	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 (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		
飛島建設	5,900	1,043.00	6,153,700		
長谷工コーポレーシヨン	79,200	1,294.00	102,484,800		
松井建設	8,200	646.00	5,297,200		
錢　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		
淺沼組	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		
ＮＥＣネッツエスアイ	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		
ＬＩＦＵＬＬ	22,200	401.00	8,902,200		
ジェイエイシーリクルートメント	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 (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
ＣＤＳ	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ン	14,600	404.00	5,898,400	貸付株式数	5,600株
ＧＣＡ	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 (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		
綜合警備保障	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
ブラス	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 (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Ｓ	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 (200株)

バリューコマース	3,600	2,735.00	9,846,000	貸付株式数	1,400株 (1,300株)
インフォマート	69,900	853.00	59,624,700	貸付株式数	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	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	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	1,300株
伊　藤　園	20,200	6,060.00	122,412,000	貸付株式数	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	100株
ジャパンフーズ	900	1,144.00	1,029,600	貸付株式数	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	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	6,400株
サンエー	5,200	4,185.00	21,762,000	貸付株式数	800株
カワチ薬品	5,100	2,647.00	13,499,700	貸付株式数	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	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	1,600株
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1,000	500.00	500,000	貸付株式数	400株
伊藤忠食品	1,600	4,875.00	7,800,000	貸付株式数	600株
くら寿司	3,400	4,835.00	16,439,000	貸付株式数	1,300株 (1,300株)
キャンドゥ	3,200	2,053.00	6,569,600	貸付株式数	1,200株 (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 (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
ＪＰ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
東京エレクトロンデバイス	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		
キユーピー	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		
イートアンド	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	1,000株 (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	400株 (100株)
日本たばこ産業	376,900	2,104.50	793,186,050	貸付株式数	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	1,600株
なとり	3,900	1,719.00	6,704,100	貸付株式数	100株
イフジ産業	1,000	800.00	800,000	貸付株式数	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	500株 (400株)
北の達人コーポ	23,500	547.00	12,854,500	貸付株式数	9,300株
ユーグレナ	28,700	762.00	21,869,400	貸付株式数	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	1,200株
ヒューリック	137,100	1,018.00	139,567,800	貸付株式数	55,500株
神　栄	1,000	481.00	481,000	貸付株式数	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	2,000株
ハブ	1,900	671.00	1,274,900	貸付株式数	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	3,700株
アルコニックス	7,000	1,159.00	8,113,000	貸付株式数	2,700株
神戸物産	22,600	6,050.00	136,730,000	貸付株式数	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	1,100株
ジンズホールディングス	3,500	6,230.00	21,805,000	貸付株式数	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	14,800株 (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	2,200株 (300株)
ＭｏｎｏｔａＲＯ	46,400	4,130.00	191,632,000	貸付株式数	18,400株
東京一番フーズ	1,500	497.00	745,500	貸付株式数	600株 (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		
ディーブイエックス	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 (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 (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 (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 (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 (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
すかいらーくＨＤ	73,000	1,754.00	128,042,000	貸付株式数	29,100株 (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
ダイドーリミテツド	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・スーパーマーケ	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ＧＨＤ	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
ＢＥＥＮＯＳ	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・ＨＬＤＧＳ	252,200	3,579.00	902,623,800		
クリエイト・レストランツ・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ＨＬＤＧＳ	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ス	16,400	1,241.00	20,352,400	貸付株式数	6,400株 (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		
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	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
日本フエルト	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 (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 (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ビバ	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		
クラウディアＨＬＤＧＳ	1,700	417.00	708,900	貸付株式数	600株
ＴＳＩ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		
ＴＩＳ	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		
ＡＧＳ	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
ＫＬａｂ	12,800	698.00	8,934,400	貸付株式数	5,000株
ポールトゥウィン・ピットクル	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		
ｅｎｉｓｈ	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 (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 (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 (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	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		
オプティム	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 (100株)
GMOクラウド	1,200	7,090.00	8,508,000	貸付株式数	400株 (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 (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	400株 (400株)
アステリア	4,400	462.00	2,032,800	貸付株式数	1,500株
アイル	2,400	1,486.00	3,566,400	貸付株式数	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	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	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	1,300株
メディカル・データ・ビジ	5,000	1,025.00	5,125,000	貸付株式数	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	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	500株
テラスカイ	2,400	2,768.00	6,643,200	貸付株式数	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	1,000株
ＰＣＩホールディングス	2,800	1,175.00	3,290,000	貸付株式数	1,000株
パイプドＨＤ	900	1,482.00	1,333,800	貸付株式数	300株 (200株)
アイビーシー	1,400	931.00	1,303,400	貸付株式数	400株
ネオジャパン	1,200	1,819.00	2,182,800	貸付株式数	400株
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	600	2,492.00	1,495,200	貸付株式数	100株
ランドコンピュータ	1,000	1,064.00	1,064,000	貸付株式数	400株
ダブルスタンダード	900	4,200.00	3,780,000	貸付株式数	200株
オープンドア	3,400	1,155.00	3,927,000	貸付株式数	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	900株
ベネフィットジャパン	500	1,391.00	695,500	貸付株式数	100株
ＵＢＩＣＯＭホールディングス	1,600	1,844.00	2,950,400	貸付株式数	500株
ＬＩＮＥ	14,800	5,350.00	79,180,000	貸付株式数	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	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　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	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 (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		
東亞合成	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
日本カーバイド	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		
日本パーカライジング	32,300	1,116.00	36,046,800		
高圧ガス	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 (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		
ＪＳＲ	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ＨＬＤＧＳ	426,400	633.10	269,953,840		
ＫＨ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		
住友ベークライト	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
ＥＰＳ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
レッグス	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		
ＴＡＣ	4,400	187.00	822,800	貸付株式数	1,600株
ＣＥ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 (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		
ネクシィーズグループ	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
ＦＩＧ	7,700	260.00	2,002,000	貸付株式数	2,800株

ＡＤＥＫＡ	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		
ビオフエルミン製薬	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		
ＪＣＲ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		
ＤＩＣ	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	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	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	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
エックスネット	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
ＣＩＪ	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 (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 (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

ＪＣＵ	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
ＯＡＴ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 (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		
ＭＯＲＥＳＣＯ	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		
ＪＸＴＧ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ＨＬＤＧＳ	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
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	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		
ＡＧＣ	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		
日本ヒユーム	6,400	728.00	4,659,200	貸付株式数	2,400株
日本コンクリート	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
フジミ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
日本鋳鉄管	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 (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
ＵＡＣＪ	9,900	1,870.00	18,513,000		
ＣＫ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	
ＯＳＪＢ　ＨＤ	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	
文化シヤツター	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	
東洋シヤツター	1,700	708.00	1,203,600	
ＬＩＸＩＬグループ	95,500	1,555.00	148,502,500	
日本フイルコン	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
ＫｅｅＰｅｒ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		
Ｇｕｎｏｓｙ	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 (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 (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
ＩＢＪ	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 (900株)
ＥＲＩ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 (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		

ＦＵＪＩ	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		
ＤＭＧ森精機	41,500	1,308.00	54,282,000		
ソディツク	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
冨士ダイス	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
ＳＭＮ	1,000	985.00	985,000		
一蔵	700	380.00	266,000	貸付株式数	200株
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	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 (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
ＯＫＫ	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 (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
ＮＣ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		
フリュー	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 (1,000株)
タツモ	3,100	1,585.00	4,913,500	貸付株式数	1,200株
ナブテスコ	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
ＳＭＣ	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		
日精エーエスビー	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
ワイエイシイホールディングス	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		
ＴＯＷＡ	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		
酉島製作所	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		
トーヨーカネツ	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		
ＣＫＤ	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		
ＳＡＮＫＹＯ	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		
Ｎ　Ｔ　Ｎ	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		
Ｔ　Ｈ　Ｋ	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
日本ピラー工業	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ング	3,900	9,030.00	35,217,000		
ＯＲＣＨＥＳＴＲＡ　ＨＬＤＧＳ	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－Ｊａｐａｎ	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ＳＨＤ	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&ＣＯＮＳＵＬＴＩＮＧ	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ＨＬＤＧＳ	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 (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		
ＩＤＥＣ	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 (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
ＥＩＺＯ	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 (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. ジー.	3,700	1,210.00	4,477,000	貸付株式数	1,400株
フオスター電機	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 (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 (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	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 (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 (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	2,700株 (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	200株
太陽誘電	29,300	3,135.00	91,855,500	貸付株式数	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	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＆ＳＨＤ	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		
ＩＨＩ	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	500株
カーブスホールディングス	15,900	601.00	9,555,900	貸付株式数	6,300株
日本車輌	2,400	2,599.00	6,237,600		
三菱ロジスネクスト	8,900	986.00	8,775,400		
近畿車輌	1,000	1,231.00	1,231,000	貸付株式数	300株
ＦＰＧ	20,200	625.00	12,625,000	貸付株式数	8,000株 (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	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	9,500株
ゆうちょ銀行	180,700	871.00	157,389,700	貸付株式数	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 (500株)
Ｃａｓａ	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		
ＫＹＢ	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　ツ　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		
ＳＵＢＡＲＵ	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		
ＴＢＫ	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ＦＧ	37,700	411.00	15,494,700		
３３ＦＧ	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 (100株)
小　野　建	5,700	1,178.00	6,714,600		
はるやまＨＬＤＧＳ	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
カッパ・クリエイト	9,400	1,464.00	13,761,600	貸付株式数	2,500株 (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 (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
ＳＰＫ	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 (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		
ＶＴ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		
ダイトロン	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 (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		
ＳＣＲＥＥＮ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 (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		
前田工繊	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 (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	1,400株 (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	1,800株
タカラトミー	29,600	865.00	25,604,000		
廣済堂	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	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		
ＮＩＳＳＨＡ	13,900	1,003.00	13,941,700	貸付株式数	200株 (200株)
光村印刷	600	1,479.00	887,400	貸付株式数	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	1,300株 (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	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	800株
ジェイ　エス　ピー	4,000	1,469.00	5,876,000	貸付株式数	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		
ピジョン	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		
ＧＳＩ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		
ゴールドウイン	11,800	6,190.00	73,042,000	貸付株式数	2,800株 (2,800株)
ユニ・チヤーム	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		
ヤマトインターナシヨナル	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
リョーサン	6,800	2,264.00	15,395,200		
新光商事	10,100	842.00	8,504,200		
トーホー	2,900	1,754.00	5,086,600	貸付株式数	1,200株 (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 (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
木曽路	8,600	2,476.00	21,293,600	貸付株式数	3,300株
ＳＲＳ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
タカキユー	6,100	142.00	866,200	貸付株式数	1,800株 (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	4,600株 (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	3,200株 (1,700株)
ＭｒＭａｘＨＤ	8,400	464.00	3,897,600	貸付株式数	3,400株
テンアライド	5,800	382.00	2,215,600	貸付株式数	2,300株
ＡＯＫＩ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	300株
高　島　屋	46,200	946.00	43,705,200	貸付株式数	19,500株
松　屋	13,200	650.00	8,580,000	貸付株式数	5,400株
エイチ・ツー・オーリテイリング	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	400株
イオン	248,100	2,376.00	589,485,600	貸付株式数	97,400株
イ　ズ　ミ	13,200	3,230.00	42,636,000		
フオーバル	2,900	988.00	2,865,200		
平　和　堂	12,500	1,881.00	23,512,500	貸付株式数	5,100株
フ　ジ	7,100	1,851.00	13,142,100	貸付株式数	2,800株
ヤオコー	7,500	7,420.00	55,650,000	貸付株式数	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		
ＰＡＬＴＡＣ	10,500	4,865.00	51,082,500		
三谷産業	8,700	334.00	2,905,800		
ＯＬＹＭＰＩＣグループ	3,200	877.00	2,806,400		
日産東京販売ＨＤ	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	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 (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		
藍澤證券	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
日本エスコン	12,200	780.00	9,516,000		
タカラレーベン	30,200	332.00	10,026,400		
ＡＶＡＮＴＩＡ	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	2,600株 (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	7,800株
ＮＳ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	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		
ＳＧホールディングス	65,400	3,455.00	225,957,000	貸付株式数	26,200株
日本航空	110,200	2,092.00	230,538,400		
ＡＮＡ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ＷＩＳＭＥＴＴＡＣＨＤ	1,200	2,037.00	2,444,400	貸付株式数	100株
ヤマシタヘルスケアＨＬＤＧＳ	700	1,767.00	1,236,900		
ＧＥＮＫＹ　ＤＲＵＧＳＴＯＲＥＳ	2,900	3,270.00	9,483,000	貸付株式数	1,100株
国際紙パルプ商事	15,900	286.00	4,547,400		
ブックオフＧＨＤ	3,900	802.00	3,127,800	貸付株式数	1,500株 (100株)
三菱倉庫	19,300	2,701.00	52,129,300		
三井倉庫ＨＯＬＤ	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	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	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	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	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		
キユーソー流通システム	1,600	1,563.00	2,500,800	貸付株式数	300株 (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ＪＳＡＴＨＤ	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 (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ミュ	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
ＤＴＳ	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		
ＳＣＳＫ	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 (100株)
ＫＮＴ－ＣＴ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		
メイテツク	7,900	5,150.00	40,685,000		
ＴＫＣ	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	13,000	2,346.00	30,498,000		
ＮＳＤ	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ＨＬＤＳ	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 (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ＨＬＤＧＳ	3,200	3,650.00	11,680,000	貸付株式数	1,100株 (1,100株)
ＪＢＣＣホールディングス	4,500	1,471.00	6,619,500		
ＪＫ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	1,500株 (100株)
北沢産業	5,200	271.00	1,409,200	貸付株式数	200株
杉本商事	3,400	1,831.00	6,225,400	貸付株式数	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	3,000株 (1,700株)
ミニストップ	4,700	1,530.00	7,191,000	貸付株式数	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	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	1,300株
タキヒヨー	2,000	1,755.00	3,510,000	貸付株式数	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	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	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		
サックスバーホールディング	5,200	576.00	2,995,200	貸付株式数	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	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（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。

【ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）】

(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】

ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	194,288	588,651
親投資信託受益証券	34,492,267	379,951,039
未収入金	8,917,700	17,000
流動資産合計	43,604,255	380,556,690
資産合計	43,604,255	380,556,690
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	556,889	4,006,532
未払解約金	8,917,600	－
未払受託者報酬	11,930	34,152
未払委託者報酬	173,580	495,754
その他未払費用	3,026	8,469
流動負債合計	9,663,025	4,544,907
負債合計	9,663,025	4,544,907
純資産の部		
元本等		
元本	※1 30,938,291	※1 333,877,680
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,002,939	42,134,103
（分配準備積立金）	13,162	88,664
元本等合計	33,941,230	376,011,783
純資産合計	33,941,230	376,011,783
負債純資産合計	43,604,255	380,556,690

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 至　2020年6月15日
営業収益		
有価証券売買等損益	△ 35,676,662	25,242,172
営業収益合計	△ 35,676,662	25,242,172
営業費用		
支払利息	－	19
受託者報酬	21,655	48,780
委託者報酬	314,948	708,447
その他費用	5,252	12,134
営業費用合計	341,855	769,380
営業利益又は営業損失（△）	△ 36,018,517	24,472,792
経常利益又は経常損失（△）	△ 36,018,517	24,472,792
当期純利益又は当期純損失（△）	△ 36,018,517	24,472,792
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（△）	△ 35,829,649	30,109,772
期首剰余金又は期首欠損金（△）	4,253,531	3,002,939
剰余金増加額又は欠損金減少額	107,749,652	334,954,298
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	107,749,652	334,954,298
剰余金減少額又は欠損金増加額	108,254,487	286,179,622
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	108,254,487	286,179,622
分配金	※1　556,889	※1　4,006,532
期末剰余金又は期末欠損金（△）	3,002,939	42,134,103

(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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2019年6月15日及びその翌日が休日のため、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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1．※1　期首元本額	22,987,038円	30,938,291円
期中追加設定元本額	816,750,378円	1,970,995,928円
期中一部解約元本額	808,799,125円	1,668,056,539円
2．計算期間末日における受益権の総数	30,938,291口	333,877,680口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 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（260,470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（3,303,943円）及び分配準備積立金（199円）より分配対象額は3,564,612円（1万口当たり1,152.17円）であり、うち556,889円（1万口当たり180円）を分配金額としております。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,427,433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（42,713,484円）及び分配準備積立金（8円）より分配対象額は46,140,925円（1万口当たり1,381.97円）であり、うち4,006,532円（1万口当たり120円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	第4期 自　2019年6月18日 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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第3期 2019年6月17日現在	第4期 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	△171,050	△5,125,860
合計	△171,050	△5,125,860

（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 2019年6月17日現在	第4期 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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0971円 (10,971円)	1.1262円 (11,262円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ストックインデックス２２５・マザーファンド	138,093,712	379,951,039	
親投資信託受益証券　合計			379,951,039	
合計			379,951,039	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２ 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３ デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「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	17,760,496,540
株式	※2※3	168,003,484,800	156,597,158,960
派生商品評価勘定		38,920	－
未収配当金		1,161,828,720	963,998,450
未収利息		－	800,124
前払金		19,270,000	100,643,200
その他未収収益	※4	－	27,137,864
差入委託証拠金		－	89,100,000
流動資産合計		171,986,574,064	175,539,335,138
資産合計		171,986,574,064	175,539,335,138
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		12,019,360	210,480,200
未払解約金		54,253,700	548,852,000
受入担保金		－	15,202,023,375
流動負債合計		66,273,060	15,961,355,575
負債合計		66,273,060	15,961,355,575
純資産の部			
元本等			
元本	※1	65,172,307,878	57,999,406,705
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（△）		106,747,993,126	101,578,572,858
元本等合計		171,920,301,004	159,577,979,563
純資産合計		171,920,301,004	159,577,979,563
負債純資産合計		171,986,574,064	175,539,335,138

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	自　2019年6月18日 至　2020年6月15日
1．有価証券の評価基準及び評価方法	株式

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年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 ファンド２２５	32,941,137,853円	26,392,822,617円
適格機関投資家専用・ダイワ・ストックインデックスファンド２２５ＶＡ	668,369,882円	494,444,637円
大和 ストック インデックス ２２５ ファンド	11,548,166,311円	9,505,686,495円
Ｄ－Ｉ's 日経２２５インデックス	196,978,371円	159,930,107円
ｉＦｒｅｅ 日経２２５インデックス	1,909,011,874円	3,558,988,869円

	ＤＣ・ダイワ・ストックインデックス２２５（確定拠出年金専用ファンド）	5,572,832,122円	5,445,218,527円
	ダイワ・ノーロード 日経２２５ファンド	348,677,753円	322,149,773円
	ダイワファンドラップ 日経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 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、以下のとおり有価証券の貸付を行っております。 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金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　2,771,150,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式　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当額の未入金分26,566,350円が含まれております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2019年6月18日 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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年6月17日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（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	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買　建	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ヨン	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	262,000	3,896.00	1,020,752,000	貸付株式数　32,600株
キリン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 (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		
ＮＴＮ	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 (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＆ＳＨＤ	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		
ＩＨＩ	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 (96,000株)
ＳＵＢＡＲＵ	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ＪＳＡＴＨＤ	26,200	430.00	11,266,000	
日本電信電話	104,800	2,474.00	259,275,200	
ＫＤＤＩ	1,572,000	3,141.00	4,937,652,000	
ＮＴＴ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	
ＮＴＴ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す。

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

【ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）】

(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】

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,260,794	19,079,626
親投資信託受益証券	3,053,130,554	8,069,419,925
未収入金	26,030,000	－
流動資産合計	3,085,421,348	8,088,499,551
資産合計	3,085,421,348	8,088,499,551
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	49,734,807	110,985,385
未払解約金	25,958,431	－
未払受託者報酬	293,114	878,167
未払委託者報酬	5,643,211	16,905,594
その他未払費用	73,885	219,509
流動負債合計	81,703,448	128,988,655
負債合計	81,703,448	128,988,655
純資産の部		
元本等		
元本	※1 2,617,621,424	※1 6,936,586,592
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	386,096,476	1,022,924,304
（分配準備積立金）	31,581,614	261,234,622
元本等合計	3,003,717,900	7,959,510,896
純資産合計	3,003,717,900	7,959,510,896
負債純資産合計	3,085,421,348	8,088,499,551

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 至　2020年6月15日
営業収益		
受取利息	―	22
有価証券売買等損益	70,079,222	391,668,171
営業収益合計	70,079,222	391,668,193
営業費用		
支払利息	1,633	3,224
受託者報酬	478,846	1,430,382
委託者報酬	9,219,220	27,536,776
その他費用	119,608	358,861
営業費用合計	9,819,307	29,329,243
営業利益	60,259,915	362,338,950
経常利益	60,259,915	362,338,950
当期純利益	60,259,915	362,338,950
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（△）	2,982,928	△ 2,394,538
期首剰余金又は期首欠損金（△）	167,468,761	386,096,476
剰余金増加額又は欠損金減少額	485,857,423	1,575,236,495
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	485,857,423	1,575,236,495
剰余金減少額又は欠損金増加額	274,771,888	1,192,156,770
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	274,771,888	1,192,156,770
分配金	※1　49,734,807	※1　110,985,385
期末剰余金又は期末欠損金（△）	386,096,476	1,022,924,304

(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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2019年6月15日及びその翌日が休日のため、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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1．※1　期首元本額	1,166,051,379円	2,617,621,424円
期中追加設定元本額	3,354,512,466円	12,869,207,903円
期中一部解約元本額	1,902,942,421円	8,550,242,735円
2．計算期間末日における受益権の総数	2,617,621,424口	6,936,586,592口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 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（44,100,538円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（13,176,449円）、投資信託約款に規定される収益調整金（367,602,969円）及び分配準備積立金（10,951,327円）より分配対象額は435,831,283円（1万口当たり1,664.99円）であり、うち49,734,807円（1万口当たり190円）を分配金額としております。	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（116,328,598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（248,404,890円）、投資信託約款に規定される収益調整金（761,689,682円）及び分配準備積立金（7,486,519円）より分配対象額は1,133,909,689円（1万口当たり1,634.68円）であり、うち110,985,385円（1万口当たり160円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第4期 自　2019年6月18日 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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第3期 2019年6月17日現在	第4期 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	63,801,934	377,296,538
合計	63,801,934	377,296,538

（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 2019年6月17日現在	第4期 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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1475円 (11,475円)	1.1475円 (11,475円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	4,083,714,537	8,069,419,925	
親投資信託受益証券　合計			8,069,419,925	
合計			8,069,419,925	

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

	原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	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 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	18,587,359,708円	21,439,177,203円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	1,137,083,572円	1,477,569,279円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	315,080,260円	660,563,226円
ダイワ・ワールド・バランスファンド７５ＶＡ	10,016,873円	－円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）	1,573,697,518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）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2019年6月18日 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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年6月17日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（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 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
株価指数先物取引								
買　建	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	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
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・シュケル	45,546,318	－	46,010,860	△464,542	60,529,579	－	60,822,648	△293,069
オーストラリア・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・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・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・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・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。
① 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
② 期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
(2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2019年6月17日現在	2020年6月15日現在
1口当たり純資産額	1.9401円	1.9760円
（1万口当たり純資産額）	(19,401円)	(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		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	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 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 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 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 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 AMERICA	894	87.980	78,654.120	
AMERICAN FINANCIAL GROUP 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 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 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 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 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	
AKAMAI 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	

FREEPORT-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 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 C	1,395	35.360	49,327.200	
HOLLYFRONTIER CORP	1,783	31.380	55,950.540	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,762	36.290	100,232.980	

LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM 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 & 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 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 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 - 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 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 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-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 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 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 A	555	258.330	143,373.150	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE 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 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 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 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 SOFTWRE	1,751	134.000	234,634.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - 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 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 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	
WW GRAINGER INC	588	303.750	178,605.000	
JACOBS ENGINEERING GROUP 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-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 344,239,043.110 (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	
GLENCORE 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	
ASHTEAD 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 PLC	30,587	30.000	917,610.000	
BHP GROUP PLC	26,142	16.674	435,891.700	
ASSOCIATED BRITISH FOODS 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 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 19,259,538.090 (2,583,474,439)	
イスラエル・シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	12,000	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 2,033,313.610 (62,727,725)	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	22,824	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 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 14,474,022.050 (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 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 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 23,087,262.570 (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 2,435,839.000 (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-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-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・クローナ		株	スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	ICA GRUPPEN AB	700	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-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 27,600,830.860 (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 869,774.760 (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 9,752,646.970 (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 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 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 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 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 DELHAIZE N	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 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 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 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 ENE	1,793	14.840	26,608.120	

	ENAGAS SA	3,675	20.720	76,146.000	
	RED ELECTRICA CORPORACION 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 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 47,669,079.080 (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 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 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 INVESTMENT	14,000	34.450	482,300.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	19,200	23.550	452,160.000	
	SANDS CHINA LTD	29,000	32.550	943,950.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO 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 40,651,305.790 (562,614,071)	
合計				51,952,815,871 [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 11,092,856.630 (1,189,597,945)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	10,295	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 239,789.410 (32,165,351)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE GROUP	4,303	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 1,837,329.410 (134,235,287)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	2,000	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 222,262.000 (17,483,129)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	28,000	49,280.000	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30,500	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 410,269.000 (31,533,275)	
	ユーロ			ユーロ	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,751	100,402.340	
		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 261,537.910 (31,562,395)	
	香港・ドル			香港・ドル	
		LINK REIT	32,000	2,147,200.000	
		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 2,941,040.000 (40,703,994)	
投資証券　合計				1,477,281,376 [1,477,281,376]	
合計				1,477,281,376 [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	組入株式時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式　585銘柄 投資証券　39銘柄	96.9%	3.1%	71.5%
イギリス・ポンド	株式　85銘柄 投資証券　3銘柄	98.8%	1.2%	4.9%
イスラエル・シュケル	株式　8銘柄	100%	-%	0.1%

オーストラリア・ドル	株式 53銘柄 投資証券 11銘柄	88.7%	11.3%	2.2%
カナダ・ドル	株式 79銘柄 投資証券 4銘柄	99.0%	1.0%	3.4%
シンガポール・ドル	株式 15銘柄 投資証券 6銘柄	85.6%	14.4%	0.4%
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 投資証券 5銘柄	99.5%	0.5%	10.8%
香港・ドル	株式 32銘柄 投資証券 3銘柄	93.3%	6.7%	1.1%

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。

【ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）】

(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】

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,237	9,302,446
親投資信託受益証券	16,579,096	223,460,271
未収入金	800	10,000
流動資産合計	16,585,133	232,772,717
資産合計	16,585,133	232,772,717
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	43,879	－
未払受託者報酬	150	453,283
未払委託者報酬	4,192	8,726,564
その他未払費用	195	113,264
流動負債合計	48,416	9,293,111
負債合計	48,416	9,293,111
純資産の部		
元本等		
元本	※1 14,626,454	※1 194,514,017
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,910,263	28,965,589
（分配準備積立金）	558,656	79
元本等合計	16,536,717	223,479,606
純資産合計	16,536,717	223,479,606
負債純資産合計	16,585,133	232,772,717

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 至　2020年6月15日
営業収益		
受取利息	－	12
有価証券売買等損益	460,415	△ 1,643,943,625
営業収益合計	460,415	△ 1,643,943,613
営業費用		
支払利息	－	1,966
受託者報酬	215	771,373
委託者報酬	6,534	14,850,477
その他費用	378	193,241
営業費用合計	7,127	15,817,057
営業利益又は営業損失（△）	453,288	△ 1,659,760,670
経常利益又は経常損失（△）	453,288	△ 1,659,760,670
当期純利益又は当期純損失（△）	453,288	△ 1,659,760,670
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	－	△ 1,642,987,843
期首剰余金又は期首欠損金（△）	127,308	1,910,263
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,373,546	3,389,146,835
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,373,546	3,389,146,835
剰余金減少額又は欠損金増加額	－	3,345,318,682
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	3,345,318,682
分配金	※1　43,879	※1　－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,910,263	28,965,589

(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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2019年6月15日及びその翌日が休日のため、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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1．※1　期首元本額	1,000,000円	14,626,454円
期中追加設定元本額	13,626,454円	15,442,007,002円
期中一部解約元本額	－円	15,262,119,439円
2．計算期間末日における受益権の総数	14,626,454口	194,514,017口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 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（36,862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（416,426円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,746,996円）及び分配準備積立金（127,308円）より分配対象額は2,327,592円（1万口当たり1,591.36円）であり、うち43,879円（1万口当たり30円）を分配金額としております。	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（55,295,423円）及び分配準備積立金（79円）より分配対象額は55,295,502円（1万口当たり2,842.75円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第4期 自　2019年6月18日 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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第3期 2019年6月17日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第4期 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）
親投資信託受益証券	460,441	△18,259,219
合計	460,441	△18,259,219

（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 2019年6月17日現在	第4期 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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1306円 (11,306円)	1.1489円 (11,489円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	外国株式インデックスマザーファンド	87,456,566	223,460,271	
親投資信託受益証券　合計			223,460,271	
合計			223,460,271	

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

	原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	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 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	555,335,842円	554,243,792円
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	1,805,981,806円	2,237,678,030円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	537,785,213円	643,296,020円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	6,557,900円	8,065,683円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	493,277円	5,547,826円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	905,383,641円	1,611,943,894円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	683,566,181円	977,106,331円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	18,023,500円	37,228,086円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	28,406,470,539円	32,298,766,795円
ダイワ・ライフ・バランス３０	566,909,665円	567,653,416円
ダイワ・ライフ・バランス５０	846,970,888円	988,544,589円
ダイワ・ライフ・バランス７０	648,553,039円	744,909,989円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	1,486,105,064円	1,548,942,585円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	3,399,663円	2,773,012円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	13,174,854円	13,532,746円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	4,250,389円	7,121,165円
ダイワつみたてインデックス外国株式	64,183,977円	331,490,248円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	39,782円	2,497,968円

	ダイワつみたてインデックスバランス５０	79,563円	1,899,391円
	ダイワつみたてインデックスバランス７０	99,454円	2,287,321円
	ダイワ世界分散バランスファンド１５ＶＡ	73,565円	－円
	ダイワ世界分散バランスファンド２０ＶＡ	151,649円	－円
	ダイワ世界分散バランスファンド２５ＶＡ	1,162,691円	－円
	ダイワ世界分散バランスファンド３０ＶＡ	1,725,194円	－円
	ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	205,401,310円	186,973,164円
	ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	345,545,113円	315,943,780円
	ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2,865,699,348円	2,678,662,952円
	ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	147,509,273円	123,631,857円
	ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	663,098,757円	782,872,861円
	ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	108,076,802円	179,126,306円
	ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	6,619,723円	87,456,566円
	ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	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）

Ｉ 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年6月18日 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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年6月17日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（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（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引								
株価指数先物取引								
買　建	1,478,267,686	－	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	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引以外の取引								
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。

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

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

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

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

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2019年6月17日現在	2020年6月15日現在
1口当たり純資産額	2.5045円	2.5551円
（1万口当たり純資産額）	(25,045円)	(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 SOLUTIO	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 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 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 AMERICA	1,950	87.980	171,561.000	
AMERICAN FINANCIAL GROUP 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 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 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 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 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	
AKAMAI 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	
FREEPORT-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 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 C	5,978	35.360	211,382.080	
HOLLYFRONTIER CORP	4,700	31.380	147,486.000	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	6,500	36.290	235,885.000	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM 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 & 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 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 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 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 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-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 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 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 A	1,760	258.330	454,660.800	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE 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 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 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 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 SOFTWRE	3,550	134.000	475,700.000	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - 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 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 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 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 830,441,849.710 (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 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 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	
ASHTEAD 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 PLC	74,310	30.000	2,229,300.000	
BHP GROUP PLC	68,727	16.674	1,145,953.990	
ASSOCIATED BRITISH FOODS 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 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 47,014,501.740 (6,306,525,263)	
イスラエル・シュケル		株	イスラエル・シュケル	イスラエル・シュケル	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	34,500	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 4,723,155.000 (145,709,332)	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	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 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-CDI	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 35,531,209.210 (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 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 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 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 55,795,798.020 (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 5,817,811.500 (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	

				40,058,676.940 (4,515,013,478)	
スウェーデン・クローナ		株	スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	ICA GRUPPEN AB	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-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・クローナ 116,512,074.500 (1,337,558,615)	
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	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 64,994,445.000 (1,052,260,064)	
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	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 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・ドル 1,976,307.370 (135,851,368)	
ノルウェー・クローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	NORSK HYDRO ASA	41,700	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 22,432,896.150 (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 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 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 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 HOLDI	33,800	2.596	87,744.800	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-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 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 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 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 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 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 ENE	6,650	14.840	98,686.000	
	ENAGAS SA	7,950	20.720	164,724.000	
	RED ELECTRICA CORPORACION 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 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	

				115,790,895.510 (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 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	
	WHEELOCK & 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 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 INVESTMENT	36,000	34.450	1,240,200.000	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	53,900	23.550	1,269,345.000	
	SANDS CHINA LTD	77,600	32.550	2,525,880.000	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO 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 98,344,492.220 (1,361,087,772)	
合計			125,564,531,893 [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 26,182,280.900 (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	
	SEGRO 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 546,952.700 (73,368,235)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	LENDLEASE 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 4,581,653.920 (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 312,137.000 (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 969,608.000 (74,524,071)	
	ユーロ			ユーロ	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,200	240,828.000	
		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 679,424.250 (81,992,918)	
	香港・ドル			香港・ドル	
		LINK REIT	67,000	4,495,700.000	
		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 6,478,260.000 (89,659,119)	
投資証券　合計				3,486,620,478 [3,486,620,478]	
合計				3,486,620,478 [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	組入株式時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	株式 589銘柄 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 投資証券 3銘柄	98.9%	1.1%	4.9%
イスラエル・シュケル	株式 8銘柄	100%	-%	0.1%
オーストラリア・ドル	株式 53銘柄 投資証券 11銘柄	88.6%	11.4%	2.3%
カナダ・ドル	株式 81銘柄 投資証券 4銘柄	99.4%	0.6%	3.4%
シンガポール・ドル	株式 16銘柄 投資証券 6銘柄	85.7%	14.3%	0.4%
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 投資証券 5銘柄	99.4%	0.6%	10.9%
香港・ドル	株式 32銘柄 投資証券 3銘柄	93.8%	6.2%	1.1%

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。

【ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）】

(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】

ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,348,486	25,210,357
親投資信託受益証券	5,111,839,357	18,576,559,929
未収入金	68,050,329	－
流動資産合計	5,188,238,172	18,601,770,286
資産合計	5,188,238,172	18,601,770,286
負債の部		
流動負債		
未払解約金	68,074,795	－
未払受託者報酬	233,500	508,160
未払委託者報酬	2,919,333	6,352,498
その他未払費用	117,807	254,074
流動負債合計	71,345,435	7,114,732
負債合計	71,345,435	7,114,732
純資産の部		
元本等		
元本	※1 4,937,687,762	※1 18,167,937,521
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	179,204,975	426,718,033
（分配準備積立金）	103,557,148	53,177,639
元本等合計	5,116,892,737	18,594,655,554
純資産合計	5,116,892,737	18,594,655,554
負債純資産合計	5,188,238,172	18,601,770,286

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 至　2020年6月15日
営業収益		
受取利息	―	34
有価証券売買等損益	112,206,312	△ 120,950,147
営業収益合計	112,206,312	△ 120,950,113
営業費用		
支払利息	3,501	3,983
受託者報酬	413,382	781,356
委託者報酬	5,168,332	9,768,041
その他費用	206,812	391,772
営業費用合計	5,792,027	10,945,152
営業利益又は営業損失（△）	106,414,285	△ 131,895,265
経常利益又は経常損失（△）	106,414,285	△ 131,895,265
当期純利益又は当期純損失（△）	106,414,285	△ 131,895,265
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	3,018,541	△ 71,372,831
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,426,013	179,204,975
剰余金増加額又は欠損金減少額	113,938,192	1,043,717,615
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	113,938,192	1,043,717,615
剰余金減少額又は欠損金増加額	41,554,974	735,682,123
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	41,554,974	735,682,123
分配金	※1 ―	※1 ―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	179,204,975	426,718,033

(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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2019年6月15日及びその翌日が休日のため、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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1．※1　期首元本額	275,900,547円	4,937,687,762円
期中追加設定元本額	8,652,065,532円	32,014,941,813円
期中一部解約元本額	3,990,278,317円	18,784,692,054円
2．計算期間末日における受益権の総数	4,937,687,762口	18,167,937,521口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 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（30,654,502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（72,677,761円）、投資信託約款に規定される収益調整金（75,647,827円）及び分配準備積立金（224,885円）より分配対象額は179,204,975円（1万口当たり362.93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（49,051,353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（539,632,677円）及び分配準備積立金（4,126,286円）より分配対象額は592,810,316円（1万口当たり326.29円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第4期 自　2019年6月18日 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。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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	第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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第3期 2019年6月17日現在	第4期 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	108,165,603	△53,780,611
合計	108,165,603	△53,780,611

（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 2019年6月17日現在	第4期 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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在

1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0363円 (10,363円)	1.0235円 (10,235円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	13,064,603,650	18,576,559,929	
親投資信託受益証券　合計			18,576,559,929	
合計			18,576,559,929	

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 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

	個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、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。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年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 日本債券ファンド	76,456,533円	78,373,970円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	19,024,110,851円	23,424,297,601円
ダイワ日本債券インデックス（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 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）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年6月18日 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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

区　分	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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年6月17日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（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 （1万口当たり純資産額）	1.4374円 (14,374円)	1.4219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 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	４０２　２年国債	150,000,000	150,429,000	
	４０５　２年国債	150,000,000	150,534,000	
	４０６　２年国債	700,000,000	702,653,000	
	４０７　２年国債	100,000,000	100,395,000	
	４０８　２年国債	150,000,000	150,627,000	
	４０９　２年国債	1,100,000,000	1,104,851,000	
	４１０　２年国債	2,000,000,000	2,009,240,000	
	１２９　５年国債	540,000,000	541,809,000	
	１３０　５年国債	680,000,000	682,781,200	
	１３１　５年国債	1,170,000,000	1,175,463,900	
	１３２　５年国債	880,000,000	884,699,200	
	１３３　５年国債	550,000,000	553,245,000	
	１３４　５年国債	470,000,000	473,078,500	
	１３５　５年国債	2,820,000,000	2,840,304,000	
	１３６　５年国債	950,000,000	957,467,000	
	１３７　５年国債	700,000,000	705,852,000	
	１３８　５年国債	900,000,000	907,938,000	
	１３９　５年国債	700,000,000	706,475,000	
	１４０　５年国債	600,000,000	605,808,000	
	１４１　５年国債	920,000,000	929,264,400	
	１４２　５年国債	1,750,000,000	1,767,867,500	
	１４３　５年国債	520,000,000	525,470,400	
	１　４０年国債	70,000,000	104,586,300	
	２　４０年国債	110,000,000	160,035,700	
	３　４０年国債	150,000,000	220,045,500	
	４　４０年国債	107,000,000	158,448,810	
	５　４０年国債	125,000,000	179,336,250	
	６　４０年国債	105,000,000	148,678,950	
	７　４０年国債	121,000,000	165,083,930	
	８　４０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	

６１　２０年国債	100,000,000	103,214,000	
６２　２０年国債	95,000,000	97,743,600	
６３　２０年国債	130,000,000	137,688,200	
６４　２０年国債	90,000,000	96,049,800	
６５　２０年国債	175,000,000	187,633,250	
６６　２０年国債	185,000,000	197,702,100	
６７　２０年国債	55,000,000	59,239,400	
６８　２０年国債	120,000,000	130,610,400	
６９　２０年国債	110,000,000	119,310,400	
７０　２０年国債	83,000,000	91,485,090	
７１　２０年国債	125,000,000	136,770,000	
７２　２０年国債	105,000,000	115,061,100	
７３　２０年国債	120,000,000	131,571,600	
７４　２０年国債	73,000,000	80,370,080	
７５　２０年国債	80,000,000	88,500,000	
７６　２０年国債	51,000,000	55,930,680	
７７　２０年国債	130,000,000	143,189,800	
７８　２０年国債	61,000,000	67,194,550	
７９　２０年国債	50,000,000	55,329,500	
８０　２０年国債	53,000,000	58,916,390	
８１　２０年国債	76,000,000	84,533,280	
８２　２０年国債	87,000,000	97,229,460	
８３　２０年国債	93,000,000	104,455,740	
８５　２０年国債	58,000,000	65,485,480	
８６　２０年国債	80,000,000	91,252,800	
８７　２０年国債	55,000,000	62,417,300	
８８　２０年国債	100,000,000	114,652,000	
８９　２０年国債	78,000,000	88,955,880	
９０　２０年国債	20,000,000	22,928,000	
９１　２０年国債	60,000,000	69,162,600	
９２　２０年国債	310,000,000	355,052,300	
９３　２０年国債	100,000,000	114,407,000	
９４　２０年国債	130,000,000	149,614,400	
９５　２０年国債	50,000,000	58,534,500	
９６　２０年国債	55,000,000	63,610,250	
９７　２０年国債	40,000,000	46,764,800	
９８　２０年国債	320,000,000	371,776,000	
９９　２０年国債	100,000,000	116,696,000	
１００　２０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　フイリピン共和国	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	

	２２２　神奈川県公債	100,000,000	99,880,300	
	３１　神奈川県２０年	100,000,000	109,643,200	
	３６１　大阪府公債	100,000,000	101,824,000	
	４２０　大阪府公債	200,000,000	200,782,000	
	２４－５　京都府公債	100,000,000	101,795,600	
	２６－１７　兵庫県公債	100,000,000	101,886,700	
	３　兵庫県公債１２年	200,000,000	204,815,600	
	１９兵庫県公債２０年	100,000,000	116,565,700	
	２６－１０　静岡県公債	100,000,000	102,136,900	
	２１－５　愛知県公債	100,000,000	119,186,800	
	２４－１６　愛知県公債	100,000,000	101,907,900	
	２９－５　広島県公債	100,000,000	101,057,400	
	４　埼玉県３０年	100,000,000	118,120,200	
	２９－１　福岡県公債	100,000,000	100,740,100	
	２２－１　福岡県１５年	100,000,000	108,740,500	
	１６　千葉県２０年	100,000,000	116,867,100	
	２８－２　新潟県公債	100,000,000	100,599,300	
	１０８　共同発行地方	100,000,000	101,760,500	
	１１７　共同発行地方	100,000,000	101,737,800	
	１２６　共同発行地方	100,000,000	102,525,800	
	１３１　共同発行地方	100,000,000	102,330,100	
	１６８　共同発行地方	100,000,000	100,802,600	
	２３－２　島根県公債	100,000,000	101,471,700	
	２５－６　大阪市公債	200,000,000	204,515,000	
	１１　名古屋市２０年	100,000,000	118,732,100	
	２０－１　神戸市２０年	100,000,000	117,897,900	
	２４－１０　神戸市公債	100,000,000	101,806,500	
	２４－３　横浜市公債	100,000,000	101,757,900	
	２４－５　札幌市公債	100,000,000	101,634,500	
	４　川崎市公債３０年	100,000,000	133,187,100	
	２３－４　福岡市２０年	100,000,000	118,607,500	
	２４－４　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	４７日本政策投資ＣＯ	100,000,000	108,254,000	
	１９　政保政策投資Ｃ	100,000,000	101,790,800	
	８１　道路機構	100,000,000	101,535,900	
	２４７　道路機構	200,000,000	195,796,200	
	８６　政保道路機構	100,000,000	117,434,300	
	１６８　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ホールデイングス	100,000,000	102,385,100	
	１７　パナソニツク	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　トヨタフアイナンス	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　フア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。

【ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）】

(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】

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	36,606,529	46,445,254
親投資信託受益証券	12,738,116,315	22,280,531,520
未収入金	108,463,748	－
流動資産合計	12,883,186,592	22,326,976,774
資産合計	12,883,186,592	22,326,976,774
負債の部		
流動負債		
未払解約金	109,150,153	－
未払受託者報酬	1,236,187	1,375,393
未払委託者報酬	22,252,237	24,757,879
その他未払費用	468,094	515,805
流動負債合計	133,106,671	26,649,077
負債合計	133,106,671	26,649,077
純資産の部		
元本等		
元本	※1 12,238,138,887	※1 20,288,495,945
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	511,941,034	2,011,831,752
（分配準備積立金）	419,361,390	321,279,837
元本等合計	12,750,079,921	22,300,327,697
純資産合計	12,750,079,921	22,300,327,697
負債純資産合計	12,883,186,592	22,326,976,774

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 至　2020年6月15日
営業収益		
受取利息	1	55
有価証券売買等損益	548,362,896	386,053,552
営業収益合計	548,362,897	386,053,607
営業費用		
支払利息	12,071	8,962
受託者報酬	1,983,652	2,281,657
委託者報酬	35,707,439	41,071,404
その他費用	744,542	859,143
営業費用合計	38,447,704	44,221,166
営業利益	509,915,193	341,832,441
経常利益	509,915,193	341,832,441
当期純利益	509,915,193	341,832,441
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	85,580,084	49,895,512
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 4,709,579	511,941,034
剰余金増加額又は欠損金減少額	93,302,780	2,544,245,353
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	93,302,780	2,544,245,353
剰余金減少額又は欠損金増加額	987,276	1,336,291,564
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	987,276	1,336,291,564
分配金	※1 －	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	511,941,034	2,011,831,752

(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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2019年6月15日及びその翌日が休日のため、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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1．※1　期首元本額	1,403,467,254円	12,238,138,887円
期中追加設定元本額	14,932,722,296円	31,728,087,266円
期中一部解約元本額	4,098,050,663円	23,677,730,208円
2．計算期間末日における受益権の総数	12,238,138,887口	20,288,495,945口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 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（209,758,810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（204,080,377円）、投資信託約款に規定される収益調整金（301,349,129円）及び分配準備積立金（5,522,203円）より分配対象額は720,710,519円（1万口当たり588.91円）であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（199,240,253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（92,696,676円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,690,551,915円）及び分配準備積立金（29,342,908円）より分配対象額は2,011,831,752円（1万口当たり991.61円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第4期 自　2019年6月18日 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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第3期 2019年6月17日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第4期 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）
親投資信託受益証券	455,957,734	323,631,353
合計	455,957,734	323,631,353

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第3期 2019年6月17日現在	第4期 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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0418円 (10,418円)	1.0992円 (10,992円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	20,995,600,754	22,280,531,520	
親投資信託受益証券　合計			22,280,531,520	
合計			22,280,531,520	

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 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 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年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	68,969,365,389円	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）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年6月18日 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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における債券先物取引を利用しております。また、信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。

3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年6月17日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（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 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引								
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 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	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・シュケル	－	－	－	－	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。

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

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

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

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

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2019年6月17日現在	2020年6月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0016円 (10,016円)	1.0612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 Note/Bond 20211115	13,946,000.000	14,302,738.680	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221115	15,000,000.000	15,513,750.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20230215	11,000,000.000	11,525,910.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230515	11,020,000.000	11,513,255.200	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230815	11,310,000.000	12,122,849.700	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20231115	12,905,000.000	14,005,925.550	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20240215	10,500,000.000	11,456,445.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240515	12,580,000.000	13,670,811.800	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	20,990,000.000	21,414,627.700	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20230815	3,300,000.000	3,929,310.000	
		6.125% United States Treasury Note/Bond 20271115	4,750,000.000	6,690,422.500	
		5.5% United States Treasury Note/Bond 20280815	3,800,000.000	5,293,248.000	
		5.25% United States Treasury Note/Bond 20281115	2,700,000.000	3,734,424.000	
		6.25% United States Treasury Note/Bond 20300515	1,400,000.000	2,154,026.000	

		5.375% United States Treasury Note/Bond 20310215	1,130,000.000	1,675,835.200	
		4.5% United States Treasury Note/Bond 20360215	700,000.000	1,065,526.000	
		3.5% United States Treasury Note/Bond 20390215	2,630,000.000	3,699,252.800	
		4.375% United States Treasury Note/Bond 20391115	2,410,000.000	3,764,853.800	
		4.625% United States Treasury Note/Bond 20400215	1,390,000.000	2,239,192.700	
		4.75% United States Treasury Note/Bond 20410215	1,770,000.000	2,915,172.300	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	2,170,000.000	2,921,514.400	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	7,500,000.000	9,731,775.000	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	1,100,000.000	1,595,506.000	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,532,000.000	3,741,814.920	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	1,000,000.000	1,454,840.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,200,000.000	4,493,984.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	5,040,000.000	6,823,857.600	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	7,810,000.000	8,476,895.900	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	22,750,000.000	23,350,600.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	8,300,000.000	9,022,930.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	3,970,000.000	5,292,486.400	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	9,020,000.000	9,776,056.400	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	16,720,000.000	17,318,241.600	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	10,700,000.000	11,767,432.000	

		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	3,300,000.000	4,418,898.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	6,000,000.000	6,404,040.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	5,165,000.000	5,523,296.050	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	2,070,000.000	2,549,639.700	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,750,000.000	6,111,157.500	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	5,000,000.000	5,189,050.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	31,700,000.000	32,081,351.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,850,000.000	6,411,190.500	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	4,980,000.000	6,575,691.600	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	8,470,000.000	9,440,069.100	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	8,000,000.000	8,218,720.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,500,000.000	4,734,555.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	3,350,000.000	3,771,865.500	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	2,250,000.000	3,045,037.500	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	12,200,000.000	13,127,322.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,310,000.000	4,295,486.300	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	7,000,000.000	7,464,800.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	5,300,000.000	5,832,438.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,500,000.000	2,773,425.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,500,000.000	6,261,480.000	

		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	4,400,000.000	5,180,296.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	1,500,000.000	2,047,320.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	7,800,000.000	9,408,126.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	1,850,000.000	2,700,408.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	4,000,000.000	4,676,240.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	3,200,000.000	4,387,488.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	2,000,000.000	2,686,240.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	4,000,000.000	4,338,720.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	2,100,000.000	2,504,250.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	6,900,000.000	7,586,757.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	2,800,000.000	3,432,828.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	2,500,000.000	2,691,000.000	
		2% United States Treasury 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 477,166,096.900 (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 20250907	750,000.000	830,565.000	
		2.5% United Kingdom Gilt 20650722	960,000.000	1,735,104.000	
		1.5% United Kingdom Gilt 20260722	1,025,000.000	1,119,156.500	
		0.5% United Kingdom Gilt 20220722	250,000.000	252,857.500	

		1.5% United Kingdom Gilt 20470722	1,850,000.000	2,261,440.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20370907	720,000.000	864,792.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20570722	1,100,000.000	1,553,640.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20270722	650,000.000	705,737.500	
		1.625% United Kingdom Gilt 20281022	800,000.000	903,192.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20711022	797,000.000	1,231,683.800	
		1% United Kingdom Gilt 20240422	400,000.000	415,796.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	1,131,426.500	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	1,600,000.000	1,707,472.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	150,000.000	169,455.000	
		8% United Kingdom Gilt 20210607	350,000.000	377,254.500	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	513,000.000	766,770.840	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	900,000.000	1,316,070.000	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	2,075,000.000	2,565,343.250	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	2,265,000.000	3,563,524.500	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	950,000.000	1,658,605.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	850,000.000	1,865,580.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	770,000.000	1,453,144.000	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,100,000.000	1,443,948.000	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	911,000.000	1,659,933.100	

		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	907,500.000	1,334,841.750	
		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	843,000.000	1,671,753.300	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,130,000.000	1,894,332.000	
		4% United Kingdom Gilt 20220307	1,040,000.000	1,112,529.600	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	300,000.000	469,590.000	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	787,000.000	1,773,032.300	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,000,000.000	1,709,600.000	
		3.75% United Kingdom Gilt 20210907	742,000.000	775,901.980	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	700,000.000	1,353,590.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20220907	1,880,000.000	1,954,786.400	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	1,175,000.000	1,852,975.000	
		2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,790,000.000	1,921,135.400	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	798,900.000	1,828,522.320	
		2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,900,000.000	2,123,155.000	
		3.5% United Kingdom Gilt 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 55,879,708.040 (7,495,704,036)	
	イスラエル・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 - Fixed 20230331	3,500,000.000	3,898,510.000	
		5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,200,000.000	2,097,120.000	
		2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	4,000,000.000	4,393,360.000	

	3.75% Israel Government Bond - 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 13,854,856.000 (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 BOND 20291121	2,200,000.000	2,572,306.000	
	2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,100,000.000	2,416,596.000	
	1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	300,000.000	307,962.000	
	1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 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 31,695,924.260 (2,315,704,226)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% Canada Government International Bond 20641201	680,000.000	1,089,026.800	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	907,000.000	1,324,891.180	
	5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,250,000.000	2,030,512.500	
	5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	648,000.000	1,067,793.840	
	4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	770,000.000	1,208,414.900	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	400,000.000	419,624.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	740,000.000	1,145,179.600	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,238,000.000	1,283,372.700	
	2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	230,000.000	249,895.000	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,100,000.000	1,558,469.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,492,000.000	1,631,636.280	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	820,000.000	874,735.000	
	0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	3,959,000.000	3,986,594.230	

		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	930,000.000	967,246.500	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	3,940,000.000	3,958,715.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	600,000.000	672,576.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,100,000.000	1,144,407.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	300,000.000	346,458.000	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,000,000.000	1,072,280.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,469,524.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	600,000.000	641,898.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 28,143,249.530 (2,213,748,008)	
	シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
		3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	203,000.000	239,743.000	
		3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	1,000,000.000	1,061,700.000	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	150,000.000	165,792.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	300,000.000	354,450.000	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	390,000.000	397,363.200	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	89,000.000	113,030.000	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	200,000.000	214,340.000	
		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	120,000.000	153,180.000	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	400,000.000	436,120.000	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	330,000.000	428,010.000	

	2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	200,000.000	217,240.000	
	2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	260,000.000	298,279.800	
	2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	800,000.000	909,040.000	
	2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	300,000.000	355,083.000	
	1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 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 5,569,393.000 (428,063,546)	
スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	1,920,000.000	2,977,420.800	
	3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	12,950,000.000	13,919,307.500	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	4,150,000.000	4,405,972.000	
	2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	2,020,000.000	2,295,568.400	
	1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	2,280,000.000	2,452,482.000	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 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 28,771,116.200 (330,292,414)	
デンマーク・クローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	6,740,000.000	12,643,566.000	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	2,310,000.000	2,426,816.700	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	2,670,000.000	2,859,516.600	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	4,330,000.000	4,863,629.200	

	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	5,200,000.000	5,544,968.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 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 30,703,936.500 (497,096,732)	
ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	1,610,000.000	1,694,315.700	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	1,300,000.000	1,433,965.000	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	150,000.000	160,314.000	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	1,430,000.000	1,522,778.400	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,000,000.000	3,266,160.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	4,000,000.000	4,470,000.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT 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 15,243,758.100 (168,748,402)	
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% Poland Government Bond 20220923	1,200,000.000	1,348,500.000	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	2,640,000.000	2,877,969.600	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	1,520,000.000	1,547,557.600	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	1,815,000.000	1,985,446.650	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	800,000.000	829,992.000	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	3,000,000.000	3,166,140.000	

		2.5% Poland Government Bond 20240425	1,400,000.000	1,502,242.000	
		2.75% Poland Government Bond 20291025	2,300,000.000	2,607,027.000	
		5.75% Poland Government Bond 20290425	600,000.000	826,950.000	
		4% Poland Government Bond 20231025	710,000.000	793,417.900	
		2.75% Poland Government Bond 20280425	1,500,000.000	1,672,875.000	
		3.25% Poland Government Bond 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 21,659,129.650 (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 20300415	1,760,000.000	1,974,984.000	
		3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	1,250,000.000	1,333,162.500	
		3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	600,000.000	632,136.000	
		3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,500,000.000	1,577,520.000	
		3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,150,000.000	1,229,752.500	
		3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,100,000.000	1,137,686.000	
		3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,600,000.000	1,665,952.000	
		4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	1,420,000.000	1,574,765.800	
		3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	2,600,000.000	2,655,900.000	
		4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	2,000,000.000	2,124,300.000	
		4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,000,000.000	1,157,840.000	
		3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	1,000,000.000	1,064,530.000	

	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,200,000.000	1,292,508.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	1,300,000.000	1,360,983.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	700,000.000	714,014.000	
マレーシア・リンギット　小計			マレーシア・リンギット 21,496,033.800 (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 153,494,666.700 (730,634,613)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	690,000.000	755,722.500	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	800,000.000	857,288.000	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	180,000.000	189,907.200	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	270,000.000	346,285.800	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	200,000.000	212,142.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	150,000.000	172,177.500	

		0.5% Finland Government Bond 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 20370622	700,000.000	824,789.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	580,000.000	626,875.600	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	500,000.000	572,545.000	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	700,000.000	764,827.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	650,000.000	827,092.500	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	300,000.000	304,578.000	
		Belgium Government Bond 20271022	3,000,000.000	3,049,110.000	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,955,000.000	2,950,681.500	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	800,000.000	1,180,576.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	896,000.000	1,484,376.320	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	1,660,000.000	2,717,835.000	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	3,270,000.000	5,646,309.000	
		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	690,000.000	1,179,996.600	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	420,000.000	778,583.400	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	2,510,000.000	5,016,184.800	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	606,000.000	1,060,233.360	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	1,542,000.000	1,619,531.760	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	1,648,000.000	2,673,006.560	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,150,000.000	1,218,839.000	

		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,460,000.000	1,586,494.400	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	2,000,000.000	2,181,620.000	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,225,000.000	2,036,133.750	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	990,000.000	1,076,120.100	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	2,000,000.000	2,142,500.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	1,190,000.000	1,256,616.200	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	6,100,000.000	6,635,763.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	883,000.000	941,922.590	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,050,000.000	2,132,164.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	1,150,000.000	1,217,988.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	1,100,000.000	1,188,143.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,260,000.000	1,698,883.200	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	750,000.000	813,150.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	1,900,000.000	2,025,894.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,800,000.000	2,989,504.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	750,000.000	742,350.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,800,000.000	1,815,192.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,500,000.000	1,518,390.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	1,800,000.000	1,828,926.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	150,000.000	153,024.000	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,000,000.000	1,023,900.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	500,000.000	513,265.000	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,415,000.000	4,609,327.950	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	1,000,000.000	1,508,660.000	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	1,700,000.000	2,899,333.000	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,710,000.000	4,527,353.100	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,232,000.000	2,497,572.000	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	1,065,000.000	1,761,382.200	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	1,200,000.000	1,397,460.000	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	2,143,000.000	3,885,923.330	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	650,000.000	1,387,223.500	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,540,000.000	4,360,253.400	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	3,314,000.000	3,486,328.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	1,900,000.000	2,027,357.000	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	1,910,000.000	2,344,104.800	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,195,000.000	2,343,469.800	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	1,190,000.000	1,939,021.700	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	4,730,000.000	5,056,370.000	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	2,200,000.000	2,445,498.000	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	2,686,000.000	3,382,990.140	

		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	1,360,000.000	1,498,896.800	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	4,400,000.000	4,618,064.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	1,500,000.000	1,751,205.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	1,800,000.000	1,897,056.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	1,250,000.000	1,441,037.500	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	900,000.000	1,256,346.000	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,970,000.000	3,085,354.800	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,100,000.000	2,632,938.000	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	1,400,000.000	1,528,072.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,300,000.000	3,118,731.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	1,200,000.000	1,219,116.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	1,500,000.000	1,619,055.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	1,300,000.000	1,494,259.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	2,250,000.000	2,432,182.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	2,700,000.000	2,756,241.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	3,000,000.000	3,029,160.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	500,000.000	616,600.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	2,000,000.000	2,119,320.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	4,200,000.000	4,243,974.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	200,000.000	203,846.000	

		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	580,000.000	843,691.200	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,200,000.000	2,014,752.000	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	1,170,000.000	1,304,070.300	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	830,000.000	1,498,689.500	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,100,000.000	1,145,980.000	
		2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	500,000.000	530,300.000	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	290,000.000	388,663.800	
		1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	750,000.000	805,372.500	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,140,000.000	1,944,555.000	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	480,000.000	531,595.200	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20250715	690,000.000	718,572.900	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20260715	1,170,000.000	1,241,475.300	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20270715	470,000.000	509,968.800	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240115	400,000.000	408,844.000	
		0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280715	600,000.000	655,668.000	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20290715	2,000,000.000	2,103,720.000	
		0.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20400115	250,000.000	273,975.000	
		7.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261101	1,600,000.000	2,211,792.000	
		6.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20271101	1,635,000.000	2,241,029.100	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241201	3,100,000.000	3,338,390.000	

		3.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20460901	705,000.000	829,918.950	
		1.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250601	920,000.000	950,709.600	
		1.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20320301	1,000,000.000	1,007,510.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251201	500,000.000	529,455.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220915	800,000.000	821,584.000	
		2.7% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20470301	2,200,000.000	2,369,114.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230315	1,200,000.000	1,220,364.000	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	1,750,000.000	1,833,230.000	
		0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	2,400,000.000	2,417,136.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	3,000,000.000	3,012,030.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	1,400,000.000	1,496,138.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,300,000.000	1,408,576.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,200,000.000	1,285,800.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,500,000.000	1,527,180.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	350,000.000	426,716.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,550,000.000	1,644,596.500	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	700,000.000	710,234.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	3,200,000.000	3,384,288.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,400,000.000	1,569,470.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	2,500,000.000	2,710,350.000	

		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	500,000.000	594,685.000	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	200,000.000	260,792.000	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,000,000.000	1,141,800.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	200,000.000	212,796.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	2,000,000.000	1,910,300.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20291101	2,040,000.000	2,731,213.200	
		6% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20310501	1,588,000.000	2,289,260.800	
		5.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20330201	1,000,000.000	1,456,390.000	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20340801	1,450,000.000	2,015,732.000	
		4% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20370201	1,270,000.000	1,624,990.400	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20390801	1,640,000.000	2,384,576.400	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20230801	3,870,000.000	4,390,398.900	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20250301	1,700,000.000	2,031,381.000	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20400901	1,714,000.000	2,497,195.160	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20260301	3,250,000.000	3,888,527.500	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20210901	1,320,000.000	1,395,187.200	
		5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220301	780,000.000	844,638.600	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20220901	500,000.000	558,135.000	
		5.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20221101	6,770,000.000	7,603,251.600	
		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20280901	80,000.000	101,637.600	

		4.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20440901	725,000.000	1,051,351.500	
		4.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240301	830,000.000	948,856.000	
		3.75% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20240901	1,610,000.000	1,812,988.800	
		3.5% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20300301	1,370,000.000	1,626,888.700	
		2.15% Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 20211215	700,000.000	721,784.000	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,000,000.000	1,449,120.000	
		5% Belgium Government Bond 20350328	750,000.000	1,268,235.000	
		4% Belgium Government Bond 20220328	550,000.000	595,265.000	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	815,000.000	1,409,795.150	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	700,000.000	899,416.000	
		4.25% Belgium Government Bond 20220928	730,000.000	811,431.500	
		4% Belgium Government Bond 20320328	300,000.000	438,498.000	
		2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,000,000.000	1,085,880.000	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	540,000.000	933,984.000	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	800,000.000	901,208.000	
		3% Belgium Government Bond 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 20270715	380,000.000	558,790.000	
		3.5% Austria Government Bond 20210915	660,000.000	693,567.600	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,110,000.000	1,849,049.100	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	700,000.000	916,244.000	
		3.65% Austria Government Bond 20220420	900,000.000	970,731.000	
		3.4% Austria Government Bond 20221122	860,000.000	944,426.200	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	420,000.000	944,987.400	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	530,000.000	885,259.000	
		1.75% Austria Government Bond 20231020	680,000.000	733,781.200	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	430,000.000	570,906.700	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	880,000.000	965,703.200	
		4% Finland Government Bond 20250704	200,000.000	246,218.000	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	120,000.000	149,655.600	
		1.625% Finland Government Bond 20220915	980,000.000	1,028,902.000	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	210,000.000	320,096.700	
		2% Finland Government Bond 20240415	350,000.000	384,853.000	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	1,420,000.000	2,092,441.000	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	1,400,000.000	1,510,782.000	

		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,610,000.000	2,970,963.000	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	1,365,000.000	1,520,186.850	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,000,000.000	1,109,650.000	
		0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,000,000.000	1,012,920.000	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	689,000.000	926,388.060	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	830,000.000	1,309,574.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	3,249,000.000	3,484,682.460	
		0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	1,250,000.000	1,267,787.500	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,100,000.000	1,197,218.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,320,000.000	1,578,944.400	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	1,170,000.000	1,269,040.500	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,650,000.000	1,787,626.500	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	550,000.000	718,993.000	
		0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	1,500,000.000	1,508,190.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	800,000.000	870,456.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	600,000.000	679,500.000	
		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	1,200,000.000	1,214,304.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,000,000.000	998,150.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	980,000.000	1,560,552.000	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	800,000.000	1,198,304.000	

		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	900,000.000	1,505,250.000	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	2,343,000.000	3,884,131.680	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,000,000.000	1,352,210.000	
		5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	600,000.000	660,828.000	
		5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	4,310,000.000	4,951,371.100	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,588,000.000	1,834,600.520	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	2,100,000.000	2,925,384.000	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	890,000.000	1,605,738.000	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	2,200,000.000	2,536,424.000	
		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,084,000.000	2,342,707.760	
	ユーロ　小計			ユーロ 365,655,369.730 (44,127,290,019)	
国債証券　合計				111,031,651,188 [111,031,651,188]	
合計				111,031,651,188 [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		組入債券時価比率	合計金額に対する比率
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・シュケル	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。

【ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）】

(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】

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	260,831	6,946,818
親投資信託受益証券	10,992,020	55,620,673
流動資産合計	11,252,851	62,567,491
資産合計	11,252,851	62,567,491
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	108,039	－
未払受託者報酬	7,331	356,069
未払委託者報酬	132,580	6,410,037
その他未払費用	2,726	133,475
流動負債合計	250,676	6,899,581
負債合計	250,676	6,899,581
純資産の部		
元本等		
元本	※1 10,803,922	※1 51,714,565
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	198,253	3,953,345
（分配準備積立金）	67,016	695,882
元本等合計	11,002,175	55,667,910
純資産合計	11,002,175	55,667,910
負債純資産合計	11,252,851	62,567,491

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 至　2020年6月15日
営業収益		
受取利息	－	12
有価証券売買等損益	1,119,117	72,485,217
営業収益合計	1,119,117	72,485,229
営業費用		
支払利息	－	1,954
受託者報酬	11,906	565,771
委託者報酬	216,311	10,185,476
その他費用	4,437	212,624
営業費用合計	232,654	10,965,825
営業利益	886,463	61,519,404
経常利益	886,463	61,519,404
当期純利益	886,463	61,519,404
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	787,072	60,823,525
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,760	198,253
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,004,763	419,235,727
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,004,763	419,235,727
剰余金減少額又は欠損金増加額	800,622	416,176,514
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	800,622	416,176,514
分配金	※1　108,039	※1　－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	198,253	3,953,345

(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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2019年6月15日及びその翌日が休日のため、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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1．※1　期首元本額	1,000,000円	10,803,922円
期中追加設定元本額	83,995,237円	9,243,518,976円
期中一部解約元本額	74,191,315円	9,202,608,333円
2．計算期間末日における受益権の総数	10,803,922口	51,714,565口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 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（80,004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（19,222円）、投資信託約款に規定される収益調整金（206,864円）及び分配準備積立金（202円）より分配対象額は306,292円（1万口当たり283.50円）であり、うち108,039円（1万口当たり100円）を分配金額としております。	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（76,510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（619,369円）、投資信託約款に規定される収益調整金（14,101,555円）及び分配準備積立金（3円）より分配対象額は14,797,437円（1万口当たり2,861.37円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第4期 自　2019年6月18日 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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第3期 2019年6月17日現在	第4期 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	101,318	732,260
合計	101,318	732,260

（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 2019年6月17日現在	第4期 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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0184円 (10,184円)	1.0764円 (10,764円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	外国債券インデックスマザーファンド	18,798,389	55,620,673	
親投資信託受益証券　合計			55,620,673	
合計			55,620,673	

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 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

	個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年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ＶＡ	654,072,209円	621,076,448円

ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	22,454,828円	17,810,994円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	147,272,269円	110,163,708円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ(一般投資家私募)	41,724,252円	32,499,022円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ(一般投資家私募)	480,965,798円	357,989,526円
外国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	11,613,534円	61,380,663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）	384,151,534円	461,248,869円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	1,314,828,554円	1,671,366,657円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	773,960,847円	636,150,174円
Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス	2,268,798円	1,079,976円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	69,170円	813,493円
ｉＦｒｅｅ 外国債券インデックス	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クス	43,728,026,780円	46,802,673,697円
ダイワ・ライフ・バランス３０	758,436,363円	779,403,095円
ダイワ・ライフ・バランス５０	377,625,094円	408,565,954円
ダイワ・ライフ・バランス７０	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）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2019年6月18日 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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	2019年6月17日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（円）	2020年6月15日現在 当期間の損益に含まれた評価差額（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 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買　建	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・ドル	23,732,703	－	23,748,000	15,297	20,422,136	－	20,590,440	168,304
スウェーデン・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・クローネ	7,784,257	－	7,784,640	383	－	－	－	－
ノルウェー・クローネ	12,093,167	－	12,120,840	27,673	10,795,217	－	10,871,980	76,763
ポーランド・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・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。

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

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

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

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

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2019年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 Note/Bond 20410815	1,517,000.000	2,217,186.520	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20411115	1,450,000.000	1,948,539.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20420215	1,623,000.000	2,185,077.360	
		3% United States Treasury Note/Bond 20420515	1,353,000.000	1,788,178.920	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20420815	2,231,000.000	2,836,404.160	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20421115	1,630,000.000	2,071,746.300	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20430215	2,626,000.000	3,535,042.420	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20430515	1,898,000.000	2,462,787.860	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20430815	3,214,000.000	4,661,778.440	
		3.75% United States Treasury Note/Bond 20431115	2,081,000.000	3,075,322.610	
		3.625% United States Treasury Note/Bond 20440215	3,707,000.000	5,393,091.880	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20440515	3,327,000.000	4,672,338.990	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20210731	2,834,000.000	2,899,522.080	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240815	6,162,000.000	6,696,307.020	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20440815	1,929,000.000	2,611,750.260	
		2% United States Treasury Note/Bond 20210831	1,301,000.000	1,329,452.870	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,625,000.000	3,713,921.250	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,163,000.000	2,217,572.490	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241115	5,921,000.000	6,426,594.190	
		3% United States Treasury Note/Bond 20441115	3,846,000.000	5,113,526.220	

		1.875% United States Treasury Note/Bond 20211130	2,886,000.000	2,956,678.140	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20211231	3,169,000.000	3,263,309.440	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,527,000.000	2,580,496.590	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250215	5,743,000.000	6,190,322.270	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20450215	2,563,000.000	3,137,265.780	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,809,000.000	3,909,557.600	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,891,000.000	2,970,039.940	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20250515	5,788,000.000	6,292,134.800	
		3% United States Treasury Note/Bond 20450515	2,835,000.000	3,779,395.200	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220430	2,612,000.000	2,688,296.520	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220531	1,326,000.000	1,369,651.920	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20220630	2,821,000.000	2,931,837.090	
		2% United States Treasury Note/Bond 20220731	4,179,000.000	4,338,972.120	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	5,743,000.000	6,224,378.260	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20450815	3,873,000.000	5,066,348.760	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220831	2,445,000.000	2,535,342.750	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,472,000.000	2,560,448.160	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	5,840,000.000	6,422,598.400	
		3% United States Treasury Note/Bond 20451115	709,000.000	949,393.540	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,558,000.000	2,659,117.740	

		2% United States Treasury Note/Bond 20221130	6,287,000.000	6,564,005.220	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20221231	4,992,000.000	5,234,561.280	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	4,366,000.000	4,660,006.440	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20230131	2,561,000.000	2,664,438.790	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	3,648,000.000	4,484,741.760	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230228	2,962,000.000	3,064,485.200	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	3,623,000.000	3,753,754.070	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260515	3,729,000.000	3,987,680.730	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,070,000.000	2,153,917.800	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460515	3,423,000.000	4,216,143.330	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,603,700.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,500,000.000	2,524,400.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230630	3,000,000.000	3,105,450.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20260815	5,400,000.000	5,739,174.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20460815	3,480,000.000	4,096,864.800	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,700,000.000	3,741,625.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210731	3,700,000.000	3,738,998.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20230731	2,780,000.000	2,868,821.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230831	2,400,000.000	2,487,744.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230930	2,505,000.000	2,599,714.050	

		1.125% United States Treasury Note/Bond 20210930	3,042,000.000	3,078,595.260	
		2% United States Treasury Note/Bond 20261115	5,300,000.000	5,808,429.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20211031	3,000,000.000	3,045,690.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20231031	2,500,000.000	2,616,975.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20461115	3,500,000.000	4,621,470.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,490,000.000	2,651,850.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20211130	3,400,000.000	3,477,826.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20211231	4,000,000.000	4,111,680.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,677,125.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270215	6,140,000.000	6,843,214.200	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220131	3,010,000.000	3,092,293.400	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240131	2,480,000.000	2,659,006.400	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470215	3,545,000.000	4,795,427.850	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220228	3,010,000.000	3,096,748.200	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240229	2,300,000.000	2,458,838.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240331	4,550,000.000	4,869,546.500	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220331	2,900,000.000	2,987,000.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	6,400,000.000	7,205,952.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20470515	3,500,000.000	4,736,725.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220430	3,000,000.000	3,094,080.000	

		2% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,000,000.000	3,200,130.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220531	3,000,000.000	3,090,210.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240531	3,800,000.000	4,058,248.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220630	3,000,000.000	3,094,680.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20240630	2,400,000.000	2,566,488.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20270815	5,900,000.000	6,610,714.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220731	2,900,000.000	3,003,298.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,000,000.000	3,228,030.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20470815	3,450,000.000	4,477,168.500	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20220831	3,200,000.000	3,300,224.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20240831	2,000,000.000	2,132,800.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20220930	2,500,000.000	2,595,875.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20240930	2,500,000.000	2,695,875.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20221031	2,500,000.000	2,606,425.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20271115	5,500,000.000	6,177,160.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20471115	3,500,000.000	4,544,505.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241031	3,500,000.000	3,797,500.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,200,000.000	3,458,496.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,800,000.000	3,044,552.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20230131	3,500,000.000	3,699,325.000	

		2.75% United States Treasury Note/Bond 20280215	5,650,000.000	6,575,187.500	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230228	3,300,000.000	3,515,523.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20250131	2,600,000.000	2,861,196.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250228	2,700,000.000	3,006,477.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480215	3,800,000.000	5,165,150.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20230331	2,900,000.000	3,084,875.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20250331	2,900,000.000	3,217,173.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20480515	4,200,000.000	5,844,048.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280515	6,500,000.000	7,652,710.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230430	2,500,000.000	2,681,625.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250430	1,900,000.000	2,133,928.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250531	3,550,000.000	3,992,614.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230531	2,500,000.000	2,686,700.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20210615	3,000,000.000	3,073,230.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20230630	2,500,000.000	2,682,025.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250630	3,000,000.000	3,360,000.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20210715	3,300,000.000	3,386,724.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230731	3,850,000.000	4,153,457.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20280815	6,700,000.000	7,916,452.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20480815	4,220,000.000	5,759,793.600	

		2.75% United States Treasury Note/Bond 20210815	2,500,000.000	2,574,500.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20250731	2,500,000.000	2,820,100.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20230831	3,600,000.000	3,890,520.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20250831	3,600,000.000	4,043,232.000	
		2.75% United States Treasury Note/Bond 20210915	3,500,000.000	3,611,965.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20250930	2,500,000.000	2,844,725.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20230930	3,000,000.000	3,258,750.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20211015	3,000,000.000	3,107,220.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20251031	2,500,000.000	2,848,625.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231031	4,000,000.000	4,353,120.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20211115	4,000,000.000	4,152,320.000	
		3.125% United States Treasury Note/Bond 20281115	4,900,000.000	5,910,233.000	
		3.375% United States Treasury Note/Bond 20481115	4,520,000.000	6,597,753.600	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20251130	3,000,000.000	3,402,420.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20231130	2,000,000.000	2,180,920.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20211215	2,800,000.000	2,902,032.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20251231	3,500,000.000	3,925,985.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20231231	2,500,000.000	2,708,975.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20220115	3,000,000.000	3,108,840.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20290215	6,600,000.000	7,715,796.000	

		2.5% United States Treasury Note/Bond 20220215	3,000,000.000	3,114,480.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20240131	4,000,000.000	4,323,720.000	
		2.625% United States Treasury Note/Bond 20260131	2,500,000.000	2,808,375.000	
		3% United States Treasury Note/Bond 20490215	4,700,000.000	6,444,123.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20260228	2,500,000.000	2,794,125.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	3,300,000.000	3,558,060.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20220315	3,500,000.000	3,632,720.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20260331	2,500,000.000	2,761,125.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20220415	3,700,000.000	3,838,602.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20220515	3,400,000.000	3,524,950.000	
		2.875% United States Treasury Note/Bond 20490515	4,650,000.000	6,245,508.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20290515	3,900,000.000	4,489,251.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20240430	3,500,000.000	3,767,400.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20260430	2,800,000.000	3,115,420.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220615	3,500,000.000	3,608,395.000	
		2.125% United States Treasury Note/Bond 20260531	3,000,000.000	3,297,180.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240630	3,500,000.000	3,707,515.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20210630	2,700,000.000	2,740,392.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260630	2,800,000.000	3,037,104.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20220715	4,000,000.000	4,128,560.000	

		1.75% United States Treasury Note/Bond 20210731	4,700,000.000	4,782,579.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20240731	3,500,000.000	3,710,805.000	
		1.875% United States Treasury Note/Bond 20260731	2,500,000.000	2,714,050.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20290815	6,900,000.000	7,498,851.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220815	3,500,000.000	3,598,560.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20490815	4,600,000.000	5,485,500.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20210831	3,100,000.000	3,149,042.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20260831	2,800,000.000	2,955,960.000	
		1.25% United States Treasury Note/Bond 20240831	4,000,000.000	4,160,920.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20220915	3,000,000.000	3,087,990.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20210930	5,100,000.000	5,186,241.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260930	2,500,000.000	2,678,125.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20240930	3,000,000.000	3,154,200.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20221015	2,900,000.000	2,978,706.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241031	1,000,000.000	1,052,100.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20211031	2,550,000.000	2,595,900.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261031	3,000,000.000	3,214,920.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20291115	6,450,000.000	7,091,968.500	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20491115	4,500,000.000	5,517,045.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20211130	1,500,000.000	1,528,650.000	

		1.625% United States Treasury Note/Bond 20261130	2,000,000.000	2,144,060.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20241130	3,000,000.000	3,159,120.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20221215	3,000,000.000	3,106,740.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20261231	2,500,000.000	2,701,950.000	
		1.75% United States Treasury Note/Bond 20241231	2,500,000.000	2,662,300.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20211231	1,500,000.000	1,533,105.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20230115	4,000,000.000	4,132,960.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20250131	4,700,000.000	4,928,373.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20220131	2,500,000.000	2,547,925.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20230215	2,250,000.000	2,320,042.500	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20300215	3,600,000.000	3,875,040.000	
		1.5% United States Treasury Note/Bond 20270131	3,200,000.000	3,407,744.000	
		2% United States Treasury Note/Bond 20500215	4,000,000.000	4,546,240.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20220228	200,000.000	203,178.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20270228	300,000.000	312,162.000	
		1.125% United States Treasury Note/Bond 20250228	200,000.000	207,608.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20230315	200,000.000	201,584.000	
		0.5% United States Treasury Note/Bond 20250331	200,000.000	201,656.000	
		0.375% United States Treasury Note/Bond 20220331	200,000.000	200,648.000	
		0.25% United States Treasury 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 813,593,781.120 (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 20240422	2,600,000.000	2,702,674.000	
		1.75% United Kingdom Gilt 20490122	930,000.000	1,208,442.000	
		1.625% United Kingdom Gilt 20541022	850,000.000	1,131,426.500	
		0.875% United Kingdom Gilt 20291022	2,100,000.000	2,241,057.000	
		0.625% United Kingdom Gilt 20250607	2,600,000.000	2,680,756.000	
		1.25% United Kingdom Gilt 20411022	90,000.000	101,673.000	
		0.125% United Kingdom Gilt 20230131	500,000.000	501,570.000	
		0.375% United Kingdom Gilt 20301022	500,000.000	506,850.000	
		0.5% United Kingdom Gilt 20611022	50,000.000	50,240.000	
		8% United Kingdom Gilt 20210607	1,102,000.000	1,187,812.740	
		6% United Kingdom Gilt 20281207	949,000.000	1,418,451.320	
		4.25% United Kingdom Gilt 20320607	1,340,000.000	1,959,482.000	
		5% United Kingdom Gilt 20250307	1,472,000.000	1,819,848.320	
		4.25% United Kingdom Gilt 20360307	1,912,000.000	3,008,149.600	
		4.75% United Kingdom Gilt 20381207	1,257,000.000	2,194,596.300	
		4.25% United Kingdom Gilt 20551207	1,608,000.000	3,529,238.400	
		4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,666,000.000	3,144,075.200	
		4.25% United Kingdom Gilt 20271207	1,232,000.000	1,617,221.760	
		4.5% United Kingdom Gilt 20421207	1,816,000.000	3,308,933.600	
		4.75% United Kingdom Gilt 20301207	1,830,000.000	2,691,747.000	

		4.25% United Kingdom Gilt 20491207	1,343,000.000	2,663,303.300	
		4.25% United Kingdom Gilt 20390907	1,446,000.000	2,424,074.400	
		4% United Kingdom Gilt 20220307	1,382,000.000	1,478,380.680	
		4.5% United Kingdom Gilt 20340907	1,260,000.000	1,972,278.000	
		4% United Kingdom Gilt 20600122	1,574,000.000	3,546,064.600	
		4.25% United Kingdom Gilt 20401207	1,577,000.000	2,696,039.200	
		3.75% United Kingdom Gilt 20210907	803,000.000	839,689.070	
		3.75% United Kingdom Gilt 20520722	1,552,000.000	3,001,102.400	
		1.75% United Kingdom Gilt 20220907	2,242,000.000	2,331,186.760	
		3.25% United Kingdom Gilt 20440122	2,166,000.000	3,415,782.000	
		2.25% United Kingdom Gilt 20230907	1,582,000.000	1,697,897.320	
		3.5% United Kingdom Gilt 20680722	1,586,000.000	3,630,036.800	
		2.75% United Kingdom Gilt 20240907	1,092,000.000	1,220,255.400	
		3.5% United Kingdom Gilt 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 95,465,437.490 (12,805,733,784)	
	イスラエル・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 - Fixed 20261030	1,500,000.000	2,043,720.000	
		5.5% Israel Government Bond - Fixed 20220131	2,000,000.000	2,177,100.000	
		4.25% Israel Government Bond - Fixed 20230331	1,800,000.000	2,004,948.000	
		5.5% Israel Government Bond - Fixed 20420131	1,900,000.000	3,320,440.000	

		3.75% Israel Government Bond - Fixed 20240331	1,500,000.000	1,698,885.000	
		1.75% Israel Government Bond - Fixed 20250831	1,900,000.000	2,034,311.000	
		2% Israel Government Bond - Fixed 20270331	1,800,000.000	1,977,012.000	
		1.25% Israel Government Bond - Fixed 20221130	1,000,000.000	1,028,060.000	
		3.75% Israel Government Bond - Fixed 20470331	1,500,000.000	2,155,185.000	
		2.25% Israel Government Bond - Fixed 20280928	1,500,000.000	1,694,670.000	
		1.5% Israel Government Bond - Fixed 20231130	1,500,000.000	1,566,540.000	
		0.75% Israel Government Bond - Fixed 20220731	1,000,000.000	1,013,790.000	
		1% Israel Government Bond - 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 23,534,293.000 (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 BOND 20220715	2,162,000.000	2,407,581.580	
		5.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20230421	3,568,000.000	4,099,275.200	
		4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	2,789,000.000	3,564,063.100	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20240421	2,473,000.000	2,704,645.910	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,504,000.000	3,019,172.960	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	2,498,000.000	2,843,298.540	
		4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	1,258,000.000	1,781,541.860	
		4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20260421	2,948,000.000	3,590,133.360	

		3.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20370421	1,113,000.000	1,507,302.510	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20350621	1,007,000.000	1,215,177.110	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20390621	792,000.000	1,015,439.040	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20271121	2,672,000.000	3,071,757.920	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20280521	2,678,000.000	2,986,880.520	
		3% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20470321	1,152,000.000	1,462,625.280	
		2% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20211221	800,000.000	820,896.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20281121	2,300,000.000	2,665,424.000	
		2.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20221121	1,550,000.000	1,625,051.000	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20291121	2,600,000.000	3,039,998.000	
		2.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20300521	2,470,000.000	2,842,377.200	
		2.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20410521	990,000.000	1,186,158.600	
		1.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20310621	2,840,000.000	2,995,149.200	
		1.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20320521	500,000.000	513,270.000	
		0.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20241121	2,400,000.000	2,388,840.000	
		1% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 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 55,554,990.890 (4,058,847,635)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	カナダ・ドル	
		2.75% Canada Government International Bond 20641201	405,000.000	648,611.550	
		8% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	586,000.000	889,665.200	

		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	983,000.000	1,435,907.420	
		5.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20330601	1,117,000.000	1,814,465.970	
		5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20370601	1,012,000.000	1,667,603.960	
		4% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20410601	1,363,000.000	2,139,051.310	
		3.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210601	956,000.000	984,670.440	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	1,751,000.000	1,836,904.060	
		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,461,000.000	2,260,955.940	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	1,253,000.000	1,298,922.450	
		2.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240601	1,405,000.000	1,526,532.500	
		2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20481201	1,337,000.000	1,894,248.230	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	1,156,000.000	1,264,190.040	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	969,000.000	1,033,680.750	
		0.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210901	2,480,000.000	2,497,285.600	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,240,000.000	1,289,662.000	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220301	1,440,000.000	1,446,840.000	
		1% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220901	1,750,000.000	1,778,962.500	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20280601	1,200,000.000	1,345,152.000	
		1.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230301	2,100,000.000	2,184,777.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230901	1,000,000.000	1,055,330.000	
		2% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20511201	1,390,000.000	1,739,557.200	

		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20290601	1,220,000.000	1,408,929.200	
		2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240301	1,200,000.000	1,286,736.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20240901	1,400,000.000	1,469,524.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20210801	400,000.000	406,024.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20300601	1,350,000.000	1,444,270.500	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20211101	800,000.000	811,672.000	
		1.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250301	1,600,000.000	1,668,560.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220201	1,100,000.000	1,122,957.000	
		1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220501	5,000.000	5,118.350	
		0.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250901	1,500,000.000	1,511,835.000	
		0.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,500,000.000	1,499,355.000	
	カナダ・ドル　小計			カナダ・ドル 46,667,957.170 (3,670,901,511)	
	シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
		3.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20270301	772,000.000	911,732.000	
		3.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20220901	438,000.000	465,024.600	
		3% SINGAPORE GOVERNMENT 20240901	623,000.000	688,589.440	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20300901	359,000.000	424,158.500	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20210601	495,000.000	504,345.600	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20420401	400,000.000	508,000.000	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230701	671,000.000	719,110.700	

		3.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20330901	568,000.000	725,052.000	
		2.875% SINGAPORE GOVERNMENT 20290701	625,000.000	729,618.750	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20250601	524,000.000	571,317.200	
		2.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20460301	688,000.000	892,336.000	
		2.125% SINGAPORE GOVERNMENT 20260601	250,000.000	271,550.000	
		1.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20211001	460,000.000	465,740.800	
		1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20220401	500,000.000	513,060.000	
		2.25% SINGAPORE GOVERNMENT 20360801	500,000.000	573,615.000	
		1.75% SINGAPORE GOVERNMENT 20230201	450,000.000	466,425.000	
		2.625% SINGAPORE GOVERNMENT 20280501	550,000.000	624,965.000	
		2% SINGAPORE GOVERNMENT 20240201	490,000.000	518,077.000	
		2.375% SINGAPORE GOVERNMENT 20390701	150,000.000	177,541.500	
		1.875% SINGAPORE GOVERNMENT 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 10,976,281.090 (843,636,964)	
	スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
		3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20390330	4,255,000.000	6,598,398.700	
		3.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20220601	8,465,000.000	9,098,605.250	
		1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	8,025,000.000	8,519,982.000	
		2.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20250512	5,595,000.000	6,358,269.900	
		1% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20261112	5,680,000.000	6,109,692.000	

	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20280512	4,550,000.000	4,853,985.500	
	0.75% SWEDISH GOVERNMENT BOND 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 46,578,132.350 (534,716,960)	
デンマーク・クローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	12,662,000.000	23,752,645.800	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	7,550,000.000	7,931,803.500	
	1.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20231115	4,846,000.000	5,189,969.080	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	6,013,000.000	6,754,042.120	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20271115	7,900,000.000	8,424,086.000	
	0.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20291115	7,590,000.000	8,160,768.000	
	0.25% DANISH GOVERNMENT BOND 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 61,028,938.500 (988,058,514)	
ノルウェー・クローネ		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	8,204,000.000	8,633,643.480	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	4,095,000.000	4,516,989.750	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20250313	3,395,000.000	3,628,440.200	
	1.5% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20260219	3,340,000.000	3,556,699.200	
	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20270217	3,450,000.000	3,756,084.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20280426	3,500,000.000	3,911,250.000	

	1.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20290906	3,250,000.000	3,606,980.000	
	1.375% NORWEGIAN GOVERNMENT 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 35,924,046.630 (397,679,196)	
ポーランド・ズロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	
	5.75% Poland Government Bond 20220923	2,309,000.000	2,594,738.750	
	2.5% Poland Government Bond 20260725	4,377,000.000	4,771,542.780	
	1.75% Poland Government Bond 20210725	3,051,000.000	3,106,314.630	
	2.5% Poland Government Bond 20270725	3,170,000.000	3,467,694.700	
	2.25% Poland Government Bond 20220425	2,320,000.000	2,406,976.800	
	2.5% Poland Government Bond 20230125	2,850,000.000	3,007,833.000	
	2.5% Poland Government Bond 20240425	2,870,000.000	3,079,596.100	
	2.75% Poland Government Bond 20291025	3,340,000.000	3,785,856.600	
	2.25% Poland Government Bond 20241025	2,400,000.000	2,560,824.000	
	Poland Government Bond 20220725	1,500,000.000	1,491,510.000	
	5.75% Poland Government Bond 20290425	827,000.000	1,139,812.750	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	1,684,000.000	1,812,691.280	
	4% Poland Government Bond 20231025	2,625,000.000	2,933,411.250	
	2.75% Poland Government Bond 20280425	2,750,000.000	3,066,937.500	
	3.25% Poland Government Bond 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 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 20270531	1,273,000.000	1,332,410.910	
	5.248% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280915	738,000.000	857,511.720	
	4.498% MALAYSIAN GOVERNMENT 20300415	1,178,000.000	1,321,892.700	
	4.16% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210715	916,000.000	936,518.400	
	4.392% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260415	1,514,000.000	1,649,139.640	
	4.232% MALAYSIAN GOVERNMENT 20310630	1,300,000.000	1,428,999.000	
	3.418% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220815	875,000.000	896,840.000	
	3.892% MALAYSIAN GOVERNMENT 20270315	731,000.000	779,633.430	
	4.127% MALAYSIAN GOVERNMENT 20320415	618,000.000	671,864.880	
	3.48% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230315	1,001,000.000	1,030,919.890	
	3.844% MALAYSIAN GOVERNMENT 20330415	1,427,000.000	1,503,430.120	
	3.733% MALAYSIAN GOVERNMENT 20280615	1,186,000.000	1,247,292.480	
	4.935% MALAYSIAN GOVERNMENT 20430930	600,000.000	702,504.000	
	4.181% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240715	1,057,000.000	1,122,111.200	
	4.048% MALAYSIAN GOVERNMENT 20210930	857,000.000	878,322.160	
	3.955% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250915	1,737,000.000	1,857,460.950	
	3.795% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220930	1,161,000.000	1,200,775.860	
	4.254% MALAYSIAN GOVERNMENT 20350531	1,220,000.000	1,335,412.000	
	3.8% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230817	1,302,000.000	1,355,668.440	

	4.736% MALAYSIAN GOVERNMENT 20460315	930,000.000	1,031,360.700	
	3.9% MALAYSIAN GOVERNMENT 20261130	650,000.000	695,123.000	
	3.62% MALAYSIAN GOVERNMENT 20211130	352,000.000	359,568.000	
	3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20220310	1,600,000.000	1,646,656.000	
	4.059% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240930	750,000.000	796,612.500	
	3.899% MALAYSIAN GOVERNMENT 20271116	890,000.000	951,374.400	
	4.762% MALAYSIAN GOVERNMENT 20370407	1,050,000.000	1,215,732.000	
	3.882% MALAYSIAN GOVERNMENT 20250314	1,200,000.000	1,266,288.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20230420	800,000.000	830,616.000	
	4.642% MALAYSIAN GOVERNMENT 20331107	700,000.000	794,493.000	
	4.893% MALAYSIAN GOVERNMENT 20380608	600,000.000	703,770.000	
	3.906% MALAYSIAN GOVERNMENT 20260715	650,000.000	691,944.500	
	3.885% MALAYSIAN GOVERNMENT 20290815	1,910,000.000	2,057,241.900	
	4.921% MALAYSIAN GOVERNMENT 20480706	1,000,000.000	1,140,640.000	
	3.478% MALAYSIAN GOVERNMENT 20240614	400,000.000	413,748.000	
	3.828% MALAYSIAN GOVERNMENT 20340705	800,000.000	837,528.000	
	3.757% MALAYSIAN GOVERNMENT 20400522	1,000,000.000	1,020,020.000	
マレーシア・リンギット　小計			マレーシア・リンギット 38,561,423.780 (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 307,978,585.560 (1,465,978,067)	
ユーロ		ユーロ	ユーロ	
	0.75% Finland Government Bond 20310415	414,000.000	453,433.500	
	0.875% Finland Government Bond 20250915	279,000.000	298,979.190	
	0.5% Finland Government Bond 20260415	1,111,000.000	1,172,149.440	
	Finland Government Bond 20230915	200,000.000	203,662.000	
	1.375% Finland Government Bond 20470415	360,000.000	461,714.400	
	Finland Government Bond 20220415	770,000.000	778,085.000	
	0.5% Finland Government Bond 20270915	800,000.000	848,568.000	
	1.125% Finland Government Bond 20340415	370,000.000	424,704.500	
	0.5% Finland Government Bond 20280915	500,000.000	531,975.000	
	0.5% Finland Government Bond 20290915	500,000.000	532,655.000	
	Finland Government Bond 20240915	200,000.000	204,518.000	

		0.125% Finland Government Bond 20360415	310,000.000	310,213.900	
		1.2% Austria Government Bond 20251020	873,000.000	952,512.840	
		0.75% Austria Government Bond 20261020	1,126,000.000	1,209,718.100	
		1.5% Austria Government Bond 20470220	634,000.000	819,108.980	
		1.5% Austria Government Bond 20861102	240,000.000	346,677.600	
		Austria Government Bond 20230715	900,000.000	915,849.000	
		0.5% Austria Government Bond 20270420	780,000.000	826,815.600	
		2.1% Austria Government Bond 21170920	490,000.000	921,528.300	
		Austria Government Bond 20220920	400,000.000	405,404.000	
		0.75% Austria Government Bond 20280220	900,000.000	973,404.000	
		0.5% Austria Government Bond 20290220	980,000.000	1,042,651.400	
		Austria Government Bond 20240715	800,000.000	817,808.000	
		Austria Government Bond 20300220	680,000.000	690,546.800	
		Austria Government Bond 20230420	1,000,000.000	1,016,400.000	
		0.75% Austria Government Bond 20510320	700,000.000	768,768.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	1,399,000.000	1,486,675.330	
		1% Belgium Government Bond 20310622	1,074,000.000	1,189,830.900	
		1.9% Belgium Government Bond 20380622	758,000.000	954,337.160	
		1% Belgium Government Bond 20260622	1,283,000.000	1,387,821.100	
		1.6% Belgium Government Bond 20470622	1,244,000.000	1,534,884.520	

		2.15% Belgium Government Bond 20660622	640,000.000	980,249.600	
		0.2% Belgium Government Bond 20231022	490,000.000	502,455.800	
		0.8% Belgium Government Bond 20270622	1,400,000.000	1,505,392.000	
		0.5% Belgium Government Bond 20241022	1,050,000.000	1,095,580.500	
		2.25% Belgium Government Bond 20570622	460,000.000	685,975.000	
		1.45% Belgium Government Bond 20370622	400,000.000	471,308.000	
		0.8% Belgium Government Bond 20280622	1,340,000.000	1,448,298.800	
		1.25% Belgium Government Bond 20330422	550,000.000	629,799.500	
		0.9% Belgium Government Bond 20290622	1,200,000.000	1,311,132.000	
		1.7% Belgium Government Bond 20500622	600,000.000	763,470.000	
		0.1% Belgium Government Bond 20300622	1,220,000.000	1,238,617.200	
		0.4% Belgium Government Bond 20400622	660,000.000	646,423.800	
		Belgium Government Bond 20271022	1,200,000.000	1,219,644.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240104	974,000.000	1,216,720.800	
		6.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270704	1,167,000.000	1,761,353.100	
		5.625% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280104	1,362,000.000	2,009,930.640	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280704	950,000.000	1,363,022.000	
		6.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20300104	951,000.000	1,575,493.170	
		5.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20310104	3,448,000.000	5,645,238.000	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20340704	1,405,000.000	2,426,013.500	

		4% GERMAN GOVERNMENT BOND 20370104	3,571,000.000	6,106,909.940	
		4.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20390704	1,325,000.000	2,456,245.250	
		4.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20400704	1,439,000.000	2,875,812.720	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20420704	2,874,000.000	5,028,235.440	
		3.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210704	1,674,000.000	1,742,466.600	
		2.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20210904	1,415,000.000	1,465,034.400	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220104	1,807,000.000	1,883,616.800	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220704	2,222,000.000	2,333,722.160	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20440704	2,508,000.000	4,067,900.760	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20220904	1,644,000.000	1,724,687.520	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	1,410,000.000	1,494,402.600	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230515	1,817,000.000	1,935,413.890	
		2% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230815	1,599,000.000	1,737,537.360	
		1.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240215	1,561,000.000	1,702,754.410	
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	2,679,000.000	4,452,899.850	
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,594,000.000	1,732,662.060	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20240815	1,542,000.000	1,651,867.500	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250215	2,194,000.000	2,316,820.120	
		1% GERMAN GOVERNMENT BOND 20250815	2,134,000.000	2,321,429.220	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20260215	2,368,000.000	2,526,016.640	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20260815	2,420,000.000	2,516,993.600	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270215	6,200,000.000	6,566,544.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20270815	2,300,000.000	2,484,299.000	
		1.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20480815	1,750,000.000	2,359,560.000	
		0.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280215	1,900,000.000	2,059,980.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20280815	4,400,000.000	4,691,544.000	
		0.25% GERMAN GOVERNMENT BOND 20290215	2,200,000.000	2,348,896.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20290815	1,900,000.000	1,985,215.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20500815	1,050,000.000	1,039,290.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20300215	1,050,000.000	1,096,294.500	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20350515	700,000.000	722,722.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20271115	500,000.000	521,045.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210611	100,000.000	100,647.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20210910	500,000.000	504,055.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20211210	800,000.000	808,024.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20220311	300,000.000	303,483.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20211008	1,400,000.000	1,411,816.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20220408	1,160,000.000	1,174,221.600	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20221007	2,100,000.000	2,133,747.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20230414	5,730,000.000	5,845,516.800	

		GERMAN GOVERNMENT BOND 20231013	1,900,000.000	1,945,410.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20240405	1,920,000.000	1,970,937.600	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20241018	1,700,000.000	1,750,473.000	
		GERMAN GOVERNMENT BOND 20250411	2,400,000.000	2,478,240.000	
		8.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230425	1,985,000.000	2,503,879.000	
		6% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251025	3,025,000.000	4,082,933.250	
		5.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290425	3,323,000.000	5,013,277.180	
		5.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20321025	2,927,000.000	4,991,969.230	
		4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	2,659,000.000	4,442,151.990	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20550425	1,514,000.000	3,069,256.500	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20381025	2,374,000.000	3,926,311.120	
		4.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20231025	4,097,000.000	4,771,161.350	
		4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	3,764,000.000	6,825,298.840	
		4% FRENCH GOVERNMENT BOND 20600425	1,287,000.000	2,746,702.530	
		3.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260425	3,146,000.000	3,874,959.660	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20211025	4,150,000.000	4,365,800.000	
		3% FRENCH GOVERNMENT BOND 20220425	3,630,000.000	3,873,318.900	
		2.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20271025	3,699,000.000	4,539,708.720	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20221025	2,694,000.000	2,876,222.160	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	2,588,000.000	4,216,964.840	

		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20230525	3,347,000.000	3,577,943.000	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	3,086,000.000	3,430,366.740	
		2.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20300525	4,387,000.000	5,525,382.630	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20241125	3,899,000.000	4,297,204.870	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20250525	3,492,000.000	3,665,063.520	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20251125	3,101,000.000	3,345,979.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20310525	4,420,000.000	5,160,217.400	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20260525	3,287,000.000	3,464,235.040	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20360525	2,969,000.000	3,422,752.270	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20660525	1,087,000.000	1,517,386.780	
		0.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20261125	2,800,000.000	2,908,752.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20220525	4,000,000.000	4,046,840.000	
		1.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20390625	2,170,000.000	2,720,702.600	
		1% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270525	3,400,000.000	3,711,032.000	
		2% FRENCH GOVERNMENT BOND 20480525	2,300,000.000	3,118,731.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20230325	2,400,000.000	2,438,232.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20280525	3,400,000.000	3,669,858.000	
		1.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20340525	3,950,000.000	4,540,248.500	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20281125	3,150,000.000	3,405,055.500	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20240325	3,400,000.000	3,470,822.000	

		FRENCH GOVERNMENT BOND 20220225	1,400,000.000	1,413,608.000	
		1.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20500525	2,500,000.000	3,083,000.000	
		0.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20290525	5,250,000.000	5,563,215.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20250325	3,130,000.000	3,202,209.100	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20291125	2,300,000.000	2,324,081.000	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20230225	2,400,000.000	2,436,288.000	
		0.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20520525	1,370,000.000	1,396,345.100	
		FRENCH GOVERNMENT BOND 20260225	3,000,000.000	3,067,200.000	
		7.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	548,000.000	664,559.600	
		5.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20280115	1,139,000.000	1,656,834.960	
		4% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20370115	1,485,000.000	2,493,255.600	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230115	791,000.000	881,640.690	
		3.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20420115	1,779,000.000	3,212,251.350	
		3.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20210715	1,463,000.000	1,524,153.400	
		2.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20220715	1,438,000.000	1,525,142.800	
		2.5% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20330115	1,168,000.000	1,565,376.960	
		1.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20230715	1,385,000.000	1,487,254.550	
		2.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20470115	1,579,000.000	2,693,379.250	
		2% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20240715	1,514,000.000	1,676,739.860	
		0.25% NETHERLANDS GOVERNMENT 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 20260601	1,786,000.000	1,851,439.040	
		0.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20210601	1,674,000.000	1,681,181.460	
		2.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360901	1,324,000.000	1,386,969.440	
		1.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20261201	1,068,000.000	1,082,161.680	
		0.65% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231015	1,550,000.000	1,561,067.000	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211101	1,358,000.000	1,363,445.580	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20670301	968,000.000	1,034,472.560	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20330901	1,500,000.000	1,625,280.000	
		2.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270601	1,510,000.000	1,617,965.000	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240515	1,300,000.000	1,362,140.000	
		1.2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220401	1,250,000.000	1,272,650.000	
		3.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20480301	1,850,000.000	2,255,501.500	
		2.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270801	1,700,000.000	1,803,751.000	
		0.9% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220801	1,700,000.000	1,724,854.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20241115	1,600,000.000	1,651,744.000	
		2.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20380901	1,300,000.000	1,474,005.000	
		2% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20280201	2,100,000.000	2,220,939.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230301	1,900,000.000	1,932,129.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250515	1,300,000.000	1,339,806.000	
		2.8% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20281201	1,550,000.000	1,737,627.500	

		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20231001	1,400,000.000	1,491,140.000	
		2.5% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20251115	1,550,000.000	1,680,417.000	
		2.3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20211015	1,200,000.000	1,235,676.000	
		3.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20350301	1,270,000.000	1,510,499.900	
		3.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20490901	1,250,000.000	1,629,950.000	
		1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	1,550,000.000	1,575,404.500	
		3% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20290801	1,900,000.000	2,169,420.000	
		1.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20240701	2,200,000.000	2,296,668.000	
		2.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20260715	1,600,000.000	1,702,368.000	
		3.1% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20400301	850,000.000	981,189.000	
		1.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300401	1,900,000.000	1,890,367.000	
		0.05% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230115	740,000.000	735,441.600	
		0.35% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250201	1,100,000.000	1,080,717.000	
		0.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20270115	2,350,000.000	2,316,066.000	
		2.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20500901	1,200,000.000	1,216,308.000	
		1.45% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20360301	1,500,000.000	1,416,810.000	
		0.6% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20230615	2,000,000.000	2,012,740.000	
		1.85% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20250701	2,300,000.000	2,411,090.000	
		0.95% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20300801	1,500,000.000	1,432,725.000	
		5.25% Italy Buoni Poliennali 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 Del Tesoro 20211215	1,593,000.000	1,642,574.160	
		5.5% Belgium Government Bond 20280328	1,706,000.000	2,472,198.720	
		5% Belgium Government Bond 20350328	2,104,000.000	3,557,821.920	
		4% Belgium Government Bond 20220328	877,000.000	949,177.100	
		4.25% Belgium Government Bond 20410328	1,604,000.000	2,774,615.240	
		4.25% Belgium Government Bond 20210928	1,446,000.000	1,535,521.860	
		4.5% Belgium Government Bond 20260328	1,001,000.000	1,286,164.880	
		4.25% Belgium Government Bond 20220928	1,316,000.000	1,462,799.800	
		4% Belgium Government Bond 20320328	780,000.000	1,140,094.800	
		2.25% Belgium Government Bond 20230622	1,338,000.000	1,452,907.440	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	843,000.000	1,458,052.800	
		2.6% Belgium Government Bond 20240622	1,505,000.000	1,695,397.550	
		3% Belgium Government Bond 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 20270715	825,000.000	1,213,162.500	
		3.5% Austria Government Bond 20210915	1,337,000.000	1,404,999.820	
		4.15% Austria Government Bond 20370315	1,273,000.000	2,120,576.130	
		4.85% Austria Government Bond 20260315	875,000.000	1,145,305.000	
		3.65% Austria Government Bond 20220420	797,000.000	859,636.230	
		3.4% Austria Government Bond 20221122	872,000.000	957,604.240	
		3.8% Austria Government Bond 20620126	338,000.000	760,489.860	
		3.15% Austria Government Bond 20440620	623,000.000	1,040,596.900	
		1.75% Austria Government Bond 20231020	959,000.000	1,034,847.310	
		2.4% Austria Government Bond 20340523	771,000.000	1,023,648.990	
		1.65% Austria Government Bond 20241021	932,000.000	1,022,767.480	
		4% Finland Government Bond 20250704	667,000.000	821,137.030	
		2.75% Finland Government Bond 20280704	389,000.000	485,133.570	
		1.625% Finland Government Bond 20220915	312,000.000	327,568.800	
		1.5% Finland Government Bond 20230415	446,000.000	472,380.900	
		2.625% Finland Government Bond 20420704	407,000.000	620,377.890	
		2% Finland Government Bond 20240415	529,000.000	581,677.820	
		6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	2,352,000.000	3,465,789.600	
		1.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250430	2,045,000.000	2,206,820.850	

		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300730	2,052,000.000	2,335,791.600	
		2.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20251031	2,192,000.000	2,441,208.480	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	1,733,000.000	1,923,023.450	
		0.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20210730	1,747,000.000	1,769,571.240	
		2.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20461031	1,652,000.000	2,221,180.080	
		3.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20660730	950,000.000	1,498,910.000	
		1.3% SPANISH GOVERNMENT BOND 20261031	2,030,000.000	2,177,256.200	
		0.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220430	2,080,000.000	2,109,598.400	
		1.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270430	1,900,000.000	2,067,922.000	
		2.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20330730	1,700,000.000	2,033,489.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20271031	2,050,000.000	2,223,532.500	
		0.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20221031	1,600,000.000	1,629,184.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	1,900,000.000	2,058,479.000	
		2.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20481031	1,300,000.000	1,699,438.000	
		0.35% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230730	1,400,000.000	1,423,856.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280730	1,900,000.000	2,060,417.000	
		0.05% SPANISH GOVERNMENT BOND 20211031	1,700,000.000	1,709,282.000	
		1.45% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290430	1,900,000.000	2,067,333.000	
		1.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20350730	1,200,000.000	1,359,000.000	
		0.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240730	2,300,000.000	2,334,178.000	

		0.6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20291031	1,900,000.000	1,922,648.000	
		0.5% SPANISH GOVERNMENT BOND 20300430	1,360,000.000	1,357,484.000	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20230430	2,460,000.000	2,474,415.600	
		SPANISH GOVERNMENT BOND 20250131	500,000.000	500,855.000	
		1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20501031	1,200,000.000	1,076,172.000	
		0.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20270730	2,400,000.000	2,491,440.000	
		1.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20301031	2,900,000.000	3,092,473.000	
		5.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20320730	1,979,000.000	3,151,359.600	
		4.2% SPANISH GOVERNMENT BOND 20370131	1,854,000.000	2,777,069.520	
		4.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20400730	2,158,000.000	3,609,255.000	
		4.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240131	1,682,000.000	1,985,432.800	
		4.7% SPANISH GOVERNMENT BOND 20410730	1,873,000.000	3,104,984.480	
		4.65% SPANISH GOVERNMENT BOND 20250730	2,189,000.000	2,710,726.260	
		5.9% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260730	1,965,000.000	2,657,092.650	
		5.85% SPANISH GOVERNMENT BOND 20220131	1,978,000.000	2,178,529.640	
		5.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20230131	1,958,000.000	2,249,369.980	
		4.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20231031	1,901,000.000	2,196,206.290	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20281031	1,770,000.000	2,465,680.800	
		5.15% SPANISH GOVERNMENT BOND 20441031	1,299,000.000	2,343,655.800	
		3.8% SPANISH GOVERNMENT BOND 20240430	1,970,000.000	2,271,252.400	

		2.75% SPANISH GOVERNMENT BOND 20241031	2,097,000.000	2,357,321.580	
	ユーロ　小計			ユーロ 631,027,342.800 (76,152,379,728)	
国債証券　合計				191,001,914,387 [191,001,914,387]	
合計				191,001,914,387 [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		組入債券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	国債証券	243銘柄	100%	45.7%
イギリス・ポンド	国債証券	45銘柄	100%	6.7%
イスラエル・シュケル	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Ｊ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）】

(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Ｊ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,527,643	5,057,185
親投資信託受益証券	1,279,520,626	586,895,325
未収入金	12,915,100	6,000
流動資産合計	1,294,963,369	591,958,510
資産合計	1,294,963,369	591,958,510
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	30,850,622	17,794,708
未払解約金	12,859,708	－
未払受託者報酬	123,563	305,359
未払委託者報酬	1,792,320	4,428,282
その他未払費用	31,127	76,271
流動負債合計	45,657,340	22,604,620
負債合計	45,657,340	22,604,620
純資産の部		
元本等		
元本	※1 1,101,807,931	※1 593,156,947
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 147,498,098	※2 △ 23,803,057
（分配準備積立金）	103,757,733	8,645,335
元本等合計	1,249,306,029	569,353,890
純資産合計	1,249,306,029	569,353,890
負債純資産合計	1,294,963,369	591,958,510

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 至　2020年6月15日
営業収益		
受取利息	－	15
有価証券売買等損益	148,518,721	△ 1,014,292,301
営業収益合計	148,518,721	△ 1,014,292,286
営業費用		
支払利息	1,425	1,317
受託者報酬	196,675	567,961
委託者報酬	2,853,174	8,236,566
その他費用	49,094	142,411
営業費用合計	3,100,368	8,948,255
営業利益又は営業損失（△）	145,418,353	△ 1,023,240,541
経常利益又は経常損失（△）	145,418,353	△ 1,023,240,541
当期純利益又は当期純損失（△）	145,418,353	△ 1,023,240,541
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（△）	10,854,156	△ 873,537,492
期首剰余金又は期首欠損金（△）	2,445,651	147,498,098
剰余金増加額又は欠損金減少額	46,379,940	989,528,608
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	46,379,940	989,528,608
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,041,068	993,332,006
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,041,068	993,332,006
分配金	※1 30,850,622	※1 17,794,708
期末剰余金又は期末欠損金（△）	147,498,098	△ 23,803,057

(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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2019年6月15日及びその翌日が休日のため、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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1．※1　期首元本額	318,605,408円	1,101,807,931円
期中追加設定元本額	1,083,924,855円	3,863,471,660円
期中一部解約元本額	300,722,332円	4,372,122,644円
2．計算期間末日における受益権の総数	1,101,807,931口	593,156,947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23,803,057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 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 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（31,869,586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（102,694,611円）、投資信託約款に規定される収益調整金（43,740,365円）及び分配準備積立金（44,158円）より分配対象額は178,348,720円（1万口当たり1,618.69円）であり、うち30,850,622円（1万口当たり280円）を分配金額としております。	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（18,050,837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（53,417,138円）及び分配準備積立金（8,389,206円）より分配対象額は79,857,181円（1万口当たり1,346.31円）であり、うち17,794,708円（1万口当たり300円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第4期 自　2019年6月18日 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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第3期 2019年6月17日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第4期 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）
親投資信託受益証券	137,537,921	△148,397,547
合計	137,537,921	△148,397,547

（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 2019年6月17日現在	第4期 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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.1339円 (11,339円)	0.9599円 (9,599円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	229,542,915	586,895,325	
親投資信託受益証券　合計			586,895,325	
合計			586,895,325	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	2019年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（毎月分配型）	80,193,938,516円	110,923,691,743円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）	338,060,927円	311,434,660円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	79,957円	1,050,856円
ｉＦｒｅｅ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	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オープン	4,402,876,383円	5,260,587,366円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	2,455,804円	2,744,770円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	4,838,857円	4,982,707円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	1,399,634円	2,440,608円
	ダイワ・ノーロード Ｊ－ＲＥＩＴファンド	50,397,512円	103,161,629円
	ダイワファンドラップ Ｊ－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イン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	374,445,092円	418,298,119円
	ダイワ・インデックスセレクト 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金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　455,400,000円	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券　2,874,650,000円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2019年6月18日 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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	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		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引								
不動産投信指数先物取引								
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 (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	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ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	
	ＡＰＩ投資法人	18,537	6,784,542,000	
	ＧＬＰ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	
	ＯＮＥ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	
	スターツ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。

【ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）】

(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】

ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,506,136	4,858,236
親投資信託受益証券	715,366,314	134,755,750
派生商品評価勘定	348,842	455,478
未収入金	7,673,384	913
流動資産合計	725,894,676	140,070,377
資産合計	725,894,676	140,070,377
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,617,718	251,774
未払金	114,100	1,690
未払収益分配金	19,055,141	－
未払解約金	7,627,934	－
未払受託者報酬	65,945	242,478
未払委託者報酬	1,237,306	4,547,419
その他未払費用	16,565	60,556
流動負債合計	30,734,709	5,103,917
負債合計	30,734,709	5,103,917
純資産の部		
元本等		
元本	※1 657,073,836	※1 150,887,999
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 38,086,131	※2 △ 15,921,539
（分配準備積立金）	34,496,458	716,459
元本等合計	695,159,967	134,966,460
純資産合計	695,159,967	134,966,460
負債純資産合計	725,894,676	140,070,377

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 至　2020年6月15日
営業収益		
受取利息	－	15
有価証券売買等損益	47,904,545	△ 1,074,212,810
為替差損益	8,169,440	43,866,705
その他収益	18,481	－
営業収益合計	56,092,466	△ 1,030,346,090
営業費用		
支払利息	1,215	1,820
受託者報酬	108,805	413,654
委託者報酬	2,041,899	7,757,932
その他費用	37,891	109,538
営業費用合計	2,189,810	8,282,944
営業利益又は営業損失（△）	53,902,656	△ 1,038,629,034
経常利益又は経常損失（△）	53,902,656	△ 1,038,629,034
当期純利益又は当期純損失（△）	53,902,656	△ 1,038,629,034
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（△）	5,946,512	△ 1,011,757,679
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 4,309,157	38,086,131
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,494,285	324,739,456
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,307,290	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,186,995	324,739,456
剰余金減少額又は欠損金増加額	－	351,875,771
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	351,875,771
分配金	※1 19,055,141	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	38,086,131	△ 15,921,539

(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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2019年6月15日及びその翌日が休日のため、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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1．※1　期首元本額	284,242,850円	657,073,836円
期中追加設定元本額	644,244,585円	4,068,922,456円
期中一部解約元本額	271,413,599円	4,575,108,293円
2．計算期間末日における受益権の総数	657,073,836口	150,887,999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15,921,539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 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 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（17,957,943円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（29,998,201円）、投資信託約款に規定される収益調整金（24,604,464円）及び分配準備積立金（2,967,160円）より分配対象額は75,527,768円（1万口当たり1,149.46円）であり、うち19,055,141円（1万口当たり290円）を分配金額としております。	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（20,591,728円）及び分配準備積立金（716,459円）より分配対象額は21,308,187円（1万口当たり1,412.19円）であり、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第4期 自　2019年6月18日 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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産について為替変動リスクを回避することを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

Ⅱ 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第3期 2019年6月17日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第4期 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）
親投資信託受益証券	41,652,250	△24,604,391
合計	41,652,250	△24,604,391

（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 2019年6月17日 現在				第4期 2020年6月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売　建	658,274,383	－	660,543,259	△2,268,876	130,046,338	－	129,842,634	203,704
アメリカ・ドル	480,129,844	－	482,159,997	△2,030,153	98,000,478	－	97,553,619	446,859
イギリス・ポンド	33,356,010	－	33,304,042	51,968	6,891,610	－	6,932,453	△40,843
イスラエル・シュケル	444,010	－	448,490	△4,480	94,798	－	95,604	△806
オーストラリア・ドル	45,401,910	－	45,118,460	283,450	8,468,823	－	8,587,152	△118,329
カナダ・ドル	12,571,388	－	12,701,300	△129,912	2,399,927	－	2,405,772	△5,845
シンガポール・ドル	23,324,894	－	23,449,182	△124,288	5,156,388	－	5,185,350	△28,962
ニュージーランド・ドル	3,108,584	－	3,095,828	12,756	576,483	－	590,734	△14,251
ユーロ	42,620,890	－	42,877,384	△256,494	6,111,942	－	6,154,680	△42,738
香港・ドル	17,316,853	－	17,388,576	△71,723	2,345,889	－	2,337,270	8,619
合計	658,274,383	－	660,543,259	△2,268,876	130,046,338	－	129,842,634	203,704

（注）　1．時価の算定方法

(1) 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
① 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
② 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
(2) 計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（関連当事者との取引に関する注記）

第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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0580円 (10,580円)	0.8945円 (8,945円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 (円)	備考

親投資信託受益証券	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	65,156,054	134,755,750	
親投資信託受益証券　合計			134,755,750	
合計			134,755,750	

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	11,968,050,382
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 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 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。 (2)投資信託受益証券

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

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

（貸借対照表に関する注記）

区　分	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ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）	4,497,284,850円	5,819,881,094円
ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	686,878,821円	1,011,439,969円
ダイワファンドラップオンライン 外国ＲＥＩＴインデックス（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イン 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）	229,637,689円	265,959,373円
Ｄ－Ｉ's グローバルＲＥＩＴインデックス	1,216,249円	2,318,298円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	79,996円	1,315,316円
ｉＦｒｅｅ 外国ＲＥＩＴインデックス	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・インデックスファンド（資産形成型）	－円	6,556,810円
	グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）	－円	8,697,140円
	ＤＣダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックスファンド	1,995,608,217円	2,515,002,695円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020	2,943,144円	3,470,362円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	5,830,872円	6,613,190円
	ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	1,473,077円	3,162,363円
	ダイワ・インデックスセレクト 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インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）	294,668,334円	65,156,054円
	ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	220,038,293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）

Ⅰ 金融商品の状況に関する事項

区　分	自　2019年6月18日 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。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における不動産投信指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

	2019年6月17日現在	2020年6月15日現在

種　類	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	3,679,934	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	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)
市場取引								
不動産投信指数先物取引								
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	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち1年超	(円)	(円)	(円)	うち1年超	(円)	(円)

市場取引以外の取引								
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。

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

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

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

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

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

2．換算において円未満の端数は切り捨てております。

3．契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2019年6月17日現在	2020年6月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	2.4277円 (24,277円)	2.0682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
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	VANGUARD REAL ESTATE ETF	62,500.000	アメリカ・ドル 5,039,375.000	
	アメリカ・ドル　小計			アメリカ・ドル 5,039,375.000 (540,422,575)	
投資信託受益証券　合計				540,422,575 [540,422,575]	
投資証券	アメリカ・ドル			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 163,670,093.540 (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・ポンド　小計			イギリス・ポンド 9,201,518.730 (1,234,291,723)	
イスラエル・シュケル			イスラエル・シュケル	
	REIT 1 LTD	28,840	413,565.600	
イスラエル・シュケル　小計			イスラエル・シュケル 413,565.600 (12,758,499)	
オーストラリア・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 21,561,031.840 (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 5,852,184.280 (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 & COMMERCI	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	
	OUE 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 12,797,885.190 (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 1,537,905.500 (105,715,624)	
ユーロ			ユーロ	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	27,210	368,423.400	
	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 PROPERTIE-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 8,317,280.750 (1,003,729,441)	
韓国・ウォン			韓国・ウォン	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	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	組入投資信託受益証券時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 1銘柄 受益証券 投資証券 157銘柄	3.0%	97.0%	75.4%
イギリス・ポンド	投資証券 30銘柄	-%	100%	5.2%
イスラエル・シュケル	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 25銘柄	-%	100%	6.6%
カナダ・ドル	投資証券 25銘柄	-%	100%	1.9%
シンガポール・ドル	投資証券 29銘柄	-%	100%	4.1%
ニュージーランド・ドル	投資証券 5銘柄	-%	100%	0.4%
ユーロ	投資証券 26銘柄	-%	100%	4.2%
韓国・ウォン	投資証券 1銘柄	-%	100%	0.0%
香港・ドル	投資証券 6銘柄	-%	100%	2.1%

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。

【ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）】

(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】

ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,137,075	1,049,400
親投資信託受益証券	534,186,963	439,898,253
未収入金	26,000	8,000
流動資産合計	535,350,038	440,955,653
資産合計	535,350,038	440,955,653
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	15,603,537	15,100,197
未払受託者報酬	55,424	51,322
未払委託者報酬	1,039,946	963,022
その他未払費用	13,931	12,748
流動負債合計	16,712,838	16,127,289
負債合計	16,712,838	16,127,289
純資産の部		
元本等		
元本	※1 503,339,911	※1 503,339,911
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	※2 15,297,289	※2 △ 78,511,547
（分配準備積立金）	10,902,230	11,690,648
元本等合計	518,637,200	424,828,364
純資産合計	518,637,200	424,828,364
負債純資産合計	535,350,038	440,955,653

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 至　2020年6月15日
営業収益		
有価証券売買等損益	26,271,171	△ 76,530,710
営業収益合計	26,271,171	△ 76,530,710
営業費用		
支払利息	124	103
受託者報酬	86,139	108,804
委託者報酬	1,616,583	2,041,837
その他費用	21,378	27,185
営業費用合計	1,724,224	2,177,929
営業利益又は営業損失（△）	24,546,947	△ 78,708,639
経常利益又は経常損失（△）	24,546,947	△ 78,708,639
当期純利益又は当期純損失（△）	24,546,947	△ 78,708,639
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△ 306,209	15,297,289
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,660,088	－
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,660,088	－
分配金	※1 15,603,537	※1 15,100,197
期末剰余金又は期末欠損金（△）	15,297,289	△ 78,511,547

(3) 【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区　分	第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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 2019年6月15日及びその翌日が休日のため、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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1．※1　期首元本額	10,000,000円	503,339,911円
期中追加設定元本額	493,339,911円	－円
期中一部解約元本額	－円	－円
2．計算期間末日における受益権の総数	503,339,911口	503,339,911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78,511,547円であります。

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区　分	第3期 自　2018年6月16日 至　2019年6月17日	第4期 自　2019年6月18日 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（14,506,850円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（9,693,897円）、投資信託約款に規定される収益調整金（6,660,088円）及び分配準備積立金（39,991円）より分配対象額は30,900,826円（1万口当たり613.92円）であり、うち15,603,537円（1万口当たり310円）を分配金額としております。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（15,888,615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（46,291円）及び分配準備積立金（10,902,230円）より分配対象額は26,837,136円（1万口当たり533.18円）であり、うち15,100,197円（1万口当たり300円）を分配金額としております。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ　金融商品の状況に関する事項

区　分	第4期 自　2019年6月18日 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。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3．金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

Ⅱ 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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種　類	第3期 2019年6月17日現在 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	第4期 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）
親投資信託受益証券	26,265,753	△76,464,125
合計	26,265,753	△76,464,125

（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 2019年6月17日現在	第4期 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 2019年6月17日現在	第4期 2020年6月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0304円 (10,304円)	0.8440円 (8,440円)

(4) 【附属明細表】

第１ 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種　類	銘　柄	券面総額	評価額 （円）	備考
親投資信託受益証券	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	212,696,187	439,898,253	
親投資信託受益証券　合計			439,898,253	
合計			439,898,253	

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「ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）」に記載のとおりであります。

２　【ファンドの現況】

ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）

【純資産額計算書】

2020年6月30日

Ⅰ	資産総額	5,146,167,081円
Ⅱ	負債総額	1,545,901円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	5,144,621,180円
Ⅳ	発行済数量	4,951,367,984口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0390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

Ⅰ	資産総額	167,520,023,701円
Ⅱ	負債総額	21,231,287,526円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	146,288,736,175円
Ⅳ	発行済数量	142,060,889,074口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0298円

ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）

純資産額計算書

2020年6月30日

Ⅰ	資産総額	394,648,642円
Ⅱ	負債総額	56,010円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	394,592,632円
Ⅳ	発行済数量	338,043,592口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1673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

Ⅰ	資産総額	184,192,003,544円
Ⅱ	負債総額	19,000,312,245円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	165,191,691,299円
Ⅳ	発行済数量	57,917,841,533口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.8522円

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）

純資産額計算書

2020年6月30日

Ⅰ	資産総額	7,990,468,395円
Ⅱ	負債総額	25,152,769円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	7,965,315,626円
Ⅳ	発行済数量	6,878,196,986口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1581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

Ⅰ	資産総額	55,429,131,626円
Ⅱ	負債総額	229,828,701円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	55,199,302,925円
Ⅳ	発行済数量	27,674,488,513口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9946円

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）

純資産額計算書

2020年6月30日

Ⅰ	資産総額	221,935,656円
Ⅱ	負債総額	41,295円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	221,894,361円
Ⅳ	発行済数量	190,596,750口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1642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

Ⅰ	資産総額	132,359,198,705円
Ⅱ	負債総額	152,248,171円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	132,206,950,534円
Ⅳ	発行済数量	51,053,723,244口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.5896円

ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）

純資産額計算書

2020年6月30日

Ⅰ	資産総額	18,467,198,725円
Ⅱ	負債総額	1,584,078円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	18,465,614,647円
Ⅳ	発行済数量	18,110,439,750口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0196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

Ⅰ	資産総額	98,290,125,303円
Ⅱ	負債総額	3,205,060円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	98,286,920,243円
Ⅳ	発行済数量	69,383,023,460口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4166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）

純資産額計算書

2020年6月30日

Ⅰ	資産総額	22,388,709,282円
Ⅱ	負債総額	72,967,861円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	22,315,741,421円
Ⅳ	発行済数量	20,193,912,238口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1051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

Ⅰ	資産総額	115,392,964,492円
Ⅱ	負債総額	715,356,929円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	114,677,607,563円
Ⅳ	発行済数量	107,463,631,395口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0671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）

純資産額計算書

2020年6月30日

Ⅰ	資産総額	56,151,038円
Ⅱ	負債総額	9,743円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	56,141,295円
Ⅳ	発行済数量	51,714,565口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0856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

Ⅰ	資産総額	198,419,722,878円
Ⅱ	負債総額	852,839,338円
Ⅲ	純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	197,566,883,540円
Ⅳ	発行済数量	66,198,223,430口
Ⅴ	１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.9845円

ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）

純資産額計算書

2020年6月30日

Ⅰ	資産総額	583,800,943円
Ⅱ	負債総額	84,059円

Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	583,716,884円
Ⅳ　発行済数量	595,039,830口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9810円

(参考) ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

純資産額計算書

2020年6月30日

Ⅰ　資産総額	338,226,094,253円
Ⅱ　負債総額	1,837,636,418円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	336,388,457,835円
Ⅳ　発行済数量	128,716,096,246口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6134円

ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）

純資産額計算書

2020年6月30日

Ⅰ　資産総額	131,046,311円
Ⅱ　負債総額	435,558円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	130,610,753円
Ⅳ　発行済数量	150,887,999口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.8656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

Ⅰ　資産総額	24,415,223,799円
Ⅱ　負債総額	154,833,390円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	24,260,390,409円
Ⅳ　発行済数量	12,067,110,119口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0105円

ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）

純資産額計算書

2020年6月30日

Ⅰ	**資産総額**	**412,978,303円**
Ⅱ	**負債総額**	**76,051円**
Ⅲ	**純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）**	**412,902,252円**
Ⅳ	**発行済数量**	**503,339,911口**
Ⅴ	**１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）**	**0.8203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「ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）」の記載と同じ。

第４　【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典

ありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の譲渡

① 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

② 上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(7) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

(8) 償還金

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

第三部　【委託会社等の情報】

第１　【委託会社等の概況】

１　【委託会社等の概況】

ａ．資本金の額

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年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

ｂ．委託会社の機構

①　会社の意思決定機構

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

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

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

②　投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ．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

CI0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 （2019年３月31日）		当事業年度 （2020年３月31日）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		28,489		2,741
有価証券		554		22,167
前払費用		214		205
未収委託者報酬		11,468		10,847
未収収益		98		63
その他		56		62
流動資産計		40,882		36,088
固定資産				
有形固定資産	※1	206	※1	217
建物		10		7
器具備品		195		209
無形固定資産		2,821		2,362
ソフトウェア		2,804		2,028
ソフトウェア仮勘定		17		333
投資その他の資産		12,799		15,844
投資有価証券		8,493		9,153
関係会社株式		1,836		3,972
出資金		183		183
長期差入保証金		1,070		1,069
繰延税金資産		1,183		1,431
その他		31		33
固定資産計		15,827		18,424

資産合計	56,709	54,512

（単位:百万円）

	前事業年度 （2019年３月31日）		当事業年度 （2020年３月31日）	
負債の部				
流動負債				
預り金		75		69
未払金		8,548		7,573
未払収益分配金		15		14
未払償還金		40		39
未払手数料		4,610		3,988
その他未払金	※2	3,882	※2	3,530
未払費用		3,735		3,830
未払法人税等		726		656
未払消費税等		255		590
賞与引当金		725		688
その他		2		5
流動負債計		14,070		13,414
固定負債				
退職給付引当金		2,389		2,574
役員退職慰労引当金		103		88
その他		2		5
固定負債計		2,496		2,667
負債合計		16,567		16,082
純資産の部				
株主資本				
資本金		15,174		15,174
資本剰余金				
資本準備金		11,495		11,495
資本剰余金合計		11,495		11,495
利益剰余金				
利益準備金		374		374
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		13,052		11,749
利益剰余金合計		13,426		12,123
株主資本合計		40,096		38,793

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

(2) 【損益計算書】

（単位:百万円）

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

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

（単位:百万円）

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△12,669	△12,669	△12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△798	△798	△798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△170	△170	△170
当期変動額合計	△170	△170	△969
当期末残高	46	46	40,142

当事業年度（自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096
当期変動額						

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	46	46	40,142
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△11,868
当期純利益	-	-	10,566
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△410	△410	△410
当期変動額合計	△410	△410	△410
当期末残高	△363	△363	38,430

注記事項

（重要な会計方針）

１．有価証券の評価基準及び評価方法

（１）子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（２）その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

２．固定資産の減価償却の方法

（１）有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物　　８～18年

器具備品　　４～17年

（２）無形固定資産

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

３．引当金の計上基準

（１）賞与引当金

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

（２）退職給付引当金

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

（３）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

４．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

５．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

６．連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

（未適用の会計基準等）

１．収益認識に関する会計基準等

・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2018年３月30日）
・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2018年３月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の５つのステップを適用し認識されます。

ステップ１：顧客との契約を識別する。

ステップ２：契約における履行義務を識別する。

ステップ３：取引価格を算定する。
ステップ４：契約における履行義務に取引価格を配分する。
ステップ５：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日
2022年３月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響
影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

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

・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

(2) 適用予定日
2022年３月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響
影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（表示方法の変更）
（損益計算書）
前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「受取配当金」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。
この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた172百万円は、「受取配当金」38百万円、「その他」134百万円として組替えております。

（貸借対照表関係）

※１　有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
建物	31百万円	34百万円
器具備品	264百万円	276百万円

※２　関係会社項目

関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

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

３　保証債務

前事業年度（2019年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（2020年３月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,603百万円に対して保証を行っております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	－	－	2,608
合　　計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

（１）　配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	１株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年６月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 ３月31日	2018年 ６月26日

（２）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2019年６月21日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 剰余金の配当の総額　11,868百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　4,550円
④ 基準日　2019年３月31日
⑤ 効力発生日　2019年６月24日

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

１．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	－	－	2,608
合　　計	2,608	－	－	2,608

２．配当に関する事項

（１） 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額（百万円）	１株当たり配当額（円）	基準日	効力発生日
2019年６月21日定時株主総会	普通株式	11,868	4,550	2019年３月31日	2019年６月24日

（２）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

① 剰余金の配当の総額　10,564百万円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　4,050円
④ 基準日　2020年３月31日
⑤ 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関係する業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

（３） 金融商品に係るリスク管理体制

①市場リスクの管理

（ｉ）為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

（ii）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

②信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

２．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注２）参照のこと）。

前事業年度（2019年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表　　計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金	28,489	28,489	－
（２）未収委託者報酬	11,468	11,468	－
（３）有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	8,380	8,380	－
資産計	48,338	48,338	－
（１）未払手数料	(4,610)	(4,610)	－
（２）その他未払金	(3,882)	(3,882)	－
（３）未払費用（*2）	(2,805)	(2,805)	－
負債計	(11,298)	(11,298)	－

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。

(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

当事業年度（2020年３月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表　　計上額(*1)	時価(*1)	差額
（１）現金・預金	2,741	2,741	－
（２）未収委託者報酬	10,847	10,847	－
（３）有価証券及び投資有価証券			
有価証券	21,900	21,900	－
その他有価証券	8,754	8,754	－
資産計	44,243	44,243	－
（１）未払手数料	(3,988)	(3,988)	－
（２）その他未払金	(3,530)	(3,530)	－
（３）未払費用（*2）	(2,889)	(2,889)	－
負債計	(10,408)	(10,408)	－

(*1) 負債に計上されているものについては、(　)で示しております。
(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

（注１）金融商品の時価の算定方法

資　産

（１）現金・預金、並びに（２）未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（３）有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

負　債

（１）未払手数料、（２）その他未払金、並びに（３）未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

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

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

（注３）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（2019年３月31日）

（単位：百万円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
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 ５年以内	５年超 10年以内	10年超
現金・預金	2,741	-	-	-
未収委託者報酬	10,847	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
有価証券	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、記載しておりません。

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、記載しておりません。

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 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	87	55	32
（２）その他	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

その他	3,301	3,560	△258
小計	3,301	3,560	△258
合計	8,380	8,328	52

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　666百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（2020年３月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（１）株式	60	55	5
（２）その他	3,004	2,772	232
小計	3,064	2,827	237
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	27,589	28,354	△764
小計	27,589	28,354	△764
合計	30,654	31,181	△526

（注）非上場株式（貸借対照表計上額　666百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

３．売却したその他有価証券

前事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（１）株式	389	86	-
（２）その他			
証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（１）株式	-	-	-
（２）その他			
証券投資信託	1,492	214	1
合計	1,492	214	1

４．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、証券投資信託について48百万円の減損処理を行っております。

（退職給付関係）

１．採用している退職給付制度の概要

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

２．確定給付制度

(１)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(３)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	当事業年度 （自　2019年４月１日 至　2020年３月31日）

勤務費用	158百万円	159百万円
その他	41	27
確定給付制度に係る退職給付費用	199	187

3．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度174百万円、当事業年度181百万円であります。

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

	前事業年度 （2019年３月31日）	当事業年度 （2020年３月31日）
繰延税金資産		
退職給付引当金	731	788
システム関連費用	170	198
賞与引当金	182	177
未払事業税	141	129
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	32	47
その他	240	399
繰延税金資産小計	1,592	1,835
評価性引当額	△164	△173
繰延税金資産合計	1,428	1,661
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	△159	△159
その他有価証券評価差額金	△85	△71
繰延税金負債合計	△244	△230
繰延税金資産の純額	1,183	1,431

2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

前事業年度（2019年３月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。

当事業年度（2020年３月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の５以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

［セグメント情報］

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

［関連情報］

１.サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

２.地域ごとの情報

（１）営業収益

内国籍証券投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（２）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

３.主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

１．関連当事者との取引

（ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）

子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 （注１）	1,719	－	－
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有) 直接91.0	経営管理	有償減資 （注２）	3,293	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注１) シンガポール通貨庁（MAS）に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

(注２) 当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）	科目	期末残高（百万円）
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 （注）	1,603	－	－

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁（MAS）に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

（イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）（注1）	科目	期末残高（百万円）（注1）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	－	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料（注2）	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	－	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入（注3）	1,052	未払費用	173
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	－	本社ビルの管理	不動産の賃借料（注4）	1,063	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金（百万円）	事業の内容	議決権等の所有（被所有）割合（%）	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（百万円）（注1）	科目	期末残高（百万円）（注1）
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	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	㈱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㈱	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す。

(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

２.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

前事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）	当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）
１株当たり純資産額　15,389.06円	１株当たり純資産額　14,732.52円
１株当たり当期純利益　4,550.81円	１株当たり当期純利益　4,050.66円

(注１)潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注２)１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）	当事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

当期純利益（百万円）	11,870	10,566
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

① 自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

② 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)。

③ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

④ 委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

⑤ 上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

ａ．定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

① 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。

② 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

＜日経225インデックス＞

① 名称 みずほ信託銀行株式会社

② 資本金の額 247,369百万円（2020年3月末日現在）

③ 事業の内容

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

＜その他各ファンド＞

① 名称 三井住友信託銀行株式会社

② 資本金の額 342,037百万円（2020年3月末日現在）

③ 事業の内容

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

(2) 販売会社

① 名称	② 資本金の額 単位：百万円 （2020年3月 末日現在）	③ 事業の内容
大和証券株式会社	100,000	（注）

（注）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

２ 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに充分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

３ 【資本関係】

該当事項はありません。

＜再信託受託会社の概要＞

名称：株式会社日本カストディ銀行

資本金の額：51,000百万円（2020年7月27日現在）

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

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

第３　【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

① 金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

② 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

③ 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

④ 詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等

・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨

⑤ 使用開始日を記載することがあります。

⑥ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法

・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日

⑦ 次の事項を記載することがあります。

・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨

・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

⑧ 委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

⑨ ファンドの形態等を記載することがあります。

⑩ 図案を採用することがあります。

⑪ ファンドの管理番号等を記載することがあります。

⑫　委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。

⑬　UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

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務執行社員	公認会計士	小倉　加奈子	印
指定有限責任社員業務執行社員	公認会計士	間瀬　友未	印
指定有限責任社員業務執行社員	公認会計士	深井　康治	印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和アセットマネジメント株式会社（旧社名 大和証券投資信託委託株式会社）の2019年４月１日から2020年３月31日までの第61期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)１．　上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
(注)２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

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ＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）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ＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）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日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）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、ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）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日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）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、ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）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Ｊ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）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Ｊ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）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外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）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、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）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外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）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、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）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外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）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、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）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外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）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、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）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外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）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、ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）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外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）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、ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）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。