

# ダイワファンドラップオンライン インデックス・シリーズ

ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)

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

ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)

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

ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス

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

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

---

---

## 運用報告書 (全体版)

### 第5期

(決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日~2021年11月30日)

---

---

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップオンライン インデックス・シリーズ」は、  
このたび、第5期の決算を行ないました。

ここに、当作成期の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先 (コールセンター)  
TEL 0120-106212  
(営業日の9:00~17:00)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

<4667>  
<2768>  
<2769>  
<4668>  
<2770>  
<2771>  
<4669>  
<2772>  
<2773>

# ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

## 運用報告書（全体版） 第5期

（決算日 2021年11月30日）

（作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日）

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、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おります。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

### 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先（コールセンター）  
TEL 0120-106212  
(営業日の9:00～17:00)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	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。	
主要投資対象	ベビーファンド	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
	トピックス・インデックス・マザーファンド	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）
組入制限	ベビーファンドの マザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの 株式実質組入上限比率	
	マザーファンドの 株式組入上限比率	
分配方針	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、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			T O P I X		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
1 期末(2017年11月30日)	円 11,827	円 0	% 18.3	1,792.08	% 16.2	% 98.7	% 1.3	百万円 1,308
2 期末(2018年11月30日)	11,209	0	△ 5.2	1,667.45	△ 7.0	98.7	1.3	2,014
3 期末(2019年12月 2 日)	11,793	0	5.2	1,714.49	2.8	98.7	1.4	2,849
4 期末(2020年11月30日)	12,343	0	4.7	1,754.92	2.4	97.9	1.8	2,646
5 期末(2021年11月30日)	13,823	0	12.0	1,928.35	9.9	97.2	3.0	3,521

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

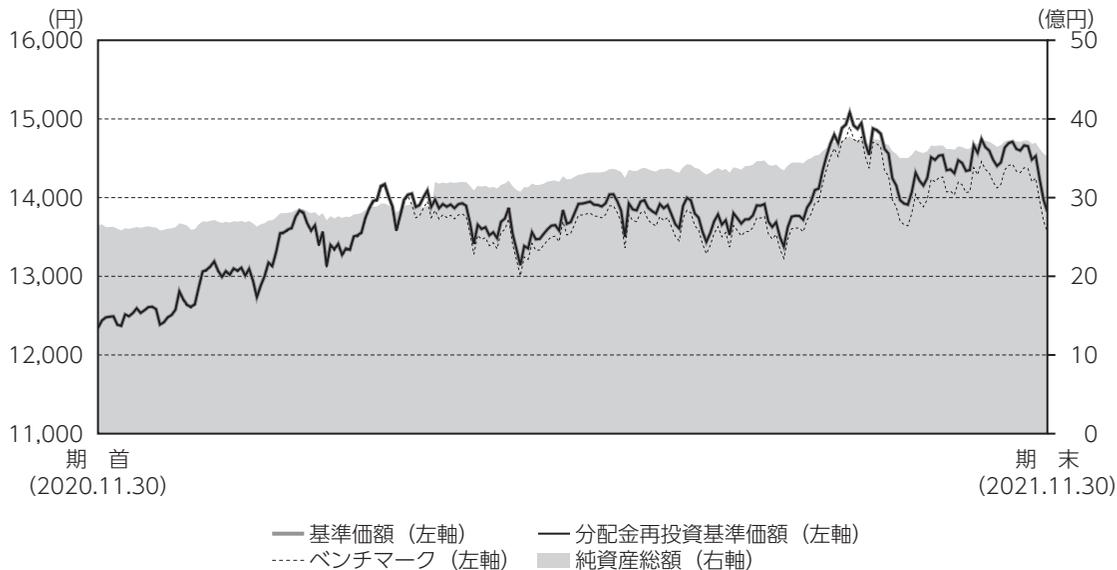
(注3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みません。

(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

\*分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

\*分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

\*ベンチマークはTOP I Xです。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：12,343円

期末：13,823円（分配金0円）

騰落率：12.0%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

ベンチマークが上昇したことを受けて、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2020年11月30日	円	%		%	%	%
	12,343	—	1,754.92	—	97.9	1.8
12月末	12,708	3.0	1,804.68	2.8	98.8	1.1
2021年 1 月末	12,735	3.2	1,808.78	3.1	99.1	0.8
2 月末	13,131	6.4	1,864.49	6.2	99.3	0.7
3 月末	13,880	12.5	1,954.00	11.3	98.1	2.8
4 月末	13,485	9.3	1,898.24	8.2	98.2	1.8
5 月末	13,668	10.7	1,922.98	9.6	97.2	2.8
6 月末	13,828	12.0	1,943.57	10.7	98.0	2.0
7 月末	13,526	9.6	1,901.08	8.3	97.0	3.0
8 月末	13,950	13.0	1,960.70	11.7	98.3	1.6
9 月末	14,559	18.0	2,030.16	15.7	98.1	1.8
10月末	14,350	16.3	2,001.18	14.0	97.5	2.5
(期末) 2021年11月30日	13,823	12.0	1,928.35	9.9	97.2	3.0

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、米国のバイデン政権による大型経済対策への期待が高まったことや、欧米において新型コロナウイルスのワクチン接種が始まったことなどが好感され、上昇しました。2021年に入ってから、米国上下両院で民主党が多数党を確保したことにより大型経済対策が実現したことや、国内のウイルスの感染状況が改善したことなどが好感され、株価は3月にかけて上昇しました。その後は、国内で感染が再拡大して再び行動制限措置がとられたことや、内閣支持率の低下で政局の行方に不透明感が増したことなどから、上値の重い展開となりました。8月下旬には、国内の感染状況が改善したことを受けて株価は上昇に転じ、9月初めに菅首相の自民党総裁選挙への不出馬表明を受けて株価は一時急騰し、年初来高値を更新しました。しかしその後は、新政権への期待がやや後退したことや、中国の大手不動産会社の信用問題に対する懸念が高まったことなどから、株価は反落しました。10月末には、衆議院議員選挙で自民党が予想以上に議席数を伸ばし、単独で絶対安定多数を維持したことを好感して株価が上昇する局面もありましたが、11月末にかけては、新型コロナウイルスの新変異株への警戒感が広がったことなどから、株価は下落しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の受益証券の組入比率を高位に維持します。

### ■トピックス・インデックス・マザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

## ポートフォリオについて

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■当ファンド

株式への投資は、「トピックス・インデックス・マザーファンド」の受益証券を組み入れることにより行いました。

### ■トピックス・インデックス・マザーファンド

株式を中心に先物取引も利用し、株式組入比率（株式先物を含む。）につきましては、当作成期を通じておおむね100%程度を維持しました。

株式ポートフォリオは、最適化の手法（株価変動を数理的にいくつかの要因に分解し、それに基づいて、ポートフォリオがベンチマークと同じように変動するよう、銘柄、株数を決定する体系的な手法）を用いて構築しています。

当作成期中、資金変動への対応や新規上場等によるベンチマークの構成の変化への対応のため、随時、株式の売買を行いました。

\*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
トピックス・インデックス・マザーファンド	TOP I X

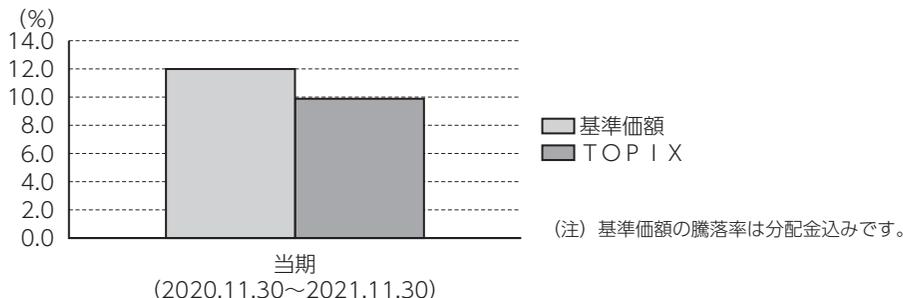
## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は9.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は12.0%となりました。

マザーファンドで保有している株式の配当金について、ベンチマークが配当落ちしているのに対して、ファンドには配当金が計上されているため、ベンチマークとかい離しました。

その他、マザーファンドで組み入れている現物株式ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、先物取引の影響、運用管理費用等のコストがかい離の要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\*ベンチマークはTOP I Xです。

## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2020年12月1日 ～2021年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	3,823

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の受益証券の組入比率を高位に維持します。

### ■トピックス・インデックス・マザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020.12.1~2021.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	32円	0.231%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は13,740円です。
(投 信 会 社)	(21)	(0.154)	投信会社分は、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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(8)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	33	0.237	

(注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

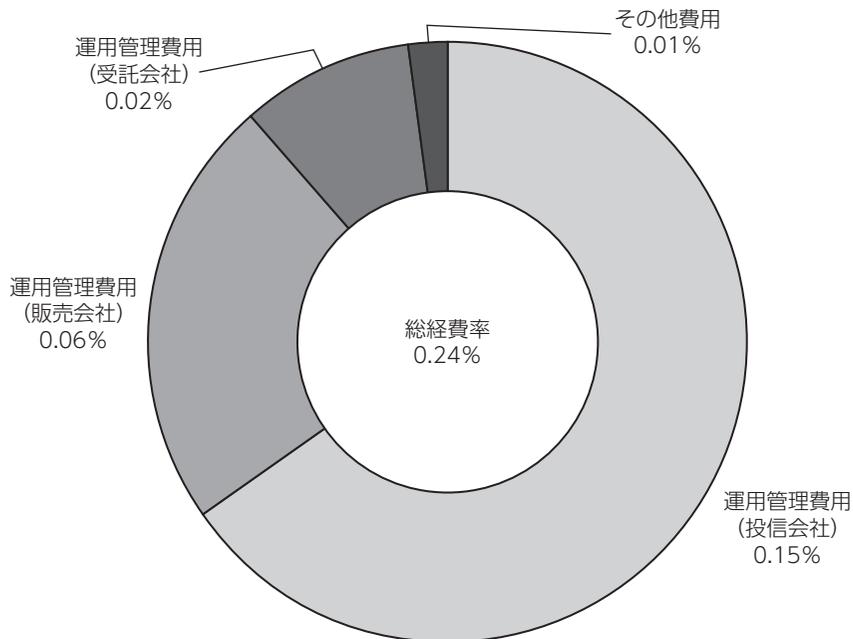
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.24%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	692,343	906,970	272,759	342,310

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

項 目	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	38,074,045千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	172,483,144千円
(c) 売買高比率(a)÷(b)	0.22

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
株式	百万円 18,333	百万円 1,487	% 8.1	百万円 19,740	百万円 61	% 0.3
株式先物取引	32,107	6,704	20.9	29,585	5,268	17.8
コール・ローン	2,738,349	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合1.8%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

種 類	当 期		
	トピックス・インデックス・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
株式	百万円 20	百万円 32	百万円 339

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

種 類	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
	買 付 額
株式	百万円 72

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	35千円
うち利害関係人への支払額 (B)	6千円
(B)÷(A)	16.9%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、大和証券グループ本社、マネーパートナーズグループ、サムディです。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	2,261,893	2,681,477	3,521,316

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	3,521,316	99.8
コール・ローン等、その他	5,403	0.2
投資信託財産総額	3,526,719	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,526,719,023円
コール・ローン等	5,403,000
トピックス・インデックス・マザーファンド(評価額)	3,521,316,023
(B) 負債	5,157,769
未払解約金	996,860
未払信託報酬	4,064,241
その他未払費用	96,668
(C) 純資産総額(A - B)	3,521,561,254
元本	2,547,528,267
次期繰越損益金	974,032,987
(D) 受益権総口数	2,547,528,267口
1万口当り基準価額(C / D)	13,823円

\* 期首における元本額は2,143,825,188円、当作成期間中における追加設定元本額は891,127,877円、同解約元本額は487,424,798円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,823円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月1日 至2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 922円
受取利息	33
支払利息	△ 955
(B) 有価証券売買損益	264,580,322
売買益	309,773,338
売買損	△ 45,193,016
(C) 信託報酬等	△ 7,536,714
(D) 当期損益金(A + B + C)	257,042,686
(E) 前期繰越損益金	223,932,404
(F) 追加信託差損益金	493,057,897
(配当等相当額)	( 408,511,953)
(売買損益相当額)	( 84,545,944)
(G) 合計(D + E + F)	974,032,987
次期繰越損益金(G)	974,032,987
追加信託差損益金	493,057,897
(配当等相当額)	( 408,511,953)
(売買損益相当額)	( 84,545,944)
分配準備積立金	480,976,012
繰越損益金	△ 922

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	257,042,681
(c) 収益調整金	493,057,897
(d) 分配準備積立金	223,933,331
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	974,033,909
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	974,033,909
(h) 受益権総口数	2,547,528,267口

## &lt;補足情報&gt;

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン TOP I Xインデックス）が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（2021年9月21日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年11月30日）現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

### トピックス・インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄 株 式

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

買				付				売				付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円		千株	千円	円		千株	千円	円
ソフトバンク	438.9	675,000	1,537	ソフトバンクグループ	161.3	1,064,019	6,596	キーエンス	9.1	518,269	56,952	トヨタ自動車	104.7	803,815	7,677
東芝	133.5	508,139	3,806	エムスリー	61.2	557,096	9,102	三菱商事	66.1	429,118	6,491	キーエンス	9.1	538,909	59,220
リクルートホールディングス	66.1	429,118	6,491	日本電信電話	150.3	399,328	2,656	トヨタ自動車	43.7	344,195	7,876	任天堂	5.3	325,565	61,427
三井物産	115.3	401,078	3,478	任天堂	5.3	325,565	61,427	ソニーグループ	27.8	308,090	11,082	信越化学	15.9	302,220	19,007
日本電気	23.3	297,430	12,765	三菱UFJフィナンシャルG	544.6	295,706	542	信越化学	16	298,823	18,676	三菱UFJフィナンシャルG	544.6	295,706	542
東京エレクトロン	5.3	269,705	50,887	ソニーグループ	27.5	276,827	10,066	日本電産	23.3	297,430	12,765	ソニーグループ	27.5	276,827	10,066
				KDDI	78.9	265,763	3,368	東京エレクトロン	5.3	269,705	50,887	KDDI	78.9	265,763	3,368

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

## 組入資産明細表

下記は、2021年11月30日現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンド（139,094,932千円）の内容です。

## (1) 国内株式

銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>			日本アクア	4.4	2,956	松井建設	8.4	5,905	ピーエス三菱	6.9	4,091
極洋	3.2	9,280	ファーストコーポレーション	2.5	1,722	銭高組	0.9	3,388	日本ハウスHLDGS	14.7	5,100
日本水産	91.4	52,372	ベステラ	1.9	2,424	鹿島建設	154.7	193,529	大東建託	21.6	265,464
マルハニチロ	14.3	32,561	キャンディル	1.7	839	不動テトラ	4.4	7,092	新日本建設	8.9	6,630
カナコ種苗	2.8	3,774	スペースバリューHD	9.6	11,001	大栄建設	2.2	2,459	NIPPO	17.7	70,977
サカタのタネ	10.9	34,062	ダイセキ環境ソリューション	1.8	2,984	鉄建建設	4.5	7,726	東亜道路	1.1	5,115
ホクト	7.9	14,551	第一カッター興業	2.3	2,918	西松建設	12.8	43,328	日本道路	2	15,600
ホクリヨウ	1.5	1,015	安藤・間	50.3	42,302	三井住友建設	47.6	19,706	東亜建設	5.1	12,132
<b>鉱業 (0.2%)</b>			東急建設	29	18,705	大豊建設	3.1	11,222	日本国土開発	20.3	10,799
住石ホールディングス	21.6	2,721	コムシスホールディングス	29.5	73,042	佐田建設	4.6	2,198	若築建設	3.5	6,650
日鉄鉱業	2.3	14,168	ピーアルホールディングス	12.7	4,483	ナカノフドー建設	5	1,665	東洋建設	24.2	12,680
三井松島HLDGS	3.6	4,654	高松コンストラクションGP	5.7	10,653	興村組	12.4	38,936	五洋建設	83.7	54,488
I N P E X	367.2	344,066	東建コーポレーション	2.8	25,060	東鉄工業	9.8	22,275	世紀東急	10.2	8,404
石油資源開発	10.7	24,513	ソネック	1	984	イチケン	1.5	2,715	福田組	2.4	9,864
K&Oエナジーグループ	4.4	6,608	ヤマウラ	4.4	4,065	富士ピー・エス	2.9	1,435	住友林業	54.4	124,412
<b>建設業 (2.2%)</b>			オリエンタル白石	32.3	7,332	浅沼組	2.4	12,624	日本基礎技術	5.8	3,195
ヒノキヤグループ	2.3	4,871	大成建設	61	201,910	戸田建設	87.3	58,316	巴コーポレーション	9	3,888
ショーボンドHD	13.2	64,482	大林組	211.1	176,479	熊谷組	10.7	28,119	大和ハウス	194.9	646,288
ミライト・ホールディングス	29.4	57,771	清水建設	197.8	141,822	北野建設	1.2	2,460	ライト工業	13.3	26,932
タマホーム	5.9	13,511	飛鳥建設	5.5	5,373	植木組	1.7	2,313	積水ハウス	228.8	505,648
サンヨーホームズ	1.5	1,069	長谷工コーポレーション	62.7	84,895	矢作建設	9.3	6,426	日特建設	4.3	2,756

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
北陸電気工事	3.8	3,993	寿スピリッツ	6.6	40,656	わらべや日洋HD	4.5	8,289	巴川製紙	2.1	1,774
ユアテック	12.1	7,272	カルビー	30.8	78,478	なとり	3.8	7,223	大王製紙	31.8	57,208
日本リーテック	4.5	6,268	森永乳業	12.6	68,544	イフジ産業	1.5	1,390	阿波製紙	1.2	439
四電工	2.4	3,904	六甲バター	5	7,640	ピックスコーポレーション	3.4	6,001	レンゴー	61.5	47,170
中電工	10.1	20,472	ヤフルト	50.1	284,067	ユージョレナ	35.3	28,063	トーモク	4.1	7,220
関電工	34.9	28,269	明治ホールディングス	44.7	297,702	ミヨシ油脂	2.4	3,040	ザ・パック	5.1	13,668
きんでん	47.1	77,385	雪印メグミルク	16.3	31,296	理研ビタミン	7.1	11,381	<b>化学 (6.8%)</b>		
東京エネシス	6.7	6,914	プリマハム	8.5	20,153	<b>繊維製品 (0.5%)</b>			北の達人コーポ	24	8,544
トーエネック	2.1	6,552	日本ハム	25.9	100,233	片倉工業	8.8	19,280	クラレ	96.3	90,907
住友電設	5.2	10,015	林兼産業	2.2	1,168	グンゼ	4.7	18,541	旭化成	436.7	467,924
日本電設工業	11.6	17,968	丸大食品	6.6	9,457	東洋紡	27.2	32,504	共和レザー	3.8	2,299
エクシオグループ	32.3	77,713	S Foods	6.1	20,038	ユニチカ	18.5	5,346	昭和電工	57.2	143,114
新日本空調	5.7	11,930	柿安本店	2.3	5,957	富士紡ホールディングス	2.9	10,918	住友化学	483.5	253,354
九電工	16.3	54,768	伊藤ハム米久HLDGS	43.8	28,119	倉敷紡績	5.6	10,203	住友精化	2.8	8,456
三機工業	13.6	18,672	サッポロホールディングス	23	50,140	シキボウ	3.1	2,771	日産化学	36	235,440
日揮ホールディングス	64.7	61,917	アサヒグループホールディング	159	666,846	日本毛織	20.2	16,988	ラサ工業	2.2	3,647
中外炉工業	2	3,104	キリンHD	248.5	451,524	ダイトウボウ	12.1	1,210	クレハ	5.2	41,080
ヤマト	6.2	4,575	宝ホールディングス	46	56,120	トア紡コーポレーション	2.3	982	多木化学	2.6	14,170
太平電業	4.9	13,259	オエノンホールディングス	19.9	7,084	ダイドーリミテツド	7.6	1,216	テイカ	4.6	5,349
高砂熱学	19.1	36,442	養命酒	2.1	3,717	帝国繊維	7.6	14,994	石原産業	10.8	12,592
三晃金属	0.9	2,070	コカ・コーラボトラーズHD	47.4	59,961	帝人	61.9	80,531	片倉コープアプリ	1.1	1,269
朝日工業社	1.3	3,651	サントリー食品インター	45.2	181,026	東レ	477.8	315,730	日本曹達	8.3	26,684
明星工業	13.6	8,867	ダイドーグループHD	3.5	17,185	住江織物	1.3	1,994	東ソー	94.9	154,781
大気社	10.2	29,580	伊藤園	20.5	136,735	日本フェルト	4.1	1,767	トクヤマ	21	37,464
ダイダ	4.7	9,635	キーコーヒー	6.9	13,392	イチカワ	0.8	1,084	セントラル硝子	11.5	22,356
日比谷総合設備	7	13,048	ユニカフェ	2	2,024	日東製網	0.9	1,305	東亜合成	39	45,864
フィル・カンパニー	1.2	2,630	ジャパンフーズ	0.9	1,092	アツギ	5.2	3,463	大阪ソーダ	6	15,330
インフロンIAHD	90	84,510	日清オイリオグループ	8.5	23,613	ダイニック	2.5	1,712	関東電化	14	14,112
東洋エンジニア	9.1	6,461	不二製油グループ	14.6	32,645	セーレン	13.4	30,458	デンカ	24	80,280
レイズネクスト	9.8	10,985	かどや製油	0.8	3,232	ソトー	1.8	1,485	信越化学	113.2	2,150,800
<b>食料品 (3.2%)</b>			J-オイルミルズ	6.3	10,401	東海染工	0.8	903	日本カーバイド	1.9	2,384
ニッパン	19.8	31,026	キッコーマン	48.6	420,876	小松マテール	10.9	12,829	堺化学	4.4	9,222
日清製粉G本社	76.4	124,990	味の素	149.2	508,324	ワコルホールディングス	16.5	33,214	第一稀元素化学工	6	7,668
日東富士製粉	1	3,455	キューピー	35.5	81,969	ホギメディアカル	8.8	26,400	エア・ウォーター	62.2	104,309
昭和産業	6.4	16,748	ハウス食品G本社	25.3	70,561	クラウディアHLDGS	1	240	日本酸素HLDGS	63.3	152,109
鳥越製粉	6.4	4,544	カゴメ	25.7	71,060	T S Iホールディングス	22.1	7,624	日本化学工業	2	5,040
中部飼料	7.8	7,363	焼津水産化工	3.4	3,165	マツオカコーポレーション	2.1	2,555	東邦アセチレン	1.2	1,432
フィード・ワン	9.3	6,640	アリアケジャパン	6.2	39,680	ワールド	8.6	10,225	日本パーカライズン	32.8	34,768
東洋精糖	1.3	1,465	ピエトロ	0.9	1,593	三陽商会	3.2	2,633	高圧ガス	10.1	7,433
日本甜菜糖	3.5	5,582	エバラ食品工業	1.5	3,460	ナイガイ	2.7	837	チタン工業	0.6	1,005
DM三井製糖ホールディ	6.1	11,358	やまひ	0.8	1,413	オンワードホールディングス	41.8	12,038	四国化成	8.4	11,474
塩水港精糖	10.3	2,193	ニチレイ	32.2	83,752	ルックホールディングス	2.1	2,709	戸田工業	1.5	5,160
日新製糖	3.3	5,375	東洋水産	32.5	149,500	ゴールドウイン	11.9	76,755	ステラ ケミファ	3.2	8,000
森永製菓	15.9	56,127	イートアンドHLDGS	2.6	5,405	デサント	12.9	59,469	保土谷化学	2.1	9,712
中村屋	1.6	5,768	大冷	0.8	1,528	キング	3.2	1,760	日本触媒	11	55,770
江崎グリコ	18.6	65,193	ヨシムラ・フード・HLDGS	3.6	2,257	ヤマインターナショナル	5.8	1,751	大日精化	5.3	11,660
名糖産業	3	4,950	日清食品HD	26.5	221,010	<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>			カネカ	17	62,900
井村屋グループ	3.8	8,215	永谷園ホールディングス	3	5,799	特種東海製紙	4	16,100	三菱瓦斯化学	61.1	115,417
不二家	4.1	9,151	一正蒲鉾	2.8	2,388	王子ホールディングス	275	144,375	三井化学	59.8	182,091
山崎製パン	50.7	74,782	フジッコ	7.5	13,560	日本製紙	30.9	32,939	J S R	61.4	260,336
第一屋製パン	1.3	687	ロックフィールド	7.5	10,785	三菱製紙	7.8	2,441	東京応化工業	11.4	81,168
モロゾフ	1.1	5,819	日本たばこ産業	362.2	823,461	北越コーポレーション	42.7	33,306	大阪有機化学	6.1	22,265
亀田製菓	3.8	16,435	ケンコーマヨネーズ	3.9	4,956	中越パルプ	2.3	2,231	三菱ケミカルHLDGS	440	392,568

銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
KHネオケム	11.1	34,188	マンダム	14.5	20,648	わかもと製菓	8.5	2,439	バンドー化学	11.1	9,435
ダイセル	95	74,385	ミルボン	8.5	48,960	日本新薬	17.6	147,840	<b>ガラス・土製品 (0.8%)</b>		
住友ベークライト	10.4	55,224	ファンケル	27.3	93,502	中外製薬	210.7	775,376	日東紡績	10.3	27,459
積水化学	137.8	254,241	コーセー	12.8	174,976	科研製薬	10.6	42,877	AGC	62	344,100
日本ゼオン	60.3	72,540	コタ	4.7	7,073	エーザイ	80.6	553,963	日本板硝子	34.2	17,168
アイカ工業	18.3	60,664	シーボン	0.8	1,348	ローテ製薬	34.6	111,931	石塚硝子	1	1,905
宇部興産	32.1	60,990	ポーラ・オルビスHD	28.9	58,435	小野薬品	154.8	387,851	日本山硝子	2.4	1,824
積水樹脂	10.2	20,593	ノビアホールディングス	5.7	29,925	久光製薬	17.8	71,022	日本電気硝子	28	82,292
タキロンシーアイ	16.4	8,560	アジュパホールディング	1.9	2,071	持田製薬	8.6	27,348	オハラ	2.8	3,816
旭有機材	5	7,450	エステー	4.4	6,762	参天製薬	125.7	189,052	住友大阪セメント	13.3	45,885
ニチパン	3.9	6,813	アグロカネショウ	2.5	2,930	扶桑薬品	2.4	5,685	太平洋セメント	39.1	85,980
リケンテクノス	16.2	7,792	コニシ	11.5	18,377	日本ケミファ	0.9	1,836	日本ヒューム	6.4	4,262
大倉工業	3.3	6,771	長谷川香料	11.5	32,338	ツムラ	20.9	67,611	日本コンクリート	13.3	3,351
積水化成	14.7	6,997	星光PMC	3.5	2,418	日医工	21	14,112	三谷セキサン	3.1	21,948
群栄化学	1.4	4,585	小林製薬	18.9	168,588	キッセイ薬品工業	11.9	27,179	アジアパイルHD	10.3	4,243
タイガース ポリマー	9.6	4,099	荒川化学工業	5.1	5,757	生化学工業	12	11,256	東海カーボン	57.6	67,795
ミライアル	2.1	3,416	メック	5.2	21,424	栄研化学	12	22,716	日本カーボン	4.2	17,409
ダイキアクシス	2.6	2,171	日本高純度化学	1.7	4,352	水製薬	2.7	2,535	東洋炭素	5.1	15,861
ダイキョーニシカワ	16.5	8,860	タカラバイオ	17.7	46,710	鳥居薬品	3.7	10,278	ノリタケ	3.9	18,057
竹本容器	2.9	2,244	JCU	7.5	36,000	JCRファーマ	19.3	48,230	TOTO	48.1	241,943
森六ホールディングス	3.5	5,985	新田ゼラチン	4.1	2,460	東和薬品	9.8	25,734	日本碍子	73.3	131,720
日本化薬	51.6	57,482	OATアグリオ	1.3	2,753	富士製薬工業	4.5	4,860	日本特殊陶業	51.5	97,232
カーリットホールディングス	6.3	4,113	デクセリアルズ	17.4	58,203	ゼリア新薬工業	12.3	23,603	ダントーホールディングス	6.2	1,227
日本精化	5.3	10,600	アース製薬	5.6	34,384	第一三共	529.2	1,494,725	MA RUWA	2.4	32,160
扶桑化学工業	5.9	27,848	北興化学	6.4	5,414	キョーリン製薬HD	13.6	22,956	品川リアクトリーズ	1.9	6,602
トリケミカル	6.8	23,800	大成ラミック	2	5,480	大幸薬品	10.5	8,484	黒崎播磨	1.4	5,460
ADEKA	30.2	72,812	クミアイ化学	27.1	21,625	ダイト	4.4	12,500	ヨータイ	5	6,055
日油	22.5	126,000	日本農薬	12.1	5,626	大塚ホールディングス	140	580,440	インソライト	4.3	3,986
新日本理化	13	3,172	アキレス	4.5	5,440	大正製薬HD	16.1	89,838	東京薬業	14.7	4,321
ハリマ化成グループ	4.7	3,717	有沢製作所	9.3	8,602	ペプチドリーム	35.4	101,314	ニッカトー	4.3	2,838
花王	148.9	861,684	日東電工	40.8	322,320	あすか製薬HD	7.8	7,503	フジミンコーポレートッド	5.6	41,160
第一工業製薬	2.4	7,428	レック	8.8	7,207	サワイグループHD	14.8	62,160	クニミネ工業	3	3,042
石原ケミカル	3.4	4,301	三光合成	8.5	3,179	<b>石油・石炭製品 (0.4%)</b>			エーアンドエーマテリアル	0.9	797
日華化学	2.1	1,717	きもと	12.7	2,667	日本コークス工業	58.3	7,112	ニチアス	15.6	40,029
ニイタカ	1.4	3,150	藤森工業	6	21,480	ニチレキ	8.7	11,370	ニチハ	9.4	26,235
三洋化成	3.8	19,342	前澤化成工業	4.5	5,629	ユシロ化学	3.4	3,529	<b>鉄鋼 (0.7%)</b>		
有機合成薬品	4.3	1,143	未来工業	2.5	4,040	ピービー・カストロール	2.4	3,276	日本製鉄	297.6	505,771
大日本塗料	7.8	6,169	ウェーブブロックHDGS	2.3	1,623	富士石油	18.9	4,573	神戸製鋼所	123.7	67,911
日本ペイントHOLD	247.7	295,506	ジェイ エス ピー	3.7	5,605	MORESCO	1.8	1,938	中山製鋼所	9.1	3,758
関西ペイント	68.2	173,910	エフエフ	12.5	46,812	出光興産	74.5	218,359	合同製鐵	3.5	4,599
神東塗料	5.8	1,061	天馬	6.3	15,132	ENEOSホールディングス	1,010.7	427,930	JFEホールディングス	179.7	236,485
中国塗料	16.4	14,136	信越ポリマー	11.7	11,126	コスエネルギーHDGS	19.4	43,165	東京製鐵	22.4	26,947
日本特殊塗料	4.9	3,885	東リ	16.5	3,613	<b>ゴム製品 (0.7%)</b>			共英製鋼	7.4	9,257
藤倉化成	7.5	3,675	ニフコ	23.1	72,072	横浜ゴム	39.2	69,227	大和工業	12.6	43,911
太陽ホールディングス	9.8	31,605	バルカー	7.2	17,582	TOYO TIRE	35.7	61,618	東京製鋼	2.7	3,350
DIC	27.6	78,522	ユニ・チャーム	129.8	634,462	ブリヂストン	193.8	892,449	大阪製鐵	3.3	3,342
サカタインクス	13.7	13,316	ショーエイコーポ	2.5	1,717	住友ゴム	60.9	69,365	淀川製鋼所	8.4	19,152
東洋インキSCホールディン	13.5	25,312	<b>医薬品 (4.8%)</b>			藤倉コンポジット	6.2	4,885	丸一鋼管	23.2	56,306
T&K TOKA	4.9	3,655	協和キリン	79.1	250,747	オカモト	4.5	16,965	モリ工業	1.9	4,890
富士フイルムHDGS	118.3	1,056,537	武田薬品	529.2	1,604,005	フコク	2.7	2,484	大同特殊鋼	11	43,230
資生堂	125.4	815,476	アステラス製薬	583.8	1,038,872	ニッタ	8.2	21,336	日本高周波	2.3	802
ライオン	81.3	130,974	大日本住友製薬	41.6	57,491	住友理工	15.5	8,897	日本冶金工	4.6	9,397
高砂香料	4.5	12,375	塩野義製薬	84.7	671,078	三ツ星ベルト	9.6	18,547	山陽特殊製鋼	6.5	11,817

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
愛知製鋼	3.8	9,222	高田機工	0.6	1,581	石川製作所	1.7	2,312	住友精密	0.9	1,873
日立金属	71.5	150,293	三和ホールディングス	62.8	76,176	東洋機械金属	3.3	1,640	日本ギア工業	2.4	657
日本金属	1.7	1,531	文化シャッター	21.1	21,289	津田駒工業	0.8	524	酒井重工業	1.1	3,028
大平洋金属	3.9	7,917	三協立山	9.4	6,429	エンシュウ	0.9	565	荏原製作所	28	170,800
新日本電工	44.3	12,935	アルincon	4.6	4,296	島精機製作所	9.5	18,126	石井鉄工所	0.7	2,097
栗本鉄工所	2.7	3,977	東洋シャッター	1.6	984	オプトラン	8.3	18,616	西島製作所	5.5	4,746
虹技	0.4	399	L I X I L	104.8	292,287	NCホールディングス	2.2	3,053	北越工業	6	5,676
日本鑄鉄管	0.7	780	日本フィルコン	7.9	4,068	イワキポンプ	4	4,016	ダイキン工業	85.8	1,986,270
三菱製鋼	4.4	4,268	ノーリツ	13.6	22,154	フリュー	6	7,632	オルگون	1.9	12,958
日亜銅業	7.2	1,886	長府製作所	6.9	13,806	ヤマシンフィルタ	14.8	7,740	トーヨーカネツ	2.6	6,484
日本鋼線	1.1	4,812	リンナイ	12.6	135,072	日阪製作所	8.1	6,382	栗田工業	36.7	194,510
エンビプロHD	2.8	5,311	ダイニチ工業	3.8	2,948	やまびこ	12.6	15,724	椿本チエイン	9.5	27,312
シンンツタン	14.2	3,024	日東精工	9.5	5,633	平田機工	3.1	18,507	大同工業	2.8	2,385
新家工業	1.6	2,728	三洋工業	0.9	1,665	ペガサスミシン製造	6.6	2,877	木村化工機	6.3	6,211
<b>非鉄金属 (0.7%)</b>			岡部	13.1	8,829	マルマエ	2.8	8,380	アネスト岩田	10.1	8,625
大紀アルミニウム	10.1	14,766	ジーテクト	8	10,664	タツモ	3.1	5,173	ダイフク	37	336,330
日本軽金属HD	16.2	27,037	東プレ	12.4	13,528	ナプテスコ	39	128,115	サムコ	1.7	4,948
三井金属	18	52,740	高周波熱錬	11.8	6,525	三井海洋開発	7.3	10,205	加藤製作所	2.6	1,989
東邦亜鉛	3.6	7,639	東京製綱	2.9	2,204	レオン自動機	6.9	9,032	油研工業	0.7	1,200
三菱マテリアル	43.9	85,780	サンコール	5.4	2,413	SMC	19.8	1,438,470	タダノ	34.9	35,179
住友鉱山	85	359,805	モリテックスチル	5.4	1,911	ホソカワミクロン	4.6	13,073	フジテック	24.8	59,073
DOWAホールディングス	18	75,960	パイオラックス	9.3	14,973	ユニオンツール	2.6	9,737	C KD	20.3	45,126
古河機金	10.3	12,339	エイチワン	6.4	3,974	オイレス工業	11.6	19,058	キトー	5.6	9,822
エス・サイエンス	23.3	675	日本発条	61.5	52,090	日精工エスビー	2.2	6,256	平和	18.7	34,557
大阪チタニウム	7.1	5,538	中央発條	4.4	3,687	サトーホールディングス	8.8	18,708	理想科学工業	5.7	11,525
東邦チタニウム	12.5	11,850	アドパネクス	1.1	1,230	技研製作所	5.9	24,367	SANKYO	14.5	41,963
UACJ	10	22,950	立川ブラインド	3.2	3,488	日本エアテック	3	3,630	日本金銭機械	6.6	4,540
CKサンエツ	1.4	4,697	三益半導体	5.2	12,173	カワタ	2	1,714	マースグループHLDGS	4.2	6,678
古河電工	21.4	48,257	<b>機械 (5.4%)</b>			日精樹脂工業	4.5	4,410	フクシマガリレイ	4.7	19,646
住友電工	248.7	370,438	日本ドライケミカル	1.6	2,835	オカダアイオン	1.8	2,550	オーイズミ	2.3	798
フジクラ	74.1	42,459	日本製鋼所	20.3	69,527	ワイエイシイホールディングス	2.6	2,410	ダイコク電機	3.1	3,689
昭和電線HLDGS	5.8	10,892	三浦工業	28.8	114,768	小松製作所	304.8	790,041	竹内製作所	10.1	27,451
東京特殊電線	1.1	2,921	タクマ	22.9	31,373	住友重機械	38.5	97,058	アミノ	17.6	43,841
タツタ電線	12.5	5,762	ツガミ	16	22,576	日立建機	26.9	88,770	JUKI	9.2	8,454
カナレ電気	0.8	1,362	オークマ	7.6	36,062	日工	8.5	5,185	サンデンホールディングス	8.9	2,233
平河ヒューテック	3.7	4,077	芝浦機械	7.3	24,601	巴工業	3.4	7,779	ジャノメ	5.6	3,483
リョービ	7.8	7,854	アマダ	104.4	110,977	井関農機	6.3	8,876	マックス	8.8	15,796
アーレステイ	6.6	2,389	アイダエンジニア	16.9	15,581	TOWA	5.8	18,560	グローリー	17.4	36,105
アサヒHD	26.5	50,721	滝澤鉄工所	1.1	1,227	丸山製作所	1.2	1,747	新晃工業	6.5	11,901
<b>金属製品 (0.6%)</b>			F U J I	30.5	75,914	北川鉄工所	3	4,179	大和冷機工業	10.9	13,145
稲葉製作所	3.7	4,839	牧野フライス	7.1	24,530	ロウツエ	3.3	39,435	セガミーホールディングス	66.7	123,061
宮地エンジニアリングG	2	5,812	オーエスジー	30.5	50,203	タカキタ	2.3	1,458	日本ピストンリング	2.7	3,291
トーカロ	16.8	24,931	ダイジェット	0.5	537	クボタ	328.2	777,505	リケン	2.7	6,579
アルファCO	2.5	2,675	旭ダイヤモンド	17	10,778	荏原実業	3.1	7,781	T P R	8.8	12,038
SUMCO	102.4	254,771	DMG森精機	39.7	70,427	三菱化工機	2.1	4,756	ツバキ・ナカシマ	15	20,550
川田テクノロジーズ	1.4	5,173	ソデイツク	16.1	12,348	月島機械	12	12,816	ホシザキ	19.7	169,814
RS TECHNOLOGIES	2.2	14,168	ディスコ	9.8	319,480	帝国電機製作所	4.5	6,259	大豊工業	6	4,368
信和	5.6	4,188	日東工器	4.1	7,134	東京機械	3.4	4,154	日本精工	127.5	98,302
東洋製罐グループHD	43.5	60,291	日進工具	5.1	7,287	新東工業	13.6	9,207	NTN	154.3	32,403
ホッカンホールディングス	5.1	7,191	パンチ工業	5.8	2,958	渋谷工業	5.9	16,862	ジェイテクト	66.4	65,868
コロナ	3.7	3,293	富士ダイス	2.8	1,800	アイチ コーポレーション	9.1	7,088	不二越	6	23,160
横河ブリッジHLDGS	11.6	24,603	豊和工業	3.7	2,871	小森コーポレーション	16.8	10,584	日本トムソン	21.6	14,925
駒井ハルテック	1.2	2,064	OK K	2.9	2,151	鶴見製作所	5	7,650	T H K	40	108,440

銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
ユーシン精機	4.6	3,348	テクノメディカ	1.4	2,240	新電元工業	2.7	9,126	日本ケミコン	6.3	11,346
前澤給装工業	5.1	5,105	ダイマンドエレクトロニクスHD	1.9	2,452	アズビル	39.6	198,792	KOA	9.9	15,147
イブグル工業	8.5	8,712	日本電気	85.5	437,760	東亜ディーケーケー	2.8	2,352	市光工業	9.8	4,860
前澤工業	4.9	2,842	富士通	60.6	1,138,977	日本光電工業	27.8	92,991	小糸製作所	36.9	240,957
日本ピラー工業	7.4	23,680	沖電気	27.4	22,961	チノー	1.9	2,718	ミツバ	12.7	5,829
キッツ	26.5	18,576	岩崎通信機	2.5	2,135	共和電業	6.6	2,560	SCREENホールディングス	11.7	134,550
マキタ	81.9	408,189	電気興業	3.5	8,813	日本電子材料	3.3	7,240	キャノン電子	6.2	9,213
三井E&S HD	21.7	8,224	サンケン電気	7.5	43,350	堀場製作所	12.4	83,700	キャノン	334.5	836,250
日立造船	56.7	47,684	ナカヨ	1.1	1,428	アドバンテスト	50	499,500	リコー	186.9	187,460
三菱重工業	105.8	270,953	アイホン	3.8	7,930	小野測器	2.3	1,122	象印マホービン	18.3	29,115
IHI	41.9	89,707	ルネサスエレクトロニクス	364.4	525,464	エスベック	5.3	11,145	MUTOHホールディングス	0.9	1,483
サヤスホールディングス	9.8	1,185	セイコーエプソン	83.5	152,805	キーエンス	61	4,290,130	東京エレクトロニクス	42.7	2,555,168
スター精密	10.4	15,038	ワコム	52.2	45,622	日置電機	3.3	29,238	<b>輸送用機器 (8.1%)</b>		
<b>電気機器 (19.8%)</b>			アルバック	12.5	81,250	シスメックス	56.9	805,704	トヨタ紡織	27.2	60,900
日清紡ホールディングス	40.9	33,497	アクセル	2.8	2,276	日本マイクロニクス	11.7	20,989	芦森工業	1.2	1,084
イビデン	35.4	250,278	EIZO	5.2	20,488	メガチップス	6.3	29,956	ユニプレス	9.6	6,816
コニカミノルタ	146.7	68,802	ジャパンディスプレイ	61.7	2,282	OBARA GROUP	2.9	9,628	豊田自動織機	54.4	507,008
ブラザー工業	82.1	160,423	日本信託	18	15,498	澤藤電機	0.8	1,353	モリタホールディングス	10.5	13,366
ミネベアミツミ	116	348,000	京三製作所	15.2	6,551	原田工業	2.9	2,818	三桜工業	9.5	8,901
日立	323.8	2,165,574	能美防災	9.3	18,590	コーセル	8.2	7,363	デンソー	148.2	1,234,654
東芝	117.6	532,375	ホーチキ	5.4	6,728	イリソ電子工業	5.7	26,077	東海理化電機	17.5	25,970
三菱電機	673.7	959,685	星和電機	4.4	2,191	オプテックスグループ	11.3	16,780	川崎重工	49	93,492
富士電機	40.7	241,758	エレコム	15.6	20,670	千代田インテグレ	2.7	5,856	名村造船所	21.9	4,401
東洋電機製造	3.2	3,360	パナソニック	718.2	892,363	アイ・オー・データ	2.4	1,860	日本車輛	2.2	4,417
安川電機	72.4	368,516	シャープ	76.8	97,536	レーザーテック	29.6	880,452	三菱ロジスネクスト	9.1	9,345
シンフォニア テクノロジー	8.3	10,466	アンリツ	43.3	76,424	スタンレー電気	46.9	138,448	近畿車輛	0.6	597
明電舎	11.6	30,020	富士通ゼネラル	18.3	47,214	岩崎電気	2.6	5,839	日産自動車	793.5	446,661
オリジン	1.3	1,640	ソニーグループ	421.7	5,830,002	ウシオ電機	35	73,745	いすゞ自動車	211	323,252
山洋電気	3	17,010	TDK	97.5	438,750	岡谷電機	4.6	1,476	トヨタ自動車	3,409.9	6,823,209
デンヨー	6.1	10,107	帝国通信工業	2.7	3,307	古河電池	6.2	1,686	日野自動車	84.6	79,862
東芝テック	7.3	31,791	タムラ製作所	25.8	17,776	エノモト	1.8	3,051	三菱自動車工業	250.8	91,792
芝浦メカトロニクス	1.2	9,900	アルプスアルパイン	59.4	60,766	日本セラミック	6.7	19,175	エフテック	5.3	2,628
マブチモーター	15.7	58,561	池上通信機	2	1,406	遠藤照明	3.3	3,375	レシップホールディングス	2.9	1,595
日本電産	174.5	2,268,500	日本電波工業	6	10,104	古河電池	4.9	7,168	GMB	1.6	1,124
ユーエムシーエレクトロニクス	2.9	1,394	鈴木	2.9	2,650	双信電機	3.3	2,095	ファルテック	1	665
トレッグ・セミコンダクター	3.4	12,869	日本トリム	1.3	4,368	山一電機	4.7	10,833	武蔵精密工業	15.4	27,288
東光高岳	4	5,216	ロランド ディー・ジー	4	10,336	図研	4.6	17,181	日産車体	9.5	6,422
ダブル・スコープ	19.3	15,999	フオスター電機	6.6	4,639	日本電子	14	132,580	新明和工業	19.5	16,477
ダイヘン	7.5	32,250	SMK	1.5	3,421	カシオ	48.8	71,931	極東開発工業	12.1	16,964
ヤーマン	11.5	11,592	ヨコオ	4.9	13,151	ファナック	59.1	1,314,679	トピー工業	5.4	5,675
JVCケンウッド	54.9	9,058	ティアック	11.2	1,377	日本シイエムケイ	12.8	6,451	ティラド	2	5,710
ミマキエンジニアリング	6.2	5,468	ホシデン	15.8	18,549	エンプラス	1.7	4,285	タチエス	11.6	13,270
IPEX	3.2	6,208	ヒロセ電機	10.4	198,120	大真空	10	15,700	NOK	32.4	39,333
日新電機	16	22,672	日本航空電子	15.8	28,677	ローム	30.1	319,963	フタバ産業	16.3	6,275
大崎電気	13.2	5,821	TOA	7.4	5,365	浜松ホトニクス	48.3	337,134	KYB	6.9	20,037
オムロン	56.3	617,329	マクセル	13.4	17,540	三井ハイテック	6.7	61,372	大同メタル工業	12.2	6,929
日東工業	9.5	14,126	古野電気	8	9,168	新光電気工業	19.7	105,395	プレス工業	33.3	12,420
IDEC	8.2	22,041	ユニデンホールディングス	1.4	4,690	京セラ	94.7	637,425	ミクニ	9	2,583
正興電機製作所	2.3	2,716	スミダコーポレーション	6.2	6,956	太陽誘電	32.6	204,076	太平洋工業	14.1	14,819
不二電機工業	1	1,257	アイコム	2.4	5,544	村田製作所	197.7	1,656,726	河西工業	7.2	1,915
ジーエス・ユアサ コーポ	22.4	51,654	リオン	2.6	5,551	双葉電子工業	10.8	7,441	アイシン	49.2	205,164
サクサホールディングス	1.5	2,022	本多通信工業	4.7	2,002	北陸電気工業	2.2	2,785	マツダ	211.9	194,524
メルコホールディングス	1.9	7,410	横河電機	67.2	143,472	ニチコン	21.8	25,331	今仙電機製作所	4.1	2,259

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
本田技研	529.9	1,643,219	パラマウントベッドHD	12.8	24,716	中国電力	104.8	93,376	日石輸送	0.6	1,564
スズキ	153.9	705,631	トランザクシオン	4.5	4,351	北陸電力	62.4	35,131	福山通運	10.5	39,480
SUBARU	192.6	412,645	粧美堂	1.9	729	東北電力	156.8	123,244	セイノールホールディングス	43.3	49,665
安永	3.2	3,081	ニホンフラッシュ	5.8	6,177	四国電力	60.2	45,451	エスライン	1.8	1,620
ヤマハ発動機	87.8	251,020	前田工業	7.6	26,676	九州電力	138.3	112,161	神奈川中央交通	1.6	5,152
TBK	6.5	2,554	永大産業	8.8	2,393	北海道電力	58.1	27,248	日立物流	12.3	56,949
エフセディ	9.9	15,939	アートネイチャー	6	3,876	沖縄電力	13.9	19,307	丸和運輸機関	13.8	19,044
豊田合成	22	49,918	パナダイナムコHLDGS	60.3	532,871	電源開発	57.2	82,654	C&Fロジホールディングス	6.5	9,763
愛三工業	10.6	8,066	アイフィスジャパン	1.8	1,162	エフオン	4.5	2,947	九州旅客鉄道	49.5	118,552
盟和産業	0.4	391	共立印刷	9.7	1,367	イーレックス	10.2	26,091	SGホールディングス	120.5	302,455
日本プラスト	4.7	2,326	S H O E I	6.5	31,200	レノバ	13.1	70,085	<b>海運業 (0.4%)</b>		
ヨロズ	6	6,324	フランスベッドHLDGS	9.8	8,359	東京瓦斯	129.1	251,099	日本郵船	53.4	395,160
エフ・シー・シー	10.6	15,221	パイロットコーポレーション	11.3	46,838	大阪瓦斯	121.8	222,528	商船三井	35.3	229,450
シマン	27.1	850,940	萩原工業	4.3	5,701	東邦瓦斯	30.9	99,034	川崎汽船	19.8	96,426
テイ・エス テック	28	37,324	トッパン・フォームズ	9.3	14,377	北海道瓦斯	3.1	4,560	NSユナイテッド海運	3.5	11,305
ジャムコ	3.8	3,142	フジシールインターナショナル	16.3	33,545	広島ガス	11.7	4,106	明治海運	7.5	5,145
<b>精密機器 (3.0%)</b>			タカラトミー	28	27,972	西部ガスHLDGS	7.4	15,688	飯野海運	29.3	15,148
テルモ	190.4	881,171	広済堂ホールディングス	4.2	3,439	静岡ガス	19.3	18,682	共栄タンカー	1.1	900
クリエートメディック	1.8	1,756	エステルホールディングス	1.3	826	メタウォーター	7.9	15,405	乾汽船	4.5	9,040
日機装	21.5	18,232	タカノ	2.1	1,344	<b>陸運業 (3.0%)</b>			<b>空運業 (0.4%)</b>		
日本エム・ディ・エム	3.9	7,550	プロネクサス	5.3	5,379	SBSホールディングス	5.4	18,711	日本航空	146.2	300,587
島津製作所	86.6	416,546	ホクシン	6.9	1,076	東武鉄道	65.8	168,777	ANAホールディングス	162	362,799
JMS	5.9	3,481	ウッドワン	2	1,904	相鉄ホールディングス	21.4	42,265	パスコ	1.1	1,427
クボテック	1	285	大建工業	4	8,632	東急	169.8	266,755	<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>		
長野計器	5.1	8,624	凸版印刷	102.1	175,918	京浜急行	86.3	96,828	トランコム	1.8	14,490
プイ・テクノロジ	2.9	9,990	大日本印刷	79.4	211,442	小田急電鉄	100.1	218,918	日新	5	7,615
東京計器	4.1	3,972	共同印刷	1.9	5,245	京王電鉄	34.9	178,339	三菱倉庫	20.1	55,757
愛知時計	1	4,505	N I S S H A	13.8	21,776	京成電鉄	46.9	145,859	三井倉庫HOLD	6.9	15,732
インターアクション	3.4	7,905	光村印刷	0.6	885	富士急行	8.1	33,250	住友倉庫	22.5	40,882
オーバル	6.6	1,669	TAKARA & COMPANY	3.3	5,712	新京成電鉄	1.6	3,152	渋沢倉庫	3.8	7,968
東京精密	11.4	54,720	アシックス	59.7	168,234	東日本旅客鉄道	118.5	827,841	東陽倉庫	10.6	3,233
マニ	26.8	44,488	ツツミ	1.7	3,519	西日本旅客鉄道	81.6	399,676	日本トランスシティ	14	7,756
ニコン	102.7	120,877	小松オール工業	2	3,692	東海旅客鉄道	56	873,600	ケイヒン	1	1,279
トプコン	31.5	56,416	ヤマハ	40	232,800	西武ホールディングス	87.8	95,263	中央倉庫	3.5	3,269
オリンパス	353	896,267	河合楽器	1.9	6,099	鴻池運輸	10.6	11,543	川西倉庫	1.2	1,280
理研計器	5.4	28,998	クリナップ	6.3	3,225	西日本鉄道	18.6	47,318	安田倉庫	5	4,650
タムロン	5.6	14,128	ピジヨン	40.8	93,880	ハマキョウレックス	4.7	13,395	ファイズホールディングス	1.4	772
HOYA	131.4	2,367,828	兼松サステック	0.5	894	サカイイ越センター	3.1	13,004	東洋埠頭	1.9	2,673
シード	2.9	1,626	キングジム	5.7	4,862	近鉄グループHLDGS	63.7	207,662	宇徳	5.4	2,786
ノーリツ鋼機	6.2	17,006	リントック	16.5	41,250	阪急阪神HLDGS	79.6	267,854	上組	35	73,465
イー・アンド・デイ	6.1	6,819	イトーヨー	12.9	4,411	南海電鉄	28.4	57,708	サンリツ	1.9	1,514
朝日インテック	73.8	183,614	任天堂	38	1,903,800	京阪ホールディングス	28.3	72,108	キムラユニティー	1.5	1,759
シチズン時計	78.4	40,689	三菱鉛筆	11	13,343	神戸電鉄	1.5	4,807	キューソー流通システム	3	2,646
リズム	2	2,380	タカラスタンダード	14	19,124	名古屋鉄道	52.4	86,984	近鉄エクスプレス	12	32,736
大研医器	5	2,725	コゴロ	32.5	53,820	山陽電鉄	4.7	9,071	東海運	3.6	1,072
メニコン	22.3	83,736	ナカパヤシ	5.8	2,894	日本通運	22.1	142,987	エーアイティー	4.1	4,669
シンシア	0.8	443	グローブライド	6	20,760	ヤマトホールディングス	89.3	223,607	内外トランスライン	2.7	4,930
松風	2.7	5,472	オカムラ	23.6	30,090	山丸	17.6	79,376	日本コンセプト	2.1	3,452
セイコーHD	9.7	21,320	美津濃	6.8	14,490	丸連	4.3	1,075	<b>情報・通信業 (8.6%)</b>		
ニプロ	49.9	53,642	<b>電気・ガス業 (1.1%)</b>			丸全昭和運輸	5.2	16,458	NECネットエスアイ	22.3	40,340
<b>その他製品 (2.2%)</b>			東京電力HD	503.8	152,651	センコグループHLDGS	32.3	29,909	クロスキャット	1.7	2,519
中本パックス	1.8	2,871	中部電力	205.4	235,388	トナミホールディングス	1.5	5,280	システナ	96	45,312
スノーピーク	9	34,875	関西電力	254.7	261,576	ニッコンホールディングス	21.3	42,237	デジタルアーツ	3.5	33,005

銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
日鉄ソリューションズ	千株	千円	さくらインターネット	千株	千円	ハイマックス	千株	千円	ネットワンシステムズ	千株	千円
キューブシステム	3.1	2,783	ヴィンクス	1.7	1,400	野村総合研究所	127.5	622,200	システムソフト	18.4	2,171
WOW WORLD	0.9	1,256	GMOグローバルサインHD	1.5	5,992	サイバネットシステム	5.3	3,614	アルゴグラフィックス	5.3	15,057
コア	2.6	3,978	S R Aホールディングス	3	8,274	C Eホールディングス	3.3	1,544	マーベラス	10.4	7,446
ラクーンホールディングス	4.7	7,205	システムインテグレータ	1.8	979	日本システム技術	1.3	3,664	エイベックス	11.7	19,831
ソリトンシステムズ	3.6	4,309	朝日ネット	6.2	3,732	インテラホールディングス	8.8	15,408	日本ユニシス	20.6	67,568
ソフトクリエイトHD	2.9	12,716	e B A S E	8.6	5,538	兼邦システムサイエンス	1.5	1,486	兼松エレクトロニクス	3.6	12,960
T I S	62.8	220,428	アバント	7.7	10,325	ソースネクスト	28	5,180	TBSホールディングス	40.2	68,943
JNSホールディングス	2.9	1,525	アドソール日進	2.7	4,611	インフocom	7.2	13,744	日本テレビH L D S	55.4	63,710
グリー	42.6	42,514	フリービット	4	4,880	H E R O Z	1.8	2,592	朝日放送グループHD	6.4	4,364
コーエーテックモHD	21.1	100,330	コムチュア	7.4	26,159	ラクスル	7.4	46,324	テレビ朝日HD	16	23,872
三菱総合研究所	2.7	10,017	サイバーコム	0.8	928	F I G	6.8	2,237	スカパーJ S A T H D	56.3	22,801
ボルテージ	2	688	アステリア	4.7	3,774	システムサポート	1.9	2,297	テレビ東京HD	4.8	9,729
電算	0.8	1,884	アイル	3.6	5,583	イーソル	4	2,664	日本B S 放送	2.4	2,644
A G S	3.1	2,545	マークラインズ	3.6	9,532	アルテリア・ネットワークス	8.6	13,235	ビジョン	11.9	15,696
ファインデックス	6.1	6,185	メディカル・データ・ビジ	8.9	11,828	東海ソフト	0.9	927	スマートパリュウ	1.8	900
ブレインパッド	1.7	9,588	g u m i	9.5	7,752	ヒト・コミュニケーションズHD	1.5	3,624	USEN-NEXT HLDGS	6.8	21,998
K L a b	12.1	6,727	ショーケース	1.9	950	トピラシステムズ	1.3	1,202	ワイヤレスゲート	2.9	939
ポルトゥワイン・ピットクル	9.4	9,061	モバイルファクトリー	2.1	2,034	S a n s a n	24	75,120	コネクシオ	4.6	6,472
イーブクイニシアティブ	0.3	1,416	テラスカイ	2.5	5,122	フォーカスシステムズ	4.2	4,296	日本通信	55.1	14,877
ネクソン	148.8	335,395	デジタル・インフォメーション	2.8	3,894	クレスコ	4.7	9,024	クロップス	1.1	1,219
アイスタイル	21.6	5,940	P C Iホールディングス	2.9	3,306	フジ・メディア・HD	63.7	71,853	日本電信電話	772.6	2,414,375
エムアップホールディングス	2	8,600	パイプドHD	1.6	3,955	オービック	20.8	436,592	K D D I	481.6	1,589,280
エイチーム	4.6	4,866	アイビシー	0.9	665	ジャストシステム	9.5	49,305	ソフトバンク	1,000.6	1,563,437
エニゴモ	7.2	7,020	ネオジャパン	1.8	2,345	T D Cソフト	5.9	7,038	光通信	7.8	128,388
テクノスジャパン	5.3	2,756	P R T I M E S	1.8	5,733	Zホールディングス	960.6	722,371	エムティーアイ	7.6	4,438
e n i s h	4.1	1,500	ラクス	22.7	69,689	トレンドマイクロ	35.3	231,215	GMOインターネット	23.7	67,734
コプラ	21.7	15,038	ランドコンピュータ	1.5	1,227	I Dホールディングス	3.7	3,082	ファイバーゲート	2.2	2,373
オルトプラス	5.1	1,698	ダブルスタンダード	2	7,490	日本オラクル	13.5	150,660	アйдママーケティングコム	1	313
ブロードリーフ	33.8	16,224	オープンドア	3.9	7,125	アルファシステムズ	1.7	6,477	K A D O K A W A	19.3	116,186
クロス・マーケティングG	3.3	3,646	マイネット	2.6	1,562	フューチャー	7.9	32,034	学研ホールディングス	9.6	9,388
デジタルハーツHLDGS	3	7,434	アカツキ	3	8,214	C A C H O L D I N G S	3.6	5,389	ゼンリン	10.9	10,191
システム情報	5.4	4,752	ベネフィットジャパン	0.7	1,853	S Bテクノロジ	2.9	7,818	昭文社ホールディングス	2.7	1,290
メディアドゥ	2.4	10,980	UBICOMホールディングス	1.7	4,862	トーセ	1.7	1,212	インプレスホールディングス	8.9	1,869
じげん	18.3	5,654	カナミックネットワーク	7.5	3,682	オービックビジネスC	6.5	33,150	アイネット	3	3,900
エイキューブ	7	7,945	ノムラシステム・コーポレーション	3.9	959	伊藤忠テクノソリューション	30.5	112,697	松竹	4.4	48,224
エンカレッジ・テクノロジ	1.1	672	チェンジ	12.6	26,586	アイティフォー	7.5	5,940	東宝	39	196,950
サイバーリンクス	2.6	2,722	シンクロ・フード	3.7	1,309	東計電算	0.9	4,635	東映	2.2	40,920
ディー・エル・イー	4.3	1,272	オクネット	3.9	6,575	エックスネット	0.9	885	N T Tデータ	175.8	420,865
フィックスターズ	7.1	5,900	セグエグループ	2	1,470	大塚商会	35.9	186,321	ピー・シー・イー	3.9	5,705
CARTA HOLDINGS	2.7	5,751	エイトレッド	0.9	2,034	サイボウズ	9.2	19,899	ビジネスS 太田昭和	2.6	5,106
オプティム	4.6	6,610	マクロミル	13.5	12,406	電通国際情報S	9.8	36,064	D T S	12.5	29,587
セレス	2.6	5,855	ビーグリー	1.7	3,034	A C C E S S	7.3	5,569	スクウェア・エニックス・HD	30.7	182,051
S H I F T	3.4	86,088	オロ	2.1	7,140	デジタルガレージ	10.9	54,282	シーイーシー	7.2	8,942
ティエーガイア	5.9	9,534	ユーザーローカル	2	3,252	イーエムシステムズ	11.7	8,131	カブコム	62.3	176,246
セック	0.8	1,809	テモナ	2	966	ウェザーニューズ	2	19,240	アイ・エス・ビー	3	3,039
テクマトリックス	11.1	21,700	ニーズウェル	1.8	1,024	C I J	4	3,220	ジャステック	3.6	3,664
プロシップ	2.2	3,381	マネーフォワード	10	78,200	ビジネスエンジニアリング	0.8	2,720	S C S K	45.9	98,914
ガンホー・オンライン・エンター	17.9	54,416	サンポスト	2.1	3,021	日本エンタープライズ	8.4	1,495	日本システムウエア	2.3	4,949
GMOペイメントゲートウェイ	12.9	196,467	電算システムHD	2.7	6,088	WOWOW	3.3	6,712	アイネス	5.7	7,923
ザッパラス	4.1	2,185	ソルクシーズ	6	2,778	スカラ	6.5	3,952	T K C	11.5	37,835
システムリサーチ	2.1	3,834	フェイス	1.9	1,202	インテリジェントウェイブ	3.3	1,722	富士ソフト	7.2	38,016
インターネットイニシアティブ	18	87,480	プロトコポレーション	7.1	9,024	IMAGICA GROUP	5.6	4,407	N S D	21.6	45,727

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
コナミホールディングス	24	139,440	ヤマエグループHD	4.5	4,513	山善	29.2	28,382	丸紅建材リース	0.3	522
福井コンピュータHLDS	3	11,460	小野建	6.1	9,589	椿本興業	1.5	5,820	日鉄物産	4.6	21,183
JBCホールディングス	4.2	7,404	南陽	1.2	2,274	住友商事	420.7	650,402	泉州電業	1.9	8,721
ミロク情報サービス	5.7	8,344	佐島電機	4	3,724	内田洋行	2.8	12,978	トラスコ中山	14.2	37,360
ソフトバンクグループ	396.1	2,388,483	エコトレーディング	1.3	768	三菱商事	497.9	1,688,378	オートバックスセブン	22.2	29,059
<b>卸売業 (5.1%)</b>			伯東	4.4	9,790	第一実業	3.3	16,137	モリト	4.9	3,140
ホウスイ	0.6	527	コンドーテック	5.3	5,088	ヤシノマーケティングJPN	16.4	36,080	加藤産業	9.6	30,432
高千穂交易	2.5	3,115	中山福	3.3	1,181	西華産業	3.3	4,973	北恵	1.7	1,392
オルパヘルスケアHLDS	1	1,495	ナガイレベーン	8.9	20,843	佐藤商事	5.1	5,421	イノテック	3.9	5,280
伊藤忠食品	1.6	7,848	三菱食品	6.4	17,216	三菱エレクトロ	3.9	8,771	イーローハット	11.5	17,825
エレマテック	5.8	5,852	松田産業	5.2	14,045	東京産業	6.6	4,877	J Kホールディングス	5.3	5,459
J A L U X	1.7	4,338	第一興商	12.9	46,182	ユアサ商事	6.6	18,460	日伝	6.3	13,734
あらた	5.3	20,405	メディアパルHD	71.6	146,064	神鋼商事	1.7	5,346	北沢産業	4.4	1,095
トーマンデバイス	1	6,720	S P K	2.5	3,250	トルク	9.2	1,904	杉本商事	3	6,270
東京エレクtronデバイス	2	13,540	萩原電気HLDS	2.4	4,780	阪和興業	13.5	41,445	因幡電機産業	18.4	45,245
フィールズ	5.9	3,138	アズワン	4.8	67,440	正栄食品	4.3	16,232	東テク	2.3	5,347
双日	74.2	119,165	スズデン	2.2	3,570	カナデン	6.9	6,803	ミスミグループ本社	83.3	398,590
アルフレックホールディングス	73.8	113,504	尾家産業	1.8	1,882	菱電商事	6.3	10,565	アルテック	6.3	1,877
横浜冷凍	18.2	14,614	シモジマ	4.2	4,531	岩谷産業	16.1	92,253	タキヒヨー	2	3,380
神栄	1.2	985	ドウシシャ	7.1	10,422	ナイス	2.5	4,030	蔵王産業	0.9	1,670
ラサ商事	4.4	3,770	小津産業	1.2	2,281	ニチモウ	1	2,029	スズケン	26	80,210
アルコンックス	7.5	8,812	高速	3.9	5,744	極東貿易	2.1	4,897	ジェコス	4.5	3,456
神戸物産	51.6	220,848	たけびし	3	4,161	アステナホールディングス	10.8	5,248	グローセル	7.3	2,861
ハイパー	1.7	933	リックス	3.4	4,906	三菱石油	16.3	19,299	<b>小売業 (4.2%)</b>		
あい ホールディングス	9.5	18,411	丸文	5.6	4,793	稲畑産業	15.6	23,852	ローソン	14.6	80,884
ディー・ブイエックス	2.1	2,110	ハピネット	6	8,574	G S I クレオス	3.2	3,267	サンエー	5	19,950
ダイワボウHD	32.2	58,249	橋本総業HLDS	1.4	2,674	明和産業	6.4	5,241	カワチ薬品	5.1	11,010
マクカ・富士HLDS	16	40,928	日本ライフライン	19.5	20,631	クワザフホールディングス	2.7	1,544	エービーシー・マート	10.3	55,002
ラクト・ジャパン	3	7,008	タカショー	5.1	3,646	ワキタ	13.8	14,158	ハードオフコーポレーション	3	2,097
バイタルK S K HD	11.8	9,027	I DOM	20.1	13,848	東邦ホールディングス	21.4	36,208	アスフル	11.2	15,892
八洲電機	4.6	4,140	進和	3.7	7,178	サンゲツ	17.6	26,734	ゲオホールディングス	8.9	10,582
メディアスホールディングス	3.9	3,521	エスケイジャパン	2.6	1,136	ミツウロコグループ	9.9	11,533	アダストリア	7.2	13,413
レスターホールディングス	6.1	11,297	グイトロン	2.7	5,437	シナネホールディングス	2.5	8,550	ジーフット	4.1	1,574
ジューテックHD	1.6	1,652	シークス	9.4	12,511	伊藤忠エネクス	14.9	14,169	シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1	380
大光	2.5	1,722	田中商事	2.1	1,304	サンリオ	20.5	50,819	くら寿司	7.1	26,554
OCHIホールディングス	2	2,512	白鳥ハシテクニカ	3.5	5,141	サンフ テクノス	3.9	6,532	キャンドウ	1.8	4,167
TOKAIホールディングス	31.5	26,019	オ鋼	2	4,710	リョーサン	7.2	15,177	バルグループHLDS	5.9	9,121
黒谷	1.5	882	ダイコー通産	0.8	939	新光商事	9.5	8,293	エディオン	30.4	30,369
Cominix	0.5	360	伊藤忠	465.3	1,516,878	トーホー	3.1	4,262	サーユーコーポレーション	13.6	7,738
三洋貿易	7.7	7,461	丸紅	654	665,445	三信電気	2.9	4,045	ワッツ	3.3	2,442
ビューティガレージ	1.1	4,108	高島	1	2,147	東陽テクニカ	6.9	7,431	ハローズ	3	7,941
ウイン・パートナーズ	4.6	4,324	長瀬産業	36	60,588	モスフード サービス	8.7	26,578	フジオフードG本社	5.7	7,660
ミタチ産業	1.1	979	蝶理	3.6	6,163	加賀電子	6.2	18,178	あみやき亭	1.6	4,592
シッパヘルスケアHD	21.2	53,636	豊田通商	66.9	331,489	ソーダニツカ	6.4	4,326	ひらまつ	14.2	2,754
明治電機工業	1.7	2,084	三共生興	8.5	4,649	立花エレテック	5.1	7,746	大黒天物産	2.1	12,852
デリカフーズHLDS	2.8	1,654	兼松	25.9	31,882	フォーバル	3	2,973	ハニーズホールディングス	5.3	5,300
スターティアホールディングス	1.6	1,814	ツカモトコーポレーション	1.1	1,496	P A L T A C	9.3	40,966	ファーマライズHD	1.9	1,426
コマダホールディングス	14.6	28,382	三井物産	516	1,319,412	三谷産業	9.4	2,791	アルペン	5.3	11,522
ピーバンドットコム	1.2	703	日本紙パルプ	3.3	11,797	太平洋興発	2.2	1,300	ハブ	2.2	1,452
アセンテック	2.2	2,567	カメイ	7.8	7,737	西本WISMETTAC HD	1.5	4,830	クオールホールディングス	8.2	11,324
富士興産	2.1	2,167	東都水産	0.4	1,800	ヤマシタヘルスケアHLDS	0.9	1,786	ジンスホールディングス	4.5	29,025
協栄産業	0.5	745	OUGホールディングス	1	2,525	国際紙パルプ商事	15.9	4,944	ビックカメラ	39.3	36,824
フルサト・マルカHD	6.3	12,593	スターゼン	5	9,220	ヤマタネ	2.9	4,396	DCMホールディングス	40.9	42,985

銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
ペッパーフードサービス	9.2	3,597	クサりのアオキHLDGS	6.6	47,454	日本瓦斯	32.6	46,194	ベルク	2.9	15,254
Monotaro	84.2	189,955	力の源HD	3.3	1,966	ロイヤルホールディングス	11.6	21,100	大庄	3.5	3,230
東京一番フーズ	1.7	994	FOOD&LIFE COMPAN	38.9	187,692	東天紅	0.5	500	ファーストリテイリング	8.9	599,860
DDホールディングス	3.5	1,606	メディカルシステムネットワーク	6.5	4,030	いなげや	8.1	10,538	サンドラッグ	25	74,725
きちりホールディングス	1.4	648	一家ホールディングス	1.5	811	チヨダ	6.4	4,492	サックスパーホールディング	6.1	3,172
アークランドサービスHD	5.5	12,397	はるやまHLDGS	3.1	1,729	ライフコーポレーション	6.2	20,801	ヤマザワ	1.4	2,352
J. フロント リテイリング	79.4	74,000	ノジマ	10.8	24,030	リンガーハット	8.2	17,515	やまや	1.3	3,026
ドトール・日レスHD	11.4	17,293	カップ・クリエイト	9.3	12,341	Mr Max HD	8.3	4,390	ペルーナ	14.9	9,938
マツキヨコカラ&カンパニー	40.8	181,560	ライトオン	5	3,475	テンアライド	6.6	2,032	<b>銀行業 (4.7%)</b>		
プロンコピリー	3.8	8,656	良品計画	76.3	140,010	AOKIホールディングス	13.3	8,166	島根銀行	2.2	1,183
ZOZO	45.6	164,844	三城ホールディングス	7.9	1,856	オーフウ	10.2	9,741	じもとホールディングス	5	2,925
トレジャー・ファクトリー	2.1	1,829	アドヴァングループ	6.8	6,004	コメリ	10.2	24,928	めびきフィナンシャルG	344.2	77,100
物語コーポレーション	3.5	25,375	アルビス	2.1	4,439	青山商事	13.7	9,850	東京きらぼしFG	8.8	12,258
三越伊勢丹HD	116.5	90,404	コナカ	7.8	2,425	九洲フィナンシャルG	7.7	74,690	九州フィナンシャルG	135.7	51,566
Hamee	1.9	2,107	ハウス ローゼ	0.8	1,328	はせがわ	3.4	782	ゆうちょ銀行	156.7	145,417
ウエルシアHD	35.2	141,680	G-7ホールディングス	7.8	12,901	高島屋	49.2	48,954	富山第一銀行	16.1	4,282
クリエイトSDH	9.8	30,576	イオン北海道	11.6	15,474	松屋	13.3	11,145	コンコディア・フィナンシャル	379	156,527
丸善CHI HD	7.7	2,787	コジマ	12.3	6,838	エフ・ツー・オーリテイリング	32.5	25,675	西日本フィナンシャルHD	43.3	29,530
ミサワ	1.9	1,240	ヒマラヤ	2.2	2,010	近鉄百貨店	2.5	6,070	33FG	6	8,130
ティーライフ	1.4	1,834	コーナン商事	9.6	31,872	丸井グループ	56.4	117,650	第四北越フィナンシャルG	10.8	24,840
エー・ピーホールディングス	1.7	749	エコス	2.5	4,370	アクシアリ リテイリング	5.1	16,626	ひろぎんHLDGS	98.7	61,391
チムニー	2	2,458	ワタミ	8.2	6,970	井筒屋	3.1	957	おきなわFG	5.8	11,982
シュッピン	5.5	5,351	マルシェ	1.5	603	イオン	255.1	674,611	十六FG	8.9	17,586
オイシックス・ラ・大地	9.5	31,730	パナソニックHD	132.6	256,713	イズミ	11.9	37,425	北國FHD	6.2	13,106
ネクステージ	13.7	31,373	西松屋チェーン	14.9	22,305	平和堂	12.2	22,606	新生銀行	43.3	82,962
ジョイフル本田	19.4	30,264	ゼンショーホールディングス	32.4	83,624	フジ	8	15,360	あおぞら銀行	37	91,464
鳥貴族ホールディングス	2.6	4,303	幸楽苑ホールディングス	4.2	5,934	ヤオコー	7.5	50,175	三菱UFJフィナンシャルG	4,258.4	2,561,001
ホットランド	4.9	6,370	ハークスレイ	3.2	1,433	ゼビオホールディングス	9	7,911	りそなホールディングス	760.7	316,146
すかいらーくHD	92.6	136,029	サイゼリヤ	10.2	29,845	ケーズホールディングス	61.2	70,318	三井住友トラストHD	125.5	446,780
SFPホールディングス	3.3	4,293	V Tホールディングス	25.2	10,609	OLYMPICグループ	3.4	2,077	三井住友フィナンシャルG	459.7	1,702,269
綿半ホールディングス	5	6,075	魚力	1.9	3,708	日産東京販売HD	8.9	2,002	千葉銀行	221.5	146,411
ヨシックスホールディングス	1.3	2,563	ポプラ	1.8	313	シルバーライフ	1.5	1,930	群馬銀行	127.2	42,103
ユナイテッド・スーパーマーケット	19	19,000	フジ・コーポレーション	3.6	4,190	GENKY DRUGSTORES	2.9	14,848	武蔵野銀行	9.9	15,424
ゴルフダイジェスト・オン	3.9	3,935	ユナイテッドアローズ	7	13,321	カルミヤ・インタナショナル	1.6	1,660	千葉興業銀行	15.8	3,871
B E E N O S	3.6	9,835	ハイデイ日高	9.6	15,081	ブックオフGHD	3.8	3,686	筑波銀行	26.2	4,113
あさひ	5.6	7,190	YU-WA CREATION H	3.6	756	アインホールディングス	9.7	59,267	七十七銀行	20.6	23,813
日本調剤	4.2	5,321	コロワイド	27.3	41,550	気象寿司	1.8	4,402	青森銀行	5.1	8,124
コスモス薬品	6.7	117,987	ピーシーデポコーポ	7.9	2,535	ヤマダホールディングス	242.5	96,030	秋田銀行	4.2	6,006
トーエル	3.1	2,399	香番屋	4.7	20,844	アークランドサカモト	10.4	17,253	山形銀行	7.4	6,001
オンリー	1.1	834	トッパカルチャー	2.5	750	ニトリホールディングス	26.3	474,189	岩手銀行	4.4	7,084
セブン&アイ・HLDGS	259.4	1,181,307	P L A N T	1.6	1,115	グルマ軒屋	5.3	5,204	東邦銀行	54.8	10,631
クワイエ・レストラン・ホール	31.7	21,556	スギホールディングス	13.3	94,962	愛眼	4.1	774	東北銀行	3.1	2,988
ツルハホールディングス	14.5	185,600	兼正堂ホールディングス	3.3	7,055	ケユーホールディングス	3.4	3,175	みちのく銀行	4.5	3,289
サンマルホールディングス	5.2	7,321	ヴィア・ホールディングス	8.5	1,300	吉野家ホールディングス	23.1	51,397	ふくおかフィナンシャルG	55.9	102,744
フェリシモ	1.6	2,113	スクロール	10.2	7,823	松屋フーズHLDGS	3.2	10,976	静岡銀行	161.8	129,440
トリドールホールディングス	16.6	40,188	ヨンドシーホールディングス	6.2	9,889	サガミホールディングス	10.3	10,207	スルガ銀行	63	29,673
TOKYO BASE	6.9	4,616	木曾路	8.7	18,165	関西スーパーマーケット	5	9,170	八十二銀行	149.3	53,150
ウエルプラスHLDGS	1	883	SRSホールディングス	9.1	6,752	王将フードサービス	4.4	25,432	山梨中央銀行	6.9	5,437
JMホールディングス	4.9	8,437	千趣会	11.9	4,617	プレナス	7.5	14,512	大垣共立銀行	13.2	23,377
サツドラホールディングス	3	2,040	タカキユー	7.3	890	ミニストップ	5.4	7,349	福井銀行	5.9	7,858
アレンザホールディングス	5.1	5,207	リテールパートナーズ	8	9,696	アークス	12.7	26,250	清水銀行	2.8	4,244
串カツ田中HLDGS	1.8	3,479	ケーヨー	12.3	9,876	パローホールディングス	14.6	30,893	富山銀行	1.2	2,035
パロックジャパン	4.9	4,037	上新電機	7.6	15,564	藤久	1.6	1,233	滋賀銀行	12.4	21,712

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
南都銀行	10.2	18,258	マネックスG	54.1	50,367	プレサンスコーポレーション	8.5	14,569	グランディハウス	5.2	2,381
百五銀行	63.6	20,224	極東証券	8.9	6,514	ハブコム	0.7	878	日本空港ビルデング	25.3	126,500
京都銀行	23.9	115,317	岩井コスモホールディング	6.3	8,139	日本管理センター	3.7	3,781	<b>サービス業 (6.2%)</b>		
紀陽銀行	23.4	31,800	アイザワ証券グループ	11	10,846	サンセイラントディック	1	778	明豊ファシリティーワークス	2.9	2,438
ほくほくフィナンシャルG	41.3	31,801	マネーパートナーズGP	9.1	1,983	エストラスト	1.1	674	日本工営	3.8	12,046
山陰合同銀行	39.3	22,165	スパークス・グループ	31.6	9,859	フージャースHD	7.3	4,599	L I F U L L	22.5	5,805
中国銀行	53.1	44,391	小林洋行	2.3	565	オーブンプラス	21.2	136,528	ミクシィ	14.8	29,910
鳥取銀行	2	2,204	<b>保険業 (1.9%)</b>			東急不動産HD	194.5	113,977	ジェイエイチリクルートメント	5.5	10,934
伊予銀行	88.3	46,269	かんぽ生命保険	66.8	117,434	飯田GHD	55.3	129,844	日本M&Aセンターホールデ	105.5	351,842
百十四銀行	6.9	9,315	SOMPOホールディングス	117	546,858	イーグランド	0.8	1,246	メンバーズ	2	4,666
四国銀行	9.7	6,828	アニコムホールディングス	20.5	15,928	ピーロッド	3.9	1,961	中広	1.1	424
阿波銀行	10.2	20,757	MS & AD	148.9	493,752	ファーストブラザーズ	1.5	1,384	UTグループ	9.4	38,070
大分銀行	3.9	6,552	第一生命HL D G S	326.8	747,391	ハウスドゥ	2.9	2,624	アイティメディア	3.1	6,218
宮崎銀行	4.1	8,003	東京海上HD	218.7	1,248,339	シーアールイー	1.9	3,178	E・Jホールディングス	3.3	3,890
佐賀銀行	3.7	5,209	T & Dホールディングス	172.4	231,360	プロパティエージェン	0.7	1,218	夢真ビーネックスグループ	17.6	29,321
琉球銀行	14.6	10,395	アドバンスクリエイト	3.2	3,139	ケイアイスター不動産	3	25,590	コシダカホールディングス	18.6	11,122
セブン銀行	196.9	44,893	<b>その他金融業 (1.1%)</b>			アプレ都市デザイン	0.9	1,528	アルトナー	1.3	1,072
みずほフィナンシャルG	849.7	1,191,279	全国保証	15.9	78,864	ジェイ・エス・ビー	1.4	3,827	パナナグループ	7.3	25,878
高知銀行	2.5	1,797	ジェイリース	2.5	5,137	テンポイノベーション	1.6	1,329	C D S	1.5	2,457
山口フィナンシャルG	77	47,817	イントラスト	3.1	2,247	グローバルリマネジメント	0.8	745	リンクアンドモチベーション	14.5	10,251
長野銀行	2.2	2,420	日本モーゲージサービス	3.9	4,048	パーク24	35.8	57,638	エス・エム・エス	22.2	94,017
名古屋銀行	4.9	10,745	C a s a	2.6	2,282	パラカ	1.9	2,861	サニーサイドアップG	2.1	1,533
北洋銀行	101.2	23,377	アルビ	10.1	10,110	宮越ホールディングス	2.7	3,248	パーソルホールディングス	64.2	210,576
愛知銀行	2.4	8,412	プレミアグループ	3.4	11,900	三井不動産	302.3	706,172	リニカル	3.4	2,893
中京銀行	2.6	3,081	クレディセゾン	42.8	48,107	三菱地所	435.5	681,557	クックパッド	21.7	5,555
大光銀行	2.3	2,911	芙蓉総合リース	7.0	50,260	平和不動産	11.5	39,100	エスクリ	3.1	1,277
愛媛銀行	9.3	6,696	みずほリース	10.5	31,122	東京建物	65.4	105,163	アイ・ケイ・ケイホールディン	3.4	2,067
トマト銀行	2.3	2,311	東京センチュリー	12.9	69,918	ダイビル	16.9	24,741	学情	2.8	3,021
京葉銀行	28	11,816	日本証券金融	26.3	21,408	京阪神ビルディング	10.5	14,458	スタジオアリス	3	6,066
栃木銀行	31.7	5,515	アイフル	113.8	40,057	住友不動産	139.1	492,274	シミックホールディングス	3.6	5,565
北日本銀行	2.1	2,969	リコーリース	6	21,690	テーオーシー	12.1	6,727	エプコ	1.5	1,213
東和銀行	12.2	5,856	イオンフィナンシャルサービス	36.1	44,294	東京楽天地	1	3,980	N J S	1.3	2,525
福島銀行	7.7	1,555	アコム	132	44,484	スターツコーポレーション	8.8	21,375	総合警備保障	25.5	123,420
大東銀行	3.1	2,033	ジャックス	7.7	21,198	Fジ住宅	7.7	5,112	カカコム	47.8	151,765
トモホールディングス	51.2	14,899	オリコ	181.6	22,518	空港施設	7.2	3,780	アイロムグループ	2.4	4,101
フィデアホール	5.9	7,062	オリックス	403	904,735	明和地所	3.4	1,870	セントケア・ホールディング	4.3	3,199
池田泉州HD	74.9	11,160	三菱HCキャピタル	246.3	131,524	ゴールドフレスト	4.7	7,012	サイネックス	1.3	812
<b>証券、商品先物取引業 (0.7%)</b>			九州リースサービス	3.3	1,867	エスリード	2.5	3,997	ルネサンス	4.7	5,306
F P G	22.7	12,507	日本取引所グループ	168.3	413,849	日神グループHL D G S	9.3	4,324	ディップ	11.4	45,372
マセキアホールディングス	2.2	1,599	イー・ギャランティ	9.8	24,078	日本エスコ	13.1	9,825	デジタルホールディングス	4.9	6,811
S B Iホールディングス	81.9	239,475	アイサックス	4.2	2,872	タカラレコーン	29.3	7,793	新日本科学	8.1	13,081
日本アジア投資	5.9	1,103	NECキャピタルソリューション	3	5,742	A V A N T I A	2.8	2,318	キャリアデザインセンター	1.6	1,544
ジャフコグループ	8.7	61,944	<b>不動産業 (1.8%)</b>			イオンモール	33.1	53,191	ベネフィット・ワン	23.5	125,020
大和証券G本社	497.1	313,620	いちご	74.3	21,101	毎日コムネット	2.7	1,962	エムスリー	113.6	695,118
野村ホールディングス	1,013	483,606	日本駐車場開発	73.5	9,996	ファースト住建	2.9	3,433	ツカダ・グローバルHOLD	4.9	1,386
岡三証券グループ	52	19,188	スター・マイカ・HLDGS	3.5	4,336	ランド	371.2	4,083	プラス	1.4	898
丸三証券	19.7	9,830	ADワークスグループ	13.1	2,056	カチタス	16.4	68,716	アウトソーシング	37.4	56,249
東洋証券	21.7	3,103	ヒューリック	157.9	169,900	トーセイ	9.3	8,955	ウェルネット	6.3	2,828
東海東京HD	75.5	28,086	三栄建築設計	2.5	4,052	穴吹興産	1.1	2,051	ワールドホールディングス	2.6	6,575
光世証券	1.4	700	野村不動産H L D G S	33.9	83,563	サンフロンティア不動産	8.5	8,143	ディー・エヌ・エー	24.6	41,328
水戸証券	17.8	4,788	三重交通グループHD	13	5,928	インテリックス	0.9	588	博報堂D Y H L D G S	89.3	151,184
いちよし証券	12.4	7,675	サムティ	10.4	23,774	ランドビジネス	2.3	568	ぐるなび	10.7	5,018
松井証券	32.5	25,382	日本商業開発	4.6	7,778	サンネクスグループ	2.3	2,311	タカミヤ	7.5	3,225

銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在		銘柄	2021年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円	
ジャパンベストレスキュー	5	4,775	テクノロ・ホールディング	38.6	120,432	GAMEWITH	1.7	856	ベネッセホールディングス	21.5	47,278
ファンコミュニケーションズ	16.4	6,625	アトラグループ	1.9	532	ソウルドアウト	1.5	1,495	イオンディライト	7.8	27,651
ライク	1.9	3,125	インターワークス	1.3	542	MS&CONSULTING	0.8	536	ナック	2.4	2,229
ビジネス・ブレイクスルー	2.6	1,071	アイ・アールジャパンHD	3	21,270	ミダックホールディングス	2.8	13,902	ダイセキ	11.8	60,888
エスプール	19.1	24,352	Keepert 技研	4.4	11,325	日経工業	5.3	4,282	ステップ	2.6	4,607
WDSホールディングス	29.9	9,062	ファーストロジック	1.5	1,096	キュービーネットHLDGS	3.1	5,124			
手問いらず	1	5,160	三機サービス	1.3	1,266	RPAホールディングス	9	3,348	合計	株数、金額	73,584.9 / 177,548,758
ティア	4.2	1,822	Gunosy	4.8	2,620	スプリックス	1.9	2,838	銘柄数<比率>	2,123銘柄	<97.2%>
CDG	0.5	695	デザインワン・ジャパン	2.1	405	マゼメントソリューションズ	3.4	11,084	(注1) 銘柄欄の( )内は国内株式の評価		
パリュウコマース	5.3	23,956	イー・ガーディアン	3.2	11,152	プロレド・パートナーズ	1.7	1,958	総額に対する各業種の比率。		
インフォーマット	71.5	73,359	リプセクス	4.4	849	AND FACTORY	1.2	502	(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額		
J Pホールディングス	17.6	4,312	ジャパンマテリアル	19.7	30,574	ギークス	1.2	2,413	に対する評価額の比率。		
Eコナックホールディングス	13.5	1,269	ベクトル	9	11,241	カープスホールディングス	18.2	14,086	(注3) 評価額の単位未満は切捨て。		
レックス	1.3	1,888	ウチヤマホールディングス	3	879	フォーラムエンジニアリング	4.3	3,564	<b>(2) 先物取引の銘柄別残高</b>		
プレスステージ・インター	23.8	16,422	チャームコアソリューション	5.4	8,002	LITALEICO	5.6	23,464	<b>(評価額)</b>		
アミューズ	3.6	6,822	キャリアリンク	2.5	3,160	アドバンテッジリスクスマネ	3.3	2,168	銘柄別		
ドリームインキュベータ	1.8	1,488	IBJ	5.9	6,018	リロググループ	35.2	73,673	2021年11月30日現在		
クイック	4.3	6,032	アサンテ	2.7	4,560	TREホールディングス	4.9	8,202	買建額 売建額		
TAC	4.2	911	パリュウHR	2.7	6,766	人・夢・技術グループ	2.6	4,713	国内		
電通グループ	66.2	238,982	M&Aキャピタルパートナー	5.5	30,250	エイチ・アイ・エス	14.5	28,144	TOPIX		
ティクアンドギヴニーズ	3.1	2,790	ライドオンエクスプレスHD	2.6	4,453	ロックランド	1.7	4,943	百万円 百万円		
ぴあ	2.3	8,671	ERIホールディングス	1.7	2,356	共立メンテナンス	11.5	45,942	5,536		
イオンファンタジー	2.5	4,345	シグマガス・ホールディング	3.9	10,923	イチネンホールディングス	6.2	8,060	-		
シーティーエス	7.3	5,686	エウログroup	4.7	6,392	建設技術研究所	3.8	8,983	(注) 単位未満は切捨て。		
ネクシィーズグループ	2.3	1,821	ウィックローAJ	8.3	1,469	スペース	3.9	3,482	<b>■有価証券の貸付および借入状況</b>		
HUグループHD	16.9	48,367	リカルトホールディングス	496.2	3,424,276	燦ホールディングス	2.7	3,742	区分		
アルプス技研	5.5	10,285	エラン	9.7	12,018	スバル興業	0.4	3,188	2021年11月30日現在		
サニックス	11.3	2,779	土木管理総合試験	2.5	830	東京テアトル	2.3	2,780	貸付 借入		
ダイオーズ	0.8	792	ネットマーケティング	4.6	2,060	タナベ経営	2	1,442	株 株		
日本空調サービス	6.3	4,907	日本郵政	496.3	424,832	ナガワ	2	22,840	3,173,500 ( 12,200)		
オリエンタルランド	76.1	1,357,624	ベルシステム24HLDGS	9.1	11,420	東京都競馬	4.8	19,152	株 (-)		
ダスキン	15	39,255	鎌倉新書	7.3	5,657	常磐興産	2.6	3,642	(注1) ( )内は、利害関係人等に貸付も		
明光ネットワークジャパン	8.1	4,382	S MN	2.1	1,354	カナモト	1.1	23,694	しくは借入をしているもの。		
ファルコホールディングス	2.9	4,909	一蔵	1	391	西尾レントオール	5.8	14,610	(注2) 当ファンドに係る当期中の利		
秀英予備校	2.2	902	グローバルキッズCOMP	1.7	1,290	アゴラ ホスピタリティG	52.2	1,200	害関係人のうち、大和証券へ		
田谷	1.6	848	アトリス	4.6	14,513	トランス・コスモス	8.1	25,515	12,200株を貸付けています。		
ラウンドワン	18	23,562	アトラエ	4.9	12,156	乃村工藝社	27.7	27,783			
リゾートトラスト	29.8	55,428	ストライク	2.6	14,716	藤田観光	2.9	6,487			
ビー・エム・エル	8.4	29,652	ソラスト	16.2	19,990	KNT-CTホールディングス	4.1	5,789			
りらいほコミュニケーション	9.9	9,989	セラック	2	3,516	日本管財	6.7	18,331			
リソー教育	29.7	12,028	インソース	6.7	16,435	トーカイ	5.6	10,914			
早稲田アカデミー	3.8	3,712	ベイカレントコンサルティング	4.5	212,850	白洋舎	0.8	1,494			
ユー・エス・エス	71.8	119,618	ORCHESTRA HLDGS	1.2	4,764	セコム	63.3	485,131			
東京個別指導学院	5.9	3,681	アイモパイル	2.6	3,330	セントラル警備保障	3	7,221			
サイバーエージェント	159.1	332,996	キャリアインデックス	2.3	2,467	丹青社	13	10,530			
楽天グループ	330.5	383,710	MS-Japan	3	2,805	メイテック	7.8	51,948			
クリーク・アンド・リバー社	3.5	6,996	船場	1.2	948	応用地質	7.1	13,937			
テー・オー・ダブリュー	10.8	3,369	グレイステクノロジー	8.4	3,544	船井総研ホールディン	13.1	33,522			
山田コンサルティングGP	3.2	3,561	ジャパリエベーターSHD	20.4	43,350	進学会ホールディングス	2.1	716			
セントラルスポーツ	2.5	5,857	フルテック	1.6	2,256	オオバ	4.3	3,268			
フルキャストホールディングス	5.7	15,093	グリーンズ	2.8	1,366	いであ	1.7	3,085			
エン・ジャパン	10.4	36,816	ツナググループHLDGS	2.1	606	学究社	2.2	3,205			
リソルホールディングス	0.8	3,228									

# トピックス・インデックス・マザーファンド 運用報告書 第33期（決算日 2021年9月21日）

（作成対象期間 2020年9月24日～2021年9月21日）

トピックス・インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

## ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	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いません。
主要投資対象	東京証券取引所第1部上場株式（上場予定を含みます。）
株式組入制限	無制限

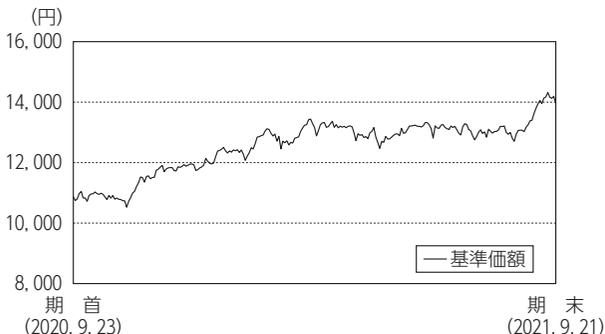
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

## ■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		TOPIX (ベンチマーク)		株式組入率	株式先物比率
	円	%	円	%		
(期首)2020年9月23日	10,865	—	1,644.25	—	99.4	0.6
9月末	10,829	△ 0.3	1,625.49	△ 1.1	98.5	1.4
10月末	10,523	△ 3.1	1,579.33	△ 3.9	97.9	2.0
11月末	11,698	7.7	1,754.92	6.7	97.9	1.8
12月末	12,046	10.9	1,804.68	9.8	98.8	1.1
2021年1月末	12,074	11.1	1,808.78	10.0	99.1	0.8
2月末	12,452	14.6	1,864.49	13.4	99.3	0.7
3月末	13,165	21.2	1,954.00	18.8	98.1	2.8
4月末	12,793	17.7	1,898.24	15.4	98.2	1.8
5月末	12,969	19.4	1,922.98	17.0	97.2	2.8
6月末	13,123	20.8	1,943.57	18.2	98.0	2.0
7月末	12,839	18.2	1,901.08	15.6	97.0	3.0
8月末	13,244	21.9	1,960.70	19.2	98.3	1.6
(期末)2021年9月21日	13,951	28.4	2,064.55	25.6	98.7	0.9

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注4) 株式組入率は新株予約権証券を含みます。

## 《運用経過》

### ◆基準価額等の推移について

#### 【基準価額・騰落率】

期首：10,865円 期末：13,951円 騰落率：28.4%

#### 【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークが上昇したことを受けて、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

### ◆投資環境について

#### ○国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、国内外の新型コロナウイルスの感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、横ばい圏で推移しました。2020年11月以降は、米大統領選挙において民主党のバイデン氏が当選確定となって選挙結果に対する不確実性が後退したことや、それによって大型経済対策への期待が高まったこと、欧米において複数のワクチンの接種が始まったことなどが好感され、株価は上昇しました。2021年に入っても、1月に行われた米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利して大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、3月には実際に米国で追加経済対策が発表されたことや、国内のウイルスの感染状況が改善したことなどが好感され、株価は上昇しました。その後は、国内で感染が再拡大して再び行動制限措置がとられたことや、内閣支持率の低下で政局の行方へ不透明感が増したこと、また世界的にインフレ懸念が台頭して米国の金融緩和縮小の早期化観測が高まったことなどから、上値の重い展開となりました。当作成期末にかけては、菅首相の自民党総選挙への不出馬表明が、支持率の低迷していた政権に有利に働くことを受け止められたことから、上昇しました。

#### ◆前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

#### ◆ポートフォリオについて

株式を中心に、一部TOPIX先物取引も利用し、株式組入比率(株式先物を含む。)につきましては、当作成期を通じておおむね100%程度を維持しました。

株式ポートフォリオは、最適化の手法(株価変動を数論的にいくつかの要因に分解し、それに基づいて、ポートフォリオがベンチマークと同じように変動するよう、銘柄、株数を決定する体系的な手法)を用いて構築しています。

当作成期中、資金変動への対応、新規上場等のベンチマークの構成の変化への対応のため、随時、株式の売買を行いました。

#### ◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は25.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は28.4%となりました。

・保有している株式の配当金について、ベンチマークが配当落ちしていることに対して、ファンドには配当金が計上されているため、ベンチマークとかがい離しました。

・その他、ファンドで組み入れている現物株式ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、先物取引の影響、売買コスト等ががい離の要因として挙げられます。

\*ベンチマークはTOPIXです。

## 《今後の運用方針》

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

## ■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	0円 ( 0) ( 0)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 ( 0)
合 計	0

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■売買および取引の状況

## (1) 株 式

(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 6,069.7 (△ 7,114.63)	千円 14,873,822 ( —)	千株 7,752.67004	千円 19,217,399

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ( )内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

## (2) 先物取引の種類別取引状況

(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	百万円 32,229	百万円 31,927	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■主要な売買銘柄

## 株 式

(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

当 期				期 付			
買 付		平均単価		売 付		平均単価	
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
キーエンス	9.2	523,226	56,872	NTTドコモ	474.3	1,849,770	3,900
東芝	133.5	508,139	3,806	トヨタ自動車	110.3	845,300	7,663
トヨタ自動車	36.1	338,024	9,363	エムスリー	61.9	562,795	9,092
信越化学	16.2	301,724	18,624	日本電信電話	157	415,890	2,648
ソニーグループ	27.5	300,228	10,917	ソフトバンクグループ	38	312,703	8,229
ソフトバンクグループ	34.3	272,972	7,958	任天堂	5	311,643	62,328
KDDI	80.2	263,160	3,281	ソニーグループ	30.5	304,967	9,998
エムスリー	32.9	246,981	7,507	第一三共	90.5	266,891	2,949
ANAホールディングス	71	164,518	2,317	キーエンス	4.6	240,319	52,243
リクルートホールディングス	29.8	158,633	5,323	東京エレクトロン	5.6	220,717	39,413

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

## (1) 国内株式

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>																					
極洋	3.3	3.1	9,455					奥村組	10	11.5	35,937					明星工業	13.8	13.1	10,087		
日本水産	92.4	84.3	54,120					東鉄工業	9	8.5	21,505					大氣社	10.4	10.1	33,885		
マルハニチロ	13.4	14	37,156					イチケン	1.5	1.5	2,904					ダイダク	5.1	4.6	12,521		
カネコ種苗	2.8	2.7	4,163					富士ピー・エス	3	2.4	1,420					日比谷総合設備	6.9	6.7	13,192		
サカタのタネ	11	10.8	39,096					浅沼組	2.4	2.6	12,012					フィル・カンパニー	1.2	1.3	3,926		
ホクト	7.1	7.9	15,626					戸田建設	87.6	86.1	71,032					OS J B HD	33.3	—	—		
ホクリヨウ	1.6	2.3	1,741					熊谷組	9.9	9.9	27,383					東洋エンジニア	8.7	9.1	8,071		
								北野建設	1.3	1.2	2,628					レイズネクスト	11.2	11.1	13,708		
<b>鉱業 (0.2%)</b>								植木組	0.9	1.8	2,766				<b>食品 (3.4%)</b>						
住石ホールディングス	18.4	21.6	3,002					矢作建設	9.3	9.3	7,746				ニッパン	20.1	19.5	32,565			
日鉄鉱業	2.1	2.1	13,818					ピーエス三菱	7	6.8	4,488				日清製粉G本社	77.3	76.2	146,761			
三井松島 HLDGS	3.4	3.6	5,058					日本ハウス HLDGS	14.2	14.7	6,438				日東富士製粉	0.5	0.5	3,390			
I N P E X	339.1	367.2	289,353					大東建託	23.1	23	300,380				昭和産業	6.3	5.9	16,726			
石油資源開発	12.1	12.4	24,366					新日本建設	9	8.4	7,660				鳥越製粉	6	6.4	5,030			
K&O エナジーグループ	4.5	4.3	5,925					N I P P O	17.4	17.7	70,623				中部飼料	8.4	8.4	9,752			
								東亜道路	1.3	1.3	5,999				フィード・ワン	45.7	9.3	7,244			
<b>建設業 (2.3%)</b>								前田道路	18.8	13.2	26,334				東洋精糖	1.2	1.5	1,795			
ヒノキヤグループ	2.3	2.3	5,451					日本道路	2	2.1	17,850				日本甜菜糖	3.5	3.5	5,866			
ショールドHD	14.3	13.2	66,792					東亜建設	6.7	6	14,622				DM三井製糖ホールディ	6	5.1	10,383			
ミライト・ホールディングス	27.4	31.9	73,497					日本国土開発	20.8	20	12,140				塩水港精糖	6.9	10.3	2,317			
タマホーム	5	5.9	16,543					若築建設	3.7	3.6	7,660				日新製糖	3.3	3.1	5,446			
サンヨーホームズ	0.5	1.5	1,113					東洋建設	23.9	24.2	13,866				森永製菓	16	15.7	66,332			
日本アーク	3.8	4.4	2,578					五洋建設	84.8	90.1	68,385				中村屋	1.8	1.6	6,312			
ファーストコーポレーション	3	3.2	2,576					世紀東急	10.2	10.2	8,843				江崎グリコ	19	18.4	80,592			
ベステラ	1.6	1.9	2,755					福田組	2.5	2.4	12,192				名糖産業	3.3	3.2	5,744			
キャンディル	1.4	1.7	1,057					住友林業	53.9	54.4	120,332				井屋グループ	3.8	3.8	9,237			
スペースバリューHD	11.1	11.5	9,740					日本基礎技術	7.3	6.3	3,830				不二家	3.8	4.1	9,987			
ダイセキ環境ソリューション	1.8	1.8	2,982					BCコーポレーション	9.2	8.4	4,107				山崎製パン	51.2	50.7	101,349			
第一カッター興業	1.1	2.3	3,045					大和ハウス	209.9	194.3	738,340				第一屋製パン	1.3	1.8	1,441			
安藤・間	54.9	58.4	47,420					ライト工業	12.2	12.2	23,838				モロゾフ	1.1	1.1	6,149			
東急建設	27.1	29	23,200					積水ハウス	229.3	227.9	541,376				亀田製菓	3.9	3.8	17,480			
コムシスホールディングス	32.6	32.6	97,343					日特建設	5.5	5.3	3,895				寿スピリッツ	6.6	6.6	47,322			
ピーアールホールディングス	9.9	12.5	6,050					北陸電気工事	3.6	3.4	4,617				カルビー	31.2	30.6	87,332			
高松コンストラクションGP	5.7	5.7	11,747					エアテック	11.9	12.1	8,990				森永乳業	12.6	12.6	90,216			
東建コーポレーション	2.8	2.8	29,064					日本リーテック	4.5	4.4	7,862				六甲バター	4.5	4.5	7,663			
ソネック	0.9	1	1,130					四電工	1.1	1.2	4,254				ヤクルト	46.8	46.4	270,048			
ヤマウラ	4	4.1	3,825					中電工	8.2	10.1	23,714				明治ホールディングス	45	44.2	323,986			
オリエンタル白石	—	32.3	8,656					関電工	29.8	34.9	33,015				雪印メグミルク	16.5	16	37,552			
大成建設	70.8	65.4	235,440					きんでん	50.1	42.2	82,712				プリマハム	10.7	9.6	29,184			
大林組	212.7	209	195,624					東京エネシス	7	6.7	7,309				日本ハム	26.1	25.7	112,566			
清水建設	215.5	197.8	167,338					トーエネック	2	2	7,500				林業産業	2.3	2.8	1,705			
飛鳥建設	5.9	5.7	6,418					住友電設	6	5.9	14,000				丸大食品	7.3	6.4	11,526			
長谷工コーポレーション	81.8	68.6	102,900					日本電設工業	11.6	11.1	20,723				S Foods	5.5	6	18,900			
松井建設	8.3	7.8	6,208					協和エクシオ	32.2	32.3	91,441				柿安本店	2.3	2.2	5,896			
銭高組	0.9	0.9	3,960					新日本空調	5.6	5.4	13,748				伊藤ハム米久 HLDGS	44.2	42.8	32,613			
鹿島建設	166.7	153.9	225,617					九電工	14.9	14.8	58,904				サッポロホールディングス	23.3	22.8	57,433			
不動産テトラ	5.5	5.1	9,149					三機工業	15.3	15.5	23,870				アサヒグループホールディン	143.3	158.6	869,921			
大末建設	2.3	2.5	2,462					日揮ホールディングス	65.8	70.1	68,698				キリンHD	288	247.6	507,332			
鉄建建設	4.6	3.9	7,133					中外炉工業	2.3	2.4	4,447				宝ホールディングス	50.7	50.2	78,563			
西松建設	16.4	15.5	55,257					ヤマト	6.8	6.8	5,331				オエノンホールディングス	18	19.9	7,820			
三井住友建設	51.7	51.7	25,126					太平電業	5.2	4.9	14,283				養命酒	2.1	2.3	4,330			
大豊建設	4.8	5	19,100					高砂熱学	17.7	18.7	40,878				コカ・コーラボラータズJHD	48	47.2	77,030			
前田建設	53.5	53.4	46,618					三晃金属	0.8	0.9	2,079				サントリー食品インター	45.7	45.2	221,028			
佐田建設	4.5	5.1	2,468					朝日工業社	1.4	1.4	4,949				ダイドーグループHD	3.5	3.8	22,344			
ナカノブドー建設	5.7	5	1,790																		

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
伊藤園	20.8	20.5	158,670	158,670	日東製網	0.8	0.9	1,341	1,341	日本カーバイド	2.1	2.2	3,174	3,174
キーコーヒー	6.7	6.9	15,587	15,587	アツギ	5.3	5.2	3,354	3,354	堺化学	4.3	4.4	10,524	10,524
ユニカフェ	1.6	2.5	2,730	2,730	ダイニップ	2.4	2.5	1,955	1,955	第一稀元素化学工	7.1	7.3	11,877	11,877
ジャパンフーズ	0.9	1	1,258	1,258	セーレン	16.4	16.4	34,440	34,440	エア・ウォーター	61.8	67.3	121,678	121,678
日清オイリオグループ	8.8	8.5	26,690	26,690	ソトー	2.4	1.8	1,477	1,477	日本酸素 HLDGS	63.7	54.3	156,221	156,221
不二製油グループ	16.7	16.5	43,840	43,840	東海染工	0.9	0.8	908	908	日本化学工業	2.1	1.9	6,289	6,289
かどや製油	0.8	0.7	2,996	2,996	小松マテール	10.8	10.5	10,741	10,741	東邦アセチレン	0.8	1.2	1,634	1,634
J-オイルミルズ	3.6	6.2	11,482	11,482	ワコールホールディングス	16.7	16.3	37,310	37,310	日本パーカラライジング	33.6	32	39,200	39,200
キッコーマン	49.1	48.5	461,720	461,720	ホギメディカル	7.5	8.7	28,579	28,579	高圧ガス	10.6	9.8	7,859	7,859
味の素	150.4	160.3	555,279	555,279	クラウディア HLDGS	1.7	2.1	594	594	チタン工業	0.9	0.9	1,746	1,746
キューピー	38.1	37.8	105,953	105,953	T S Iホールディングス	22.1	19.7	6,638	6,638	四国化成	9.7	8	11,448	11,448
ハウス食品G本社	25.6	25.1	93,497	93,497	マツコカコーポレーション	1.9	2	2,900	2,900	戸田工業	1.5	1.5	4,972	4,972
カゴメ	26	25.4	76,454	76,454	ワールド	9.5	8.5	12,087	12,087	ステラ ケミファ	3.6	3.5	10,535	10,535
焼津水産化工	3.2	3.1	3,199	3,199	三陽商会	3.5	4	3,788	3,788	保土谷化学	2.5	1.9	9,842	9,842
アリアケジャパン	6.2	6.2	41,664	41,664	ナイガイ	2.5	3.2	1,126	1,126	日本触媒	10.2	11.7	69,498	69,498
ピエトロ	0.8	0.9	1,640	1,640	オンワードホールディングス	40.1	41.8	13,501	13,501	大日精化	5.9	5	14,110	14,110
エバラ食品工業	1.7	1.7	4,437	4,437	ルックホールディングス	2.1	2.3	3,192	3,192	カネカ	17.2	17	81,005	81,005
やまひ	0.6	0.8	1,596	1,596	ゴールドウイン	12	11	80,630	80,630	三菱瓦斯化学	61.8	65.8	154,827	154,827
ニチレイ	32.6	32.1	95,658	95,658	デサント	13	11.4	43,890	43,890	三井化学	61.50004	57	224,580	224,580
東洋水産	35.1	34.7	182,522	182,522	キング	3	3.4	1,740	1,740	J S R	61.8	66.3	287,410	287,410
イトアンド HLDGS	2.3	2.3	5,287	5,287	ヤマトインタナショナル	5.7	5.8	1,908	1,908	東京応化工業	11.4	11.4	87,666	87,666
大冷	0.8	1.1	2,206	2,206	<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>					大阪有機化学	6.1	6.1	25,345	25,345
ヨシムラ・フード・HLDGS	3.8	4	3,052	3,052	特種東海製紙	4.1	3.9	18,271	18,271	三菱ケミカル HLDGS	442.5	439.1	453,151	453,151
日清食品HD	29	26.4	243,672	243,672	王子ホールディングス	277.1	297.6	173,203	173,203	K Hネオケム	11	11.1	35,131	35,131
永谷園ホールディングス	3.4	3.5	7,619	7,619	日本製紙	29.3	29.5	36,196	36,196	ダイセル	86.7	88.5	78,853	78,853
一正蒲鉾	2.6	2.8	2,648	2,648	三菱製紙	7.3	7.8	2,964	2,964	住友ベークライト	10.5	10.4	55,744	55,744
フジッコ	7.4	7.5	14,617	14,617	北越コーポレーション	39.9	48.7	32,434	32,434	積水化学	139.9	137.3	276,110	276,110
ロックフィールド	7.3	7.5	12,795	12,795	中越パルプ	2.8	2.3	2,838	2,838	日本ゼオン	60.2	59.3	93,931	93,931
日本たばこ産業	364.8	360.4	779,905	779,905	巴川製紙	2.1	2.1	1,877	1,877	アイカ工業	19.9	18.2	70,616	70,616
ケンコーマヨネーズ	3.8	4	6,712	6,712	大王製紙	29	31.8	69,546	69,546	宇部興産	33.4	33.1	75,732	75,732
わらべや日洋HD	4.4	4.6	11,785	11,785	阿波製紙	2	1.6	668	668	積水樹脂	11.9	10.2	22,378	22,378
なとり	3.9	4.1	8,183	8,183	レンゴー	62.5	68.3	61,879	61,879	タキロンシーアイ	14	13.8	9,259	9,259
イフジ産業	1	1.5	1,432	1,432	トーモク	4.1	4.1	7,990	7,990	旭有機材	3.8	3.6	5,626	5,626
ビッグスクコーポレーション	1.5	3.4	7,473	7,473	ザ・パック	5	4.8	14,856	14,856	ニチバン	3.5	3.2	5,872	5,872
北の達人コーポ	23.8	24	11,664	11,664	<b>化学 (7.2%)</b>					リケンテクノス	16.6	16.2	9,525	9,525
ユーグレナ	29.4	35.3	30,816	30,816	クラレ	104.8	96.3	101,789	101,789	大倉工業	3.1	3.5	7,910	7,910
ミヨシ油脂	2.5	2.3	3,079	3,079	旭化成	439.2	435.4	541,419	541,419	積水化成成品	8.9	7.9	4,858	4,858
理研ビタミン	6.5	6.4	12,371	12,371	共和レザー	3.6	3.3	2,339	2,339	群栄化学	1.4	1.4	4,424	4,424
<b>繊維製品 (0.5%)</b>					昭和電工	47.5	47	127,887	127,887	タイガース ポリマー	3.4	2.2	957	957
片倉工業	9.2	8.8	13,912	13,912	住友化学	488.4	518.1	306,197	306,197	ミリアール	2.3	1.9	3,106	3,106
グンゼ	4.9	4.8	21,048	21,048	住友精化	3	3.2	11,808	11,808	ダイキアクシス	2.4	2.6	2,459	2,459
東洋紡	26.4	25.6	35,737	35,737	日産化学	36.8	36	249,120	249,120	ダイキョーニシカワ	14.1	13.7	9,192	9,192
ユニチカ	19.8	18.5	7,141	7,141	ラサ工業	2.3	2.2	4,303	4,303	竹本容器	2.2	2.9	2,711	2,711
富士紡ホールディングス	3.2	3.2	14,464	14,464	クレハ	5.7	5.6	44,576	44,576	森六ホールディングス	3.6	3.5	7,574	7,574
倉敷紡績	6.6	5.6	11,407	11,407	多木化学	2.6	2.6	18,200	18,200	日本化薬	41.4	39.9	51,111	51,111
シキボウ	4	3.7	3,492	3,492	テイカ	4.9	4.6	6,412	6,412	カーリットホールディングス	6.9	6.3	5,859	5,859
日本毛織	21.4	20.2	21,068	21,068	石原産業	11.9	12.1	16,068	16,068	日本精化	5.4	4.8	12,201	12,201
ダイトウボウ	12.1	12.1	1,210	1,210	片倉コープアグリ	1.6	1.6	1,964	1,964	扶桑化学工業	6.7	5.3	27,931	27,931
トーア紡コーポレーション	2.6	2.3	995	995	日本曹達	9.9	9.1	32,760	32,760	トリケミカル	1.5	6.4	23,616	23,616
ダイドーリミテッド	9.7	7.6	1,307	1,307	東ソー	102.5	101.6	211,429	211,429	A D E K A	30.5	30.2	79,818	79,818
帝国繊維	7.5	7.6	15,922	15,922	トクヤマ	19.2	19.3	42,730	42,730	日油	24.9	24.9	167,826	167,826
帝人	54.1	61.6	100,038	100,038	セントラル硝子	13.5	12	26,532	26,532	新日本理化	10.7	13	4,745	4,745
東レ	480.7	476.3	346,412	346,412	東亜合成	41.5	39	52,494	52,494	ハリマ化成グループ	5.5	4.7	4,488	4,488
サカイオーベックス	1.7	—	—	—	大阪ソーダ	6.7	6.4	17,984	17,984	花王	162	148.3	991,088	991,088
住江織物	1.4	1.4	2,641	2,641	関東電化	15.8	15	16,275	16,275	第一工業製薬	2.5	2.3	7,659	7,659
日本フェルト	3.5	3	1,401	1,401	デンカ	24.2	24	97,080	97,080	石原ケミカル	1.8	1.7	5,100	5,100
イチカワ	0.9	0.8	1,146	1,146	信越化学	113.7	121.6	2,571,840	2,571,840	日華化学	2.2	2.7	2,837	2,837

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			千株	千株	千円			千株	千株	千円	
ニイタカ	1.4	1.5	3,633		ジェイ エス ピー	4	4.3	7,193		出光興産	74.9	73.9	213,644	
三洋化成	3.9	3.9	23,478		エフピコ	7.5	12.5	53,500		ENEOSホールディングス	1,014.5	1,004.4	462,124	
有機合成薬品	5.9	5.7	1,846		天馬	4.5	5.2	15,600		コスモエネルギーHLDGS	19.7	21.3	50,523	
大日本塗料	7.5	7	6,188		信越ポリマー	12.2	9.9	10,662		<b>ゴム製品 (0.7%)</b>				
日本ペイント HOLD	54.7	247.6	323,118		東リ	16.8	14.7	3,528		横浜ゴム	39.4	39.2	77,772	
関西ペイント	74.5	74	217,486		ニフコ	25.1	25	90,625		TOYO TIRE	35.9	35.7	70,614	
神東塗料	6.8	5.8	1,142		バルカー	5.5	5.3	12,110		ブリヂストン	179.5	193.5	1,026,130	
中国塗料	18.8	16.4	14,727		ユニ・チャーム	143.7	129.4	640,788		住友ゴム	61.2	60.9	85,625	
日本特殊塗料	5	4.9	5,316		ショーエイコーポ	0.9	2.2	1,872		藤倉コンポジット	6.2	6.2	4,984	
藤倉化成	8.9	8.2	4,600		<b>医薬品 (5.1%)</b>					オカモト	4.1	3.9	17,316	
太陽ホールディングス	4.9	4.9	29,645		協和キリン	68	79	326,270		フコク	3	3.1	3,292	
D I C	28.1	27.2	89,488		武田薬品	562.5	558.4	2,099,025		ニッタ	7.7	6.8	19,278	
サカタインクス	14.6	13.7	16,686		アステラス製薬	586.3	581.9	1,091,644		住友理工	13.3	13.3	9,948	
東洋インキSCホールディング	13.9	13.3	28,222		大日本住友製薬	50.2	50.2	103,261		三ツ星ベルト	9	7.7	16,023	
T & K T O K A	5.1	4.6	4,057		塩野義製薬	85.1	84.3	621,375		バンドー化学	12	11.1	10,678	
富士フィルム HLDGS	129.7	118.1	1,144,861		わかもと製薬	8.5	8.5	2,924		<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>				
資生堂	134.5	125.3	957,041		あすか製薬	7.7	—	—		日東紡績	10.1	10	37,250	
ライオン	88	81.1	149,629		日本新薬	17.7	19.1	183,933		A G C	62.1	61.7	351,690	
高砂香料	4.3	4.2	12,768		ピオフエルミン製薬	1.2	—	—		日本板硝子	32.3	34.6	19,895	
マンダム	15.3	14.5	23,214		中外製薬	211.4	210.1	867,502		石塚硝子	1.2	1	2,262	
ミルボン	9.1	8.5	58,310		科研製薬	11.6	11.3	54,409		日本山村硝子	2.8	2.4	2,200	
ファンケル	27.5	24.7	94,477		エーザイ	81	74.4	623,397		日本電気硝子	25.5	26.9	64,775	
コーセー	12.8	12.8	165,120		ロート製薬	34.7	31.8	111,141		オハラ	2.7	2.8	4,370	
コタ	3.9	4.7	7,985		小野薬品	155.3	153.7	409,303		住友大阪セメント	12.8	11.9	37,544	
シーボン	0.8	0.8	1,518		久光製薬	17.9	19.4	84,293		太平洋セメント	43	38	93,100	
ポーラ・オルビス HD	29.1	28.9	74,851		持田製薬	9.3	9.2	32,660		日本ヒューム	6.7	5.6	4,211	
ノエビアホールディングス	5.8	5.6	33,544		参天製薬	126.1	117	189,540		日本コンクリート	14.6	15	4,665	
アジパホンホールディング	1.4	1.9	2,029		扶桑薬品	2.4	2.1	5,571		三谷セキサン	3.1	3.1	21,359	
エステー	4.4	4.2	7,677		日本ケミファ	0.9	0.8	1,876		アジアパイルHD	9.6	9.6	4,809	
アグロカネショウ	2.7	2.5	3,887		ツムラ	21	22.5	86,062		東海カーボン	66.3	56.9	87,284	
コニシ	11.1	10.9	19,652		日医工	19.2	19	17,252		日本カーボン	3.5	3.7	15,743	
長谷川香料	11.7	11.5	32,959		キッセイ薬品工業	12	11.5	28,957		東洋炭素	4	4.6	13,938	
星光PMC	3.8	3.8	3,332		生化学工業	13.2	11.5	12,937		ノリタケ	3.8	3.7	17,038	
小林製薬	19	18.8	171,080		栄研化学	11.9	12	26,988		T O T O	48.3	47.9	267,282	
荒川化学工業	6.1	5	6,455		日水製薬	2.8	2.5	2,555		日本碍子	81.6	73.3	138,097	
メック	4.6	5.2	18,746		鳥居薬品	4.3	4.2	12,810		日本特殊陶業	51.6	51.5	92,545	
日本高純度化学	1.8	2	6,140		J C R ファーマ	4.8	19.3	56,857		ダントーホールディングス	6.3	6.2	1,612	
タカラバイオ	17.8	17.7	57,436		東和薬品	8.6	9.8	32,634		M A R U W A	2.6	2.4	28,368	
J C U	8.2	7.5	35,550		富士製薬工業	4.6	4.5	5,413		品川リフラクトリズ	1.7	1.5	5,985	
新田セラチン	4	4	2,632		沢井製薬	13.9	—	—		黒崎播磨	1.3	1.1	5,522	
O A T アグリオ	1.2	1.2	2,274		ゼリア新薬工業	12.3	12.1	26,414		ユーティ	5.3	5	6,855	
デクセラリアルズ	17.6	19.6	44,825		第一三共	193.5	527.7	1,593,654		インソライト	3.4	3	2,406	
アース製薬	4.8	5.6	39,144		キョーリン製薬HD	15	14.8	27,557		東京窯業	8.4	7.7	2,671	
北興化学	6.6	6.4	7,603		大幸薬品	8.3	10.5	9,933		ニッカトー	3	2.9	2,093	
大成ラミック	2.2	2.4	6,955		ダイト	4.2	4.3	15,028		フジインコボレーテッド	6.1	5.5	37,125	
クミアイ化学	28.1	27.1	25,474		大塚ホールディングス	140.5	139	675,123		クニミネ工業	2.8	2.2	2,490	
日本農業	12	12.1	6,776		大正製薬HD	14.3	16.8	113,232		エーアンドエマーテリアル	1.1	0.9	909	
アキレス	4.7	4.5	6,228		ペプチドリーム	34.4	35.4	133,989		ニチアス	18.6	16.9	48,824	
有沢製作所	10.7	9	8,163		あすか製薬HD	—	7.8	8,564		ニチハ	9.5	9.2	31,050	
日東電工	46.7	40.5	336,555		サワイグループHD	—	14.8	76,664		<b>鉄鋼 (0.8%)</b>				
レック	7.2	7.8	8,689		<b>石油・石炭製品 (0.4%)</b>					日本製鉄	299.9	317	651,910	
三光合成	7.5	7.2	3,297		日本コークス工業	56	58.3	7,695		神戸製鋼所	123.2	122.5	83,912	
きもと	12.4	12.7	3,225		ニチレキ	8	7.7	10,564		中山製鋼所	8.7	8.4	3,654	
藤森工業	6.1	6	29,580		ユシロ化学	3.7	3.4	4,158		合同製鐵	3.6	3.5	5,390	
前澤化成工業	4.3	4.5	5,868		ビービー・カストロール	2.4	2.4	3,324		J F E ホールディングス	181.8	192.4	339,008	
未来工業	3.5	2.5	4,135		富士石油	17.7	18.9	4,895		東京製鐵	32.6	26.2	31,518	
ウェーブロックHLDGS	2.3	2.3	1,626		M O R E S C O	2.3	2.1	2,564		共英製鋼	7.6	7.4	10,493	

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
大和工業	14.2	14.1	53,721	53,721	信和	3.6	3.5	2,520	2,520	豊和工業	3.9	3.8	3,195	3,195
東京製鋼	2.7	2.7	4,363	4,363	東洋製罐グループHD	42.9	42.4	57,028	57,028	〇KK	2.7	2.9	1,209	1,209
大阪製鋼	3.6	3.3	3,719	3,719	ホッカンホールディングス	3.7	3.1	4,535	4,535	石川製作所	1.7	1.8	2,943	2,943
淀川製鋼所	8.9	8.4	21,092	21,092	コナ	3.4	3.7	3,407	3,407	東洋機械金属	4.6	3.9	2,020	2,020
丸一鋼管	21.7	21.4	59,192	59,192	横河ブリッジHLDGS	12.5	11.6	28,744	28,744	津田駒工業	1.2	1.3	1,095	1,095
モリ工業	2	1.9	4,694	4,694	駒井ハルテック	1.2	1.4	2,490	2,490	エンシュウ	1.5	1.4	1,124	1,124
大同特殊鋼	11.1	11	54,560	54,560	高田機工	0.6	0.6	1,765	1,765	島精機製作所	10.6	9.4	22,785	22,785
日本高周波	2.4	2.3	945	945	三和ホールディングス	63.4	62.7	94,739	94,739	オプトラン	7.5	8.3	19,239	19,239
日本冶金工	5.5	5.1	13,948	13,948	文化シャッター	19.8	20.2	23,896	23,896	NCホールディングス	2	2.7	3,780	3,780
山陽特殊製鋼	4.6	7.8	13,540	13,540	三協立山	8.7	8.7	6,907	6,907	イワキポンプ	4.2	4	4,124	4,124
愛知製鋼	3.6	3.8	10,374	10,374	アルインコ	4.9	4.4	4,545	4,545	フリュー	6.5	6.8	12,512	12,512
日立金属	72.1	63.1	135,791	135,791	東洋シャッター	1.7	1.7	1,147	1,147	ヤマシンフィルタ	14.6	13.8	9,480	9,480
日本金属	1.6	1.7	1,866	1,866	L I X I L	98.8	91.3	287,595	287,595	日阪製作所	8.4	8.1	7,500	7,500
大太平洋金属	4.5	4.5	8,523	8,523	日本ファイルコン	5	4.2	2,196	2,196	やまびこ	13	12.6	16,430	16,430
新日本電工	43.6	44.3	14,530	14,530	ノーリツ	14	13.6	25,513	25,513	平田機工	3.2	3	21,060	21,060
栗本鉄工所	3.3	2.9	4,903	4,903	長府製作所	6.8	6.5	14,098	14,098	ペガサスモシン製造	6.6	6.6	2,976	2,976
虹技	1	0.8	919	919	リンナイ	13.1	12.9	168,345	168,345	マルマエ	2.7	2.9	6,304	6,304
日本鑄鉄管	0.8	0.7	850	850	ダイニチ工業	3.5	3.8	2,990	2,990	タツメ	3.1	3.1	5,006	5,006
三菱製鋼	4.9	5	6,450	6,450	日東精工	9.2	8.6	5,882	5,882	ナブテスコ	39.5	39	181,935	181,935
日亜鋼業	9.6	8.8	2,798	2,798	三洋工業	0.8	0.7	1,332	1,332	三井海洋開発	7.1	7.3	12,548	12,548
日本精線	1.1	1	5,010	5,010	岡部	13.7	12.2	8,564	8,564	レオン自動車	6.6	6.3	9,884	9,884
エンビプロHD	3	3.2	5,705	5,705	ジーテクト	8.4	7.9	11,865	11,865	S M C	21.2	19.6	1,515,668	1,515,668
シンニッタン	10.4	8.5	2,116	2,116	東プレ	12.6	12.3	16,912	16,912	ホソカワミクロン	2.4	2.3	16,744	16,744
新家工業	1.5	1.6	2,481	2,481	高周波熱錬	12.9	11.8	8,047	8,047	ユニオンツール	2.5	2.6	10,439	10,439
<b>非鉄金属 (0.7%)</b>					東京製鋼	4.7	2.9	2,871	2,871	オイレス工業	8.8	8.9	15,379	15,379
大紀アルミニウム	11	10.1	18,664	18,664	サンコール	4.9	5.4	2,565	2,565	日精エーエスピー	2	2.2	9,130	9,130
日本軽金属HD	170.7	17.7	35,683	35,683	モリテックスチル	5.4	5.4	2,467	2,467	サトーホールディングス	9.6	8.6	24,123	24,123
三井金属	18.2	18	59,400	59,400	パイオラックス	9.9	9.3	14,703	14,703	技研製作所	5.9	5.9	28,585	28,585
東邦亜鉛	3.4	3.6	10,328	10,328	エイチワン	6.4	6.4	4,755	4,755	日本エアーテック	2.3	3.2	4,099	4,099
三菱マテリアル	44.2	43.6	97,620	97,620	日本発条	72	66.5	53,931	53,931	カワタ	1.9	1.8	1,816	1,816
住友鉱山	85.5	85	351,985	351,985	中央発條	0.7	4.4	4,950	4,950	日精樹脂工業	5.6	5.5	6,534	6,534
DOWAホールディングス	17	17	77,775	77,775	アドパネクス	0.9	1.1	1,513	1,513	オカダアイオン	2	2.1	2,883	2,883
古河機金	12	10.3	12,833	12,833	立川プラインド	3	3.1	4,123	4,123	ワイエシイホールディングス	2.8	2.8	2,548	2,548
エス・サイエンス	37.6	35.4	1,239	1,239	三益半導体	5.3	5	12,975	12,975	小松製作所	306.9	304	825,208	825,208
大阪チタニウム	6.9	6.7	5,286	5,286	<b>機械 (5.6%)</b>					住友重機械	39	38.5	116,462	116,462
東邦チタニウム	12	12.5	14,875	14,875	日本ドライケミカル	1.7	1.6	3,721	3,721	日立建機	27.3	31.6	100,804	100,804
U A C J	10.2	10	28,670	28,670	日本製鋼所	20.4	20.3	60,027	60,027	日工	9.2	10.1	6,928	6,928
C K サンエツ	1.4	1.4	4,620	4,620	三浦工業	28.9	28.8	144,000	144,000	巴工業	2.7	2.6	6,541	6,541
古河電工	20.9	20.6	49,543	49,543	タクマ	22.7	22.9	37,349	37,349	井関農機	6.8	6.3	10,930	10,930
住友電工	250.1	230.9	344,618	344,618	ツガミ	13.9	14.3	27,770	27,770	T O W A	6.8	6.3	17,595	17,595
フジクラ	81.2	80.7	55,440	55,440	オークマ	7.9	7.6	42,864	42,864	丸山製作所	1.8	1.3	2,141	2,141
昭和電線 HLDGS	7.8	6.7	15,470	15,470	芝浦機械	7.6	6.8	18,938	18,938	北川鉄工所	3	2.7	4,471	4,471
東京特殊電線	1	0.7	2,065	2,065	アマダ	83.3	97.1	116,617	116,617	ローツェ	3	3.1	27,962	27,962
タツタ電線	13.3	12.5	6,787	6,787	アイダエンジニア	17.7	16.9	18,995	18,995	タカキタ	2.5	2.2	1,546	1,546
カナレ電気	1.1	0.9	1,592	1,592	滝澤鉄工所	2	1.8	2,068	2,068	クボタ	359	327.4	791,980	791,980
平河ヒューテック	3.3	3.7	4,621	4,621	F U J I	29	26.4	80,652	80,652	荏原実業	1.7	3.4	9,832	9,832
リョービ	8.3	7.8	10,124	10,124	牧野フライス	7.9	7.7	34,342	34,342	三菱化工機	2.3	2.3	5,646	5,646
アーレスティ	8.6	8.1	3,726	3,726	オーエスジー	31.2	30.3	62,024	62,024	月島機械	12.6	11.8	14,289	14,289
アサヒHD	11.8	25.6	54,528	54,528	ダイジェット	0.7	0.7	884	884	帝国電機製作所	5.6	4.5	6,507	6,507
<b>金属製品 (0.6%)</b>					旭ダイヤモンド	17.6	16.3	10,660	10,660	東京機械	3.1	3.4	6,721	6,721
稲葉製作所	3.7	4.9	6,909	6,909	DMG 森精機	42.6	39.7	84,402	84,402	新東工業	16.2	15.3	12,148	12,148
宮地エンジニアリングG	2	2.3	6,046	6,046	ソディック	15.4	16.1	15,182	15,182	渋谷工業	5.9	5.9	19,145	19,145
トーカロ	18.7	16.7	24,248	24,248	ディスコ	9.1	9	303,300	303,300	アイチ コーポレーション	11.8	11.2	8,803	8,803
アルファ CO	2.2	2.2	2,851	2,851	日東工器	3.7	3.2	6,556	6,556	小森コーポレーション	17.3	16.8	15,120	15,120
SUMCO	80.1	84.6	201,771	201,771	日進工具	2.6	5.1	7,466	7,466	鶴見製作所	5.1	5	9,225	9,225
川田テクノロジーズ	1.4	1.3	4,914	4,914	パンチ工業	5.9	5.8	3,642	3,642	住友精密	1	0.9	2,277	2,277
RS TECHNOLOGIES	1.9	2.2	13,574	13,574	富士ダイス	2.9	2.8	1,920	1,920	日本ギア工業	2.4	2.4	760	760

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
酒井重工業	1.2	1.1	2,866		マキタ	88.2	87.6	598,308		セイコーエプソン	84.4	83.4	190,068	
荏原製作所	28.1	28	162,960		日立造船	53.6	54.6	50,232		ワコム	45.8	49.2	36,211	
石井鉄工所	0.9	0.9	2,799		三菱重工業	113.9	105.7	316,360		アルバック	12.5	12.5	81,500	
西島製作所	6.8	6.6	6,263		IHI	49.1	45.3	116,375		アクセル	2.7	2.8	2,164	
北越工業	7	6.8	7,051		スター精密	10.5	10.4	17,097		EIZO	5.3	5.8	24,766	
ダイキン工業	86.2	85.5	2,281,140		電気機器 (18.8%)					ジャパンディスプレイ	61.7	61.7	2,282	
オルガノ	2.4	2.3	16,031		日清紡ホールディングス	42.4	40.4	33,814		日本信号	17.4	15.5	15,577	
トーヨーカネツ	3	2.6	7,001		イビデン	41.5	32.6	217,442		京三製作所	15.8	13.4	7,169	
栗田工業	36.7	36.7	215,796		コニカミノルタ	148.9	137.2	82,457		能美防災	9	8.8	18,585	
椿本チエイン	9.8	9.6	34,800		ブラザー工業	83.1	81.6	207,753		ホーチキ	4.9	4.6	5,543	
大同工業	3.2	3.3	3,643		ミネベアミツミ	125.9	115.7	340,505		星和電機	3.5	3.4	1,788	
木村化工機	5.7	6.3	4,731		日立	325	322.9	2,080,444		エレコム	7.6	15.6	29,016	
アナスト岩田	10.6	10.9	10,627		東芝	—	133	629,090		パナソニック	773.4	715.6	990,748	
ダイフク	34.7	37	412,180		三菱電機	676.1	670.3	1,056,727		シャープ	78.8	89.6	124,185	
サムコ	1.9	1.7	5,040		富士電機	41	40.6	208,278		アンリツ	43.6	40.9	83,108	
加藤製作所	3.7	3.4	3,083		東洋電機製造	2.4	2.4	2,865		富士通ゼネラル	18.5	20.8	60,569	
油研工業	1.1	0.9	1,611		安川電機	72.9	72.2	423,814		ソニーグループ	423.6	420.6	5,190,204	
タダノ	32.8	32.7	39,141		シンフォニアテクノロジー	8.8	8.6	10,569		TDK	32.7	32.5	404,950	
フジテック	24.8	23.3	66,731		明電舎	12.5	11.3	28,464		帝国通信工業	3	2.7	4,317	
CKD	18.7	15.7	39,673		オリゾン	1.8	1.6	2,160		タムラ製作所	22.7	25.2	18,849	
キトー	5.2	5.6	10,332		山洋電気	3.3	3.3	24,090		アルプスアルパイン	60.3	54.7	66,351	
平和	18.7	18.3	37,789		デンヨー	5.8	5.6	12,796		池上通信機	2.1	2.4	1,936	
理想科学工業	6	5	12,535		東芝テック	8.5	7.2	34,020		日本電波工業	6.3	7.1	6,397	
SANKYO	15	16	44,816		芝浦メカトロニクス	1.2	1.3	9,646		鈴木	3.3	3.1	2,690	
日本金銭機械	7.3	6.6	4,237		マブチモーター	18.8	15.7	60,288		日本トリム	0.9	1.6	6,056	
マースグループHLDGS	4.2	3.8	6,422		日本電産	162.7	161.6	2,156,552		ローランドディー・ジー	3.7	4	12,400	
フクシマガリレイ	4.2	4.7	24,205		ユーエムシーエレクトロニクス	4.2	3.9	3,026		フオスター電機	7.1	6.6	6,164	
オーイズミ	2.8	2.3	883		トレックス・セミコンダクター	3.9	3.8	10,138		SMMK	1.7	1.6	3,825	
ダイコク電機	3.1	2.6	3,426		東高岳	3.7	3.4	5,113		ヨコオ	4.4	5.5	14,157	
竹内製作所	11.4	11.6	30,345		ダブル・スコープ	10.7	19.3	17,370		ティアック	4.9	5.2	608	
アマノ	17.8	17.6	52,800		宮越ホールディングス	2.7	2.7	3,472		ホシデン	18.6	18	17,154	
JUKI	9.3	9.2	7,709		ダイヘン	7.5	7.4	37,518		ヒロセ電機	10.4	10.4	204,568	
サンデンホールディングス	9	9.2	2,723		ヤーマン	11.1	11.5	16,514		日本航空電子	15.6	15.8	26,322	
蛇の目ミシン	6	6.5	4,927		JVCケンウッド	55.1	60.1	12,621		TOA	7.3	7.4	6,445	
マックス	10.4	8.8	17,485		ミマキエンジニアリング	6	6.2	5,611		マクセルホールディングス	14.6	13.1	17,344	
グローリー	17.5	16.9	42,976		IPEX	2.8	3.2	6,595		古野電気	8.7	8.5	9,868	
新晃工業	6.3	6.3	14,351		日新電機	16	15.8	22,467		ユニデンホールディングス	1.9	1.8	5,094	
大和冷機工業	9.8	10.9	13,995		大崎電気	13.3	13.2	7,418		スミダコーポレーション	5.2	6.2	7,570	
セガサミーホールディングス	67.1	60.8	96,976		オムロン	60.6	55.8	640,584		アイコム	3.8	2.8	6,857	
日本ピストンリング	2.4	2.7	3,982		日東工業	10	9.8	17,257		リオン	2.8	2.9	8,265	
リケン	3.1	2.9	8,418		IDEC	9.8	9.2	20,884		本多通信工業	5.8	4.4	2,173	
TPR	9.1	8.6	13,201		正興電機製作所	1.8	2.5	3,585		船井電機	6.8	—	—	
ツバキ・ナカシマ	13.8	15	22,755		不二電機工業	1	1	1,276		横河電機	62.5	66.6	131,068	
ホシザキ	19.9	19.6	208,152		ジーエス・ユアサコーポ	22.7	24.4	63,049		新電元工業	2.4	2.7	11,164	
大豊工業	5.4	6	5,106		サクサホールディングス	1.5	1.5	2,121		アズビル	42.9	45.6	233,472	
日本精工	128.4	138	104,466		メルコホールディングス	2.3	2.4	11,904		東亜ディーケーケー	3.3	2.8	2,836	
NTN	157.3	154.3	38,575		テクノメディカ	1.5	1.4	2,380		日本光電工業	28	27.8	109,254	
ジェイテクト	65.5	64.7	62,176		ダイヤモンドエレクトロニクスHD	1.4	2	4,736		チノー	2.3	1.8	2,685	
不二越	6.4	6	27,420		日本電気	82	85.5	531,810		共和電業	6.9	6.6	2,580	
日本トムソン	19.9	18.6	10,230		富士通	65.2	60.5	1,272,315		日本電子材料	2.7	2.9	5,585	
THK	39.6	39	100,893		沖電気	27.7	27.1	26,639		堀場製作所	13.5	12.3	101,106	
ユーシン精機	5.3	4.3	3,581		岩崎通信機	2.9	2.9	2,636		アドバンテクト	50.5	50	555,000	
前澤給装工業	2.4	4.7	4,991		電気興業	3.3	3.1	8,022		小野測器	2.7	2.5	1,367	
イーグル工業	8.5	8.1	10,327		サンケン電気	7.4	7.5	51,525		エスベック	6	5.8	13,728	
前澤工業	4	4.9	3,973		ナカヨ	1.3	1.1	1,580		キーエンス	61.3	65.9	4,720,417	
日本ビラー工業	6.8	7.3	20,272		アイホン	3.8	4.3	10,109		日置電機	3.3	3.3	32,241	
キッツ	27.7	22.6	19,187		ルネサスエレクトロニクス	290.1	362.2	496,938		シスメックス	48.3	52.4	769,756	

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
日本マイクロニクス	11.8	11.5	17,664		三桜工業	8.6	9.5	10,089		クリエートメディック	2.1	1.8	1,796	
メガチップス	6.3	6.7	23,215		デンソー	148.8	147.8	1,143,972		日機装	20.4	21.5	20,790	
OBARA GROUP	4	3.7	15,336		東海理化電機	18	17.5	28,892		日本エム・ディ・エム	3.9	4	9,068	
澤藤電機	0.9	0.8	1,640		三井 E&SHD	21.7	21.7	10,524		島津製作所	80.9	86.5	462,775	
原田工業	3.2	2.7	2,600		川崎重工業	53	52.7	128,904		JMS	5.7	5.9	4,967	
コーセル	9	8.2	8,167		名村造船所	22.2	21.9	5,277		クボテック	1.9	1.8	545	
イリソ電子工業	5.7	5.7	27,075		サノヤスホールディングス	9.4	9.8	1,381		長野計器	5	5.1	5,967	
オプテックスグループ	11.2	11.1	17,438		日本車輛	2.5	2.2	4,620		ブイ・テクノロジ	3.2	3.1	14,554	
千代田インテグレ	2.9	2.7	5,896		三菱ロジスネクスト	9	9.1	10,474		東京計器	4.2	4.1	4,309	
アイ・オー・データ	2.3	2.4	2,205		近畿車輛	1	1	1,154		愛知時計	0.9	0.7	3,360	
レーザーテック	29.8	29.6	843,896		日産自動車	799.9	790.6	439,810		インターアクション	3.6	3.5	9,877	
スタンレー電気	47.5	46.9	134,696		いすゞ自動車	196.8	178.9	264,593		オーバル	6.4	6.6	1,782	
岩崎電気	2.6	2.4	4,915		トヨタ自動車	754.3	680.1	6,752,712		東京精密	12.4	11.4	54,492	
ウシオ電機	37.6	35	75,145		日野自動車	85.1	84.6	85,699		マニー	27	26.7	60,261	
岡谷電機	5.2	4.6	1,669		三菱自動車工業	252.4	250.8	69,973		ニコン	104.1	102.7	134,947	
ヘリオステクノH	6.3	6.2	2,083		エフテック	4.8	5.3	3,354		トプコン	34.3	34	70,142	
エノモト	2	2.1	3,906		レシップホールディングス	2.6	2.9	1,737		オリンパス	374.2	352.1	818,984	
日本セラミック	6.9	6.7	20,535		GMB	1.5	1.6	1,454		理研計器	6	5.9	18,142	
遠藤照明	3.3	3.3	3,356		ファルテック	1.4	1.4	1,037		タムロン	5.5	5.6	15,573	
古河電池	4.8	4.9	7,604		武蔵精密工業	15.1	15.4	29,768		HOYA	134.1	131	2,412,365	
双信電機	3.3	3.3	2,847		日産車体	13.3	9.3	7,393		シード	2.9	2.4	1,644	
山一電機	4.9	4.5	7,600		新明和工業	18.3	19.5	18,681		ノーリツ鋼機	4.6	6.2	17,050	
図研	4.4	4.6	19,619		極東開発工業	12.6	11.6	20,172		イー・アンド・デイ	6.1	5.8	6,153	
日本電子	13.4	12.4	112,096		日信工業	13.3	—	—		朝日インテック	76.6	72.2	233,928	
カシオ	60.3	54	97,902		トビー工業	5.6	5.4	6,744		シチズン時計	79.6	85.2	44,730	
ファナック	63.6	58.9	1,506,367		ティラド	2.4	2.2	7,150		リズム	2.1	1.9	2,832	
日本シイエムケイ	15.9	13.9	6,268		タチエス	11.1	10.5	13,734		大研医器	5.1	4.8	2,976	
エンプラス	3.5	3.1	9,935		NOK	36.6	32.4	44,226		メニコン	9.6	10.5	95,550	
大真空	2.5	2.5	10,100		フタバ産業	18.9	16.1	7,711		シンシア	0.9	1.4	942	
ローム	28.2	27.9	312,759		K Y B	7.6	7.7	23,408		松風	3	3.2	7,033	
浜松ホトニクス	48.5	48.3	339,066		大同メタル工業	13.1	13	8,177		セイコーHD	9.6	9.7	21,378	
三井ハイテック	7.5	6.7	57,151		プレス工業	33.6	32.6	11,279		ゼロ	46.9	49.8	59,062	
新光電気工業	22.9	22.9	90,111		ミクニ	8.4	7.9	2,607		<b>その他製品 (2.2%)</b>				
京セラ	95	102	713,592		太平洋工業	14.3	14.1	17,018		中本パックス	1.6	1.6	3,056	
太陽誘電	30.2	30	221,700		ケーヒン	15	—	—		スノーピーク	3.5	4.5	27,225	
村田製作所	198.6	197.2	1,974,958		河西工業	9.2	9.4	3,609		パラマウントベッドHD	7.1	12.5	28,337	
双葉電子工業	10.8	10.8	8,834		アイシン	55.7	49.2	205,656		トランザクション	4.4	4.5	5,445	
北陸電気工業	2.7	2.2	2,321		マツダ	200.4	211.9	198,126		粧美堂	2	2.3	984	
ニチコン	23.1	21.8	23,805		今仙電機製作所	6.1	5.6	4,076		二ホンフラッシュ	6.3	5.7	6,697	
日本ケミコン	5.1	7	15,582		本田技研	532.4	528.2	1,763,131		前田工織	7.5	7.6	26,182	
K O A	10.2	9.6	17,068		スズキ	134.2	133.1	676,946		永大産業	8.6	8.6	2,648	
市光工業	10.2	9.8	6,154		SUBARU	210.2	192	394,944		アートネイチャー	7.2	6.3	4,699	
小糸製作所	40.6	40.1	273,482		安永	3.3	3.2	3,830		バンドナムコHLDGS	69.9	55.5	493,006	
ミツバ	12.4	12.7	8,521		ヤマハ発動機	88.9	87.8	270,863		アイフィスジャパン	1.8	1.8	1,294	
SCREENホールディングス	11.8	11.7	119,457		ショーワ	15.4	—	—		共立印刷	11.3	8.2	1,459	
キャノン電子	6.1	6.2	10,180		T B K	7.9	7.4	3,100		S H O E I	6	6.5	34,125	
キャノン	336.3	333.6	896,716		エクセディ	9.3	9.1	15,925		フランスベッドHLDGS	9.2	9.8	9,359	
リコー	173.2	171.6	188,931		豊田合成	22	22	50,446		パイロットコーポレーション	11.1	11.1	49,062	
象印マホービン	18.4	17.9	33,562		愛三工業	10.6	10.6	8,957		萩原工業	3.7	3.8	6,224	
MUTOHホールディングス	1	0.9	1,499		盟和産業	1	1.1	1,153		日本フーズ	14.6	11.9	12,304	
東京エレクトロン	43	39.3	2,124,951		日本プラスト	5	5.1	3,401		フジールインターナショナル	15.3	13.7	35,784	
<b>輸送用機器 (7.6%)</b>					ヨロズ	6.4	5.5	6,809		タカラトミー	30.5	30.3	35,784	
トヨタ紡織	19.8	19.8	39,857		エフ・シー・シー	11.2	10.5	16,401		廣済堂	4.9	5.2	8,632	
芦森工業	1.3	1.2	1,258		シマノ	25.3	27.1	929,530		エスデルホールディングス	2	4	2,640	
ユニプレス	13.2	10.6	9,826		テイ・エス・テック	15.7	30.8	44,752		タカノ	2.6	2.1	1,745	
豊田自動織機	54.8	54.3	518,565		ジャムコ	3.3	4.3	4,235		プロネクサス	5.8	5.3	5,787	
モリタホールディングス	12	10.2	16,238		<b>精密機器 (3.0%)</b>					ホクシン	5.7	6.9	1,166	
					テルモ	191.4	205.8	1,094,032						

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			千株	千株	千円			千株	千株	千円	
ウッドワン	2.4	2.5	2,870		小田急電鉄	100.5	107.3	276,297		沢沢倉庫	3.5	3.4	8,255	
大建工業	4.6	4.5	10,651		京王電鉄	35.1	37.4	224,026		東陽倉庫	11.3	9.6	3,398	
凸版印刷	95.9	101.3	201,789		京成電鉄	47.1	50.5	179,527		日本トランスシティ	13.8	13.5	9,045	
大日本印刷	88.8	79	217,961		富士急行	9.3	9.2	42,136		ケイヒン	0.9	1.1	1,577	
共同印刷	2.1	2	5,564		新京成電鉄	1.7	1.9	4,142		中央倉庫	3.9	3.5	3,661	
N I S S H A	13.9	13.8	25,281		東日本旅客鉄道	119	118.2	837,801		川西倉庫	1.1	1.1	1,468	
光村印刷	0.6	0.6	1,030		西日本旅客鉄道	60.4	75	389,400		安田倉庫	5.1	5	5,005	
TAKARA & COMPANY	3.3	3.3	6,039		東海旅客鉄道	56.2	55.8	913,167		ファイズホールディングス	1.4	1.4	1,073	
アシックス	56.2	59.7	152,772		西武ホールディングス	88.9	81.3	108,372		東洋埠頭	2	1.8	2,818	
ツツミ	2.1	2.1	4,953		鴻池運輸	10.9	10.4	14,227		宇徳	5.5	5.4	3,099	
小松ウオール工業	1.9	2.2	4,371		西日本鉄道	18.8	18.4	52,826		上組	35.7	34.9	83,829	
ヤマハ	40.3	39.9	290,073		ハマキョウレックス	5.2	5	17,275		サンリツ	1.5	1.9	1,569	
河合楽器	2.1	2	7,820		サカイ引越センター	3.6	3.2	15,808		キムラユニティ	1.6	1.4	2,146	
クリナップ	6.3	6	3,588		近鉄グループHLDGS	64.1	63.4	236,482		キューソー流通システム	1.6	1.5	2,802	
ビジョン	41.2	40.8	117,136		阪急阪神HLDGS	85.4	84	295,680		近鉄エクスプレス	13.7	12	37,680	
オリバー	1.4	—	—		南海電鉄	30.5	29.8	71,132		東海運	3.6	4	1,404	
兼松サステック	0.4	0.6	1,086		京阪ホールディングス	28.5	28.3	88,296		エーアイティー	4.5	4.1	5,079	
キングジム	5.7	5.6	5,006		神戸電鉄	1.5	1.5	5,422		内外トランスライン	2.1	2.7	6,642	
リンテック	16.1	14	37,450		名古屋鉄道	52.4	52.3	106,901		日本コンセプト	2	2.2	4,952	
イトーキ	14.4	12.9	5,108		山陽電鉄	4.7	4.4	9,081		<b>情報・通信業 (8.5%)</b>				
任天堂	41.5	38.5	2,027,410		日本通運	22.2	22	178,640		NEC ネットエスアイ	18.9	22.3	49,082	
三菱鉛筆	11.3	10.6	15,984		ヤマトホールディングス	112.3	89.1	259,637		クロスキャット	1.8	1.8	2,545	
タカラスタンダード	13.7	13.2	21,978		山九	17.8	16.2	86,670		システナ	23.7	24	57,360	
コクヨ	32.3	32.5	65,162		丸連	3.5	4.3	1,186		デジタルアーツ	3.3	3.9	36,114	
ナカバヤシ	6.6	5.8	3,520		丸全昭和運輸	5.2	5.2	19,136		日鉄ソリューションズ	9.9	9.7	38,751	
グローブライド	3	3.4	32,164		センコーグループHLDGS	34.9	36.2	38,010		キューブシステム	3.5	3.8	4,187	
オカムラ	23.5	23.6	40,049		トナミホールディングス	1.5	1.5	7,875		WOW WORLD	1.4	1.7	2,981	
美津濃	6.2	6.8	18,700		ニッコンホールディングス	22.9	21.3	52,376		コア	2.8	2.6	4,053	
<b>電気・ガス業 (1.2%)</b>					日石輸送	0.6	0.6	1,602		ラクーンホールディングス	3.2	5	7,595	
東京電力HD	542	573.4	177,180		福山通運	8.2	8.1	40,743		ソリトンシステムズ	3.1	3.6	5,569	
中部電力	205.8	204.9	279,483		セイノーホールディングス	47.9	47.6	65,640		ソフトクリエイトHD	2.9	2.7	9,396	
関西電力	255.9	253.5	291,905		エスライン	1.7	1.3	1,231		T I S	66.3	66.3	210,171	
中国電力	97.1	97.7	104,343		神奈川中央交通	1.5	1.5	5,415		JNS ホールディングス	2.8	4.3	2,201	
北陸電力	62.2	62.4	38,438		日立物流	11.7	13.4	66,866		電算システム	2.5	—	—	
東北電力	168.3	156.4	134,660		丸和運輸機関	6.8	13.8	23,156		グリー	40.9	42.6	27,349	
四国電力	61.1	55.1	45,567		C&F ロジホールディングス	6.5	6.3	12,196		コーエーテックモHD	13.6	17.9	105,252	
九州電力	139.3	148.5	130,531		九州旅客鉄道	56.3	49.5	123,255		三菱総合研究所	2.9	2.8	12,418	
北海道電力	63.7	64.3	35,300		SG ホールディングス	67.2	120.5	407,892		ポルテージ	1.9	3.1	1,398	
沖縄電力	13.2	13	19,487		<b>海運業 (0.6%)</b>					電算	0.7	0.8	2,064	
電源開発	54	53.3	88,904		日本郵船	53.7	53.4	537,204		AGS	3.7	3.1	3,081	
エフオン	3.7	4.5	4,090		商船三井	40.7	37.9	348,301		ファインデックス	5.7	6.1	6,423	
イーレックス	9.7	10.2	28,968		川崎汽船	19.8	19.8	144,738		ブレインパッド	1.7	1.9	11,552	
レノバ	11.3	11.7	64,233		NS ユナイテッド海運	3.6	3.2	16,096		K L a b	12.6	12	7,296	
東京瓦斯	130.1	128.7	277,798		明治海運	6.6	7	6,251		ポルトタウン・ピットクル	8	8.9	9,095	
大阪瓦斯	131.5	120.9	257,396		飯野海運	30.2	29.3	16,818		イーブクイニシアティブ	0.9	1.3	5,297	
東邦瓦斯	33.3	33.1	179,733		共栄タンカー	1.2	1.2	1,300		ネクソン	167.2	148.6	259,752	
北海道瓦斯	3.6	3.5	5,607		乾汽船	3.7	4.5	12,060		アイスタイル	18.4	21.6	9,763	
広島ガス	13	11.7	4,680		<b>空運業 (0.5%)</b>					エムアップホールディングス	1.9	2	6,730	
西部ガスHLDGS	7.6	7.4	18,973		日本航空	113.5	155.4	388,344		エイチーム	4.5	5.1	7,435	
静岡ガス	19.3	19.3	24,993		ANA ホールディングス	117.3	172	466,120		エニグモ	6.3	6.5	8,417	
メタウォーター	3.3	7.9	15,215		パスコ	1.3	1.3	1,913		テクノスジャパン	5.3	5.3	3,296	
<b>陸運業 (3.1%)</b>					<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>					enish	3.5	3.9	1,770	
SBS ホールディングス	5.1	5.4	22,923		トランコム	1.8	2	17,400		コロプラ	21.9	21.3	17,657	
東武鉄道	70.4	69.5	206,971		日新	5.6	4.9	8,467		オルトプラス	4.6	5.1	2,142	
相鉄ホールディングス	21.6	22.6	50,488		三菱倉庫	20.4	22	72,380		プロードリーフ	32.9	33.8	19,435	
東急	170.5	168.3	270,626		三井倉庫 HOLD	7.4	6.9	18,719		クロス・マーケティングG	3.2	3.3	2,930	
京浜急行	87.1	86	116,444		住友倉庫	23	22.5	43,897		デジタルハーツHLDGS	3.7	3.4	7,650	

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
システム情報	4.9	5.4	5,529	5,529	カナミックネットワーク	6	7.5	4,740	4,740	エックスネット	1.1	1.6	1,657	1,657
メディアドゥ	2.1	2.8	14,000	14,000	ノムラシステムコーポレーション	3.6	3.9	1,119	1,119	大塚商会	35.9	35.9	212,169	212,169
じげん	16.5	17	6,987	6,987	チェンジ	4.6	12.6	28,350	28,350	サイボウズ	7.8	9.2	23,404	23,404
ブイキューブ	3.7	7	11,571	11,571	シンクロ・フード	2.7	5.2	2,069	2,069	ソフトブレーン	4.1	—	—	—
エンカレッジ・テクノロジ	1.3	1.1	674	674	オークネット	3.6	3.9	8,872	8,872	電通国際情報S	4.1	9.8	43,806	43,806
サイバーリンクス	1.2	2.6	3,746	3,746	セグエグループ	1.3	2	1,644	1,644	A C C E S S	6.1	8.4	8,601	8,601
ディー・エル・イー	4.3	4.3	1,259	1,259	エイトレッド	1.1	1.6	4,096	4,096	デジタルガレージ	12	10.9	54,500	54,500
フィックスターズ	7.1	7.1	5,687	5,687	AOI TYO HOLDINGS	6.7	—	—	—	イーエムシステムズ	9.3	11.7	9,711	9,711
CARTA HOLDINGS	3.1	3	7,605	7,605	マクロミル	13.5	13.5	10,840	10,840	ウェザーニューズ	2.3	2.1	13,986	13,986
オプティム	3.5	5	9,810	9,810	ビーグリー	1.3	1.7	2,415	2,415	C I J	4.8	4	3,500	3,500
セレス	2.3	2.6	7,033	7,033	オロ	1.7	2.3	9,165	9,165	ビジネスエンジニアリング	0.8	0.8	2,916	2,916
S H I F T	2.7	3.4	92,922	92,922	ユーザーローカル	0.6	2.7	5,429	5,429	日本エンタープライズ	7.3	8.4	1,806	1,806
ティーガイア	5.9	6.7	13,567	13,567	デモナ	1.3	2	1,618	1,618	WOWOW	3.2	3.3	8,157	8,157
セック	1	1	2,442	2,442	ニーズウェル	1	1.8	1,405	1,405	スカラ	4.6	6.5	4,933	4,933
日本アジアグループ	7.3	—	—	—	サインポスト	1.3	1.8	2,484	2,484	インテリジェントウェイブ	3.7	3.7	2,345	2,345
テクマトリックス	9.4	11.1	22,422	22,422	電算システムHD	—	2.9	8,569	8,569	IMAGICA GROUP	5.7	5.4	2,986	2,986
プロシップ	1.9	2.2	3,680	3,680	ソルクシーズ	3	3	3,309	3,309	ネットワンシステムズ	25.3	27.1	105,961	105,961
ガンホー・オンライン・エンター	16.1	17.8	37,967	37,967	フェイス	2.3	2.5	1,760	1,760	システムソフト	22.4	18.4	3,128	3,128
GMOペイメントゲートウェイ	14.1	12.9	196,983	196,983	プロトコーポレーション	6	8.1	12,708	12,708	アルゴグラフィックス	5.7	5.3	17,967	17,967
ザッパラス	2.9	4.1	2,140	2,140	ハイマックス	0.8	2.2	2,448	2,448	マーベラス	10	10.4	7,290	7,290
システムリサーチ	1.8	2.1	4,380	4,380	野村総合研究所	94	114.8	516,026	516,026	エイベックス	11.5	11.7	17,585	17,585
インターネットアジアティブ	9.9	18	71,460	71,460	サイバネットシステム	5.1	5.3	3,439	3,439	日本ユニシス	20.7	23.1	69,762	69,762
さくらインターネット	7	7.8	4,898	4,898	C E ホールディングス	4	3.8	2,382	2,382	兼松エレクトロニクス	3.6	3.6	14,526	14,526
ヴェンクス	1.9	1.9	1,873	1,873	日本システム技術	1.2	1.2	2,175	2,175	TBS ホールディングス	40.2	43.6	74,556	74,556
GMOグローバルサインHD	1.2	1.6	7,408	7,408	インテージホールディングス	8.4	8.8	14,440	14,440	日本テレビHLDS	55.1	55.1	68,930	68,930
SRA ホールディングス	3.6	3.6	10,659	10,659	東邦システムサイエンス	1.7	1.4	1,491	1,491	朝日放送グループHD	6.4	5.3	4,049	4,049
システムインテグレート	2.3	1.8	1,137	1,137	ソースネクスト	31.6	33.4	8,183	8,183	テレビ朝日HD	18.3	20.6	36,008	36,008
朝日ネット	4.7	6	4,530	4,530	インフォコム	7.3	6.6	16,691	16,691	スカパーJSATHD	43.9	42.6	18,147	18,147
e B A S E	8	8.6	7,172	7,172	HEROZ	0.9	2	4,066	4,066	テレビ東京HD	5.5	4.5	9,864	9,864
アバント	6.3	7.7	11,958	11,958	ラクスル	5.3	7.4	47,952	47,952	日本BS放送	2.1	2	2,286	2,286
アドソル日進	2.4	2.7	6,166	6,166	F I G	7.7	6.8	1,972	1,972	ビジョン	6.1	11.9	16,671	16,671
フリービット	3.7	4.7	5,480	5,480	システムサポート	1.4	1.9	2,540	2,540	スマートパリュウ	1.8	2.1	1,472	1,472
コムチュア	7.5	6.2	19,902	19,902	イーソル	3.1	4	4,068	4,068	USEN-NEXT HLDGS	2.6	6.8	25,296	25,296
サイバーコム	1.2	1.1	1,465	1,465	アルテリア・ネットワークス	7.4	7.8	13,751	13,751	ワイヤレスゲート	3.2	3.1	1,236	1,236
アステリア	4.4	5.2	3,666	3,666	東海ソフト	0.4	1.3	1,718	1,718	コネクシオ	3.8	4.2	6,678	6,678
アイル	3.7	3.9	7,538	7,538	ヒト・コミュニケーションズHD	1.6	1.9	3,718	3,718	日本通信	51.7	60.9	14,128	14,128
マークラインズ	3.2	3.6	10,998	10,998	トピラスシステムズ	0.8	1.6	2,140	2,140	クロップス	1.3	1.2	1,194	1,194
メディカル・データ・ビジ	5	8.9	14,151	14,151	S a n s a n	—	6	75,540	75,540	日本電信電話	886.5	770.5	2,485,633	2,485,633
g u m i	8.6	9.5	7,780	7,780	フォーカスシステムズ	4.2	5.6	5,796	5,796	K D D I	483.8	528.4	2,000,522	2,000,522
ショーケース	1.6	1.9	1,238	1,238	クレスコ	4	4.7	10,133	10,133	ソフトバンク	607.9	599.1	932,199	932,199
モバイルファクトリー	1.6	2.1	2,188	2,188	フジ・メディア・HD	64.4	68.5	81,583	81,583	光通信	6.8	7.8	152,958	152,958
テラスカイ	2.4	2.5	5,400	5,400	オービック	23	20.8	484,016	484,016	N T T ドコモ	474.3	—	—	—
デジタル・インフォメーション	2.9	3.4	6,953	6,953	ジャストシステム	10.8	9.5	67,260	67,260	エムティーアイ	6.4	7.6	5,449	5,449
PCI ホールディングス	2.8	3.6	4,060	4,060	T D C ソフト	5.9	5.9	8,572	8,572	GMO インターネット	24	23.7	70,815	70,815
パイブドHD	0.9	1.6	4,038	4,038	Z ホールディングス	912.6	869.7	638,794	638,794	ファイバーゲート	2.1	2.9	4,341	4,341
アイビーシー	1.4	1.4	1,239	1,239	トレンドマイクロ	35.5	35.3	219,213	219,213	アイドマーケティングコミュ	2.1	1.7	649	649
ネオジャパン	1.2	1.7	2,888	2,888	ID ホールディングス	2.5	3.6	3,459	3,459	K A D O K A W A	18	17.3	98,437	98,437
P R T I M E S	1.2	1.8	5,490	5,490	日本オラクル	13.4	13.5	126,495	126,495	学研ホールディングス	8.9	9.6	11,625	11,625
ラクス	—	20.4	94,758	94,758	アルファシステムズ	2.1	1.9	8,103	8,103	ゼンリン	13.3	11.7	12,647	12,647
ランドコンピュータ	1	1	1,309	1,309	フューチャー	8	7.9	22,159	22,159	昭文社ホールディングス	3.1	3.4	1,774	1,774
ダブルスタンダード	0.9	1	7,830	7,830	CAC HOLDINGS	4.4	4.1	7,216	7,216	インプレスホールディングス	5.3	8.9	2,536	2,536
オーブントア	3.4	4.3	10,074	10,074	S B テクノロジー	2.4	2.8	8,540	8,540	アイネット	3.4	3	4,236	4,236
マイネット	2.1	2.6	1,682	1,682	トーセ	1.8	1.7	1,337	1,337	松竹	4.4	4.3	55,126	55,126
アカツキ	2.4	2.9	9,367	9,367	オービックビジネスC	6.8	6.5	37,570	37,570	東宝	39.2	38.9	204,614	204,614
ベネフィットジャパン	0.5	0.7	1,640	1,640	伊藤忠テクノソリューション	30.1	30.5	114,832	114,832	東映	2.5	2.2	48,202	48,202
UBICOMホールディングス	1.6	2	5,786	5,786	アイティフォー	8.1	8.8	7,664	7,664	N T T データ	176.7	175.8	382,365	382,365
LINE	20.4	—	—	—	東計電算	1	0.9	4,383	4,383	ピー・シー・エー	1.1	1.1	6,798	6,798

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ビジネスB太田昭和	2.2	2.6	4,479		明治電機工業	2	2.1	2,908		カメイ	8.6	8.1	10,116	
DT S	14.9	14	37,660		デリカフーズ HLDGS	2.2	3.5	2,359		東都水産	0.8	0.4	2,832	
スウェア・エニックス・HD	28.3	28.1	179,278		スターティアホールディングス	1.7	1.6	2,924		OUGホールディングス	1.1	1	2,935	
シーイーシー	7.1	7.2	9,907		コマダホールディングス	14.6	14.6	31,375		スターゼン	2.5	5	11,205	
カプコン	31.3	56.8	189,996		ピーバンドットコム	0.6	1.2	858		山善	26.2	25	28,300	
アイ・エス・ピー	1.4	4.1	5,231		アセンテック	1.4	2	2,500		椿本興業	1.2	1.2	4,698	
ジャステック	4.2	4.1	5,198		富士興産	2.2	2.1	2,221		住友商事	420.5	416.2	665,920	
S C S K	15.3	15.3	114,444		協栄産業	0.7	0.7	1,027		内田洋行	2.7	2.9	16,675	
日本システムウエア	2.2	2.1	5,212		小野建	5.5	5.5	9,581		三菱商事	436.9	402.7	1,422,336	
アイネス	6.5	6.8	10,778		南陽	1.4	1.2	2,490		第一実業	3.3	3.2	16,224	
T K C	5.6	11.5	42,492		佐島電機	4.5	4	3,668		キャノンマーケティングJPN	16.7	16.3	42,005	
富士ソフト	7.1	7.2	43,704		エコートレーディング	1.5	1.9	1,274		西華産業	3.7	3.3	5,494	
N S D	21.3	21.6	45,403		伯東	4.1	4.4	8,676		佐藤商事	5.6	5.1	6,186	
コナミホールディングス	24.2	24	164,160		コンドーテック	5.2	4.8	4,968		菱洋エレクトロ	6.8	5.1	12,138	
福井コンピュータ HLDGS	2.6	3.3	14,520		中山福	3.7	4.3	1,840		東京産業	6	6.6	4,989	
JBCCホールディングス	4.5	4.2	6,997		ナガイレーベン	8.9	8.4	23,007		ユアサ商事	6.4	6.6	20,559	
ミロク情報サービス	5.9	6.6	11,338		三菱食品	7.4	7	20,517		神鋼商事	1.6	1.5	5,085	
ソフトバンクグループ	526.6	522.9	3,309,434		松田産業	4.9	5.2	15,782		トルク	3.9	3.9	897	
<b>卸売業 (4.8%)</b>					第一興商	10	12.9	49,213		阪和興業	12.5	13.3	47,747	
ハウスイ	0.5	0.5	471		メディアパルHD	71.5	66.2	145,706		正栄食品	4.3	4.2	18,501	
高千穂交易	2.5	2.5	3,092		S P K	2.8	2.9	4,065		カナデン	5.4	5.3	5,618	
オルパルスケア HLDGS	0.7	1.1	1,755		萩原電気 HLDGS	2.5	2.4	5,551		菱電商事	4.8	4.7	8,629	
伊藤忠食品	1.7	1.6	8,736		アズワン	4.4	4.8	84,720		フルサト工業	3.4	3.4	7,752	
エレマテック	6.3	5.8	6,849		スズデン	2.3	2.2	3,568		岩谷産業	14.9	16.1	107,065	
J A L U X	1.8	1.7	3,054		尾家産業	1.9	2	2,302		ナイス	2.5	2.5	4,925	
あらた	5.3	5.1	23,358		シモジマ	4.1	4.2	5,481		昭光通商	2.3	—	—	
トーマンデバイス	1	0.9	4,941		ドウシシャ	6.3	6.2	11,042		ニチモウ	1	1	2,076	
東京エレクトロンデバイス	2.4	2.2	18,876		小津産業	1.5	1.7	3,394		榎東貿易	1.9	2.1	5,707	
フィールズ	4.9	5.9	3,097		高速	4	3.5	5,656		アステナホールディングス	8.7	10.8	6,696	
双日	368.1	367.4	130,059		たけびし	2.4	2.2	3,823		三菱石油	16.5	16.2	24,478	
アルフレッサホールディングス	73.9	68.6	119,981		リックス	1.5	1.3	1,989		稲畑産業	14.8	16	28,080	
横浜冷凍	17.5	17.4	16,077		丸文	5.6	5.6	4,390		G S I クレオス	1.6	3.6	3,790	
神栄	1	1.2	1,296		ハピネット	5.5	6	8,988		明和産業	6.3	5.9	6,820	
ラサ商事	3.4	3.3	3,184		橋本総業 HLDGS	1.3	1.6	3,652		クワザホールディングス	2.1	2.5	1,630	
アルコニクス	7.1	7.2	12,139		日本ライフライン	19.9	21.3	29,394		ヤマエ久野	4.9	4.6	5,796	
神戸物産	23	51.6	208,980		タカショー	3.9	5.1	4,758		ワキタ	14.2	13	14,144	
ハイパー	0.9	1.6	870		マルカ	2.3	2.3	6,713		東邦ホールディングス	21.1	20.8	39,520	
あいホールディングス	9.5	9.3	22,329		I D O M	18	22.7	22,858		サンゲツ	18.3	17.5	28,647	
ディービーエックス	2.3	2.1	2,370		進和	4	3.8	9,450		ミツウロコグループ	9.8	9.9	14,404	
ダイワボウHD	5.7	30.3	59,812		エスケイジャパン	1.6	2.6	1,276		シナモンホールディングス	2.8	2.5	9,275	
マクニカ・富士エレ HLDGS	15.9	16	44,624		ダイترون	2.8	2.8	6,801		伊藤忠エネクス	14.1	14.9	15,555	
ラクト・ジャパン	2.5	3	8,532		シークス	8.5	9.4	11,458		サンリオ	18.8	19.1	47,769	
バイタルK S K HD	11.5	11.3	9,446		田中商事	2.1	1.7	1,149		サンワテクノス	4.7	4.4	6,542	
八洲電機	5.1	4.6	4,968		オーハシテクニカ	3.5	3.4	5,348		リョーサン	7.4	6.8	15,925	
メディアスホールディングス	3.7	3.9	3,662		白銅	2.3	2.3	7,831		新光商事	10.3	9.1	8,171	
レスターホールディングス	7	6.5	12,629		ダイコー通産	0.4	0.9	1,131		トーホー	3	3	5,223	
ジューテックHD	1.3	1.4	1,569		伊藤忠	465.8	462.5	1,597,937		三信電気	3.6	4.1	7,047	
大光	2.8	3	2,124		丸紅	693.5	652.2	602,893		東陽テクニカ	7.6	6.9	8,907	
OCHIホールディングス	1.9	1.9	2,492		高島	1	1	1,901		モスフードサービス	8.8	9	29,835	
TOKAIホールディングス	34.9	31.5	29,295		長瀬産業	37.3	35.8	70,311		加賀電子	6.7	6.2	19,902	
黒谷	1.6	2.4	1,910		蝶理	4.3	4.3	8,406		ソーダニツカ	6.8	6.3	4,139	
Cominix	1.1	1.3	939		豊田通商	74.5	66.2	316,105		立花エレテック	4.9	4.6	7,318	
三洋貿易	6.7	6.9	8,438		三共生興	10	9.2	5,023		フラワーパル	2.9	2.2	2,435	
ビューティガレージ	1.1	1.2	4,362		兼松	25	26.1	37,688		P A L T A C	10.7	10.7	54,891	
ウイン・パートナーズ	4.8	4.6	4,558		ツカモトコーポレーション	1.3	1.4	1,993		三谷産業	8.7	9.4	3,647	
ミタチ産業	2	1.1	963		三井物産	577	527.9	1,290,715		太平洋興発	2.6	2.6	1,739	
シップヘルスケアHD	10.7	23.5	68,385		日本紙パルプ	3.8	3.3	12,837		西本 WISMETTAC HD	1.2	1.5	5,700	

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ヤマシタヘルスケア HLDGS	0.7	0.9	1,708		MonotaRO	47.5	84.2	212,015		メディカシステムネットワーク	6.4	6.2	4,761	
国際紙パルプ商事	15.9	13.6	4,787		東京一番フーズ	1.5	1.6	953		はるやま HLDGS	3.1	2.3	1,382	
ヤマタネ	3.3	2.9	4,808		DD ホールディングス	2.7	3.4	1,700		ノジマ	12	11.7	33,590	
丸建建材リース	0.7	0.5	949		きちりホールディングス	1.7	1.4	898		カッパ・クリエイト	9.4	9.1	12,794	
日鉄物産	4.7	4.6	24,150		アークランドサービスHD	4.9	5.5	13,018		ライトオン	4.9	4.6	3,353	
泉州電業	2	2	10,160		J. フロントリテイリング	79.8	79.4	80,511		ジーンズメイト	2.7	—	—	
トラスコ中山	14	13.8	41,096		ドトール・日レスHD	9.7	10.4	17,648		良品計画	88.9	76.2	195,605	
オートバックスセブン	24.6	23.4	35,357		マツモトキヨシ HLDGS	27.5	27.5	141,900		三城ホールディングス	6.9	7.9	2,117	
モリト	4.9	4.5	3,145		ブロンコビルー	3.5	3.6	9,183		アドヴァングルーヴ	10.3	6.6	6,448	
加藤産業	9.7	9.3	32,550		ZOZO	45.9	39.2	166,600		アルビス	2.5	1.9	4,721	
北恵	1.6	1.8	1,886		トレジャー・ファクトリー	2	2.1	2,064		コナカ	7.7	7.8	2,870	
イノテック	3.9	3.7	5,335		物語コーポレーション	1.8	3.7	27,713		ハウス ローゼ	0.8	0.6	1,008	
イエローハット	12.6	12	23,952		ココカラファイン	6.9	5.9	51,330		G-アールディングス	3.9	3.9	16,731	
JK ホールディングス	6	5.8	4,901		三越伊勢丹HD	117.3	116.5	93,083		イオン北海道	8.5	8.9	11,570	
日伝	6.1	5.3	13,393		Hamee	2.4	1.9	2,513		コジマ	11.4	12.3	8,142	
北沢産業	5.2	4.3	1,130		ウエルシアHD	39.6	35.2	145,904		ヒマラヤ	2.2	2.2	3,080	
杉本商事	3.5	3.2	9,558		クリエイティブSDH	11.2	9.7	37,830		コーナン商事	9.5	9.6	35,808	
因幡電機産業	19.1	17.5	49,577		丸善 CHI HD	5.6	5.1	1,963		エコス	2.4	2.5	4,937	
東テック	2.2	2.3	6,433		ミサワ	1.6	1.9	1,282		ワタミ	7.9	8.9	8,997	
ミスミグループ本社	83.6	82.9	398,334		ディーライフ	0.9	1.4	2,121		マルシェ	1.5	1.5	741	
アルテック	5.6	6.3	2,003		エー・ピーホールディングス	1.5	1.7	761		パンパシフィック HD	146.4	132.5	269,372	
タキヒヨー	2	2.1	4,063		テムニー	2	2.1	3,173		西松屋チェーン	14.7	14.9	21,083	
蔵王産業	1	1	1,736		シュッピン	4.6	4.8	6,100		ゼンショーホールディングス	32	35.4	99,898	
スズケン	28.1	28	91,700		オイシックス・ラ・大地	6.6	9	45,630		幸楽苑ホールディングス	4.2	4.1	6,211	
ジェコス	4.6	4.5	4,099		ネクステージ	9.6	13.7	32,332		ハークスレイ	1.3	1	1,026	
グローセル	6.7	6.4	2,668		ジョイフル本田	19.6	18.6	29,332		サイゼリヤ	10	10.2	28,345	
<b>小売業 (4.4%)</b>					鳥貴族ホールディングス	2.3	2.6	5,558		V Tホールディングス	27.6	25.2	14,389	
ローソン	16.9	16.6	95,118		キリン堂ホールディングス	2.6	—	—		魚力	1.9	1.9	4,216	
サンエー	5.5	4.8	19,416		ホットランド	4.5	4.6	6,242		ポプラ	1.8	3.1	688	
カワチ薬品	5.2	4.6	10,704		すかいらーく HD	74.9	92.6	147,048		フジ・コーポレーション	1.8	3.4	4,195	
エービーシー・マート	10.4	10.3	60,255		SFP ホールディングス	3.8	2.9	4,176		ユナイテッドアローズ	7	7.7	15,030	
ハードオフコーポレーション	2.5	2.5	1,952		綿半ホールディングス	2.5	4.9	6,374		ハイデイ日高	9.7	9.5	16,539	
アスクル	7	11.2	19,219		ヨシックスホールディングス	1.1	1.3	2,973		京都きもの友禅	3.9	4.3	1,105	
ゲオホールディングス	11.9	8.9	10,920		ユナイテッド・スーパーマーケット	19.3	19	21,964		コロワイド	22.3	22	38,016	
アダストリア	9.3	9.4	18,630		ゴルフダイジェスト・オン	2.9	3.9	5,460		ピーシーデポコーポ	8.8	7.4	3,507	
ジーフット	4.4	3	1,224		BEENOS	3	3.6	10,782		壱番屋	4.7	4.4	20,636	
シー・ヴィー・エス・バイエリア	1	1	413		あさひ	5	5	7,050		トップカルチャー	2.4	2.5	855	
くら寿司	3.5	7.1	28,293		日本調剤	4.1	4.2	7,320		PLANT	1.6	1.6	1,182	
キャンドゥ	3.2	3.6	6,872		コスモス薬品	5.9	6.7	136,747		スギホールディングス	13.3	13.3	116,242	
パルグループ HLDGS	6.9	5.9	10,307		トーエール	3.2	3.1	2,824		薬王堂ホールディングス	2.9	2.8	7,092	
エディオン	30.8	27.5	29,617		オンリー	1.1	1.1	840		ヴィア・ホールディングス	8.1	7.6	1,504	
サラコーポレーション	13.4	13.6	8,880		セブン&アイ・HLDGS	260.5	258.8	1,326,091		スクロール	10.1	9.9	8,751	
ワッツ	2.8	3.4	3,022		クリエイティブ・レストラン・ホールディングス	36.1	36.2	33,050		ヨンドシーホールディングス	6.8	6.2	11,352	
ハロース	2.5	2.7	8,140		ツルハホールディングス	14.5	14.5	203,000		ファミリーマート	53.2	—	—	
フジオフード G 本社	5.7	5.6	7,800		サンマルクホールディングス	5.3	5.1	8,058		木曽路	8.8	8.3	20,575	
あみやき亭	1.4	1.3	3,802		フェリシモ	1.4	1.7	2,864		SRS ホールディングス	8.1	8.2	6,888	
ひらまつ	11.8	12.7	2,705		トリドールホールディングス	16.6	16.6	43,259		千趣会	12.2	11.8	4,625	
大黒天物産	1.6	2.2	15,158		TOKYO BASE	6	6.9	4,319		タカキユー	6.1	7.3	963	
ハニーズホールディングス	5.8	5	5,640		ウィルプラス HLDGS	1.1	1.2	1,306		リテールパートナーズ	8.9	7.9	10,262	
ファーマライズ HD	1.5	1.5	1,218		JM ホールディングス	5.1	4.9	10,691		ケーヨー	13.7	11.9	10,103	
アルペン	5.1	5.3	17,543		サツドラホールディングス	0.9	0.9	2,000		上新電機	7.9	7.4	19,402	
ハブ	1.9	2.1	1,520		アレンザホールディングス	3.3	4.9	7,154		日本瓦斯	10.6	32.6	55,159	
クオールホールディングス	9.8	8.8	14,229		串カツ田中 HLDGS	1.3	1.9	4,284		ロイヤルホールディングス	11.7	11.6	24,812	
ジーンズホールディングス	3.6	4.6	37,398		パロックジャパン	4.6	4.9	4,272		東天紅	0.5	0.5	557	
ビックカメラ	39.8	38.5	40,964		クスリのアオキ HLDGS	6	6.6	56,034		いなげや	8.2	7.3	10,570	
DCM ホールディングス	37.3	40.7	46,113		力の源 HD	3	2.3	1,405		島忠	12.5	—	—	
ペッパーフードサービス	5.7	9.2	3,413		FOOD&LIFE COMPAN	36.7	38.9	195,667		チヨダ	7.1	6.4	5,254	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ライフコーポレーション	5.1	6.2	29,667	千円	<b>銀行業 (4.9%)</b>					阿波銀行	10.9	9.9	21,968	
リンガーハット	8.3	7.9	19,054		島根銀行	1.5	3	1,845		大分銀行	3.9	3.7	6,889	
Mr Ma x HD	9.2	8.8	6,036		じもとホールディングス	45	4.3	3,048		富岡銀行	4.5	4.1	8,745	
テンアライド	5.9	5.3	1,738		めぶきフィナンシャルG	346	344.1	86,369		佐賀銀行	4	3.8	5,719	
AOKI ホールディングス	13.5	13.3	9,123		東京きらぼしFG	9	8.8	13,860		沖縄銀行	6.1	5.8	16,634	
オークワ	10.5	10	12,170		九州フィナンシャルG	146.2	134.9	56,658		琉球銀行	15.5	13.6	10,812	
コメリ	10.3	10	27,250		ゆうちょ銀行	187.6	187.2	179,337		セブン銀行	223	221.9	56,806	
青山商事	13.8	15.3	12,163		富山第一銀行	15.7	14.7	4,410		みずほフィナンシャルG	9,059.1	898.7	1,439,717	
しまむら	7.8	7.7	77,077		コンソルディア・フィナンシャル	380.6	402.8	178,843		高知銀行	2.5	2.5	2,102	
はせがわ	3.4	3.3	884		西日本フィナンシャルHD	44.6	43.3	30,959		山口フィナンシャルG	83.5	82.6	54,929	
高島屋	48.9	49.2	56,973		関西みらいFG	39.5	—	—		長野銀行	2.1	2.4	2,812	
松屋	13.5	14.4	16,156		33FG	6.2	5.6	8,366		名古屋銀行	5.1	5.2	14,414	
イチ・ツー・オーリテイリング	31.8	32.5	30,712		第四北越フィナンシャルG	11.7	10.7	27,841		北洋銀行	101.3	101.2	26,716	
近鉄百貨店	2.6	2.5	6,507		ひろぎん HLDGS	—	98.7	64,352		愛知銀行	2.4	2.3	8,418	
丸井グループ	61.2	56.4	118,045		新生銀行	49.1	54.7	103,164		中京銀行	2.7	2.6	3,653	
アクシアリテイリング	5.5	5.3	21,677		あおぞら銀行	40	39.5	107,993		大光銀行	2.2	2.2	3,498	
井筒屋	4	3.7	987		三菱UFJフィナンシャルG	4,562.2	4,527.4	2,863,580		愛媛銀行	9	8.9	7,120	
イオン	256.1	254.2	767,175		りそなホールディングス	725.8	768.7	341,225		トマト銀行	2.5	2.3	2,566	
イズミ	13.7	13.5	48,465		三井住友トラストHD	126	125.2	479,516		京葉銀行	28.5	25.7	11,693	
平和堂	13.4	12	27,684		三井住友フィナンシャルG	461	457.6	1,797,910		栃木銀行	31.6	31.6	5,846	
フジ	8.1	7.9	17,917		千葉銀行	222.5	221.2	157,715		北日本銀行	2	1.9	3,060	
ヤオコー	7.6	7.5	54,075		群馬銀行	128	136.6	49,449		東和銀行	11.7	12.2	6,771	
ゼビオホールディングス	8	7.4	8,569		武蔵野銀行	10	9.7	18,284		福島銀行	7.3	7.7	1,940	
ケーズホールディングス	64.4	56.6	67,750		千葉興業銀行	18	16.6	4,648		大東銀行	3.3	3	2,055	
OLYMPIC グループ	3.4	3.6	2,876		筑波銀行	28.1	29.1	5,267		トモニホールディングス	51.8	48.2	16,147	
日産東京販売HD	9.7	8.9	2,171		七七七銀行	22.7	20.5	26,076		フィデアホール	64.4	66.2	8,473	
シルバライフ	0.9	1.5	2,320		青森銀行	5.2	5.1	11,123		池田泉州HD	76.9	74.8	12,641	
一家ダイニングプロジ	0.5	1.3	757		秋田銀行	4.3	4	5,980		<b>証券、商品先物取引業 (0.7%)</b>				
GENKY DRUGSTORES	2.9	2.9	14,964		山形銀行	7.5	7	6,244		FPG	20.6	22.7	16,048	
カルミヤ・インターナショナル	1.4	1.6	1,654		岩手銀行	4.4	4.2	7,413		マキアライベストメント	2.8	—	—	
ブックオフGHD	3.9	3.7	3,637		東邦銀行	59.7	56.7	12,247		マキアライベストメント	—	3.2	2,422	
アインホールディングス	8.2	9.6	71,328		東北銀行	3.1	3.3	3,418		SBIホールディングス	74.6	81.8	227,240	
元気寿司	1.7	1.8	4,941		みちのく銀行	4.4	4.5	3,996		日本アジア投資	6.3	6.1	1,518	
ヤマダホールディングス	203.4	221	105,196		ふくおかフィナンシャルG	56.3	60.1	121,161		ジャフコグループ	10.3	8.7	63,423	
アークランドサカモト	10.5	10.3	17,911		静岡銀行	162.2	161.8	150,150		大和証券G本社	534.4	495.5	330,845	
ニトリホールディングス	28.8	26.2	588,976		十六銀行	8.4	8.3	18,284		野村ホールディングス	1,174.1	1,013	558,264	
ブルメ杵屋	4.7	4.1	4,169		スルガ銀行	63	63	24,129		岡三証券グループ	57.3	53.9	22,476	
美眼	5.4	4.4	976		八十二銀行	161	148.5	58,954		丸三証券	19.7	19.6	12,759	
ケーユーホールディングス	2.9	3.4	3,478		山梨中央銀行	7.8	7.4	6,349		東洋証券	24.3	21.5	3,612	
吉野家ホールディングス	22	21.7	48,759		大垣共立銀行	13.2	12.9	25,038		東海東京HD	76.9	68.8	29,240	
松屋フーズHLDGS	3.2	2.9	10,614		福井銀行	5.7	5.9	9,971		光世証券	1.8	1.8	1,089	
サガミホールディングス	8.9	8.7	9,291		北國銀行	6.7	6.2	13,106		水戸証券	19.1	17.8	5,571	
関西スーパーマーケット	5.5	4.8	9,528		清水銀行	2.7	2.5	4,232		いちよし証券	12.2	13.3	9,522	
王将フードサービス	4.9	4.1	25,010		富山銀行	1.3	1.3	2,996		松井証券	37.7	32.2	26,822	
プレナス	7.2	7.5	16,222		滋賀銀行	13.4	13.2	24,987		マネックスG	50	60.4	34,428	
ミニストップ	5	5.4	8,127		南都銀行	11.2	9.3	18,972		極東証券	8.7	8.5	7,403	
アークス	13.6	12.7	29,959		百五銀行	59.5	59.3	19,924		岩井コスモホールディング	6.3	7.7	11,118	
パローホールディングス	14.7	13.3	33,795		京都銀行	23.9	23.9	119,978		藍澤證券	12	11.9	13,768	
藤久	0.6	1.7	1,283		紀陽銀行	23.7	23	36,593		マネーパートナーズGP	6.6	9.1	1,992	
ベルク	3.3	3.2	19,872		ほくほくフィナンシャルG	44.5	44.2	37,083		スパークス・グループ	30.8	31.6	9,290	
大庄	3.5	3.1	3,205		広島銀行	99	—	—		小林洋行	2.8	4.1	1,123	
ファーストリテイリング	8.9	8.9	664,207		山陰合同銀行	39.9	41	23,124		<b>保険業 (2.0%)</b>				
サンドラッグ	25.1	25	91,250		中国銀行	57.5	56	49,840		かんぽ生命保険	23.5	82.4	171,227	
サックスパーホールディング	5.5	5	2,845		鳥取銀行	2.2	2.2	2,530		SOMPOホールディングス	125.4	116.6	592,094	
ヤマザワ	1.4	1.1	1,927		伊予銀行	95.1	88.2	51,597		アニコムホールディングス	5.5	19.5	17,667	
やまや	1.3	1.2	3,050		百十四銀行	7.1	6.5	10,400		M S & A D	174.3	160.3	615,071	
ペルーナ	14.4	14.9	12,650		四国銀行	10.2	9.3	6,937		第一生命HLDGS	377.8	326.2	769,342	

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
東京海上HD	235.9	218.1	1,308.600	600	ケイアイスター不動産	2.2	2.3	12,788	12,788	リンクアンドモチベーション	13.7	14.5	16,037	16,037
T&Dホールディングス	199.7	198.3	305,382	382	アブレ都市デザイン	1.7	1.7	2,007	2,007	G C A	7.8	8.2	11,439	11,439
アドバンスクリエイト	1.6	3.4	3,787	787	ジェイ・エス・ビー	1.3	1.4	4,298	4,298	エス・エム・エス	20.2	22.2	94,128	94,128
<b>その他金融業 (1.1%)</b>					テンポイノベーション	1.7	2.2	2,010	2,010	サニーサイドアップG	2.1	2	1,566	1,566
全国保証	18.9	17.2	94,944	944	グローバルリンクマネジメント	1.4	1.3	1,223	1,223	パーソルホールディングス	65.1	64.2	175,009	175,009
ジェイリース	2.5	2.5	5,120	1,200	パーク24	36	35.8	64,547	64,547	リニカル	3.2	3.7	2,963	2,963
イントラスト	2.5	2.7	1,917	1,917	パラカ	1.7	1.6	2,944	2,944	クックパッド	22.4	21.7	5,099	5,099
日本モーゲージサービス	2.8	3.7	3,870	3,870	三井不動産	329	301.5	760,533	760,533	エスクリ	2	3	1,671	1,671
C a s a	2.3	2.1	2,034	2,034	三菱地所	467.2	433.9	750,863	750,863	アイ・ケイ・ケイ	3.1	3.1	2,135	2,135
アルヒ	10.7	10.1	13,180	13,180	平和不動産	12.2	11.5	47,092	47,092	学情	2.4	2.8	3,533	3,533
プレミアグループ	3.6	3.4	11,798	11,798	東京建物	66.1	65.4	111,114	111,114	スタジオアリス	3.2	3.4	8,027	8,027
クレディセゾン	47	38.9	52,787	52,787	ダイビル	17	16.9	26,296	26,296	シックホールディングス	3.6	3.6	5,403	5,403
芙蓉総合リース	7	6.8	53,924	53,924	京阪神ビルディング	10.5	10.5	15,456	15,456	エプコ	1.3	1.5	1,336	1,336
みずほリース	10.2	10.5	38,377	38,377	住友不動産	149.9	148.9	578,923	578,923	N J S	1.4	1.6	3,152	3,152
東京センチュリー	13.4	15.3	99,450	99,450	テオーシー	12.9	12.1	8,022	8,022	総合警備保障	25.9	25.4	129,032	129,032
日本証券金融	29.5	29	27,318	27,318	東京楽天地	1.2	1	4,125	4,125	カクコム	48	47.8	177,099	177,099
アイフル	102	113.8	40,968	40,968	スターツコーポレーション	9	7.7	21,937	21,937	アイロムグループ	2.4	2.4	5,232	5,232
リコーリース	5.2	5.2	19,578	19,578	フジ住宅	7.7	7.7	5,528	5,528	セントケア・ホールディング	4	5.2	5,215	5,215
イオンフィナンシャルサービス	41.1	40.4	52,802	52,802	空港施設	6.8	7.2	4,305	4,305	サイネックス	1.1	1.8	1,213	1,213
アコム	133.9	129.8	54,645	54,645	明和地所	4.2	3.4	2,077	2,077	ルネサンス	3.5	4.2	4,897	4,897
ジャックス	7.4	7.7	23,485	23,485	ゴールドクレスト	5	5.8	9,987	9,987	ディップ	9.1	10.4	42,844	42,844
オリコ	181.6	179.6	27,478	27,478	エスリード	2.7	2.5	4,175	4,175	デジタルホールディングス	3.5	4.9	8,619	8,619
日立キャピタル	15.8	—	—	—	日神グループHLDGS	10.3	9.3	4,752	4,752	新日本科学	7.1	8.1	7,452	7,452
アプラスフィナンシャル	34.1	—	—	—	日本エスコ	12.2	13.1	10,427	10,427	ツクイホールディングス	15.2	—	—	—
オリックス	413.9	401.5	850,577	850,577	タカラレーベン	30.2	29.3	9,434	9,434	キャリアデザインセンター	1.7	1.6	1,936	1,936
三菱HCキャピタル	168.4	227	134,838	134,838	A V A N T I A	3.8	3.6	3,178	3,178	ベネフィット・ワン	23.7	23.5	129,485	129,485
九州リースサービス	2.9	3	1,842	1,842	イオンモール	33.4	33.1	55,674	55,674	エムスリー	142.6	113.6	975,596	975,596
日本取引所グループ	191.3	178.7	519,659	519,659	毎日コムネット	2	2.7	2,073	2,073	ツカガ・グローバルHOLD	4	4.9	1,734	1,734
イー・キャランティ	7.2	8	20,144	20,144	ファースト住建	2.9	2.9	3,862	3,862	プラス	0.7	1.4	1,143	1,143
アサックス	3.5	3.9	2,780	2,780	ランド	378.1	371.2	4,454	4,454	アウトソーシング	37.1	37.4	74,987	74,987
NECキャピタルソリューション	2.7	2.8	6,014	6,014	カチタス	16.6	16.4	66,502	66,502	ウエルネット	6.6	6.3	3,320	3,320
<b>不動産業 (1.9%)</b>					トーセイ	9.4	9.3	10,648	10,648	ワールドホールディングス	2.3	2.6	7,264	7,264
いちご	85.5	74.3	26,153	26,153	穴吹興産	1.5	1.8	3,668	3,668	ディー・エヌ・エー	27.5	27.8	55,155	55,155
日本駐車場開発	69.7	73.5	11,907	11,907	サンフロンティア不動産	9.5	8.1	9,185	9,185	博報堂D Y HLDGS	90.5	89.1	169,913	169,913
スター・マイカ・HLDGS	3.3	3.5	5,281	5,281	インテリックス	2.8	2	1,542	1,542	ぐるなび	11.3	11.1	5,805	5,805
ADワークスグループ	14.9	13.1	2,096	2,096	ランドビジネス	2.6	2.9	783	783	タカミヤ	6.7	7.5	3,720	3,720
ヒューリック	141.5	139.7	186,359	186,359	サンネクスグループ	1.9	2.3	2,339	2,339	ジャパンベストレスクー5	5	5	6,340	6,340
三栄建築設計	2.7	3	5,907	5,907	グランディハウス	5.3	5.2	2,527	2,527	ファンコミュニケーションズ	18	16.4	7,183	7,183
野村不動産HLDGS	40.5	38.3	110,074	110,074	日本空港ビルデング	21.4	23.1	115,962	115,962	ライク	2.3	1.9	3,465	3,465
三重交通グループHD	13.3	12.8	6,758	6,758	<b>サービス業 (6.0%)</b>					ビジネス・ブレイクスルー	3.2	3	1,317	1,317
サムティ	9.5	9.7	22,765	22,765	明豊ファシリティアワークス	2.7	3.3	3,012	3,012	エスプール	16.6	19.1	20,131	20,131
日本商業開発	4.5	4.6	8,050	8,050	日本工営	4.4	3.8	13,148	13,148	WDBホールディングス	3	3	10,920	10,920
プレサンスコーポレーション	11.1	11	20,614	20,614	L I F U L L	22.6	22.5	8,212	8,212	手間いらず	0.4	1	5,850	5,850
ハウスコム	0.9	1.2	1,536	1,536	ミクシィ	12.4	16.5	43,560	43,560	ティア	3.6	3.6	1,828	1,828
日本管理センター	3.9	3.7	4,643	4,643	ジェイエイシリアルメント	4.3	5.5	11,698	11,698	C D G	0.7	0.5	785	785
サンセイランディック	2.5	2	1,656	1,656	日本M&Aセンター	49.2	105.5	378,745	378,745	パリュウコマース	3.6	5.3	25,705	25,705
エストラスト	1.4	1.1	729	729	メンバーズ	1.9	2.4	8,280	8,280	インフォーマット	65.6	71.5	76,648	76,648
フージャースHD	13.3	10.4	7,238	7,238	中広	0.6	1.1	442	442	JPホールディングス	20.2	18.8	5,264	5,264
オープンハウス	19.5	21.2	139,072	139,072	UTグループ	10.2	9.4	29,046	29,046	エコナックホールディングス	13.5	13.5	1,201	1,201
東急不動産HD	181.9	180.4	119,785	119,785	アイティメディア	2.6	2.5	5,910	5,910	EPSホールディングス	9	—	—	—
飯田GHD	55.5	55.3	160,093	160,093	タケエイ	6.2	7.5	14,175	14,175	レッグス	1.7	1.7	3,610	3,610
イーグランド	1	1.3	2,139	2,139	E・Jホールディングス	1.2	3.5	4,753	4,753	プレステージ・インター	24.3	23.6	18,360	18,360
ビーロッド	3.4	4.7	2,547	2,547	夢真ビーネックスグループ	8.1	17.6	23,496	23,496	アミューズ	3.5	3.5	8,319	8,319
ファーストブラザーズ	1.5	1.2	1,238	1,238	コジダカホールディングス	15.5	18.6	10,843	10,843	ドリームインキュベータ	1.9	2.1	1,782	1,782
ハウスドゥ	3.5	3.3	3,286	3,286	アルトナー	1.8	1.6	1,385	1,385	クイック	3.9	3.9	5,440	5,440
シーアールイー	1.8	1.9	4,582	4,582	パソナグループ	7	7.3	24,345	24,345	T A C	4.4	4	972	972
プロパティエージェント	1.1	1.4	4,494	4,494	C D S	1.6	1.5	2,446	2,446	ケネディクス	56.8	—	—	—

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	千株	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円
電通グループ	67.1	66.2	278,040	ERIホールディングス	1.8	1.8	2,039	長大	2.5	2.6	5,842	長大	2.5	2.6	5,842	燦ホールディングス	2.8	2.7	3,923	
テイクアンドギヴニーズ	2.4	3.4	3,437	アビスト	0.9	1.1	3,349	スバル興業	0.4	0.4	3,324	スバル興業	0.4	0.4	3,324	西尾レントオール	6	5.8	17,162	
イオン	1.8	1.9	6,688	シブマックス	4.4	3.8	10,978	アゴラホスピタリティーG	47.5	52.2	1,305	アゴラホスピタリティーG	47.5	52.2	1,305	トランス・コスモス	6.2	6.4	23,616	
ジオファンタジー	2.5	2.5	5,097	ウィルグループ	4.3	4.7	6,138	トランス・コスモス	6.2	6.4	23,616	乃村工務社	27.8	27.7	27,118	乃村工務社	27.8	27.7	27,118	
シーティーエス	7.3	7.3	5,847	エスクローA J	9	10.3	2,451	藤田観光	2.9	2.7	6,480	藤田観光	2.9	2.7	6,480	KNT-CTホールディングス	3.9	3.8	5,354	
ネクシィーズグループ	2.4	2.3	2,047	リクルートホールディングス	463.1	459.6	3,209,386	KNT-CTホールディングス	3.9	3.8	5,354	日本管財	7.2	6.7	18,029	日本管財	7.2	6.7	18,029	
HUグループHD	18.2	18.1	58,372	エラン	3.8	9.7	11,950	トーカイ	6.3	6.1	14,347	トーカイ	6.3	6.1	14,347	白洋舎	0.8	0.7	1,464	
アルプス技研	5.7	5.5	11,423	土木管理総合試験	2.9	3.4	1,244	白洋舎	0.8	0.7	1,464	セコム	68.7	63.1	530,040	セコム	68.7	63.1	530,040	
サニックス	11.4	10.8	3,574	ネットマーケティング	2.3	4.6	2,125	セコム	68.7	63.1	530,040	セントラル警備保障	3.1	3	8,412	セントラル警備保障	3.1	3	8,412	
ダイオース	1.2	0.8	900	日本郵政	527	484.9	468,801	丹青社	12.2	11.9	10,186	丹青社	12.2	11.9	10,186	メイテック	8	7.8	51,246	
日本空調サービス	6.8	6.3	5,216	ベルシステム24HLDGS	10.9	10.9	18,257	メイテック	8	7.8	51,246	応用地質	6.9	7.1	10,302	応用地質	6.9	7.1	10,302	
オリエンタルランド	68.7	68.1	1,175,065	鎌倉新書	4.9	6.9	5,865	船井総研ホールディング	13.4	13.1	39,496	船井総研ホールディング	13.4	13.1	39,496	進学会ホールディングス	2.5	2.6	1,089	
ダスキン	16.2	14.5	38,976	S MN	1.3	2.1	1,421	進学会ホールディングス	2.5	2.6	1,089	オオバ	4.8	4.2	3,704	オオバ	4.8	4.2	3,704	
明光ネットワークジャパン	8.1	8.1	5,038	一蔵	0.7	0.9	369	オオバ	4.8	4.2	3,704	いであ	1.5	1.5	2,872	いであ	1.5	1.5	2,872	
ファルコホールディングス	3.5	2.9	5,251	LITALICO	2.2	—	—	学究社	1.8	1.9	2,660	ベネッセホールディングス	21.7	23.6	58,221	学究社	1.8	1.9	2,660	
秀英予備校	1.4	2	862	グローバルキッズCOMP	1	—	1,283	イオンディライト	8	7.8	28,236	イオンディライト	8	7.8	28,236	ナック	3.9	2.7	2,629	
田谷	1.2	1.5	862	エアトリ	3.3	4.6	15,226	ナック	3.9	2.7	2,629	ニチイ学館	6.2	—	—	ニチイ学館	6.2	—	—	
ラウンドワン	18.1	22.7	31,439	アトラエ	1.9	4.9	12,475	ダイセキ	10.9	12.9	63,081	ダイセキ	10.9	12.9	63,081	ステップ	2.4	2.3	4,372	
リゾートトラスト	29.8	29.8	61,477	ストライク	2.4	2.6	10,881	ステップ	2.4	2.3	4,372	株数、金額	79,781,50004	70,983,9189,973,468	銘柄数<比率>	2,151銘柄	2,126銘柄	<98.7%>		
ビー・エム・エル	8.3	8.4	37,212	ソラスト	18	16.2	25,077	合計	銘柄数<比率>	2,151銘柄	2,126銘柄	<98.7%>	銘柄数<比率>	2,151銘柄	2,126銘柄	<98.7%>	銘柄数<比率>	2,151銘柄	2,126銘柄	<98.7%>
ワタベウエディング	1	—	—	セラク	2.2	2.6	6,117	(注1)	銘柄欄の( )内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。				(注2)	合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。						
りあいコミュニケーション	11.7	9.9	12,315	インソース	2.8	6.7	13,929	(注3)	評価額の単位未満は切捨て。											
リソー教育	29.6	34.2	14,671	ペイカレントコンサルティング	3.9	4.2	258,720													
早稲田アカデミー	2.8	2.8	2,738	ORCHESTRA HLDGS	1.6	1.6	6,192													
ユー・エス・エス	72.9	71.5	143,071	アイモバイル	2.2	2.6	3,601													
東京個別指導学院	2.3	5.7	3,762	キャリアインデックス	2.8	3.2	3,244													
サイバーエージェント	39.9	159.1	348,906	MS-Japan	2.2	3	3,189													
楽天グループ	301.7	330.2	366,522	船場	1.1	0.9	743													
クワーク・アンド・リバー社	3.4	3.5	6,436	グレイステクノロジー	3	7.2	7,689													
テー・オー・ダブリュー	10.4	10.8	3,704	ジャパンエレベーターSHD	6.8	19.1	50,443													
山田コンサルティングGP	4.1	3.6	4,132	フルテック	0.9	0.9	1,320													
セントラルスポーツ	2.4	2.4	6,211	グリーンズ	1.8	2.8	1,540													
フルキャストホールディングス	6.2	5.7	12,722	ツナググループHLDGS	0.9	2.1	632													
エン・ジャパン	11.5	11.5	46,920	GAMEWITH	1.7	2.4	1,308													
リソルホールディングス	0.7	0.7	2,891	ソウルドアウト	1.3	1.6	2,585													
テクノプロ・ホールディング	13	38.6	128,924	MS&CONSULTING	1	1.3	783													
アトラグループ	1.7	1.9	590	ミダックホールディングス	0.8	2.9	17,081													
インターワークス	1.6	1.6	651	日総工産	4.5	5.3	3,821													
アイ・アールジャパンHD	2.6	2.7	37,125	キュービネットHLDGS	2.9	3	5,613													
Keeper 技研	2.4	4.4	16,786	RPAホールディングス	4.8	8.8	5,306													
ファーストロジック	1.4	2.2	1,683	スプリックス	2.2	2.1	2,009													
三機サービス	1.3	1.5	1,699	マネジメントソリューションズ	2.8	3.4	10,608													
Gunosy	4	4.8	3,494	プロレド・パートナーズ	0.9	1.7	3,173													
デザインワン・ジャパン	1.5	3.5	836	AND FACTORY	0.5	1.9	957													
イー・ガーディアン	3.2	3.2	10,304	ギークス	0.6	1.5	2,296													
リブセンス	4.5	6.6	1,346	カープスホールディングス	17.8	18.2	16,289													
ジャパンマテリアル	20	19.1	25,594	フォーラムエンジニアリング	3.3	4.7	4,399													
ベクトル	8.2	8.3	9,154	LITALICO	—	2.8	20,104													
ウチヤマホールディングス	3.2	3	1,029	アドバンテッジリスクマネ	3.3	3.6	4,032													
チャームケアコーポレーション	5.5	5.4	8,920	リログループ	35.4	35.2	75,856													
キャリアリンク	2.4	2.5	4,650	東祥	4	4.3	7,675													
I B J	4.5	5.9	6,407	エイチ・アイ・エス	10.1	14.5	35,728													
Aサンテ	2.7	2.6	4,693	ラックランド	1.5	1.9	5,468													
N・フィールド	4.3	—	—	共立メンテナンス	10.8	10.7	42,158													
パリュウHR	2.6	2.7	4,819	イチネンホールディングス	7.2	6.2	8,320													
M&Aキャピタルパートナー	5.3	5.5	31,735	建設技術研究所	4.4	4.1	10,783													
ライドオンエクスプレスHD	2.5	2.6	4,248	スペース	4.1	3.9	3,802													

## (2)先物取引の銘柄別期末残高(評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内	百万円	百万円
TOPIX	1,788	—

(注) 単位未満は切捨て。

## ■有価証券の貸付及び借入の状況

項 目	当 期 末	
	貸 付	借 入
株式	3,837,400 (株 16,100)	株 — (—)

(注1) ( )内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。  
 (注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、大和証券へ16,100株を貸付しています。

## ■投資信託財産の構成

2021年9月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 189,973,468	% 94.3
コール・ローン等、その他	11,462,381	5.7
投資信託財産総額	201,435,849	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年9月21日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	202,168,697,086円
コール・ローン等	11,388,192,763
株式 (評価額)	189,973,468,640
未収配当金	69,858,959
未収利息	581,660
その他未収収益	3,470,064
差入委託証拠金	733,125,000
(B) 負債	9,685,976,375
未払金	82,698,850
未払解約金	229,583,550
差入委託証拠金代用有価証券	767,800,000
受入担保金	8,605,893,975
(C) 純資産総額 (A - B)	192,482,720,711
元本	137,972,449,571
次期繰越損益金	54,510,271,140
(D) 受益権総口数	137,972,449,571口
1万口当り基準価額 (C / D)	13,951円

\* 期首における元本額は144,273,817,223円、当作成期間中における追加設定元本額は20,154,777,070円、同解約元本額は26,456,144,722円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、トピックス・インデックスファンド2,989,191,828円、ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A5,882,696,138円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A2 925,539円、ダイワ国内重視バランスファンド30 V A (一般投資家私募) 25,469,299円、ダイワ国内重視バランスファンド50 V A (一般投資家私募) 429,078,400円、ダイワ国際分散バランスファンド30 V A (一般投資家私募) 23,164,900円、ダイワ国際分散バランスファンド50 V A (一般投資家私募) 721,398,709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) 212,609,568円、D-1's T O P I Xインデックス50,045,732円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 112,275,070円、iFree T O P I Xインデックス4,271,085,355円、iFree 8資産バランス3,194,833,049円、iFree 年金バランス442,601,861円、D Cダイワ日本株式インデックス

65,726,059,110円、ダイワ・ライフ・バランス30 2,904,866,842円、ダイワ・ライフ・バランス50 3,951,974,309円、ダイワ・ライフ・バランス70 3,760,977,295円、年金ダイワ日本株式インデックス5,858,241,088円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 50,696,932円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 51,725,840円、ダイワつみたてインデックス日本株式1,353,026,496円、ダイワつみたてインデックスバランス30 9,628,593円、ダイワつみたてインデックスバランス50 8,568,294円、ダイワつみたてインデックスバランス70 17,409,216円、ダイワ世界バランスファンド40 V A113,101,715円、ダイワ世界バランスファンド60 V A130,262,046円、ダイワ・バランスファンド35 V A 6,161,189,519円、ダイワ・バランスファンド25 V A (適格機関投資家専用) 559,246,637円、ダイワ国内バランスファンド25 V A (適格機関投資家専用) 80,610,399円、ダイワ国内バランスファンド30 V A (適格機関投資家専用) 146,638,577円、ダイワ・ノーロード T O P I Xファンド178,771,082円、ダイワファンドラップ T O P I Xインデックス10,294,148,277円、ダイワT O P I Xインデックス (ダイワSMA専用) 2,512,120,167円、ダイワファンドラップオンライン T O P I Xインデックス2,644,643,973円、ダイワ・インデックスセレクト T O P I X1,211,577,472円、ダイワライフスタイル25 153,686,797円、ダイワライフスタイル50 617,422,037円、ダイワライフスタイル75 487,367,793円、D C・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) 10,633,113,617円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,951円です。

## ■損益の状況

当 期 自 2020年9月24日 至 2021年9月21日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,637,373,520円
受取配当金	3,444,555,096
受取利息	10,228,943
その他収益金	185,636,976
支払利息	△ 3,047,495
(B) 有価証券売買損益	38,506,139,309
売買益	42,610,806,704
売買損	△ 4,104,667,395
(C) 先物取引等損益	573,547,310
取引益	744,881,500
取引損	△ 171,334,190
(D) その他費用	△ 7,799
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	42,717,052,340
(F) 前期繰越損益金	12,474,802,077
(G) 解約差損益金	△ 5,947,540,027
(H) 追加信託差損益金	5,265,956,750
(I) 合計 (E + F + G + H)	54,510,271,140
次期繰越損益金 (I)	54,510,271,140

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

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

## 運用報告書 (全体版) 第5期

(決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日~2021年11月30日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、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した。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先（コールセンター）  
TEL 0120-106212  
(営業日の9:00~17:00)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	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。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの受益証券	
	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	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。）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	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、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株式組入 比率	株式先物 比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率					
1期末(2017年11月30日)	円 11,363	円 0	% 13.6	11,186	% 11.9	% 92.8	% 3.6	% 0.0	% 2.5	百万円 1,294
2期末(2018年11月30日)	11,423	0	0.5	11,049	△ 1.2	91.5	6.8	—	2.5	2,198
3期末(2019年12月2日)	13,050	0	14.2	12,386	12.1	93.4	3.8	—	2.8	2,353
4期末(2020年11月30日)	14,661	0	12.3	13,721	10.8	93.1	4.7	—	2.3	3,369
5期末(2021年11月30日)	18,402	0	25.5	17,006	23.9	93.0	3.7	—	2.3	3,374

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、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。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

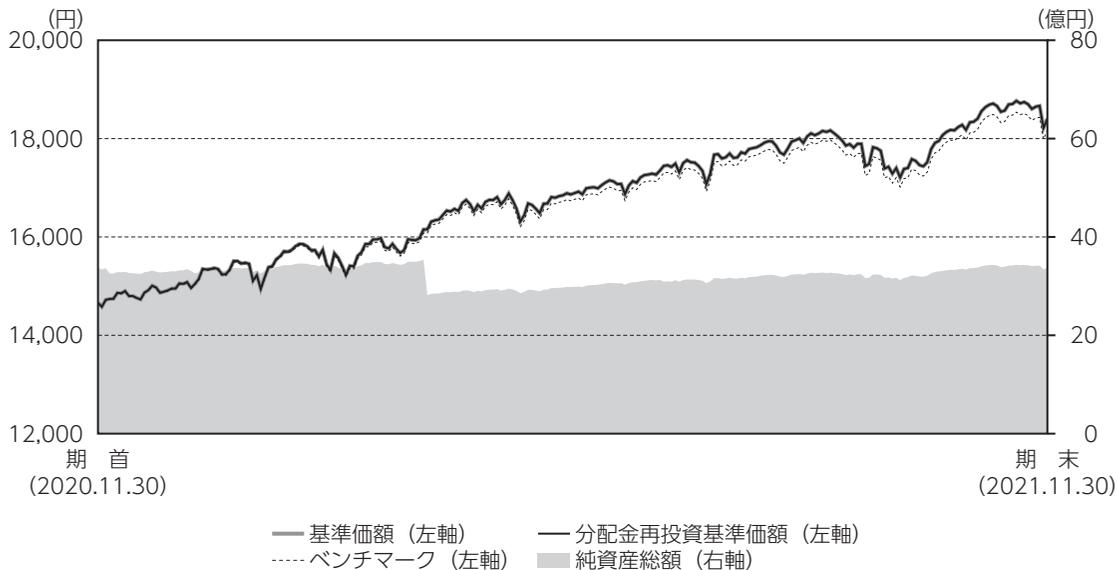
(注6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注7) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- \* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- \* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- \* ベンチマークはMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）です。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：14,661円

期末：18,402円（分配金0円）

騰落率：25.5%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドの受益証券を通じてベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行った結果、新型コロナウイルスのワクチン接種進捗への期待などを背景に海外株式市況が上昇したことから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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)

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	投 資 信 託 資 産 組 入 証 券 比 率	投 信 託 証 券 組 入 証 券 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首) 2020年11月30日	円 14,661	% -	13,721	% -	% 93.1	% 4.7	% -	% 2.3
12月末	15,046	2.6	14,067	2.5	90.5	7.0	-	2.1
2021年 1 月末	15,224	3.8	14,227	3.7	91.0	6.3	-	2.2
2 月末	15,442	5.3	14,414	5.0	94.5	4.9	-	2.2
3 月末	15,933	8.7	14,845	8.2	97.4	3.3	-	2.3
4 月末	16,810	14.7	15,645	14.0	94.2	2.9	-	2.3
5 月末	16,889	15.2	15,687	14.3	94.8	3.7	-	2.3
6 月末	17,288	17.9	16,048	17.0	93.7	4.3	-	2.3
7 月末	17,696	20.7	16,419	19.7	92.0	4.4	-	2.3
8 月末	18,107	23.5	16,776	22.3	91.2	6.5	-	2.2
9 月末	17,428	18.9	16,130	17.6	94.3	4.9	-	2.3
10月末	18,331	25.0	16,958	23.6	94.0	5.8	-	2.3
(期末) 2021年11月30日	18,402	25.5	17,006	23.9	93.0	3.7	-	2.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は上昇しました。

先進国株式市況は、当作成期首より、米国大統領選挙の不透明感が解消されたことや新型コロナウイルスのワクチン開発への期待を受け、上昇しました。2021年2月以降は、米国においてウイルスの新規感染者数の減少傾向が鮮明となったことに加え、ワクチン接種が着実に進んでいることが投資家心理を改善させ、上昇基調となりました。9月に入ると、米国や中国における経済指標の悪化をきっかけに軟調となり、その後も中国の大手不動産会社の資金繰り問題や米国の債務上限問題、米国金利の上昇に対する警戒感など複数のリスク要因が嫌気され、株価は下落しました。10月中旬以降は、米国の債務上限の一時引き上げが決定されたことなどが好感されて反発し、堅調に推移しました。11月下旬には、南アフリカでウイルスの新変異株であるオミクロン株が確認されたことが嫌気されて調整し、当作成期末を迎えました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

### ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

## ポートフォリオについて

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■当ファンド

当作成期を通じて、「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の受益証券組入比率をおおむね100%程度に維持しました。

### ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式（投資信託証券、株式先物を含む。）等のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

\*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

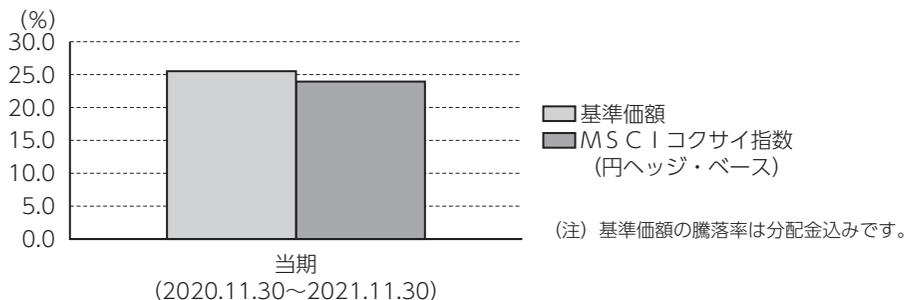
組入ファンド	ベンチマーク
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	M S C I コクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)

## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は23.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は25.5%となりました。

ファンドには保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、かい離要因となりました。その他、マザーファンドで組み入れているポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、運用管理費用、売買委託手数料や保管費用等のコスト負担がかい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\*ベンチマークはM S C I コクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) です。

## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2020年12月1日 ～2021年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	8,401

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

### ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2020.12.1~2021.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	56円	0.335%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は16,770円です。
（投 信 会 社）	(43)	(0.258)	投信会社分は、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、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(9)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(4)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	1	0.003	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株 式）	(0)	(0.002)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.002)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
有 価 証 券 取 引 税	0	0.002	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株 式）	(0)	(0.002)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
そ の 他 費 用	5	0.032	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(2)	(0.014)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(2)	(0.012)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	62	0.372	

(注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

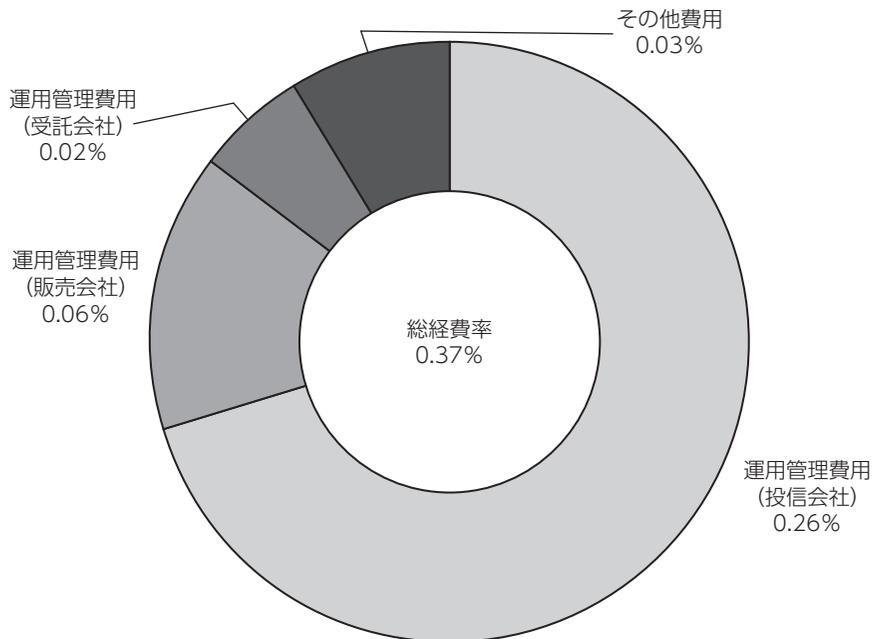
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.37%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	174,730	468,666	467,983	1,203,850

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

項 目	当 期
	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	9,573,531千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	69,229,920千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.13

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	1,431,778	1,138,524	3,374,132

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	3,374,132	99.8
コール・ローン等、その他	6,748	0.2
投資信託財産総額	3,380,881	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1香港ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.21円、1ニュージーランド・ドル=77.53円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シケル=36.011円、1スイス・フラン=123.25円、1デンマーク・クローネ=17.27円、1ノルウェー・クローネ=12.61円、1スウェーデン・クローネ=12.53円、1ユーロ=128.41円です。

(注3) 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(79,502,498千円)の投資信託財産総額(82,299,363千円)に対する比率は、96.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,380,881,193円
コール・ローン等	6,628,705
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)	3,374,132,488
未収入金	120,000
(B) 負債	6,212,789
未払解約金	724,525
未払信託報酬	5,399,835
その他未払費用	88,429
(C) 純資産総額(A - B)	3,374,668,404
元本	1,833,901,672
次期繰越損益金	1,540,766,732
(D) 受益権総口数	1,833,901,672口
1万口当り基準価額(C / D)	18,402円

\* 期首における元本額は2,298,185,009円、当作成期間中における追加設定元本額は503,558,139円、同解約元本額は967,841,476円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は18,402円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月1日 至2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,191円
受取利息	148
支払利息	△ 1,339
(B) 有価証券売買損益	610,594,888
売買益	731,366,001
売買損	△ 120,771,113
(C) 信託報酬等	△ 10,975,685
(D) 当期損益金(A + B + C)	599,618,012
(E) 前期繰越損益金	446,398,425
(F) 追加信託差損益金	494,750,295
(配当等相当額)	( 340,252,585)
(売買損益相当額)	( 154,497,710)
(G) 合計(D + E + F)	1,540,766,732
次期繰越損益金(G)	1,540,766,732
追加信託差損益金	494,750,295
(配当等相当額)	( 340,252,585)
(売買損益相当額)	( 154,497,710)
分配準備積立金	1,046,017,628
繰越損益金	△ 1,191

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	599,618,174
(c) 収益調整金	494,750,295
(d) 分配準備積立金	446,399,454
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	1,540,767,923
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	1,540,767,923
(h) 受益権総口数	1,833,901,672口

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

## <補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の決算日（2021年1月12日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年11月30日）現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

## ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの主要な売買銘柄 株 式

（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

買				付				売				付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円		千株	千円	円		千株	千円	円
AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.483	187,622	388,451	APPLE INC (アメリカ)	23.013	324,438	14,098	TESLA INC (アメリカ)	1.396	108,589	77,786	MICROSOFT CORP (アメリカ)	6.983	207,251	29,679
TESLA INC (アメリカ)	1.396	108,589	77,786	MICROSOFT CORP (アメリカ)	6.983	207,251	29,679	APPLE INC (アメリカ)	5.422	92,141	16,993	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.37	135,438	366,050
APPLE INC (アメリカ)	5.422	92,141	16,993	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.37	135,438	366,050	MICROSOFT CORP (アメリカ)	2.5	84,468	33,787	ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.51	128,730	252,413
MICROSOFT CORP (アメリカ)	2.5	84,468	33,787	ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.51	128,730	252,413	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.281	75,780	269,679	TESLA INC (アメリカ)	1.068	89,005	83,338
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.281	75,780	269,679	TESLA INC (アメリカ)	1.068	89,005	83,338	SNOWFLAKE INC-CLASS A (アメリカ)	2.091	71,227	34,063	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.287	74,208	258,565
SNOWFLAKE INC-CLASS A (アメリカ)	2.091	71,227	34,063	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.287	74,208	258,565	PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A (アメリカ)	19.77	55,009	2,782	META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)	2.055	70,413	34,264
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A (アメリカ)	19.77	55,009	2,782	META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)	2.055	70,413	34,264	PROSUS NV (オランダ)	5.3	49,511	9,341	NESTLE SA-REG (スイス)	4.437	57,786	13,023
PROSUS NV (オランダ)	5.3	49,511	9,341	NESTLE SA-REG (スイス)	4.437	57,786	13,023	MODERNA INC (アメリカ)	1.393	45,946	32,983	ALEXION PHARMACEUTICALS INC (アメリカ)	2.652	52,988	19,980
MODERNA INC (アメリカ)	1.393	45,946	32,983	ALEXION PHARMACEUTICALS INC (アメリカ)	2.652	52,988	19,980	ASTRAZENECA PLC (イギリス)	3.494	45,263	12,954	ASML HOLDING NV (オランダ)	0.596	45,161	75,774
ASTRAZENECA PLC (イギリス)	3.494	45,263	12,954	ASML HOLDING NV (オランダ)	0.596	45,161	75,774								

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

下記は、2021年11月30日現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（27,761,727千円）の内容です。

### (1) 外国株式

銘柄	2021年11月30日現在				業 種 等
	株 数	評 価 額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円		
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	12.95	227	25,858	情報技術	
PALO ALTO NETWORKS INC	12.2	672	76,503	情報技術	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22.71	449	51,090	情報技術	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	15.94	137	15,610	資本財・サービス	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7.46	91	10,389	ヘルスケア	
SYNCHRONY FINANCIAL	72.38	341	38,801	金融	
ABBOTT LABORATORIES	212.42	2,719	309,410	ヘルスケア	
HOWMET AEROSPACE INC	39.5	112	12,807	資本財・サービス	
VERISK ANALYTICS INC	19.43	445	50,656	資本財・サービス	
LAS VEGAS SANDS CORP	47.29	176	20,046	一般消費財・サービス	
AMPHENOL CORP-CL A	69.05	572	65,148	情報技術	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4.43	249	28,441	情報技術	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	74.82	788	89,710	情報技術	
QORVO INC	12.83	193	22,017	情報技術	
AFLAC INC	84.71	471	53,680	金融	
DARDEN RESTAURANTS INC	18.7	265	30,157	一般消費財・サービス	
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	18.35	197	22,515	コミュニケーション・サービス	
ADOBE INC	57.19	3,931	447,315	情報技術	

銘柄	2021年11月30日現在				業 種 等
	株 数	評 価 額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	28.72	180	20,572	素材	
LULULEMON ATHLETICA INC	16.07	744	84,697	一般消費財・サービス	
GARMIN LTD	20.68	287	32,759	一般消費財・サービス	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	26.02	758	86,248	素材	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	83.91	1,742	198,241	資本財・サービス	
VR BERKLEY CORP	17.71	140	16,012	金融	
AUTOZONE INC	2.61	479	54,598	一般消費財・サービス	
DOLLAR TREE INC	25.66	362	41,264	一般消費財・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	123.65	106	12,084	ヘルスケア	
PINNACLE WEST CAPITAL	15.08	99	11,373	公益事業	
CELANESE CORP	12.97	207	23,578	素材	
DR HORTON INC	43.97	434	49,404	一般消費財・サービス	
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	119	13,571	ヘルスケア	
AUTODESK INC	26.84	700	79,744	情報技術	
MOODY'S CORP	20.35	808	91,976	金融	
DEVON ENERGY CORP	77.48	340	38,715	エネルギー	
ALBEMARLE CORP	14.27	393	44,790	素材	
ATMOS ENERGY CORP	16.54	155	17,650	公益事業	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ALLIANT ENERGY CORP	36.14	207	23,551	公益事業	
CITIGROUP INC	248.66	1,617	183,998	金融	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	51.05	1,204	137,009	情報技術	
AMERICAN ELECTRIC POWER	59.18	493	56,091	公益事業	
ALLEGHANY CORP	1.46	97	11,041	金融	
DOMINO'S PIZZA INC	5.26	280	31,953	一般消費財・サービス	
HESS CORP	38.07	289	32,947	エネルギー	
DAVITA INC	10	96	11,025	ヘルスケア	
DANAHER CORP	76.75	2,506	285,112	ヘルスケア	
FORTIVE CORP	43.35	330	37,596	資本財・サービス	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	66.22	873	99,371	金融	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	65.8	426	48,517	生活必需品	
BUNGE LTD	18.38	166	18,941	生活必需品	
TE CONNECTIVITY LTD	40.02	637	72,571	情報技術	
APPLE INC	2,015.15	32,290	3,673,720	情報技術	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	37.57	425	48,436	金融	
BOEING CO/THE	66.98	1,329	151,263	資本財・サービス	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20.63	244	27,803	金融	
BECTON DICKINSON AND CO	34.85	848	96,588	ヘルスケア	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	20	20	2,302	一般消費財・サービス	
LEIDOS HOLDINGS INC	14	126	14,422	資本財・サービス	
NISOURCE INC	40.26	101	11,565	公益事業	
CH. ROBINSON WORLDWIDE INC	17.08	163	18,580	資本財・サービス	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	1.16	51	5,838	生活必需品	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	99.78	568	64,717	金融	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	493.71	2,550	290,171	コミュニケーション・サービス	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	159.59	4,502	512,232	金融	
ANSYS INC	10.38	412	46,968	情報技術	
TRUIST FINANCIAL CORP	160.8	981	111,704	金融	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	86.15	1,282	145,921	金融	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	272.84	1,490	169,608	ヘルスケア	
JPMORGAN CHASE & CO	365.51	5,893	670,460	金融	
T ROWE PRICE GROUP INC	26.58	550	62,602	金融	
LKQ CORP	33	190	21,625	一般消費財・サービス	
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	5.47	84	9,652	金融	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	36.65	271	30,934	生活必需品	
CADENCE DESIGN SYS INC	33.59	627	71,344	情報技術	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13.48	395	45,043	金融	
DOLLAR GENERAL CORP	28.25	635	72,337	一般消費財・サービス	
SERVICENOW INC	24.19	1,627	185,166	情報技術	
CATERPILLAR INC	65.72	1,287	146,488	資本財・サービス	
BROWN & BROWN INC	28.86	188	21,476	金融	
ESSENTIAL UTILITIES INC	24.78	120	13,656	公益事業	
CHARLES RIVER LABORATORIES	6.4	240	27,327	ヘルスケア	
CMS ENERGY CORP	33.84	206	23,534	公益事業	
MOSAIC CO/THE	52.09	187	21,352	素材	
DELTA AIR LINES INC	16.5	59	6,802	資本財・サービス	
CORNING INC	99.83	383	43,681	情報技術	
CISCO SYSTEMS INC	505.01	2,815	320,369	情報技術	
MORGAN STANLEY	170.09	1,653	188,151	金融	
ZILLOW GROUP INC - A	10.16	55	6,260	不動産	

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
MSCI INC	10.06	649	73,878	金融	
FAIR ISAAC CORP	3.98	139	15,878	情報技術	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4.5	144	16,491	資本財・サービス	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	27.8	218	24,821	情報技術	
BROADCOM INC	48.79	2,753	313,256	情報技術	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14.16	255	29,116	ヘルスケア	
ARAMARK	31.73	109	12,410	一般消費財・サービス	
DTE ENERGY COMPANY	22.81	254	28,932	公益事業	
CENTENE CORP	68.44	504	57,440	ヘルスケア	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	13.58	176	20,038	金融	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	55.32	269	30,700	金融	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24.75	407	46,407	金融	
GARTNER INC	10.48	340	38,750	情報技術	
SPLUNK INC	20.29	253	28,854	情報技術	
DOMINION ENERGY INC	97.4	724	82,466	公益事業	
MONSTER BEVERAGE CORP	47.68	414	47,112	生活必需品	
SMITH (A.O.) CORP	14	113	12,879	資本財・サービス	
DEERE & CO	36.23	1,261	143,478	資本財・サービス	
POOL CORP	4.38	245	27,910	一般消費財・サービス	
GLOBAL PAYMENTS INC	35.67	428	48,803	情報技術	
VMWARE INC-CLASS A	23.35	281	31,979	情報技術	
CABLE ONE INC	0.6	109	12,464	コミュニケーション・サービス	
BURLINGTON STORES INC	7.66	224	25,566	一般消費財・サービス	
NASDAQ INC	14.27	298	33,944	金融	
VAIL RESORTS INC	5.53	184	20,978	一般消費財・サービス	
AMC ENTERTAINMENT HLDG-CL A	63.6	234	26,656	コミュニケーション・サービス	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	120	13,735	金融	
CONSOLIDATED EDISON INC	37.8	303	34,554	公益事業	
COGNEX CORP	24.39	191	21,826	情報技術	
TELEFLEX INC	5.63	173	19,789	ヘルスケア	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	9.79	191	21,816	資本財・サービス	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8.52	381	43,365	ヘルスケア	
BIO-RAD LABORATORIES-A	3	224	25,583	ヘルスケア	
CATALENT INC	20	267	30,481	ヘルスケア	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17.57	516	58,786	ヘルスケア	
MOLINA HEALTHCARE INC	8	238	27,079	ヘルスケア	
IDEX CORP	9.53	223	25,416	資本財・サービス	
COLGATE-PALMOLIVE CO	97.15	754	85,890	生活必需品	
ROLLINS INC	26.85	94	10,792	資本財・サービス	
AMETEK INC	25.97	363	41,367	資本財・サービス	
CHURCH & DWIGHT CO INC	30.47	285	32,499	生活必需品	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	16.44	95	10,816	資本財・サービス	
HEICO CORP	5.35	74	8,532	資本財・サービス	
GENERAC HOLDINGS INC	7.16	303	34,585	資本財・サービス	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4.8	225	25,635	金融	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	34.22	305	34,715	素材	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5.09	265	30,186	情報技術	
COSTCO WHOLESALE CORP	52.6	2,918	332,056	生活必需品	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	11.28	133	15,203	情報技術	
EPAM SYSTEMS INC	7.49	474	54,039	情報技術	
RPM INTERNATIONAL INC	17.5	162	18,520	素材	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3.53	592	67,393	一般消費財・サービス
UGI CORP	20.85	90	10,294	公益事業
CUMMINS INC	17.63	383	43,579	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	93.22	562	63,962	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	17.92	349	39,715	情報技術
COSTAR GROUP INC	49.2	393	44,774	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	6.9	499	56,874	金融
AMERCO	0.7	50	5,711	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	12.39	442	50,354	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	5.56	686	78,064	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	127	14,503	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	34.77	480	54,617	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	2.5	40	4,641	情報技術
DEXCOM INC	11.88	678	77,177	ヘルスケア
NORDSON CORP	7.5	196	22,368	資本財・サービス
COPART INC	24.95	369	42,013	資本財・サービス
SEAGEN INC	15.45	255	29,057	ヘルスケア
ALIGM TECHNOLOGY INC	9.09	576	65,614	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	6.37	372	42,339	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	5.07	243	27,669	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	12.03	101	11,597	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	24.57	250	28,534	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	278.51	445	50,729	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	32.61	749	85,301	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4.2	148	16,865	金融
COTERRA ENERGY INC	95	197	22,524	エネルギー
T-MOBILE US INC	76.24	864	98,361	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	17.86	96	11,025	不動産
COCA-COLA CO/THE	488.85	2,668	303,554	生活必需品
COCA-COLA EUROPA PACIFIC PARTNE	25.75	133	15,181	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.46	246	28,064	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	38.51	129	14,786	金融
CSX CORP	272.23	969	110,320	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11.66	340	38,724	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	15.63	260	29,607	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	8	76	8,731	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	54.65	19,463	2,214,417	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	73.71	816	92,841	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	515.19	3,173	360,998	エネルギー
AES CORP	83.41	197	22,414	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	5.71	150	17,174	金融
EOG RESOURCES INC	72.38	639	72,786	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	19.14	218	24,880	情報技術
ABIOMED INC	5.55	177	20,149	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	19.89	239	27,206	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	36.83	565	64,285	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	475.97	936	106,515	一般消費財・サービス
NOVAVAX INC	9.75	189	21,515	ヘルスケア
DISCOVERY INC - A	15.21	37	4,255	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	22.19	192	21,855	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	66	7,597	コミュニケーション・サービス

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LIBERTY BROADBAND-A	3.24	50	5,762	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	45.54	109	12,460	コミュニケーション・サービス
FORTINET INC	15.95	547	62,296	情報技術
MARKEL CORP	1.77	220	25,045	金融
NEXTERA ENERGY INC	233.99	2,074	236,022	公益事業
MASIMO CORP	6.93	199	22,729	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	182.97	694	79,061	素材
INSULET CORP	7.69	227	25,885	ヘルスケア
US BANCORP	171.43	984	111,950	金融
UNITED RENTALS INC	9.18	327	37,287	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	6.59	152	17,324	情報技術
FASTENAL CO	67.16	409	46,562	資本財・サービス
FISERV INC	72.06	702	79,908	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	132.27	1,301	148,075	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	154.98	927	105,545	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	13.05	124	14,120	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	28.75	559	63,599	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	40.78	1,576	179,336	金融
ALPHABET INC-CL A	36.31	10,568	1,202,369	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	35.09	10,254	1,166,629	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	17.63	153	17,476	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	78.49	498	56,722	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	58.4	228	25,945	公益事業
GENUINE PARTS CO	17.7	235	26,764	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	44.17	574	65,393	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	81	348	39,616	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	24.78	531	60,523	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	102.3	227	25,896	エネルギー
HOME DEPOT INC	128.45	5,225	594,516	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	8.4	131	14,912	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	190.88	293	33,378	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5	90	10,337	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	17.25	309	35,160	生活必需品
HUMANA INC	15.69	671	76,412	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	33.62	752	85,655	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9.17	203	23,168	情報技術
HENRY SCHEIN INC	18.7	137	15,694	ヘルスケア
HP INC	153.38	551	62,698	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	141.15	206	23,461	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	13.95	69	7,892	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	27.62	165	18,869	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20.28	101	11,510	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	50.11	209	23,790	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	83.9	291	33,198	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	15.58	399	45,502	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	107.57	1,274	145,023	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	191	21,741	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	154	17,570	資本財・サービス
ZOETIS INC	56.48	1,262	143,647	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	29.08	561	63,829	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	35.38	377	42,908	エネルギー

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ALLEGION PLC	11.1	142	16,250	資本財・サービス	
LIBERTY GLOBAL PLC- C	51.08	142	16,225	コミュニケーション・サービス	
WASTE CONNECTIONS INC	34.31	470	53,551	資本財・サービス	
JUNIPER NETWORKS INC	49.12	156	17,793	情報技術	
JM SMUCKER CO/THE	13.93	180	20,502	生活必需品	
JOHNSON & JOHNSON	317.89	5,078	577,757	ヘルスケア	
PLUG POWER INC	62.51	260	29,599	資本財・サービス	
ABBVIE INC	211.65	2,473	281,464	ヘルスケア	
HOLOGIC INC	30.42	231	26,292	ヘルスケア	
KIMBERLY-CLARK CORP	39.87	538	61,254	生活必需品	
KROGER CO	86.74	367	41,792	生活必需品	
KLA CORP	18.3	757	86,161	情報技術	
LOCKHEED MARTIN CORP	29.82	1,017	115,766	資本財・サービス	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	9.76	207	23,649	情報技術	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	28.72	217	24,790	一般消費財・サービス	
LOWE'S COS INC	84.7	2,105	239,539	一般消費財・サービス	
ELI LILLY & CO	97.69	2,489	283,222	ヘルスケア	
LAM RESEARCH CORP	17.56	1,195	135,958	情報技術	
LOEWS CORP	28.73	158	18,013	金融	
LINCOLN NATIONAL CORP	26.43	180	20,549	金融	
MCDONALD'S CORP	90.35	2,261	257,286	一般消費財・サービス	
3M CO	69.54	1,225	139,425	資本財・サービス	
META PLATFORMS INC CLASS A	289.43	9,783	1,113,080	コミュニケーション・サービス	
S&P GLOBAL INC	29.23	1,358	154,612	金融	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7.67	320	36,505	素材	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	5.75	199	22,713	情報技術	
PHILLIPS 66	51.07	356	40,590	エネルギー	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	56.59	232	26,480	一般消費財・サービス	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	29.92	260	29,611	生活必需品	
METLIFE INC	90.65	542	61,766	金融	
MARVELL TECHNOLOGY INC	104.85	786	89,489	情報技術	
ARISTA NETWORKS INC	23.72	300	34,164	情報技術	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	12.03	101	11,530	金融	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	20.48	531	60,463	情報技術	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.84	436	49,636	ヘルスケア	
BAKER HUGHES CO	84.46	198	22,610	エネルギー	
ROCKWELL AUTOMATION INC	14.6	497	56,571	資本財・サービス	
MERCK & CO. INC.	303.2	2,270	258,333	ヘルスケア	
DUPONT DE NEMOURS INC	66.57	512	58,347	素材	
MASCO CORP	35.43	238	27,143	資本財・サービス	
M & T BANK CORP	13.71	208	23,733	金融	
MARSH & MCLENNAN COS	60.48	1,010	114,930	金融	
BLACK KNIGHT INC	16.44	120	13,679	情報技術	
HEICO CORP-CLASS A	10.18	129	14,708	資本財・サービス	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	33.61	506	57,651	一般消費財・サービス	
WORKDAY INC-CLASS A	23.03	648	73,780	情報技術	
WAYFAIR INC- CLASS A	8.8	235	26,782	一般消費財・サービス	
SQUARE INC - A	46.73	994	113,171	情報技術	
TRANSUNION	22.93	261	29,773	資本財・サービス	
VISTRA CORP	42.85	86	9,793	公益事業	
NOVOCURE LTD	10.54	98	11,193	ヘルスケア	

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
NETAPP INC	27.03	247	28,144	情報技術	
NIKE INC -CL B	152.54	2,591	294,800	一般消費財・サービス	
NORFOLK SOUTHERN CORP	29.93	804	91,509	資本財・サービス	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	66.46	560	63,816	情報技術	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	26.23	263	30,011	金融	
ALLY FINANCIAL INC	50.94	243	27,650	金融	
NORTHROP GRUMMAN CORP	18.35	653	74,402	資本財・サービス	
APTIV PLC	32.32	534	60,851	一般消費財・サービス	
NEWMONT CORP	92.52	512	58,314	素材	
MCKESSON CORP	18.5	413	46,992	ヘルスケア	
XYLEM INC	19.72	244	27,775	資本財・サービス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	187.91	1,641	186,741	生活必需品	
NUCOR CORP	36.92	413	47,073	素材	
SUNRUN INC	15	71	8,167	資本財・サービス	
WESTERN UNION CO	43.5	70	7,997	情報技術	
GODADDY INC - CLASS A	19.3	133	15,170	情報技術	
NEWELL BRANDS INC	40.58	90	10,318	一般消費財・サービス	
EVERGY INC	26.54	173	19,704	公益事業	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	102.38	307	35,013	エネルギー	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	54	6,249	金融	
OKTA INC	16.34	365	41,569	情報技術	
COUPA SOFTWARE INC	8.8	178	20,289	情報技術	
LIBERTY BROADBAND-C	18.78	300	34,172	コミュニケーション・サービス	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	48.77	147	16,751	ヘルスケア	
LINDE PLC	57.29	1,837	209,054	素材	
WUX.COM LTD	7.85	125	14,233	情報技術	
EQUITABLE HOLDINGS INC	61.84	199	22,682	金融	
KKR & CO INC	64.89	495	56,336	金融	
PAYCHEX INC	36.57	452	51,478	情報技術	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8.38	539	61,412	一般消費財・サービス	
ALTRIA GROUP INC	220.86	960	109,253	生活必需品	
P G & E CORP	155.15	192	21,852	公益事業	
PFIZER INC	669.99	3,510	399,417	ヘルスケア	
CIGNA CORP	40.86	815	92,791	ヘルスケア	
DELL TECHNOLOGIES -C	32.76	188	21,456	情報技術	
ALTICE USA INC- A	41.47	66	7,544	コミュニケーション・サービス	
XCEL ENERGY INC	65.28	428	48,713	公益事業	
STERIS PLC	13.29	301	34,275	ヘルスケア	
SEA LTD-ADR	7	208	23,729	コミュニケーション・サービス	
FOX CORP - CLASS B	15.3	52	6,003	コミュニケーション・サービス	
FOX CORP - CLASS A	41.92	154	17,608	コミュニケーション・サービス	
STRYKER CORP	40.86	994	113,194	ヘルスケア	
LYFT INC-A	36.49	152	17,361	資本財・サービス	
DOW INC	87.18	495	56,396	素材	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	15.08	146	16,693	金融	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	27.23	596	67,839	情報技術	
PARKER HANNIFIN CORP	15.38	475	54,092	資本財・サービス	
UBER TECHNOLOGIES INC	151.86	602	68,590	資本財・サービス	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	30.37	556	63,354	エネルギー	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	291.25	4,340	493,785	生活必需品	
EXELON CORP	118.82	643	73,227	公益事業	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TELADOC HEALTH INC	19.85	211	24,030	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	49.86	298	33,921	資本財・サービス
NVR INC	0.45	237	27,040	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	167.66	1,209	137,623	エネルギー
TWILIO INC - A	20.53	602	68,489	情報技術
DOCUSIGN INC	25.65	645	73,392	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	6.01	268	30,593	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	14.7	166	18,893	情報技術
PEPSICO INC	167.68	2,752	313,129	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4.09	72	8,234	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	54.14	135	15,367	情報技術
MONGODB INC	7.12	374	42,606	情報技術
SNAPE INC - A	116.75	570	64,885	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	85.3	397	45,213	製薬
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	49.01	514	58,563	金融
AMCOR PLC	174.57	202	22,998	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	23.36	524	59,683	情報技術
ROKU INC	15.56	359	40,942	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20.92	362	41,251	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	75.59	2,765	314,600	情報技術
10X GENOMICS INC-CLASS A	8.18	118	13,443	ヘルスケア
PENTAIR PLC	15.75	120	13,761	資本財・サービス
QUALCOMM INC	135.24	2,484	282,707	情報技術
INVESCO LTD	37	85	9,782	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	8.19	186	21,176	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31.93	226	25,762	金融
DATADOG INC - CLASS A	25.36	464	52,796	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	77.35	313	35,675	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	12.57	179	20,407	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	12.61	825	93,882	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	26.67	368	41,942	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	5.01	1,093	124,371	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	41.1	458	52,211	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	9.98	133	15,180	素材
RESMED INC	16.6	426	48,521	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	15.58	244	27,775	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	14.99	172	19,571	資本財・サービス
MODERNA INC	42.39	1,562	177,721	ヘルスケア
HUBSPOT INC	5.64	480	54,663	情報技術
PERKINELMER INC	11.63	215	24,507	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	97.33	544	61,987	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	48.66	406	46,270	資本財・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	23	168	19,193	金融
AVANTOR INC	66.86	265	30,259	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	14.76	83	9,538	金融
DYNATRACE INC	23.39	150	17,155	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	54	578	65,773	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	108.25	254	28,990	金融
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	14.76	61	6,941	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	10.21	133	15,194	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	31.62	423	48,234	コミュニケーション・サービス

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CHEVRON CORP	231.9	2,663	303,011	エネルギー
PELTON INTERACTIVE INC-A	31.74	140	16,029	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	10.89	387	44,096	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	49.85	329	37,471	公益事業
ETSY INC	16.62	467	53,223	一般消費財・サービス
TESLA INC	98.86	11,240	1,278,807	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	24.54	895	101,843	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	79.44	201	22,874	情報技術
DRAFTKINGS INC - CL A	41.34	145	16,555	一般消費財・サービス
UNITY SOFTWARE INC	7.52	128	14,572	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	18.95	348	39,701	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	17.76	632	71,905	情報技術
CARVANA CO	9.64	281	32,021	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	8.56	58	6,686	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	29.34	560	63,786	情報技術
PPD INC	19.37	91	10,401	ヘルスケア
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	15.9	1,062	120,871	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	137.45	172	19,578	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	9.49	173	19,759	一般消費財・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	16.31	293	33,415	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	38.49	377	42,896	不動産
TWITTER INC	95.99	439	49,995	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	125.64	789	89,795	公益事業
SYSCO CORP	61.6	450	51,300	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	29.58	450	51,287	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6	30	3,446	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	19.25	118	13,473	金融
STEEL DYNAMICS INC	23	141	16,066	素材
SCHLUMBERGER LTD	178.99	530	60,378	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	117	13,345	資本財・サービス
AT&T INC	855.56	2,043	232,538	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	17.58	78	8,908	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	55.54	350	39,820	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	25.95	242	27,598	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	30.57	1,021	116,260	素材
SEMPRA ENERGY	38.07	472	53,793	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	22.64	113	12,894	情報技術
CLARIVATE PLC	47.21	107	12,262	資本財・サービス
OAK STREET HEALTH INC	16.54	50	5,771	ヘルスケア
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	197.7	416	47,391	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	26.06	271	30,852	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	109.81	2,134	242,840	情報技術
SALESFORCE.COM INC	116.24	3,449	392,427	情報技術
WESTROCK CO	26.18	120	13,736	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	83.22	652	74,190	資本財・サービス
TERADYNE INC	20.96	323	36,830	情報技術
UNION PACIFIC CORP	80.74	1,933	219,962	資本財・サービス
MARATHON PETROLEUM CORP	81.28	502	57,129	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	182.23	1,511	171,953	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	87.73	1,795	204,252	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	24.35	649	73,881	ヘルスケア

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
VOYA FINANCIAL INC	18	112	12,747	金融	
AMEREN CORPORATION	28.61	243	27,696	公益事業	
UNITEDHEALTH GROUP INC	114.28	5,165	587,673	ヘルスケア	
VERISIGN INC	13.65	333	37,963	情報技術	
VALERO ENERGY CORP	45.84	312	35,552	エネルギー	
ULTA BEAUTY INC	6.35	254	29,000	一般消費財・サービス	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	150	17,093	金融	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9.92	120	13,686	ヘルスケア	
ANTHEM INC	29.98	1,247	141,965	ヘルスケア	
WALT DISNEY CO/THE	217.61	3,216	365,940	コミュニケーション・サービス	
WELLS FARGO & CO	496.46	2,440	277,666	金融	
WASTE MANAGEMENT INC	50.34	839	95,546	資本財・サービス	
WILLIAMS COS INC	145.42	407	46,340	エネルギー	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	13.93	315	35,927	一般消費財・サービス	
WHIRLPOOL CORP	8.7	193	22,050	一般消費財・サービス	
WALMART INC	184.85	2,636	299,956	生活必需品	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	24.92	307	35,014	ヘルスケア	
WYNN RESORTS LTD	11.45	95	10,812	一般消費財・サービス	
WABTEC CORP	18.98	175	19,967	資本財・サービス	
TJX COMPANIES INC	145.67	1,029	117,120	一般消費財・サービス	
WATERS CORP	7.6	259	29,503	ヘルスケア	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	6.5	394	44,902	情報技術	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	86.95	400	45,583	生活必需品	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14.52	334	38,059	金融	
WESTERN DIGITAL CORP	35.31	208	23,697	情報技術	
WEC ENERGY GROUP INC	41.89	379	43,125	公益事業	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	58.55	376	42,798	公益事業	
VISA INC-CLASS A SHARES	202.64	3,977	452,533	情報技術	
PPL CORP	101.94	289	32,983	公益事業	
PULTEGROUP INC	35.56	183	20,839	一般消費財・サービス	
PPG INDUSTRIES INC	28.34	445	50,736	素材	
NORTHERN TRUST CORP	22.6	271	30,838	金融	
NVIDIA CORP	300.67	10,035	1,141,700	情報技術	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	51.6	1,036	117,927	金融	
TYSON FOODS INC-CL A	33.22	272	30,946	生活必需品	
NETFLIX INC	53.01	3,519	400,358	コミュニケーション・サービス	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	46.9	3,042	346,171	ヘルスケア	
NRG ENERGY INC	30	109	12,502	公益事業	
GLOBE LIFE INC	12.15	107	12,229	金融	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	21.06	451	51,382	金融	
TEXTRON INC	28.31	206	23,444	資本財・サービス	
NEWS CORP - CLASS A	37.49	81	9,306	コミュニケーション・サービス	
OMNICOM GROUP	25.46	171	19,543	コミュニケーション・サービス	
ORACLE CORP	225.74	2,098	238,692	情報技術	
MASTERCARD INC - A	106.04	3,425	389,684	情報技術	
ONEOK INC	55.26	345	39,268	エネルギー	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	110.62	143	16,297	コミュニケーション・サービス	
ROPER TECHNOLOGIES INC	12.69	610	69,513	資本財・サービス	
YUM! BRANDS INC	36.01	451	51,313	一般消費財・サービス	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	14.13	239	27,264	コミュニケーション・サービス	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	22.06	99	11,376	生活必需品	

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
BANK OF AMERICA CORP	926.34	4,223	480,471	金融	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	6.22	268	30,561	情報技術	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	28.38	248	28,219	ヘルスケア	
AMERICAN EXPRESS CO	81.72	1,290	146,766	金融	
ANALOG DEVICES INC	64.8	1,187	135,060	情報技術	
ADVANCED MICRO DEVICES	146.31	2,368	269,510	情報技術	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	100.84	554	63,041	金融	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	19.4	300	34,192	情報技術	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	32.66	228	25,969	一般消費財・サービス	
AVEX DENNISON CORP	11.31	243	27,733	素材	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	65.6	522	59,490	情報技術	
EMERSON ELECTRIC CO	71.75	651	74,168	資本財・サービス	
AON PLC-CLASS A	27.11	804	91,508	金融	
AMGEN INC	69.99	1,424	162,018	ヘルスケア	
EATON CORP PLC	50.56	846	96,280	資本財・サービス	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	20.19	458	52,135	生活必需品	
APPLIED MATERIALS INC	109.56	1,656	188,490	情報技術	
CME GROUP INC	42.9	966	109,977	金融	
ECOLAB INC	31.06	705	80,267	素材	
EQUIFAX INC	14.41	409	46,569	資本財・サービス	
GILEAD SCIENCES INC	148.98	1,052	119,747	ヘルスケア	
KEURIG DR PEPPER INC	92.36	324	36,955	生活必需品	
HORMEL FOODS CORP	33.15	140	16,024	生活必需品	
STATE STREET CORP	41.52	386	44,020	金融	
SCHWAB (CHARLES) CORP	173.79	1,392	158,374	金融	
BAXTER INTERNATIONAL INC	60.96	463	52,729	ヘルスケア	
CAMPBELL SOUP CO	21.66	89	10,152	生活必需品	
CROWN HOLDINGS INC	15.97	173	19,695	素材	
CARDINAL HEALTH INC	33.19	157	17,924	ヘルスケア	
FEDEX CORP	29.79	716	81,534	資本財・サービス	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	54.87	806	91,778	金融	
FMC CORP	13.6	140	16,020	素材	
CERNER CORP	41.33	301	34,259	ヘルスケア	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	30.05	442	50,321	素材	
CITRIX SYSTEMS INC	14.12	116	13,232	情報技術	
INTEL CORP	483.45	2,417	275,010	情報技術	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	52.31	177	20,246	コミュニケーション・サービス	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	48.66	333	37,982	金融	
ILLINOIS TOOL WORKS	37.68	897	102,074	資本財・サービス	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	153	95	10,914	コミュニケーション・サービス	
ILLUMINA INC	17.87	662	75,388	ヘルスケア	
SEALED AIR CORP	14.5	93	10,590	素材	
INTUITIVE SURGICAL INC	42.55	1,424	162,044	ヘルスケア	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	13.3	147	16,812	情報技術	
SNAP-ON INC	5	106	12,106	資本財・サービス	
CARMAX INC	19.9	291	33,163	一般消費財・サービス	
DUKE ENERGY CORP	91.33	915	104,134	公益事業	
TARGET CORP	60	1,494	170,081	一般消費財・サービス	
DOVER CORP	17.13	294	33,481	資本財・サービス	
VW GRAINGER INC	5.88	291	33,152	資本財・サービス	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17.5	255	29,086	資本財・サービス	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CINTAS CORP	11.62	505	57,471	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	55.67	175	19,957	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	15	79	9,094	生活必需品
CLOROX COMPANY	16.28	275	31,331	生活必需品
ENTERGY CORP	22.43	235	26,812	公益事業
MICROSOFT CORP	863.66	29,073	3,307,679	情報技術
INCYTE CORP	26.89	189	21,528	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	160.17	1,473	167,683	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	161.74	1,783	202,927	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	135.86	1,170	133,144	情報技術
BLACKROCK INC	18.34	1,701	193,631	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	56.36	149	17,049	公益事業
HASBRO INC	14.49	143	16,341	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	36.9	235	26,813	生活必需品
KEYCORP	117.82	268	30,602	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	11.76	348	39,628	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	173.19	1,050	119,484	生活必需品
COOPER COS INC/THE	6.47	246	28,059	ヘルスケア
CHUBB LTD	54.52	1,008	114,775	金融
ARROW ELECTRONICS INC	10	124	14,155	情報技術
ALLSTATE CORP	34.77	393	44,755	金融
EBAY INC	83.08	586	66,683	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	133.7	2,503	284,811	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	14.92	164	18,702	素材
XILINX INC	28.92	674	76,688	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	29.84	98	11,247	コミュニケーション・サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	27.83	946	107,667	生活必需品
TRIMBLE INC	29.38	254	28,923	情報技術
LENNAR CORP-A	33.94	364	41,413	一般消費財・サービス
LEAR CORP	6	101	11,536	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	69.8	662	75,417	金融
PACCAR INC	41.7	359	40,857	資本財・サービス
BIOGEN INC	19.48	459	52,327	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	10.24	646	73,546	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	142.74	1,580	179,820	一般消費財・サービス
PTC INC	12	132	15,061	情報技術
EVERSOURCE ENERGY	42.9	365	41,618	公益事業
INTUIT INC	32.63	2,266	257,879	情報技術
BORGWARNER INC	30.81	138	15,707	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	29.87	331	37,704	一般消費財・サービス
BALL CORP	38.6	365	41,636	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	171.49	661	75,290	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	36.77	459	52,241	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	16.06	320	36,424	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	32.07	609	69,363	ヘルスケア
VF CORP	42.16	310	35,364	一般消費財・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B	72.02	232	26,449	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	6.28	109	12,459	一般消費財・サービス
CARNIVAL CORP	99.86	181	20,631	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	548.2	2,824	321,385	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16	93	10,625	資本財・サービス

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	231	128	14,612	不動産
アメリカ・ドル 通貨 通計	株数・金額 換算率 <比率>	38,180.79 598銘柄	497,667 <68.8%>	
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD	23	98	8,797	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2.5	551	49,211	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	37.21	271	24,232	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	63	339	30,338	素材
INTACT FINANCIAL CORP	23.79	383	34,264	金融
BCE INC	9	58	5,210	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	22	395	35,339	素材
SUNCOR ENERGY INC	173.48	554	49,474	エネルギー
METRO INC/CN	30	186	16,642	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	39.41	401	35,835	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	150.75	1,227	109,571	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	57	829	74,073	金融
TORONTO-DOMINION BANK	217.6	2,036	181,779	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	39	146	13,036	金融
ROYAL BANK OF CANADA	170.86	2,216	197,850	金融
TC ENERGY CORP	121.44	741	66,144	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	63.75	245	21,936	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	218.48	533	47,642	素材
CAE INC	23	72	6,475	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	22.84	356	31,803	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	18	66	5,962	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	10.34	110	9,850	素材
BALLARD POWER SYSTEMS INC	32.06	62	5,600	資本財・サービス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	15.6	98	8,836	素材
HYDRO ONE LTD	48	149	13,333	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	24.89	241	21,519	生活必需品
NORTHLAND POWER INC	30.03	116	10,410	公益事業
WSP GLOBAL INC	12	218	19,477	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9.74	108	9,645	資本財・サービス
PARKLAND CORP	28	95	8,540	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	23	66	5,953	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	27.31	162	14,467	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	35	3,150	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	43.06	248	22,184	コミュニケーション・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	142.61	147	13,149	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	29	187	16,721	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	70	122	10,959	公益事業
B2GOLD CORP	164	83	7,494	素材
AIR CANADA	17	36	3,232	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	147.57	113	10,142	素材
BANK OF MONTREAL	78.55	1,076	96,062	金融
POWER CORP OF CANADA	63	263	23,522	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	13.56	2,712	242,073	情報技術
NUTRIEN LTD	69.06	602	53,789	素材
CANOPY GROWTH CORP	20	28	2,515	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	31.93	162	14,512	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	15.32	73	6,525	公益事業

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
CAMECO CORP	28	89	7,955	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	4.22	106	9,532	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	24.05	123	10,986	資本財・サービス
LIGHTSPEED COMMERCE INC	15.6	106	9,490	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	10	122	10,963	情報技術
TELUS CORP	6	17	1,579	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	44	149	13,310	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	7.43	129	11,543	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	152	812	72,491	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3	170	15,176	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	36.93	370	33,085	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	9.01	122	10,976	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	12.18	39	3,546	素材
BLACKBERRY LTD	64	80	7,175	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	72.66	498	44,536	金融
ENBRIDGE INC	246.95	1,203	107,436	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	159.13	1,175	104,924	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	221.84	530	47,365	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	43	136	12,201	ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	80.45	735	65,662	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	11	76	6,861	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	28	149	13,316	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	87.93	1,439	128,529	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	28	300	26,849	情報技術
ONEX CORPORATION	16	152	13,654	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	68	253	22,603	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	3	14	1,308	金融
TMX GROUP LTD	7.94	102	9,114	金融
OPEN TEXT CORP	32.1	199	17,775	情報技術
SAPUTO INC	29	84	7,501	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63	176	15,784	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	100.13	475	42,462	生活必需品
YAMANA GOLD INC	119	61	5,480	素材
FORTIS INC	62	346	30,968	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	13.55	120	10,723	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	66	68	6,138	素材
CENOVUS ENERGY INC	141	223	19,960	エネルギー
DOLLARAMA INC	35.29	199	17,769	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	8	34	3,037	公益事業
ALTAGAS LTD	47	117	10,462	公益事業
KEYERA CORP	22	63	5,653	エネルギー
カナダ・ドル 通貨計	4,930.13 88銘柄	30,418 銘柄数<比率>	2,715,192 < 3.3%>	
(オーストラリア)	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
MEDIBANK PRIVATE LTD	228.24	76	6,234	金融
BHP GROUP LTD	365.48	1,409	114,590	素材
SOUTH32 LTD	563.87	201	16,363	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	105.76	224	18,260	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	205.54	361	29,406	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	419.83	1,141	92,828	金融
WESTPAC BANKING CORP	442.7	926	75,284	金融

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
SANTOS LTD	182.7	116	9,490	エネルギー
AUSNET SERVICES	285	71	5,838	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	351.9	936	76,149	金融
RIO TINTO LTD	41.69	397	32,327	素材
ORIGIN ENERGY LTD	209.68	103	8,386	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD	290.47	99	8,051	資本財・サービス
XERO LTD	14.26	201	16,368	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	9.53	29	2,410	エネルギー
COLES GROUP LTD	166.96	301	24,470	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	25.09	129	10,566	情報技術
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	148.32	143	11,646	素材
EVOLUTION MINING LTD	170.17	70	5,699	素材
AFTERPAY LTD	30	331	26,959	情報技術
REECE LTD	63.58	149	12,125	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	139.06	95	7,743	生活必需品
OIL SEARCH LTD	173.45	67	5,513	エネルギー
SEEK LTD	26	89	7,249	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	101.73	121	9,857	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	119.81	289	23,549	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	218.56	2,049	166,616	金融
AMPOL LTD	20	57	4,703	エネルギー
ORICA LTD	58.45	84	6,832	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	153.48	178	14,472	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD	157.79	632	51,435	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	173.52	86	7,038	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	30	33	2,706	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	63.73	31	2,538	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	351.14	140	11,417	コミュニケーション・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	58.26	320	26,014	素材
MACQUARIE GROUP LTD	42.77	829	67,452	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	64.62	288	23,422	一般消費財・サービス
CSL LTD	55.5	1,703	138,505	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	137.98	803	65,290	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	8.05	182	14,832	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	70.92	144	11,720	素材
SUNCORP GROUP LTD	145.04	154	12,556	金融
ASX LTD	22.6	205	16,721	金融
COMPUTERSHARE LTD	60.54	115	9,419	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	118	9,625	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	52.23	223	18,129	ヘルスケア
AGL ENERGY LTD	84.66	45	3,668	公益事業
BRAMBLES LTD	183.37	185	15,055	資本財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20.64	136	11,107	ヘルスケア
REA GROUP LTD	6.08	97	7,957	コミュニケーション・サービス
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15.51	50	4,114	金融
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	12.88	167	13,628	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル 通貨計	7,420.11 53銘柄	17,152 銘柄数<比率>	1,394,359 < 1.7%>	
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	235	1,123	16,388	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	230	1,003	14,647	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千香港ドル	千円		
MTR CORP	165	693	10,110	資本財・サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	160	1,548	22,585	不動産	
SINO LAND CO	340	328	4,786	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	375.52	1,896	27,668	資本財・サービス	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	80	352	5,141	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	170	1,305	19,048	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	205.65	679	9,916	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	1,720.27	2,036	29,716	公益事業	
HANG SENG BANK LTD	80	1,127	16,445	金融	
NEW WORLD DEVELOPMENT	175	553	8,068	不動産	
WH GROUP LTD	1,695	864	12,612	生活必需品	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	149	6,630	96,738	金融	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	370	592	8,637	不動産	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	260	503	7,351	資本財・サービス	
SJM HOLDINGS LTD	100	55	814	一般消費財・サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	80	155	2,264	不動産	
CK ASSET HOLDINGS LTD	285.52	1,293	18,870	不動産	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	255	3,731	公益事業	
AIA GROUP LTD	1,500	12,585	183,615	金融	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	220	633	9,244	資本財・サービス	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	200	805	11,744	不動産	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	192	387	5,658	生活必需品	
ESR CAYMAN LTD	180	465	6,788	不動産	
SANDS CHINA LTD	290	541	7,903	一般消費財・サービス	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	350	509	7,435	一般消費財・サービス	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	170	2,799	40,850	資本財・サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	450	1,080	15,757	金融	
WYNNJ MACAU LTD	168	120	1,762	一般消費財・サービス	
香港ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	10,650.96 30銘柄	42,927 < 0.8%>	626,306 < 0.8%>	
<b>(シンガポール)</b>	百株	千シンガポール・ドル	千円		
CAPITALAND INVESTMENT LTD	334	112	9,365	不動産	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	159	421	35,100	金融	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	213	655	54,571	金融	
SINGAPORE AIRLINES LTD	177.5	87	7,251	資本財・サービス	
KEPPEL CORP LTD	173	90	7,499	資本財・サービス	
UOL GROUP LTD	30	20	1,714	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	36	3,028	不動産	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	447	506	42,178	金融	
GENTING SINGAPORE LTD	450	35	2,958	一般消費財・サービス	
VENTURE CORP LTD	32	60	5,008	情報技術	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,284	309	25,748	コミュニケーション・サービス	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	54	4,505	資本財・サービス	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	118	108	9,062	金融	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	66	5,508	生活必需品	
シンガポール・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,768.5 14銘柄	2,565 < 0.3%>	213,504 < 0.3%>	
<b>(ニュージーランド)</b>	百株	千ニュージーランド・ドル	千円		
MERIDIAN ENERGY LTD	150	67	5,221		
MERCURY NZ LTD	32.94	19	1,493		

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千ニュージーランド・ドル	千円		
A2 MILK CO LTD	70	43	3,364	生活必需品	
SPARK NEW ZEALAND LTD	168.6	73	5,692	コミュニケーション・サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	132.89	103	8,020	資本財・サービス	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	92	303	23,538	ヘルスケア	
RYMAN HEALTHCARE LTD	44.19	53	4,145	ヘルスケア	
ニュージーランド・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	690.62 7銘柄	663 < 0.1%>	51,477 < 0.1%>	
<b>(イギリス)</b>	百株	千イギリス・ポンド	千円		
BP PLC	2,510.81	822	124,702	エネルギー	
UNILEVER PLC	314.26	1,232	186,754	生活必需品	
BARCLAYS PLC	2,037.15	373	56,587	金融	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,031.03	126	19,142	資本財・サービス	
PRUDENTIAL PLC	314.21	406	61,646	金融	
NATWEST GROUP PLC	823.39	173	26,256	金融	
EVRAZ PLC	74.41	42	6,450	素材	
JOHNSON MATTHEY PLC	17.58	37	5,683	素材	
BAE SYSTEMS PLC	377.96	207	31,494	資本財・サービス	
AVIVA PLC	510.81	193	29,279	金融	
AVEVA GROUP PLC	11.4	36	5,563	情報技術	
GLAXOSMITHKLINE PLC	605.42	923	139,930	ヘルスケア	
INFORMA PLC	162	76	11,637	コミュニケーション・サービス	
MELROSE INDUSTRIES PLC	579.01	84	12,816	資本財・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	144.99	106	16,094	コミュニケーション・サービス	
DCC PLC	9.38	52	8,009	資本財・サービス	
OCADO GROUP PLC	62.34	114	17,328	生活必需品	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7.4	117	17,765	資本財・サービス	
HALMA PLC	39.78	120	18,262	情報技術	
ENTAIN PLC	73.37	128	19,415	一般消費財・サービス	
JD SPORTS FASHION PLC	64.11	73	11,091	一般消費財・サービス	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	108.88	70	10,627	金融	
M&G PLC	259.64	49	7,490	金融	
RELX PLC	242.03	567	85,946	資本財・サービス	
DIAGEO PLC	279.1	1,067	161,735	生活必需品	
RIO TINTO PLC	136.27	629	95,448	素材	
STANDARD CHARTERED PLC	319.51	132	20,057	金融	
TESCO PLC	867.91	242	36,699	生活必需品	
SMITH & NEPHEW PLC	112.97	140	21,230	ヘルスケア	
GLENCORE PLC	1,292.26	461	69,949	素材	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	42	6,506	金融	
SMITHS GROUP PLC	40.8	59	9,003	資本財・サービス	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	168.79	45	6,835	金融	
PEARSON PLC	82.71	50	7,704	コミュニケーション・サービス	
SAINSBURY (J) PLC	176.31	51	7,741	生活必需品	
NEXT PLC	16.85	134	20,333	一般消費財・サービス	
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	50	7,597	一般消費財・サービス	
WHITBREAD PLC	17.85	51	7,777	一般消費財・サービス	
BUNZL PLC	31.59	90	13,726	資本財・サービス	
VODAFONE GROUP PLC	3,635.21	400	60,670	コミュニケーション・サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	17.49	176	26,680	素材	
KINGFISHER PLC	172.29	56	8,512	一般消費財・サービス	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
WPP PLC	130.21	138	20,928	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	89	13,600	公益事業
SEVERN TRENT PLC	33.27	96	14,658	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	222.42	137	20,852	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	86.77	534	81,061	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	48.83	76	11,563	金融
SCHRODERS PLC	12.27	43	6,540	金融
SSE PLC	124.6	194	29,421	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	85	12,986	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	186.18	1,557	236,095	ヘルスケア
FERGUSON PLC	27.24	314	47,704	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	682.32	194	29,462	金融
3I GROUP PLC	132.93	184	27,963	金融
ASHTED GROUP PLC	59.21	362	55,009	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	115.48	89	13,599	情報技術
NATIONAL GRID PLC	451.05	451	68,443	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,652.13	404	61,369	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	108.06	168	25,598	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	18.12	78	11,877	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	258.15	659	100,004	生活必需品
BHP GROUP PLC	269.34	543	82,417	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	49.64	94	14,347	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	2,448.46	1,019	154,539	金融
ANGLO AMERICAN PLC	168.85	453	68,673	素材
MONDI PLC	59.21	103	15,686	素材
COMPASS GROUP PLC	219.92	334	50,729	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	26.88	74	11,239	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	1,027.57	167	25,447	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	25.74	60	9,179	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	51.36	92	13,972	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	22.68	104	15,811	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	18.97	103	15,755	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	37.5	257	39,045	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	518.12	826	125,233	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	446.23	711	107,803	エネルギー
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	20.39	45	6,891	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	47	7,169	金融
ANTOFAGASTA PLC	34.6	48	7,331	素材
ABRDN PLC	330.46	77	11,809	金融
EXPERIAN PLC	113.47	383	58,179	資本財・サービス
イギリス・ポンド 通貨計	35,564.08 82銘柄	21,431	3,248,193 < 3.9%>	
<b>(イスラエル)</b>	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	120	237	8,534	金融
AZRIELI GROUP LTD	5.3	154	5,552	不動産
ICL GROUP LTD	110.96	316	11,396	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	3	141	5,088	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	151.6	466	16,781	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	190.43	591	21,286	金融
NICE LTD	8	707	25,487	情報技術

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
<b>(イスラエル)</b>	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	18.83	220	7,940	金融
イスラエル・シェケル 通貨計	608.12 8銘柄	2,834	102,066 < 0.1%>	
<b>(スイス)</b>	百株	千スイス・フラン	千円	
UBS GROUP AG-REG	425.54	670	82,631	金融
ROCHE HOLDING AG-BR	2.8	107	13,217	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1.3	115	14,260	素材
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	76	9,455	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	83.88	2,998	369,591	ヘルスケア
SIKA AG-REG	16.9	614	75,755	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	112	13,840	生活必需品
ABB LTD-REG	210.74	673	82,960	資本財・サービス
SWISS RE AG	36.66	317	39,155	金融
NESTLE SA-REG	342.92	4,118	507,601	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2.87	452	55,712	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4.89	117	14,482	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	301.22	267	32,915	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	26.84	153	18,915	金融
SGS SA-REG	11.87	184	22,800	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	4.67	109	13,468	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	6.65	69	8,622	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG	7.93	96	11,855	情報技術
ALCON INC	58.53	427	52,718	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	5	136	16,835	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	17.92	684	84,325	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	6.11	84	10,414	金融
CLARIANT AG-REG	15.68	28	3,499	素材
NOVARTIS AG-REG	269.42	2,000	246,521	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.56	123	15,253	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	60.87	845	104,205	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	2.76	141	17,464	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	7.84	55	6,841	金融
GEBERIT AG-REG	4.56	318	39,228	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	1.13	511	63,006	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1.11	215	26,609	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	6.72	231	28,508	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	21.65	163	20,130	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	9.13	666	82,189	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	23	2,942	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD	65.87	299	36,922	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3.81	199	24,634	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	6.4	170	20,989	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	83	10,330	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.14	158	19,549	生活必需品
スイス・フラン 通貨計	2,073.18 40銘柄	18,826	2,320,365 < 2.8%>	
<b>(デンマーク)</b>	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	213.44	15,275	263,814	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	72.36	793	13,708	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0.39	722	12,473	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千円			
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	127.85	2,831	48,906	資本財・サービス	
GN STORE NORD A/S	11.59	446	7,718	ヘルスケア	
CARLSBERG AS-B	12.32	1,309	22,617	生活必需品	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	29.81	1,456	25,154	素材	
COLOPLAST-B	15.19	1,632	28,187	ヘルスケア	
DSV PANALPINA A/S	25.8	3,682	63,604	資本財・サービス	
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	1.43	392	6,774	資本財・サービス	
DEMANT A/S	13.14	413	7,139	ヘルスケア	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.66	1,297	22,408	資本財・サービス	
TRYG A/S	45.94	727	12,555	金融	
PANDORA A/S	13.25	1,116	19,290	一般消費財・サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	12.62	621	10,725	素材	
GENMAB A/S	9.19	2,343	40,471	ヘルスケア	
ORSTED A/S	22.46	1,900	32,822	公益事業	
AMBU A/S-B	20.91	399	6,897	ヘルスケア	
デンマーク・クロネ 通 貨 計	株数、金額 18銘柄 <比率>	648.35 37,363	645,269 < 0.8% >		
<b>(ノルウェー)</b>	百株	千円			
DNB BANK	128.38	2,590	32,668	金融	
NORSK HYDRO ASA	130.5	789	9,955	素材	
ORKLA ASA	74.83	629	7,935	生活必需品	
TELENOR ASA	87.46	1,206	15,208	コミュニケーション・サービス	
EQUINOR ASA	142.48	3,236	40,811	エネルギー	
SCHIBSTED ASA-CL A	17.12	702	8,859	コミュニケーション・サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	27.56	1,227	15,479	素材	
MOWI ASA	46.77	984	12,408	生活必需品	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	414	5,228	金融	
SCHIBSTED ASA-B SHS	17	608	7,674	コミュニケーション・サービス	
ADEVINTA ASA	45.82	604	7,623	コミュニケーション・サービス	
ノルウェー・クロネ 通 貨 計	株数、金額 11銘柄 <比率>	737.92 12,994	163,854 < 0.2% >		
<b>(スウェーデン)</b>	百株	千円			
ICA GRUPPEN AB	12.97	692	8,681	生活必需品	
ERICSSON LM-B SHS	384.64	3,608	45,216	情報技術	
VOLVO AB-B SHS	188.73	3,742	46,898	資本財・サービス	
SKF AB-B SHARES	40	841	10,540	資本財・サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	26	529	6,636	一般消費財・サービス	
SWEDISH MATCH AB	218.8	1,465	18,362	生活必需品	
TELE2 AB-B SHS	70.26	921	11,545	コミュニケーション・サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANAN	217.79	2,863	35,885	金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN A SHS	154.82	1,491	18,688	金融	
SWEDBANK AB - A SHARES	108.21	1,986	24,888	金融	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	103.52	1,683	21,093	一般消費財・サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	82.01	1,235	15,485	素材	
SKANSKA AB-B SHS	37.09	780	9,773	資本財・サービス	
SANDVIK AB	146.57	3,362	42,129	資本財・サービス	
INVESTOR AB-B SHS	219.28	4,645	58,207	金融	
ATLAS COPCO AB-A SHS	85.75	4,781	59,911	資本財・サービス	
VOLVO AB-A SHS	39.23	792	9,929	資本財・サービス	
SECURITAS AB-B SHS	25	332	4,164	資本財・サービス	

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千円			
TELIA CO AB	364.21	1,288	16,143	コミュニケーション・サービス	
ALFA LAVAL AB	48.4	1,750	21,929	資本財・サービス	
ATLAS COPCO AB-B SHS	48.13	2,287	28,663	資本財・サービス	
ASSA ABLOY AB-B	126.35	3,272	41,003	資本財・サービス	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	16.38	450	5,644	金融	
FASIGHTS AB BALDER-B SHRS	19.88	1,361	17,058	不動産	
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	481	6,031	金融	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	9.24	315	3,958	資本財・サービス	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	167.16	2,124	26,621	資本財・サービス	
LUNDIN ENERGY AB	19	643	8,063	エネルギー	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	72.6	2,122	26,598	生活必需品	
EMBRACER GROUP AB	70.9	674	8,446	コミュニケーション・サービス	
BOLIDEN AB	31.71	971	12,174	素材	
EPIROC AB-A	86.6	1,889	23,676	資本財・サービス	
EPIROC AB-B	40.15	724	9,080	資本財・サービス	
HUSQVARNA AB-B SHS	54	709	8,894	資本財・サービス	
NORDEA BANK ABP	452.91	4,857	60,858	金融	
EQT AB	29.6	1,572	19,708	金融	
EVOLUTION AB	20.64	2,071	25,949	一般消費財・サービス	
SINCH AB	64	790	9,907	情報技術	
KINNEVIK AB - B	36.41	1,196	14,989	金融	
HEXAGON AB-B SHS	270.76	3,614	45,291	情報技術	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13	352	4,422	金融	
スウェーデン・クロネ 通 貨 計	株数、金額 41銘柄 <比率>	4,232.18 71,281	893,156 < 1.1% >		
<b>ユーロ (アイルランド)</b>	百株	千ユーロ	千円		
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	30.55	140	17,994	素材	
KINGSPAN GROUP PLC	20.88	208	26,806	資本財・サービス	
KERRY GROUP PLC-A	18.22	197	25,349	生活必需品	
CRH PLC	92	399	51,271	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	17.85	217	27,975	一般消費財・サービス	
国 小 計	株数、金額 5銘柄 <比率>	179.5 1,163	149,397 < 0.2% >		
<b>ユーロ (オランダ)</b>	百株	千ユーロ	千円		
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	89.3	223	28,678	コミュニケーション・サービス	
QIAGEN N.V.	25.21	124	15,936	ヘルスケア	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	114.2	362	46,562	ヘルスケア	
NN GROUP NV	31	136	17,471	金融	
HEINEKEN NV	31.23	291	37,471	生活必需品	
AEGON NV	179.67	70	9,087	金融	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	121.3	366	47,125	生活必需品	
AKZO NOBEL N.V.	25.04	236	30,372	素材	
KONINKLIJKE DSM NV	22.3	427	54,922	素材	
WOLTERS KLUWER	33	330	42,502	資本財・サービス	
ING GROEP NV	456.01	554	71,192	金融	
KONINKLIJKE KPN NV	376.07	98	12,647	コミュニケーション・サービス	
ASML HOLDING NV	49.16	3,464	444,914	情報技術	
ABN AMRO BANK NV-CVA	40.3	51	6,557	金融	
ADYEN NV	2.25	553	71,089	情報技術	
JUST EAT TAKEAWAY	23.81	138	17,779	一般消費財・サービス	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
PROSUS NV	112.99	798	102,549	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV	14.76	36	4,747	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV	6.02	238	30,642	情報技術
VOPAK	6.3	20	2,684	エネルギー
RANDSTAD NV	20.2	113	14,551	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	12.85	99	12,755	生活必需品
STMICROELECTRONICS NV	85.75	368	47,375	情報技術
AIRBUS SE	69.81	695	89,365	資本財・サービス
ARGENX SE	5.16	129	16,624	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	85	111	14,282	生活必需品
EXOR NV	10.88	85	11,020	金融
CNH INDUSTRIAL NV	116.91	174	22,436	資本財・サービス
STELLANTIS NV	248.03	386	49,583	一般消費財・サービス
FERRARI NV	17.22	406	52,140	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,431.73 30銘柄	11,097 < 1.7%>	
ユーロ (ベルギー)	百株	千ユーロ	千円	
UCB SA	19.21	186	23,937	ヘルスケア
KBC GROUP NV	30.11	218	28,062	金融
COLRUYT SA	3.5	14	1,858	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11.39	110	14,160	金融
SOLVAY SA	8.73	86	11,122	素材
UMICORE	22.7	97	12,554	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	89.26	453	58,272	生活必需品
AGEAS	16.54	76	9,835	金融
PROXIMUS	22.69	36	4,670	コミュニケーション・サービス
ELIA GROUP SA/NV	7	76	9,806	公益事業
SOFINA	2.39	97	12,484	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	233.52 11銘柄	1,454 < 0.2%>	
ユーロ (ルクセンブルグ)	百株	千ユーロ	千円	
AROUNDTOWN SA	160.64	88	11,386	不動産
ARCELORMITTAL	80.31	196	25,204	素材
INPOST SA	31.82	32	4,213	資本財・サービス
EUROFINS SCIENTIFIC	14.8	167	21,471	ヘルスケア
TENARIS SA	47	41	5,384	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	334.57 5銘柄	526 < 0.1%>	
ユーロ (フランス)	百株	千ユーロ	千円	
TOTALENERGIES SE	299.62	1,234	158,513	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	21.46	275	35,369	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	57.59	848	108,974	素材
KERING	8.88	607	77,972	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	63.38	958	123,088	資本財・サービス
BOUYGUES SA	27.21	81	10,450	資本財・サービス
BNP PARIBAS	134	742	95,292	金融
THALES SA	14.04	103	13,319	資本財・サービス
DANONE	75.51	410	52,679	生活必需品
CARREFOUR SA	80.22	121	15,626	生活必需品
SUEZ	29.5	58	7,489	公益事業

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
VIVENDI	89.3	100	12,843	コミュニケーション・サービス
L'OREAL	29.56	1,187	152,515	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	69.75	399	51,267	資本財・サービス
LEGRAND SA	34.59	331	42,542	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA	25.44	525	67,491	生活必需品
EURAZEO SE	5.6	41	5,281	金融
SOIETE GENERALE SA	110.65	304	39,052	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	33.37	2,326	298,753	一般消費財・サービス
ACCOR SA	18.5	49	6,335	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	19.81	399	51,359	情報技術
VALEO SA	37.03	90	11,683	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	29.18	169	21,717	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA	32.27	91	11,731	資本財・サービス
EIFFAGE	9.45	77	9,989	資本財・サービス
SODEXO SA	12.48	93	12,041	一般消費財・サービス
IPSEN	2.76	23	3,075	ヘルスケア
ORPEA	5.24	43	5,625	ヘルスケア
AMUNDI SA	4.37	32	4,211	金融
TELEPERFORMANCE	7.01	250	32,171	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	9.77	43	5,631	コミュニケーション・サービス
FAURECIA	10.41	38	4,964	一般消費財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3.99	204	26,294	ヘルスケア
SEB SA	2.16	28	3,697	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA	35.06	632	81,208	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA	2.2	18	2,385	資本財・サービス
WORLDLINE SA	31.35	148	19,109	情報技術
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8.78	36	4,716	一般消費財・サービス
AXA SA	243.18	589	75,678	金融
EDENRED	30.07	121	15,638	情報技術
RENAULT SA	25.54	74	9,558	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	4.05	664	85,289	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	2.53	53	6,932	生活必需品
ATOS SE	9.46	35	4,538	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SE	81.65	436	56,019	情報技術
WENDEL	5.55	57	7,376	金融
ORANGE	257.92	247	31,807	コミュニケーション・サービス
ALSTOM	51.06	165	21,223	資本財・サービス
CNP ASSURANCES	13.49	29	3,738	金融
SANOFI	133.26	1,140	146,495	ヘルスケア
VINCI SA	64.38	541	69,575	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	73.51	207	26,656	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	146.09	177	22,758	金融
BIOMERIEUX	4.57	58	7,473	ヘルスケア
ENGIE	210.99	272	34,934	公益事業
EDF	67.6	83	10,716	公益事業
SAFRAN SA	39.31	399	51,285	資本財・サービス
ARKEMA	8.38	97	12,482	素材
ADP	3.5	36	4,692	資本財・サービス
SCOR SE	15.35	40	5,262	金融
GETLINK SE	49.73	64	8,234	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
BOLLORE	百株 73	千ユーロ 34	千円 4,467		コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率> 62銘柄	18,762	2,409,308 < 2.9%>		
ユーロ (ドイツ)	百株	千ユーロ	千円		
BAYER AG-REG	115.83	524	67,407		ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	18	48	6,171		素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	255.58	272	35,044		金融
COMMERZBANK AG	96.89	60	7,757		金融
VOLKSWAGEN AG	4.2	107	13,774		一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	22.72	373	47,998		一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	90.95	1,314	168,830		資本財・サービス
E.ON SE	300.06	329	42,352		公益事業
UNIPER SE	20.66	79	10,261		公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	37.29	319	41,074		一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	13	57	7,440		資本財・サービス
CONTINENTAL AG	14.74	137	17,650		一般消費財・サービス
BASF SE	112.83	654	84,004		素材
ALLIANZ SE-REG	50.14	963	123,670		金融
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	21.41	152	19,547		生活必需品
RWE AG	75.26	263	33,843		公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	17	9	1,200		資本財・サービス
BRENNTAG SE	21.21	161	20,791		資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	48.35	163	20,972		ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9.59	31	4,066		コミュニケーション・サービス
SAP SE	122.83	1,434	184,223		情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	17.04	407	52,317		金融
ZALANDO SE	28.56	232	29,889		一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	21.28	126	16,291		素材
KION GROUP AG	6	56	7,234		資本財・サービス
COVESTRO AG	19.45	98	12,657		素材
RATIONAL AG	0.74	60	7,712		資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	3.88	225	28,897		ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PREF	21.02	157	20,243		一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	21.48	256	32,905		一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	5.6	99	12,763		ヘルスケア
BECHTLE AG	8.19	51	6,650		情報技術
NEMETSCHEK SE	11.39	122	15,730		情報技術
SCOUT24 AG	14.6	87	11,203		コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	28.94	186	23,954		ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	13.57	122	15,759		資本財・サービス
HELLOFRESH SE	18.14	171	22,012		生活必需品
TEAMVIEWER AG	14.61	18	2,316		情報技術
SIEMENS ENERGY AG	47.32	113	14,637		資本財・サービス
BEIERSDORF AG	12.75	113	14,613		生活必需品
FUCHS PETROLUB PREF	7	27	3,577		素材
MERCK KGAA	16.92	371	47,712		ヘルスケア
ADIDAS AG	21.88	556	71,448		一般消費財・サービス
PUMA SE	12.95	137	17,685		一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	13.11	87	11,245		生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	411.35	659	84,725		コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	25.61	137	17,600		ヘルスケア

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	百株 101.1	千ユーロ 837	千円 107,493		一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	155.1	623	80,103		情報技術
HANNOVER RUECK SE	6.44	100	12,859		金融
DEUTSCHE POST AG-REG	116.91	626	80,436		資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	24.04	341	43,896		金融
LANXESS AG	15.29	78	10,060		素材
MTU AERO ENGINES AG	6.66	111	14,337		資本財・サービス
SYMRISE AG	16.56	208	26,772		素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	62.4	14	1,888		コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	9	63	8,147		一般消費財・サービス
VONOVIA SE	62.49	307	39,455		不動産
LEG IMMOBILIEN SE	10.73	133	17,105		不動産
国小計	株数、金額 銘柄数<比率> 59銘柄	15,594	2,002,430 < 2.4%>		
ユーロ (ポルトガル)	百株	千ユーロ	千円		
JERONIMO MARTINS	29	56	7,261		生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	359.64	175	22,471		公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	71.83	60	7,738		エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数<比率> 3銘柄	291	37,472 < 0.0%>		
ユーロ (スペイン)	百株	千ユーロ	千円		
TELEFONICA SA	754.91	299	38,401		コミュニケーション・サービス
ENDESA SA	37.6	75	9,728		公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	835.83	401	51,544		金融
IBERDROLA SA	720.39	714	91,728		公益事業
REPSOL SA	176.85	175	22,509		エネルギー
GRIFOLS SA	27.95	46	6,004		ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	2,073.7	577	74,120		金融
AMADEUS IT GROUP SA	54	313	40,273		情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA	39.78	97	12,581		公益事業
CAIXABANK SA	468.59	107	13,761		金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	35.83	77	9,910		資本財・サービス
AENA SME SA	8.66	112	14,384		資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA	65.12	346	44,519		コミュニケーション・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	124.17	368	47,307		一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	32.93	77	9,928		資本財・サービス
ENAGAS SA	36.75	73	9,494		公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	51.47	95	12,240		公益事業
FERROVIAL SA	60.55	151	19,515		資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA	43.83	98	12,640		公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数<比率> 19銘柄	4,209	540,596 < 0.7%>		
ユーロ (イタリア)	百株	千ユーロ	千円		
PRYSMIAN SPA	41.45	137	17,718		資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	129.44	230	29,586		金融
MEDIOBANCA SPA	99.71	96	12,450		金融
UNICREDIT SPA	294.71	311	40,000		金融
TELECOM ITALIA SPA	1,085.03	51	6,563		コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP	483.81	21	2,767		コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO	1,910.98	409	52,586		金融
ATLANTIA SPA	60.27	97	12,506		資本財・サービス

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>ユーロ(イタリア)</b>	百株	千ユーロ	千円	
POSTE ITALIANE SPA	77.27	86	11,107	金融
MONCLER SPA	24.35	157	20,199	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	12.85	70	9,068	ヘルスケア
ENI SPA	281.9	332	42,714	エネルギー
DIASORIN SPA	2.77	51	6,583	ヘルスケア
INFRASTRUCTURE WIRELESS ITAL	24.14	24	3,185	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA	80.78	111	14,309	情報技術
AMPLIFON SPA	17.5	74	9,608	ヘルスケア
ENEL SPA	983.37	667	85,727	公益事業
SNAM SPA	243	121	15,592	公益事業
TERNA SPA	199	129	16,599	公益事業
FINCOBANK SPA	59.72	92	11,928	金融
<b>国小計</b>	<b>株数、金額 銘柄数&lt;比率&gt;</b>	<b>1,112.05 20銘柄</b>	<b>3,277 420,807</b>	<b>&lt; 0.5%&gt;</b>
<b>ユーロ(フィンランド)</b>	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ	65.25	213	27,398	素材
NOKIA OYJ	652.61	327	42,060	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	41.16	50	6,519	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	88.53	136	17,552	素材
ELISA OYJ	17.34	92	11,863	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS	68.09	293	37,649	金融
FORTUM OYJ	44	112	14,441	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	42.45	118	15,246	生活必需品
KONE OYJ-B	37.96	224	28,837	資本財・サービス
NESTE OYJ	57.78	248	31,889	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	17.63	65	8,360	ヘルスケア
<b>国小計</b>	<b>株数、金額 銘柄数&lt;比率&gt;</b>	<b>1,132.8 11銘柄</b>	<b>1,883 241,817</b>	<b>&lt; 0.3%&gt;</b>
<b>ユーロ(オーストリア)</b>	百株	千ユーロ	千円	
VERBUND AG	12.16	109	14,014	公益事業
OMV AG	12.09	57	7,335	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	34.89	135	17,365	金融
VOESTALPINE AG	18	53	6,813	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	11	28	3,607	金融
<b>国小計</b>	<b>株数、金額 銘柄数&lt;比率&gt;</b>	<b>88.14 5銘柄</b>	<b>382 49,136</b>	<b>&lt; 0.1%&gt;</b>
<b>ユーロ通貨計</b>	<b>株数、金額 銘柄数&lt;比率&gt;</b>	<b>22,605.99 230銘柄</b>	<b>58,643 7,530,455</b>	<b>&lt; 9.2%&gt;</b>
<b>ファンド合計</b>	<b>株数、金額 銘柄数&lt;比率&gt;</b>	<b>132,110.93 1,220銘柄</b>	<b>- 76,523,797</b>	<b>&lt; 93.0%&gt;</b>

(注1) 邦貨換算金額は、2021年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場  
の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで  
邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	2021年11月30日現在			
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(アメリカ)</b>	千口	千アメリカ・ドル	千円	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.679	404	45,993	
SIMON PROPERTY GROUP INC	4.012	641	73,003	
BOSTON PROPERTIES INC	1.915	211	24,039	
VORNADO REALTY TRUST	2.128	88	10,066	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1.28	455	51,780	
EQUITY RESIDENTIAL	4.406	379	43,219	
EQUINIX INC	1.081	886	100,848	
AMERICAN TOWER CORP	5.453	1,455	165,606	
HOST HOTELS & RESORTS INC	6.701	110	12,518	
INVITATION HOMES INC	6.976	287	32,754	
VICI PROPERTIES INC	8.607	242	27,545	
VENTAS INC	4.401	216	24,594	
WEYERHAEUSER CO	8.683	336	38,279	
AGNC INVESTMENT CORP	7.559	119	13,613	
CROWN CASTLE INTL CORP	5.102	948	107,865	
IRON MOUNTAIN INC	3.474	162	18,520	
SUN COMMUNITIES INC	1.214	238	27,174	
PROLOGIS INC	8.863	1,358	154,558	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.648	338	38,484	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1.177	198	22,610	
DUKE REALTY CORP	4.971	295	33,621	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.771	267	30,393	
WELLTOWER INC	4.901	402	45,744	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6.434	219	24,931	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.452	304	34,690	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1.95	165	18,817	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15.632	130	14,850	
REALTY INCOME CORP	6.508	454	51,680	
PUBLIC STORAGE	1.857	616	70,118	
REGENCY CENTERS CORP	1.939	137	15,609	
UDR INC	3.7	212	24,191	
WP CAREY INC	2.702	212	24,208	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2.164	60	6,834	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3.415	576	65,579	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1.797	364	41,512	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8.597	184	21,018	
<b>アメリカ・ドル 通貨計</b>	<b>口数、金額 銘柄数&lt;比率&gt;</b>	<b>155.149 36銘柄</b>	<b>13,684 1,556,883</b>	<b>&lt; 1.9%&gt;</b>
<b>(カナダ)</b>	千口	千カナダ・ドル	千円	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1.6	93	8,349	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1.4	30	2,764	
<b>カナダ・ドル 通貨計</b>	<b>口数、金額 銘柄数&lt;比率&gt;</b>	<b>3 2銘柄</b>	<b>124 &lt; 0.0%&gt;</b>	
<b>(オーストラリア)</b>	千口	千オーストラリア・ドル	千円	
DEXUS/AU	13.949	151	12,302	
LENDLEASE GROUP	14.733	156	12,695	

銘柄	2021年11月30日現在		
	□ 数	評 価	額
		外貨建金額	邦貨換算金額
<b>(オーストラリア)</b>	千口	千オーストラリア・ドル	千円
TRANSURBAN GROUP	33.406	457	37,176
SYDNEY AIRPORT	18.747	154	12,557
APA GROUP	14.243	138	11,230
SCENTRE GROUP	64.017	194	15,819
GPT GROUP	30.647	159	12,929
MIRVAC GROUP	61.117	177	14,407
STOCKLAND	18.729	81	6,622
GOODMAN GROUP	20.198	495	40,308
VICINITY CENTRES	50.371	85	6,940
オーストラリア・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	340.157 11銘柄	2,251 <0.2%>
<b>(香港)</b>	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT	26	1,786	26,060
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	52	397	5,803
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34	361	5,268
香港ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	112 3銘柄	2,545 <0.0%>
<b>(シンガポール)</b>	千口	千シンガポール・ドル	千円
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30.5	91	7,588
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	56.826	121	10,118
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	46	87	7,310
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	37.6	78	6,538
(非上場)			
シンガポール・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	170.926 4銘柄	379 <0.0%>
<b>(イギリス)</b>	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	10.295	77	11,717
SEGRO PLC	13.286	188	28,543
BRITISH LAND CO PLC	14.58	76	11,521
イギリス・ポンド 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	38.161 3銘柄	341 <0.1%>
<b>ユーロ (フランス)</b>	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1.751	105	13,490
GECINA SA	0.578	68	8,858
KLEPIERRE	2.394	45	5,857
COVIVIO	0.353	25	3,325
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	5,076 4銘柄	245 <0.0%>
ユーロ通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	5,076 4銘柄	245 <0.0%>
合 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	824.469 63銘柄	- 1,902,993 <2.3%>

(注1) 邦貨換算金額は、2021年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2021年11月30日現在		
	買 建 額	売 建 額	
外 国	S&P500 EMINI FUT(アメリカ)	百万円 2,381	百万円 -
	S&P/TSX 60 IX FUT(カナダ)	91	-
	SPI 200 FUTURES(オーストラリア)	58	-
	FTSE 100 IDX FUT(イギリス)	129	-
	SWISS MKT IX FUTR(スイス)	105	-
	EURO STOXX 50(ドイツ)	289	-

(注1) 外貨建の評価額は、2021年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

## 運用報告書 第13期 (決算日 2021年1月12日)

(作成対象期間 2020年1月11日～2021年1月12日)

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

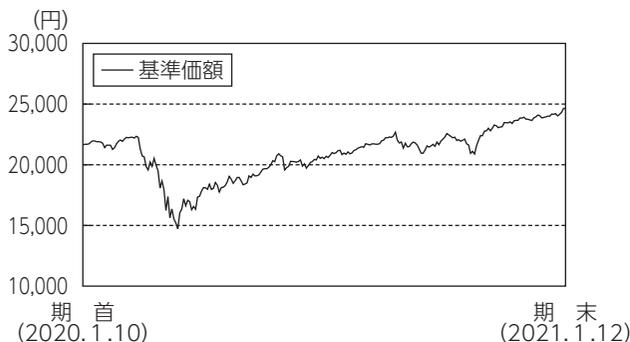
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）
株式組入制限	無制限

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース、指数化)		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率					
(期首)2020年1月10日	21,621	-	16,543	-	91.8	6.0	2.7		
1月末	21,603	△ 0.1	16,520	△ 0.1	90.5	6.7	2.7		
2月末	19,854	△ 8.2	15,150	△ 8.4	92.0	5.9	2.9		
3月末	17,076	△21.0	13,015	△21.3	90.3	7.5	2.6		
4月末	19,038	△11.9	14,482	△12.5	94.6	2.1	2.7		
5月末	19,676	△ 9.0	14,934	△ 9.7	95.6	2.3	2.7		
6月末	19,946	△ 7.7	15,112	△ 8.6	95.5	2.2	2.6		
7月末	20,907	△ 3.3	15,828	△ 4.3	91.6	4.3	2.5		
8月末	22,290	3.1	16,844	1.8	93.3	4.4	2.4		
9月末	21,459	△ 0.7	16,200	△ 2.1	94.2	2.4	2.4		
10月末	21,107	△ 2.4	15,922	△ 3.7	92.6	3.9	2.4		
11月末	23,531	8.8	17,727	7.2	93.1	4.7	2.3		
12月末	24,156	11.7	18,174	9.9	90.5	7.0	2.1		
(期末)2021年1月12日	24,628	13.9	18,522	12.0	91.1	7.9	2.0		

(注1) 騰落率は期首比。  
 (注2) MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース、指数化)は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)をもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、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。  
 (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。  
 (注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。  
 (注5) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：21,621円 期末：24,628円 騰落率：13.9%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク(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った結果、各国の大胆な景気刺激策や米国大統領選挙の不透明感が解消したことなどを好感し海外株式市況が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より、米中通商協議の第1段階の合意などを背景に、上昇して始まりました。2020年2月以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大や原油価格の急落などを受けて大きく下落しました。3月下旬以降は、各国の大胆な景気刺激策や新型コロナウイルスワクチン開発への期待などを好感し、上昇しました。6月は、米国の一部の州で新規感染者が増加したことなどを背景に下落しました。9月以降は、米国の景気回復に対して懐疑的な見方が広がったことを受け、上値の重い展開となりました。11月以降は、米国大統領選挙の不透明感が解消されたことやワクチンへの開発期待を受け、上昇して当作成期末を迎えました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

◆ポートフォリオについて

ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式(投資信託証券、株式先物を含む。)等のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は12.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は13.9%となりました。

ファンドには保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、かい離要因となりました。その他、ファンドで組み入れているポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、売買手数料・保管費用等のコスト負担がかい離要因としてあげられます。

《今後の運用方針》

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (先物・オプション) (投資信託証券)	2円 (1) (0) (1) (0)
有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (投資信託証券)	1 (1) (0) (0)
その他費用 (保管費用) (その他)	5 (5) (1)
合計	8

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	アメリカ	百株 千アメリカ・ドル 7,711.2 ( 2,340.92)	百株 千アメリカ・ドル 61,778 (△ 1,024)	4,461.27	29,941
	カナダ	百株 千カナダ・ドル 1,333.48 (△ 160.13)	百株 千カナダ・ドル 5,452 (△ 118)	643.62	1,756
	オーストラリア	百株 千オーストラリア・ドル 1,948.34 ( 60.04)	百株 千オーストラリア・ドル 3,074 ( 4)	1,905.2	1,535
	香港	百株 千香港ドル 3,132 (△ 292.19)	百株 千香港ドル 10,269 ( -)	2,053.8	8,665
	シンガポール	百株 千シンガポール・ドル 739 ( 315.95)	百株 千シンガポール・ドル 523 ( 31)	1,438.45	431
	ニュージーランド	百株 千ニュージーランド・ドル 188.72 ( -)	百株 千ニュージーランド・ドル 113 ( -)	466.2	242
	イギリス	百株 千イギリス・ポンド 6,371.46 ( 786.03)	百株 千イギリス・ポンド 3,425 ( 849)	3,412.39	1,465
	イスラエル	百株 千イスラエル・シケル 38.83 ( 7.49)	百株 千イスラエル・シケル 258 (△ 0)	7.49	6
	スイス	百株 千スイス・フラン 402.74 ( 0.06)	百株 千スイス・フラン 3,225 (△ 49)	182.57	1,322
	国	デンマーク	百株 千デンマーク・クローネ 152.64 ( -)	百株 千デンマーク・クローネ 7,453 ( -)	82.05
ノルウェー		百株 千ノルウェー・クローネ 156.08 ( -)	百株 千ノルウェー・クローネ 2,169 ( -)	112.13	1,290
スウェーデン		百株 千スウェーデン・クローネ 1,277.97 ( 62.41)	百株 千スウェーデン・クローネ 18,822 ( -)	681.33	8,348

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	ユーロ (アイルランド)	百株 千ユーロ 62.81 ( 8.02)	百株 千ユーロ 264 ( 75)	213.27	128
	ユーロ (オランダ)	百株 千ユーロ 1,066.23 (△ 229.06)	百株 千ユーロ 1,937 (△ 37)	406.43	695
	ユーロ (ベルギー)	百株 千ユーロ 51.87 ( -)	百株 千ユーロ 323 ( -)	29.11	150
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 千ユーロ 0.98 ( 13.32)	百株 千ユーロ 65 ( -)	0.81	53
	ユーロ (フランス)	百株 千ユーロ 483.52 ( 29.61)	百株 千ユーロ 2,581 (△ 0)	249.8	925
	ユーロ (ドイツ)	百株 千ユーロ 652.44 ( 53.32)	百株 千ユーロ 2,874 (△ 33)	314.07	918
	ユーロ (ポルトガル)	百株 千ユーロ - ( 275.76)	百株 千ユーロ - ( -)	275.76	2
	ユーロ (スペイン)	百株 千ユーロ 1,131.64 ( 4,509.73)	百株 千ユーロ 746 ( 99)	6,434.87	494
	ユーロ (イタリア)	百株 千ユーロ 1,276.57 ( -)	百株 千ユーロ 793 ( -)	313.44	292
	ユーロ (フィンランド)	百株 千ユーロ 126.92 ( -)	百株 千ユーロ 406 ( -)	65.24	240
国	ユーロ (オーストリア)	百株 千ユーロ 31.29 ( -)	百株 千ユーロ 54 ( -)	29.4	67
	ユーロ (その他)	百株 千ユーロ - ( -)	百株 千ユーロ - (△ 927)	-	-
	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 千ユーロ 4,884.27 ( 4,660.7)	百株 千ユーロ 10,047 (△ 823)	8,332.2	3,969

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ( )内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 新株予約権証券

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

	買 付		売 付		
	証 券 数	金 額	証 券 数	金 額	
外	アメリカ	証券 千アメリカ・ドル ( 1,279)	証券 千アメリカ・ドル ( -)	証券 千アメリカ・ドル 1,279 ( -)	証券 千アメリカ・ドル 6 ( -)
	スイス	証券 (13,420)	証券 千スイス・フラン ( -)	証券 千スイス・フラン 13,420 ( -)	証券 千スイス・フラン 2 ( -)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ( )内は、割当、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

(3) 投資信託証券

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

	買		付		売		付		
	口数	金額	口数	金額	口数	金額	口数	金額	
外	アメリカ	千口 35,979 (△11,575)	千アメリカ・ドル 2,180 ( - )	千口 16,299 ( - )	千アメリカ・ドル 795 ( - )	千口 4,2 ( - )	千カナダ・ドル 132 ( - )	千口 8,2 ( - )	千カナダ・ドル 141 ( - )
	カナダ	千口 8,297 ( 1,772)	千オーストラリア・ドル 103 ( - )	千口 8,131 ( - )	千オーストラリア・ドル 93 ( - )	千口 8 ( - )	千香港ドル 538 ( - )	千口 46 (△ 7,84)	千シンガポール・ドル 94 (△ 10)
	オーストラリア	千口 8 ( - )	千香港ドル 538 ( - )	千口 0,406 ( - )	千ユーロ 25 ( - )	千口 2 (△ 2)	千ユーロ 25 ( - )		
	香港	千口 46 (△ 7,84)	千シンガポール・ドル 94 (△ 10)						
	シンガポール	千口 2 ( - )	千ユーロ 25 ( - )						
国	千口 2 ( - )	千ユーロ 25 ( - )							

- (注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 買付( )内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。  
 (注3) 売付( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。  
 (注4) 金額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	28,948	27,174	-	-

- (注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄  
株 式

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘柄	柄	株 数	金 額	平均単価	銘柄	柄	株 数	金 額	平均単価
MICROSOFT CORP (アメリカ)		16,824	307,438	18,273	APPLE INC (アメリカ)		19,054	265,080	13,912
APPLE INC (アメリカ)		10,291	280,992	27,304	MICROSOFT CORP (アメリカ)		6,958	150,838	21,678
AMAZON.COM INC (アメリカ)		0,942	227,384	241,384	AMAZON.COM INC (アメリカ)		0,337	111,876	331,976
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)		5,14	104,840	20,397	NESTLE SA-REG (スイス)		4,845	59,157	12,209
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)		0,715	101,233	141,585	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)		0,352	56,311	159,974
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)		5,681	88,689	15,611	TESLA INC (アメリカ)		0,967	54,926	56,801
NESTLE SA-REG (スイス)		7,355	85,300	11,597	FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)		1,807	51,218	28,344
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)		3,943	83,306	21,127	BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)		15,9	41,894	2,634
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)		0,574	74,824	130,356	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)		3,273	34,684	10,597
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A (アメリカ)		2,495	69,335	27,789	NOVO NORDISK A/S-B (デンマーク)		4,964	34,486	6,947

- (注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	期首		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千円	千円	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	11	12.95	200	20,922	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	11.98	12.2	445	46,388	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22.71	22.71	340	35,541	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS INC	15.94	15.94	145	15,183	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5.5	7.46	120	12,588	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	62	62	224	23,451	金融
ABBOTT LABORATORIES	201.07	223.7	2,479	258,437	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	39.5	39.5	111	11,614	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	15.96	19.43	384	40,072	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	32.29	47.29	266	27,804	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	31.88	41.67	565	58,929	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	-	1.87	73	7,649	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	70.48	77.66	1,056	110,133	情報技術
QORVO INC	11.79	12.83	234	24,439	情報技術
AFLAC INC	81.23	84.71	377	39,299	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	12.48	12.48	156	16,293	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	18.35	18.35	132	13,816	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	56.65	60.97	2,891	301,374	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	28.72	28.72	123	12,904	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	12.99	16.07	581	60,577	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	44.09	-	-	-	金融
GARMIN LTD	13.18	15.27	185	19,294	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24.48	28.19	798	83,190	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	79.24	88.26	1,838	191,677	資本財・サービス
VR BERKLEY CORP	17.71	17.71	117	12,251	金融
AUTOZONE INC	2.91	2.91	368	38,382	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	23.99	33.98	382	39,819	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	96.83	123.65	140	14,666	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	15.08	15.08	115	12,054	公益事業
CELANESE CORP	12.97	12.97	177	18,519	素材
DR HORTON INC	43.97	43.97	299	31,191	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	12.49	-	-	-	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	24.5	143	14,938	ヘルスケア
AUTODESK INC	25.81	26.84	853	88,908	情報技術
MOODY'S CORP	17.82	21.43	592	61,726	金融
DEVON ENERGY CORP	48.68	77.48	142	14,802	エネルギー
ALBEMARLE CORP	16.68	16.68	295	30,822	素材
ATMOS ENERGY CORP	16.54	16.54	145	15,113	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	22	36.14	175	18,288	公益事業
CITIGROUP INC	263.51	261.68	1,738	181,214	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	47.42	53.55	902	94,054	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	56.57	59.18	466	48,591	公益事業
ALLEGHANY CORP	2.03	1.46	91	9,560	金融
DOMINO'S PIZZA INC	5.26	5.26	205	21,411	一般消費財・サービス
HESS CORP	28.96	34.26	208	21,761	エネルギー
DAVITA INC	10	10	123	12,832	ヘルスケア
DANAHER CORP	70.15	80.31	1,960	204,345	ヘルスケア
FORTIVE CORP	30.44	43.35	308	32,121	資本財・サービス

銘柄	期首		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	59.49	71.72	843	87,947	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	40.93	-	-	-	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17.01	-	-	-	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	60.74	65.8	342	35,690	生活必需品
BUNGE LTD	18.38	18.38	128	13,356	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	38.44	42.21	550	57,400	情報技術
APPLE INC	507.77	2,156.06	27,808	2,898,517	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33.59	33.59	319	33,340	金融
BOEING CO/THE	60.58	67.41	1,393	145,293	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20.63	20.63	182	19,066	金融
BECTON DICKINSON AND CO	30.11	36.79	945	98,591	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	15	20	36	3,756	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	14	14	145	15,174	情報技術
CDK GLOBAL INC	11	-	-	-	情報技術
NISOURCE INC	40.26	40.26	88	9,181	公益事業
CH. ROBINSON WORLDWIDE INC	17.08	17.08	164	17,184	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	96.83	99.78	454	47,382	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	464.47	519.78	2,986	311,299	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	144.92	173.71	4,054	422,643	金融
ANSYS INC	9.89	10.38	387	40,390	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	137.39	171.23	872	90,914	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	77.86	81.93	513	53,534	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	262.66	286.15	1,859	193,775	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	362.64	382.84	5,285	550,866	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	27.59	30.13	468	48,796	金融
LKQ CORP	33	33	125	13,056	一般消費財・サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	5.47	5.47	91	9,533	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	36.65	36.65	283	29,505	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	36.14	36.14	486	50,736	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16.11	16.11	324	33,848	金融
DOLLAR GENERAL CORP	26.72	30.52	656	68,476	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	20.83	24.19	1,265	131,880	情報技術
CATERPILLAR INC	65.65	68.56	1,329	138,532	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	24.93	28.86	135	14,131	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	22.01	24.78	119	12,444	公益事業
CMS ENERGY CORP	33.84	33.84	193	20,150	公益事業
MOSAIC CO/THE	52.09	52.09	139	14,534	素材
DELTA AIR LINES INC	16.5	16.5	65	6,777	資本財・サービス
CORNING INC	83.99	99.83	374	39,061	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	483.58	534.5	2,424	252,704	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12.65	12.97	80	8,395	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	139.89	189.09	1,438	149,905	金融
ZILLOW GROUP INC - A	-	5.87	87	9,132	コミュニケーション・サービス
WABCO HOLDINGS INC	9.4	-	-	-	その他
MSCI INC	9.75	10.06	454	47,372	金融
FAIR ISAAC CORP	-	3.98	197	20,562	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	4.5	4.5	123	12,846	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
MIDDLEBY CORP	9.18	-	-	-	資本財・サービス		
COTY INC-CL A	47.57	-	-	-	生活必需品		
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	25.07	27.8	196	20,509	情報技術		
BROADCOM INC	45.31	50.58	2,254	235,002	情報技術		
ACUIITY BRANDS INC	3.5	-	-	-	資本財・サービス		
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14.16	14.16	221	23,116	ヘルスケア		
ARAMARK	31.73	31.73	118	12,398	一般消費財・サービス		
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	16.12	16.12	48	5,070	素材		
DTE ENERGY COMPANY	19.33	27.39	323	33,681	公益事業		
CENTENE CORP	51.13	77.79	534	55,686	ヘルスケア		
CBOE GLOBAL MARKETS INC	13.58	13.58	135	14,126	金融		
CITIZENS FINANCIAL GROUP	55.32	55.32	220	22,965	金融		
ARTHUR J GALLAGHER & CO	22.32	22.32	264	27,558	金融		
GARTNER INC	11.74	11.74	196	20,457	情報技術		
SPLUNK INC	17.1	20.29	337	35,213	情報技術		
DOMINION ENERGY INC	89.41	109.95	799	83,280	公益事業		
MONSTER BEVERAGE CORP	44.36	47.68	443	46,188	生活必需品		
SMITH (A.O.) CORP	14	14	79	8,302	資本財・サービス		
DEERE & CO	33.62	36.23	1,068	111,369	資本財・サービス		
POOL CORP	-	1.74	67	6,986	一般消費財・サービス		
GLOBAL PAYMENTS INC	33.87	38.66	778	81,102	情報技術		
VMWARE INC-CLASS A	8.33	8.92	126	13,155	情報技術		
CABLE ONE INC	-	0.6	123	12,885	コミュニケーション・サービス		
BURLINGTON STORES INC	7	7.66	202	21,068	一般消費財・サービス		
NASDAQ INC	14.27	14.27	201	20,956	金融		
VAIL RESORTS INC	3.9	5.53	155	16,245	一般消費財・サービス		
EAST WEST BANCORP INC	14.61	-	-	-	金融		
TARGA RESOURCES CORP	16.33	-	-	-	エネルギー		
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	8.94	8.94	102	10,708	金融		
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	8.74	78	8,211	金融		
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4.05	-	-	-	素材		
CONSOLIDATED EDISON INC	36.48	46.02	316	32,967	公益事業		
COGNEX CORP	24.39	24.39	209	21,788	情報技術		
TELEFLEX INC	4.85	5.63	227	23,699	ヘルスケア		
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8.06	9.79	145	15,116	資本財・サービス		
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8.52	8.52	257	26,855	ヘルスケア		
BIO-RAD LABORATORIES-A	3	3	184	19,255	ヘルスケア		
WELLCARE HEALTH PLANS INC	5	-	-	-	その他		
CATALENT INC	-	20	230	24,056	ヘルスケア		
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	15.7	17.57	505	52,718	ヘルスケア		
MOLINA HEALTHCARE INC	-	8	193	20,162	ヘルスケア		
IDEX CORP	7	11.56	241	25,130	資本財・サービス		
COLGATE-PALMOLIVE CO	91.32	104.86	861	89,775	生活必需品		
ROLLINS INC	10.5	26.85	109	11,448	資本財・サービス		
AMETEK INC	25.97	25.97	322	33,605	資本財・サービス		
CHURCH & DWIGHT CO INC	28.83	30.47	258	26,969	生活必需品		
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10	16.44	70	7,318	資本財・サービス		
HEICO CORP	5.35	5.35	73	7,675	資本財・サービス		
XPO LOGISTICS INC	10.6	10.6	131	13,736	資本財・サービス		
GENERAC HOLDINGS INC	-	2.64	68	7,176	資本財・サービス		
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3.98	4.8	159	16,622	金融		

銘柄	期首		当		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
LYONDELLBASELL INDU-CL A	34.22	34.22	331	34,590	素材		
TYLER TECHNOLOGIES INC	4.17	5.09	218	22,794	情報技術		
COSTCO WHOLESALE CORP	48.83	55.33	2,014	209,926	生活必需品		
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	11.28	11.28	147	15,336	情報技術		
GRUBHUB INC	10	-	-	-	一般消費財・サービス		
EPAM SYSTEMS INC	5.49	7.49	256	26,764	情報技術		
RPM INTERNATIONAL INC	17.5	17.5	154	16,093	素材		
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3.1	3.53	495	51,606	一般消費財・サービス		
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	28	-	-	-	金融		
UGI CORP	20.85	20.85	74	7,732	公益事業		
CUMMINS INC	16.04	17.63	417	43,491	資本財・サービス		
ACTIVISION BLIZZARD INC	87.14	99.82	907	94,584	コミュニケーション・サービス		
SABRE CORP	43.26	-	-	-	情報技術		
CDW CORP/DE	17.92	17.92	239	24,963	情報技術		
SIGNATURE BANK	7.69	-	-	-	金融		
COSTAR GROUP INC	4.92	4.92	444	46,377	資本財・サービス		
SVB FINANCIAL GROUP	6.9	6.9	299	31,217	金融		
AMERCO	0.7	0.7	33	3,461	資本財・サービス		
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8.26	12.39	250	26,130	資本財・サービス		
MERCADOLIBRE INC	4.8	6.03	1,062	110,714	一般消費財・サービス		
HANESBRANDS INC	29	-	-	-	一般消費財・サービス		
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	8.37	138	14,392	情報技術		
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	28.81	38.01	430	44,839	一般消費財・サービス		
IPG PHOTONICS CORP	2.5	2.5	61	6,397	情報技術		
DEXCOM INC	11.72	11.88	440	45,894	ヘルスケア		
NORDSON CORP	-	7.5	153	15,965	資本財・サービス		
COPART INC	24.95	24.95	301	31,432	資本財・サービス		
DIAMONDBACK ENERGY INC	15.91	-	-	-	エネルギー		
SEAGEN INC	15.45	15.45	276	28,831	ヘルスケア		
ALIGN TECHNOLOGY INC	9.63	9.63	536	55,912	ヘルスケア		
TRANSDigm GROUP INC	5	6.98	427	44,591	資本財・サービス		
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	12.03	12.03	132	13,830	ヘルスケア		
HORIZON THERAPEUTICS PLC	-	14.47	113	11,868	ヘルスケア		
NIELSEN HOLDINGS PLC	43.47	-	-	-	資本財・サービス		
KINDER MORGAN INC	225.94	278.51	410	42,788	エネルギー		
HCA HEALTHCARE INC	31.38	32.61	558	58,247	ヘルスケア		
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3.82	5.44	295	30,829	金融		
CABOT OIL & GAS CORP	46.08	46.08	83	8,664	エネルギー		
T-MOBILE US INC	42.03	72.44	962	100,367	コミュニケーション・サービス		
ZILLOW GROUP INC - C	17.86	17.86	255	26,655	コミュニケーション・サービス		
COCA-COLA CO/THE	454.42	514.9	2,584	269,413	生活必需品		
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	25.75	25.75	129	13,457	生活必需品		
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.46	19.46	182	19,060	資本財・サービス		
EATON VANCE CORP	12.5	-	-	-	金融		
FRANKLIN RESOURCES INC	38.51	38.51	99	10,335	金融		
CSX CORP	81.51	94.51	907	94,557	資本財・サービス		
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10.5	11.66	253	26,372	ヘルスケア		
EXPEDIA GROUP INC	15.63	15.63	223	23,289	一般消費財・サービス		
AUTOLIV INC	8	8	73	7,682	一般消費財・サービス		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当		期		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
AMAZON.COM INC	47.47	53.52	16,667	1,737,227	千円	千円	一般消費財・サービス
FLOWERVEVE CORP	19.86	—	—	—	千円	千円	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	22.03	81.09	724	75,535	千円	千円	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	479.45	529.46	2,479	258,489	千円	千円	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	16.13	—	—	—	千円	千円	情報技術
AES CORP	83.41	83.41	212	22,134	千円	千円	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	5.71	5.71	135	14,120	千円	千円	金融
EOG RESOURCES INC	64.76	76.55	456	47,561	千円	千円	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	19.14	19.14	195	20,422	千円	千円	情報技術
ABIOMED INC	5.55	5.55	180	18,776	千円	千円	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	19.89	19.89	213	22,255	千円	千円	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	34.58	36.83	471	49,194	千円	千円	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	433.81	475.97	442	46,137	千円	千円	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	11	15.21	53	5,569	千円	千円	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	17.21	17.21	247	25,830	千円	千円	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	24.16	61	6,441	千円	千円	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	—	5.95	90	9,410	千円	千円	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	45.54	45.54	139	14,519	千円	千円	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	18.24	—	—	—	千円	千円	資本財・サービス
FORTINET INC	15.95	15.95	236	24,632	千円	千円	情報技術
MARKEL CORP	1.58	1.77	182	19,050	千円	千円	金融
NEXTERA ENERGY INC	51.64	243.24	1,938	202,037	千円	千円	公益事業
MASIMO CORP	—	6.93	193	20,219	千円	千円	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	150.25	197.64	599	62,459	千円	千円	素材
INSULET CORP	7.69	7.69	195	20,410	千円	千円	ヘルスケア
US BANCORP	165.2	180.05	888	92,594	千円	千円	金融
UNITED RENTALS INC	10.55	10.55	271	28,309	千円	千円	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	5.5	11.11	211	22,042	千円	千円	情報技術
FASTENAL CO	58.14	79.24	400	41,692	千円	千円	資本財・サービス
FISERV INC	64.56	73.39	844	88,006	千円	千円	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	988.88	1,169.58	1,339	139,581	千円	千円	資本財・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	21.49	—	—	—	千円	千円	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	136.43	165.43	744	77,609	千円	千円	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	7	—	—	—	千円	千円	コミュニケーション・サービス
ZENDESK INC	—	4.65	70	7,379	千円	千円	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	26.11	32.11	487	50,798	千円	千円	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	36.27	41.76	1,227	127,893	千円	千円	金融
ALPHABET INC-CL A	32.74	36.37	6,387	665,782	千円	千円	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	35.95	39.68	7,010	730,688	千円	千円	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	17.63	17.63	142	14,878	千円	千円	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	65.95	78.49	436	45,461	千円	千円	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	56.61	76.12	229	23,960	千円	千円	公益事業
GENUINE PARTS CO	17.7	17.7	186	19,391	千円	千円	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	42.11	44.17	387	40,352	千円	千円	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	81	81	254	26,492	千円	千円	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	24.09	27.79	509	53,148	千円	千円	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9.5	—	—	—	千円	千円	資本財・サービス

銘柄	期首		当		期		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
HALLIBURTON CO	102.3	102.3	210	21,933	千円	千円	エネルギー
HOME DEPOT INC	124.15	135.34	3,670	382,610	千円	千円	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	8.4	8.4	115	12,065	千円	千円	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	95.84	166.84	245	25,615	千円	千円	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3.5	5	84	8,817	千円	千円	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	17.25	17.25	258	26,989	千円	千円	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	14	—	—	—	千円	千円	一般消費財・サービス
HUMANA INC	14.85	17.33	751	78,310	千円	千円	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	33.54	36.71	635	66,275	千円	千円	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9.17	9.17	352	36,694	千円	千円	情報技術
HENRY SCHEIN INC	18.7	18.7	135	14,107	千円	千円	ヘルスケア
HP INC	161.33	174.43	449	46,870	千円	千円	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	132.5	200.5	239	25,015	千円	千円	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	11	13.95	59	6,221	千円	千円	コミュニケーション・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	17.83	—	—	—	千円	千円	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	27.62	27.62	111	11,624	千円	千円	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20.28	20.28	87	9,129	千円	千円	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	50.11	50.11	181	18,891	千円	千円	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	77.25	83.9	275	28,726	千円	千円	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	—	15.58	314	32,750	千円	千円	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	96.54	110.82	1,424	148,519	千円	千円	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	40.47	210	21,976	千円	千円	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	15	131	13,686	千円	千円	資本財・サービス
ZOETIS INC	51.45	60.03	1,016	105,986	千円	千円	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	25.48	32.74	498	51,955	千円	千円	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	24.84	24.84	166	17,364	千円	千円	エネルギー
ALLEGION PLC	11.1	11.1	133	13,921	千円	千円	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	15.72	—	—	—	千円	千円	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC - C	51.08	51.08	128	13,368	千円	千円	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	26.65	34.31	356	37,116	千円	千円	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	49.12	49.12	116	12,190	千円	千円	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC	8.64	8.64	77	8,083	千円	千円	ヘルスケア
JIM SMUCKER CO/THE	13.93	13.93	158	16,566	千円	千円	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	296.77	332.56	5,300	552,419	千円	千円	ヘルスケア
ABBVIE INC	166.54	223.87	2,440	254,386	千円	千円	ヘルスケア
HOLOGIC INC	30.42	30.42	238	24,896	千円	千円	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	39.32	44.29	582	60,681	千円	千円	生活必需品
KROGER CO	94.8	100.13	318	33,146	千円	千円	生活必需品
KLA CORP	19.19	19.19	554	57,827	千円	千円	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	29.5	31.47	1,062	110,763	千円	千円	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	9.36	9.76	263	27,504	千円	千円	情報技術
LOWE'S COS INC	85.96	94.68	1,574	164,132	千円	千円	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	98.52	109.21	2,030	211,654	千円	千円	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	17.24	17.56	906	94,530	千円	千円	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	5.87	—	—	—	千円	千円	不動産
LOEWS CORP	35.91	35.91	167	17,423	千円	千円	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	26.43	26.43	136	14,181	千円	千円	金融
MCDONALD'S CORP	86.07	94.58	2,026	211,189	千円	千円	一般消費財・サービス
3M CO	63.95	72.16	1,192	124,250	千円	千円	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価価額				
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円			
FACEBOOK INC-CLASS A	270.31	303.64	7,798	812,857	コミュニケーション・サービス		
MANPOWERGROUP INC	6.5	-	-	-	資本財・サービス		
S&P GLOBAL INC	26.18	29.23	933	97,248	金融		
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7.67	7.67	237	24,787	素材		
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	-	5.75	202	21,099	情報技術		
CONCHO RESOURCES INC	25.52	25.52	168	17,608	エネルギー		
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	19	-	-	-	その他		
PHILLIPS 66	50.6	51.07	369	38,469	エネルギー		
TECHNIPFMC PLC	45.61	-	-	-	エネルギー		
MGM RESORTS INTERNATIONAL	56.59	56.59	174	18,161	一般消費財・サービス		
DXC TECHNOLOGY CO	24.29	-	-	-	情報技術		
MCCORMICK & CO-NON VGTG SHRS	13.75	29.92	280	29,199	生活必需品		
MYLAN NV	48.88	-	-	-	その他		
METLIFE INC	86.35	90.65	447	46,675	金融		
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	86.17	86.17	432	45,123	情報技術		
ARISTA NETWORKS INC	5.93	5.93	179	18,725	情報技術		
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	24.19	24.19	107	11,207	金融		
MOTOROLA SOLUTIONS INC	17.71	22.32	387	40,407	情報技術		
BETTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.84	2.84	353	36,854	ヘルスケア		
BAKER HUGHES CO	84.46	84.46	191	19,939	エネルギー		
ROCKWELL AUTOMATION INC	14.6	14.6	383	39,959	資本財・サービス		
MERCK & CO. INC.	285.53	318.87	2,710	282,504	ヘルスケア		
DUPONT DE NEMOURS INC	83.2	91.81	771	80,363	素材		
MASCO CORP	35.43	35.43	197	20,624	資本財・サービス		
M & T BANK CORP	13.23	19.84	291	30,336	金融		
MARSH & MCLENNAN COS	55.85	64.53	726	75,727	金融		
BLACK KNIGHT INC	16.44	16.44	142	14,854	情報技術		
HEICO CORP-CLASS A	7.07	10.18	124	12,967	資本財・サービス		
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	31.8	33.61	432	45,071	一般消費財・サービス		
WORKDAY INC-CLASS A	18.78	21.23	485	50,635	情報技術		
WAYFAIR INC-CLASS A	6	8.8	228	23,772	一般消費財・サービス		
SQUARE INC - A	36.26	48.01	1,082	112,842	情報技術		
TRANSUNION	20.29	22.93	214	22,339	資本財・サービス		
VISTRA CORP	42.85	42.85	90	9,455	公益事業		
CAPRI HOLDINGS LTD	11	-	-	-	一般消費財・サービス		
BEIGENE LTD-ADR	3.5	-	-	-	ヘルスケア		
NOVOCCURE LTD	-	6.16	104	10,920	ヘルスケア		
NETAPP INC	23	27.03	176	18,374	情報技術		
NIKE INC -CL B	142.18	155.47	2,286	238,289	一般消費財・サービス		
NORFOLK SOUTHERN CORP	28.43	33.43	850	88,632	資本財・サービス		
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26.26	34.92	516	53,798	情報技術		
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17.49	17.49	180	18,833	金融		
ALLY FINANCIAL INC	50.94	50.94	190	19,899	金融		
NORTHROP GRUMMAN CORP	17.72	20.25	596	62,209	資本財・サービス		
APTIV PLC	26.8	32.32	468	48,873	一般消費財・サービス		
NEWMONT CORP	91.73	104.13	645	67,237	素材		
MCKESSON CORP	21.61	21.61	396	41,309	ヘルスケア		
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	32.57	32.57	310	32,379	情報技術		
XYLEM INC	19.72	19.72	209	21,791	資本財・サービス		
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	171.14	196.39	1,616	168,486	生活必需品		
NUCOR CORP	36.92	36.92	209	21,857	素材		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価価額				
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円			
SUNRUN INC	-	15	143	14,949	資本財・サービス		
WESTERN UNION CO	36	68.11	153	16,029	情報技術		
GODADDY INC - CLASS A	19.3	19.3	156	16,338	情報技術		
NEWELL BRANDS INC	40.58	40.58	93	9,757	一般消費財・サービス		
EVERGY INC	32.43	32.43	170	17,725	公益事業		
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	102.38	102.38	205	21,427	エネルギー		
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	2.69	69	7,209	金融		
OKTA INC	10.1	13.76	347	36,170	情報技術		
COUPA SOFTWARE INC	-	8.8	301	31,422	情報技術		
LIBERTY BROADBAND-C	13.5	8.84	136	14,182	コミュニケーション・サービス		
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	48.77	48.77	153	16,032	ヘルスケア		
LINDE PLC	57.96	61.08	1,634	170,319	素材		
WIX.COM LTD	5	7.85	208	21,773	情報技術		
EQUITABLE HOLDINGS INC	61.84	61.84	165	17,287	金融		
KKR & CO INC	49.96	64.89	263	27,446	金融		
PAYCHEX INC	33	46	418	43,630	情報技術		
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8.27	9.16	443	46,193	一般消費財・サービス		
ALTRIA GROUP INC	207.29	232.79	962	100,330	生活必需品		
P G & E CORP	-	155.15	189	19,745	公益事業		
PFIZER INC	623.73	702.37	2,652	276,506	ヘルスケア		
CIGNA CORP	40.5	46.3	1,018	106,130	ヘルスケア		
DELL TECHNOLOGIES -C	19.17	32.76	247	25,824	情報技術		
ALTICE USA INC- A	10.38	41.47	149	15,560	コミュニケーション・サービス		
XCEL ENERGY INC	53.81	65.28	420	43,818	公益事業		
STERIS PLC	8.97	8.97	179	18,741	ヘルスケア		
FOX CORP - CLASS B	15.3	15.3	45	4,736	コミュニケーション・サービス		
FOX CORP - CLASS A	52.67	52.67	159	16,650	コミュニケーション・サービス		
STRYKER CORP	37.38	44.82	1,083	112,982	ヘルスケア		
DOW INC	88.15	96.64	568	59,288	素材		
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	-	15.08	97	10,160	金融		
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	-	23.26	785	81,874	情報技術		
PARKER HANNIFIN CORP	12.39	18.39	522	54,440	資本財・サービス		
UBER TECHNOLOGIES INC	16.48	116.86	637	66,492	資本財・サービス		
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	22.03	22.03	289	30,176	エネルギー		
POLARIS INC	9.89	-	-	-	一般消費財・サービス		
PROCTER & GAMBLE CO/THE	278.25	310.59	4,281	446,258	生活必需品		
EXELON CORP	98.59	118.82	497	51,841	公益事業		
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	26.52	26.52	415	43,259	ヘルスケア		
TELADOC HEALTH INC	-	13.4	295	30,847	ヘルスケア		
INGERSOLL-RAND INC	-	53.97	250	26,151	資本財・サービス		
NVR INC	0.45	0.45	179	18,699	一般消費財・サービス		
CONOCOPHILLIPS	122.28	141.85	643	67,064	エネルギー		
TWILIO INC - A	13.31	17.46	632	65,880	情報技術		
DOCUSIGN INC	10.27	22.52	542	56,559	情報技術		
PAYCOM SOFTWARE INC	4.91	6.01	256	26,758	情報技術		
CERIDIAN HCM HOLDING INC	-	6.12	62	6,516	情報技術		
MATCH GROUP INC	9.28	-	-	-	その他		
PEPSICO INC	156.2	174.34	2,477	258,198	生活必需品		
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4.09	4.09	63	6,572	情報技術		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ドル	千円			
DROPBOX INC-CLASS A	23.92	23.92	55	5,821	情報技術		
MONGODB INC	3.9	6.1	220	22,981	情報技術		
SNAP INC - A	68.89	116.75	634	66,174	コミュニケーション・サービス		
CORTEVA INC	75.09	85.3	372	38,781	素材		
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42.88	53.88	435	45,365	金融		
AMCOR PLC	174.57	174.57	201	20,997	素材		
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	-	19.1	443	46,234	情報技術		
ROKU INC	9.39	14.88	599	62,523	コミュニケーション・サービス		
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20.92	20.92	327	34,155	公益事業		
ACCENTURE PLC-CL A	72.8	79.88	2,079	216,764	情報技術		
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	-	58.76	247	25,766	情報技術		
10X GENOMICS INC-CLASS A	-	4.21	70	7,350	ヘルスケア		
PENTAIR PLC	15.75	15.75	89	9,326	資本財・サービス		
QUALCOMM INC	134.03	142.14	2,218	231,280	情報技術		
INVESCO LTD	37	37	70	7,304	金融		
ADVANCE AUTO PARTS INC	8.19	8.19	140	14,599	一般消費財・サービス		
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31.93	31.93	165	17,239	金融		
DATADOG INC - CLASS A	-	18.25	190	19,830	情報技術		
PINTEREST INC- CLASS A	-	60.8	435	45,437	コミュニケーション・サービス		
RAYTHEON COMPANY	31.16	-	-	-	その他		
AVALARA INC	-	12.57	198	20,734	情報技術		
REGENERON PHARMACEUTICALS	9.25	13.27	667	69,560	ヘルスケア		
REPUBLIC SERVICES INC	26.67	26.67	255	26,616	資本財・サービス		
BOOKING HOLDINGS INC	4.86	5.01	1,112	115,993	一般消費財・サービス		
ROSS STORES INC	41.29	48.88	590	61,580	一般消費財・サービス		
PACKAGING CORP OF AMERICA	8.44	9.98	145	15,169	素材		
RESMED INC	13.83	19.83	436	45,533	ヘルスケア		
QUEST DIAGNOSTICS INC	18.12	18.12	224	23,349	ヘルスケア		
ROBERT HALF INTL INC	14.99	14.99	94	9,855	資本財・サービス		
MODERNA INC	-	33.62	394	41,090	ヘルスケア		
RALPH LAUREN CORP	4	-	-	-	一般消費財・サービス		
HUBSPOT INC	-	3.54	142	14,849	情報技術		
PERKINELMER INC	11.63	11.63	185	19,304	ヘルスケア		
CARRIER GLOBAL CORP	-	97.33	404	42,171	資本財・サービス		
OTIS WORLDWIDE CORP	-	48.66	322	33,656	資本財・サービス		
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	-	23	109	11,377	金融		
AVANTOR INC	-	56	170	17,796	ヘルスケア		
CARLYLE GROUP INC/THE	-	31.23	101	10,614	金融		
DYNATRACE INC	-	23.39	98	10,244	情報技術		
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	-	5.4	420	43,861	情報技術		
REGIONS FINANCIAL CORP	92.5	153.5	274	28,606	金融		
IAC/INTERACTIVECORP	-	10.21	192	20,069	コミュニケーション・サービス		
MATCH GROUP INC	-	31.62	480	50,062	コミュニケーション・サービス		
CHEVRON CORP	213.52	234.68	2,149	224,059	エネルギー		
PELOTON INTERACTIVE INC-A	-	25.9	394	41,125	一般消費財・サービス		
ZSCALER INC	-	12.94	257	26,799	情報技術		
EDISON INTERNATIONAL	38.64	49.85	307	32,042	公益事業		
ETSY INC	-	13.29	243	25,355	一般消費財・サービス		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ドル	千円			
TESLA INC	16.51	93.77	7,606	792,828	一般消費財・サービス		
SNOWFLAKE INC-CLASS A	-	3.63	106	11,092	情報技術		
NORTONLIFELOCK INC	79.44	79.44	167	17,412	情報技術		
DRAFTKINGS INC - CL A	-	12.2	65	6,815	一般消費財・サービス		
STANLEY BLACK & DECKER INC	15.81	22	387	40,438	資本財・サービス		
SYNOPSYS INC	15.82	20.31	528	55,130	情報技術		
CARVANA CO	-	6.88	188	19,657	一般消費財・サービス		
CHEWY INC - CLASS A	-	8.56	83	8,667	一般消費財・サービス		
CLOUDFLARE INC - CLASS A	-	20.3	155	16,186	情報技術		
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	18.17	18.26	1,170	122,022	コミュニケーション・サービス		
VIATRIS INC	-	137.45	253	26,460	ヘルスケア		
CBRE GROUP INC - A	38.49	38.49	239	24,969	不動産		
TWITTER INC	84.84	105.16	506	52,809	コミュニケーション・サービス		
SOUTHERN CO/THE	113.05	139.16	851	88,782	公益事業		
SYSCO CORP	48.6	61.6	477	49,791	生活必需品		
TRAVELERS COS INC/THE	28.6	29.58	406	42,371	金融		
SEI INVESTMENTS COMPANY	19.25	19.25	117	12,275	金融		
STEEL DYNAMICS INC	23	23	92	9,591	素材		
SCHLUMBERGER LTD	149.99	178.99	447	46,621	エネルギー		
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	20.26	113	11,806	資本財・サービス		
AT&T INC	818.15	897.21	2,590	269,981	コミュニケーション・サービス		
SOUTHWEST AIRLINES CO	17.58	17.58	83	8,692	資本財・サービス		
ON SEMICONDUCTOR CORP	36.27	44.52	160	16,728	情報技術		
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	8.34	10.19	748	78,058	素材		
SEMPRA ENERGY	31.6	39.15	463	48,318	公益事業		
TIFFANY & CO	10.86	-	-	-	その他		
SEAGATE TECHNOLOGY	23.49	26.06	153	15,949	情報技術		
TEXAS INSTRUMENTS INC	105.74	114.44	1,960	204,339	情報技術		
SALESFORCE.COM INC	96.2	114.15	2,491	259,670	情報技術		
WESTROCK CO	23.21	26.18	121	12,675	素材		
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	99.06	99.06	505	52,647	資本財・サービス		
TERADYNE INC	20.96	20.96	284	29,645	情報技術		
UNION PACIFIC CORP	80.49	85.02	1,847	192,607	資本財・サービス		
MARATHON OIL CORP	102.44	-	-	-	エネルギー		
MARATHON PETROLEUM CORP	70.61	81.28	354	36,928	エネルギー		
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	90.33	190.09	1,326	138,295	資本財・サービス		
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	80.87	87.73	1,419	148,006	資本財・サービス		
UNUM GROUP	19	-	-	-	金融		
SPRINT CORP	114.74	-	-	-	その他		
IQVIA HOLDINGS INC	17.81	24.35	466	48,587	ヘルスケア		
VOYA FINANCIAL INC	18	18	107	11,219	金融		
AMEREN CORPORATION	28.61	28.61	214	22,377	公益事業		
UNITEDHEALTH GROUP INC	107.26	119.3	4,303	448,579	ヘルスケア		
VERISIGN INC	10.85	13.65	271	28,333	情報技術		
VALERO ENERGY CORP	45.4	58.84	345	35,963	エネルギー		
ULTA BEAUTY INC	6.35	6.35	184	19,205	一般消費財・サービス		
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	30.08	120	12,581	金融		
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9.92	9.92	134	13,970	ヘルスケア		
ANTHEM INC	29.08	32.54	1,102	114,898	ヘルスケア		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当		期末		業種等
	株数	株数	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
WALT DISNEY CO/THE	201.84	228.95	4,100	427,370	コミュニケーション・サービス		
WELLS FARGO & CO	476.67	483.84	1,608	167,631	金融		
WASTE MANAGEMENT INC	46.9	55.07	644	67,180	資本財・サービス		
WILLIAMS COS INC	125.23	171.23	368	38,389	エネルギー		
TRACTOR SUPPLY COMPANY	15.91	15.91	237	24,791	一般消費財・サービス		
WHIRLPOOL CORP	8.7	8.7	156	16,338	一般消費財・サービス		
WALMART INC	158.96	178.52	2,629	274,064	生活必需品		
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	9	-	-	-	資本財・サービス		
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	23.65	24.92	396	41,298	ヘルスケア		
WYNN RESORTS LTD	11.45	11.45	123	12,892	一般消費財・サービス		
XEROX HOLDINGS CORP	19.88	-	-	-	情報技術		
WABTEC CORP	18.98	18.98	155	16,156	資本財・サービス		
TJX COMPANIES INC	131.81	149.98	1,025	106,878	一般消費財・サービス		
WATERS CORP	6.5	7.6	202	21,075	ヘルスケア		
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	9.92	-	-	-	資本財・サービス		
ALLERGAN PLC	38.47	-	-	-	その他		
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5.55	5.55	229	23,936	情報技術		
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	89.76	86.95	414	43,229	生活必需品		
WILLIS TOWERS WATSON PLC	15.11	18.68	372	38,790	金融		
WESTERN DIGITAL CORP	35.31	35.31	182	18,975	情報技術		
WEC ENERGY GROUP INC	34.67	41.89	364	37,968	公益事業		
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	50.77	68.77	391	40,842	公益事業		
VISA INC-CLASS A SHARES	193.27	212.64	4,526	471,838	情報技術		
PPL CORP	73.94	101.94	283	29,506	公益事業		
PULTEGROUP INC	35.56	35.56	149	15,596	一般消費財・サービス		
PPG INDUSTRIES INC	24.34	32.34	483	50,376	素材		
NORTHERN TRUST CORP	20.62	22.6	221	23,058	金融		
NVIDIA CORP	63.91	77.62	4,229	440,809	情報技術		
IAC/INTERACTIVECORP	8.59	-	-	-	コミュニケーション・サービス		
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	49.94	51.6	822	85,718	金融		
HD SUPPLY HOLDINGS INC	24.82	-	-	-	その他		
TYSON FOODS INC-CL A	32.11	33.22	215	22,426	生活必需品		
NETFLIX INC	50.12	55.58	2,773	289,133	コミュニケーション・サービス		
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	43.93	49.85	2,559	266,729	ヘルスケア		
NRG ENERGY INC	30	30	119	12,420	公益事業		
GLOBE LIFE INC	12.15	12.15	115	12,076	金融		
FIRST REPUBLIC BANK/CA	18.56	19.53	319	33,308	金融		
TEXTRON INC	22.1	28.31	137	14,337	資本財・サービス		
NEWS CORP - CLASS A	79.99	37.49	69	7,291	コミュニケーション・サービス		
OGE ENERGY CORP	24.52	24.52	77	8,083	公益事業		
OMNICOM GROUP	25.46	25.46	162	16,904	コミュニケーション・サービス		
ORACLE CORP	261.18	257.94	1,625	169,456	情報技術		
MASTERCARD INC - A	101.41	112.66	3,922	408,875	情報技術		
ONEOK INC	45.66	45.66	188	19,621	エネルギー		
CENTURYLINK INC	97.47	110.62	116	12,152	コミュニケーション・サービス		
ROPER TECHNOLOGIES INC	12.69	12.69	556	58,003	資本財・サービス		
YUM! BRANDS INC	32.71	41.58	447	46,662	一般消費財・サービス		

銘柄	期首		当		期末		業種等
	株数	株数	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	11.91	14.13	291	30,418	コミュニケーション・サービス		
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4	-	-	-	情報技術		
NOLSON COORS BEVERAGE CO - B	17.75	33.74	167	17,471	生活必需品		
NOBLE ENERGY INC	62.74	-	-	-	その他		
BANK OF AMERICA CORP	1,012.68	980.93	3,243	338,115	金融		
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4.18	4.18	155	16,215	資本財・サービス		
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	21.27	29.08	236	24,623	ヘルスケア		
NORDSTROM INC	8	-	-	-	一般消費財・サービス		
AMERICAN EXPRESS CO	72.62	88.35	1,069	111,480	金融		
ANALOG DEVICES INC	39.3	48.3	764	79,693	情報技術		
ADVANCED MICRO DEVICES	114.47	146.31	1,422	148,305	情報技術		
TD AMERITRADE HOLDING CORP	34.8	-	-	-	その他		
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	94.6	100.84	406	42,336	金融		
SKYYWORKS SOLUTIONS INC	22.83	22.83	369	38,560	情報技術		
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17.84	21.47	154	16,139	一般消費財・サービス		
AVERY DENNISON CORP	11.31	11.31	182	19,019	素材		
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	62.07	65.6	525	54,795	情報技術		
EMERSON ELECTRIC CO	63.46	78.46	648	67,565	資本財・サービス		
ACON PLC-CLASS A	26.41	30.57	617	64,404	金融		
AMGEN INC	66.7	73.75	1,752	182,619	ヘルスケア		
TAPESTRY INC	25.5	-	-	-	一般消費財・サービス		
EATON CORP PLC	48.03	50.56	641	66,906	資本財・サービス		
CONSTELLATION BRANDS INC-A	17.84	21.81	494	51,575	生活必需品		
APPLIED MATERIALS INC	102.64	119.64	1,171	122,156	情報技術		
CME GROUP INC	41.37	45.88	912	95,134	金融		
NOV INC	33.89	-	-	-	エネルギー		
ECOLAB INC	29.12	33.15	732	76,381	素材		
EQUIFAX INC	12.56	17.75	327	34,169	資本財・サービス		
GAP INC/THE	28.2	-	-	-	一般消費財・サービス		
GILEAD SCIENCES INC	144.04	158.31	989	103,145	ヘルスケア		
KEURIG DR PEPPER INC	-	45.94	144	15,016	生活必需品		
HORMEL FOODS CORP	33.15	33.15	147	15,351	生活必需品		
STATE STREET CORP	39.48	41.52	324	33,816	金融		
SCHWAB (CHARLES) CORP	128.07	187.78	1,131	117,923	金融		
BAXTER INTERNATIONAL INC	51.75	65.68	541	56,457	ヘルスケア		
CAMPBELL SOUP CO	13	21.66	99	10,391	生活必需品		
CROWN HOLDINGS INC	11.45	15.97	159	16,652	素材		
CARDINAL HEALTH INC	33.19	33.19	185	19,282	ヘルスケア		
FEDEX CORP	28.93	31.93	783	81,640	資本財・サービス		
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	51.81	54.87	599	62,515	金融		
FMC CORP	11.42	13.6	162	16,921	素材		
FLEX LTD	45	-	-	-	情報技術		
CERNER CORP	41.33	41.33	326	33,980	ヘルスケア		
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11.63	11.63	142	14,843	素材		
CITRIX SYSTEMS INC	13.5	14.12	183	19,080	情報技術		
INTEL CORP	497.06	534.49	2,754	287,128	情報技術		
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	52.31	52.31	127	13,314	コミュニケーション・サービス		
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	48.66	48.66	244	25,485	金融		
ILLINOIS TOOL WORKS	35.91	40.4	840	87,616	資本財・サービス		
SIRIUS XM HOLDINGS INC	153	153	90	9,472	コミュニケーション・サービス		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当		期		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
ILLUMINA INC	16.54	17.87	665	69,377	ヘルスケア		
SEALED AIR CORP	14.5	14.5	67	7,012	素材		
INTUITIVE SURGICAL INC	12.38	15.22	1,238	129,075	ヘルスケア		
CHECK POINT SOFTWARE TECH	17.9	13.3	178	18,563	情報技術		
SNAP-ON INC	5	5	85	8,931	資本財・サービス		
CARMAX INC	19.9	19.9	208	21,704	一般消費財・サービス		
COMERICA INC	11.87	-	-	-	金融		
INGREDION INC	5.3	-	-	-	生活必需品		
DUKE ENERGY CORP	82.01	89.87	802	83,639	公益事業		
TARGET CORP	55.74	64.74	1,264	131,772	一般消費財・サービス		
DOVER CORP	17.13	17.13	220	22,993	資本財・サービス		
VWV GRAINGER INC	5.88	5.88	230	24,006	資本財・サービス		
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17.5	17.5	197	20,613	資本財・サービス		
CINTAS CORP	9.95	11.62	394	41,118	資本財・サービス		
CONAGRA BRANDS INC	55.67	55.67	184	19,206	生活必需品		
LAMB WESTON HOLDINGS INC	15	15	114	11,883	生活必需品		
CLOXOR COMPANY	12.78	16.28	315	32,873	生活必需品		
ENTERGY CORP	21.14	22.43	211	22,067	公益事業		
MICROSOFT CORP	809.83	908.49	19,758	2,059,454	情報技術		
INCYTE CORP	19.93	26.89	250	26,155	ヘルスケア		
CVS HEALTH CORP	147.72	160.17	1,218	126,995	ヘルスケア		
MEDTRONIC PLC	148.77	169.39	2,007	209,217	ヘルスケア		
MICRON TECHNOLOGY INC	129.91	146.66	1,153	120,257	情報技術		
BLACKROCK INC	13.6	19.59	1,501	156,545	金融		
CENTERPOINT ENERGY INC	56.36	56.36	117	12,212	公益事業		
HASBRO INC	14.49	14.49	140	14,627	一般消費財・サービス		
KELLOGG CO	26.2	36.9	219	22,834	生活必需品		
KEYCORP	117.82	117.82	217	22,694	金融		
KANSAS CITY SOUTHERN	11.76	11.76	251	26,260	資本財・サービス		
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	165.75	183.59	1,048	109,245	生活必需品		
KOHL'S CORP	16.5	-	-	-	一般消費財・サービス		
COOPER COS INC/THE	5.72	6.47	232	24,253	ヘルスケア		
APACHE CORP	36.73	-	-	-	エネルギー		
CHUBB LTD	50.52	58.31	898	93,674	金融		
ARROW ELECTRONICS INC	10	10	104	10,839	情報技術		
ALLSTATE CORP	39.99	39.99	436	45,495	金融		
EBAY INC	90.53	93.21	502	52,394	一般消費財・サービス		
PAYPAL HOLDINGS INC	129.27	141.1	3,351	349,287	情報技術		
EASTMAN CHEMICAL CO	12.83	14.92	159	16,666	素材		
XILINX INC	25.83	28.92	436	45,540	情報技術		
DISH NETWORK CORP-A	29.84	29.84	97	10,179	コミュニケーション・サービス		
ZIONS BANCORP NA	19	-	-	-	金融		
ESTEEL LAUDER COMPANIES-CLA	23.4	27.83	718	74,870	生活必需品		
TRIMBLE INC	22	29.38	214	22,379	情報技術		
LENNAR CORP-A	33.94	33.94	257	26,843	一般消費財・サービス		
LEAR CORP	6	6	98	10,236	一般消費財・サービス		
E*TRADE FINANCIAL CORP	39.17	-	-	-	その他		
PROGRESSIVE CORP	64.74	73.91	702	73,253	金融		
PACCAR INC	35.25	48.25	425	44,366	資本財・サービス		
PVH CORP	6.18	-	-	-	一般消費財・サービス		
BIOGEN INC	21.3	19.48	521	54,317	ヘルスケア		

銘柄	期首		当		期		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
IDEXX LABORATORIES INC	9.37	10.24	518	54,064	ヘルスケア		
STARBUCKS CORP	130.62	148.28	1,551	161,661	一般消費財・サービス		
PTC INC	12	12	154	16,154	情報技術		
PERRIGO CO PLC	19.29	19.29	86	8,967	ヘルスケア		
EVERSOURCE ENERGY	34.23	42.9	382	39,889	公益事業		
INTUIT INC	28.46	34.01	1,266	131,989	情報技術		
BORGWARNER INC	30.81	30.81	123	12,903	一般消費財・サービス		
BEST BUY CO INC	23	29.87	330	34,489	一般消費財・サービス		
BALL CORP	35.8	38.6	349	36,434	素材		
BOSTON SCIENTIFIC CORP	162.47	184.24	671	69,976	ヘルスケア		
ELECTRONIC ARTS INC	36.77	36.77	519	54,123	コミュニケーション・サービス		
VULCAN MATERIALS CO	16.06	16.06	261	27,285	素材		
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28.56	32.07	752	78,432	ヘルスケア		
VF CORP	38.82	42.16	367	38,265	一般消費財・サービス		
VIACOMCBS INC - CLASS B	57.34	72.02	295	30,822	コミュニケーション・サービス		
MOHAWK INDUSTRIES INC	9.42	9.42	139	14,490	一般消費財・サービス		
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10.03	10.03	176	18,373	ヘルスケア		
CARNIVAL CORP	49.92	49.92	100	10,479	一般消費財・サービス		
COMCAST CORP-CLASS A	510.46	574.77	2,961	308,647	コミュニケーション・サービス		
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	21	21	54	5,664	資本財・サービス		
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	22	36	207	21,643	資本財・サービス		
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	56	-	-	-	生活必需品		
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	231	231	101	10,593	不動産		
アメリカ・ドル 通貨計	株数・金額 銘柄数&比率	33,749.8 608銘柄	39,340.65 591銘柄	422,959	44,085,043	<65.1%>	
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円			
IMPERIAL OIL LTD	23	23	63	5,168	エネルギー		
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2.5	2.5	405	33,100	情報技術		
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	24.38	-	-	-	エネルギー		
RESTAURANT BRANDS INTERN	21.21	37.21	300	24,530	一般消費財・サービス		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	42	63	343	28,024	素材		
INTACT FINANCIAL CORP	17	17	243	19,834	金融		
BCE INC	9	9	49	4,045	コミュニケーション・サービス		
FRANCO-NEVADA CORP	22	22	355	28,972	素材		
SUNCOR ENERGY INC	172.12	218.12	510	41,628	エネルギー		
METRO INC/CN	30	30	174	14,247	生活必需品		
NATIONAL BANK OF CANADA	33	39.41	287	23,483	金融		
BANK OF NOVA SCOTIA	130	150.75	1,026	83,680	金融		
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	44	57	643	52,477	金融		
TORONTO-DOMINION BANK	189	230.3	1,708	139,371	金融		
GREAT-WEST LIFE CO INC	39	39	120	9,790	金融		
ROYAL BANK OF CANADA	166	182.32	1,966	160,358	金融		
TC ENERGY CORP	88	113.04	609	49,739	エネルギー		
PEMBINA PIPELINE CORP	55.71	63.75	215	17,574	エネルギー		
BOMBARDIER INC-B	192	-	-	-	資本財・サービス		
BARRICK GOLD CORP	174	218.48	656	53,511	素材		
CAE INC	23	23	79	6,486	資本財・サービス		
THOMSON REUTERS CORP	18.33	22.84	232	18,971	資本財・サービス		
EMPIRE CO LTD 'A'	18	18	64	5,232	生活必需品		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千カナダ・ドル	千円			
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6	6	-	-	-	-	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	10	15.6	94	7,668	94	7,668	素材
HYDRO ONE LTD	48	48	139	11,360	139	11,360	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	24.89	24.89	160	13,087	160	13,087	生活必需品
WSP GLOBAL INC	12	12	147	12,006	147	12,006	資本財・サービス
PARKLAND CORP	28	28	124	10,157	124	10,157	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	23	23	73	6,023	73	6,023	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	25	27.31	142	11,640	142	11,640	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	10	31	2,564	31	2,564	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	39	56	341	27,838	341	27,838	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	29	29	257	20,965	257	20,965	素材
STARS GROUP INC/THE	35	-	-	-	-	-	その他
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	70	70	150	12,291	150	12,291	公益事業
B2GOLD CORP	-	164	110	8,988	110	8,988	素材
AIR CANADA	17	17	38	3,104	38	3,104	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	105.34	147.57	136	11,097	136	11,097	素材
BANK OF MONTREAL	66	82	818	66,792	818	66,792	金融
POWER CORP OF CANADA	31	63	188	15,358	188	15,358	金融
METHANEX CORP	6	-	-	-	-	-	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	10	14.44	2,169	176,942	2,169	176,942	情報技術
NUTRIEN LTD	60.27	80.27	526	42,953	526	42,953	素材
AURORA CANNABIS INC	70	-	-	-	-	-	ヘルスケア
CANOPY GROWTH CORP	20	20	80	6,547	80	6,547	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	34	-	-	-	-	-	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	22	31.93	165	13,502	165	13,502	素材
TOPICUS.COM INC	-	4.64	2	182	2	182	その他
CAMECO CORP	28	28	50	4,138	50	4,138	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	-	4.22	74	6,053	74	6,053	不動産
TELUS CORP	3	6	15	1,302	15	1,302	コミュニケーション・サービス
POWER FINANCIAL CORP	20	-	-	-	-	-	その他
TECK RESOURCES LTD-CLS B	44	44	107	8,784	107	8,784	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	4	7.43	130	10,665	130	10,665	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	117	152	513	41,902	513	41,902	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3	3	141	11,532	141	11,532	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	31	31	295	24,105	295	24,105	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	9.01	9.01	88	7,198	88	7,198	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	-	43.08	188	15,361	188	15,361	素材
BLACKBERRY LTD	64	64	62	5,089	62	5,089	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	65	72.66	438	35,793	438	35,793	金融
ENBRIDGE INC	213	267	1,133	92,484	1,133	92,484	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	90	180	885	72,214	885	72,214	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	202	266	637	51,981	637	51,981	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	43	43	129	10,521	129	10,521	ヘルスケア
ENCANA CORP	152	-	-	-	-	-	その他
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	18	18	837	68,342	837	68,342	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	11	11	61	5,044	61	5,044	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	28	28	99	8,097	99	8,097	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	71	87.93	1,280	104,475	1,280	104,475	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	28	28	281	22,989	281	22,989	情報技術

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千カナダ・ドル	千円			
HUSKY ENERGY INC	30.12	-	-	-	-	-	その他
ONEX CORPORATION	16	16	116	9,535	116	9,535	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	68	68	155	12,656	155	12,656	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	3	3	10	864	10	864	金融
TMX GROUP LTD	-	7.94	99	8,140	99	8,140	金融
OPEN TEXT CORP	27	45	254	20,754	254	20,754	情報技術
CI FINANCIAL CORP	20	20	32	2,681	20	2,681	金融
SAPUTO INC	29	29	107	8,786	29	8,786	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63	63	155	12,681	63	12,681	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	90	100.13	423	34,503	90	34,503	生活必需品
YAMANA GOLD INC	-	119	82	6,696	119	6,696	素材
FORTIS INC	42	62	316	25,774	42	25,774	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	-	13.55	114	9,312	114	9,312	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	66	66	75	6,147	66	6,147	素材
CENOVUS ENERGY INC	141	141	115	9,452	141	9,452	エネルギー
DOLLARAMA INC	27	35.29	190	15,545	27	15,545	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	8	8	29	2,415	8	2,415	公益事業
ALTAGAS LTD	47	47	88	7,241	47	7,241	公益事業
KEYERA CORP	22	22	53	4,388	22	4,388	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	48	48	63	5,144	48	5,144	エネルギー
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 総額	金額 総額	4,325.88	4,855.61	25,896	2,112,108	
(オーストラリア)	株数	株数	85銘柄	82銘柄	千円	< 3.1% >	
MEDIBANK PRIVATE LTD	228.24	228.24	67	5,446	67	5,446	金融
BHP GROUP LTD	318.05	365.48	1,699	136,536	1,699	136,536	素材
SOUTH32 LTD	563.87	563.87	146	11,778	146	11,778	素材
ALUMINA LTD	362.17	-	-	-	-	-	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	95.76	156.53	398	32,017	398	32,017	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	205.54	205.54	518	41,629	518	41,629	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	36	-	-	-	-	-	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	297.31	421.03	977	78,509	977	78,509	金融
WESTPAC BANKING CORP	368.11	442.7	898	72,164	898	72,164	金融
SANTOS LTD	182.7	182.7	131	10,568	131	10,568	エネルギー
AUSNET SERVICES	285	285	51	4,121	51	4,121	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	307.72	351.9	839	67,427	839	67,427	金融
RIO TINTO LTD	41.69	41.69	510	40,996	510	40,996	素材
ORIGIN ENERGY LTD	209.68	209.68	107	8,608	107	8,608	エネルギー
AURIZON HOLDINGS LTD	290.47	290.47	111	8,984	111	8,984	資本財・サービス
XERO LTD	-	6.32	85	6,901	85	6,901	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	-	9.53	27	2,215	27	2,215	エネルギー
COLES GROUP LTD	166.96	166.96	308	24,815	308	24,815	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	-	25.09	69	5,591	69	5,591	情報技術
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	-	81.83	104	8,401	104	8,401	素材
EVOLUTION MINING LTD	-	170.17	80	6,452	80	6,452	素材
AFTERPAY LTD	-	30	341	27,473	341	27,473	情報技術
TPG TELECOM LTD	-	50	34	2,783	34	2,783	コミュニケーション・サービス
OIL SEARCH LTD	154.18	173.45	73	5,894	73	5,894	エネルギー
SEEK LTD	26	26	72	5,821	72	5,821	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	101.73	101.73	94	7,560	94	7,560	生活必需品

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ドル	千円			
NEWCREST MINING LTD	84.2	119.81	315	25,334	素材		
INCITEC PIVOT LTD	204	-	-	-	素材		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	188.45	218.56	1,861	149,533	金融		
AMPOL LTD	20	20	55	4,487	エネルギー		
ORICA LTD	58.45	58.45	89	7,161	素材		
QBE INSURANCE GROUP LTD	153.48	153.48	129	10,444	金融		
CIMIC GROUP LTD	10	10	25	2,014	資本財・サービス		
WOOLWORTHS GROUP LTD	140.56	169.8	677	54,444	生活必需品		
COCA-COLA AMATIL LTD	26	26	33	2,711	生活必需品		
TABCORP HOLDINGS LTD	173.52	173.52	69	5,604	一般消費財・サービス		
CROWN RESORTS LTD	30	30	30	2,453	一般消費財・サービス		
QANTAS AIRWAYS LTD	-	63.73	31	2,513	資本財・サービス		
TELSTRA CORP LTD	351.14	351.14	105	8,463	コミュニケーション・サービス		
AMP LTD	249.35	249.35	39	3,205	金融		
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	67.33	67.33	244	19,608	素材		
MACQUARIE GROUP LTD	31.29	42.77	598	48,109	金融		
ARISTOCRAT LEISURE LTD	61.63	61.63	194	15,616	一般消費財・サービス		
CSL LTD	54.73	55.5	1,531	123,042	ヘルスケア		
WESFARMERS LTD	157.53	137.98	709	56,967	一般消費財・サービス		
COCHLEAR LTD	8.05	8.05	147	11,828	ヘルスケア		
BLUESCOPE STEEL LTD	70.92	70.92	130	10,512	素材		
SUNCORP GROUP LTD	145.04	145.04	150	12,106	金融		
BORAL LTD	86	-	-	-	素材		
ASX LTD	22.6	22.6	163	13,147	金融		
COMPUTERSHARE LTD	20.61	60.54	85	6,848	情報技術		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	270.97	132	10,667	金融		
SONIC HEALTHCARE LTD	52.23	52.23	175	14,073	ヘルスケア		
CHALLENGER LTD	63	-	-	-	金融		
WORLEY LTD	71.87	-	-	-	エネルギー		
AGL ENERGY LTD	84.66	84.66	103	8,318	公益事業		
BRAMBLES LTD	183.37	183.37	194	15,586	資本財・サービス		
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	8	-	-	-	一般消費財・サービス		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20.64	20.64	124	9,982	ヘルスケア		
REA GROUP LTD	6.08	6.08	88	7,125	コミュニケーション・サービス		
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15.51	15.51	79	6,404	金融		
オーストラリア・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	7,432.39 53銘柄	7,535.57 54銘柄	16,069 < 1.9% >	1,291,019 < 1.9% >		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円			
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	235	235	970	13,044	公益事業		
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	220	230	1,391	18,701	一般消費財・サービス		
MTR CORP	165	165	726	9,757	資本財・サービス		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	190	190	2,052	27,578	不動産		
SINO LAND CO	340	340	354	4,761	不動産		
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	285.52	375.52	2,127	28,591	資本財・サービス		
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	80	80	368	4,945	不動産		
CLP HOLDINGS LTD	190	170	1,229	16,519	公益事業		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	205.65	205.65	640	8,609	不動産		
HONG KONG & CHINA GAS	1,180.35	1,638.36	1,887	25,366	公益事業		
HANG SENG BANK LTD	90	80	1,167	15,687	金融		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千香港ドル	千円			
WHEELLOCK & CO LTD	160	-	-	-	その他		
NEW WORLD DEVELOPMENT	580	175	637	8,561	不動産		
WH GROUP LTD	915	1,695	1,135	15,263	生活必需品		
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	139	149	6,707	90,155	金融		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	370	370	764	10,268	不動産		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20	30	284	3,822	情報技術		
YUE YUEN INDUSTRIAL HDG	80	-	-	-	一般消費財・サービス		
NWWS HOLDINGS LTD	150	-	-	-	資本財・サービス		
KERRY PROPERTIES LTD	75	-	-	-	不動産		
BANK OF EAST ASIA LTD	86	86	146	1,964	金融		
SJM HOLDINGS LTD	100	100	83	1,126	一般消費財・サービス		
SWIRE PROPERTIES LTD	80	80	188	2,532	不動産		
CK ASSET HOLDINGS LTD	305.52	285.52	1,134	15,253	不動産		
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	55	230	3,097	公益事業		
PCCW LTD	600	600	268	3,604	コミュニケーション・サービス		
AIA GROUP LTD	1,478	1,594	15,756	211,769	金融		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140	200	843	11,329	不動産		
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	120	-	-	-	生活必需品		
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	192	192	492	6,618	生活必需品		
ESR CAYMAN LTD	-	180	488	6,568	不動産		
SANDS CHINA LTD	238	290	928	12,472	一般消費財・サービス		
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	190	190	2,204	29,621	資本財・サービス		
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	390	450	1,127	15,150	金融		
WYNN MACAU LTD	168	168	210	2,826	一般消費財・サービス		
香港ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	9,813.04 34銘柄	10,599.05 30銘柄	46,545 < 0.9% >	625,571 < 0.9% >		
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール ドル	千円			
UNITED OVERSEAS BANK LTD	129	179	425	33,368	金融		
DBS GROUP HOLDINGS LTD	211	233	627	49,150	金融		
SINGAPORE AIRLINES LTD	71	177.5	76	5,980	資本財・サービス		
KEPPEL CORP LTD	173	173	97	7,645	資本財・サービス		
UOL GROUP LTD	166	30	23	1,828	不動産		
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	52	37	2,929	不動産		
CAPITALAND LTD	334	334	114	8,977	不動産		
YANGZIJUANG SHIPBUILDING	270	-	-	-	資本財・サービス		
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	120	-	-	-	コミュニケーション・サービス		
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9	-	-	-	一般消費財・サービス		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	348	447	473	37,128	金融		
GENTING SINGAPORE LTD	450	450	38	3,032	一般消費財・サービス		
VENTURE CORP LTD	32	32	64	5,042	情報技術		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	924	1,284	321	25,153	コミュニケーション・サービス		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	141	55	4,342	資本財・サービス		
SENBCORP INDUSTRIES LTD	40	-	-	-	資本財・サービス		
SATS LTD	77	-	-	-	資本財・サービス		
SINGAPORE EXCHANGE LTD	168	168	168	13,217	金融		
COMFORTDELGRO CORP LTD	369	-	-	-	資本財・サービス		
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	158	79	6,239	生活必需品		
シンガポール・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,242 20銘柄	3,858.5 14銘柄	2,603 < 0.3% >	204,037 < 0.3% >		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額 千ニュージーランド・ドル	邦貨換算金額 千円	
(ニュージーランド)	百株	百株	千円	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	150	150	126	9,442	公益事業
MERCURY NZ LTD	217.05	32.94	23	1,743	公益事業
A2 MILK CO LTD	70	70	79	5,971	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	168.6	168.6	82	6,176	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81	132.89	105	7,868	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	145.26	—	—	—	素材
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	92	92	295	22,078	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	44.19	44.19	68	5,120	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル 通貨計	株数、金額 8銘柄	金額 7銘柄	781	58,400	
(イギリス)	百株	百株	千円	千円	
TUI AG-DI	48.02	—	—	—	一般消費財・サービス
BP PLC	2,309.65	2,510.81	750	105,737	エネルギー
UNILEVER PLC	120.91	337.93	1,492	210,324	生活必需品
BARCLAYS PLC	1,801.73	2,413.66	364	51,434	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	177.45	768.95	81	11,460	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	324.28	—	—	—	一般消費財・サービス
PRUDENTIAL PLC	303.22	314.21	446	62,906	金融
NATWEST GROUP PLC	508.36	508.36	82	11,599	金融
EVRAZ PLC	74.41	74.41	37	5,310	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	17.58	17.58	46	6,556	素材
BAE SYSTEMS PLC	377.96	377.96	187	26,443	資本財・サービス
AVIVA PLC	443.49	510.81	176	24,888	金融
AVEVA GROUP PLC	11.4	11.4	39	5,625	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC	546.29	629.03	877	123,674	ヘルスケア
INFORMA PLC	162	162	88	12,452	コミュニケーション・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	42.04	—	—	—	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC	643.35	643.35	118	16,638	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	144.99	144.99	85	12,081	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	9.38	9.38	51	7,281	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	44.17	62.34	155	21,965	一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7.4	7.4	86	12,140	資本財・サービス
HALMA PLC	39.78	39.78	103	14,549	情報技術
ENTAIN PLC	88.05	88.05	126	17,845	一般消費財・サービス
NMC HEALTH PLC	9.75	—	—	—	その他
JD SPORTS FASHION PLC	64.11	64.11	56	7,980	一般消費財・サービス
M&G PLC	259.64	259.64	51	7,192	金融
RELX PLC	202.6	242.03	452	63,720	資本財・サービス
DIAGEO PLC	266.94	293.51	867	122,302	生活必需品
RIO TINTO PLC	125.42	145.2	899	126,757	素材
STANDARD CHARTERED PLC	297.45	319.51	161	22,822	金融
TESCO PLC	1,093.1	1,344.91	328	46,326	生活必需品
FRESNILLO PLC	—	39.07	46	6,492	素材
SMITH & NEPHEW PLC	112.97	112.97	178	25,108	ヘルスケア
GLENCORE PLC	1,235.14	1,292.26	349	49,275	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	32	52	7,342	金融
SMITHS GROUP PLC	40.8	40.8	63	8,950	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	109.63	168.79	57	8,040	金融
PEARSON PLC	82.71	82.71	55	7,891	コミュニケーション・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額 千イリス・ポンド	邦貨換算金額 千円	
SAINSBURY (J) PLC	176.31	176.31	41	5,876	生活必需品
NEXT PLC	11.59	16.85	128	18,058	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	322.36	53	7,591	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	17.85	17.85	54	7,615	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	31.59	31.59	78	11,055	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	3,034.98	3,591.29	460	64,939	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	17.49	17.49	115	16,323	素材
KINGFISHER PLC	172.29	172.29	48	6,786	一般消費財・サービス
WPP PLC	130.21	130.21	105	14,931	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	82.44	76	10,819	公益事業
SEVERN TRENT PLC	13	43	100	14,181	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	177.58	222.42	119	16,877	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	80.82	91.11	597	84,185	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	48.83	48.83	57	8,103	金融
SCHRODERS PLC	12.27	12.27	43	6,085	金融
SSE PLC	124.6	124.6	198	28,001	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	39.42	—	—	—	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	123.68	86	12,219	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	144.04	166.08	1,254	176,865	ヘルスケア
FERGUSON PLC	27.24	27.24	249	35,190	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	682.32	682.32	187	26,484	金融
3I GROUP PLC	132.93	132.93	153	21,676	金融
ASHTED GROUP PLC	59.21	59.21	216	30,459	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	97.25	115.48	67	9,443	情報技術
NATIONAL GRID PLC	357.13	451.05	395	55,789	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,349.13	8,652.13	312	44,100	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	125.86	125.86	85	12,033	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	102.29	137.85	222	31,299	生活必需品
CENTRICA PLC	680.02	—	—	—	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	19.63	19.63	91	12,828	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	255.03	286.95	797	112,410	生活必需品
BHP GROUP PLC	261.42	269.34	582	82,166	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	49.64	49.64	110	15,531	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	2,333.46	2,560.05	1,045	147,284	金融
ANGLO AMERICAN PLC	107.45	146.45	403	56,937	素材
MONDI PLC	59.21	59.21	109	15,450	素材
WIM MORRISON SUPERMARKETS	391.67	391.67	71	10,115	生活必需品
CARNIVAL PLC	13.83	—	—	—	一般消費財・サービス
EASYJET PLC	16.44	—	—	—	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC	164.81	219.92	310	43,703	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	25.69	49.69	139	19,665	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	856.24	1,317.54	188	26,498	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	25.74	25.74	60	8,525	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	51.36	51.36	92	13,076	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	21.82	21.82	103	14,573	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	15.92	18.97	108	15,298	資本財・サービス
ITV PLC	275.87	—	—	—	コミュニケーション・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	34.41	37.5	345	48,645	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	477.42	495.26	724	102,078	エネルギー

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	428.67	482.46	679	95,700	千イリス・ポンド	千円	エネルギー
MEGGITT PLC	99.25	-	-	-	-	-	資本財・サービス
G4S PLC	113.2	-	-	-	-	-	資本財・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	-	20.39	54	7,635	-	-	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	15.7	46	6,582	-	-	金融
ANTOFAGASTA PLC	34.6	34.6	53	7,561	-	-	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	330.46	330.46	98	13,888	-	-	金融
EXPERIAN PLC	93.19	121.19	343	48,389	-	-	資本財・サービス
イギリス・ポンド 通貨計	33,125.03 93銘柄	36,870.13 84銘柄	-21,091	2,972,663	-	-	< 4.4% >
<b>(イスラエル)</b>	百株	百株	千イスラエル・シケル	千円			
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	120	120	158	5,199	-	-	金融
AZRIELI GROUP LTD	5.3	5.3	115	3,778	-	-	不動産
ICL GROUP LTD	110.96	110.96	196	6,451	-	-	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	3	3	124	4,099	-	-	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	151.6	151.6	350	11,508	-	-	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	190.43	190.43	379	12,467	-	-	金融
NICE LTD	8	8	692	22,745	-	-	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	-	38.83	306	10,062	-	-	金融
イスラエル・シケル 通貨計	589.29 7銘柄	628.12 8銘柄	2,323	76,313	-	-	< 0.1% >
<b>(スイス)</b>	百株	百株	千スイス・フラン	千円			
DUFREY AG-REG	8.3	-	-	-	-	-	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	425.77	464.78	626	73,305	-	-	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1.3	1.3	111	13,014	-	-	素材
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	17.54	105	12,363	-	-	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	76.24	88.76	2,776	325,142	-	-	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	3.89	-	-	-	-	-	金融
SIKA AG-REG	11.4	16.9	431	50,558	-	-	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	0.01	87	10,221	-	-	生活必需品
ABB LTD-REG	206.23	221.39	591	69,265	-	-	資本財・サービス
SWISS RE AG	36.66	36.66	308	36,082	-	-	金融
NESTLE SA-REG	335.45	360.55	3,627	424,701	-	-	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2.34	2.34	245	28,796	-	-	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5.31	5.31	128	15,052	-	-	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	301.22	301.22	366	42,958	-	-	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	21.98	26.84	145	17,020	-	-	金融
SGS SA-REG	0.65	0.65	175	20,541	-	-	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1.53	4.67	113	13,276	-	-	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	6.65	6.65	90	10,554	-	-	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG	7.93	7.93	97	11,374	-	-	情報技術
ALCON INC	42.49	58.53	351	41,188	-	-	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	5	5	122	14,325	-	-	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	14.92	17.92	685	80,321	-	-	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	6.11	6.11	97	11,360	-	-	金融
CLARIANT AG-REG	15.68	15.68	30	3,535	-	-	素材
NOVARTIS AG-REG	234.62	278.51	2,333	273,277	-	-	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.2	0.56	115	13,546	-	-	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMO-A-REG	54.28	67.1	561	65,760	-	-	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	2.76	2.76	131	15,398	-	-	コミュニケーション・サービス

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	-	7.84	75	8,794	千スイス・フラン	千円	金融
GEBERIT AG-REG	4.56	4.56	266	31,245	-	-	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	0.89	1.13	422	49,497	-	-	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1.11	1.11	110	12,945	-	-	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	5.63	6.72	150	17,656	-	-	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	-	21.65	196	23,012	-	-	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	8.55	9.13	540	63,265	-	-	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	4.5	21	2,477	-	-	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	47.7	65.87	341	39,936	-	-	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3.81	3.81	164	19,231	-	-	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4.95	6.4	127	14,916	-	-	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	9.46	81	9,559	-	-	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.17	0.17	143	16,859	-	-	生活必需品
スイス・フラン 通貨計	1,937.79 39銘柄	2,158.02 39銘柄	-17,100	2,002,345	-	-	< 3.0% >
<b>(デンマーク)</b>	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円			
NOVO NORDISK A/S-B	210.28	236.71	10,190	173,643	-	-	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	72.36	72.36	770	13,137	-	-	金融
ISS A/S	13.2	-	-	-	-	-	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.3	0.39	521	8,878	-	-	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	5	5	106	1,814	-	-	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18.57	25.57	3,890	66,293	-	-	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S	-	11.59	536	9,138	-	-	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B	12.32	12.32	1,126	19,200	-	-	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	29.81	29.81	1,069	18,230	-	-	素材
COLOPLAST-B	15.19	15.19	1,367	23,300	-	-	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	27.98	27.98	2,816	47,987	-	-	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	-	1.43	351	5,989	-	-	資本財・サービス
DEMANT A/S	13.14	13.14	298	5,089	-	-	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.66	0.66	951	16,211	-	-	資本財・サービス
TRYG A/S	17	17	337	5,755	-	-	金融
PANDORA A/S	7.5	16.37	1,048	17,869	-	-	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	12.62	12.62	782	13,341	-	-	素材
GENMAB A/S	7.33	9.19	2,338	39,854	-	-	ヘルスケア
ORSTED A/S	22.76	28.37	3,673	62,603	-	-	公益事業
AMBU A/S-B	-	20.91	510	8,697	-	-	ヘルスケア
デンマーク・クローネ 通貨計	486.02 17銘柄	556.61 19銘柄	-32,690	557,038	-	-	< 0.8% >
<b>(ノルウェー)</b>	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円			
NORSK HYDRO ASA	130.5	130.5	536	6,557	-	-	素材
DNB ASA	85.45	128.38	2,134	26,089	-	-	金融
ORKLA ASA	137.84	74.83	639	7,814	-	-	生活必需品
TELENOR ASA	87.46	87.46	1,276	15,603	-	-	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	111.21	142.48	2,233	27,291	-	-	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	27.56	27.56	1,049	12,824	-	-	素材
MOWI ASA	46.77	46.77	885	10,819	-	-	生活必需品
GENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	20	386	4,716	-	-	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	17	17	510	6,232	-	-	コミュニケーション・サービス
AKER BP ASA	13.06	-	-	-	-	-	エネルギー

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
ADEVINTA ASA	—	45.82	621	7,592	コミュニケーション・サービス
株数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	676.85 10銘柄	720.8 10銘柄	10,273	125,542 < 0.2%>	
(スウェーデン)	百株	百株	千円	千円	
ICA GRUPPEN AB	7	26	1,068	13,424	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	403.81	445.95	4,398	55,249	情報技術
VOLVO AB-B SHS	181.58	188.73	3,968	49,850	資本財・サービス
MILICOM INTL CELLULAR-SDR	7.77	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SKF AB-B SHARES	40	40	917	11,520	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	26	26	488	6,129	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	21.88	21.88	1,380	17,335	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	70.26	70.26	792	9,949	コミュニケーション・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	196.97	217.79	1,848	23,212	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	165.26	241.45	2,037	25,589	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	90.75	108.21	1,582	19,881	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	90.39	103.52	1,819	22,851	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	—	82.01	1,231	15,466	素材
SKANSKA AB-B SHS	37.09	37.09	839	10,542	資本財・サービス
SANDVIK AB	132.81	146.57	3,168	39,800	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	62.9	62.9	3,860	48,491	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	76.68	85.75	3,992	50,146	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	25	25	324	4,077	資本財・サービス
TELIA CO AB	364.21	364.21	1,243	15,612	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	48.4	48.4	1,117	14,036	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	38.11	48.13	1,954	24,549	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	108.82	144.49	3,076	38,636	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	—	29	818	10,286	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	—	19	768	9,650	不動産
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	9.48	417	5,248	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	—	9.24	176	2,222	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	—	41.79	1,185	14,890	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB	19	19	450	5,655	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	67.47	72.6	1,888	23,717	生活必需品
BOLIDEN AB	31.71	31.71	983	12,346	素材
EPIROC AB-A	69.82	121.82	1,985	24,939	資本財・サービス
EPIROC AB-B	25	40.15	601	7,549	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS	24	114	1,221	15,342	一般消費財・サービス
NORDEA BANK ABP	435.48	435.48	2,984	37,483	金融
EQT AB	—	38.45	817	10,262	金融
EVOLUTION GAMING GROUP	—	20.64	1,671	20,998	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B	36.41	36.41	1,534	19,273	金融
HEXAGON AB-B SHS	38.68	38.68	2,914	36,611	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13	13	352	4,431	金融
株数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	2,965.74 32銘柄	3,624.79 38銘柄	61,884	777,263 < 1.1%>	
(ユーロ (アイルランド))	百株	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19.95	30.55	122	15,579	素材

銘柄	期首		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIB GROUP PLC	90	—	—	—	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC	102.34	—	—	—	金融
KINGSPAN GROUP PLC	16	16	105	13,372	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A	17.12	18.22	214	27,223	生活必需品
CRH PLC	80.12	105.17	394	50,020	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8.89	22.04	380	48,251	一般消費財・サービス
株数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	334.42 7銘柄	191.98 5銘柄	1,218	154,447 < 0.2%>	
(ユーロ (オランダ))	百株	百株	千ユーロ	千円	
QIAGEN N.V.	25.21	25.21	108	13,737	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	93.09	114.2	514	65,213	ヘルスケア
NN GROUP NV	31	31	112	14,300	金融
HEINEKEN NV	29.1	37.11	340	43,126	生活必需品
AEGON NV	143.61	380.61	132	16,742	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	131.07	138.93	326	41,357	生活必需品
AKZO NOBEL N.V.	25.04	25.04	229	29,092	素材
KONINKLIJKE DSM NV	19.38	22.3	320	40,554	素材
WOLTERS KLUWER	30.97	33	231	29,375	資本財・サービス
ING GROEP NV	432.86	456.01	367	46,532	金融
KONINKLIJKE KPN NV	295.49	376.07	99	12,672	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV	46.53	53.27	2,210	280,095	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA	34.53	90.53	80	10,215	金融
ADYEN NV	1.5	2.15	375	47,532	情報技術
UNILEVER NV	166.82	—	—	—	その他
JUST EAT TAKEAWAY	—	14	140	17,813	一般消費財・サービス
PROSUS NV	54.94	59.99	523	66,324	一般消費財・サービス
VOPAK	6.3	6.3	26	3,338	エネルギー
RANDSTAD NV	20.2	20.2	110	14,043	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	11	12.85	100	12,775	生活必需品
ALTICE EUROPE NV	112.95	112.95	60	7,620	コミュニケーション・サービス
STMICROELECTRONICS NV	74.98	85.75	286	36,274	情報技術
AIRBUS SE	63.45	74.02	664	84,218	資本財・サービス
ARGENX SE	—	5.16	114	14,517	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	44.83	85	74	9,393	生活必需品
EXOR NV	10.88	10.88	71	9,100	金融
CNH INDUSTRIAL NV	116.91	116.91	129	16,356	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	107.87	169.37	243	30,865	一般消費財・サービス
FERRARI NV	14.78	17.22	309	39,226	一般消費財・サービス
株数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	2,145.29 27銘柄	2,576.03 28銘柄	8,304	1,052,417 < 1.6%>	
(ユーロ (ベルギー))	百株	百株	千ユーロ	千円	
GALAPAGOS NV	5.57	5.57	46	5,858	ヘルスケア
UCB SA	19.21	19.21	166	21,082	ヘルスケア
KBC GROUP NV	30.11	30.11	179	22,711	金融
COLRUYT SA	3.5	3.5	17	2,164	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	15.39	11.39	96	12,197	金融
SOLVAY SA	8.73	8.73	88	11,262	素材
UMICORE	16	22.7	100	12,758	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	83.47	98.76	559	70,852	生活必需品
AGEAS	16.54	16.54	75	9,612	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
PROXIMUS	百株	百株	千ユーロ	千円	コミュニケーション・サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	22.69	22.69	38	4,822	
ELIA GROUP SA/INV	4.62	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SOFINA	—	7	69	8,791	公益事業
		2.39	64	8,193	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	225.83 11銘柄	248.59 12銘柄	1,501 190,307 < 0.3%>	
ユーロ (ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AROUNDTOWN SA	160.64	160.64	92	11,661	不動産
ARCELORMITTAL	80.31	80.31	161	20,513	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	1.31	14.8	109	13,834	ヘルスケア
SES	44.02	44.02	33	4,295	コミュニケーション・サービス
TENARIS SA	47	47	32	4,142	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	333.28 5銘柄	346.77 5銘柄	429 54,446 < 0.1%>	
ユーロ (フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA	8.45	—	—	—	コミュニケーション・サービス
TOTAL SE	255.19	307.62	1,135	143,911	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	18.61	21.46	230	29,167	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	52.1	61.19	833	105,617	素材
KERING	8.24	9.77	569	72,196	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	58.92	67.45	855	108,387	資本財・サービス
BOUYGUES SA	18.92	27.21	95	12,113	資本財・サービス
BNP PARIBAS	122.69	134	602	76,384	金融
PEUGEOT SA	64.97	64.97	141	17,891	一般消費財・サービス
NATIXIS	76.74	76.74	21	2,786	金融
THALES SA	14.04	14.04	105	13,380	資本財・サービス
DANONE	64.94	75.51	397	50,411	生活必需品
CARREFOUR SA	80.22	80.22	122	15,579	生活必需品
SUEZ	29.5	29.5	49	6,235	公益事業
VIVENDI	104.3	104.3	272	34,551	コミュニケーション・サービス
L'OREAL	27.41	32.05	977	123,922	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	58.49	69.75	299	37,947	資本財・サービス
LEGRAND SA	30.42	41.19	330	41,927	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	2	—	—	—	生活必需品
PERNOD RICARD SA	26.32	27.44	430	54,526	生活必需品
EURAZEO SE	5.6	5.6	32	4,070	金融
SOCIETE GENERALE SA	80.65	110.65	194	24,592	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	29.88	34.42	1,798	227,873	一般消費財・サービス
ACCOR SA	18.5	18.5	54	6,895	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	16.45	19.81	244	30,954	情報技術
VALEO SA	37.03	37.03	113	14,345	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	29.18	29.18	125	15,901	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA	32.27	32.27	74	9,401	資本財・サービス
EFFAGE	7.5	9.45	74	9,484	資本財・サービス
SODEXO SA	12.48	12.48	93	11,842	一般消費財・サービス
IPSEN	2.76	2.76	19	2,429	ヘルスケア
INGENICO GROUP	4.99	—	—	—	その他

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ORPEA	百株	百株	千ユーロ	千円	ヘルスケア
AMUNDI SA	—	5.24	56	7,208	金融
TELEPERFORMANCE	4.37	4.37	30	3,815	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	8.7	8.7	234	29,779	コミュニケーション・サービス
FAURECIA	9.77	9.77	77	9,845	一般消費財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	5.6	5.6	21	2,724	ヘルスケア
SEB SA	3.99	3.99	118	14,957	一般消費財・サービス
AXA SA	1.97	1.97	29	3,787	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA	31.11	38.09	492	62,439	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA	0.22	0.22	19	2,459	資本財・サービス
WORLDLINE SA	0.22	0.22	19	2,459	情報技術
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	13.3	31.35	234	29,717	一般消費財・サービス
EDENRED	—	22.16	81	10,345	金融
RENAULT SA	231.71	243.18	492	62,406	情報技術
HERMES INTERNATIONAL	30.07	30.07	142	18,101	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	25.54	25.54	92	11,737	一般消費財・サービス
ATOS SE	3.41	4.51	400	50,765	生活必需品
DASSAULT SYSTEMES SE	2.53	2.53	37	4,713	情報技術
WENDEL	9.46	9.46	62	7,977	金融
ORANGE	15.15	16.33	271	34,436	情報技術
ALSTOM	2.01	2.01	20	2,565	金融
CNP ASSURANCES	257.92	257.92	259	32,898	コミュニケーション・サービス
SANOFI	29.61	29.61	139	17,696	資本財・サービス
VINCI SA	13.49	13.49	18	2,309	金融
VEOLIA ENVIRONNEMENT	120.77	142.91	1,132	143,511	ヘルスケア
CREDIT AGRICOLE SA	55.31	69.25	571	72,384	資本財・サービス
BIOMERIEUX	73.51	73.51	159	20,215	公益事業
ENGIE	146.09	146.09	153	19,485	金融
EDF	4.57	4.57	53	6,729	ヘルスケア
SAFRAN SA	210.99	210.99	277	35,201	公益事業
ILIAD SA	67.6	67.6	90	11,492	公益事業
ARKEMA	35.87	43.81	510	64,681	資本財・サービス
ADP	2.19	2.19	36	4,573	コミュニケーション・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8.38	8.38	79	10,080	素材
SCOR SE	3.5	3.5	33	4,231	資本財・サービス
GETLINK SE	14	—	—	—	コミュニケーション・サービス
BOLLORE	32.89	32.89	91	11,537	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,987.76 67銘柄	3,251.09 65銘柄	16,913 2,143,461 < 3.2%>	
ユーロ (ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG	100.78	125.53	640	81,117	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	18	18	48	6,168	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	229.67	255.58	243	30,844	金融
VOLKSWAGEN AG	96.89	96.89	54	6,854	金融
VOLKSWAGEN AG-PREF	4.2	4.2	69	8,867	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	21.21	22.72	329	41,721	一般消費財・サービス
E.ON SE	82.21	94.65	1,173	148,713	資本財・サービス
	276.97	300.06	270	34,307	公益事業

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当		期		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		業 種 等		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千ユーロ	千円			
UNIPER SE	13.8	20.66	63	8,006	公益事業		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	29.21	37.29	258	32,749	一般消費財・サービス		
GEA GROUP AG	13	13	37	4,784	資本財・サービス		
CONTINENTAL AG	11.8	14.74	171	21,724	一般消費財・サービス		
BASF SE	112.83	112.83	762	96,589	素材		
ALLIANZ SE-REG	45.48	53.92	1,096	138,920	金融		
THYSSENKRUPP AG	40.3	-	-	-	素材		
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	18.57	26.83	242	30,791	生活必需品		
RWE AG	75.26	75.26	287	36,462	公益事業		
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	17	17	17	2,188	資本財・サービス		
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	5.6	-	-	-	資本財・サービス		
BRENNTAG AG	14.36	21.21	143	18,181	資本財・サービス		
FRESENIUS SE & CO KGAA	48.35	48.35	188	23,847	ヘルスケア		
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9.59	9.59	34	4,393	コミュニケーション・サービス		
HOCHTIEF AG	1.66	1.66	13	1,699	資本財・サービス		
SAP SE	104.71	130.66	1,385	175,586	情報技術		
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	17.04	17.04	409	51,935	金融		
ZALANDO SE	20.25	20.25	192	24,379	一般消費財・サービス		
HEIDELBERGCEMENT AG	21.28	21.28	142	18,090	素材		
KION GROUP AG	6	6	45	5,713	資本財・サービス		
WIRECARD AG	13.67	-	-	-	情報技術		
COVESTRO AG	19.45	19.45	104	13,246	素材		
SARTORIUS AG-VORZUG	3.05	5.13	182	23,157	ヘルスケア		
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	21.02	21.02	115	14,645	一般消費財・サービス		
DELIVERY HERO SE	10.56	19.79	261	33,193	一般消費財・サービス		
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	5.6	5.6	63	8,047	ヘルスケア		
METRO AG	15	-	-	-	生活必需品		
BECHTLE AG	-	2.73	47	6,033	情報技術		
NEMETSCHKE SE	-	11.39	66	8,379	情報技術		
SCOUT24 AG	-	14.6	94	11,915	コミュニケーション・サービス		
SIEMENS HEALTHINEERS AG	15	40.38	179	22,705	ヘルスケア		
KNORR-BREMSE AG	5.49	5.49	62	7,976	資本財・サービス		
HELLOFRESH SE	-	18.14	114	14,482	一般消費財・サービス		
TEAMVIEWER AG	-	14.61	59	7,554	情報技術		
SIEMENS ENERGY AG	-	47.32	157	19,969	資本財・サービス		
BEIERSDORF AG	12.75	12.75	119	15,165	生活必需品		
FUCHS PETROLUB SE-PREF	7	7	32	4,077	素材		
MERCK KGAA	16.92	16.92	245	31,070	ヘルスケア		
ADIDAS AG	19.8	23.85	696	88,227	一般消費財・サービス		
PUMA SE	12.95	12.95	113	14,425	一般消費財・サービス		
HENKEL AG & CO KGAA	13.11	13.11	103	13,092	生活必需品		
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	363.69	418.6	635	80,581	コミュニケーション・サービス		
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAINLER AG-REGISTERED SHARES	22.71	25.61	176	22,420	ヘルスケア		
INFINEON TECHNOLOGIES AG	98.52	110.27	630	79,864	一般消費財・サービス		
HANNOVER RUECK SE	130.44	164.97	553	70,141	情報技術		
DEUTSCHE POST AG-REG	6.44	6.44	86	10,903	金融		
DEUTSCHE BOERSE AG	106.76	131.16	537	68,066	資本財・サービス		
LANXESS AG	18.04	24.04	329	41,753	金融		
	15.29	15.29	96	12,226	素材		

銘柄	期首		当		期		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		業 種 等		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千ユーロ	千円			
MTU AERO ENGINES AG	6.66	6.66	136	17,319	資本財・サービス		
DEUTSCHE WOHNEN SE	47.96	47.96	200	25,454	不動産		
SYMRISE AG	14.36	16.56	176	22,413	素材		
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	62.4	62.4	14	1,893	コミュニケーション・サービス		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	9	9	48	6,130	一般消費財・サービス		
VONOVIA SE	57.63	71.86	413	52,364	不動産		
LEG IMMOBILIEN AG	-	10.73	129	16,434	不動産		
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,607.29 57銘柄	2,998.98 60銘柄	15,307	1,939,976	< 2.9% >	
ユーロ (ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円			
JERONIMO MARTINS	29	29	42	5,433	生活必需品		
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	275.76	275.76	152	19,388	公益事業		
GALP ENERGIA SGPS SA	71.83	71.83	66	8,391	エネルギー		
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	376.59 3銘柄	376.59 3銘柄	262	33,213	< 0.0% >	
ユーロ (スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円			
TELEFONICA SA	542.59	570.39	202	25,690	コミュニケーション・サービス		
ENDESA SA	21.5	37.6	84	10,688	公益事業		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	711.85	951.66	404	51,268	金融		
IBERDROLA SA	685.24	720.39	894	113,297	公益事業		
BANCO DE SABADELL SA	503.83	-	-	-	金融		
BANKINTER SA	67	-	-	-	金融		
REPSOL SA	176.85	176.85	152	19,355	エネルギー		
GRIFOLS SA	30.04	51.14	120	15,314	ヘルスケア		
BANCO SANTANDER SA	1,775.93	2,073.7	582	73,846	金融		
AMADEUS IT GROUP SA	50.48	54	303	38,487	情報技術		
NATURGY ENERGY GROUP SA	39.78	39.78	80	10,158	公益事業		
MAPFRE SA	80.05	-	-	-	金融		
CAIXABANK SA	468.59	468.59	107	13,634	金融		
ACS ACTIVIDADES CONIS Y SERV	35.83	35.83	100	12,773	資本財・サービス		
AENA SME SA	8.66	8.66	120	15,244	資本財・サービス		
CELLNEX TELECOM SA	20.96	45.46	220	27,987	コミュニケーション・サービス		
IBERDROLA SA - RTS	685.24	-	-	-	公益事業		
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	117.54	142.55	373	47,367	一般消費財・サービス		
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	17.93	17.93	66	8,443	資本財・サービス		
ENAGAS SA	36.75	36.75	66	8,453	公益事業		
RED ELECTRICA CORPORACION SA	40.56	51.47	83	10,615	公益事業		
FERROVIAL SA	60.55	60.55	131	16,636	資本財・サービス		
BANKIA SA	159.05	-	-	-	金融		
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	6,336.8 23銘柄	5,543.3 18銘柄	4,097	519,261	< 0.8% >	
ユーロ (イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円			
PRYSMIAN SPA	41.45	41.45	126	16,042	資本財・サービス		
ASSICURAZIONI GENERALI	117.33	159.85	230	29,211	金融		
MEDIOBANCA SPA	99.71	99.71	74	9,464	金融		
UNICREDIT SPA	294.71	294.71	236	30,013	金融		
TELECOM ITALIA SPA	1,085.03	1,085.03	42	5,332	コミュニケーション・サービス		
TELECOM ITALIA-RSP	483.81	483.81	20	2,638	コミュニケーション・サービス		

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
INTESA SANPAOLO	1,354.57	2,135.25	414	52,572	金融
ATLANTIA SPA	60.27	60.27	83	10,639	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	77.27	77.27	65	8,356	金融
MONCLER SPA	15.22	24.35	116	14,812	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	6.92	12.85	55	6,976	ヘルスケア
ENI SPA	286.21	360.61	323	41,029	エネルギー
PIRELLI & C SPA	56.51	-	-	-	一般消費財・サービス
DIASORIN SPA	-	2.77	44	5,599	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	-	24.14	23	2,921	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA	-	35.53	55	7,076	情報技術
AMPLIFON SPA	-	17.5	58	7,469	ヘルスケア
LEONARDO SPA	66.76	-	-	-	資本財・サービス
ENEL SPA	889.57	983.37	879	111,512	公益事業
SNAM SPA	243	243	112	14,301	公益事業
TERNA SPA	199	199	123	15,666	公益事業
FINCOBANK SPA	59.72	59.72	82	10,395	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,437.06 18銘柄	6,400.19 20銘柄	3,172 402,030 < 0.6%>	
ユーロ (フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ	65.25	65.25	204	25,898	素材
NOKIA OYJ	652.61	652.61	205	26,014	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	41.16	41.16	35	4,461	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	88.53	88.53	144	18,332	素材
NELES OYJ	11.08	-	-	-	資本財・サービス
ELISA OYJ	13	17.34	79	10,119	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS	49.34	68.09	235	29,787	金融
FORTUM OYJ	44	44	93	11,860	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	-	51.25	109	13,821	生活必需品
KONE OYJ-B	38.6	45.43	302	38,366	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ	17.7	-	-	-	一般消費財・サービス
NESTE OYJ	48.49	57.78	355	45,033	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	17.63	17.63	65	8,360	ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,087.39 12銘柄	1,149.07 11銘柄	1,831 232,057 < 0.3%>	
ユーロ (オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
VERBUND AG	12.16	12.16	91	11,604	公益事業
OMV AG	12.09	12.09	44	5,598	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	27.5	34.89	90	11,522	金融
VOESTALPINE AG	18	18	55	6,987	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	11	11	19	2,442	金融
ANDRITZ AG	5.5	-	-	-	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	86.25 6銘柄	88.14 5銘柄	301 38,154 < 0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	21,957.96 236銘柄	23,170.73 232銘柄	53,339 6,759,775 <10.0%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	122,269.89 1,242銘柄	134,609.2 1,208銘柄	- 61,647,123 <91.1%>	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	口数	口数	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.679	1.679	264	27,541	
SIMON PROPERTY GROUP INC	3.433	4.233	351	36,681	
BOSTON PROPERTIES INC	1.556	2.356	211	22,000	
VORNADO REALTY TRUST	2.128	2.128	75	7,822	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1.28	1.501	390	40,733	
EQUITY RESIDENTIAL	4.248	5.245	304	31,735	
EQUINIX INC	0.944	1.081	737	76,886	
AMERICAN TOWER CORP	4.869	5.555	1,193	124,438	
HOST HOTELS & RESORTS INC	6.228	12.228	175	18,314	
KIMCO REALTY CORP	3.3	-	-	-	
INVITATION HOMES INC	6.081	6.976	202	21,122	
VICI PROPERTIES INC	5.464	5.464	138	14,431	
VENTAS INC	3.702	4.401	203	21,192	
WEYERHAEUSER CO	7.435	8.683	287	29,956	
AGNC INVESTMENT CORP	7.559	7.559	116	12,117	
CROWN CASTLE INTL CORP	4.614	5.102	780	81,394	
IRON MOUNTAIN INC	3.474	3.474	97	10,138	
VEREIT INC	13.632	2.726	95	9,958	
SUN COMMUNITIES INC	1.214	1.214	174	18,236	
PROLOGIS INC	7.007	9.436	893	93,099	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.2	1.648	271	28,302	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1.177	1.177	113	11,778	
DUKE REALTY CORP	4.971	4.971	190	19,865	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.771	0.771	178	18,585	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.974	-	-	-	
WELLTOWER INC	4.572	4.901	299	31,252	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6.434	6.434	183	19,092	
LIBERTY PROPERTY TRUST	2.058	-	-	-	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.1	1.714	212	22,190	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1.95	1.95	117	12,290	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15.632	15.632	127	13,327	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1.552	-	-	-	
REALTY INCOME CORP	3.348	4.587	272	28,408	
PUBLIC STORAGE	1.75	2.105	465	48,543	
REGENCY CENTERS CORP	1.939	1.939	85	8,896	
SL GREEN REALTY CORP	0.65	-	-	-	
UDR INC	2.965	4.752	176	18,350	
WVP CAREY INC	1.6	2.702	179	18,691	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2.164	2.164	76	7,932	
DIGITAL REALTY TRUST INC	2.269	3.415	448	46,724	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1.072	1.797	200	20,856	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	4.197	8.597	179	18,682	
アメリカ・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	154,192 42銘柄	162,297 37銘柄	10,472 1,091,576 <1.6%>	
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	2	-	-	-	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1.6	1.6	79	6,476	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2	-	-	-	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1.4	1.4	23	1,955	
カナダ・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	7 4銘柄	3 2銘柄	103 8,432 <0.0%>	

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末	
	口数	口数	評価額	評価額
(オーストラリア)	千口	千口	千円	千円
LENLEASE GROUP	4.303	4.303	56	4,525
TRANSURBAN GROUP	31.468	33.406	436	35,104
SYDNEY AIRPORT	9.129	9.129	57	4,583
APA GROUP	14.243	14.243	139	11,225
SCENTRE GROUP	64.017	64.017	179	14,400
DEXUS	13.949	13.949	125	10,085
GPT GROUP	30.647	30.647	134	10,808
MIRVAC GROUP	61.117	61.117	157	12,619
STOCKLAND	18.729	18.729	77	6,214
GOODMAN GROUP	20.198	20.198	365	29,338
VICINITY CENTRES	50.371	50.371	78	6,272
オーストラリア・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	318.171 11銘柄	320.109 11銘柄	1,807 <0.2%>
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT	24	32	2,236	30,062
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	52	52	400	5,381
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34	34	335	4,510
香港ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	110 3銘柄	118 3銘柄	2,972 <0.1%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	28	—	—	—
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30.5	30.5	92	7,265
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	31.5	51.66	116	9,148
SUNTEC REIT	26	26	39	3,076
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	—	46	92	7,245
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	37.6	37.6	81	6,423
シンガポール・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	153.6 5銘柄	191.76 5銘柄	423 <0.0%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	10.295	10.295	67	9,548
SEGRO PLC	13.286	13.286	126	17,882
BRITISH LAND CO PLC	14.58	14.58	65	9,288
イギリス・ポンド 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	38.161 3銘柄	38.161 3銘柄	260 <0.1%>
(ユーロ (フランス))	千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1.751	1.751	109	13,900
ICADE	0.406	—	—	—
GECINA SA	0.578	0.578	71	9,046
KLEPIERRE	2.394	2.394	44	5,609
COVIVIO	0.353	0.353	26	3,312
ユーロ通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	5.482 5銘柄	5.076 4銘柄	251 <0.0%>
合計	口数、金額 銘柄数<比率>	786.606 73銘柄	838.403 65銘柄	— <2.0%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
外	百万円	百万円
S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	3,814	—
S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	225	—
SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	186	—
HANG SENG IDX FUT (香港)	37	—
FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	295	—
SWISS MKT IX FUT (スイス)	189	—
EURO STOXX 50 (ドイツ)	585	—
国		

(注1) 外貨建の評価額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2021年1月12日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 61,647,123	% 90.3
投資信託証券	1,386,889	2.0
コール・ローン等、その他	5,233,490	7.7
投資信託財産総額	68,267,503	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、1月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=104.23円、1カナダ・ドル=81.56円、1オーストラリア・ドル=80.34円、1香港ドル=13.44円、1シンガポール・ドル=78.36円、1ニュージーランド・ドル=74.76円、1イギリス・ポンド=140.94円、1イスラエル・シケル=32.85円、1スイス・フラン=117.09円、1デンマーク・クローネ=17.04円、1ノルウェー・クローネ=12.22円、1スウェーデン・クローネ=12.56円、1ユーロ=126.73円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (64,274,219千円) の投資信託財産総額 (68,267,503千円) に対する比率は、94.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年1月12日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>130,640,893,085円</b>
コール・ローン等	4,048,123,263
株式(評価額)	61,647,123,188
投資信託証券(評価額)	1,386,889,965
未収入金	62,511,377,805
未収配当金	58,301,845
差入委託証拠金	989,077,019
<b>(B) 負債</b>	<b>62,961,779,555</b>
未払金	62,960,069,555
未払解約金	1,710,000
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>67,679,113,530</b>
元本	27,480,973,178
次期繰越損益金	40,198,140,352
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>27,480,973,178口</b>
<b>1万口当り基準価額(C/D)</b>	<b>24,628円</b>

\* 期首における元本額は24,932,860,048円、当作成期間中における追加設定元本額は11,073,895,044円、同解約元本額は8,525,781,914円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、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) 20,166,452,741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) 1,352,817,336円、i F r e e 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 931,749,730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) 5,029,953,371円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,628円です。

■損益の状況

当期 自2020年1月11日 至2021年1月12日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>987,064,309円</b>
受取配当金	986,536,948
受取利息	134,329
その他収益金	1,219,904
支払利息	△ 826,872
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>7,925,754,908</b>
売買益	16,493,607,249
売買損	△ 8,567,852,341
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>372,892,882</b>
取引益	1,583,340,597
取引損	△ 1,210,447,715
<b>(D) その他費用</b>	<b>△ 13,887,514</b>
<b>(E) 当期損益金(A + B + C + D)</b>	<b>9,271,824,585</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>28,973,475,897</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△ 9,111,378,086</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>11,064,217,956</b>
<b>(I) 合計(E + F + G + H)</b>	<b>40,198,140,352</b>
<b>次期繰越損益金(I)</b>	<b>40,198,140,352</b>

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

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

## 運用報告書 (全体版) 第5期

(決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式	
信託期間	無期限	
運用方針	海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	イ. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券 ロ. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券
	外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式 (預託証券を含みます。)
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	イ. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式 (上場予定および店頭登録予定を含みます。) ロ. 新興国の企業のDR (預託証券) ハ. FTSE RAFI エマージングインデックスとの連動をめざすETF (上場投資信託証券)
組入制限	ベビーファンドのマザーファンドの株式組入上限比率 外国株式インデックスマザーファンドの株式組入上限比率 ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの株式組入上限比率	無制限
分配方針	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、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、海外の株価指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

### 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先 (コールセンター)  
TEL 0120-106212  
(営業日の9:00～17:00)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	投 信 託 証 券 率 組 入 比	純 資 産 額 総
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率				
1 期末(2017年11月30日)	円 11,391	円 0	% 13.9	% 93.0	% 1.5	% 4.5	百万円 915
2 期末(2018年11月30日)	11,550	0	1.4	92.1	2.0	5.0	1,637
3 期末(2019年12月 2 日)	12,622	0	9.3	90.2	5.5	3.4	1,845
4 期末(2020年11月30日)	13,420	0	6.3	92.7	4.3	2.5	2,513
5 期末(2021年11月30日)	17,840	0	32.9	89.2	6.8	3.3	2,628

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注3) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

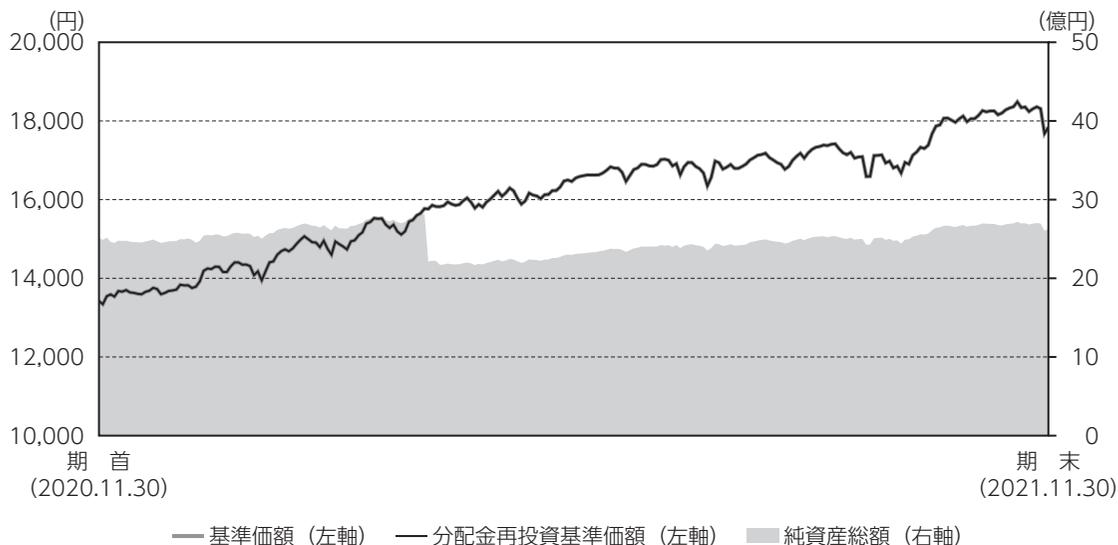
(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注5) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



\*分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

\*分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：13,420円

期末：17,840円（分配金0円）

騰落率：32.9%（分配金込み）

#### ■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国株式インデックスマザーファンド	36.9%	80.3%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	20.9%	18.9%

#### ■ 基準価額の主な変動要因

海外の株式市場の動きを反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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)

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率 株 比	株 式 先 物 率 株 比	投 信 組 託 入 証 比	資 券 率
	騰 落 率	騰 落 率				
(期首) 2020年11月30日	円 13,420	% -	% 92.7	% 4.3	% 2.5	% 2.5
12月末	13,819	3.0	93.3	3.3	2.6	2.6
2021年 1 月末	14,176	5.6	91.9	4.2	3.1	3.1
2 月末	14,748	9.9	90.9	4.9	3.3	3.3
3 月末	15,598	16.2	90.6	6.4	1.9	1.9
4 月末	16,211	20.8	93.0	3.9	2.4	2.4
5 月末	16,498	22.9	91.8	4.5	2.9	2.9
6 月末	16,849	25.6	89.8	6.4	3.0	3.0
7 月末	16,892	25.9	91.5	5.5	2.2	2.2
8 月末	17,276	28.7	90.3	6.3	2.9	2.9
9 月末	16,979	26.5	90.5	5.6	3.0	3.0
10月末	18,056	34.5	90.2	5.9	3.2	3.2
(期末) 2021年11月30日	17,840	32.9	89.2	6.8	3.3	3.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■先進国株式市況

先進国株式市況は上昇しました。

先進国株式市況は、当作成期首より、米国大統領選挙の不透明感が解消されたことや新型コロナウイルスのワクチン開発への期待を受け、上昇しました。2021年2月以降は、米国においてウイルスの新規感染者数の減少傾向が鮮明となったことに加え、ワクチン接種が着実に進んでいることが投資家心理を改善させ、上昇基調となりました。9月に入ると、米国や中国における経済指標の悪化をきっかけに軟調となり、その後も、中国の大手不動産会社の資金繰り問題や米国の債務上限問題、米国金利の上昇に対する警戒感など複数のリスク要因が嫌気され、株価は下落しました。10月中旬以降は、米国の債務上限の一時引き上げが決定されたことなどが好感されて反発し、上昇して当作成期末を迎えました。

### ■先進国為替相場

先進国為替相場は、当作成期を通して見ると円安が進みました。

先進国為替相場は、当作成期首より、米国において民主党が大統領府および議会上下両院を制したことから、株価が上昇するなど市場のリスク選好姿勢が強まり、円安となりました。2021年3月には、米国での追加経済対策の成立や、経済指標の改善により米国金利が上昇したことなどを背景に米ドルが買い進められ、全般的に円安が進行しました。7月以降は、新型コロナウイルスの新規感染者数の増加を受けた景気への懸念などを受け、円高が進みました。9月以降は、日本以外の各国で利上げ観測が高まり、金融政策の方向性の違いを要因として、円安となりました。

### ■新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

新興国株式市況は、当作成期首より、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通りの当選確実となり、選挙に対する不確実性が後退したことや、米国での大規模経済対策などの政策期待から上昇しました。2021年1月末からは、金利上昇に伴い軟調な展開となる場面も散見されたものの、経済活動の正常化期待から上昇しました。その後も、中国における規制強化懸念や新興国における新型コロナウイルスの感染状況により下落する局面もありましたが、上昇基調で推移しました。当作成期末にかけては、ウイルスの新変異株への警戒感が広がったことなどから、株価は下落基調となりました。

### ■新興国為替相場

新興国通貨の為替相場は、対米ドルおよび対円で上昇（円安）しました。

新興国の為替相場は、当作成期首より、市場のリスク選好的な姿勢が強まり、多くの新興国通貨は対米ドル、対円ともに上昇しました。その後は、経済指標の改善によって米国金利が上昇したことなどから米ドル高となりましたが、対円では新興国通貨も上昇しました。2021年4月以降は、米ドルの下落が新興国通貨の上昇圧力となりました。7月以降は、新型コロナウイルスの動向、米国の物価ならびに

金融政策の動向などに反応しながらも、新興国通貨は対米ドルでは一定の範囲内で推移しました。当作成期を通じて、円は全面的に下落して推移したため、新興国通貨は対円で上昇して推移しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

今後の運用にあたりましては、引き続き、海外の株価指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ってまいります。

### ■外国株式インデックスマザーファンド

今後の運用にあたりましては、引き続き、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

### ■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

今後の運用にあたりましては、引き続き、主として新興国の株式（D R（預託証券）を含む。）に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行うことを基本とします。また、効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすE T F（上場投資信託証券）にも一部投資します。なお、株式およびE T Fの組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。さらに、リバランス時等に、株式実質組入比率の維持を目的に株価指数先物取引の利用も検討します。

## ポートフォリオについて

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■当ファンド

「外国株式インデックスマザーファンド」の受益証券を80%程度、「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の受益証券を20%程度組み入れました。

### ■外国株式インデックスマザーファンド

外国株式を中心に組み入れ、S & P 500先物取引等の株価指数先物も一部利用し、株式組入比率（投資信託証券、株価指数先物を含む。）につきましては、当作成期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。

外国株式等のポートフォリオ構築にはリスクモデルを利用し、ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

## ■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら運用を行いました。

ポートフォリオ構築にあたっては、FTSE RAFI エマージング インデックスの組入比率上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、DR（預託証券）等の組み入れを行いました。また、効率性の観点からETF（上場投資信託証券）および株価指数先物を利用し、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

\*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
外国株式インデックスマザーファンド	MSCIコクサイ指数（円ベース）
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

## ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2020年12月1日 ～2021年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	7,839

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

今後の運用にあたりましては、引き続き、海外の株価指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ってまいります。

### ■外国株式インデックスマザーファンド

今後の運用にあたりましては、引き続き、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

### ■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020.12.1~2021.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	56円	0.346%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は16,103円です。
(投 信 会 社)	(43)	(0.269)	投信会社分は、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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(9)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(4)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	3	0.019	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(2)	(0.013)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(1)	(0.003)	
有 価 証 券 取 引 税	2	0.012	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(2)	(0.012)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
そ の 他 費 用	10	0.063	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(6)	(0.035)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(4)	(0.022)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	71	0.440	

(注1) 当作成期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

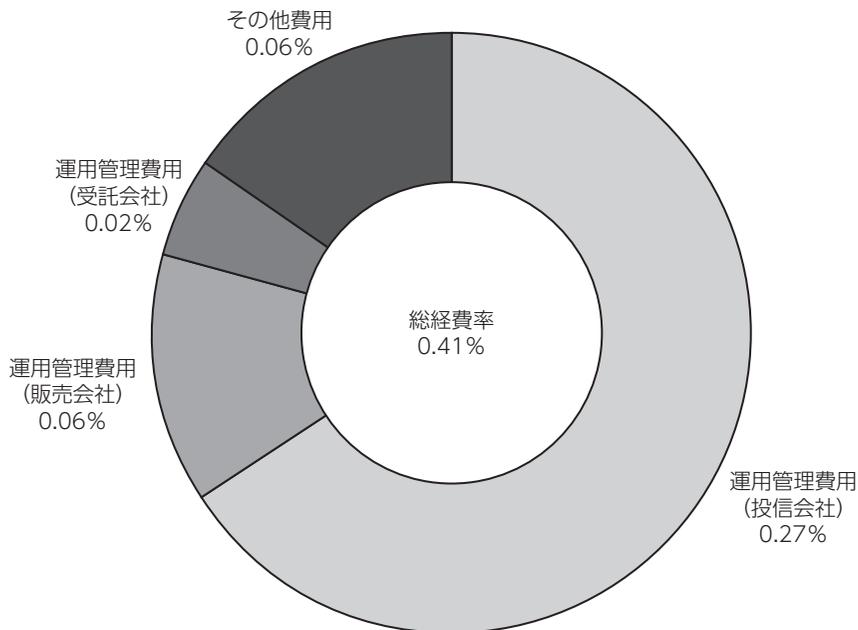
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.41%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

項目	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国株式ファン ダメンタル・インデック ス・マザーファンド	65,944	120,440	127,577	223,410
外国株式インデック スマザーファンド	73,174	258,910	222,071	768,110

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

項 目	当 期
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	7,551,579千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	13,179,387千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.57
	外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	26,340,718千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	196,027,709千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.13

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド	331,827	270,194	497,292			
外国株式インデックスマザーファンド	662,541	513,644	2,110,820			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド	497,292	18.9
外国株式インデックスマザーファンド	2,110,820	80.1
コール・ローン等、その他	27,262	1.0
投資信託財産総額	2,635,375	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1香港ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.21円、1ニュージーランド・ドル=77.53円、1台湾ドル=4.094円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シェケル=36.011円、1スイス・フラン=123.25円、1トルコ・リラ=8.926円、1デンマーク・クローネ=17.27円、1ノルウェー・クローネ=12.61円、1スウェーデン・クローネ=12.53円、1メキシコ・ペソ=5.252円、100チリ・ペソ=13.505円、1サウジアラビア・リアル=30.37円、1インド・ルピー=1.53円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1ブラジル・レアル=20.288円、1オフショア人民元=17.83円、1マレーシア・リンギット=26.851円、1南アフリカ・ランド=7.05円、1タイ・バーツ=3.38円、1ユーロ=128.41円です。

(注3) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(15,538,914千円)の投資信託財産総額(16,218,281千円)に対する比率は、95.8%です。外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(241,345,626千円)の投資信託財産総額(250,978,162千円)に対する比率は、96.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,635,375,847円
コール・ローン等	27,262,842
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド(評価額)	497,292,272
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	2,110,820,733
(B) 負債	6,426,476
未払解約金	2,014,805
未払信託報酬	4,342,828
その他未払費用	68,843
(C) 純資産総額(A - B)	2,628,949,371
元本	1,473,643,378
次期繰越損益金	1,155,305,993
(D) 受益権総口数	1,473,643,378口
1万口当り基準価額(C / D)	17,840円

\* 期首における元本額は1,873,069,139円、当作成期間中における追加設定元本額は415,335,713円、同解約元本額は814,761,474円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は17,840円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月1日 至2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 6,005円
受取利息	930
支払利息	△ 6,935
(B) 有価証券売買損益	569,018,228
売買益	712,825,028
売買損	△ 143,806,800
(C) 信託報酬等	△ 8,761,527
(D) 当期損益金(A + B + C)	560,250,696
(E) 前期繰越損益金	240,199,677
(F) 追加信託差損益金	354,855,620
(配当等相当額)	( 240,333,321)
(売買損益相当額)	( 114,522,299)
(G) 合計(D + E + F)	1,155,305,993
次期繰越損益金(G)	1,155,305,993
追加信託差損益金	354,855,620
(配当等相当額)	( 240,333,321)
(売買損益相当額)	( 114,522,299)
分配準備積立金	800,456,378
繰越損益金	△ 6,005

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	560,252,154
(c) 収益調整金	354,855,620
(d) 分配準備積立金	240,204,224
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	1,155,311,998
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	1,155,311,998
(h) 受益権総口数	1,473,643,378口

<補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の決算日（2021年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年11月30日）現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

買				付				売				付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
ALIBABA GROUP HOLDING LTD (ケイマン諸島)	95.1	313,294	3,294	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	155	354,624	2,287	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR (ケイマン諸島)	8.5	225,640	26,545	CHINA MOBILE LTD (香港)	282	177,806	630
HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	434	209,605	482	JD.COM INC-ADR (ケイマン諸島)	11.3	100,740	8,915	BAIDU INC - SPON ADR (ケイマン諸島)	3	85,509	28,503	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル)	273.5	126,690	463
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	243.1	132,773	546	VALE SA (ブラジル)	46	83,384	1,812	PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	256.6	116,640	454	CNOOC LTD (香港)	773	81,115	104
PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	273.5	126,690	463	MEDIA TEK INC (台湾)	22	75,353	3,425	IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	1,430	111,187	77	PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)	73	97,270	1,332
BANCO BRADESCO SA-PREF (ブラジル)	197.1	102,330	519	UNITED MICROELECTRONICS CORP (台湾)	410	73,223	178	PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)	73	97,270	1,332	JD.COM INC - CL A (ケイマン諸島)	14.4	59,674	4,144
SBERBANK PJSC - SPONSORED ADR (ロシア)	53.177	90,355	1,699	CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	738	67,886	91	SBERBANK PJSC - SPONSORED ADR (ロシア)	53.177	90,355	1,699				
JD.COM INC - CL A (ケイマン諸島)	14.4	59,674	4,144												

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

買				付				売				付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	1,285.6	3,197,230	2,486	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	948.6	2,409,841	2,540	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	100.4	12,867	128	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)	76.93	7,549	98

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2021年11月30日現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド(8,761,904千円)の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	株数	2021年11月30日現在		業種等	銘柄	株数	2021年11月30日現在		業種等
		評価額	外貨建金額				評価額	外貨建金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円			百株	千アメリカ・ドル	千円	
JOYY INC-ADR	10	52	6,007	コミュニケーション・サービス	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	169.93	492	55,988	素材
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	52	11	1,277	一般消費財・サービス	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	206.94	331	37,716	生活必需品
SURGUTNEFTGAZ-SP ADR PREF	290	147	16,793	エネルギー	SBERBANK PJSC - SPONSORED ADR	1,569.77	2,641	300,571	金融
BAIDU INC - SPON ADR	28	420	47,875	コミュニケーション・サービス	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	24.98	547	62,239	エネルギー
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	56	54	6,154	一般消費財・サービス	LUKOIL PJSC-SPON ADR	202.88	1,793	204,088	エネルギー
CANADIAN SOLAR INC	23	89	10,220	情報技術	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	912.99	697	79,315	エネルギー
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	34	105	11,983	資本財・サービス	GAZPROM PJSC-SPON ADR	3,923.39	3,545	403,334	エネルギー
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	353.5	285	32,495	コミュニケーション・サービス	SEVERSTAL - GDR REG S	134.6	291	33,199	素材
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	93	252	28,694	一般消費財・サービス	TATNEFT PJSC - PREF	155.09	91	10,360	エネルギー
VTB BANK JSC -GDR-REG S	1,912.17	232	26,497	金融	SISTEMA PJSC	3,192	106	12,149	コミュニケーション・サービス
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	72.9	213	24,251	素材	INTER RAO UES PJSC	27,261	157	17,894	公益事業
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	96.08	362	41,297	エネルギー	ALROSA PJSC	1,803.1	301	34,310	素材
SURGUTNEFTGAZ-SP ADR	360.75	183	20,870	エネルギー	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	566.19	115	13,084	金融

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
AEROFLOT PJSC	1,649.1	134	15,325	資本財・サービス	
アメリカ・ドル 通貨計	45,153.36 27銘柄	13,659 < 銘柄数 >	1,553,999 < 9.6% >		
(香港)	百株	千香港ドル	千円		
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	4,600	1,720	25,100	資本財・サービス	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	620	750	10,945	資本財・サービス	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	780	1,868	27,255	一般消費財・サービス	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	510	652	9,524	素材	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	492	863	12,605	公益事業	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	20,798	7,320	106,811	エネルギー	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,460	1,790	26,128	一般消費財・サービス	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	3,540	237	3,460	一般消費財・サービス	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	290	1,097	16,014	資本財・サービス	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	715	617	9,002	資本財・サービス	
TENCENT HOLDINGS LTD	215	9,941	145,047	コミュニケーション・サービス	
AIR CHINA LTD-H	1,100	554	8,088	資本財・サービス	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	605	553	8,076	不動産	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	2,580	603	8,808	不動産	
PETROCHINA CO LTD-H	20,520	6,997	102,090	エネルギー	
HUANGSHENG GROUP HOLDINGS	155	1,007	14,699	一般消費財・サービス	
ZHONENING POWER INTL INC-H	6,120	2,111	30,805	公益事業	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	355	1,292	18,853	素材	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,050	1,722	25,123	公益事業	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	47,080	23,869	348,256	金融	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	1,242	1,366	19,932	金融	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	7,040	2,386	34,819	金融	
GF SECURITIES CO LTD-H	500	691	10,081	金融	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	484	550	8,036	金融	
MEANGAN INTL GROUP CO LTD	275	1,060	15,467	生活必需品	
POSTAL SAVINGS BANK OF CH-H	4,750	2,569	37,492	金融	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	760	337	4,923	資本財・サービス	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,450	4,052	59,123	エネルギー	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1,091.2	902	13,166	ヘルスケア	
SINOPHARM GROUP CO-H	1,028	1,885	27,507	ヘルスケア	
CHINA RESOURCES LAND LTD	1,100	3,773	55,048	不動産	
YANZHOU COAL MINING CO-H	1,820	2,224	32,448	エネルギー	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,285	724	10,573	ヘルスケア	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	220	916	13,368	公益事業	
BYD CO LTD-H	50	1,511	22,045	一般消費財・サービス	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	25,230	6,559	95,707	金融	
CHINA RESOURCES CEMENT	820	473	6,903	素材	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	254	265	3,868	金融	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	358	762	11,125	金融	
PEOPLES INSURANCE CO GROU-H	3,900	904	13,201	金融	
CITIC LTD	2,150	1,539	22,459	資本財・サービス	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,165	871	12,714	素材	
IND & COMM BK OF CHINA-H	54,900	22,838	333,212	金融	
CHINA TOWER CORP LTD-H	16,760	1,676	24,452	コミュニケーション・サービス	
MEITUAN-CLASS B	52	1,274	18,587	一般消費財・サービス	
SEAZEN GROUP LTD	1,240	698	10,185	不動産	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	951	12,363	180,376	一般消費財・サービス	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	860	932	13,601	公益事業	
JD.COM INC - CL A	144	5,048	73,659	一般消費財・サービス	
NETEASE INC	135	2,413	35,217	コミュニケーション・サービス	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	2,150	425	6,210	資本財・サービス	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	250	718	10,486	一般消費財・サービス	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	3,180	5,819	84,905	不動産	
CGN POWER CO LTD-H	4,570	977	14,268	公益事業	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,940	10,776	157,232	金融	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1,040	1,460	21,303	不動産	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	760.5	979	14,291	資本財・サービス	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	7,335.8	2,222	32,489	金融	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2,440	1,705	24,884	不動産	

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千香港ドル	千円		
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	60	737	10,758	一般消費財・サービス	
CHINA VANKE CO LTD-H	899	1,632	23,819	不動産	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	2,900	536	7,827	素材	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	960	744	10,854	一般消費財・サービス	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	64	972	14,193	一般消費財・サービス	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	330	1,508	22,003	生活必需品	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	3,600	2,448	35,716	金融	
GETC WALL MOTOR COMPANY-H	415	1,384	20,192	一般消費財・サービス	
WEICHAI POWER CO LTD-H	560	773	11,291	資本財・サービス	
SUNNY OPTICAL TECH	37	879	12,826	情報技術	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	2,920	1,109	16,189	素材	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	882	2,041	29,790	金融	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	606	873	12,749	ヘルスケア	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,950	2,550	37,213	金融	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	132	1,980	28,888	公益事業	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	660	586	8,560	素材	
KUNLUN ENERGY CO LTD	2,020	1,484	21,661	公益事業	
ZUIJIN MINING GROUP CO LTD-H	620	634	9,262	素材	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	1,280	998	14,566	資本財・サービス	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,680	2,318	33,822	金融	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	8,521	3,962	57,809	金融	
CHINA EVERGRANDE GROUP	1,420	323	4,723	不動産	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	1,980	520	7,597	金融	
CHINA MERCHANTS BANK-H	1,010	6,155	89,815	金融	
BANK OF CHINA LTD-H	33,500	9,145	133,432	金融	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	440	802	11,709	金融	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LH	2,400	650	9,489	金融	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	1,272	835	12,192	金融	
BRIILLANCE CHINA AUTOMOTIVE	940	686	10,011	一般消費財・サービス	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	580	2,238	32,664	不動産	
香港・ドル 通貨計	346,903.5 89銘柄	225,747 < 銘柄数 >	3,293,656 < 20.4% >		
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円		
YANGZHIJIANG SHIPBUILDING	1,427	185	15,436	資本財・サービス	
シンガポール・ドル 通貨計	1,427 1銘柄	185 < 銘柄数 >	15,436 < 0.1% >		
(台湾)	百株	千台湾ドル	千円		
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	220	3,553	14,548	情報技術	
TAIWAN CEMENT	1,481.45	6,888	28,206	素材	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	1,160	11,716	47,972	情報技術	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	90	1,584	6,485	情報技術	
ANTI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	881.12	5,929	24,280	生活必需品	
FORMOSA PLASTICS CORP	806	8,301	33,992	素材	
NAN YA PLASTICS CORP	621.4	5,138	21,042	素材	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	593.9	4,709	19,284	素材	
CHINA STEEL CORP	3,206.86	10,550	43,200	素材	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	676.16	4,097	16,777	情報技術	
DELTA ELECTRONICS INC	340	8,619	35,291	情報技術	
YAGEO CORPORATION	80	3,676	15,051	情報技術	
WINBOND ELECTRONICS CORP	750	2,317	9,489	情報技術	
ACER INC	1,730	4,809	19,692	情報技術	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	670	4,355	17,831	情報技術	
QUANTA COMPUTER INC	720	6,235	25,530	情報技術	
AU OPTRONICS CORP	6,680	13,794	56,481	情報技術	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	834	9,382	38,417	コミュニケーション・サービス	
MEDIATEK INC	160.03	16,483	67,491	情報技術	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	360	5,364	21,963	情報技術	
EVA AIRWAYS CORP	1,690	4,013	16,434	資本財・サービス	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	1,227.2	3,736	15,300	金融	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	2,144.34	15,760	64,534	金融	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,968.38	11,672	47,794	金融	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	4,120	6,674	27,328	金融	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,191.24	5,960	24,404	金融	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千台湾ドル	千円		
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	2,553.81	6,205	25,410	金融	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,769.93	6,000	24,567	金融	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	4,482.31	4,773	19,546	金融	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	2,470.28	6,002	24,578	金融	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,482.14	3,453	14,140	金融	
LARGAN PRECISION CO LTD	20	3,990	16,337	情報技術	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	80	3,760	15,395	情報技術	
TAIWAN MOBILE CO LTD	340	3,338	13,671	コミュニケーション・サービス	
WISTRON CORP	1,331.1	3,900	15,969	情報技術	
INNOLUX CORP	6,600	11,781	48,238	情報技術	
PEGATRON CORP	1,680	11,256	46,088	情報技術	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	240	2,361	9,669	情報技術	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	277.94	6,726	27,540	金融	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	324	3,149	12,895	情報技術	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	360	3,499	14,327	エネルギー	
COMPAL ELECTRONICS	1,850	4,319	17,687	情報技術	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,140	126,902	519,612	情報技術	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	9,169.02	94,899	388,574	情報技術	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	130	3,607	14,771	生活必需品	
ASUSTEK COMPUTER INC	317.6	11,290	46,230	情報技術	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	2,060	12,854	52,633	情報技術	
台湾ドル	株数・金額	519,396	2,126,719		
通貨計	銘柄数<比率>	47銘柄	<13.2%>		
(トルコ)	百株	千トルコ・リラ	千円		
IS YATIRIM MENKUL DEGERLER A	324.96	639	5,708	金融	
TURKIYE GARANTI BANKASI	2,418.41	2,756	24,609	金融	
AKBANK T.A.S.	3,342.74	2,206	19,692	金融	
TURKIYE IS BANKASI-C	2,498.56	1,656	14,786	金融	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	877.6	1,621	14,476	コミュニケーション・サービス	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	199.9	3,106	27,728	エネルギー	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	842.22	1,923	17,170	素材	
HACI OMER SABANCI HOLDING	1,279.23	1,675	14,958	金融	
TURKIYE HALK BANKASI	1,108.22	539	4,817	金融	
YAPI VE KREDI BANKASI	2,377.87	753	6,728	金融	
KOC HOLDING AS	807.81	2,344	20,925	資本財・サービス	
TURK HAVA YOLLARI AO	1,294.89	2,242	20,019	資本財・サービス	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	123.96	860	7,684	生活必需品	
トルコ・リラ	株数・金額	22,328	199,304		
通貨計	銘柄数<比率>	13銘柄	<1.2%>		
(メキシコ)	百株	千メキシコ・ペソ	千円		
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	88	2,197	11,540	資本財・サービス	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	8,965	16,648	87,450	コミュニケーション・サービス	
GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO	758	3,014	15,835	コミュニケーション・サービス	
CEMEX SAB-CPO	8,967.19	12,302	64,626	素材	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	756	11,702	61,474	生活必需品	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	574	5,038	26,467	素材	
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	1,593	11,117	58,399	生活必需品	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	653	8,225	43,206	金融	
メキシコ・ペソ	株数・金額	70,246	368,999		
通貨計	銘柄数<比率>	8銘柄	<2.3%>		
(チリ)	百株	千チリ・ペソ	千円		
CENCOSUD SA	461.15	58,566	7,909	生活必需品	
BANCO SANTANDER CHILE	28,986.96	108,846	14,699	金融	
ENEL AMERICAS SA	12,217.63	131,950	17,819	公益事業	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	14.72	79,370	10,718	素材	
FALABELLA SA	215.93	58,301	7,873	一般消費財・サービス	
BANCO DE CHILE	10,345.39	82,763	11,177	金融	
チリ・ペソ	株数・金額	519,796	70,198		
通貨計	銘柄数<比率>	6銘柄	<0.4%>		
(サウジアラビア)	百株	千サウジアラビア・リアル	千円		
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	131.73	1,464	44,487	素材	
SAUDI TELECOM CO	54.52	605	18,379	コミュニケーション・サービス	

銘柄	2021年11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千サウジアラビア・リアル	千円		
AL RAJHI BANK	241.62	3,261	99,062	金融	
ETIHAD ETISALAT CO	176.9	547	16,627	コミュニケーション・サービス	
ALINMA BANK	329.25	757	23,018	金融	
THE SAUDI NATIONAL BANK	118.42	717	21,794	金融	
SAUDI ARABIAN OIL CO	280.37	978	29,716	エネルギー	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	285.25	470	14,276	素材	
SAUDI ELECTRICITY CO	366.17	878	26,689	公益事業	
サウジアラビア・リアル	株数・金額	1,984.23	9,682	294,052	
通貨計	銘柄数<比率>	9銘柄	<1.8%>		
(インド)	百株	千インド・ルピー	千円		
TATA STEEL LTD	348.72	38,873	59,476	素材	
AXIS BANK LTD	431.9	28,121	43,025	金融	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	19.5	13,941	21,330	一般消費財・サービス	
TATA POWER CO LTD	794.37	17,368	26,574	公益事業	
BANK OF BARODA	736.29	6,350	9,716	金融	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	52.23	12,166	18,614	生活必需品	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	664.96	19,712	30,160	エネルギー	
STATE BANK OF INDIA	782.7	36,403	55,697	金融	
NTPC LTD	2,405.22	30,426	46,551	公益事業	
JSW STEEL LTD	317.64	19,871	30,403	金融	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	867.98	17,381	26,593	公益事業	
INDIAN OIL CORP LTD	2,304.71	27,379	41,891	エネルギー	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	686.05	25,208	38,569	エネルギー	
JINDAL STEEL & POWER LTD	220.88	7,789	11,917	素材	
ULTRATECH CEMENT LTD	10.97	8,104	12,400	素材	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	53.46	7,501	11,477	金融	
TECH MAHINDRA LTD	92.74	14,250	21,803	情報技術	
YES BANK LTD	176.4	214	327	金融	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	282.02	7,263	11,113	一般消費財・サービス	
REC LTD	530.6	6,839	10,464	金融	
COAL INDIA LTD	1,440.5	22,219	33,996	エネルギー	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	622.66	14,377	21,997	金融	
GAIL INDIA LTD	691.94	9,019	13,799	公益事業	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	640.18	26,897	41,152	素材	
GRASIM INDUSTRIES LTD	136.2	22,935	35,091	素材	
WIPRO LTD	160.49	10,120	15,484	情報技術	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	108.98	38,164	58,392	情報技術	
INFOSYS LTD	487.24	82,652	126,459	情報技術	
LARSEN & TOUBRO LTD	135.49	23,944	36,635	資本財・サービス	
TATA MOTORS LTD	1,103.73	50,931	77,925	一般消費財・サービス	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	218.9	59,405	90,889	金融	
ICICI BANK LTD	222.99	16,019	24,509	金融	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	552	134,770	206,199	エネルギー	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	2,380.25	34,299	52,478	エネルギー	
ITC LTD	804.34	17,816	27,258	生活必需品	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	234.85	19,981	30,570	一般消費財・サービス	
HERO MOTOCORP LTD	29.67	7,390	11,307	一般消費財・サービス	
BHARTI AIRTEL LTD	290.16	21,452	32,823	コミュニケーション・サービス	
UPL LTD	137.76	9,496	14,529	素材	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	147.6	11,085	16,960	ヘルスケア	
HCL TECHNOLOGIES LTD	162.74	18,440	28,214	情報技術	
VEDANTA LTD	1,329.16	46,095	70,525	素材	
インド・ルピー	株数・金額	23,817.17	1,042,686	1,595,310	
通貨計	銘柄数<比率>	42銘柄	<9.9%>		
(インドネシア)	百株	千インドネシア・ルピア	千円		
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	4,933	2,947,467	23,579	一般消費財・サービス	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	1,013	790,140	6,321	素材	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	18,061	7,477,254	59,818	コミュニケーション・サービス	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	4,250	2,953,750	23,630	金融	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	5,970	4,417,800	35,342	金融	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	5,474	3,927,595	31,420	金融	
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	8,570	1,319,780	10,558	公益事業	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千円	千円	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER ADARAO ENERGY TBK PT	13,452 12,895	5,609,484 2,179,255	44,875 17,434	金融 エネルギー
インドネシア・ルピア 通貨計	74,618 9銘柄	31,622,525 <銘柄数<比率>	252,980 <1.6%>	
(ブラジル)	百株	千円	千円	
XP INC BDR	124.05	2,075	42,118	金融
GETNET ADQUIRENCA E SERVICO CIA PARANAENSE DE ENERGIA ENERGISA SA-UNITS	83 164 106	31 91 481	634 1,853 9,763	情報技術 公益事業 公益事業
RUMO SA	285	502	10,188	資本財・サービス
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	1,765	739	15,004	金融
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	184	391	7,932	金融
VIBRA ENERGIA SA	755	1,635	33,178	一般消費財・サービス
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC TIM SA	108 485.26	249 674	5,059 13,674	生活必需品 コミュニケーション・サービス
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	4,438	13,078	265,348	エネルギー
BANCO BRADESCO SA-PREF	4,212.18	8,538	173,225	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	4,857.36	11,006	223,311	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	185	416	8,460	素材
VALE SA	948.9	6,594	133,799	素材
GERDAU SA-PREF	570	1,470	29,836	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	3,673	11,077	224,751	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	1,074.87	1,445	29,331	公益事業
ITAUSA SA	1,361	1,336	27,115	金融
BRASKEM SA-PREF A	261	1,362	27,641	素材
CENTRAIS ELÉTRICAS BRAS-PR B	222	716	14,543	公益事業
BANCO DO BRASIL S.A.	1,543	4,753	96,451	金融
COSAN SA	644	1,383	28,065	エネルギー
CENTRAIS ELÉTRICAS BRASILEIR	372	1,224	24,845	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	792	483	9,801	公益事業
EMBRAER SA	712	1,406	28,529	資本財・サービス
METALURGICA GERDAU SA-PREF	949	1,020	20,697	素材
CCR SA	886	1,019	20,689	資本財・サービス
BRF SA	571	1,164	23,632	生活必需品
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	260	891	18,093	公益事業
LOJAS RENNER S.A.	216.75	627	12,726	一般消費財・サービス
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	147.84	83	1,691	一般消費財・サービス
JBS SA	965	3,351	67,995	生活必需品
SUZANO SA	122.45	681	13,830	素材
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	379	905	18,362	生活必需品
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	906	1,041	21,138	金融
CIELO SA	2,442.28	505	10,256	情報技術
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	370	842	17,100	公益事業
SUL AMERICA SA - UNITS	188.18	478	9,705	金融
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	186.54	327	6,642	公益事業
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	332	1,120	22,740	金融
RAIA DROGASIL SA	235	531	10,779	生活必需品
TELEFONICA BRASIL S.A.	369	1,856	37,671	コミュニケーション・サービス
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	732	1,038	21,073	エネルギー
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	516	1,046	21,230	金融
LOJAS AMERICANAS SA	46.93	26	537	一般消費財・サービス
COGNA EDUCACAO	2,643	636	12,923	一般消費財・サービス
BANCO BRADESCO S.A.	1,267.65	2,210	44,853	金融
AMBEV SA	1,872	3,058	62,059	生活必需品
ブラジル・レリアル 通貨計	46,529.24 49銘柄	97,636 <銘柄数<比率>	1,980,898 <12.3%>	
(中国)	百株	千円	千円	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	737	1,331	23,745	金融
BANK OF BEIJING CO LTD -A	1,495	657	11,728	金融
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	175	291	5,204	金融
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	249	1,211	21,603	金融
IND & COMM BK OF CHINA-A	3,796	1,738	30,998	金融

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千円	千円	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	93	172	3,077	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	94	270	4,830	金融
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	29	170	3,037	一般消費財・サービス
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	3	595	10,617	生活必需品
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	80	288	5,152	素材
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	500	697	12,436	不動産
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	1,733	1,488	26,542	金融
CITIC SECURITIES CO-A	148	352	6,280	金融
CHINA MERCHANTS BANK-A	388	1,933	34,465	金融
PING AN BANK CO LTD-A	464	812	14,486	金融
GF SECURITIES CO LTD-A	134	308	5,502	金融
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	3,940	1,828	32,596	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-A	101	271	4,833	一般消費財・サービス
SAIC MOTOR CORP LTD-A	630	1,265	22,567	一般消費財・サービス
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	337	156	2,794	素材
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	421	261	4,654	資本財・サービス
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	289	110	1,968	金融
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	171.6	281	5,014	資本財・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHINA-A	903	341	6,086	資本財・サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	704	369	6,590	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-A	68	156	2,783	素材
YANZHOU COAL MINING CO-A	81	186	3,317	エネルギー
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	306	176	3,142	金融
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	8,046	2,349	41,890	金融
BANK OF CHINA LTD-A	2,581	789	14,081	金融
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	2,089	848	15,122	エネルギー
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	3,315	1,518	27,070	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	398	778	13,887	エネルギー
CHINA VANKE CO LTD -A	344	635	11,322	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	153	416	7,433	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	487	221	3,942	金融
CHINA MINSHENG BANKING-A	3,033	1,179	21,036	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	2,530	845	15,066	金融
CGN POWER CO LTD-A	189	54	977	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	154	240	4,294	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	229	271	4,838	金融
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	1,850	984	17,548	資本財・サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	915	609	10,865	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	52	198	3,530	金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	1,174	666	11,889	金融
AIR CHINA LTD-A	207	165	2,945	資本財・サービス
BYD CO LTD -A	7	213	3,799	一般消費財・サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	71	111	1,990	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-A	98	150	2,685	資本財・サービス
ZUIJIN MINING GROUP CO LTD-A	130	133	2,375	素材
HUANENG POWER INTL INC-A	665	414	7,386	公益事業
オフショア人民元 通貨計	46,786.6 51銘柄	31,522 <銘柄数<比率>	562,041 <3.5%>	
(マレーシア)	百株	千円	千円	
MALAYAN BANKING BHD	583	469	12,601	金融
GENTING BHD	878	402	10,797	一般消費財・サービス
PUBLIC BANK BERHAD	2,617	1,036	27,827	金融
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	1,360	694	18,660	金融
TENAGA NASIONAL BHD	497	460	12,357	公益事業
マレーシア・リンギット 通貨計	5,935 5銘柄	3,062 <銘柄数<比率>	82,245 <0.5%>	
(南アフリカ)	百株	千円	千円	
GOLD FIELDS LTD	241.42	4,175	29,437	素材
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	15.03	2,651	18,694	金融
NEPI ROCKCASTLE PLC	151.07	1,491	10,516	不動産

銘柄	2021年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
MULTICHOICE GROUP LTD	118.08	千株 1,443	千円 10,177	コミュニケーション・サービス
OLD MUTUAL LTD	1,295.77	1,614	11,382	金融
VODACOM GROUP LTD	141.5	1,940	13,681	コミュニケーション・サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD	157.17	3,069	21,640	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD	156.55	2,537	17,886	金融
BIDVEST GROUP LTD	90.87	1,675	11,812	資本財・サービス
BID CORP LTD	68.49	2,030	14,314	生活必需品
STANDARD BANK GROUP LTD	320.36	4,132	29,132	金融
SASOL LTD	273.1	7,067	49,824	素材
DISCOVERY LTD	130.47	1,739	12,266	金融
SANLAM LTD	530.72	2,935	20,698	金融
FIRSTRAND LTD	1,215.28	6,714	47,336	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	278.95	1,427	10,061	一般消費財・サービス
ABSA GROUP LTD	255.81	3,374	23,791	金融
NASPERS LTD-N SHS	26.73	6,579	46,385	一般消費財・サービス
MTN GROUP LTD	433.66	6,912	48,736	コミュニケーション・サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	64.45	1,232	8,689	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	119.7	2,683	18,921	ヘルスケア
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	122.25	3,942	27,791	素材
MR PRICE GROUP LTD	79.44	1,580	11,141	一般消費財・サービス
SIBANYE STILLWATER LTD	344.77	1,667	11,759	素材
南アフリカ・ランド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	6,631.64 24銘柄	74,621 526,081 < 3.3%>	
(タイ)	株数、金額 銘柄数<比率>	百株 千タイ・パート 千円		
CHAROEN POKPHAND FOODS NON-VOTING	32.77	—	—	生活必需品
CP ALL NON-VOTING DR PCL	96.46	72	244	生活必需品
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	271	3,170	10,716	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR	458	17,449	58,980	素材
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	385	5,236	17,697	金融
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,139	3,217	10,875	一般消費財・サービス
KASIKORNBANK PCL-NVDR	169	2,306	7,797	金融
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,641	20,266	68,500	金融
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	31,683	3,801	12,850	金融
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	917	3,645	12,320	素材
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	412	8,693	29,383	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	6,418	7,380	24,946	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	4,964	5,311	17,952	エネルギー
BANGKOK DUSIT MED SERV-NVDR	1,520	3,450	11,662	ヘルスケア
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	670	7,604	25,703	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	11,202	4,323	14,615	エネルギー
BANGCHAK CORP PCL-NVDR	1,048	2,557	8,643	エネルギー
PTT PCL-NVDR	10,368	37,324	126,157	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	961	4,660	15,753	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	1,447	8,609	29,100	生活必需品
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	539	3,220	10,885	資本財・サービス
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	187	2,187	7,395	金融
LAND & HOUSES PUB - NVDR	3,271	2,780	9,397	不動産
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	2,294	5,643	19,074	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,404	8,002	27,049	素材
タイ・パート 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	83,497.23 25銘柄	170,918 577,703 < 3.6%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	850,455.52 405銘柄	— 13,499,628 < 83.7%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2021年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (2) 外国投資信託証券

銘柄	柄	2021年11月30日現在		
		□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千円	千アメリカ・ドル	千円
INVESTCO FTSE RAFI EMERGING M		504.6	10,894	1,239,446
合計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	504.6 1銘柄	10,894	1,239,446 < 7.7%>

(注1) 邦貨換算金額は、2021年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2021年11月30日現在	
	買 建 額	売 建 額
外国	百万円	百万円
MSCI EMGMKT(アメリカ)	1,302	—

(注1) 外貨建の評価額は、2021年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

# 外国株式インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第22期 (決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日)

外国株式インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	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うことを基本とします。
主要投資対象	外国の株式（預託証券を含みます。）
株式組入制限	無制限

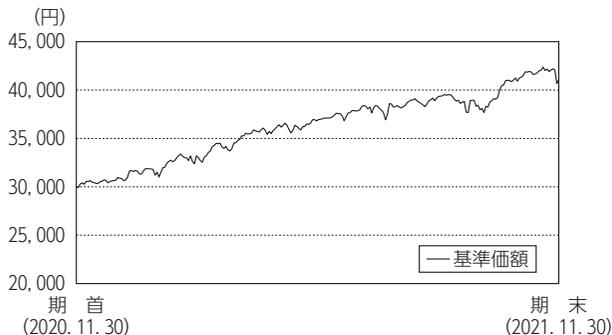
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		MSCIコクサイ指数 (円ベース)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率			
(期首) 2020年11月30日	30,015	—	19,635	—	93.3	4.7	2.3
12月末	30,882	2.9	20,178	2.8	94.5	3.3	2.2
2021年1月末	31,520	5.0	20,593	4.9	93.8	4.2	2.2
2月末	32,597	8.6	21,302	8.5	92.6	5.2	2.2
3月末	34,778	15.9	22,626	15.2	92.5	5.3	2.2
4月末	36,409	21.3	23,655	20.5	93.7	4.3	2.2
5月末	36,946	23.1	23,953	22.0	92.8	5.1	2.2
6月末	37,865	26.2	24,531	24.9	91.0	6.7	2.2
7月末	38,400	27.9	24,862	26.6	92.0	5.7	2.2
8月末	39,351	31.1	25,432	29.5	91.2	6.8	2.2
9月末	38,438	28.1	24,810	26.4	92.2	5.6	2.2
10月末	41,250	37.4	26,603	35.5	92.1	5.8	2.3
(期末) 2021年11月30日	41,095	36.9	26,449	34.7	91.4	6.5	2.2

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) MSCIコクサイ指数 (円ベース) は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIコクサイ指数 (米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日(10,000)として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIコクサイ指数 (米ドルベース) は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、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。
- (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。
- (注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：30,015円 期末：41,095円 騰落率：36.9%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークの動きをほぼ反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より、米国大統領選挙の不透明感が解消されたことや新型コロナウイルスのワクチン開発への期待を受け、上昇しました。2021年2月以降は、米国においてウイルスの新規感染者数の減少傾向が鮮明となったことに加え、ワクチン接種が着実に進んでいることが投資家心理を改善させ、上昇基調となりました。9月に入ると、米国や中国における経済指標の悪化をきっかけに軟調となり、その後も中国の大手不動産会社の資金繰り問題や米国の債務上限問題、米国金利の上昇に対する警戒感など複数のリスク要因が嫌気され、株価は下落しました。10月中旬以降は、米国の債務上限の一時引き上げが決定されたことなどが好感されて反発し、堅調に推移しました。11月下旬には、南アフリカでウイルスの新変異株であるオミクロン株が確認されたことが嫌気されて調整し、当作成期末を迎えました。

○為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると円安が進みました。

為替相場は、当作成期首より、米国において民主党が大統領・議会上下両院を制したことから、株価が上昇するなど市場のリスク選好姿勢が強まり、円安となりました。2021年3月には、米国での追加経済対策の成立や、経済指標の改善により米国金利が上昇したことなどから米ドルが買い進められ、全般的に円安が進行しました。7月以降は、新型コロナウイルスの新規感染者数の増加を受けた景気への懸念などを受け、円高が進みました。9月以降は、日本以外の各国で利上げ観測が高まり、金融政策の方向性の違いを要因として、円安となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

今後の運用にあたりましても、引き続き、当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

◆ポートフォリオについて

外国株式を中心に組み入れ、S & P 500先物取引等の株価指数先物も一部利用し、株式組入比率 (投資信託証券、株価指数先物を含む) につきましては、当作成期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。

外国株式等のポートフォリオ構築にはリスクモデルを利用し、ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は34.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は36.9%となりました。

ファンドには保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、かい離要因となりました。

その他、ファンドで組み入れているポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、売買手数料・保管費用等のコスト負担がかい離要因としてあげられます。

\*ベンチマークはMSCIコクサイ指数 (円ベース) です。

《今後の運用方針》

今後の運用にあたりましても、引き続き、当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (先物・オプション) (投資信託証券)	1円 ( 1) ( 0) ( 1) ( 0)
有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	1 ( 1) ( 0)
その他費用 (保管費用) (その他)	12 ( 6) ( 5)
合 計	14

(注 1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注 2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2020年12月 1 日から2021年11月30日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	アメリカ	百株 15,282.5 (△ 828.54)	千アメリカ・ドル 166,102 (△ 1,904)	百株 1,904.86	千アメリカ・ドル 9,623
	カナダ	百株 1,880 ( 214.08)	千カナダ・ドル 10,122 (△ 32)	百株 356.08	千カナダ・ドル 732
	オーストラリア	百株 1,960.2 ( 301.86)	千オーストラリア・ドル 5,090 (△ 238)	百株 1,186.06	千オーストラリア・ドル 243
	香港	百株 5,643 ( 201.17)	千香港・ドル 21,457 (△ 19)	百株 2,647.4	千香港・ドル 5,196
	シンガポール	百株 1,052 ( 1,013.12)	千シンガポール・ドル 801 (△ 98)	百株 1,953.12	千シンガポール・ドル 132
	ニュージーランド	百株 344 ( — )	千ニュージーランド・ドル 292 ( — )	百株 —	千ニュージーランド・ドル —
	イギリス	百株 11,569.5 (△ 1,546.66)	千イギリス・ポンド 7,107 ( 1,666)	百株 107.38	千イギリス・ポンド 63
	イスラエル	百株 294.5 ( — )	千イスラエル・シェケル 944 ( — )	百株 —	千イスラエル・シェケル —
	スイス	百株 548.91 ( — )	千スイス・フラン 4,917 (△ 90)	百株 36	千スイス・フラン 364
	デンマーク	百株 290.45 ( 650.6)	千デンマーク・クローネ 11,548 ( — )	百株 411	千デンマーク・クローネ 1,511
ノルウェー	百株 333.5 ( — )	千ノルウェー・クローネ 5,172 ( — )	百株 —	千ノルウェー・クローネ —	

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	スウェーデン	百株 1,523 ( 2,840.43)	千スウェーデン・クローネ 32,328 ( — )	百株 663.5	千スウェーデン・クローネ 2,486
	ユーロ (アイルランド)	百株 57.2 ( — )	千ユーロ 414 ( — )	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (オランダ)	百株 1,074.8 (△ 72)	千ユーロ 4,391 (△ 98)	百株 335.09	千ユーロ 482
	ユーロ (ベルギー)	百株 51 ( — )	千ユーロ 327 ( — )	百株 28.4	千ユーロ 138
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 143.5 ( — )	千ユーロ 242 ( — )	百株 177	千ユーロ 111
	ユーロ (フランス)	百株 748 (△ 93.56)	千ユーロ 4,645 (△ 164)	百株 230	千ユーロ 137
	ユーロ (ドイツ)	百株 804.1 ( 354.42)	千ユーロ 4,935 (△ 88)	百株 663.32	千ユーロ 919
	ユーロ (ポルトガル)	百株 134 ( — )	千ユーロ 78 ( — )	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (スペイン)	百株 2,106.38 ( 8,378.69)	千ユーロ 1,626 ( 156)	百株 8,900.19	千ユーロ 346
	ユーロ (イタリア)	百株 2,231 ( — )	千ユーロ 972 (△ 1)	百株 241.75	千ユーロ 129
国	ユーロ (フィンランド)	百株 269.5 ( — )	千ユーロ 642 ( — )	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (オーストリア)	百株 26.8 ( — )	千ユーロ 104 ( — )	百株 21	千ユーロ 74
	ユーロ (その他)	百株 — ( — )	千ユーロ — (△ 2,409)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 7,646.28 ( 8,567.55)	千ユーロ 18,379 (△ 2,606)	百株 10,596.75	千ユーロ 2,340

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) ( )内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注 3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 新株予約権証券

(2020年12月 1 日から2021年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	スイス	証 券 —	千スイス・フラン —	証 券 34,320 ( — )	千スイス・フラン 6 ( — )

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) ( )内は、割当、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注 3) 単位未満は切捨て。

(3) 投資信託証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外	千口 56.01 (△ 27.261)	千アメリカ・ドル 4,314 ( — )	千口 9.654 ( — )	千アメリカ・ドル 441 ( — )
	千口 1.6 ( — )	千カナダ・ドル 50 ( — )	千口 6.9 ( — )	千カナダ・ドル 125 ( — )
	千口 79.6 10.6)	千オーストラリア・ドル 461 ( — )	千口 10.6 ( — )	千オーストラリア・ドル 9 ( — )
	千口 27 ( — )	千香港・ドル 985 ( — )	千口 — ( — )	千香港・ドル — ( — )
	千口 75 ( 12.101)	千シンガポール・ドル 173 ( 19)	千口 63 ( — )	千シンガポール・ドル 89 ( — )
国	千口 6.55 ( — )	千イギリス・ポンド 63 ( — )	千口 — ( — )	千イギリス・ポンド — ( — )
	千口 1.75 ( — )	千ユーロ 87 ( — )	千口 0.95 ( — )	千ユーロ 58 ( — )

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付( )内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 売付( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の種別別取引状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 株式先物取引	百万円 74,080	百万円 68,520	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄  
株 式

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

銘 柄	当 期			銘 柄	期 付		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
AMAZON.COM INC (アメリカ)	千株 2.59	千円 974,179	円 376,130	ALEXION PHARMACEUTICALS INC (アメリカ)	千株 7.98	千円 159,446	円 19,980
MICROSOFT CORP (アメリカ)	24.9	721,062	28,958	APPLE INC (アメリカ)	9.4	115,811	12,320
APPLE INC (アメリカ)	47.2	704,361	14,922	DEUTSCHE WOHNEN SE (ドイツ)	12.05	73,268	6,080
TESLA INC (アメリカ)	5.35	410,777	76,780	STELLANTIS NV (オランダ)	33.359	54,116	1,622
META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)	8.45	304,247	36,005	XPO LOGISTICS INC (アメリカ)	3.1	47,864	15,440
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	1.08	288,548	267,174	NESTLE SA-REG (スイス)	3.6	42,658	11,849
SNOWFLAKE INC-CLASS A (アメリカ)	6	204,383	34,063	ORACLE CORP (アメリカ)	6.6	39,420	5,972
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.75	201,444	268,592	BEIGENE LTD-ADR (ケイマン諸島)	1.45	38,370	26,462
NVIDIA CORP (アメリカ)	4.22	193,934	45,956	REINSURANCE GROUP OF AMERICA (アメリカ)	2.45	31,755	12,961
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	10	172,381	17,238	ORGANON & CO (アメリカ)	8.782	27,472	3,128

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)					
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	37.5	42.5	745	84,863	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	32.3	35.1	1,934	220,104	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	61	67.5	1,334	151,853	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS INC	44	47.5	408	46,518	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	17.8	21.5	263	29,942	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	173	211	994	113,113	金融
ABBOTT LABORATORIES	579.16	643.66	8,240	937,553	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	132.33	141.33	402	45,825	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	51.5	56.5	1,294	147,304	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	111	126.5	471	53,624	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	96.5	216	1,791	203,794	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	16.1	908	103,366	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES INC	202.62	225.62	2,377	270,523	情報技術
QORVO INC	38.5	40.7	613	69,845	情報技術
AFLAC INC	225.5	236	1,314	149,552	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	43.5	48	680	77,409	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	50.5	60.5	652	74,234	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	157.7	173.2	11,907	1,354,696	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	70.5	76.5	481	54,796	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	41	45.3	2,098	238,754	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	144	—	—	—	金融
GARMIN LTD	46.5	56.5	786	89,503	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	73.1	79.5	2,316	263,517	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	227.5	251.5	5,222	594,180	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	45.75	52.75	419	47,692	金融
AUTOZONE INC	7.7	8.2	1,507	171,533	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	77.21	83.21	1,176	133,813	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	366.5	419	359	40,948	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	38	41	271	30,921	公益事業
CELANESE CORP	39.5	41.5	663	75,444	素材
DR HORTON INC	113.16	125.66	1,241	141,190	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	70	79.5	387	44,038	ヘルスケア
AUTODESK INC	72.3	80.2	2,094	238,282	情報技術
MOODY'S CORP	55.7	61.6	2,447	278,416	金融
DEVON ENERGY CORP	—	233	1,023	116,424	エネルギー
ALBEMARLE CORP	35.5	43.1	1,189	135,282	素材
ATMOS ENERGY CORP	40	48.5	454	51,757	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	80.5	90.5	518	58,976	公益事業
CITIGROUP INC	681.73	748.73	4,869	554,030	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	141.5	155	3,656	415,994	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	164	183	1,524	173,450	公益事業
ALLEGHANY CORP	4.8	4.8	319	36,300	金融
DOMINO'S PIZZA INC	12.7	14.3	763	86,868	一般消費財・サービス
HESS CORP	90	102	775	88,275	エネルギー
DAVITA INC	27.5	27.5	266	30,319	ヘルスケア
DANAHER CORP	208.5	232.5	7,591	863,695	ヘルスケア
FORTIVE CORP	98.5	117	891	101,470	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	180.5	205.5	2,710	308,378	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	184	201.5	1,305	148,574	生活必需品
BUNGE LTD	44.5	51	461	52,556	生活必需品

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TE CONNECTIVITY LTD	106.75	119.25	1,900	216,245	情報技術
APPLE INC	5,678	6,056	97,041	11,040,393	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	102	110.5	1,252	142,461	金融
BOEING CO/THE	175.6	201.3	3,995	454,602	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	51.65	55.65	659	75,000	金融
BECTON DICKINSON AND CO	94.19	106.19	2,586	294,310	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	67	76	76	8,750	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	43.5	49	443	50,479	資本財・サービス
CDK GLOBAL INC	40	—	—	—	情報技術
NISOURCE INC	126	139	350	39,930	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	44.5	49	468	53,305	資本財・サービス
BOSTON BEER COMPANY INC-A	—	3.2	141	16,105	生活必需品
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	260.21	300.71	1,714	195,041	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,355.04	1,502.04	7,759	882,802	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	455.5	488.5	13,781	1,567,928	金融
ANSYS INC	27.8	32	1,272	144,795	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	444.17	490.67	2,996	340,858	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	222	249.5	3,714	422,605	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	740	810	4,425	503,527	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	997.7	1,097.7	17,698	2,013,526	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	77	83	1,718	195,487	金融
LKQ CORP	91.5	102.5	590	67,169	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	16.6	18.3	283	32,291	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	100.62	114.12	846	96,324	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	93	100.5	1,876	213,459	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	40.1	42.2	1,239	141,012	金融
DOLLAR GENERAL CORP	83.5	88.5	1,991	226,614	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	62.6	71.5	4,810	547,309	情報技術
CATERPILLAR INC	176.5	198.5	3,889	442,452	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	79.5	85.5	559	63,626	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	73	83	402	45,741	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	—	18	675	76,858	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	93	106.5	651	74,068	公益事業
MOSAIC CO/THE	120.5	128	461	52,468	素材
DELTA AIR LINES INC	51.5	57.5	208	23,707	資本財・サービス
CORNING INC	246	294	1,130	128,642	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,382.5	1,529.5	8,528	970,286	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	42	—	—	—	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	459.02	506.52	4,924	560,305	金融
ZILLOW GROUP INC - A	—	21	113	12,939	不動産
MSCI INC	28.2	30	1,936	220,312	金融
FAIR ISAAC CORP	10	10	350	39,894	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	11	12	386	43,977	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	75	85	667	75,893	情報技術
BROADCOM INC	130.52	148.12	8,359	951,003	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	37.8	43.5	786	89,448	ヘルスケア
ARAMARK	72	85	292	33,247	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	72.5	—	—	—	素材
DTE ENERGY COMPANY	62.5	71.7	799	90,945	公益事業
CENTENE CORP	189.87	213.87	1,577	179,497	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	35	39.5	512	58,286	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	143	157	765	87,130	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	61.5	75	1,236	140,628	金融

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
GARTNER INC	29.2	31.5	1,023	116,472	情報技術		
SPLUNK INC	51.8	60.1	751	85,469	情報技術		
DOMINION ENERGY INC	276.41	294.41	2,190	249,269	公益事業		
MONSTER BEVERAGE CORP	128.5	143	1,241	141,297	生活必需品		
SMITH (A. O.) CORP	42.5	50	404	45,997	資本財・サービス		
DEERE & CO	96.5	108	3,759	427,703	資本財・サービス		
POOL CORP	—	14.8	828	94,309	一般消費財・サービス		
GLOBAL PAYMENTS INC	98.84	106.84	1,284	146,178	情報技術		
VMWARE INC-CLASS A	28.3	74.8	900	102,443	情報技術		
CABLE ONE INC	1.7	2	365	41,548	コミュニケーション・サービス		
BURLINGTON STORES INC	21.9	24	704	80,104	一般消費財・サービス		
NASDAQ INC	37	42	878	99,905	金融		
VAIL RESORTS INC	13.6	14.9	496	56,525	一般消費財・サービス		
EAST WEST BANCORP INC	46	—	—	—	金融		
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	—	184	677	77,119	コミュニケーション・サービス		
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	22.5	—	—	—	金融		
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	24.3	26.3	363	41,333	金融		
CONSOLIDATED EDISON INC	109	126	1,012	115,181	公益事業		
COGNEX CORP	55	65	511	58,169	情報技術		
TELEFLEX INC	15	17.2	531	60,456	ヘルスケア		
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	28	30.5	597	67,966	資本財・サービス		
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	24	27.1	1,212	137,934	ヘルスケア		
BIO-RAD LABORATORIES-A	7.1	7.9	592	67,369	ヘルスケア		
CATALENT INC	51.5	62	830	94,491	ヘルスケア		
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	44.8	50.5	1,485	168,966	ヘルスケア		
MOLINA HEALTHCARE INC	20	21.2	630	71,761	ヘルスケア		
IDEX CORP	25.2	27.6	646	73,609	資本財・サービス		
COLGATE-PALMOLIVE CO	268	293.5	2,280	259,485	生活必需品		
ROLLINS INC	49.25	80.87	285	32,505	資本財・サービス		
AMETEK INC	74.25	84.45	1,182	134,519	資本財・サービス		
CHURCH & DWIGHT CO INC	82	89	834	94,926	生活必需品		
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	43.5	55.5	320	36,515	資本財・サービス		
HEICO CORP	14	16	224	25,517	資本財・サービス		
XPO LOGISTICS INC	31	—	—	—	資本財・サービス		
GENERAC HOLDINGS INC	—	23.2	985	112,066	資本財・サービス		
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	12.4	14	657	74,769	金融		
LYONDELLBASELL INDU-CL A	88.5	97	864	98,405	素材		
TYLER TECHNOLOGIES INC	13	15	781	88,959	情報技術		
COSTCO WHOLESALE CORP	144.4	160.6	8,911	1,013,846	生活必需品		
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	26	28	331	37,739	情報技術		
EPAM SYSTEMS INC	18	20	1,268	144,299	情報技術		
RPM INTERNATIONAL INC	43.5	46	427	48,681	素材		
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	8.8	10	1,678	190,917	一般消費財・サービス		
UGI CORP	70.5	76.5	332	37,772	公益事業		
CUMMINS INC	48.5	53.5	1,162	132,245	資本財・サービス		
ACTIVISION BLIZZARD INC	253	283.5	1,709	194,522	コミュニケーション・サービス		
CDW CORP/DE	46.5	51	993	113,028	情報技術		
SIGNATURE BANK	16.5	—	—	—	金融		
COSTAR GROUP INC	13.1	145	1,159	131,956	資本財・サービス		
SVB FINANCIAL GROUP	17.1	20.2	1,463	166,501	金融		
AMERCO	2.9	3.7	265	30,191	資本財・サービス		
OLD DOMINION FREIGHT LINE	31.5	36.4	1,300	147,932	資本財・サービス		
MERCADOLIBRE INC	14.8	16.1	1,986	226,049	一般消費財・サービス		
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	25	27.6	420	47,826	情報技術		

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	90.16	100.16	1,382	157,333	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	11.7	14.2	231	26,362	情報技術
DEXCOM INC	30	35.4	2,021	229,971	ヘルスケア
NORDSON CORP	17.3	19.1	500	56,965	資本財・サービス
COPART INC	68.5	78.3	1,158	131,850	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	51.5	—	—	—	エネルギー
SEAGEN INC	39.5	49.5	818	93,096	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	25.1	27.1	1,719	195,617	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	17.1	18.9	1,104	125,622	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	—	14	671	76,404	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	28	33.5	283	32,296	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	—	77.5	791	90,005	ヘルスケア
NIELSEN HOLDINGS PLC	111	—	—	—	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	673.81	733.81	1,174	133,660	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	90	98	2,253	256,348	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	12.2	14	494	56,218	金融
COTERRA ENERGY INC	124	290	604	68,758	エネルギー
T-MOBILE US INC	183.27	226.77	2,571	292,567	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	45.5	59.5	322	36,730	不動産
COCA-COLA CO/THE	1,336	1,486.5	8,113	923,052	生活必需品
COCA-COLA EUROPA PACIFIC PARTNE	65	73.5	380	43,332	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	55.5	61.5	779	88,692	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	95	111.5	376	42,813	金融
CSX CORP	252.5	821	2,924	332,709	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	31.3	34.6	1,010	114,912	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	43.75	51.75	861	98,028	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	27.5	29.5	282	32,196	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	138.8	164.7	58,659	6,673,641	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	202.4	226.9	2,512	285,791	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,384.05	1,536.05	9,460	1,076,324	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	42	—	—	—	その他
AES CORP	219	246	581	66,106	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	13.5	15	396	45,116	金融
EOG RESOURCES INC	193	210	1,856	211,178	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	52	60	685	77,996	情報技術
ABIOMED INC	15.2	16.1	513	58,453	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	49.5	56.8	682	77,694	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	101.4	111.7	1,713	194,967	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1,263.23	1,433.23	2,819	320,736	一般消費財・サービス
NOVAVAX INC	—	26	504	57,373	ヘルスケア
DISCOVERY INC - A	46.9	62.9	154	17,596	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	48.5	62.5	541	61,556	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48.87	56.37	155	17,726	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	8.5	8.5	132	15,118	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	103.89	113.89	273	31,162	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	40	—	—	—	資本財・サービス
FORTINET INC	48	50.5	1,733	197,239	情報技術
MARKEL CORP	4.6	5.1	634	72,165	金融
NEXTERA ENERGY INC	640.8	711.8	6,310	717,981	公益事業
MASIMO CORP	17	19.2	553	62,973	ヘルスケア
FREEMPORT-MCMORAN INC	472.08	536.08	2,036	231,639	素材
INSULET CORP	22.2	24.4	721	82,133	ヘルスケア
US BANCORP	441.5	512	2,938	334,356	金融
UNITED RENTALS INC	23.5	25.7	917	104,388	資本財・サービス

銘柄	期首 株数	当 株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
F5 NETWORKS INC	19	22.5	519	59,149	情報技術
FASTENAL CO	186	210.5	1,282	145,942	資本財・サービス
FISERV INC	185.83	219.33	2,137	243,218	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	2,880.5	398.56	3,921	446,186	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	426	476.5	2,852	324,509	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	—	43.7	415	47,286	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	79.5	87.5	1,701	193,562	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	107.6	123.5	4,773	543,111	金融
ALPHABET INC-CL A	98.2	109	31,725	3,609,427	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	98.87	105.57	30,850	3,509,862	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	33.5	39	339	38,659	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	200.5	220.5	1,400	159,348	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	180.68	197.68	771	87,823	公益事業
GENUINE PARTS CO	48.5	51	677	77,117	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	125.84	138.84	1,806	205,551	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	230	259	1,113	126,676	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	71.6	75.5	1,620	184,402	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	276	326	725	82,523	エネルギー
HOME DEPOT INC	352	385.5	15,682	1,784,244	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	19	22.5	351	39,943	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	318	529	813	92,503	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	12.9	15.1	274	31,218	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	47.4	53.9	965	109,864	生活必需品
HUMANA INC	43.5	47.2	2,020	229,871	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	93	101	2,261	257,324	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	23.6	28.2	626	71,250	情報技術
HENRY SCHEIN INC	45	51	376	42,803	ヘルスケア
HP INC	473	473	1,699	193,350	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	419	476	695	79,119	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	59.78	59.78	297	33,822	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	65	70	420	47,823	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	29.5	29.5	147	16,744	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	132	144	600	68,365	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	217.53	243.03	845	96,165	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	—	46.9	1,203	136,975	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	291.5	324	3,839	436,808	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	122	137.5	649	73,868	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	43.5	49	504	57,397	資本財・サービス
ZOETIS INC	156	173	3,867	439,995	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	79.79	87.79	1,693	192,695	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	76.5	88.5	943	107,331	エネルギー
ALLEGION PLC	29	33	424	48,311	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	129.73	129.73	362	41,208	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	85.07	94.87	1,301	148,074	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	105	122	388	44,193	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC	24	—	—	—	ヘルスケア
JM SMUCKER CO/THE	36.7	40.5	523	59,609	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	862	955	15,256	1,735,689	ヘルスケア
PLUG POWER INC	—	186	774	88,072	資本財・サービス
ABBVIE INC	577.72	640.72	7,489	852,066	ヘルスケア
HOLOGIC INC	83.5	91.5	695	79,084	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	112.5	122	1,647	187,434	生活必需品
KROGER CO	255	264	1,118	127,199	生活必需品
KLA CORP	50.3	55.6	2,300	261,779	情報技術

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LOCKHEED MARTIN CORP	82.6	90.3	3,081	350,560	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	27.8	29.3	624	70,996	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	—	97	735	83,727	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	244.5	260	6,463	735,304	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	281.85	295.35	7,526	856,278	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	48.2	52	3,538	402,610	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	16.5	—	—	—	不動産
LOEWS CORP	83	83	457	52,039	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	62.49	66.49	454	51,696	金融
MCDONALD'S CORP	243	270.5	6,770	770,292	一般消費財・サービス
3M CO	188.5	210.4	3,707	421,845	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	787.5	869	29,374	3,341,971	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	79	87.7	4,077	463,889	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	21.1	23.1	966	109,943	素材
SOLAREDDGE TECHNOLOGIES INC	—	19.2	666	75,843	情報技術
CONCHO RESOURCES INC	62	—	—	—	その他
PHILLIPS 66	141.5	157.5	1,100	125,180	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	152.5	160.5	660	75,103	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	40.5	92	800	91,051	生活必需品
METLIFE INC	255.5	270	1,617	183,969	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	217	299.5	2,246	255,624	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	18.7	84.8	1,073	122,139	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	48	48	404	46,008	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	56.58	62.28	1,616	183,871	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	8	8.5	1,305	148,559	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	213.73	265.23	624	71,002	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	37.6	41.9	1,427	162,353	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	826.21	918.21	6,876	782,336	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	242.18	207.51	1,598	181,879	素材
MASCO CORP	87	91	612	69,717	資本財・サービス
M & T BANK CORP	42.89	46.89	713	81,172	金融
MARSH & MCLENNAN COS	168.5	185.2	3,093	351,935	金融
BLACK KNIGHT INC	50	56	409	46,598	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	25	27.2	345	39,300	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	91.22	101.72	1,533	174,481	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	56.8	69	1,942	221,051	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	21	27.1	724	82,477	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	118	142	3,022	343,898	情報技術
TRANSUNION	61.5	69	787	89,593	資本財・サービス
VISTRA CORP	142.5	156.5	314	35,770	公益事業
BEIGENE LTD-ADR	14.5	—	—	—	ヘルスケア
NOVOCURE LTD	—	34.5	322	36,640	ヘルスケア
NETAPP INC	74.5	82	750	85,380	情報技術
NIKE INC -CL B	406	462	7,847	892,866	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	84.5	90.5	2,432	276,699	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	80	201	1,696	193,003	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	41.5	68.55	689	78,433	金融
ALLY FINANCIAL INC	125.5	136.5	651	74,091	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	52.2	57.1	2,034	231,520	資本財・サービス
APTIV PLC	87	97.5	1,613	183,571	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	264.61	293.11	1,623	184,743	素材
MCKESSON CORP	52.5	57.5	1,283	146,058	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	87	—	—	—	情報技術
XYLEM INC	58.7	66.7	825	93,945	資本財・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	510	565	4,935	561,486	生活必需品
NUCOR CORP	99	109.5	1,227	139,614	素材
SUNRUN INC	39	61	291	33,214	資本財・サービス
WESTERN UNION CO	129.46	152.46	246	28,030	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	57	60	414	47,162	情報技術
NEWELL BRANDS INC	125.42	134.42	300	34,179	一般消費財・サービス
EVERGY INC	74	82.5	538	61,253	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	302.24	343.24	1,031	117,385	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	8.2	9	183	20,907	金融
OKTA INC	38.6	45.1	1,008	114,734	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	21.8	25.5	516	58,794	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	36	56	895	101,899	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	133.55	157.55	475	54,113	ヘルスケア
LINDE PLC	171.96	188.46	6,044	687,701	素材
WIX.COM LTD	17.8	21.3	339	38,620	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	133	143	461	52,451	金融
KKR & CO INC	163	188	1,434	163,217	金融
PAYCHEX INC	107	117	1,447	164,698	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	24.1	24.8	1,597	181,746	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	611.5	667	2,900	329,946	生活必需品
P G & E CORP	355	551	682	77,606	公益事業
PFIZER INC	1,819.13	2,031.13	10,643	1,210,867	ヘルスケア
CIGNA CORP	121.6	126.2	2,519	286,595	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	78.51	101.01	581	66,158	情報技術
ALTICE USA INC- A	109	109	174	19,829	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	174.5	197	1,292	147,004	公益事業
STERIS PLC	28.5	36	816	92,845	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	—	27	804	91,527	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	54.33	54.33	187	21,318	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	108.49	121.99	450	51,240	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	111.2	123.3	3,002	341,577	ヘルスケア
LYFT INC-A	—	92	384	43,772	資本財・サービス
DOW INC	240.68	273.68	1,556	177,042	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	28	38.5	374	42,618	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	51.8	77.4	1,694	192,829	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	41.7	46.6	1,440	163,896	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	315	445	1,766	200,991	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	53.5	84.5	1,549	176,274	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	809.17	886.67	13,213	1,503,260	生活必需品
EXELON CORP	322.72	357.72	1,937	220,460	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	73.5	—	—	—	その他
TELADOC HEALTH INC	23	51	542	61,741	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	113.58	147.08	879	100,065	資本財・サービス
NVR INC	1.1	1.2	633	72,108	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	355	492.02	3,549	403,874	エネルギー
TWILIO INC - A	40.5	59.5	1,744	198,496	情報技術
DOCUSIGN INC	57.5	71	1,785	203,153	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	16.1	18.9	845	96,208	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	50	564	64,262	情報技術
PEPSICO INC	454	501	8,223	935,577	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	13	15	265	30,199	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	80	114	284	32,359	情報技術
MONGODB INC	16.2	20.2	1,062	120,878	情報技術
SNAP INC - A	295	347.5	1,697	193,128	コミュニケーション・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CORTEVA INC	248.18	269.18	1,254	142,680	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	128	143	1,501	170,874	金融
AMCO PLC	522	564	653	74,304	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	46.5	69	1,549	176,290	情報技術
ROKU INC	33.5	42.2	976	111,039	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	60	65.5	1,135	129,156	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	208.5	230.5	8,432	959,325	情報技術
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	126	—	—	—	情報技術
10X GENOMICS INC-CLASS A	—	27.5	397	45,193	ヘルスケア
PENTAIR PLC	55.05	59.25	455	51,769	資本財・サービス
QUALCOMM INC	364.5	408.5	7,505	853,932	情報技術
INVESCO LTD	120	141	327	37,280	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	23.5	23.5	534	60,762	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	92	100	709	80,685	金融
DATADOG INC - CLASS A	43.5	68	1,244	141,567	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	131	199	806	91,783	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	25	30.5	435	49,516	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	33.2	38	2,486	282,914	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	74	82.5	1,140	129,743	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	13.5	15	3,273	372,370	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	118	131	1,462	166,416	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	31	34.5	461	52,478	素材
RESMED INC	48.5	53.3	1,369	155,794	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	43.5	47.3	741	84,325	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	36	41.5	476	54,183	資本財・サービス
MODERNA INC	88	123.7	4,558	518,616	ヘルスケア
RALPH LAUREN CORP	14.5	—	—	—	一般消費財・サービス
HUBSPOT INC	—	15.9	1,354	154,105	情報技術
PERKINELMER INC	37.3	41.3	764	87,029	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	266.37	302.37	1,692	192,574	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	137.18	149.38	1,248	142,043	資本財・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	58	63	462	52,573	金融
AVANTOR INC	155	193.5	769	87,573	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	47	57	323	36,834	金融
DYNATRACE INC	61	67	431	49,142	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	13.3	158.2	1,693	192,691	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	321.35	351.85	828	94,230	金融
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	—	65.5	270	30,806	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	25.3	28.8	376	42,860	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	81.7	93.7	1,256	142,932	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	610.18	701.18	8,053	916,195	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A	65	94	417	47,472	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	24	30	1,067	121,479	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	123.5	140	924	105,234	公益事業
ETSY INC	—	46.5	1,308	148,911	一般消費財・サービス
TESLA INC	242.7	296.2	33,677	3,831,505	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10	70	2,553	290,507	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	178.5	214	541	61,621	情報技術
DRAFTKINGS INC - CL A	—	117	411	46,855	一般消費財・サービス
UNITY SOFTWARE INC	—	21	357	40,694	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	50.22	58.52	1,077	122,603	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	50.4	55.8	1,985	225,919	情報技術
CARVANA CO	—	26.2	764	87,029	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	—	32.5	223	25,387	一般消費財・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	—	85	1,624	184,792	情報技術
PPD INC	—	44	207	23,627	ヘルスケア
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	46.85	47.85	3,197	363,755	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	386.21	433.21	542	61,706	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	—	27	494	56,216	一般消費財・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	—	46	828	94,243	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	108.5	121.5	1,190	135,410	不動産
TWITTER INC	259.5	292	1,336	152,085	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	347.5	386.5	2,427	276,232	公益事業
SYSCO CORP	160	187.5	1,372	156,149	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	84.03	91.03	1,387	157,832	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	—	20	100	11,488	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	43	43	264	30,096	金融
STEEL DYNAMICS INC	66	76.5	469	53,438	素材
SCHLUMBERGER LTD	460.02	503.52	1,492	169,851	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	50.5	58.5	338	38,535	資本財・サービス
AT&T INC	2,332.91	2,589.91	6,187	703,928	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	47	55.5	247	28,123	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	129	155	976	111,131	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	75	701	79,764	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	26.9	91.7	3,065	348,744	素材
SEMPRA ENERGY	96.7	114	1,415	161,084	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	—	65	325	37,019	情報技術
CLARIVATE PLC	—	125	285	32,467	資本財・サービス
OAK STREET HEALTH INC	—	36	110	12,561	ヘルスケア
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	—	560	1,179	134,239	情報技術
TIFFANY & CO	36.5	—	—	—	その他
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	76.5	79.5	827	94,119	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	297.5	335	6,511	740,839	情報技術
SALESFORCE.COM INC	294.21	352.16	10,449	1,188,896	情報技術
WESTROCK CO	85.3	98.8	455	51,841	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	244.84	259.34	2,032	231,202	資本財・サービス
TERADYNE INC	55	60.5	934	106,309	情報技術
UNION PACIFIC CORP	219.8	240.8	5,766	656,020	資本財・サービス
MARATHON PETROLEUM CORP	215.88	234.88	1,451	165,090	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	494.79	549.29	4,555	518,314	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	230.5	262	5,361	609,985	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	62.44	70.44	1,878	213,724	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	43.5	43.5	270	30,807	金融
AMEREN CORPORATION	80.5	92	782	89,062	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	310.16	342.16	15,465	1,759,524	ヘルスケア
VERISIGN INC	33.7	37	904	102,905	情報技術
VALERO ENERGY CORP	131.42	147.92	1,008	114,722	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	17.6	18.9	758	86,315	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	86.88	98.88	493	56,191	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	25	28.3	343	39,045	ヘルスケア
ANTHEM INC	83	89.2	3,712	422,391	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	591.62	658.62	9,735	1,107,558	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,274.22	1,499.22	7,370	838,503	金融
WASTE MANAGEMENT INC	140	152	2,535	288,499	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	402	438	1,226	139,577	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	37	42.5	963	109,614	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	19.5	23.2	516	58,801	一般消費財・サービス
WALMART INC	464	561	8,001	910,335	生活必需品

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	67.5	76.5	944	107,487	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	30.5	37	307	34,938	一般消費財・サービス
WABTEC CORP	58.61	65.11	602	68,497	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	394	438	3,095	352,157	一般消費財・サービス
WATERS CORP	20.5	22.3	760	86,569	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	17.6	18.9	1,147	130,563	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	247	265	1,221	138,926	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	41.73	47.43	1,092	124,321	金融
WESTERN DIGITAL CORP	97.5	112.5	663	75,502	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	104.8	114.3	1,034	117,672	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	168	182.5	1,172	133,402	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	552	612.5	12,022	1,367,829	情報技術
PPL CORP	248	279	793	90,273	公益事業
PULTEGROUP INC	89	94.5	486	55,379	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	78.5	85.3	1,342	152,711	素材
NORTHERN TRUST CORP	64	73	875	99,612	金融
NVIDIA CORP	201	903.8	30,165	3,431,898	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	138.43	154.63	3,106	353,393	金融
HD SUPPLY HOLDINGS INC	53	—	—	—	その他
TYSON FOODS INC-CL A	98	108.5	888	101,073	生活必需品
NETFLIX INC	144	160.7	10,667	1,213,687	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	129.2	142.4	9,238	1,051,062	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	79.5	86.5	316	36,047	公益事業
GLOBE LIFE INC	32.25	36.55	323	36,788	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	57	64.5	1,383	157,366	金融
TEXTRON INC	71.5	83	604	68,734	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	131.37	141.37	308	35,094	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	67.5	—	—	—	公益事業
OMNICOM GROUP	71.5	79.5	536	61,024	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	720.33	681.33	6,332	720,423	情報技術
MASTERCARD INC - A	292	320.5	10,352	1,177,800	情報技術
ONEOK INC	144	164	1,024	116,539	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	311.52	347.52	450	51,200	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	34.2	38	1,829	208,156	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	98	108.5	1,358	154,609	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	37	42.5	720	82,005	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	60.5	69.5	315	35,842	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	2,556.01	2,794.01	12,737	1,449,189	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	12.1	17.2	742	84,512	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	58.5	67.5	589	67,118	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	226	247.5	3,907	444,503	金融
ANALOG DEVICES INC	121.99	193.91	3,552	404,160	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	383	441.5	7,148	813,265	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	283.22	311.72	1,712	194,876	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	55	59.5	921	104,870	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	59	84.5	590	67,189	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	27.5	30.3	653	74,298	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	179	191.5	1,526	173,663	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	197	215.5	1,958	222,765	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	76.2	82.4	2,444	278,136	金融
AMGEN INC	192.5	208.5	4,242	482,652	ヘルスケア
EATON CORP PLC	130.86	145.86	2,441	277,758	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	55.8	62.5	1,418	161,389	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	302	332.5	5,028	572,042	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CME GROUP INC	118	131.2	2,956	336,341	金融
NOV INC	116.94	—	—	—	エネルギー
ECOLAB INC	84.5	94	2,135	242,922	素材
EQUIFAX INC	40.5	44.3	1,258	143,166	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	411.5	456.5	3,225	366,927	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	115	255	896	102,032	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	96	105.5	448	50,999	生活必需品
STATE STREET CORP	117.43	124.63	1,161	132,135	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	502.9	525.4	4,208	478,795	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	169	182	1,383	157,428	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	60	70	288	32,811	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	45.5	49.8	539	61,416	素材
CARDINAL HEALTH INC	94.5	104	493	56,166	ヘルスケア
FEDEX CORP	82	92	2,213	251,800	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	151.04	165.04	2,426	276,053	金融
FMC CORP	42	46.5	481	54,775	素材
CERNER CORP	100.5	108.5	790	89,938	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	28.24	90.13	1,326	150,929	素材
CITRIX SYSTEMS INC	38	46	378	43,107	情報技術
INTEL CORP	1,386	1,465	7,325	833,365	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	124	142	483	54,960	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	116.5	131.5	902	102,645	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	103	115.5	2,750	312,886	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	346	386	242	27,534	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	48.5	53.3	1,976	224,856	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	50	54	346	39,441	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	38.2	128.7	4,308	490,132	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	40.5	43.5	483	54,988	情報技術
SNAP-ON INC	16.3	20.2	429	48,909	資本財・サービス
CARMAX INC	53.5	58	849	96,657	一般消費財・サービス
COMERICA INC	45	—	—	—	金融
INGREDION INC	21.5	—	—	—	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	241.78	280.28	2,808	319,576	公益事業
TARGET CORP	162.8	179.5	4,472	508,827	一般消費財・サービス
DOVER CORP	48	52	893	101,637	資本財・サービス
VWV GRAINGER INC	14.9	15.8	783	89,083	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	42.5	47.2	689	78,449	資本財・サービス
CINTAS CORP	29.4	34.2	1,486	169,150	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	158	173	545	62,018	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	47.5	54.5	290	33,042	生活必需品
CLOROX COMPANY	40.5	44.3	749	85,256	生活必需品
ENTERGY CORP	66.5	74.2	779	88,697	公益事業
MICROSOFT CORP	2,359	2,596	87,389	9,942,263	情報技術
INCYTE CORP	60	69.3	487	55,481	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	429.69	477.69	4,395	500,099	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	438.98	488.98	5,392	613,501	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	366.5	408.5	3,518	400,336	情報技術
BLACKROCK INC	50	55.1	5,113	581,737	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	158	211	561	63,830	公益事業
HASBRO INC	44	47	465	53,006	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	84	93	593	67,578	生活必需品
KEYCORP	326	354	808	91,946	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	31.5	33.5	992	112,886	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	468.11	510.61	3,096	352,270	生活必需品

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	当株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
COOPER COS INC/THE	17.7	17.7	674	76,761	ヘルスケア	
CHUBB LTD	148.69	162.19	3,001	341,442	金融	
ARROW ELECTRONICS INC	27	27	335	38,219	情報技術	
ALLSTATE CORP	102.5	109.5	1,238	140,947	金融	
EBAY INC	256.5	249	1,756	199,859	一般消費財・サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	365	405	7,583	862,742	情報技術	
EASTMAN CHEMICAL CO	45.5	50.5	556	63,302	素材	
XILINX INC	80	88.5	2,062	234,679	情報技術	
DISH NETWORK CORP-A	82	89	294	33,545	コミュニケーション・サービス	
ZIONS BANCORP NA	52	—	—	—	金融	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	74.5	84.7	2,880	327,683	生活必需品	
TRIMBLE INC	82.5	90.5	783	89,092	情報技術	
LENNAR CORP-A	90	100.5	1,077	122,628	一般消費財・サービス	
LEAR CORP	18	21.5	363	41,338	一般消費財・サービス	
PROGRESSIVE CORP	193	213.9	2,031	231,113	金融	
PACCAR INC	114.87	125.37	1,079	122,835	資本財・サービス	
BIOGEN INC	56.2	55.2	1,303	148,279	ヘルスケア	
IDEXX LABORATORIES INC	27.7	30.9	1,950	221,933	ヘルスケア	
STARBUCKS CORP	383.5	427.5	4,733	538,553	一般消費財・サービス	
PTC INC	37	40.2	443	50,455	情報技術	
PERRIGO CO PLC	42	—	—	—	ヘルスケア	
EVERSOURCE ENERGY	109.8	124.1	1,058	120,391	公益事業	
INTUIT INC	85.7	98.8	6,863	780,830	情報技術	
BORGWARNER INC	82	87.5	392	44,607	一般消費財・サービス	
BEST BUY CO INC	76	82.5	915	104,137	一般消費財・サービス	
BALL CORP	105.84	119.84	1,136	129,265	素材	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	470.97	517.97	1,998	227,408	ヘルスケア	
ELECTRONIC ARTS INC	95.7	105.7	1,319	150,174	コミュニケーション・サービス	
VULCAN MATERIALS CO	43.5	49	976	111,132	素材	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	85.5	93.5	1,777	202,229	ヘルスケア	
VF CORP	109	122.5	903	102,756	一般消費財・サービス	
VIACOMCBS INC - CLASS B	183.75	220.25	710	80,886	コミュニケーション・サービス	
MOHAWK INDUSTRIES INC	19	22	383	43,646	一般消費財・サービス	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	30.7	—	—	—	その他	
CARNIVAL CORP	153	300	544	61,981	一般消費財・サービス	
COMCAST CORP-CLASS A	1,490.9	1,660.9	8,558	973,713	コミュニケーション・サービス	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	72	—	—	—	その他	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	75	83	484	55,118	資本財・サービス	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	90	—	—	—	生活必需品	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	403	448	249	28,338	不動産	
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	102,065.16 591銘柄	114,614.26 598銘柄	1,496,632	170,271,878 <67.9%>	
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD	83	91	389	34,805	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	7	7	1,543	137,792	情報技術	
RESTAURANT BRANDS INTERN	92.87	96.87	706	63,085	一般消費財・サービス	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	149	161	868	77,530	素材	
INTACT FINANCIAL CORP	46.5	64.5	1,040	92,899	金融	
BCE INC	49.3	49.3	319	28,541	コミュニケーション・サービス	
FRANCO-NEVADA CORP	62	69	1,241	110,836	素材	
SUNCOR ENERGY INC	501.3	542.3	1,732	154,656	エネルギー	
METRO INC/CN	82	86	534	47,708	生活必需品	
NATIONAL BANK OF CANADA	110	120	1,222	109,114	金融	

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
BANK OF NOVA SCOTIA	399	435	3,542	316,177	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	146.5	159.5	2,322	207,276	金融
TORONTO-DOMINION BANK	594	652	6,102	544,670	金融
GREAT-WEST LIFE CO INC	91	98	367	32,759	金融
ROYAL BANK OF CANADA	467.5	510.5	6,622	591,143	金融
TC ENERGY CORP	310.5	352.5	2,150	191,994	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	178.29	197.29	760	67,886	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	586	633	1,546	138,033	素材
CAE INC	79	109	343	30,686	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	57.12	62.12	969	86,499	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	53	59	218	19,543	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	35	373	33,343	素材
BALLARD POWER SYSTEMS INC	—	78	152	13,625	資本財・サービス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	46.5	54.5	345	30,871	素材
HYDRO ONE LTD	105	113	351	31,388	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	59.6	59.6	577	51,528	生活必需品
NORTHLAND POWER INC	—	79	306	27,388	公益事業
WSP GLOBAL INC	37	43	781	69,793	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	—	28	310	27,727	資本財・サービス
PARKLAND CORP	44	51	174	15,555	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	53	60	174	15,531	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	77	90	534	47,678	公益事業
SSR MINING INC	72	—	—	—	素材
CANADIAN UTILITIES LTD-A	40	48	169	15,124	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	116	127	733	65,431	コミュニケーション・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	—	225	232	20,746	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	78	87	562	50,165	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	189	215	377	33,660	公益事業
B2GOLD CORP	347	347	177	15,858	素材
AIR CANADA	41	65	138	12,358	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	403	432	332	29,691	素材
BANK OF MONTREAL	211	231	3,164	282,501	金融
POWER CORP OF CANADA	181	201	840	75,048	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	35	41	8,200	731,932	情報技術
NUTRIEN LTD	188.19	203.19	1,773	158,261	素材
CANOPY GROWTH CORP	74	84	118	10,564	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	55	—	—	—	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	88	96	488	43,633	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	—	47	224	20,019	公益事業
CAMECO CORP	128	140	445	39,776	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	—	14	354	31,625	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	—	65	332	29,694	資本財・サービス
LIGHTSPEED COMMERCE INC	—	39	265	23,727	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	—	19	233	20,831	情報技術
TELUS CORP	108	108	318	28,428	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	151	170	576	51,425	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	18	22	382	34,178	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	389	420	2,244	200,304	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	9	10	566	50,587	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	92	102	1,023	91,382	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	25.37	27.37	373	33,342	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	70	70	228	20,381	素材
BLACKBERRY LTD	160	194	243	21,749	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	192.5	208.5	1,431	127,799	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	当 株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
ENBRIDGE INC	665	727	3,543	316,283	エネルギー	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	434.25	461.25	3,407	304,131	金融	
MANULIFE FINANCIAL CORP	638	691	1,652	147,535	金融	
BAUSCH HEALTH COS INC	105	105	333	29,794	ヘルスケア	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	45	240	2,194	195,886	資本財・サービス	
IA FINANCIAL CORP INC	33	37	258	23,078	金融	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	63	70	372	33,290	一般消費財・サービス	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	233.5	255.5	4,184	373,469	資本財・サービス	
CGI INC - CLASS A	79	79	848	75,754	情報技術	
ONEX CORPORATION	26	26	248	22,188	金融	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	151	160	595	53,184	コミュニケーション・サービス	
IGM FINANCIAL INC	24	31	151	13,522	金融	
TMX GROUP LTD	19	19	244	21,811	金融	
OPEN TEXT CORP	87	99	614	54,823	情報技術	
CI FINANCIAL CORP	70	—	—	—	金融	
SAPUTO INC	80	87	252	22,504	生活必需品	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	193	204	572	51,112	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	283	302	1,434	128,070	生活必需品	
YAMANA GOLD INC	323	323	166	14,876	素材	
FORTIS INC	150	166	928	82,916	公益事業	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	38	38	336	30,072	資本財・サービス	
LUNDIN MINING CORP	194	221	230	20,554	素材	
CENOVUS ENERGY INC	314	467	740	66,111	エネルギー	
DOLLARAMA INC	97	107	603	53,876	一般消費財・サービス	
ATCO LTD -CLASS I	22	29	123	11,011	公益事業	
ALTAGAS LTD	91	103	256	22,929	公益事業	
KEYERA CORP	74	74	213	19,016	エネルギー	
INTER PIPELINE LTD	128	—	—	—	エネルギー	
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,687.79 82銘柄	14,425.79 88銘柄	89,694	8,006,114 <3.2%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
MEDIBANK PRIVATE LTD	888	970	325	26,494	金融	
BHP GROUP LTD	957.5	1,034	3,988	324,195	素材	
SOUTH32 LTD	1,516	1,601	571	46,461	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	305.5	335.5	712	57,927	エネルギー	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	565	591	1,040	84,554	素材	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,024.5	1,159.5	3,153	256,375	金融	
WESTPAC BANKING CORP	1,173.48	1,289.48	2,697	219,287	金融	
SANTOS LTD	531	629	401	32,672	エネルギー	
AUSNET SERVICES	650	650	163	13,315	公益事業	
AUST AND NZ BANKING GROUP	924.5	1,008.5	2,684	218,233	金融	
RIO TINTO LTD	122.5	130	1,240	100,805	素材	
ORIGIN ENERGY LTD	535	590	290	23,596	公益事業	
AURIZON HOLDINGS LTD	600	600	204	16,631	資本財・サービス	
XERO LTD	—	47.5	670	54,525	情報技術	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	34	34	105	8,598	エネルギー	
COLES GROUP LTD	430.45	468.45	844	68,658	生活必需品	
WISETECH GLOBAL LTD	45	54	279	22,742	情報技術	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	250	370	357	29,054	素材	
EVOLUTION MINING LTD	530	595	245	19,927	素材	
AFTERPAY LTD	70	76	840	68,298	情報技術	
TPG TELECOM LTD	120	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
REECE LTD	—	105	246	20,024	資本財・サービス	

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	—	473	324	26,338	生活必需品
OIL SEARCH LTD	642	642	251	20,405	エネルギー
SEEK LTD	107	117	401	32,622	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	235	256	305	24,805	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	260	285	689	56,019	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	574.5	623.5	5,847	475,317	金融
AMPOL LTD	79.5	79.5	229	18,696	エネルギー
ORICA LTD	131	131	188	15,313	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	464.5	519.5	602	48,986	金融
CIMIC GROUP LTD	28	—	—	—	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	413	441	1,768	143,754	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	157	—	—	—	その他
TABCORP HOLDINGS LTD	727.63	782.63	390	31,746	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	116	134	148	12,091	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	305	305	149	12,148	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	1,345	1,435	574	46,660	コミュニケーション・サービス
AMP LTD	1,020	—	—	—	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	142.5	156.5	859	69,881	素材
MACQUARIE GROUP LTD	110.84	119.84	2,325	189,000	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	184.5	211.3	942	76,590	一般消費財・サービス
CSL LTD	147.5	160	4,912	399,296	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	370	403	2,345	190,695	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	20.5	23.2	525	42,748	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	163	178	361	29,416	素材
SUNCORP GROUP LTD	412.57	436.57	464	37,795	金融
ASX LTD	62.5	67	609	49,573	金融
COMPUTERSHARE LTD	159	182	348	28,317	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	709.36	861.36	376	30,598	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	143.5	159.5	681	55,363	ヘルスケア
AGL ENERGY LTD	190	215	114	9,315	公益事業
BRAMBLES LTD	504	504	509	41,379	資本財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	57.5	61.5	407	33,095	ヘルスケア
REA GROUP LTD	16	18	289	23,557	コミュニケーション・サービス
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	38	44	143	11,670	金融
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	22	286	23,279	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	21,308.83 53銘柄	22,384.83 53銘柄	49,438 4,018,864 <1.6%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	475	525	2,509	36,613	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	770	830	3,622	52,858	一般消費財・サービス
MTR CORP	525	585	2,457	35,847	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	445	510	4,934	71,990	不動産
SINO LAND CO	1,040	1,260	1,215	17,739	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	956.69	1,046.69	5,285	77,119	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	155	185	814	11,889	不動産
CLP HOLDINGS LTD	560	620	4,761	69,471	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	485.07	555.07	1,834	26,765	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	3,773.58	4,224.75	5,002	72,980	公益事業
HANG SENG BANK LTD	261	288	4,057	59,205	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT	525	585	1,848	26,971	不動産
WH GROUP LTD	3,210	3,610	1,841	26,861	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	419	461	20,514	299,306	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	660	780	1,248	18,208	不動産

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千香港・ドル	千円		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	108	—	—	—	情報技術	
KERRY PROPERTIES LTD	225	—	—	—	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	452.4	—	—	—	金融	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	260	—	—	—	ヘルスケア	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	—	690	1,337	19,510	資本財・サービス	
SJM HOLDINGS LTD	580	710	396	5,780	一般消費財・サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	382	450	873	12,737	不動産	
CK ASSET HOLDINGS LTD	911.69	911.69	4,129	60,256	不動産	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	200	235	1,092	15,943	公益事業	
PCCW LTD	1,470	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
AIA GROUP LTD	4,194	4,614	38,711	564,800	金融	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	—	540	1,555	22,690	資本財・サービス	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	570	630	2,535	36,996	不動産	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	609	679	1,371	20,011	生活必需品	
ESR CAYMAN LTD	—	750	1,938	28,286	不動産	
SANDS CHINA LTD	824	928	1,733	25,291	一般消費財・サービス	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	—	820	1,193	17,419	一般消費財・サービス	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	470	530	8,729	127,357	資本財・サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,255	1,415	3,396	49,547	金融	
WYNN MACAU LTD	540	540	388	5,664	一般消費財・サービス	
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	27,311.43 31銘柄	30,508.2 30銘柄	131,331	1,916,123 <0.8%>	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
CAPITALAND INVESTMENT LTD	—	1,024	345	28,714	不動産	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	420	452	1,199	99,781	金融	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	629	699	2,152	179,086	金融	
SINGAPORE AIRLINES LTD	436.75	484.75	238	19,804	資本財・サービス	
KEPPEL CORP LTD	513	563	293	24,407	資本財・サービス	
UOL GROUP LTD	140	171	117	9,775	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	161	161	112	9,377	不動産	
CAPITALAND LTD	829	—	—	—	不動産	
YANGZIJIAN SHIPBUILDING	913	—	—	—	資本財・サービス	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	27	—	—	—	一般消費財・サービス	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,164	1,293	1,466	122,007	金融	
GENTING SINGAPORE LTD	2,090	2,090	165	13,738	一般消費財・サービス	
VENTURE CORP LTD	86	99	186	15,495	情報技術	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,909.5	3,201.5	771	64,201	コミュニケーション・サービス	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	500	565	216	18,053	資本財・サービス	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	273	315	290	24,192	金融	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	659	744	311	25,939	生活必需品	
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,750.25 16銘柄	11,862.25 14銘柄	7,866	654,577 <0.3%>	
(ニュージーランド)		百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	415	475	213	16,535	公益事業	
MERCURY NZ LTD	230	260	152	11,792	公益事業	
A2 MILK CO LTD	262	262	162	12,593	生活必需品	
SPARK NEW ZEALAND LTD	620.89	727.89	316	24,576	コミュニケーション・サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	389	483	376	29,152	資本財・サービス	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	204	232	765	59,356	ヘルスケア	
RYMAN HEALTHCARE LTD	140	165	199	15,478	ヘルスケア	
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,260.89 7銘柄	2,604.89 7銘柄	2,186	169,486 <0.1%>	

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BP PLC	6,665	7,330	2,402	364,053	エネルギー
UNILEVER PLC	384.1	948.6	3,719	563,721	生活必需品
BARCLAYS PLC	5,688	6,223	1,140	172,861	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,795	3,005	368	55,791	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	849	951	1,231	186,580	金融
NATWEST GROUP PLC	1,597.91	2,102.91	442	67,058	金融
EVRAZ PLC	150	174	99	15,084	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	60.64	70.64	150	22,836	素材
BAE SYSTEMS PLC	1,065	1,170	643	97,493	資本財・サービス
AVIVA PLC	1,289.66	1,423.66	538	81,604	金融
AVEVA GROUP PLC	20	44	141	21,473	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,651	1,823	2,780	421,348	ヘルスケア
INFORMA PLC	499	527	249	37,859	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,565	1,595.4	233	35,314	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	319	350	256	38,850	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	31.5	34	191	29,032	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	152	175	320	48,643	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	24.5	27.5	435	66,019	資本財・サービス
HALMA PLC	122.5	137	414	62,893	情報技術
ENTAIN PLC	191	212	370	56,100	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	146	172	196	29,756	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	235	151	22,937	金融
M&G PLC	837	917	174	26,454	金融
RELX PLC	631.46	703.96	1,649	249,979	資本財・サービス
DIAGEO PLC	769	847	3,238	490,827	生活必需品
RIO TINTO PLC	370	407	1,880	285,076	素材
STANDARD CHARTERED PLC	868	970	401	60,892	金融
TESCO PLC	3,207	2,806.84	783	118,687	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	290.5	319.5	396	60,045	ヘルスケア
GLENCORE PLC	3,307.25	3,645.25	1,301	197,316	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	102.5	124.5	167	25,313	金融
SMITHS GROUP PLC	123.83	143.83	209	31,739	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	419.83	465.83	124	18,864	金融
PEARSON PLC	235.63	257.63	158	23,997	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	542.25	595.25	172	26,135	生活必需品
NEXT PLC	44.5	48.5	386	58,525	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	1,177	1,277	198	30,095	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	68.61	73.61	211	32,074	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	112.05	119.05	341	51,729	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	8,701.83	10,141.83	1,116	169,264	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	42.61	50.11	504	76,440	素材
KINGFISHER PLC	682.11	737.11	240	36,419	一般消費財・サービス
WPP PLC	409	429	454	68,952	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	228.27	248.27	270	40,957	公益事業
SEVERN TRENT PLC	78.33	90.83	264	40,018	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	612	673	416	63,097	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	234.5	260	1,602	242,896	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	165.5	194.5	303	46,060	金融
SCHRODERS PLC	41.5	41.5	145	22,121	金融
SSE PLC	339	376	585	88,785	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	340	367	254	38,535	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	431.5	561	4,693	711,405	ヘルスケア
FERGUSON PLC	74.87	80.87	934	141,625	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	当 株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,955	2,152	613	92,922	金融
3I GROUP PLC	313.91	350.91	487	73,819	金融
ASHTED GROUP PLC	146.5	161.5	989	150,043	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	351.14	401.14	311	47,239	情報技術
NATIONAL GRID PLC	1,144.34	1,296.34	1,297	196,709	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	22,964.65	25,754.65	1,205	182,677	金融
RSA INSURANCE GROUP LTD	317.6	—	—	—	その他
IMPERIAL BRANDS PLC	304	341	532	80,778	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	41.5	38.32	165	25,118	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	753.6	790.6	2,020	306,268	生活必需品
BHP GROUP PLC	687.27	768.27	1,551	235,090	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	115	128.5	245	37,139	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	6,696.5	7,416.5	3,088	468,108	金融
ANGLO AMERICAN PLC	403.83	465.83	1,250	189,458	素材
MONDI PLC	156.5	176	307	46,627	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	734	—	—	—	生活必需品
COMPASS GROUP PLC	589.39	647.39	985	149,336	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	106	112	309	46,833	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	2,901	3,206	523	79,396	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	65.5	71.5	168	25,498	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	132.89	142.89	256	38,873	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	56.36	64.36	296	44,870	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	52	58.5	320	48,587	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	104.99	120.49	827	125,456	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,350	1,489	2,374	359,903	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,223.18	1,346.18	2,145	325,219	エネルギー
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	57	57	127	19,264	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	61.5	70.5	212	32,193	金融
ANTOFAGASTA PLC	128	141	197	29,875	素材
ABRDN PLC	708.62	778.62	183	27,826	金融
EXPERIAN PLC	296.54	336.54	1,138	172,553	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	95,671.55 105,587.01	64,194	9,729,339	<3.9%>
	百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
(イスラエル)					
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	345	443	874	31,507	金融
AZRIELI GROUP LTD	14	16.5	479	17,284	不動産
ICL GROUP LTD	236	281	801	28,859	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	9.5	9.5	447	16,113	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	357	441	1,355	48,818	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	512	562	1,744	62,819	金融
NICE LTD	22	24	2,123	76,461	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	41	54	632	22,771	金融
イスラエル・シェケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,536.5 8銘柄	1,831 8銘柄	8,459	304,635 <0.1%>
	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)					
UBS GROUP AG-REG	1,200	1,306	2,057	253,599	金融
ROCHE HOLDING AG-BR	—	11	421	51,925	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2.8	2.8	249	30,713	素材
ADECCO GROUP AG-REG	51.5	51.5	225	27,763	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	229.8	250	8,937	1,101,546	ヘルスケア
SIKA AG-REG	47.1	51	1,854	228,612	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.03	0.04	449	55,363	生活必需品

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
ABB LTD-REG	601	627	2,002	246,825	資本財・サービス	
SWISS RE AG	97.5	107	927	114,285	金融	
NESTLE SA-REG	972	1,027	12,334	1,520,198	生活必需品	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	5.9	8	1,260	155,295	金融	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	12.6	15	360	44,425	資本財・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	799.7	909.2	806	99,351	金融	
JULIUS BAER GROUP LTD	74	80	457	56,379	金融	
SGS SA-REG	2	2.1	597	73,661	資本財・サービス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	6.9	6.9	161	19,899	資本財・サービス	
VIFOR PHARMA AG	14.5	17.5	184	22,690	ヘルスケア	
TEMENOS AG - REG	21.2	23	278	34,385	情報技術	
ALCON INC	161.3	178	1,300	160,326	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	9.7	9.7	265	32,661	一般消費財・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	48.62	53.42	2,039	251,377	金融	
BALOISE HOLDING AG - REG	15.7	17	235	28,977	金融	
CLARIANT AG-REG	57	77	139	17,186	素材	
NOVARTIS AG-REG	726	791	5,872	723,771	ヘルスケア	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1.2	265	32,685	生活必需品	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	171.6	186	2,583	318,421	一般消費財・サービス	
SWISSCOM AG-REG	8.3	9	462	56,948	コミュニケーション・サービス	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	10.1	10.1	71	8,813	金融	
GEBERIT AG-REG	11.9	13	907	111,837	資本財・サービス	
GIVAUDAN-REG	3	3.3	1,492	184,002	素材	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	3.4	3.6	700	86,299	ヘルスケア	
SONOVA HOLDING AG-REG	18.22	19.92	685	84,505	ヘルスケア	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	55	62	467	57,647	情報技術	
LONZA GROUP AG-REG	24	26.9	1,964	242,158	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	15.2	19	100	12,422	一般消費財・サービス	
HOLCIM LTD	172.9	185.4	843	103,924	素材	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	10.4	11.1	582	71,769	金融	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	18	19.2	510	62,969	資本財・サービス	
SWISS PRIME SITE-REG	25.1	27	239	29,483	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.34	0.34	385	47,478	生活必需品	
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,705.31 39銘柄	6,218.22 40銘柄	55,680 <2.7%>	6,862,594	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円		
NOVO NORDISK A/S-B	595	648	46,377	800,937	ヘルスケア	
DANSKE BANK A/S	227	260	2,852	49,257	金融	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1.05	1.2	2,222	38,380	資本財・サービス	
H LUNDBECK A/S	23	—	—	—	ヘルスケア	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	68	386.5	8,560	147,848	資本財・サービス	
GN STORE NORD A/S	43	48.5	1,870	32,297	ヘルスケア	
CARLSBERG AS-B	36.5	39	4,145	71,596	生活必需品	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	72.5	78.5	3,835	66,239	素材	
COLOPLAST-B	40.5	45	4,835	83,504	ヘルスケア	
DSV PANALPINA A/S	71.6	79.1	11,291	195,004	資本財・サービス	
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	—	3	822	14,211	資本財・サービス	
DEMANT A/S	34.25	38.75	1,219	21,053	ヘルスケア	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2.2	2.3	4,521	78,091	資本財・サービス	
TRYG A/S	40	132	2,088	36,075	金融	
PANDORA A/S	35	38	3,203	55,322	一般消費財・サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	34.5	40.5	1,993	34,419	素材	
GENMAB A/S	22.9	25.2	6,426	110,977	ヘルスケア	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	首数	当期		業種等		
			株数	株数		期末	
						評価額	評価額
ORSTED A/S	66	百株	70.5	百株	千デンマーク・クローネ	千円	公益事業
AMBU A/S-B	56		63		5,965	103,027	ヘルスケア
デンマーク・クローネ通貨計	1,469		1,999.05		113,435	1,959,025	
	銘柄数 < 比率 >	18 銘柄	18 銘柄			<0.8% >	
(ノルウェー)		百株	百株		千ノルウェー・クローネ	千円	
DNB BANK	—		367.5		7,416	93,517	金融
NORSK HYDRO ASA	417		507		3,067	38,679	素材
DNB	331		—		—	—	金融
ORKLA ASA	244.5		290.5		2,443	30,807	生活必需品
TELENOR ASA	254		278		3,833	48,341	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	338.23		382.23		8,682	109,484	エネルギー
SCHIBSTED ASA-CL A	—		28		1,149	14,490	コミュニケーション・サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	57.1		66.6		2,966	37,405	素材
MOWI ASA	141		166		3,492	44,042	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	73.5		73.5		1,523	19,213	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	31		36.5		1,306	16,477	コミュニケーション・サービス
ADEVINTA ASA	81		106		1,398	17,637	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計	1,968.33		2,301.83		37,279	470,097	
	銘柄数 < 比率 >	10 銘柄	11 銘柄			<0.2% >	
(スウェーデン)		百株	百株		千スウェーデン・クローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB	35.2		38.7		2,067	25,903	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	996.3		1,128.3		10,585	132,638	情報技術
VOLVO AB-B SHS	508.5		556.5		11,036	138,287	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES	133		144		3,028	37,944	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	76		86		1,751	21,950	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	56.5		613		4,105	51,446	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	168		188		2,465	30,894	コミュニケーション・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	574		620		8,153	102,157	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	528.5		548.5		5,284	66,211	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	318		341		6,259	78,430	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	282		282		4,585	57,461	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	207		229		3,451	43,241	素材
SKANSKA AB-B SHS	115.5		128.5		2,702	33,860	資本財・サービス
SANDVIK AB	384.5		431		9,887	123,885	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	156		700		14,829	185,813	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	229.5		254.5		14,190	177,812	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS	—		80		1,616	20,248	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	109.5		119.5		1,588	19,907	資本財・サービス
TELIA CO AB	862		1,002		3,544	44,413	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	110		119		4,303	53,917	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	132.5		149		7,081	88,737	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	341.5		387.5		10,036	125,754	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	—		47.43		1,304	16,343	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	—		40		2,739	34,322	不動産
LUNDBERGS AB-B SHS	26		30		1,523	19,088	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	52		57		1,948	24,418	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	104		543		6,901	86,476	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB	63.5		75.5		2,557	32,041	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	212		230		6,725	84,266	生活必需品
EMBRACER GROUP AB	—		200		1,901	23,827	コミュニケーション・サービス
LOLIDEN AB	93		104		3,186	39,927	素材
EPIROC AB-A	222.5		249.5		5,444	68,214	資本財・サービス

銘	柄	期 首		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
EPIROC AB-B		135	148	2,671	33,472	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		141.5	158.5	2,083	26,106	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP		1,111	1,250	13,405	167,964	金融
EQT AB		81	91	4,835	60,591	金融
EVOLUTION AB		44	65.5	6,572	82,350	一般消費財・サービス
SINCH AB		—	194	2,396	30,032	情報技術
KINNEVIK AB - B		83	93	3,055	38,285	金融
HEXAGON AB-B SHS		99	764	10,199	127,798	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		57	62	1,683	21,091	金融
スウェーデン・クロネ通貨計	株 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	8,848.5 36 銘柄	12,548.43 41 銘柄	213,690	2,677,537 <1.1%>	
<b>ユーロ (アイルランド)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		75.5	86	394	50,655	素材
KINGSPAN GROUP PLC		50	54	539	69,327	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		51.5	56	606	77,914	生活必需品
CRH PLC		253.5	281	1,219	156,601	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		49.6	60.3	735	94,504	一般消費財・サービス
国 小 計	株 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	480.1 5 銘柄	537.3 5 銘柄	3,496	449,002 <0.2%>	
<b>ユーロ (オランダ)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV		—	278.91	697	89,572	コミュニケーション・サービス
QIAGEN N. V.		72.98	76.98	378	48,663	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		302.1	322.6	1,024	131,503	ヘルスケア
NN GROUP NV		90.5	99	434	55,795	金融
HEINEKEN NV		85.5	92	859	110,387	生活必需品
AEGON NV		582.44	642.44	253	32,495	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		362.33	373.83	1,131	145,234	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.		65.38	67.68	639	82,093	素材
KONINKLIJKE DSM NV		57	62	1,189	152,700	素材
WOLTERS KLUWER		89	96	962	123,643	資本財・サービス
ING GROEP NV		1,262.5	1,396	1,697	217,944	金融
KONINKLIJKE KPN NV		1,146.5	1,211.5	317	40,743	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		139.3	150.1	10,579	1,358,455	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA		130.5	151.5	191	24,652	金融
ADYEN NV		6	7	1,722	221,166	情報技術
UNILEVER NV		479.5	—	—	—	その他
JUST EAT TAKEAWAY		40	64.5	375	48,162	一般消費財・サービス
PROSUS NV		161	333.8	2,359	302,957	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV		—	26	65	8,363	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV		—	17	673	86,532	情報技術
VOPAK		23	23	76	9,799	エネルギー
RANDSTAD NV		37	43	241	30,976	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		37.5	39.5	305	39,208	生活必需品
ALTICE EUROPE NV		205	—	—	—	その他
STMICROELECTRONICS NV		210.5	244	1,049	134,806	情報技術
AIRBUS SE		194	211	2,103	270,105	資本財・サービス
ARGENX SE		14.5	16.4	411	52,837	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		195	195	255	32,764	生活必需品
EXOR NV		35.3	37.8	298	38,287	金融
CNH INDUSTRIAL NV		328	366	546	70,238	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	当株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
STELLANTIS NV	百株 360	百株 732	千ユーロ 1,139	千円 146,333	一般消費財・サービス	
FERRARI NV	41.45	44.95	1,059	136,104	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,753.78 29銘柄	7,421.49 30銘柄	33,038	4,242,530 <1.7%>	
<b>ユーロ (ベルギー)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
GALAPAGOS NV	13.9	—	—	—	ヘルスケア	
UCB SA	41.3	45.3	439	56,447	ヘルスケア	
KBC GROUP NV	82.5	89	645	82,947	金融	
COLRUYT SA	16	16	66	8,495	生活必需品	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	36	40	387	49,730	金融	
SOLVAY SA	24.5	26	257	33,126	素材	
UMICORE	63.5	70	301	38,714	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	249	272	1,382	177,571	生活必需品	
AGEAS	57.9	62.9	291	37,404	金融	
PROXIMUS	49.5	49.5	79	10,189	コミュニケーション・サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	14.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
ELIA GROUP SA/NV	10.5	10.5	114	14,710	公益事業	
SOFINA	5.5	6	244	31,342	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	664.6 13銘柄	687.2 11銘柄	4,210	540,680 <0.2%>	
<b>ユーロ (ルクセンブルグ)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
AROUNDTOWN SA	370	325	179	23,036	不動産	
ARCELORMITTAL	233	257	628	80,655	素材	
INPOST SA	—	70	72	9,269	資本財・サービス	
EUROFINS SCIENTIFIC	44	47.5	536	68,911	ヘルスケア	
SES	110	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
TENARIS SA	133	157	140	17,987	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	890 5銘柄	856.5 5銘柄	1,556	199,860 <0.1%>	
<b>ユーロ (フランス)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA	27	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
TOTALENERGIES SE	810.5	893.5	3,681	472,705	エネルギー	
MICHELIN (CGDE)	57	60.5	776	99,712	一般消費財・サービス	
AIR LIQUIDE SA	155.77	169.77	2,501	321,247	素材	
KERING	25	27	1,846	237,078	一般消費財・サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	182	193.5	2,926	375,791	資本財・サービス	
BOUYGUES SA	74	82	245	31,494	資本財・サービス	
BNP PARIBAS	364.5	403	2,231	286,587	金融	
PEUGEOT SA	191.5	—	—	—	その他	
NATIXIS	295.5	—	—	—	金融	
THALES SA	35	38.5	284	36,524	資本財・サービス	
DANONE	200	234	1,271	163,250	生活必需品	
CARREFOUR SA	198	212	321	41,297	生活必需品	
SUEZ	112.25	126.25	249	32,050	公益事業	
VIVENDI	268.91	278.91	312	40,112	コミュニケーション・サービス	
L'OREAL	82.3	90.4	3,632	466,420	生活必需品	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	168.5	179	1,024	131,568	資本財・サービス	
LEGRAND SA	88.17	94.67	906	116,435	資本財・サービス	
PERNOD RICARD SA	69.37	74.87	1,546	198,626	生活必需品	
EURAZEO SE	12.54	12.54	92	11,827	金融	
SOCIETE GENERALE SA	269.5	290	797	102,351	金融	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	91	99.1	6,909	887,217	一般消費財・サービス	
ACCOR SA	61.5	61.5	164	21,061	一般消費財・サービス	
CAPGEMINI SE	53.2	57.2	1,154	148,296	情報技術	
VALEO SA	77	77	189	24,293	一般消費財・サービス	
PUBLICIS GROUPE	70.5	80	463	59,541	コミュニケーション・サービス	
BUREAU VERITAS SA	97	106	300	38,534	資本財・サービス	
EIFFAGE	27.4	30.4	250	32,134	資本財・サービス	
SODEXO SA	27	29.5	221	28,463	一般消費財・サービス	
IPSEN	11.5	11.5	99	12,814	ヘルスケア	
ORPEA	18	18	150	19,323	ヘルスケア	
AMUNDI SA	19.5	22.5	168	21,683	金融	
TELEPERFORMANCE	19.2	21	750	96,376	資本財・サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT	30	30	134	17,292	コミュニケーション・サービス	
FAURECIA	22.5	38.57	143	18,394	一般消費財・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	9	10	513	65,900	ヘルスケア	
SEB SA	6.5	9.97	132	17,065	一般消費財・サービス	
ESSILORLUXOTTICA	92.5	101.5	1,830	235,100	一般消費財・サービス	
DASSAULT AVIATION SA	1	10	84	10,844	資本財・サービス	
WORLDLINE SA	78.14	85.14	404	51,898	情報技術	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	30	35	146	18,799	一般消費財・サービス	
AXA SA	638.5	694	1,681	215,973	金融	
EDENRED	79.5	88.5	358	46,025	情報技術	
RENAULT SA	58	64	186	23,952	一般消費財・サービス	
HERMES INTERNATIONAL	10.2	11.3	1,853	237,969	一般消費財・サービス	
REMY COINTREAU	7.5	7.5	160	20,552	生活必需品	
ATOS SE	32	32	119	15,351	情報技術	
DASSAULT SYSTEMES SE	43.6	234.5	1,252	160,889	情報技術	
WENDEL	7.8	9.3	96	12,360	金融	
ORANGE	659	714	685	88,054	コミュニケーション・サービス	
ALSTOM	63	114	369	47,385	資本財・サービス	
CNP ASSURANCES	48.5	58.5	126	16,210	金融	
SANOFI	370.75	407.25	3,486	447,697	ヘルスケア	
VINCI SA	170	188.5	1,586	203,711	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	175	197	556	71,438	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA	376	416	504	64,807	金融	
BIOMERIEUX	13.4	13.4	170	21,913	ヘルスケア	
ENGIE	602.23	646.23	833	106,997	公益事業	
EDF	202.5	202.5	249	32,100	公益事業	
SAFRAN SA	104.2	122	1,239	159,166	資本財・サービス	
ILIAD SA	4.9	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
ARKEMA	22.2	22.2	257	33,068	素材	
ADP	9.1	9.1	95	12,199	資本財・サービス	
SCOR SE	49.5	55.5	148	19,028	金融	
GETLINK SE	142	142	183	23,513	資本財・サービス	
BOLLORE	286	286	136	17,503	コミュニケーション・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,705.13 66銘柄	9,129.57 62銘柄	55,198	7,087,987 <2.8%>	
ユーロ (ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BAYER AG-REG	322.7	352.2	1,596	204,964	ヘルスケア	
EVONIK INDUSTRIES AG	65	70	186	23,999	素材	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	639.5	739	789	101,328	金融	
COMMERZBANK AG	329.35	329.35	205	26,368	金融	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首 株数	当 株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
VOLKSWAGEN AG	10.1	11.1	283	36,403	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	61.2	65.5	1,077	138,375	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	250.5	273.5	3,953	507,696	資本財・サービス
E.ON SE	742	793	871	111,930	公益事業
UNIPER SE	66.5	66.5	257	33,029	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	110	117.5	1,007	129,426	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	50.5	50.5	225	28,902	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	35.9	39.6	369	47,417	一般消費財・サービス
BASF SE	301.2	328.7	1,905	244,724	素材
ALLIANZ SE-REG	134.7	147.4	2,831	363,561	金融
THYSSENKRUPP AG	114.5	—	—	—	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	58	64	455	58,431	生活必需品
RWE AG	212	227	794	102,080	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	96.5	96.5	53	6,816	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	11.8	—	—	—	資本財・サービス
BRENNTAG SE	50	53.5	408	52,445	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	135.5	148	499	64,197	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	33.2	33.2	109	14,077	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG	7.1	—	—	—	資本財・サービス
SAP SE	341.92	373.92	4,367	560,815	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	46.1	50.4	1,205	154,742	金融
ZALANDO SE	49.5	76.5	623	80,060	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	49	53.5	318	40,958	素材
KION GROUP AG	21	24	225	28,938	資本財・サービス
COVESTRO AG	56	67	339	43,602	素材
RATIONAL AG	—	1.9	154	19,801	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	12.1	12.1	701	90,118	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	50	53	397	51,042	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	41.5	58	691	88,852	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	12.5	14	248	31,909	ヘルスケア
METRO AG	50	—	—	—	生活必需品
BECHTLE AG	—	28.5	180	23,143	情報技術
NEMETSCHKE SE	20	20	215	27,620	情報技術
SCOUT24 AG	36	36	215	27,625	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	86	101	651	83,600	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	23	25	226	29,033	資本財・サービス
HELLOFRESH SE	—	57	538	69,168	生活必需品
TEAMVIEWER AG	44.5	53.5	66	8,484	情報技術
SIEMENS ENERGY AG	131.25	143.25	345	44,312	資本財・サービス
KION GROUP AG-RTS	21	—	—	—	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	32.9	36.1	322	41,377	生活必需品
FUCHS PETROLUB PREF	23.5	23.5	93	12,010	素材
MERCK KGAA	42.5	46	1,010	129,714	ヘルスケア
ADIDAS AG	61.7	68.1	1,731	222,378	一般消費財・サービス
PUMA SE	27.1	38.6	410	52,713	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	34	37.5	250	32,166	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,092.5	1,192	1,911	245,515	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	69.2	72.2	386	49,619	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	281	306.5	2,537	325,881	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	413	467	1,878	241,189	情報技術
HANNOVER RUECK SE	20	22	342	43,929	金融
DEUTSCHE POST AG-REG	324	354.5	1,899	243,903	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	62.6	67.1	954	122,523	金融

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
LANXESS AG	百株 25	百株 28	千ユーロ 143	千円 18,423	素材	
MTU AERO ENGINES AG	17.1	17.9	300	38,535	資本財・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN SE	110	—	—	—	不動産	
SYMRISE AG	42.2	44	553	71,134	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	338	338	79	10,229	コミュニケーション・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	19.5	19.5	137	17,653	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	170.5	195	958	123,121	不動産	
LEG IMMOBILIEN SE	23	25.5	316	40,652	不動産	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,158.42 62銘柄	8,653.62 59銘柄	45,811	5,882,683 <2.3%>	
<b>ユーロ (ポルトガル)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	77	85	165	21,283	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	883	992	482	61,984	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	150.5	167.5	140	18,045	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,110.5 3銘柄	1,244.5 3銘柄	788	101,314 <0.0%>	
<b>ユーロ (スペイン)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA	1,572.27	1,867.27	739	94,987	コミュニケーション・サービス	
ENDESA SA	103.5	103.5	208	26,780	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,205.12	2,367	1,136	145,970	金融	
IBERDROLA SA	1,944.34	2,119.34	2,101	269,858	公益事業	
BANKINTER SA	215	—	—	—	金融	
REPSOL SA	494	534	529	67,967	エネルギー	
GRIFOLS SA	98	98	163	21,053	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	5,477.5	6,199.5	1,725	221,588	金融	
AMADEUS IT GROUP SA	146	160.5	932	119,701	情報技術	
NATURGY ENERGY GROUP SA	94	103	253	32,576	公益事業	
MAPFRE SA	306.5	—	—	—	金融	
CAIXABANK SA	1,175	1,605	367	47,134	金融	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	88.76	88.76	191	24,550	資本財・サービス	
AENA SME SA	22.5	26	336	43,185	資本財・サービス	
CELLNEX TELECOM SA	104.55	180.05	958	123,092	コミュニケーション・サービス	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	360	390	1,157	148,587	一般消費財・サービス	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	77	85	199	25,628	資本財・サービス	
ENAGAS SA	79.5	79.5	159	20,539	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	139	157	290	37,337	公益事業	
FERROVIAL SA	162.7	176.7	443	56,952	資本財・サービス	
EDP RENOVAVEIS SA	—	110	247	31,724	公益事業	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	14,865.24 20銘柄	16,450.12 19銘柄	12,142	1,559,214 <0.6%>	
<b>ユーロ (イタリア)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA	78.5	88.5	294	37,831	資本財・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI	372.43	394.43	702	90,154	金融	
MEDIOBANCA SPA	188.65	223.65	217	27,926	金融	
UNICREDIT SPA	696.56	763.56	807	103,637	金融	
TELECOM ITALIA SPA	2,629.82	3,439.82	162	20,808	コミュニケーション・サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	1,719.5	2,039.5	90	11,667	コミュニケーション・サービス	
INTESA SANPAOLO	5,507.37	5,945.37	1,274	163,606	金融	
ATLANTIA SPA	172.57	172.57	278	35,810	資本財・サービス	
POSTE ITALIANE SPA	160	177	198	25,444	金融	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
MONCLER SPA	63	74	478	61,385	一般消費財・サービス	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	34.5	38.5	211	27,171	ヘルスケア	
ENI SPA	841	904	1,066	136,977	エネルギー	
PIRELLI & C SPA	110	—	—	—	一般消費財・サービス	
DIASORIN SPA	8.5	8.5	157	20,203	ヘルスケア	
INFRASTRUTTURA WIRELESS ITAL	83	112	115	14,777	コミュニケーション・サービス	
NEXI SPA	120.5	158.5	218	28,076	情報技術	
AMPLIFON SPA	—	43	183	23,610	ヘルスケア	
LEONARDO SPA	131.75	—	—	—	資本財・サービス	
ENEL SPA	2,671.34	2,911.34	1,976	253,803	公益事業	
SNAM SPA	666	701	350	44,980	公益事業	
TERNA SPA	463	490	318	40,873	公益事業	
FINECOBANK SPA	197	219	340	43,743	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	16,914.99 21銘柄	18,904.24 20銘柄	9,442	1,212,490 <0.5%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (フィンランド)</b>						
UPM-KYMMENE OYJ	175.5	191.5	626	80,410	素材	
NOKIA OYJ	1,864	1,913	960	123,290	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP	147	170	209	26,926	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS	188.5	197	304	39,058	素材	
ELISA OYJ	46	51	271	34,892	コミュニケーション・サービス	
SAMPO OYJ-A SHS	153	178	766	98,422	金融	
FORTUM OYJ	138.5	159	406	52,186	公益事業	
KESKO OYJ-B SHS	—	98	274	35,197	生活必需品	
KONE OYJ-B	112.5	121	715	91,920	資本財・サービス	
NESTE OYJ	139	151	648	83,337	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	32	36	132	17,071	ヘルスケア	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,996 10銘柄	3,265.5 11銘柄	5,316	682,716 <0.3%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (オーストリア)</b>						
VERBUND AG	20	24.3	218	28,005	公益事業	
OMV AG	44.5	53	250	32,157	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	94.5	100	387	49,771	金融	
VOESTALPINE AG	42.5	42.5	125	16,088	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	44	52.5	134	17,217	金融	
ANDRITZ AG	21	—	—	—	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	266.5 6銘柄	272.3 5銘柄	1,115	143,240 <0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	61,805.26 240銘柄	67,422.34 230銘柄	172,118	22,101,720 <8.8%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	354,388.8 1,214銘柄	394,308.1 1,220銘柄	—	229,141,995 <91.4%>	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘 柄	期 首		当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円
<b>(アメリカ)</b>				
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4.587	5.087	1,224	139,350
SIMON PROPERTY GROUP INC	10.137	11.857	1,896	215,754
BOSTON PROPERTIES INC	4.95	5.47	603	68,666
VORNADO REALTY TRUST	5.397	5.897	245	27,896
SBA COMMUNICATIONS CORP	3.65	4.04	1,436	163,430
EQUITY RESIDENTIAL	12.35	13.05	1,125	128,010
EQUINIX INC	2.918	3.288	2,696	306,742
AMERICAN TOWER CORP	14.5	16.45	4,391	499,582
HOST HOTELS & RESORTS INC	22.243	24.943	409	46,596
INVITATION HOMES INC	17.7	20.85	860	97,896
VICI PROPERTIES INC	15.4	19.8	556	63,366
VENTAS INC	12.2	13.8	677	77,119
WEYERHAEUSER CO	24.114	27.564	1,068	121,518
AGNC INVESTMENT CORP	18.1	19.6	310	35,299
CROWN CASTLE INTL CORP	13.75	15.75	2,926	332,984
IRON MOUNTAIN INC	9.71	10.26	480	54,698
VEREIT INC	33.5	—	—	—
SUN COMMUNITIES INC	3.25	4.1	806	91,775
PROLOGIS INC	24.402	26.952	4,131	470,006
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4.12	5.1	1,046	119,097
CAMDEN PROPERTY TRUST	3.2	3.45	582	66,274
DUKE REALTY CORP	12.15	13.8	820	93,338
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2.17	2.4	831	94,611
FEDERAL REALTY INVST TRUST	2.36	—	—	—
WELLTOWER INC	13.85	15.3	1,255	142,805
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	17.65	19.8	674	76,725
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3.75	4.25	892	101,539
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5.8	6.15	521	59,347
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	45.1	50.8	424	48,258
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	5.35	—	—	—
REALTY INCOME CORP	11.2	19.445	1,357	154,415
PUBLIC STORAGE	5.22	5.67	1,881	214,094
REGENCY CENTERS CORP	5.3	5.7	403	45,887
UDR INC	9.75	10.55	606	68,979
WP CAREY INC	5.8	6.4	504	57,340
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	7.6	8.3	230	26,213
DIGITAL REALTY TRUST INC	8.9	10.3	1,738	197,793
EXTRA SPACE STORAGE INC	4.25	4.9	994	113,194
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	17.25	21.65	465	52,932
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	443.628 39 銘柄	462.723 36 銘柄	41,078 <1.9%>
<b>(カナダ)</b>				
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	4.8	—	—	—
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2.1	—	—	—
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2.4	2.9	169	15,132
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4.7	5.8	128	11,451
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	14 4 銘柄	8.7 2 銘柄	297 <0.0%>

外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄	期 首		期 末	
	□ 数	□ 数	評 価	額
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円
<b>(オーストラリア)</b>				
DEXUS/AU	—	36.15	392	31,884
LENDLEASE GROUP	21.5	23.5	249	20,249
TRANSURBAN GROUP	89.5	95.4	1,306	106,166
SYDNEY AIRPORT	42.5	45.8	377	30,678
APA GROUP	38.1	41.4	401	32,644
SCENTRE GROUP	159.922	181.922	553	44,956
DEXUS	33.15	—	—	—
GPT GROUP	63.16	68.16	353	28,756
MIRVAC GROUP	126.1	136.1	394	32,084
STOCKLAND	78	83.8	364	29,632
GOODMAN GROUP	52.9	58.2	1,428	116,147
VICINITY CENTRES	123.273	137.273	232	18,914
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	828.105 11 銘柄	907.705 11 銘柄	6,053 <0.2%>
<b>(香港)</b>				
LINK REIT	70.5	81.5	5,599	81,690
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	92	92	703	10,268
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	122	138	1,465	21,382
香 港 ・ ド ル 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	284.5 3 銘柄	311.5 3 銘柄	7,768 <0.0%>
<b>(シンガポール)</b>				
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	101	124.5	372	30,975
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	158.032	190.87	408	33,988
SUNTEC REIT	63	—	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	91.8	114.3	218	18,165
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST (非上場)	65.5	77.5	161	13,477
ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS	3.737	—	—	—
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	483.069 6 銘柄	507.17 4 銘柄	1,161 <0.0%>
<b>(イギリス)</b>				
LAND SECURITIES GROUP PLC	21.662	23.562	176	26,818
SEGRO PLC	38.45	43.1	610	92,594
BRITISH LAND CO PLC	29.55	29.55	154	23,351
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	89.662 3 銘柄	96.212 3 銘柄	941 <0.1%>
<b>ユーロ (フランス)</b>				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4.2	4.6	276	35,441
ICADE	0.95	—	—	—
GECCINA SA	1.4	1.6	190	24,521
KLEPIERRE	6.25	7.15	136	17,494
COVIVIO	1.5	1.75	128	16,485
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	14.3 5 銘柄	15.1 4 銘柄	731 <0.0%>
合 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,157.264 71 銘柄	2,309.11 63 銘柄	— 5,638,901 <2.2%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
外 S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	11,720	—
S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	683	—
SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	527	—
国 FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	722	—
SWISS MKT IX FUTR (スイス)	633	—
EURO STOXX 50 (ドイツ)	2,024	—

(注1) 外貨建の評価額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	229,141,995	91.3
投資信託証券	5,638,901	2.2
コール・ローン等、その他	16,197,265	6.5
投資信託財産総額	250,978,162	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1香港・ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.21円、1ニュージランド・ドル=77.53円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シェケル=36.011円、1スイス・フラン=123.25円、1デンマーク・クローネ=17.27円、1ノルウェー・クローネ=12.61円、1スウェーデン・クローネ=12.53円、1ユーロ=128.41円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (241,345,626千円) の投資信託財産総額 (250,978,162千円) に対する比率は、96.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	260,709,876,829円
コール・ローン等	10,822,639,735
株式 (評価額)	229,141,995,652
投資信託証券 (評価額)	5,638,901,532
未収入金	10,204,922,167
未収配当金	248,294,417
差入委託証拠金	4,653,123,326
(B)負債	9,932,665,466
未払金	9,867,283,466
未払解約金	65,382,000
(C)純資産総額 (A-B)	250,777,211,363
元本	61,024,141,090
次期繰越損益金	189,753,070,273
(D)受益権総口数	61,024,141,090口
1万口当り基準価額 (C/D)	41,095円

\* 期首における元本額は54,067,455,177円、当作成期間中における追加設定元本額は13,499,704,777円、同解約元本額は6,543,018,864円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額:

ダイワ外国株式インデックスVA	372,377,534円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA (一般投資家私募)	4,453,234円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA (一般投資家私募)	59,956,664円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA (一般投資家私募)	7,408,815円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA (一般投資家私募)	236,485,519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)	36,674,409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)	508,352,729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)	2,520,260,966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)	513,644,174円
D-1's 外国株式インデックス	15,304,858円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	32,174,123円
i Free 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)	4,063,382,462円
i Free 8資産バランス	1,116,648,157円
i Free 年金バランス	171,426,649円
DCダイワ外国株式インデックス	38,249,671,210円
ダイワ・ライフ・バランス30	500,854,698円
ダイワ・ライフ・バランス50	919,288,192円
ダイワ・ライフ・バランス70	740,101,154円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,732,619,609円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	12,075,244円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	10,707,802円
ダイワつみたてインデックス外国株式	811,486,824円
ダイワつみたてインデックスバランス30	1,690,959円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,170,527円
ダイワつみたてインデックスバランス70	3,559,196円
ダイワ世界バランスファンド40VA	107,882,488円
ダイワ世界バランスファンド60VA	208,152,302円
ダイワ・バランスファンド35VA	1,461,676,506円
ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用)	73,896,117円
ダイワバランスファンド2020-07 (適格機関投資家専用)	211,630,253円
ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用)	212,845,169円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	927,057,365円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	324,437,993円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用)	1,929,148,713円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,822,903,027円
ダイワライフスタイル25	12,346,386円
ダイワライフスタイル50	49,688,514円
ダイワライフスタイル75	39,700,549円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は41,095円です。

■損益の状況

当期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,297,226,954円
受取配当金	3,289,764,908
受取利息	1,845
その他収益金	10,303,967
支払利息	△ 2,843,766
(B) 有価証券売買損益	57,314,244,756
売買益	62,568,866,991
売買損	△ 5,254,622,235
(C) 先物取引等損益	2,472,470,870
取引益	2,561,237,007
取引損	△ 88,766,137
(D) その他費用	△ 66,438,634
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	63,017,503,946
(F) 前期繰越損益金	108,215,788,993
(G) 解約差損益金	△ 17,149,000,589
(H) 追加信託差損益金	35,668,777,923
(I) 合計 (E + F + G + H)	189,753,070,273
次期繰越損益金 (I)	189,753,070,273

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

# ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド

運用報告書 第11期 (決算日 2021年7月5日)

(作成対象期間 2020年7月7日～2021年7月5日)

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

## ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	1. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式 (上場予定および店頭登録予定を含みます。) 2. 新興国の企業のDR (預託証券) 3. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF (上場投資信託証券)
株式組入制限	無制限

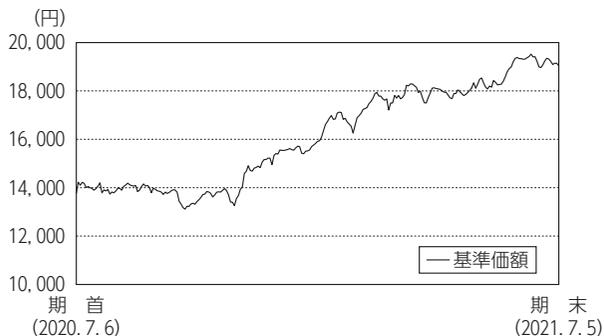
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：13,774円 期末：19,034円 騰落率：38.2%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークへの連動をめざした運用を行いました。経済回復への期待から世界的な株高となる中で新興国株式市況は上昇し、基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆ 投資環境について

○ 新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

新興国株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大に対する懸念が継続する一方で、市場予想を上回る米国の経済指標や中国の景気持ち直しから上昇しました。その後2020年9月に入ると、高値警戒感や欧州でのウイルス感染拡大による行動制限を嫌気したことなどから、下落基調へと転換しました。11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通りの当選確実となり、選挙に対する不確実性が後退したことや、米国の大規模経済対策などの政策期待から上昇しました。2021年1月末から当作成期末にかけては、金利上昇に伴って軟調な展開となる場面も散見されたものの、経済活動の正常化期待から堅調な展開になり、当作成期は大幅な上昇となりました。

○ 為替相場

新興国通貨の為替相場は、対円で上昇（円安）しました。

新興国の為替相場は、当作成期首から2020年12月末にかけて、緩和的な金融環境によって米国の実質金利が低下したことなどが米ドルの下落要因となり、新興国通貨高で推移しました。また、新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念、米中間味の動向や追加経済対策をめぐる先行きの見通しの不透明感なども、米ドル安要因となりました。2021年に入ると、米国において民主党が大統領府・連邦議会上下両院を制したことやワクチンの実用化などから市場のリスク選好姿勢が強まりました。また、FRB（米国連邦準備制度理事会）高官の量的緩和政策の縮小時期をめぐる発言が、米国の金利上昇とともに米ドル買いにつながったことで、新興国通貨は米ドルに対して横ばいの推移となりました。一方この期間の円は弱く、対円でも上昇しました。4月から当作成期末にかけては、再び米ドル安となり新興国通貨高で当作成期末を迎えました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

主として、新興国の株式（DR（預託証券）を含む。）に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行うことを基本とします。また、効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF（上場投資信託証券）にも一部投資します。なお、株式およびETFの組入比率の合計は、通常の状態ですべての純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。さらに、株式実質組入比率の維持を目的に新興国株式市場を対象とした株価指数先物取引も利用します。

◆ ポートフォリオについて

ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら運用を行いました。

ポートフォリオ構築にあたっては、FTSE RAFI エマージング インデックスの組入比率上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、DR（預託証券）等の組み入れを行いました。また、効率性の観点からETF（上場投資信託証券）および株価指数先物を利用し、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

年月日	基準価額		FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算)		株 組 比	式 入 率	株 先 比	式 物 率	投資信託 証券 組入比率	
	円	騰落率 %	円換算 %	騰落率 %					%	%
(期首)2020年7月6日	13,774	—	15,645	—	82.7	3.0	3.0	13.8		
7月末	13,738	△ 0.3	15,586	△ 0.4	87.5	2.7	2.7	9.5		
8月末	14,010	1.7	15,863	1.4	93.2	2.9	2.9	3.9		
9月末	13,221	△ 4.0	14,980	△ 4.2	95.6	4.0	4.0	0.4		
10月末	13,397	△ 2.7	15,175	△ 3.0	94.7	2.6	2.6	2.6		
11月末	15,220	10.5	17,279	10.4	94.1	2.9	2.9	3.2		
12月末	15,763	14.4	17,902	14.4	91.9	3.6	3.6	4.2		
2021年1月末	16,539	20.1	18,706	19.6	88.1	4.6	4.6	6.9		
2月末	17,668	28.3	20,139	28.7	88.2	4.0	4.0	7.8		
3月末	18,118	31.5	20,599	31.7	86.2	11.2	11.2	1.0		
4月末	18,338	33.1	20,813	33.0	94.1	2.3	2.3	3.1		
5月末	18,921	37.4	21,532	37.6	91.5	2.2	2.2	5.9		
6月末	19,090	38.6	21,707	38.7	88.6	5.1	5.1	6.1		
(期末)2021年7月5日	19,034	38.2	21,635	38.3	88.1	8.7	8.7	2.9		

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) は、FTSE International Limited の承諾を得て、FTSE RAFI エマージング インデックス (配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE International Limited と Research Affiliates LLC に帰属します。また、FTSE International Limited 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。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は38.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は38.2%となりました。

配当金に対する課税分や売買手数料・保管費用等のコスト負担が、マイナス要因となりました。

なお、組み入れている株式ポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、株価指数先物とベンチマークとの騰落率の差異、ファンドとベンチマークの為替評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

\*ベンチマークは FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) です。

【今後の運用方針】

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	18円 ( 13)
(新株予約権証券)	( 0)
(先物・オプション)	( 2)
(投資信託証券)	( 3)
有価証券取引税 (株式)	10 ( 10)
(新株予約権証券)	( 0)
(投資信託証券)	( 0)
その他費用 (保管費用)	32 ( 22)
(その他)	( 10)
合 計	60

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1)株 式

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	アメリカ	百株 48,920.05 ( 2)	千アメリカ・ドル 5,867 (△ 95)	百株 54,215.61	千アメリカ・ドル 4,625
	香港	百株 172,167 ( 486.74)	千香港・ドル 137,155 (△ 43)	百株 90,792.54	千香港・ドル 67,975
	シンガポール	百株 540 ( 1)	千シンガポール・ドル 57 ( 1)	百株 —	千シンガポール・ドル —
	台湾	百株 40,550 ( 304.98)	千台湾・ドル 240,294 (△ 217)	百株 30,847.47	千台湾・ドル 213,730
	トルコ	百株 10,320.93 ( 1)	千トルコ・リラ 8,416 ( 1)	百株 2,239.54	千トルコ・リラ 1,404
	メキシコ	百株 8,819 ( 1)	千メキシコ・ペソ 23,420 (△ 33)	百株 8,129.23	千メキシコ・ペソ 20,332
	チリ	百株 26,824.87 ( 2.74)	千チリ・ペソ 303,684 ( 1)	百株 23,591.85	千チリ・ペソ 188,530
	サウジアラビア	百株 1,226.07 ( 1)	千サウジアラビア・リアル 4,176 ( 1)	百株 962.7	千サウジアラビア・リアル 4,914
	インド	百株 15,624.43 ( 3.51)	千インド・ルピー 333,172 ( 791)	百株 17,150.95	千インド・ルピー 115,090
	インドネシア	百株 44,534 ( 1)	千インドネシア・ルピア 14,948,841 ( 1)	百株 —	千インドネシア・ルピア —
国	ブラジル	百株 29,729 ( 3,286.6)	千ブラジル・リアル 61,962 ( 1)	百株 1,156.89	千ブラジル・リアル 6,496
	中国	百株 23,707.07 ( 1)	千オフショア・人民元 16,868 ( 1)	百株 7,461.07	千オフショア・人民元 6,036
	マレーシア	百株 2,639 ( 1,796)	千マレーシア・リンギット 1,586 ( 1)	百株 991	千マレーシア・リンギット 744
	南アフリカ	百株 3,281.3 ( 3.21)	千南アフリカ・ランド 28,767 (△ 63)	百株 5,065.75	千南アフリカ・ランド 33,160
	タイ	百株 57,946 ( 1)	千タイ・バーツ 80,478 (△ 128)	百株 4,250	千タイ・バーツ 8,166

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ( )内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 新株予約権証券

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	タイ	証券 — ( 7,487)	千タイ・パーツ — ( 34)	証券 7,487 ( —)	千タイ・パーツ 40 ( —)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ( )内は、割当、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	株式先物取引	百万円 8,120	百万円 7,077	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(3) 投資信託証券

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 963.6 ( —)	千アメリカ・ドル 21,090 ( —)	千口 1,436 ( —)	千アメリカ・ドル 30,083 ( —)
	メキシコ	千口 20.2 ( —)	千メキシコ・ペソ 343 (△ 40)	千口 100.4 ( —)	千メキシコ・ペソ 2,391 ( —)
国	南アフリカ	千口 — ( —)	千南アフリカ・ランド — ( —)	千口 76.93 ( —)	千南アフリカ・ランド 1,017 ( —)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付( )内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 売付( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

当 期				期 付			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ALIBABA GROUP HOLDING LTD (ケイマン諸島)	95.1	313,294	3,294	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	155	354,624	2,287
HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	549	241,857	440	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR (ケイマン諸島)	8.5	225,640	26,545
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	103	175,474	1,703	CHINA MOBILE LTD (香港)	282	177,806	630
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	2,407	170,280	70	BAIDU INC - SPON ADR (ケイマン諸島)	3	85,509	28,503
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	302.4	160,751	531	VALE SA (ブラジル)	46	83,384	1,812
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル)	313.8	143,431	457	CNOOC LTD (香港)	773	81,115	104
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	1,635	131,283	80	MEDIATEK INC (台湾)	22	75,353	3,425
PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)	102.5	130,526	1,273	UNITED MICROELECTRONICS CORP (台湾)	410	73,223	178
PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	285.2	129,148	452	CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	738	67,886	91
BANCO BRADESCO SA-PREF (ブラジル)	239.2	119,232	498	BANK OF CHINA LTD-H (中国)	1,371	56,132	40

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

当				期			
買		付		売		付	
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	963.6	2,269,015	2,354	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	1,436	3,264,963	2,273
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	20.2	1,630	80	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	100.4	12,867	128
				GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)	76.93	7,549	98

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	株数	金額	期末		業種等	
			株数	金額		
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
<b>(アメリカ)</b>						
JOYY INC-ADR	—	10	64	7,137	コミュニケーション・サービス	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	—	52	39	4,375	一般消費財・サービス	
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	337	290	181	20,212	エネルギー	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	64	—	—	—	一般消費財・サービス	
BAIDU INC - SPON ADR	44	28	550	61,222	コミュニケーション・サービス	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	80	56	106	11,808	一般消費財・サービス	
CANADIAN SOLAR INC	28	23	99	11,014	情報技術	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	25	34	99	11,073	資本財・サービス	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	199.5	353.5	340	37,841	コミュニケーション・サービス	
JD.COM INC-ADR	82	78	594	66,095	一般消費財・サービス	
NETEASE INC-ADR	5	30	339	37,786	コミュニケーション・サービス	
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	56	93	330	36,689	一般消費財・サービス	
VTB BANK JSC -GDR-REG S	1,642.98	1,912.17	249	27,759	金融	
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	45.6	72.9	227	25,331	素材	
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	60.5	96.08	424	47,131	エネルギー	
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	296	360.75	179	19,914	エネルギー	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	92.1	169.93	580	64,564	素材	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	249.7	206.94	295	32,894	生活必需品	
RUSHYDRO PJSC-ADR	604.95	—	—	—	公益事業	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	811	1,569.77	2,626	291,931	金融	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	12.2	24.98	561	62,449	エネルギー	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	168.3	202.88	1,890	210,185	エネルギー	
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	487	912.99	698	77,699	エネルギー	
GAZPROM PJSC-SPON ADR	3,272.9	3,923.39	3,041	338,083	エネルギー	
SEVERSTAL - GDR REG S	102.7	134.6	288	32,108	素材	
TATNEFT PJSC - PREF	35.1	155.09	106	11,849	エネルギー	
SISTEMA PJSC	147	3,192	137	15,283	コミュニケーション・サービス	
ROSSETI PJSC	29,890	—	—	—	公益事業	
INTER RAO UES PJSC	10,160	27,261	173	19,320	公益事業	
ALROSA PJSC	791.6	1,803.1	309	34,354	素材	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	362.29	566.19	131	14,644	金融	
AEROFLOT PJSC	402.5	1,649.1	153	17,112	資本財・サービス	
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	50,554.92	45,261.36	14,824	1,647,876	
	銘柄数 < 比率 >	30銘柄	29銘柄		<10.2%>	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港・ドル	千円	
(香港)					
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1,410	—	—	—	資本財・サービス
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	2,770	4,600	1,849	26,462	資本財・サービス
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	400	620	706	10,114	資本財・サービス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	760	780	1,817	26,006	一般消費財・サービス
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	1,100	—	—	—	資本財・サービス
JIANGXI COPPER CO LTD-H	750	510	801	11,472	素材
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	1,400	—	—	—	公益事業
CHINA GAS HOLDINGS LTD	196	492	1,163	16,650	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	17,438	20,798	8,132	116,369	エネルギー
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	155	—	—	—	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,060	2,460	1,699	24,324	一般消費財・サービス
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	—	3,540	350	5,015	一般消費財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	980	—	—	—	資本財・サービス
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	135	290	932	13,341	資本財・サービス
FOSUN INTERNATIONAL LTD	930	715	795	11,377	資本財・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD	182	215	12,351	176,753	コミュニケーション・サービス
CHINA TELECOM CORP LTD-H	6,920	—	—	—	コミュニケーション・サービス
AIR CHINA LTD-H	600	1,100	621	8,893	資本財・サービス
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	3,320	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	470	605	1,161	16,622	不動産
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	1,500	2,580	670	9,599	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	580	—	—	—	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	12,580	20,520	7,777	111,290	エネルギー
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	—	155	1,079	15,448	一般消費財・サービス
CNOOC LTD	5,930	—	—	—	エネルギー
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	880	—	—	—	不動産
HUANENG POWER INTL INC-H	3,380	6,120	1,817	26,010	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	195	355	1,444	20,675	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,150	1,050	1,377	19,713	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	38,110	47,080	28,577	408,944	金融
CHINA MOBILE LTD	2,150	—	—	—	コミュニケーション・サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	656	1,242	1,602	22,927	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	5,380	7,040	2,583	36,972	金融
GF SECURITIES CO LTD-H	306	500	501	7,169	金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	284	484	541	7,743	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	140	275	1,454	20,817	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	2,660	4,750	2,484	35,549	金融
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	700	760	364	5,209	資本財・サービス
HUADIAN POWER INTL CORP-H	1,420	—	—	—	公益事業
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1,705	2,450	3,660	52,378	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	312	1,091.2	1,204	17,239	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H	512	1,028	2,343	33,540	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	700	1,100	3,465	49,584	不動産
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	260	—	—	—	その他
YANZHOU COAL MINING CO-H	1,000	1,820	1,856	26,565	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	430	1,285	959	13,736	ヘルスケア
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	—	220	1,016	14,544	公益事業
BYD CO LTD-H	80	50	1,106	15,826	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	14,670	25,230	6,812	97,481	金融
CHINA RESOURCES CEMENT	—	820	594	8,507	素材
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	—	254	276	3,961	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	210	358	930	13,319	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	2,120	3,900	1,014	14,510	金融

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千香港・ドル	千円		
CITIC LTD	880	2,150	1,806	25,843	資本財・サービス	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	—	1,165	1,211	17,337	素材	
IND & COMM BK OF CHINA-H	30,830	54,900	24,979	357,456	金融	
CHINA TOWER CORP LTD-H	5,820	16,760	1,776	25,422	コミュニケーション・サービス	
XIAOMI CORP-CLASS B	916	—	—	—	情報技術	
MEITUAN-CLASS B	106	52	1,580	22,621	一般消費財・サービス	
SEAZEN GROUP LTD	—	1,240	908	13,006	不動産	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	—	951	20,161	288,506	一般消費財・サービス	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	420	860	949	13,586	公益事業	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	2,150	2,150	380	5,445	資本財・サービス	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	—	250	673	9,641	一般消費財・サービス	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	1,220	3,180	5,673	81,182	不動産	
CRRG CORP LTD - H	1,240	—	—	—	資本財・サービス	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	3,110	—	—	—	資本財・サービス	
CGN POWER CO LTD-H	—	4,570	776	11,117	公益事業	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	915	1,940	14,530	207,932	金融	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	290	1,040	2,766	39,587	不動産	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	—	585	1,172	16,784	資本財・サービス	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	3,845.8	7,335.8	2,721	38,945	金融	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2,200	2,440	2,110	30,202	不動産	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	70	60	1,055	15,102	一般消費財・サービス	
CHINA VANKE CO LTD-H	409	899	2,198	31,454	不動産	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	1,940	2,900	522	7,469	素材	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	560	960	655	9,382	一般消費財・サービス	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	55	64	1,223	17,510	一般消費財・サービス	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	—	330	1,504	21,533	生活必需品	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2,020	3,600	2,480	35,494	金融	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	1,075	415	1,016	14,549	一般消費財・サービス	
WEICHAI POWER CO LTD-H	440	560	937	13,414	資本財・サービス	
SUNNY OPTICAL TECH	—	37	875	12,527	情報技術	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	2,680	2,920	1,316	18,845	素材	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	646	882	2,125	30,417	金融	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	349	606	993	14,221	ヘルスケア	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,210	1,950	2,987	42,749	金融	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	100	132	1,958	28,031	公益事業	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	620	660	728	10,426	素材	
KUNLUN ENERGY CO LTD	1,400	2,020	1,442	20,639	公益事業	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	804	—	—	—	不動産	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,140	620	648	9,280	素材	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	—	1,280	670	9,598	資本財・サービス	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,300	2,680	2,420	34,630	素材	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	4,381	8,521	4,447	63,650	金融	
CHINA EVERGRANDE GROUP	800	1,420	1,428	20,442	不動産	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	520	—	—	—	不動産	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	—	1,980	605	8,670	金融	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	12,260	3,800	752	10,766	情報技術	
CHINA MERCHANTS BANK-H	915	1,010	6,534	93,511	金融	
BANK OF CHINA LTD-H	33,860	33,500	9,313	133,269	金融	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	335	440	837	11,988	金融	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	1,600	2,400	698	9,994	金融	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	680	1,272	859	12,304	金融	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	—	940	686	9,819	一般消費財・サービス	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	300	580	2,479	35,481	不動産	
香港・ドル通貨計	株数、金額	268,387.8	350,249	250,487	3,584,473	
	銘柄数 < 比率 >	90銘柄	88銘柄		<22.2%>	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)					
YANGZHIJIANG SHIPBUILDING	887	1,427	205	16,950	資本財・サービス
シンガポール・ドル通貨計	株数・金額 銘柄数 < 比率 >	887 1銘柄	1,427 1銘柄	205 <0.1%>	
(台湾)					
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	200	220	3,388	13,450	情報技術
TAIWAN CEMENT	1,272.32	1,481.45	7,481	29,701	素材
ASIA CEMENT CORP	630	—	—	—	素材
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	940	1,160	12,992	51,579	情報技術
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	420	—	—	—	金融
WALSIN TECHNOLOGY CORP	—	90	1,899	7,539	情報技術
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	821.12	881.12	6,467	25,676	生活必需品
FORMOSA PLASTICS CORP	496	806	8,463	33,598	素材
NAN YA PLASTICS CORP	441.4	621.4	5,250	20,846	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	433.9	593.9	5,054	20,065	素材
CHINA STEEL CORP	976.86	3,206.86	12,490	49,589	素材
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30	—	—	—	一般消費財・サービス
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	586.16	676.16	3,847	15,274	情報技術
DELTA ELECTRONICS INC	470	340	10,166	40,360	情報技術
YAGEO CORPORATION	60	80	4,448	17,659	情報技術
WINBOND ELECTRONICS CORP	—	750	2,610	10,361	情報技術
ACER INC	—	1,730	4,956	19,677	情報技術
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	300	670	4,355	17,289	情報技術
QUANTA COMPUTER INC	850	720	6,400	25,411	情報技術
AU OPTRONICS CORP	7,450	6,680	15,096	59,935	情報技術
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	884	834	9,507	37,746	コミュニケーション・サービス
MEDIA TEK INC	280.03	160.03	15,314	60,801	情報技術
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	230	360	6,516	25,869	情報技術
EVA AIRWAYS CORP	—	1,690	3,405	13,519	資本財・サービス
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	—	1,180	3,068	12,180	金融
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,234.11	1,884.11	13,735	54,529	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,548.38	1,968.38	10,609	42,121	金融
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	2,240	4,120	5,417	21,509	金融
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,440.27	2,065.05	5,369	21,315	金融
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,388.28	2,553.81	6,767	26,868	金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,589.93	1,769.93	5,761	22,872	金融
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,287.68	—	—	—	金融
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	4,193.34	4,243.34	4,001	15,886	金融
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,670	—	—	—	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	2,720.28	2,470.28	5,533	21,968	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,191.72	1,467.47	3,294	13,079	金融
LARGAN PRECISION CO LTD	10	20	6,210	24,654	情報技術
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	110	80	3,948	15,673	情報技術
TAIWAN MOBILE CO LTD	310	340	3,468	13,768	コミュニケーション・サービス
WISTRON CORP	1,291.1	1,331.1	4,306	17,095	情報技術
INNOLUX CORP	9,660	6,600	14,025	55,680	情報技術
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	310	—	—	—	コミュニケーション・サービス
PEGATRON CORP	630	1,680	11,424	45,354	情報技術
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	150	240	2,496	9,909	情報技術
CHAILEASE HOLDING CO LTD	214.71	264.71	5,333	21,176	金融
POWERTECH TECHNOLOGY INC	194	324	3,483	13,827	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	320	360	3,960	15,721	エネルギー
COMPAL ELECTRONICS	1,070	1,850	4,079	16,195	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,660	2,140	125,832	499,565	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY	3,679.02	9,169.02	102,234	405,881	情報技術
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	80	130	3,386	13,444	生活必需品
ASUSTEK COMPUTER INC	137.6	317.6	11,782	46,779	情報技術
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	690	—	—	—	資本財・サービス
UNITED MICROELECTRONICS CORP	4,580	2,060	10,835	43,018	情報技術
台湾・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	64,372.21 49銘柄	74,379.72 47銘柄	530,473 2,106,031 <13.1%>	
(トルコ)		百株	百株	千トルコ・リラ	千円
IS YATIRIM MENKUL DEGERLER A	—	324.96	475	6,094	金融
TURKIYE GARANTI BANKASI	1,060.2	2,418.41	2,031	26,041	金融
AKBANK T. A. S.	1,492.72	3,342.74	1,781	22,839	金融
TURKIYE IS BANKASI-C	1,271	2,498.56	1,286	16,495	金融
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	696.6	877.6	1,408	18,056	コミュニケーション・サービス
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	90.9	199.9	1,912	24,511	エネルギー
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	868.81	842.22	1,530	19,617	素材
HACI OMER SABANCI HOLDING	803.9	1,279.23	1,169	14,988	金融
TURKIYE HALK BANKASI	1,108.3	1,108.22	549	7,046	金融
YAPI VE KREDI BANKASI	—	2,377.87	520	6,675	金融
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	961.2	—	—	—	金融
KOC HOLDING AS	399.15	807.81	1,571	20,141	資本財・サービス
TURK HAVA YOLLARI AO	567.8	1,294.89	1,779	22,807	資本財・サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	94.4	123.96	774	9,923	生活必需品
トルコ・リラ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,414.98 12銘柄	17,496.37 13銘柄	16,790 215,240 <1.3%>	
(メキシコ)		百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	134	—	—	—	生活必需品
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	—	88	1,866	10,477	資本財・サービス
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	7,766	8,965	13,268	74,474	コミュニケーション・サービス
GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO	719	758	4,358	24,464	コミュニケーション・サービス
CEMEX SAB-CPO	10,067.19	8,967.19	14,768	82,898	素材
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	430	756	12,675	71,149	生活必需品
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	296.23	—	—	—	素材
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	648	574	5,441	30,543	素材
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	956	1,593	10,163	57,046	生活必需品
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	648	653	8,513	47,788	金融
メキシコ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	21,664.42 9銘柄	22,354.19 8銘柄	71,056 398,841 <2.5%>	
(チリ)		百株	百株	千チリ・ペソ	千円
ENEL CHILE SA	6,997.67	—	—	—	公益事業
CENCOSUD SA	—	461.15	65,944	9,965	生活必需品
BANCO SANTANDER CHILE	21,058.8	28,986.96	102,816	15,537	金融
ENEL AMERICAS SA	8,533.63	12,217.63	133,172	20,125	公益事業
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	—	14.72	51,888	7,841	素材
FALABELLA SA	218	215.93	67,478	10,197	一般消費財・サービス
BANCO DE CHILE	12,197.92	10,345.39	73,969	11,178	金融
チリ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	49,006.02 5銘柄	52,241.78 6銘柄	495,269 74,846 <0.5%>	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円		
<b>(サウジアラビア)</b>						
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	214.6	131.73	1,604	47,620	素材	
SAUDI TELECOM CO	75	54.52	717	21,294	コミュニケーション・サービス	
AL RAJHI BANK	174	241.62	2,725	80,892	金融	
SAMBA FINANCIAL GROUP	126.2	—	—	—	金融	
RIYAD BANK	163.6	—	—	—	金融	
ETIHAD ETISALAT CO	120.7	176.9	574	17,063	コミュニケーション・サービス	
SAVOLA	71.2	—	—	—	生活必需品	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	62.1	—	—	—	素材	
ALINMA BANK	174.26	329.25	723	21,459	金融	
THE SAUDI NATIONAL BANK	130.5	118.42	688	20,420	金融	
SAUDI ARABIAN OIL CO	98.8	280.37	982	29,166	エネルギー	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	309.9	285.25	552	16,407	素材	
SAUDI ELECTRICITY CO	—	366.17	884	26,256	公益事業	
サウジアラビア・リアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,720.86 12銘柄	1,984.23 9銘柄	9,453 <1.7%>	280,582	
<b>(インド)</b>						
	百株	百株	千インド・ルピー	千円		
RELIANCE INDUSTRIES-PARTLY P	—	25.19	3,791	5,686	エネルギー	
TATA STEEL LTD	185.4	348.72	39,614	59,421	素材	
AXIS BANK LTD	233.9	431.9	32,420	48,630	金融	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	13.5	19.5	14,769	22,153	一般消費財・サービス	
TATA POWER CO LTD	—	794.37	9,607	14,411	公益事業	
BANK OF BARODA	—	736.29	6,273	9,409	金融	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	27.3	52.23	12,991	19,486	生活必需品	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	469.4	664.96	19,812	29,718	エネルギー	
STATE BANK OF INDIA	554.7	782.7	33,217	49,826	金融	
NTPC LTD	916	2,405.22	28,261	42,392	公益事業	
POWER FINANCE CORPORATION	359.4	—	—	—	金融	
JSW STEEL LTD	335.2	317.64	21,323	31,984	素材	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	—	650.99	14,839	22,258	公益事業	
INDIAN OIL CORP LTD	1,020.7	2,304.71	24,994	37,491	エネルギー	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	422.05	686.05	31,746	47,620	エネルギー	
VODAFONE IDEA LTD	11,058.9	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
JINDAL STEEL & POWER LTD	276.9	220.88	8,573	12,860	素材	
ULTRATECH CEMENT LTD	—	10.97	7,371	11,057	素材	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	30.5	53.46	7,282	10,923	金融	
TECH MAHINDRA LTD	58.2	92.74	10,103	15,154	情報技術	
YES BANK LTD	176.4	176.4	239	358	金融	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	318.2	282.02	4,399	6,599	一般消費財・サービス	
REC LTD	383.6	530.6	7,664	11,496	金融	
COAL INDIA LTD	725.1	1,440.5	21,268	31,903	エネルギー	
INDUS TOWERS LTD	206.8	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	217.4	622.66	16,189	24,283	金融	
GAIL INDIA LTD	378.66	691.94	10,469	15,703	公益事業	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	528	640.18	24,073	36,110	素材	
GRASIM INDUSTRIES LTD	106.8	136.2	20,290	30,435	素材	
WIPRO LTD	204.23	160.49	8,643	12,965	情報技術	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	84.16	108.98	36,240	54,361	情報技術	
INFOSYS LTD	472.4	487.24	76,389	114,584	情報技術	
LARSEN & TOUBRO LTD	55.72	135.49	20,129	30,193	資本財・サービス	
TATA MOTORS LTD	1,066.8	1,103.73	38,067	57,101	一般消費財・サービス	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	147.9	218.9	54,193	81,289	金融	
ICICI BANK LTD	—	222.99	14,276	21,415	金融	

銘柄	株数	当株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千インド・ルピー	千円		
RELIANCE INDUSTRIES LTD	400.4	526.81	112,160	168,240	エネルギー	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	1,211.25	2,380.25	28,194	42,291	エネルギー	
ITC LTD	432.9	804.34	16,279	24,419	生活必需品	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	169.5	234.85	18,379	27,569	一般消費財・サービス	
HERO MOTOCORP LTD	25.1	29.67	8,663	12,994	一般消費財・サービス	
BHARTI AIRTEL LTD	211.42	290.16	15,233	22,850	コミュニケーション・サービス	
UPL LTD	—	137.76	11,011	16,517	素材	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	152.4	147.6	10,055	15,082	ヘルスケア	
HCL TECHNOLOGIES LTD	151.4	162.74	16,024	24,036	情報技術	
VEDANTA LTD	1,334.6	1,329.16	34,830	52,245	素材	
インド・ルピー通貨計	株数、金額	25,123.19	23,600.18	950,361	1,425,542	
	銘柄数 < 比率 >	39銘柄	43銘柄		< 8.8% >	
(インドネシア)		百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,563	4,933	2,466,500	18,992	一般消費財・サービス	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	—	1,013	780,010	6,006	素材	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	9,272	18,061	5,544,727	42,694	コミュニケーション・サービス	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,727	4,250	2,052,750	15,806	金融	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	615	1,194	3,641,700	28,041	金融	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	3,370	5,474	3,257,030	25,079	金融	
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	—	8,570	886,995	6,829	公益事業	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	7,761	13,452	5,367,348	41,328	金融	
ADARO ENERGY TBK PT	—	12,895	1,624,770	12,510	エネルギー	
インドネシア・ルピア通貨計	株数、金額	25,308	69,842	25,621,830	197,288	
	銘柄数 < 比率 >	6銘柄	9銘柄		< 1.2% >	
(ブラジル)		百株	百株	千ブラジル・リアル	千円	
ULTRAPAR PARTICIPACOES RIGHTS SA	—	902.93	0	19	エネルギー	
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	6	164	92	2,025	公益事業	
ENERGISA SA-UNITS	—	106	483	10,633	公益事業	
RUMO SA	—	285	562	12,367	資本財・サービス	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	146	1,765	1,009	22,181	金融	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	36	184	578	12,718	金融	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	268	755	2,218	48,752	一般消費財・サービス	
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	66	108	423	9,304	生活必需品	
TIM SA	—	485.26	557	12,239	コミュニケーション・サービス	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	1,300	4,438	12,950	284,528	エネルギー	
BANCO BRADESCO SA-PREF	1,437.26	4,212.18	10,951	240,621	金融	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	1,833.36	4,857.36	14,576	320,272	金融	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	246	185	833	18,319	素材	
VALE SA	1,035.9	948.9	10,777	236,796	素材	
GERDAU SA-PREF	367	570	1,696	37,270	素材	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	821	3,673	11,030	242,342	エネルギー	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	413.97	1,074.87	1,301	28,599	公益事業	
ITAUSA SA	—	1,361	1,528	33,580	金融	
BRASKEM SA-PREF A	125	261	1,566	34,406	素材	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	48	222	960	21,095	公益事業	
BANCO DO BRASIL S. A.	453	1,543	4,959	108,959	金融	
COSAN SA	—	644	1,573	34,567	エネルギー	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	123	372	1,620	35,602	公益事業	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	33	792	472	10,388	公益事業	
EMBRAER SA	282	712	1,349	29,644	資本財・サービス	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	753	949	1,327	29,170	素材	
CCR SA	252	886	1,189	26,124	資本財・サービス	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ブラジル・リアル	千円		
BRF SA	197	571	1,533	33,697	生活必需品	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	68	260	949	20,867	公益事業	
TIM PARTICIPACOES SA	194.26	—	—	—	その他	
TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	153	—	—	—	その他	
LOJAS RENNEN S. A.	50.05	197.05	854	18,785	一般消費財・サービス	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	85.84	147.84	315	6,941	一般消費財・サービス	
JBS SA	429	965	2,849	62,610	生活必需品	
SUZANO SA	89.45	122.45	724	15,927	素材	
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	197	379	729	16,037	生活必需品	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	141	906	1,487	32,685	金融	
CIELO SA	752.28	2,442.28	886	19,478	情報技術	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	90	370	905	19,884	公益事業	
SUL AMERICA SA - UNITS	—	188.18	641	14,102	金融	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	32	186.54	270	5,938	公益事業	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	146	332	1,356	29,812	金融	
RAIA DROGASIL SA	—	235	582	12,804	生活必需品	
TELEFONICA BRASIL S. A.	10	369	1,548	34,018	コミュニケーション・サービス	
KLABIN SA - UNIT	144	—	—	—	素材	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	565	732	1,387	30,477	エネルギー	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	199	516	1,376	30,236	金融	
LOJAS AMERICANAS SA	22.93	46.93	95	2,104	一般消費財・サービス	
COGNA EDUCACAO	475	2,643	1,147	25,202	一般消費財・サービス	
BANCO BRADESCO S. A.	382.41	1,267.65	2,786	61,218	金融	
AMBEV SA	878	1,872	3,262	71,689	生活必需品	
ブラジル・リアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	15,346.71 43銘柄	47,205.42 48銘柄	112,285 <15.3%>	2,467,055	
(中国)		百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	650	737	1,532	26,315	金融	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	—	1,495	729	12,530	金融	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	682	—	—	—	資本財・サービス	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	—	175	291	5,001	金融	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	131	249	1,551	26,642	金融	
IND & COMM BK OF CHINA-A	2,318	3,796	1,992	34,227	金融	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	55	93	193	3,319	ヘルスケア	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	60	94	300	5,164	金融	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	84	29	121	2,085	一般消費財・サービス	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	4	3	603	10,371	生活必需品	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	46	80	322	5,541	素材	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	—	500	604	10,382	不動産	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	996	1,733	1,720	29,555	金融	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	404	—	—	—	公益事業	
CITIC SECURITIES CO-A	110	148	350	6,011	金融	
CHINA MERCHANTS BANK-A	359	388	2,058	35,351	金融	
PING AN BANK CO LTD-A	378	464	1,011	17,380	金融	
GF SECURITIES CO LTD-A	98	134	197	3,390	金融	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	2,175	3,940	1,824	31,330	資本財・サービス	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	—	101	259	4,458	一般消費財・サービス	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	379	630	1,325	22,765	一般消費財・サービス	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	238	337	124	2,135	素材	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	291	421	250	4,302	資本財・サービス	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	—	289	114	1,965	金融	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	—	132	404	6,950	資本財・サービス	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	845	903	267	4,590	資本財・サービス	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	621	704	361	6,214	素材	

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	96	68	150	2,576	素材
YANZHOU COAL MINING CO-A	49	81	119	2,049	エネルギー
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	303	306	204	3,510	金融
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	4,834	8,046	2,437	41,871	金融
BANK OF CHINA LTD-A	2,442	2,581	794	13,653	金融
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	1,704	2,089	900	15,463	エネルギー
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	1,733	3,315	1,624	27,898	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	263	398	767	13,179	エネルギー
CHINA VANKE CO LTD -A	191	344	827	14,209	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	122	153	431	7,407	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	412	487	247	4,257	金融
CHINA MINSHENG BANKING-A	1,525	3,033	1,331	22,868	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	1,551	2,530	951	16,338	金融
CRRC CORP LTD-A	552	—	—	—	資本財・サービス
CHINA UNITED NETWORK-A	913	—	—	—	コミュニケーション・サービス
CGN POWER CO LTD-A	—	189	50	866	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	90	154	239	4,112	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	123	229	261	4,491	金融
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	—	1,850	965	16,585	資本財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	268	—	—	—	資本財・サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	815	915	698	11,990	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	35	52	231	3,978	金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	603	1,174	725	12,460	金融
AIR CHINA LTD-A	148	207	157	2,709	資本財・サービス
BYD CO LTD -A	18	7	167	2,873	一般消費財・サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	44	71	93	1,599	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-A	98	98	167	2,884	資本財・サービス
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	259	130	127	2,197	素材
HUANENG POWER INTL INC-A	386	665	280	4,819	公益事業
オフショア・人民元通貨計	株数	金額	33,469	574,840	
	銘柄数 < 比率 >	51銘柄		< 3.6% >	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リングギット	千円	
MISC BHD	429	—	—	—	資本財・サービス
MALAYAN BANKING BHD	675	583	472	12,649	金融
GENTING BHD	—	878	434	11,627	一般消費財・サービス
PUBLIC BANK BERHAD	349	2,617	1,075	28,775	金融
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	691	1,360	631	16,882	金融
TENAGA NASIONAL BHD	347	497	483	12,937	公益事業
マレーシア・リングギット通貨計	株数	金額	3,097	82,871	
	銘柄数 < 比率 >	5銘柄		< 0.5% >	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
GOLD FIELDS LTD	154.2	241.42	3,195	24,894	素材
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	—	15.03	2,510	19,552	金融
NEPI ROCKCASTLE PLC	75	151.07	1,540	12,001	不動産
MULTICHOICE GROUP LTD	127.3	118.08	1,395	10,870	コミュニケーション・サービス
OLD MUTUAL LTD	1,695.4	1,295.77	1,709	13,314	金融
VODACOM GROUP LTD	171.2	141.5	1,807	14,083	コミュニケーション・サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD	227.2	157.17	2,444	19,046	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD	119	139.46	2,347	18,287	金融
BIDVEST GROUP LTD	88.7	90.87	1,701	13,252	資本財・サービス
BID CORP LTD	73.1	68.49	2,139	16,670	生活必需品
NETCARE LTD	566.9	—	—	—	ヘルスケア
STANDARD BANK GROUP LTD	364.2	320.36	4,040	31,477	金融
SASOL LTD	236.4	273.1	5,977	46,563	素材

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円		
REMGRO LTD	124.1	—	—	—	金融	
DISCOVERY LTD	89.4	130.47	1,603	12,491	金融	
EXXARO RESOURCES LTD	80.3	—	—	—	エネルギー	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	210.2	—	—	—	一般消費財・サービス	
SANLAM LTD	427.2	530.72	3,234	25,194	金融	
TIGER BRANDS LTD	66.8	—	—	—	生活必需品	
FIRSTRAND LTD	889.3	1,215.28	6,445	50,213	金融	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	399.6	278.95	1,506	11,734	一般消費財・サービス	
THE FOSCHINI GROUP LTD	78.4	—	—	—	一般消費財・サービス	
ABSA GROUP LTD	254.6	255.81	3,396	26,461	金融	
NASPERS LTD-N SHS	17.29	26.73	7,910	61,626	一般消費財・サービス	
MTN GROUP LTD	385.9	433.66	4,531	35,298	コミュニケーション・サービス	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	64.3	64.45	1,554	12,105	素材	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	132.8	119.7	1,936	15,084	ヘルスケア	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	54.5	122.25	3,309	25,783	素材	
SAPPI LIMITED	470.8	—	—	—	素材	
TELKOM SA SOC LTD	350	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
SPAR GROUP LIMITED/THE	77.7	—	—	—	生活必需品	
MR PRICE GROUP LTD	59	79.44	1,659	12,924	一般消費財・サービス	
SIBANYE STILLWATER LTD	265	344.77	2,064	16,082	素材	
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額	8,395.79	6,614.55	69,963	545,014	
	銘柄数 < 比率 >	32 銘柄	24 銘柄		< 3.4% >	
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	千円		
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	208	271	3,035	10,501	金融	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	309	458	19,602	67,824	素材	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	227	385	4,620	15,985	金融	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	—	1,139	3,388	11,724	一般消費財・サービス	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	116	169	2,002	6,929	金融	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,068	1,641	15,876	54,933	金融	
THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	372	—	—	—	金融	
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	—	31,683	3,548	12,277	金融	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	685	917	3,828	13,246	素材	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	221	412	7,065	24,447	コミュニケーション・サービス	
KRUNG THAI BANK - NVDR	2,994	6,418	6,803	23,538	金融	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	3,163	3,723	5,026	17,390	エネルギー	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	—	1,520	3,556	12,306	ヘルスケア	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	384	670	7,906	27,354	エネルギー	
IRPC PCL - NVDR	8,853	11,202	4,323	14,960	エネルギー	
BANGCHAK CORP PCL-NVDR	—	1,048	2,588	8,956	エネルギー	
PTT PCL-NVDR	5,902	10,368	40,176	139,008	エネルギー	
THAI OIL PCL-NVDR	706	961	5,189	17,955	エネルギー	
CP ALL PCL-NVDR	693	1,447	8,645	29,914	生活必需品	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	—	539	3,355	11,609	資本財・サービス	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	—	187	2,094	7,246	金融	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	—	3,271	2,616	9,054	不動産	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,316	2,294	6,079	21,033	生活必需品	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,214	1,404	8,424	29,147	素材	
タイ・パーツ通貨計	株数、金額	28,431	82,127	169,753	587,347	
	銘柄数 < 比率 >	17 銘柄	23 銘柄		< 3.6% >	
ファンド合計	株数、金額	601,604.9	847,464.8	—	14,204,803	
	銘柄数 < 比率 >	398 銘柄	404 銘柄		< 88.1% >	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	柄	期首		当期		期末	
		□ 数	□ 数	□ 数	□ 数	評価額	価額
(アメリカ)			千口		千口	千アメリカ・ドル	千円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M			651		178.6	4,156	461,983
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額		651		178.6	4,156	461,983
	銘柄数 < 比率 >		1 銘柄		1 銘柄		< 2.9% >
(メキシコ)			千口		千口	千メキシコ・ペソ	千円
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA			80.2		—	—	—
メキシコ・ペソ通貨計	□ 数、金額		80.2		—	—	—
	銘柄数 < 比率 >		1 銘柄		—	—	< — >
(南アフリカ)			千口		千口	千南アフリカ・ランド	千円
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD			76.93		—	—	—
南アフリカ・ランド通貨計	□ 数、金額		76.93		—	—	—
	銘柄数 < 比率 >		1 銘柄		—	—	< — >
合計	□ 数、金額		808.13		178.6	—	461,983
	銘柄数 < 比率 >		3 銘柄		1 銘柄		< 2.9% >

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国 MSCI EMGMKT (アメリカ)	百万円 1,401	百万円 —

(注1) 外貨建の評価額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 14,204,803	% 88.0
投資信託証券	461,983	2.9
コール・ローン等、その他	1,477,725	9.1
投資信託財産総額	16,144,512	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=111.16円、1香港・ドル=14.31円、1シンガポール・ドル=82.49円、1台湾・ドル=3.97円、1トルコ・リラ=12.819円、1メキシコ・ペソ=5.613円、100チリ・ペソ=15.112円、1サウジアラビア・リアル=29.68円、1インド・ルピー=1.50円、100インドネシア・ルピア=0.77円、1ブラジル・リアル=21.971円、1オフショア・人民元=17.174円、1マレーシア・リンギット=26.753円、1南アフリカ・ランド=7.79円、1タイ・バーツ=3.46円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (16,010,106千円) の投資信託財産総額 (16,144,512千円) に対する比率は、99.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年7月5日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>16,467,168,379円</b>
コール・ローン等	842,077,407
株式（評価額）	14,204,803,209
投資信託証券（評価額）	461,983,406
未収入金	712,351,835
未取配当金	107,607,095
差入委託証拠金	138,345,427
<b>(B) 負債</b>	<b>340,596,345</b>
未払金	333,023,836
未払解約金	7,566,569
その他未払費用	5,940
<b>(C) 純資産総額（A－B）</b>	<b>16,126,572,034</b>
元本	8,472,556,221
次期繰越損益金	7,654,015,813
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>8,472,556,221口</b>
1万口当り基準価額（C/D）	19,034円

\*期首における元本額は6,697,704,657円、当作成期間中における追加設定元本額は2,563,269,417円、同解約元本額は788,417,853円です。

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、新興国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）30,073,026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）244,455,917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）247,588,516円、D-1's 新興国株式インデックス135,184,864円、i F r e e 新興国株式インデックス3,368,872,878円、i F r e e 8資産バランス2,090,080,781円、新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド（為替ヘッジなし/適格機関投資家専用）717,072,972円、D Cダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド1,170,193,060円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式372,572,544円、ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド96,461,663円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は19,034円です。

■損益の状況

当期 自 2020年7月7日 至 2021年7月5日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>420,452,414円</b>
受取配当金	420,289,006
受取利息	198,675
その他収益金	225
支払利息	△ 35,492
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>3,619,866,641</b>
売買益	4,235,122,648
売買損	△ 615,256,007
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>81,757,968</b>
取引益	158,263,439
取引損	△ 76,505,471
<b>(D) その他費用</b>	<b>△ 24,606,978</b>
<b>(E) 当期損益金（A+B+C+D）</b>	<b>4,097,470,045</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>2,527,410,481</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△ 506,206,067</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>1,535,341,354</b>
<b>(I) 合計（E+F+G+H）</b>	<b>7,654,015,813</b>
次期繰越損益金（I）	7,654,015,813

（注1）解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

（注2）追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

【注記】

出典：FTSE International Limited（以下、「FTSE」）<sup>®</sup> FTSE。FTSE<sup>®</sup>は、ロンドン証券取引所グループ会社が所有する商標であり、ライセンスに基づき FTSE International Limited によって使用されています。Fundamental Index<sup>®</sup> および RAFI<sup>®</sup> は Research Affiliates, LLC の登録商標です。FTSE RAFI<sup>®</sup> エマージング インデックスは Research Affiliates LLC（以下、「RAI」）と共同し FTSE International Limited（以下、「FTSE」）によって計算されます。本インデックスに関する知的財産権はすべて FTSE に帰属します。FTSE のインデックス、FTSE Ratings、またはその基礎データに関する瑕疵や不作為については、FTSE 並びにライセンス各社はいずれも一切の責任を負いません。また、書面に基づく FTSE の同意がない限り、FTSE のデータの再配信も許可されません。

Source: FTSE International Limited ("FTSE")<sup>®</sup> FTSE. "FTSE"<sup>®</sup> is a trade mark of the London Stock Exchange Group companies and is used by FTSE International Limited under licence. The trade names Fundamental Index<sup>®</sup> and RAFI<sup>®</sup> are registered trademarks of Research Affiliates, LLC. The FTSE RAFI<sup>®</sup> Emerging Index is calculated by FTSE in conjunction with Research Affiliates LLC. All intellectual property rights in the Index vest in FTSE. Neither FTSE nor its licensors accept any liability for any errors or omissions in the FTSE indices and / or FTSE ratings or underlying data. No further distribution of FTSE Data is permitted without FTSE's express written consent.

# 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

## 運用報告書（全体版） 第5期

（決算日 2021年11月30日）  
（作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日）

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、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おります。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先（コールセンター）  
TEL 0120-106212  
（営業日の9:00～17:00）  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	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います。		
主要投資対象	ベビーファンド	日本債券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マザーファンド	わが国の公社債	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の30%以下	
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	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、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公社債 組入比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
1 期末(2017年11月30日)	円 10,010	円 0	% 0.1	522.295	% 0.2	% 99.3	% -	百万円 1,379
2 期末(2018年11月30日)	10,025	0	0.1	523.683	0.3	99.4	-	2,161
3 期末(2019年12月 2 日)	10,249	0	2.2	536.068	2.4	99.5	-	2,135
4 期末(2020年11月30日)	10,153	0	△0.9	531.781	△0.8	99.5	-	2,402
5 期末(2021年11月30日)	10,151	0	△0.0	532.469	0.1	99.1	-	3,041

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。

(注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注4) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

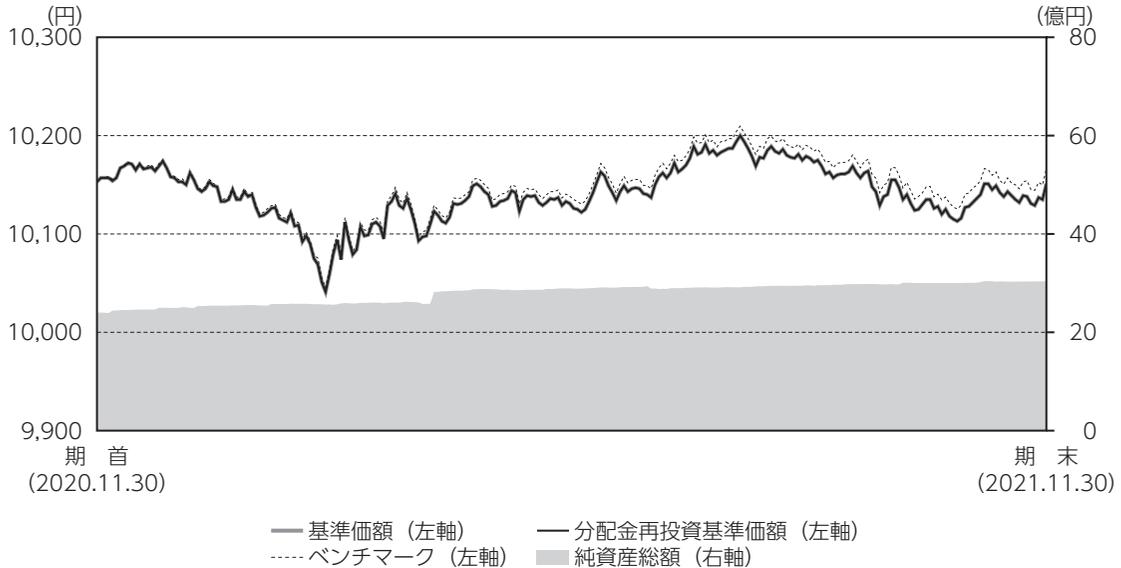
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- \* 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- \* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- \* 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。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：10,153円  
 期末：10,151円（分配金0円）  
 騰落率：△0.0%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

わが国の公社債に投資した結果、金利は上昇（債券価格は下落）したものの、債券の利息収入がプラス要因となり、基準価額は当作成期首と同程度の水準となりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス ( D B I ) 総合指数 (ベンチマーク)		公 社 債 率 組 入 比	債 券 先 物 率 比
	円	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2020年11月30日	10,153	% -	531.781	% -	% 99.5	% -
12月末	10,153	0.0	531.946	0.0	99.5	-
2021年 1 月末	10,127	△0.3	530.582	△0.2	99.5	-
2 月末	10,041	△1.1	526.155	△1.1	99.2	-
3 月末	10,111	△0.4	529.811	△0.4	99.3	-
4 月末	10,129	△0.2	530.887	△0.2	99.3	-
5 月末	10,133	△0.2	531.127	△0.1	99.0	-
6 月末	10,137	△0.2	531.421	△0.1	99.5	-
7 月末	10,187	0.3	534.087	0.4	99.1	-
8 月末	10,177	0.2	533.627	0.3	99.0	-
9 月末	10,140	△0.1	531.730	△0.0	99.3	-
10月末	10,128	△0.2	531.186	△0.1	99.4	-
(期末) 2021年11月30日	10,151	△0.0	532.469	0.1	99.1	-

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇後、当作成期首の水準まで一時低下しましたが、再び上昇しました。

国内長期金利は、日銀の長短金利操作の下、2020年中はゼロ%をやや上回る狭いレンジで推移しました。2021年に入ると、日銀が3月の金融政策決定会合での各種施策の点検において長期金利の許容変動幅を拡大するとの思惑や、米国長期金利の急上昇を受け、2月末にかけて0.1%台半ばまで上昇しました。3月の金融政策決定会合では長期金利の変動幅の明確化等が決定されましたが、政策の大枠に変更がなかったこともあり、長期金利は低下基調に転じました。その後も、米国長期金利の低下や新型コロナウイルスの感染拡大も重なり、8月には一時ゼロ%程度まで低下しました。9月以降は、商品市況の上昇などによる世界的なインフレ懸念を受けた先進各国の長期金利の上昇に連動して、国内長期金利は当作成期末にかけて上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「日本債券インデックスマザーファンド」の受益証券を中心に組み入れ、ベンチマークに連動することをめざした運用を行います。

### ■日本債券インデックスマザーファンド

今後も、ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行います。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入出や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

## ポートフォリオについて

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■当ファンド

「日本債券インデックスマザーファンド」の受益証券を高位に組み入れ、ベンチマークに連動することをめざした運用を行いました。

### ■日本債券インデックスマザーファンド

当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

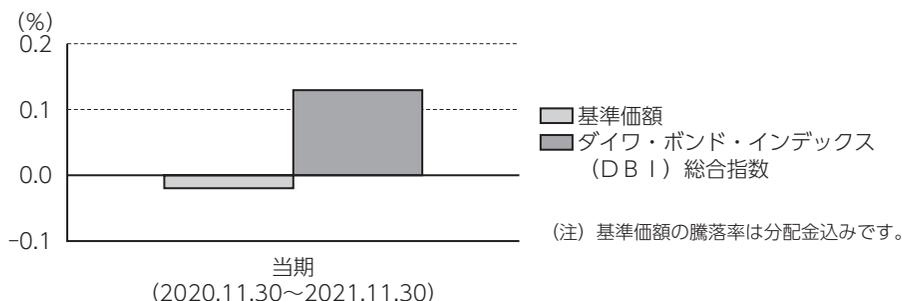
組入ファンド	ベンチマーク
日本債券インデックスマザーファンド	ダイワ・ボンド・インデックス (DB I) 総合指数

## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は0.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△0.0%となりました。

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差異は0.1%でした。差異の内訳は、運用管理費用等の要因によるベンチマークとの差異が0.1%程度、「日本債券インデックスマザーファンド」におけるベンチマークとの差異が0.0%程度となっており、信託報酬要因を除くと、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\* ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス (DB I) 総合指数です。

## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2020年12月1日 ～2021年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	196

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

「日本債券インデックスマザーファンド」の受益証券を中心に組み入れ、ベンチマークに連動することをめざした運用を行います。

### ■日本債券インデックスマザーファンド

今後も、ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行います。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入出や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2020.12.1~2021.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	11円	0.110%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10,142円です。
(投 信 会 社)	(7)	(0.071)	投信会社分は、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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(3)	(0.027)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(1)	(0.011)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	12	0.115	

(注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

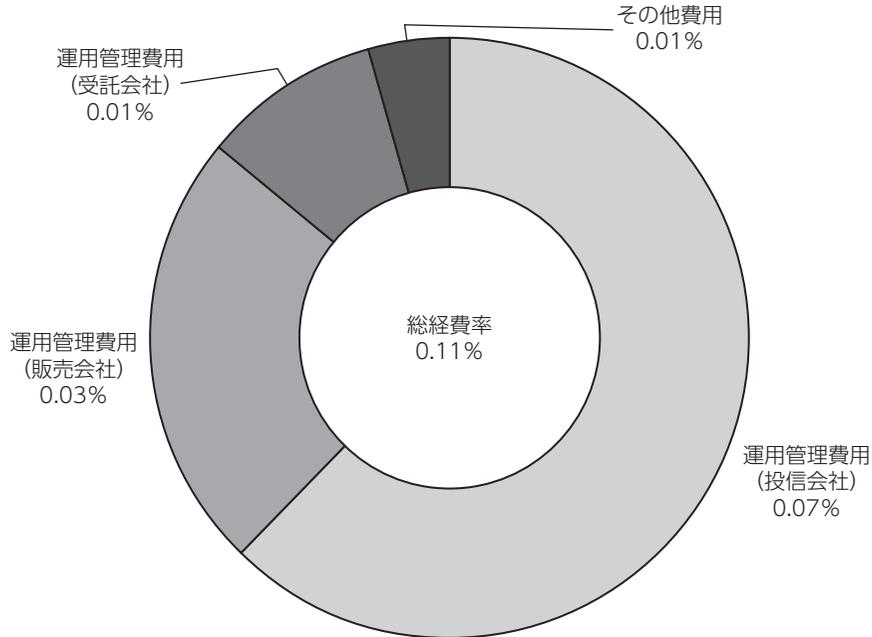
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.11%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日本債券インデックス マザーファンド	644,071	912,460	196,246	277,896

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等			売付額等		
区 分	A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
公社債	百万円 21,163	百万円 225	1.1	百万円 16,183	百万円 503	% 3.1
コール・ローン	91,036	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合3.1%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

種 類	当 期	
	日本債券インデックスマザーファンド	
	買	付 額
公社債		百万円 600

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
日本債券インデックスマザーファンド	1,691,971	2,139,796	3,038,297	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日本債券インデックスマザーファンド	千円 3,038,297	% 99.8
コール・ローン等、その他	5,351	0.2
投資信託財産総額	3,043,649	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,043,649,365円
コール・ローン等	5,351,695
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	3,038,297,670
(B) 負債	2,324,894
未払解約金	612,482
未払信託報酬	1,630,950
その他未払費用	81,462
(C) 純資産総額(A-B)	3,041,324,471
元本	2,995,991,358
次期繰越損益金	45,333,113
(D) 受益権総口数	2,995,991,358口
1万口当り基準価額(C/D)	10,151円

\*期首における元本額は2,366,238,389円、当作成期間中における追加設定元本額は1,226,825,775円、同解約元本額は597,072,806円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は10,151円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月1日 至2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,299円
受取利息	87
支払利息	△ 1,386
(B) 有価証券売買損益	4,631,962
売買益	5,144,915
売買損	△ 512,953
(C) 信託報酬等	△ 3,231,301
(D) 当期繰越損益金(A + B + C)	1,399,362
(E) 前期繰越損益金	6,252,094
(F) 追加信託差損益金	37,681,657
(配当等相当額)	( 32,844,106)
(売買損益相当額)	( 4,837,551)
(G) 合計(D + E + F)	45,333,113
次期繰越損益金(G)	45,333,113
追加信託差損益金	37,681,657
(配当等相当額)	( 32,844,106)
(売買損益相当額)	( 4,837,551)
分配準備積立金	21,171,812
繰越損益金	△13,520,356

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	37,681,657
(d) 分配準備積立金	21,171,812
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	58,853,469
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	58,853,469
(h) 受益権総口数	2,995,991,358口

# 日本債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第22期 (決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日)

日本債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	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
株式組入制限	純資産総額の30%以下

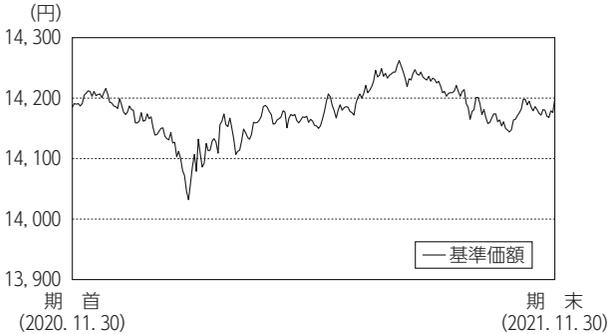
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

## ■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		ダイワ・ポンド・インデックス (DBI) 総合指数 (ベンチマーク)		公社債組入比率	債券先物比率
	円	騰落率	総合指数	騰落率		
(期首) 2020年11月30日	14,185	—	531.781	—	99.6	—
12月末	14,186	0.0	531.946	0.0	99.6	—
2021年1月末	14,151	△ 0.2	530.582	△ 0.2	99.6	—
2月末	14,032	△ 1.1	526.155	△ 1.1	99.3	—
3月末	14,132	△ 0.4	529.811	△ 0.4	99.4	—
4月末	14,158	△ 0.2	530.887	△ 0.2	99.4	—
5月末	14,165	△ 0.1	531.127	△ 0.1	99.1	—
6月末	14,172	△ 0.1	531.421	△ 0.1	99.6	—
7月末	14,243	0.4	534.087	0.4	99.2	—
8月末	14,231	0.3	533.627	0.3	99.1	—
9月末	14,181	△ 0.0	531.730	△ 0.0	99.4	—
10月末	14,165	△ 0.1	531.186	△ 0.1	99.5	—
(期末) 2021年11月30日	14,199	0.1	532.469	0.1	99.2	—

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) ダイワ・ポンド・インデックス (DBI) 総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。

(注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注5) 債券先物比率は買建比率 - 売建比率です。

## 《運用経過》

## ◆基準価額等の推移について

## 【基準価額・騰落率】

期首：14,185円 期末：14,199円 騰落率：0.1%

## 【基準価額の主な変動要因】

わが国の公社債に投資した結果、金利は上昇 (債券価格は下落) したものの、債券の利息収入がプラス要因となり、基準価額は当作成期首と同程度の水準となりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

## ◆投資環境について

## ○国内債券市場

国内債券市場では、長期金利は上昇後、当作成期首の水準まで一時低下しましたが、再び上昇しました。

国内長期金利は、日銀の長短金利操作の下、2020年中はゼロ%をやや上回る狭いレンジで推移しました。2021年に入ると、日銀が3月の金融政策決定会合での各種施策の点検において長期金利の許容変動幅を拡大するとの思惑や、米国長期金利の急上昇を受け、2月末にかけて0.1%台半ばまで上昇しました。3月の金融政策決定会合では長期金利の変動幅の明確化等が決定されましたが、政策の大枠に変更がなかったこともあり、長期金利は低下基調に転じました。その後も、米国長期金利の低下や新型コロナウイルスの感染拡大も重なり、8月には一時ゼロ%程度まで低下しました。9月以降は、商品市況の上昇などによる世界的なインフレ懸念を受けた先進各国の長期金利の上昇に連動して、国内長期金利は当作成期末にかけて上昇しました。

## ◆前作成期末における「今後の運用方針」

今後も、ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行います。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド (国債以外の債券における国債との利回り格差) への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

## ◆ポートフォリオについて

当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド (国債以外の債券における国債との利回り格差) の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

## ◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は0.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率も0.1%となりました。

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差はほとんどなく、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。金利や信用スプレッドの変動に対する感応度を適切にコントロールしたことから、目立った超過損益は発生しませんでした。

\*ベンチマークはダイワ・ポンド・インデックス (DBI) 総合指数です。

## 《今後の運用方針》

今後も、ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行います。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド (国債以外の債券における国債との利回り格差) への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

# 日本債券インデックスマザーファンド

## ■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 ( 0)
合 計	0

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■売買および取引の状況

### 公 社 債

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	19,816,548	( 14,064,024 —)
	地方債証券	421,001	( 1,009,011 —)
	特殊債券	225,389	( 605,562 —)
	社債券	700,719	( 505,306 —)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債券(転換社債券)は含まれておりません。

(注4) 単位未満は切捨て。

## ■主要な売買銘柄

### 公 社 債

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当 期		付	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	千円	銘 柄	千円
145 5年国債 0.1% 2025/9/20	1,110,680	410 2年国債 0.1% 2022/3/1	2,005,080
148 5年国債 0.005% 2026/6/20	1,005,249	131 5年国債 0.1% 2022/3/20	1,173,167
360 10年国債 0.1% 2030/9/20	895,581	132 5年国債 0.1% 2022/6/20	882,041
147 5年国債 0.005% 2026/3/20	872,273	415 2年国債 0.1% 2022/8/1	751,784
362 10年国債 0.1% 2031/3/20	745,643	347 10年国債 0.1% 2027/6/20	709,633
363 10年国債 0.1% 2031/6/20	744,395	348 10年国債 0.1% 2027/9/20	608,574
361 10年国債 0.1% 2030/12/20	630,890	133 5年国債 0.1% 2022/9/20	551,287
421 2年国債 0.1% 2023/2/1	602,557	357 10年国債 0.1% 2029/12/20	404,692
348 10年国債 0.1% 2027/9/20	557,039	144 5年国債 0.1% 2025/6/20	388,457
364 10年国債 0.1% 2031/9/20	520,914	323 10年国債 0.9% 2022/6/20	384,073

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

## (1) 国内（邦貨建）公社債（種類別、新株予約権付社債券（転換社債券）を除く）

作成期 区分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うち B B 格 以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	79,992,000	85,097,080	89.5	—	58.1	21.6	9.7
地方債証券	3,300,000	3,514,853	3.7	—	2.2	1.0	0.5
特殊債券（除く金融債券）	2,500,000	2,602,888	2.7	—	1.3	0.8	0.6
金融債券	100,000	100,201	0.1	—	—	0.1	—
普通社債券	2,900,000	2,976,109	3.1	—	1.6	1.4	0.1
合 計	88,792,000	94,291,133	99.2	—	63.3	24.8	11.0

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注3) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

## (2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別、新株予約権付社債券（転換社債券）を除く）

区 分	当 期		末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
<b>国債証券</b>		%	千円	千円	
	134 5年国債	0.1000	950,000	952,251	2022/12/20
	326 10年国債	0.7000	30,000	30,258	2022/12/20
	327 10年国債	0.8000	450,000	454,360	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	45,862	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,160	2022/12/20
	421 2年国債	0.1000	600,000	601,614	2023/02/01
	135 5年国債	0.1000	1,550,000	1,554,526	2023/03/20
	328 10年国債	0.6000	350,000	353,300	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	101,463	2023/03/20
	423 2年国債	0.0050	100,000	100,180	2023/04/01
	424 2年国債	0.0050	500,000	500,955	2023/05/01
	425 2年国債	0.0050	380,000	380,767	2023/06/01
	136 5年国債	0.1000	950,000	953,391	2023/06/20
	329 10年国債	0.8000	500,000	507,185	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	96,365	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	133,887	2023/06/20
	426 2年国債	0.0050	390,000	390,830	2023/07/01
	427 2年国債	0.0050	166,000	166,373	2023/08/01
	137 5年国債	0.1000	800,000	803,392	2023/09/20
	330 10年国債	0.8000	612,000	622,281	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	365,000	369,814	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	93,301	2023/09/20
	429 2年国債	0.0050	40,000	40,099	2023/10/01
	138 5年国債	0.1000	1,200,000	1,205,676	2023/12/20
	332 10年国債	0.6000	250,000	253,727	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	182,290	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	185,000	192,326	2023/12/20
	139 5年国債	0.1000	900,000	904,770	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	700,000	711,697	2024/03/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
	67 20年国債		1. 9000	55, 000	57, 560	2024/03/20
	68 20年国債		2. 2000	120, 000	126, 416	2024/03/20
	69 20年国債		2. 1000	110, 000	115, 628	2024/03/20
	140 5年国債		0. 1000	700, 000	704, 025	2024/06/20
	334 10年国債		0. 6000	900, 000	916, 695	2024/06/20
	70 20年国債		2. 4000	83, 000	88, 362	2024/06/20
	71 20年国債		2. 2000	125, 000	132, 436	2024/06/20
	141 5年国債		0. 1000	1, 120, 000	1, 127, 078	2024/09/20
	335 10年国債		0. 5000	690, 000	702, 123	2024/09/20
	72 20年国債		2. 1000	105, 000	111, 555	2024/09/20
	142 5年国債		0. 1000	850, 000	855, 856	2024/12/20
	336 10年国債		0. 5000	275, 000	280, 263	2024/12/20
	337 10年国債		0. 3000	400, 000	405, 208	2024/12/20
	73 20年国債		2. 0000	120, 000	127, 792	2024/12/20
	74 20年国債		2. 1000	73, 000	77, 964	2024/12/20
	143 5年国債		0. 1000	700, 000	705, 215	2025/03/20
	338 10年国債		0. 4000	580, 000	589, 987	2025/03/20
	75 20年国債		2. 1000	80, 000	85, 881	2025/03/20
	76 20年国債		1. 9000	51, 000	54, 411	2025/03/20
	77 20年国債		2. 0000	130, 000	139, 126	2025/03/20
	144 5年国債		0. 1000	890, 000	896, 977	2025/06/20
	339 10年国債		0. 4000	590, 000	600, 938	2025/06/20
	78 20年国債		1. 9000	61, 000	65, 381	2025/06/20
	79 20年国債		2. 0000	50, 000	53, 770	2025/06/20
	80 20年国債		2. 1000	53, 000	57, 185	2025/06/20
	145 5年国債		0. 1000	1, 100, 000	1, 109, 031	2025/09/20
	340 10年国債		0. 4000	760, 000	775, 093	2025/09/20
	82 20年国債		2. 1000	87, 000	94, 341	2025/09/20
	146 5年国債		0. 1000	480, 000	484, 099	2025/12/20
	341 10年国債		0. 3000	500, 000	508, 445	2025/12/20
	83 20年国債		2. 1000	93, 000	101, 365	2025/12/20
	147 5年国債		0. 0050	840, 000	843, 981	2026/03/20
	342 10年国債		0. 1000	880, 000	887, 981	2026/03/20
	85 20年国債		2. 1000	58, 000	63, 536	2026/03/20
	86 20年国債		2. 3000	80, 000	88, 326	2026/03/20
	87 20年国債		2. 2000	55, 000	60, 487	2026/03/20
	148 5年国債		0. 0050	1, 000, 000	1, 005, 020	2026/06/20
	343 10年国債		0. 1000	780, 000	787, 488	2026/06/20
	88 20年国債		2. 3000	100, 000	110, 996	2026/06/20
	89 20年国債		2. 2000	78, 000	86, 220	2026/06/20
	149 5年国債		0. 0050	220, 000	221, 060	2026/09/20
	344 10年国債		0. 1000	780, 000	787, 527	2026/09/20
	90 20年国債		2. 2000	20, 000	22, 219	2026/09/20
	345 10年国債		0. 1000	900, 000	909, 135	2026/12/20
	92 20年国債		2. 1000	310, 000	344, 627	2026/12/20
	346 10年国債		0. 1000	780, 000	788, 307	2027/03/20
	93 20年国債		2. 0000	100, 000	111, 186	2027/03/20
	94 20年国債		2. 1000	130, 000	145, 234	2027/03/20
	347 10年国債		0. 1000	600, 000	606, 528	2027/06/20
	95 20年国債		2. 3000	50, 000	56, 682	2027/06/20

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率	末		
			額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	96 20年国債	2.1000	55,000	61,736	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	550,000	556,253	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	45,343	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	320,000	360,876	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	1,050,000	1,062,453	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	100,000	113,326	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	500,000	506,015	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	155,000	177,426	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	350,000	405,076	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	99,550	2028/04/20
	351 10年国債	0.1000	800,000	809,744	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	170,000	196,642	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	10,000	11,435	2028/06/20
	11 フィリピン共和国	0.9900	100,000	101,955	2028/08/15
	352 10年国債	0.1000	700,000	708,855	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	144,787	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	173,392	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	580,000	587,609	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	90,000	103,914	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	300,000	342,126	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	600,000	607,926	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	55,000	62,971	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	260,000	301,498	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	690,000	699,163	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	200,000	234,462	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	150,000	174,708	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	510,000	516,599	2029/09/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	19,579	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	310,000	362,634	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	620,000	627,768	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	70,000	82,200	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	212,828	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	28,854	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	660,000	667,966	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	200,000	237,400	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	200,000	235,734	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	35,947	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	930,000	940,360	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	111,531	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	107,588	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	317,000	361,294	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	900,000	909,117	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	200,000	233,758	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	200,000	231,996	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	45,364	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	633,000	638,437	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	200,000	237,910	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	300,000	354,150	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	710,000	715,268	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	130,000	156,302	2031/03/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
	126 20年国債		2.0000	110,000	130,214	2031/03/20
	127 20年国債		1.9000	250,000	293,620	2031/03/20
	5 30年国債		2.2000	28,000	33,734	2031/05/20
	363 10年国債		0.1000	700,000	703,990	2031/06/20
	128 20年国債		1.9000	250,000	294,380	2031/06/20
	129 20年国債		1.8000	200,000	233,600	2031/06/20
	364 10年国債		0.1000	520,000	522,277	2031/09/20
	130 20年国債		1.8000	140,000	163,899	2031/09/20
	131 20年国債		1.7000	150,000	174,142	2031/09/20
	6 30年国債		2.4000	24,000	29,580	2031/11/20
	132 20年国債		1.7000	40,000	46,531	2031/12/20
	133 20年国債		1.8000	430,000	504,506	2031/12/20
	134 20年国債		1.8000	30,000	35,288	2032/03/20
	135 20年国債		1.7000	92,000	107,278	2032/03/20
	136 20年国債		1.6000	300,000	346,755	2032/03/20
	7 30年国債		2.3000	55,000	67,672	2032/05/20
	138 20年国債		1.5000	100,000	114,796	2032/06/20
	139 20年国債		1.6000	370,000	428,615	2032/06/20
	140 20年国債		1.7000	300,000	351,486	2032/09/20
	8 30年国債		1.8000	27,000	31,965	2032/11/22
	9 30年国債		1.4000	43,000	49,056	2032/12/20
	141 20年国債		1.7000	200,000	234,850	2032/12/20
	142 20年国債		1.8000	240,000	284,443	2032/12/20
	10 30年国債		1.1000	45,000	49,915	2033/03/20
	143 20年国債		1.6000	210,000	244,782	2033/03/20
	144 20年国債		1.5000	240,000	277,072	2033/03/20
	11 30年国債		1.7000	40,000	47,173	2033/06/20
	145 20年国債		1.7000	420,000	495,318	2033/06/20
	12 30年国債		2.1000	60,000	73,740	2033/09/20
	146 20年国債		1.7000	350,000	413,633	2033/09/20
	13 30年国債		2.0000	75,000	91,533	2033/12/20
	147 20年国債		1.6000	320,000	375,148	2033/12/20
	14 30年国債		2.4000	82,000	104,279	2034/03/20
	148 20年国債		1.5000	530,000	616,029	2034/03/20
	15 30年国債		2.5000	50,000	64,395	2034/06/20
	149 20年国債		1.5000	402,000	467,988	2034/06/20
	16 30年国債		2.5000	250,000	323,187	2034/09/20
	150 20年国債		1.4000	180,000	207,610	2034/09/20
	17 30年国債		2.4000	130,000	166,909	2034/12/20
	151 20年国債		1.2000	400,000	451,740	2034/12/20
	18 30年国債		2.3000	80,000	102,026	2035/03/20
	152 20年国債		1.2000	460,000	520,260	2035/03/20
	19 30年国債		2.3000	57,000	72,888	2035/06/20
	153 20年国債		1.3000	430,000	492,401	2035/06/20
	154 20年国債		1.2000	550,000	623,034	2035/09/20
	21 30年国債		2.3000	60,000	77,168	2035/12/20
	155 20年国債		1.0000	350,000	387,208	2035/12/20
	22 30年国債		2.5000	170,000	223,884	2036/03/20
	156 20年国債		0.4000	270,000	275,969	2036/03/20
	157 20年国債		0.2000	360,000	357,220	2036/06/20

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
	24 30年国債		2.5000	92,000	121,895	2036/09/20
	158 20年国債		0.5000	350,000	362,229	2036/09/20
	25 30年国債		2.3000	150,000	194,889	2036/12/20
	159 20年国債		0.6000	170,000	178,243	2036/12/20
	26 30年国債		2.4000	180,000	237,198	2037/03/20
	160 20年国債		0.7000	360,000	382,741	2037/03/20
	161 20年国債		0.6000	320,000	335,008	2037/06/20
	27 30年国債		2.5000	150,000	200,848	2037/09/20
	162 20年国債		0.6000	350,000	366,117	2037/09/20
	163 20年国債		0.6000	340,000	355,347	2037/12/20
	28 30年国債		2.5000	170,000	228,825	2038/03/20
	164 20年国債		0.5000	500,000	514,340	2038/03/20
	165 20年国債		0.5000	300,000	308,244	2038/06/20
	29 30年国債		2.4000	200,000	267,398	2038/09/20
	166 20年国債		0.7000	350,000	370,615	2038/09/20
	167 20年国債		0.5000	300,000	307,488	2038/12/20
	30 30年国債		2.3000	220,000	291,638	2039/03/20
	168 20年国債		0.4000	320,000	322,083	2039/03/20
	169 20年国債		0.3000	320,000	316,044	2039/06/20
	31 30年国債		2.2000	300,000	394,329	2039/09/20
	170 20年国債		0.3000	220,000	216,882	2039/09/20
	171 20年国債		0.3000	300,000	295,197	2039/12/20
	32 30年国債		2.3000	285,000	380,899	2040/03/20
	172 20年国債		0.4000	100,000	100,000	2040/03/20
	173 20年国債		0.4000	410,000	409,290	2040/06/20
	33 30年国債		2.0000	280,000	360,231	2040/09/20
	174 20年国債		0.4000	420,000	418,534	2040/09/20
	175 20年国債		0.5000	400,000	405,284	2040/12/20
	34 30年国債		2.2000	270,000	358,030	2041/03/20
	176 20年国債		0.5000	340,000	343,933	2041/03/20
	177 20年国債		0.4000	365,000	362,043	2041/06/20
	35 30年国債		2.0000	250,000	323,395	2041/09/20
	178 20年国債		0.5000	150,000	151,363	2041/09/20
	36 30年国債		2.0000	310,000	402,364	2042/03/20
	37 30年国債		1.9000	350,000	448,668	2042/09/20
	38 30年国債		1.8000	250,000	316,517	2043/03/20
	39 30年国債		1.9000	230,000	296,389	2043/06/20
	40 30年国債		1.8000	180,000	228,472	2043/09/20
	41 30年国債		1.7000	170,000	212,629	2043/12/20
	42 30年国債		1.7000	205,000	256,668	2044/03/20
	43 30年国債		1.7000	200,000	250,668	2044/06/20
	44 30年国債		1.7000	200,000	250,922	2044/09/20
	45 30年国債		1.5000	200,000	242,592	2044/12/20
	46 30年国債		1.5000	140,000	169,923	2045/03/20
	47 30年国債		1.6000	400,000	494,788	2045/06/20
	48 30年国債		1.4000	160,000	190,832	2045/09/20
	49 30年国債		1.4000	120,000	143,187	2045/12/20
	50 30年国債		0.8000	260,000	274,814	2046/03/20
	51 30年国債		0.3000	240,000	226,044	2046/06/20
	52 30年国債		0.5000	260,000	256,321	2046/09/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当 期		末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	53 30年国債	0.6000	250,000	251,920	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	310,000	326,485	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	260,000	273,639	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	170,000	178,593	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	230,000	241,451	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	100,678	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	350,000	367,150	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	300,000	306,870	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	210,000	224,544	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	203,706	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	153,078	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	230,000	222,258	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	230,000	216,057	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	220,000	206,078	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	200,000	187,026	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	209,835	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	200,000	186,930	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	230,000	226,412	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	290,000	285,441	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	259,000	261,843	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	180,000	253,659	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	235,000	237,307	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	240,000	242,373	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	140,000	141,218	2051/09/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	141,153	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	156,797	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	279,128	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	200,910	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	275,000	293,053	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	330,697	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	380,000	354,897	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	430,000	400,394	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	300,000	298,161	2061/03/20
種別小計	銘柄数	262銘柄			
	金額		79,992,000	85,097,080	
地方債証券	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	100,888	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	100,639	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	101,485	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	202,723	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	101,460	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	101,504	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	101,447	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	203,686	2025/04/16
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	106,623	2025/11/21
	27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	101,874	2025/11/27
	751 東京都公債	0.3700	100,000	101,482	2025/12/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	100,259	2026/06/19

区 分	当 期		末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,916	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	101,119	2027/03/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	201,625	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	101,039	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	101,351	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	115,199	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	113,930	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	116,763	2029/06/20
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	116,484	2029/12/14
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	117,498	2030/05/24
	2-2 岡山県公債	0.1200	100,000	100,154	2031/01/29
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	100,139	2031/06/30
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	117,121	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	115,382	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	115,827	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	109,600	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	130,694	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	115,929	2045/12/20
種別小計	銘柄数	30銘柄			
	金額		3,300,000	3,514,853	
特殊債券 (除く金融債券)	25 政保日本政策	0.8150	100,000	101,061	2023/02/24
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	100,916	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	100,927	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	101,190	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	100,960	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	101,467	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	101,524	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,108	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	101,547	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	203,284	2025/11/28
	127 都市再生	0.0750	100,000	100,191	2026/09/18
	80 住宅支援機構	1.5890	100,000	107,467	2026/09/18
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	107,540	2027/08/25
	1 地方公共団体15年	1.3340	100,000	107,919	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	115,190	2029/07/31
	47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	107,254	2029/09/20
	123 住宅支援機構	1.8010	100,000	116,970	2032/09/17
31 地方公共団体20	1.7440	100,000	117,162	2033/09/28	
223 政保道路機構	1.4270	100,000	114,844	2034/07/31	
284 政保道路機構	0.1490	200,000	195,373	2036/07/31	
298 政保道路機構	0.5470	100,000	103,238	2036/12/26	
247 道路機構	0.3420	200,000	195,749	2040/03/19	
種別小計	銘柄数	22銘柄			
	金額		2,500,000	2,602,888	

日本債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期		末		償還年月日
		銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	
金融債券		19 利付商工債	0.1000 %	100,000 千円	100,201 千円	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄				
	金額			100,000	100,201	
普通社債券		175 オリックス	1.0640	100,000	101,961	2023/11/24
		21 西日本高速道	0.7540	100,000	101,538	2023/12/20
		1 三菱UFJFG 劣後	0.9400	100,000	101,659	2024/06/26
		482 九州電力	0.1700	100,000	100,233	2024/08/23
		5 野村不動産 HD	0.9240	100,000	102,551	2025/05/30
		11日本たばこ産業	0.5990	100,000	101,889	2025/07/15
		63 中日本高速道	0.5760	100,000	102,163	2025/11/13
		4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	102,699	2025/12/18
		14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	100,443	2025/12/19
		16 NTT ファイナンス	0.1800	100,000	100,241	2025/12/19
		1 日生2021基金	0.2800	100,000	100,018	2026/08/03
		20 成田国際空港	0.1050	100,000	100,249	2026/08/21
		17 パナソニック	0.4700	100,000	101,500	2026/09/18
		7 三井住友海上	0.1900	100,000	100,049	2026/11/13
		509 関西電力	0.4700	100,000	101,460	2027/05/25
		12 アサヒグループHD	0.3300	100,000	101,050	2027/06/11
		15 デンソー	0.2450	100,000	100,656	2027/06/18
		78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	100,754	2027/07/23
		11 東京電力パワー	0.7900	100,000	102,792	2028/01/25
		20 ZHD	0.4600	100,000	99,967	2028/07/28
		15 ソフトバンク	0.4100	100,000	99,989	2028/10/12
		41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	114,360	2029/01/29
		13 NTT ファイナンス	1.0900	100,000	106,692	2029/09/20
		7 凸版印刷	1.1040	100,000	106,876	2029/12/12
		65 東京瓦斯	0.2250	100,000	100,444	2030/09/10
		18 楽天グループ	1.0500	100,000	100,138	2031/12/02
		332 北海道電力	0.9070	100,000	104,791	2036/04/25
		23 森ビル	0.9700	100,000	102,592	2038/05/17
		107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	116,343	2045/01/27
種別小計	銘柄数	29銘柄				
	金額			2,900,000	2,976,109	
合 計	銘柄数	344銘柄				
	金額			88,792,000	94,291,133	

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	94,291,133	99.0
コール・ローン等、その他	905,947	1.0
投資信託財産総額	95,197,080	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	95,197,080,993円
コール・ローン等	304,345,621
公社債 (評価額)	94,291,133,700
未収入金	403,578,000
未収利息	195,282,238
前払費用	2,741,434
(B) 負債	117,470,022
未払金	100,000,000
未払解約金	17,470,022
(C) 純資産総額 (A - B)	95,079,610,971
元本	66,960,247,306
次期繰越損益金	28,119,363,665
(D) 受益権総口数	66,960,247,306口
1万口当り基準価額 (C / D)	14,199円

\* 期首における元本額は63,632,169,674円、当作成期間中における追加設定元本額は13,191,022,279円、同解約元本額は9,862,944,647円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワ国内重視バランスファンド30V A (一般投資家私募)	59,050,508円
ダイワ国内重視バランスファンド50V A (一般投資家私募)	412,666,474円
ダイワ国際分散バランスファンド30V A (一般投資家私募)	49,180,012円
ダイワ国際分散バランスファンド50V A (一般投資家私募)	693,952,196円
D Cダイワ日本債券インデックス	9,573,099,389円
ダイワ国内債券インデックス (ラップ専用)	704,912円
ダイワ・バランスファンド35V A	10,117,083,683円
ダイワ・バランスファンド25V A (適格機関投資家専用)	1,686,540,655円
ダイワ国内バランスファンド25V A (適格機関投資家専用)	219,254,803円
ダイワ国内バランスファンド30V A (適格機関投資家専用)	314,922,939円
ダイワ・ノーロード日本債券ファンド	61,401,829円
ダイワファンドラップ日本債券インデックス	26,594,045,062円
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	6,074,653,568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	2,139,796,937円
ダイワ・インデックスセレクト日本債券	965,018,800円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,784,763,908円
ダイワライフスタイル25	477,075,499円
ダイワライフスタイル50	581,511,996円
ダイワライフスタイル75	155,524,136円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,199円です。

## ■損益の状況

当期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	676,821,899円
受取利息	676,924,268
支払利息	△ 102,369
(B) 有価証券売買損益	△ 562,204,040
売買益	73,052,280
売買損	△ 635,256,320
(C) その他費用	△ 221
(D) 当期損益金 (A + B + C)	114,617,638
(E) 前期繰越損益金	26,626,976,422
(F) 解約差損益金	△ 4,127,794,494
(G) 追加信託差損益金	5,505,564,099
(H) 合計 (D + E + F + G)	28,119,363,665
次期繰越損益金 (H)	28,119,363,665

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

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

## 運用報告書 (全体版) 第5期

(決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日~2021年11月30日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、外国の公社債に投資し、投資成果をF T S E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した。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先（コールセンター）  
TEL 0120-106212  
(営業日の9:00~17:00)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果をF T S E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	ベビーファンド	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの受益証券
	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	外国の公社債
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の10%以下
	マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	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、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
1 期末(2017年11月30日)	円 10,078	円 0	% 0.8	10,111	% 1.1	% 95.4	% 1.5	百万円 2,166
2 期末(2018年11月30日)	9,860	0	△2.2	9,927	△1.8	97.0	0.7	3,598
3 期末(2019年12月 2 日)	10,567	0	7.2	10,687	7.7	98.3	—	3,539
4 期末(2020年11月30日)	11,094	0	5.0	11,264	5.4	98.4	—	3,993
5 期末(2021年11月30日)	10,770	0	△2.9	10,974	△2.6	96.9	—	5,184

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)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。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)を除きます。

(注7) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

\*分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

\*分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

\*ベンチマークはF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）です。

### ■基準価額・騰落率

期首：11,094円

期末：10,770円（分配金0円）

騰落率：△2.9%（分配金込み）

### ■基準価額の主な変動要因

日本を除く先進国国債に主に投資した結果、債券市場で金利が上昇（債券価格は下落）したため基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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)

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) (ベンチマーク)		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2020年11月30日	11,094	% -	11,264	% -	% 98.4	% -
12月末	11,080	△0.1	11,257	△0.1	97.6	0.4
2021年 1 月末	11,011	△0.7	11,190	△0.7	97.7	0.4
2 月末	10,681	△3.7	10,854	△3.6	99.0	-
3 月末	10,660	△3.9	10,837	△3.8	99.5	-
4 月末	10,646	△4.0	10,830	△3.9	97.5	-
5 月末	10,665	△3.9	10,847	△3.7	98.8	-
6 月末	10,703	△3.5	10,893	△3.3	97.6	-
7 月末	10,887	△1.9	11,083	△1.6	96.4	-
8 月末	10,886	△1.9	11,086	△1.6	97.8	-
9 月末	10,712	△3.4	10,911	△3.1	98.5	-
10月末	10,706	△3.5	10,905	△3.2	98.9	2.2
(期末) 2021年11月30日	10,770	△2.9	10,974	△2.6	96.9	-

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると上昇しました。

当作成期首より、米国の財政拡大観測の高まりなどから各国の金利は上昇しました。また、米国で今後の金融緩和策の後退が市場で意識されたことも、さらなる金利上昇要因となりました。その後はレンジ内で推移しましたが、2021年6月には、米国で将来の利上げ後の経済回復ペースや物価上昇圧力の鈍化が意識されたことで、長期ゾーンを中心に金利は低下しました。しかし9月には、F R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げ見通しが市場予想を上回ったことなどから、金利は上昇に転じました。10月に入っても、物資の供給制約の長期化を背景にインフレへの懸念が高まったことが、主要国の金利上昇圧力となりました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」を高位に組み入れます。

### ■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

外国の公社債に投資し、外貨建資産については為替ヘッジを行い、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

## ポートフォリオについて

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■当ファンド

「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」を高位に組み入れました。

### ■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

外国の公社債に投資し、外貨建資産については為替ヘッジを行い、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

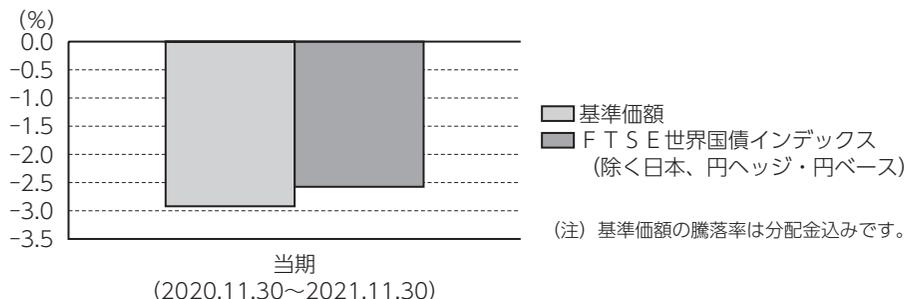
組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	F T S E 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）

## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△2.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△2.9%となりました。

当作成期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.1%程度でした。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\*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。

## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### 分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2020年12月1日 ～2021年11月30日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	955

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」を高位に組み入れます。

### ■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

外国の公社債に投資し、外貨建資産については為替ヘッジを行い、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2020.12.1~2021.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	29円	0.264%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10,802円です。
(投 信 会 社)	(20)	(0.187)	投信会社分は、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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.000	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	2	0.017	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.008)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	30	0.281	

(注1) 当作成期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

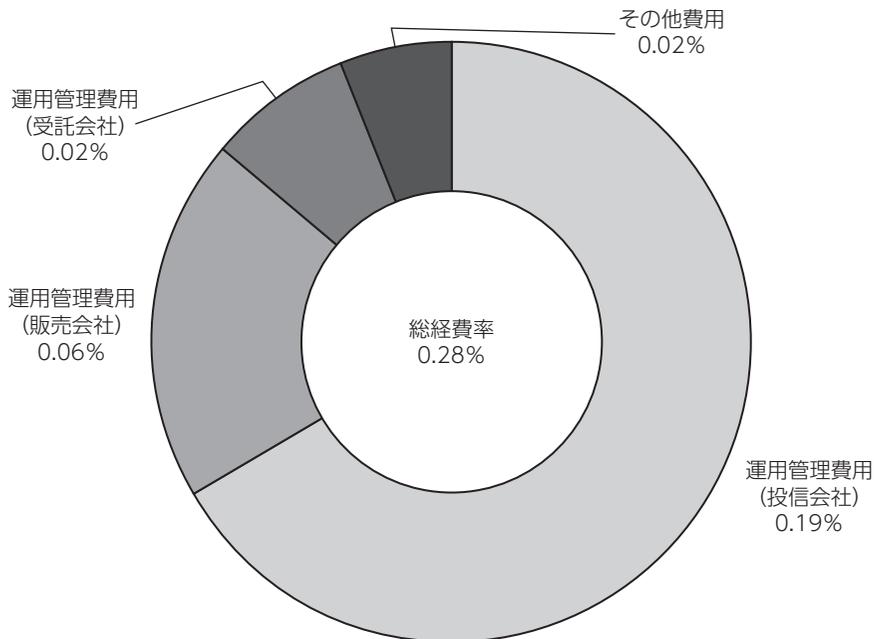
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.28%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	1,488,352	1,556,345	254,674	267,330

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	□ 数	金 額	評 価 額	□ 数	金 額	評 価 額
	千口	千円	千円	千口	千円	千円
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	3,712,169	4,945,846	5,174,345			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	5,174,345	99.7
コール・ローン等、その他	17,793	0.3
投資信託財産総額	5,192,138	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1シンガポール・ドル=83.21円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シケル=36.011円、1デンマーク・クローネ=17.27円、1ノルウェー・クローネ=12.61円、1スウェーデン・クローネ=12.53円、1メキシコ・ペソ=5,252円、1オフショア人民元=17.83円、1マレーシア・リンギット=26.851円、1南アフリカ・ランド=7.05円、1ポーランド・ズロチ=27.465円、1ユーロ=128.41円です。

(注3) 外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (130,274,457千円) の投資信託財産総額 (133,586,612千円) に対する比率は、97.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	5,192,138,911円
コール・ローン等	17,793,811
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド(評価額)	5,174,345,100
(B) 負債	7,694,554
未払解約金	791,713
未払信託報酬	6,693,738
その他未払費用	209,103
(C) 純資産総額(A-B)	5,184,444,357
元本	4,813,778,100
次期繰越損益金	370,666,257
(D) 受益権総口数	4,813,778,100口
1万口当り基準価額(C/D)	10,770円

\* 期首における元本額は3,599,799,209円、当作成期間中における追加設定元本額は1,938,477,119円、同解約元本額は724,498,228円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,770円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月1日 至2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3,817円
受取利息	198
支払利息	△ 4,015
(B) 有価証券売買損益	△ 87,753,512
売買益	15,599,492
売買損	△103,353,004
(C) 信託報酬等	△ 12,777,275
(D) 当期損益金(A + B + C)	△100,534,604
(E) 前期繰越損益金	240,954,172
(F) 追加信託差損益金	230,246,689
(配当等相当額)	( 218,757,164)
(売買損益相当額)	( 11,489,525)
(G) 合計(D + E + F)	370,666,257
次期繰越損益金(G)	370,666,257
追加信託差損益金	230,246,689
(配当等相当額)	( 218,757,164)
(売買損益相当額)	( 11,489,525)
分配準備積立金	240,956,918
繰越損益金	△100,537,350

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	218,757,164
(d) 分配準備積立金	240,956,918
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	459,714,082
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	459,714,082
(h) 受益権総口数	4,813,778,100口

<補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の決算日（2021年6月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年11月30日）現在における外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの主要な売買銘柄  
公 社 債

（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

買			付			売			付		
銘	柄	金額	銘	柄	金額	銘	柄	金額	銘	柄	金額
		千円			千円			千円			千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.625% 2022/11/15	2,119,062	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2022/9/30	4,464,104	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2022/2/28	2,515,522	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.75% 2023/11/15	1,365,052
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.875% 2028/8/15	1,480,220	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.875% 2022/1/31	882,586	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.375% 2027/5/15	472,249	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	1.25% 2031/8/15	855,174
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.75% 2023/11/15	1,365,052	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2022/11/15	817,603	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	4.7% 2041/7/30	449,611	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	6.125% 2027/11/15	817,603
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	1.25% 2031/8/15	855,174	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.375% 2023/9/30	793,513	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (イタリア)	5.5% 2022/11/1	439,242	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.375% 2023/9/30	793,513
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	6.125% 2027/11/15	817,603	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2022/9/30	745,724	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	2022/2/25	391,685	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2022/9/30	745,724
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.375% 2023/9/30	793,513	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.875% 2030/11/15	714,211	CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ)	0.5% 2022/3/1	350,612	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.875% 2030/11/15	714,211
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2022/9/30	745,724	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.5% 2026/8/15	695,205	United Kingdom Gilt (イギリス)	1.75% 2022/9/7	328,650	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.5% 2026/8/15	695,205
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.875% 2030/11/15	714,211	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.625% 2026/2/15	681,068				United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.625% 2026/2/15	681,068

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2021年11月30日現在における外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド（127,114,402千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	2021年11月30日現在								
	額 面 金 額	評 価		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
アメリカ	千アメリカ・ドル 510,882	千アメリカ・ドル 539,575	千円 61,387,508	% 46.2	% -	% 21.1	% 15.0	% 10.1	
カナダ	千カナダ・ドル 26,607	千カナダ・ドル 28,076	2,506,073	1.9	-	1.0	0.5	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 25,957	千オーストラリア・ドル 27,272	2,216,968	1.7	-	1.1	0.4	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 6,122	千シンガポール・ドル 6,507	541,470	0.4	-	0.3	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 41,077	千イギリス・ポンド 52,467	7,952,022	6.0	-	4.7	0.8	0.5	
イスラエル	千イスラエル・シケル 14,750	千イスラエル・シケル 16,543	595,756	0.4	-	0.3	0.1	0.1	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 30,040	千デンマーク・クローネ 36,595	632,003	0.5	-	0.3	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 22,990	千ノルウェー・クローネ 23,336	294,273	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 25,320	千スウェーデン・クローネ 27,651	346,477	0.3	-	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 154,430	千メキシコ・ペソ 154,752	812,897	0.6	-	0.4	0.3	-	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	2021年11月30日現在								
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
中国	千オフショア人民元 14,400	千オフショア人民元 14,588	千円 260,121	% 0.2	% -	% 0.1	% 0.0	% 0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 21,580	千マレーシア・リンギット 22,110	593,693	0.4	-	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 23,195	千ポーランド・ズロチ 22,724	624,129	0.5	-	0.2	0.2	0.1	
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 6,738	千ユーロ 7,705	989,495	0.7	-	0.5	0.2	0.0	
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 15,220	千ユーロ 18,531	2,379,567	1.8	-	1.3	0.3	0.2	
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 18,954	千ユーロ 22,537	2,893,994	2.2	-	1.6	0.4	0.1	
ユーロ (フランス)	千ユーロ 84,551	千ユーロ 99,777	12,812,390	9.6	-	6.2	2.7	0.8	
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 58,613	千ユーロ 72,539	9,314,763	7.0	-	4.7	1.8	0.5	
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 49,398	千ユーロ 59,131	7,593,129	5.7	-	3.6	1.5	0.6	
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 77,117	千ユーロ 91,474	11,746,193	8.8	-	5.3	2.4	1.2	
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 5,070	千ユーロ 5,506	707,064	0.5	-	0.3	0.2	-	
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 12,310	千ユーロ 14,795	1,899,887	1.4	-	0.9	0.3	0.2	
ユーロ (小計)	327,971	391,998	50,336,486	37.8	-	24.4	9.8	3.7	
合 計	-	-	129,099,884	97.1	-	54.4	27.5	15.2	

(注1) 邦貨換算金額は、2021年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2) 外国（外貨建）公社債（銘柄別）

区 分	銘	種 類	年 利 率	2021年11月30日現在				償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	千アメリカ・ドル 34,000	千アメリカ・ドル 34,463	千円 3,920,903	2022/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	11,000	11,230	1,277,713	2023/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	15,520	15,838	1,801,907	2023/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	13,310	13,781	1,567,975	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	25,405	26,521	3,017,327	2023/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	15,000	15,715	1,787,935	2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	9,580	10,008	1,138,657	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.2500	3,300	3,627	412,733	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.1250	8,950	11,443	1,301,913	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.5000	800	1,011	115,042	2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.2500	3,700	4,653	529,406	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.2500	1,400	1,939	220,662	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.3750	1,130	1,513	172,229	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.0000	300	439	49,956	2037/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.5000	830	1,044	118,810	2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	1,410	1,967	223,879	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.6250	1,390	1,999	227,511	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.7500	2,270	3,336	379,587	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.7500	600	783	89,161	2041/08/15	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2021年11月30日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額			償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	千 円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル			
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,170	2,613		297,375	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,500	5,234		595,476	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,100	1,430		162,699	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,532	3,355		381,799	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,000	1,305		148,469	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,200	4,037		459,401	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,940	4,796		545,641	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	12,810	13,347		1,518,589	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	600	662		75,370	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	10,300	10,712		1,218,786	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	370	444		50,572	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	14,820	15,356		1,747,056	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	16,300	17,060		1,940,998	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,400	1,689		192,178	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	12,000	12,258		1,394,674	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	10,865	11,100		1,262,860	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,070	1,188		135,267	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	11,750	11,935		1,357,892	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	12,000	12,203		1,388,380	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	8,850	9,197		1,046,424	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,330	2,773		315,572	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,670	4,915		559,215	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,100	3,776		429,696	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,550	3,759		427,769	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,250	2,750		312,956	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	16,000	16,846		1,916,596	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	14,700	15,242		1,734,147	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,310	3,880		441,448	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	7,000	7,212		820,616	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	15,800	16,614		1,890,248	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,641		300,512	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,500	5,668		644,912	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	7,300	7,975		907,344	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	12,000	13,139		1,494,828	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,500	1,849		210,371	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	6,300	7,018		798,446	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	1,850	2,440		277,660	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,000	4,328		492,410	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,200	3,965		451,180	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	2,428		276,281	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	7,000	7,230		822,639	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,100	2,264		257,674	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,400	5,528		628,924	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	3,104		353,147	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,500	4,515		513,680	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,561		291,444	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,400	2,914		331,541	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	11,800	10,314		1,173,520	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,300	5,859		666,657	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,200	1,944		221,177	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	6,900	6,549		745,110	2030/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,800	3,570		406,213	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,500	6,238		709,806	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,300	2,219		252,512	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,100	4,085		464,852	2051/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	4,900	4,748		540,247	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,400	2,373		270,060	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	4,968		565,294	2028/03/31

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

2021年11月30日現在									
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	1.6250	5,600	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	2031/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	2.3750	4,400		4,896	644,502	2051/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	2.2500	1,600		1,680	191,146	2041/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国 債 証 券	1.2500	7,700		7,514	854,978	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国 債 証 券	2.0000	4,600		4,722	537,241	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国 債 証 券	1.7500	3,750		3,627	412,669	2041/08/15
通貨小計	銘	柄	数						
	金		額						
			83銘柄			510,882	539,575	61,387,508	
<b>カナダ</b>	Canada Government International Bond		国 債 証 券	2.7500	860	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	5.7500	907		1,181	105,450	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	5.7500	1,050		1,486	132,695	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	5.0000	300		428	38,229	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.0000	620		832	74,340	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.5000	140		182	16,278	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	4,038		4,078	364,010	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.5000	730		755	67,441	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.7500	1,100		1,288	115,054	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.2500	1,492		1,544	137,845	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	1,220		1,227	109,563	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.0000	930		908	81,106	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.0000	600		620	55,347	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	2,800		2,834	252,967	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.0000	1,520		1,540	137,538	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.2500	300		316	28,266	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.2500	1,000		1,027	91,686	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	1,400		1,414	126,263	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.2500	1,700		1,664	148,553	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	900		874	78,013	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	1,700		1,547	138,133	2030/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	1,300		1,286	114,824	2031/06/01
通貨小計	銘	柄	数						
	金		額						
			22銘柄			26,607	28,076	2,506,073	
<b>オーストラリア</b>	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	5.5000	1,083	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		2023/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.7500	889		1,044	84,896	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.7500	1,156		1,213	98,642	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.2500	320		357	29,061	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.2500	3,000		3,217	261,511	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.5000	359		459	37,346	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.2500	2,398		2,703	219,777	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.7500	725		886	72,069	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.7500	800		877	71,307	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.2500	684		789	64,184	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.7500	1,300		1,396	113,501	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.2500	658		688	55,965	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.0000	575		643	52,286	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.7500	1,250		1,349	109,728	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.2500	200		204	16,585	2022/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.5000	2,100		2,240	182,122	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.7500	510		547	44,492	2041/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	1,800		1,764	143,470	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.2500	1,350		1,283	104,348	2032/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.0000	3,800		3,575	290,667	2030/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	1,000		869	70,670	2051/06/21
通貨小計	銘	柄	数						
	金		額						
			21銘柄			25,957	27,272	2,216,968	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2021年11月30日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 203	千シンガポール・ドル 223	千円 18,606	2027/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	150	158	13,165	2024/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	600	654	54,469	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	239	268	22,315	2042/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	700	722	60,111	2023/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	420	484	40,312	2033/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	500	543	45,183	2029/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	400	416	34,681	2025/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	330	371	30,946	2046/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	200	207	17,224	2026/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	260	270	22,472	2036/08/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	800	852	70,894	2028/05/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	500	512	42,668	2024/02/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	300	317	26,423	2039/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	350	337	28,104	2050/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	170	166	13,890	2051/10/01	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	16銘柄		6,122	6,507	541,470		
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	千イギリス・ポンド 1,350	千イギリス・ポンド 1,424	215,842	2025/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	810	1,332	201,989	2065/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,875	1,956	296,479	2026/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	950	1,058	160,424	2047/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	920	1,016	154,046	2037/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,100	1,399	212,154	2057/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	350	362	54,984	2027/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	800	853	129,292	2028/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	597	841	127,584	2071/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	800	810	122,912	2024/04/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	800	949	143,834	2049/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	1,018	154,341	2054/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	800	809	122,721	2029/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,000	1,035	156,914	2041/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,200	1,197	181,442	2023/01/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	700	675	102,388	2030/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	550	498	75,499	2061/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	370	341	51,717	2050/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,450	1,376	208,653	2035/07/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	1,200	1,133	171,787	2031/07/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	800	774	117,318	2046/01/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	513	701	106,248	2028/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,600	2,143	324,830	2032/06/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,275	1,460	221,301	2025/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	915	1,313	199,108	2036/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	950	1,509	228,725	2038/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	850	1,690	256,193	2055/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	770	1,320	200,062	2046/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,800	2,184	331,014	2027/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	911	1,511	229,118	2042/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	907	1,222	185,287	2030/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	843	1,523	230,960	2049/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,130	1,725	261,499	2039/09/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	300	427	64,843	2034/09/07		
United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	777	1,590	241,041	2060/01/22		
United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,000	1,556	235,919	2040/12/07		
United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	700	1,224	185,552	2052/07/22		
United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,175	1,694	256,863	2044/01/22		
United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	2,890	2,982	451,972	2023/09/07		

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

2021年11月30日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	3.5000	858	千円	千円	2068/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	2.7500	1,000	1,790	271,409	2024/09/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	3.5000	640	1,062	161,032	2045/01/22	
通貨小計	銘 柄 数 額	42銘柄		41,077	52,467	7,952,022		
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	4.2500	3,500	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	2023/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	5.5000	1,200	3,697	133,159	2024/01/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	3.7500	1,650	1,945	70,063	2024/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	1.7500	500	1,788	64,420	2025/08/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	2.0000	4,000	526	18,961	2027/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	3.7500	1,200	4,315	155,396	2027/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	1.0000	1,700	1,583	57,008	2047/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	1.5000	1,000	1,709	61,569	2030/03/31	
通貨小計	銘 柄 数 額	8銘柄		14,750	16,543	595,756		
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.5000	6,740	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	2039/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	2,670	12,190	210,527	2023/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	4,330	2,784	48,080	2023/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	5,200	4,720	81,521	2025/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	4,700	5,464	94,375	2027/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,900	4,967	85,781	2029/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	-	1,500	1,910	32,988	2052/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	-	3,000	1,508	26,044	2031/11/15	
通貨小計	銘 柄 数 額	8銘柄		30,040	36,595	632,003		
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	1,610	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	2023/05/24	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	6,300	1,631	20,568	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	150	6,545	82,534	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,430	151	1,913	2025/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	3,000	1,432	18,064	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	4,000	3,037	38,299	2027/02/17	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	2,000	4,114	51,887	2028/04/26	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.3750	2,500	2,025	25,539	2029/09/06	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	2,000	2,459	31,010	2030/08/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	2,000	1,939	24,455	2031/09/17	
通貨小計	銘 柄 数 額	9銘柄		22,990	23,336	294,273		
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	2,520	千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	4,150	3,792	47,522	2023/11/13	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	3,820	4,295	53,819	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	4,780	4,170	52,255	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	2,550	5,018	62,877	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	500	2,660	33,330	2028/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	3,000	604	7,577	2032/06/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.1250	4,000	3,144	39,404	2029/11/12	
通貨小計	銘 柄 数 額	8銘柄		25,320	27,651	346,477		
メキシコ	Mexican Bonos	国 債 証 券	5.7500	24,200	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.0000	11,450	22,771	119,616	2024/11/07	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.0000	27,900	11,242	59,054	2024/09/05	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.0000	6,740	28,408	149,227	2024/09/05	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	10.0000	6,340	6,881	36,148	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	7.5000	20,800	6,799	35,717	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	10.0000	2,750	20,849	109,520	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	10.0000	2,750	3,280	17,232	2036/11/20	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2021年11月30日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	Mexican Bonos		国債証券	8.5000	千メキシコ・ペソ 6,500	千メキシコ・ペソ 6,848	千円 35,976	2029/05/31
	Mexican Bonos		国債証券	8.5000	5,000	5,171	27,167	2038/11/18
	Mexican Bonos		国債証券	7.7500	22,700	22,840	119,978	2031/05/29
	Mexican Bonos		国債証券	7.7500	9,750	9,340	49,064	2042/11/13
	Mexican Bonos		国債証券	7.7500	10,300	10,316	54,193	2034/11/23
通貨小計	銘 柄 数 金 額	12銘柄			154,430	154,752	812,897	
中国	China Government Bond		国債証券	3.2500	千オフショア人民元 2,500	千オフショア人民元 2,559	45,636	2028/11/22
	China Government Bond		国債証券	3.7200	1,600	1,687	30,084	2051/04/12
	China Government Bond		国債証券	3.0200	1,800	1,824	32,530	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7400	3,000	3,007	53,617	2026/08/04
	CHINA GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5700	5,500	5,510	98,252	2023/05/20
通貨小計	銘 柄 数 金 額	5銘柄			14,400	14,588	260,121	
マレーシア	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.4980	千マレーシア・リンギット 1,760	千マレーシア・リンギット 1,873	50,300	2030/04/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.2320	1,000	1,048	28,149	2031/06/30
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8920	1,950	2,013	54,060	2027/03/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8440	1,400	1,405	37,742	2033/04/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.7330	1,500	1,527	41,021	2028/06/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.9550	1,150	1,194	32,061	2025/09/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8000	1,600	1,637	43,971	2023/08/17
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.7360	1,420	1,494	40,140	2046/03/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.0590	2,000	2,076	55,744	2024/09/30
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8990	500	515	13,842	2027/11/16
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.7620	1,000	1,066	28,644	2037/04/07
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.9060	1,500	1,552	41,699	2026/07/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8850	1,200	1,230	33,030	2029/08/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8280	1,300	1,281	34,418	2034/07/05
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.7570	1,400	1,326	35,628	2040/05/22
	MALYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.0650	900	865	23,237	2050/06/15
通貨小計	銘 柄 数 金 額	16銘柄			21,580	22,110	593,693	
ポーランド	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	千ポーランド・ズロチ 2,640	千ポーランド・ズロチ 2,568	70,557	2026/07/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	1,815	1,746	47,967	2027/07/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	3,000	3,001	82,424	2023/01/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	2,900	2,875	78,965	2024/04/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.7500	2,300	2,233	61,357	2029/10/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.2500	1,000	980	26,923	2024/10/25
	Poland Government Bond		国債証券	1.2500	1,800	1,539	42,296	2030/10/25
	Poland Government Bond		国債証券	0.2500	400	346	9,520	2026/10/25
	Poland Government Bond		国債証券	5.7500	600	703	19,329	2029/04/25
	Poland Government Bond		国債証券	4.0000	710	725	19,925	2023/10/25
	Poland Government Bond		国債証券	2.7500	1,800	1,752	48,130	2028/04/25
	Poland Government Bond		国債証券	3.2500	4,230	4,250	116,731	2025/07/25
通貨小計	銘 柄 数 金 額	12銘柄			23,195	22,724	624,129	
ユーロ（アイルランド）	IRISH TREASURY		国債証券	5.4000	千ユーロ 688	千ユーロ 824	105,897	2025/03/13
	IRISH TREASURY		国債証券	3.9000	420	445	57,154	2023/03/20
	IRISH TREASURY		国債証券	3.4000	300	328	42,176	2024/03/18
	IRISH TREASURY		国債証券	2.4000	680	820	105,387	2030/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	2.0000	710	923	118,597	2045/02/18
	IRISH TREASURY		国債証券	1.0000	820	874	112,297	2026/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	1.7000	570	677	87,027	2037/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	0.9000	500	535	68,745	2028/05/15

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

2021年11月30日現在								
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	150	150	21,532	2033/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	1,100	1,231	158,192	2031/03/18	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	300	326	41,889	2029/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	300	353	45,356	2050/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	-	200	196	25,239	2031/10/18	
国小計	銘 柄 数 金 額	13銘柄		6,738	7,705	989,495		
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	580	795	102,166	2028/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,400	2,257	289,905	2037/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,170	1,231	158,127	2023/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,280	2,238	287,419	2042/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	290	374	48,138	2033/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	750	781	100,390	2023/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,040	1,739	223,356	2047/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	980	1,051	135,066	2024/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	690	712	91,540	2025/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,170	1,230	158,011	2026/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,470	1,575	202,349	2027/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	400	406	52,193	2024/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	900	971	124,741	2028/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	731	93,911	2029/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	272	34,963	2040/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	750	766	98,460	2030/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	500	477	61,290	2052/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	900	915	117,534	2031/07/15	
国小計	銘 柄 数 金 額	18銘柄		15,220	18,531	2,379,567		
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,170	1,230	157,980	2025/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	610	755	97,068	2038/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	595	637	81,819	2026/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	764	925	118,792	2047/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	570	832	106,938	2066/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	400	407	52,310	2023/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	730	780	100,284	2027/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	500	517	66,492	2024/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	310	444	57,067	2057/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	700	812	104,314	2037/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	580	624	80,132	2028/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	500	567	72,856	2033/04/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,100	1,195	153,539	2029/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	350	435	55,907	2050/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	900	918	117,890	2030/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	200	195	25,098	2040/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	-	800	819	105,185	2027/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	-	1,800	1,793	230,292	2031/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	170	149	19,163	2071/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,000	1,381	177,431	2028/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	750	1,222	156,960	2035/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	965	1,627	209,012	2041/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	700	857	110,137	2026/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	300	424	54,522	2032/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,000	1,047	134,544	2023/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	390	658	84,607	2045/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	800	869	111,595	2024/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	300	405	52,046	2034/06/22	
国小計	銘 柄 数 金 額	28銘柄		18,954	22,537	2,893,994		

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2021年11月30日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
ユーロ（フランス）	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	千ユーロ 3,415	千ユーロ 4,307	千円 553,127	2025/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,200	3,574	458,966	2032/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,210	3,543	455,008	2035/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,232	2,412	309,756	2055/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,265	2,029	260,600	2038/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,200	1,315	168,934	2023/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,943	3,407	437,516	2041/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,000	2,058	264,349	2060/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,540	5,352	687,323	2026/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,910	4,650	597,127	2027/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,340	2,133	274,005	2045/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,730	4,907	630,125	2023/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,000	3,222	413,775	2024/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,986	2,437	313,011	2030/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,360	3,604	462,867	2024/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,400	3,532	453,577	2025/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,650	3,036	389,947	2031/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,400	3,555	456,524	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,550	1,756	225,535	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,100	1,458	187,250	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,070	2,145	275,444	2026/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	2,228	286,213	2039/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,510	193,958	2027/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,800	2,393	307,383	2048/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,800	1,818	233,504	2023/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,000	3,210	412,303	2028/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	2,029	260,652	2034/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,250	3,484	447,497	2028/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,200	2,236	287,157	2024/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,500	1,808	232,241	2050/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,100	3,268	419,670	2029/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	3,400	3,443	442,178	2029/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	700	699	89,860	2052/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,300	1,302	167,213	2040/05/25		
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	3,000	3,018	387,591	2030/11/25		
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	600	498	64,006	2072/05/25		
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	400	394	50,622	2044/06/25		
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,700	1,692	217,388	2031/11/25		
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	300	297	38,168	2053/05/25		
国小計	銘柄数 金額	39銘柄		84,551	99,777	12,812,390		
ユーロ（ドイツ）	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	千ユーロ 455	千ユーロ 641	82,414	2027/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	800	1,113	142,958	2028/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	800	1,089	139,877	2028/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	3,296	5,151	661,472	2030/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,660	2,585	331,978	2031/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	3,270	5,418	695,821	2034/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,490	2,469	317,083	2037/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,020	1,843	236,731	2039/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,810	3,522	452,323	2040/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	456	785	100,821	2042/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,648	2,655	341,044	2044/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,150	1,182	151,881	2023/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,460	1,531	196,665	2023/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,800	4,017	515,874	2024/02/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,775	2,938	377,354	2046/08/15		
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	990	1,046	134,382	2024/05/15		

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

2021年11月30日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	千ユーロ 2,000	千ユーロ 2,097	千円 269,339	2024/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,238	159,051	2025/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,800	5,110	656,271	2025/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	883	928	119,172	2026/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	3,850	3,973	510,238	2026/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,550	1,621	208,222	2027/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,100	3,297	423,448	2027/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,260	1,700	218,368	2048/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,050	1,120	143,926	2028/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,800	2,950	378,920	2028/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,400	1,478	189,877	2029/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,600	1,607	206,460	2050/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	700	726	93,254	2030/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,600	1,660	213,160	2030/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	600	620	79,737	2031/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	200	203	26,182	2036/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	400	406	52,205	2050/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	300	309	39,746	2031/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	300	298	38,351	2052/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,650	1,668	214,300	2023/04/14	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,000	1,015	130,422	2023/10/13	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	500	509	65,421	2024/04/05	
国 小 計	銘 柄 数 額	38銘柄		58,613	72,539	9,314,763		
ユーロ (スペイン)	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	千ユーロ 1,420	千ユーロ 2,030	260,729	2029/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,100	2,248	288,707	2025/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,410	1,616	207,604	2030/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,565	2,821	362,354	2025/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,400	1,540	197,758	2026/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,189	1,654	212,395	2046/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,530	2,401	308,426	2066/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,049	2,207	283,455	2026/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,100	1,200	154,183	2027/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,320	1,589	204,109	2033/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,670	1,822	234,064	2027/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,150	2,345	301,138	2028/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	650	881	113,239	2048/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	500	550	70,646	2029/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,400	1,608	206,603	2035/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,500	1,553	199,499	2029/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	1,023	131,401	2030/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	100	94	12,120	2050/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	1,953	250,817	2030/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	950	986	126,699	2040/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	400	390	50,165	2031/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,000	1,001	128,544	2028/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	500	499	64,119	2037/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	600	604	77,599	2031/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	200	200	25,693	2042/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,480	2,304	295,980	2032/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	900	1,351	173,529	2037/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	900	1,529	196,378	2040/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,043	1,755	225,484	2041/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,000	1,291	165,824	2026/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	3,810	4,078	523,777	2023/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	2,188	2,402	308,512	2023/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,700	2,302	295,692	2028/10/31	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2021年11月30日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.1500	千ユーロ 1,090	千ユーロ 2,013	千円 258,545	2044/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.8000	2,700	2,988	383,769	2024/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	2,084	2,286	293,556	2024/10/31	
国 小 計	銘 柄 数 額	36銘柄		49,398	59,131	7,593,129		
ユーロ（イタリア）	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	7.2500	千ユーロ 2,000	千ユーロ 2,694	346,034	2026/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.5000	1,635	2,220	285,165	2027/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	3,100	3,345	429,630	2024/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,105	1,441	185,083	2046/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	920	969	124,549	2025/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.6500	1,500	1,597	205,096	2032/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	900	970	124,675	2025/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7000	1,200	1,433	184,052	2047/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9500	1,700	1,731	222,346	2023/03/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,850	2,083	267,585	2036/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.6500	2,700	2,753	353,630	2023/10/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.8000	1,300	1,493	191,772	2067/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.4500	1,300	1,489	191,318	2033/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2000	1,700	1,877	241,034	2027/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.4500	950	1,287	165,279	2048/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0500	1,550	1,699	218,168	2027/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.9500	200	245	31,560	2038/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	2,500	2,741	352,071	2028/02/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.8000	1,400	1,618	207,788	2028/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,300	1,427	183,337	2025/11/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.3500	700	879	112,905	2035/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.8500	700	1,013	130,091	2049/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	1,400	1,648	211,638	2029/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.1000	1,400	1,526	195,955	2026/07/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.3500	500	524	67,367	2030/04/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.4500	150	170	21,928	2050/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4500	500	511	65,651	2036/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9500	3,000	3,037	390,087	2030/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.6500	600	641	82,423	2030/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.8000	600	621	79,811	2041/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7000	100	97	12,488	2051/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.6000	1,600	1,552	199,323	2031/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	200	193	24,842	2045/04/30	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.1500	450	436	56,054	2072/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.2500	1,540	2,092	268,694	2029/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	6.0000	1,988	2,919	374,943	2031/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.7500	1,300	1,950	250,426	2033/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	1,650	2,391	307,146	2034/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.0000	1,270	1,730	222,244	2037/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	1,640	2,537	325,864	2039/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.7500	3,870	4,210	540,653	2023/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	2,400	2,798	359,404	2025/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	2,014	3,163	406,205	2040/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000	4,750	5,645	724,971	2026/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.5000	3,170	3,345	429,606	2022/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.7500	1,380	1,768	227,137	2028/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.7500	1,125	1,787	229,494	2044/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000	2,830	3,135	402,683	2024/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.7500	2,110	2,338	300,342	2024/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.5000	1,370	1,679	215,621	2030/03/01	
国 小 計	銘 柄 数 額	50銘柄		77,117	91,474	11,746,193		

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2021年11月30日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ユーロ（フィンランド）	Finland Government Bond		国債証券	0.7500	千ユーロ 690	千ユーロ 746	千円 95,861	2031/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.8750	800	846	108,725	2025/09/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.5000	180	188	24,232	2026/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	1.3750	270	341	43,915	2047/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.5000	200	210	27,090	2027/09/15
	Finland Government Bond		国債証券	1.1250	150	169	21,764	2034/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.5000	500	528	67,823	2028/09/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.5000	300	317	40,798	2029/09/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.1250	350	346	44,527	2036/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.2500	150	149	19,225	2040/09/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.1250	200	185	23,837	2052/04/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND		国債証券	-	400	409	52,602	2026/09/15
	Finland Government Bond		国債証券	4.0000	200	234	30,085	2025/07/04
	Finland Government Bond		国債証券	2.7500	120	145	18,646	2028/07/04
	Finland Government Bond		国債証券	2.6250	210	311	39,995	2042/07/04
	Finland Government Bond		国債証券	2.0000	350	373	47,933	2024/04/15
国小計	銘金	柄数 16銘柄			5,070	5,506	707,064	
ユーロ（オーストリア）	Austria Government Bond		国債証券	1.2000	千ユーロ 540	千ユーロ 578	74,297	2025/10/20
	Austria Government Bond		国債証券	0.7500	490	520	66,873	2026/10/20
	Austria Government Bond		国債証券	1.5000	120	151	19,424	2047/02/20
	Austria Government Bond		国債証券	1.5000	280	379	48,746	2086/11/02
	Austria Government Bond		国債証券	0.5000	1,000	1,052	135,138	2027/04/20
	Austria Government Bond		国債証券	2.1000	150	248	31,909	2117/09/20
	Austria Government Bond		国債証券	0.7500	600	641	82,424	2028/02/20
	Austria Government Bond		国債証券	0.5000	700	738	94,800	2029/02/20
	Austria Government Bond		国債証券	-	450	455	58,472	2030/02/20
	Austria Government Bond		国債証券	0.7500	600	641	82,317	2051/03/20
	Austria Government Bond		国債証券	0.8500	50	46	6,034	2120/06/30
	Austria Government Bond		国債証券	-	500	502	64,566	2031/02/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	200	199	25,644	2036/10/20
	Austria Government Bond		国債証券	6.2500	380	527	67,685	2027/07/15
	Austria Government Bond		国債証券	4.1500	700	1,122	144,113	2037/03/15
	Austria Government Bond		国債証券	4.8500	700	865	111,174	2026/03/15
	Austria Government Bond		国債証券	3.4000	860	894	114,853	2022/11/22
	Austria Government Bond		国債証券	3.8000	370	791	101,650	2062/01/26
	Austria Government Bond		国債証券	3.1500	830	1,343	172,468	2044/06/20
	Austria Government Bond		国債証券	1.7500	1,280	1,341	172,308	2023/10/20
Austria Government Bond		国債証券	2.4000	630	811	104,164	2034/05/23	
Austria Government Bond		国債証券	1.6500	880	940	120,819	2024/10/21	
国小計	銘金	柄数 22銘柄			12,310	14,795	1,899,887	
通貨小計	銘金	柄数 260銘柄			327,971	391,998	50,336,486	
合計	銘金	柄数 522銘柄					129,099,884	

(注1) 邦貨換算金額は、2021年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

# 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

## 運用報告書 第5期（決算日 2021年6月15日）

（作成対象期間 2020年6月16日～2021年6月15日）

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	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
株式組入制限	純資産総額の10%以下

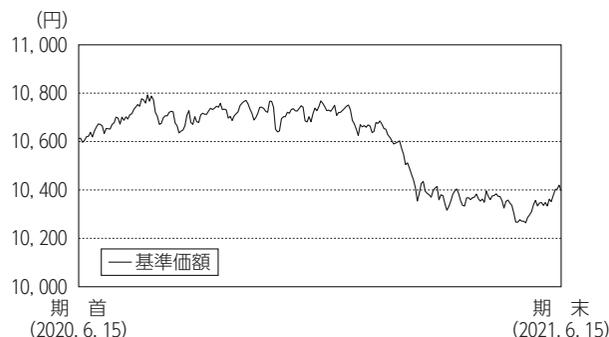
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,612円 期末：10,398円 騰落率：△2.0%

【基準価額の主な変動要因】

日本を除く先進国債に投資した結果、各国の金利が上昇（債券価格は下落）したため、基準価額は下落しました。

◆ 投資環境について

○ 海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると上昇しました。

当作成期首より、新型コロナウイルス感染再拡大への懸念が続いていたことなどから、金利は低位で推移しました。しかし2020年8月は、株価が上昇するなどリスク選好姿勢が改善し、金利は上昇しました。10月には、米国大統領・議会選挙を控えて、バイデン候補が大統領に当選して民主党が上下両院を制した場合の拡張的な財政政策を懸念する動きなどから、米国を中心に金利は上昇しました。その後はおおむねレンジ内で推移しましたが、2021年に入り、米国の財政拡大観測の高まりなどから金利は上昇しました。また米国で今後の金融緩和策の後退が市場で意識されたこともさらなる金利上昇要因となりました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

外貨建資産については為替ヘッジを行い、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

◆ ポートフォリオについて

外貨建資産については為替ヘッジを行い、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

◆ ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△1.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△2.0%となりました。当作成期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.1%程度でした。

\*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。

《今後の運用方針》

外貨建資産については為替ヘッジを行い、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

年月日	基準価額		FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公社債組入比率	債先比率	債券比率
	円	騰落率 (ベンチマーク)	騰落率	騰落率			
(期首) 2020年6月15日	10,612	—	10,666	—	97.6	%	—
6月末	10,671	0.6	10,728	0.6	97.8	%	—
7月末	10,777	1.6	10,835	1.6	95.9	%	0.5
8月末	10,643	0.3	10,701	0.3	97.7	%	—
9月末	10,758	1.4	10,818	1.4	96.1	%	—
10月末	10,737	1.2	10,797	1.2	96.7	%	—
11月末	10,748	1.3	10,806	1.3	98.5	%	—
12月末	10,737	1.2	10,799	1.3	97.7	%	0.4
2021年1月末	10,672	0.6	10,736	0.7	97.8	%	0.4
2月末	10,354	△ 2.4	10,413	△ 2.4	99.2	%	—
3月末	10,336	△ 2.6	10,397	△ 2.5	99.7	%	—
4月末	10,325	△ 2.7	10,389	△ 2.6	97.7	%	—
5月末	10,346	△ 2.5	10,407	△ 2.4	99.0	%	—
(期末) 2021年6月15日	10,398	△ 2.0	10,462	△ 1.9	98.8	%	—

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) は、FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) 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。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (先物・オプション)	0円 ( 0)
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	1 ( 1)
(その他)	( 0)
合 計	1

(注 1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注 2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 公 社 債

(2020年 6 月16日から2021年 6 月15日まで)

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカ・ドル 190,822	千アメリカ・ドル 173,704 ( —)
	カナダ	千カナダ・ドル 11,299	千カナダ・ドル 11,250 ( —)
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 13,412	千オーストラリア・ドル 13,917 ( —)
	シンガポール	千シンガポール・ドル 2,100	千シンガポール・ドル 916 ( —)
	イギリス	千イギリス・ポンド 14,207	千イギリス・ポンド 15,188 ( —)
	イスラエル	千イスラエル・シケル 1,387	千イスラエル・シケル 735 ( —)
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 5,320	千デンマーク・クローネ 2,389 ( —)
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 1,955	千ノルウェー・クローネ — ( —)
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 10,743	千スウェーデン・クローネ 6,446 ( —)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 22,055	千メキシコ・ペソ 13,929 ( —)
マレーシア	千マレーシア・リンギット 2,407	千マレーシア・リンギット 2,644 ( —)	

		買付額	売付額
外	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 7,552	千ポーランド・ズロチ 3,948 ( —)
	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 1,558	千ユーロ 333 ( —)
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 4,055	千ユーロ 3,433 ( —)
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 3,982	千ユーロ 5,536 ( —)
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 24,931	千ユーロ 26,924 ( —)
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 20,776	千ユーロ 17,264 ( —)
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 15,471	千ユーロ 17,187 ( —)
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 21,313	千ユーロ 24,521 ( —)
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 652	千ユーロ — ( —)
	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 3,031	千ユーロ 3,344 ( —)
国	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 95,771	千ユーロ 98,545 ( —)

(注 1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注 2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注 3) 単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2020年 6 月16日から2021年 6 月15日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国 債券先物取引	百万円 2,069	百万円 2,082	百万円 —	百万円 —

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 単位未満は切捨て。

# 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

## ■主要な売買銘柄

### 公 社 債

（2020年6月16日から2021年6月15日まで）

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄		銘 柄	
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/9/30	2,415,555	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2021/9/30	3,346,760
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2022/11/15	2,119,062	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/2/28	2,515,522
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2027/8/15	1,592,972	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.125% 2021/6/30	2,236,982
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2040/5/15	1,165,225	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/9/30	1,571,039
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2025/11/15	927,282	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2021/11/15	1,469,245
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2025/1/31	923,086	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.875% 2022/1/31	882,586
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2023/11/15	839,250	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2024/5/15	739,151
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.875% 2030/11/15	714,211	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2023/11/15	737,558
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2026/2/15	681,068	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2025/11/15	576,444
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.625% 2027/11/30	679,880	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 1% 2025/8/15	540,164

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

### (1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	当 期		組入比率	未 うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額					
アメリカ	千アメリカ・ドル 443,652	千アメリカ・ドル 469,818	千円 51,731,693	43.9 %	— %	19.7 %	15.9 %	8.2 %
カナダ	千カナダ・ドル 24,437	千カナダ・ドル 26,507	2,403,686	2.0	—	0.9	0.5	0.6
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 27,307	千オーストラリア・ドル 29,496	2,504,506	2.1	—	1.4	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 5,952	千シンガポール・ドル 6,486	538,334	0.5	—	0.3	0.1	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 39,617	千イギリス・ポンド 49,472	7,687,562	6.5	—	5.0	1.1	0.5
イスラエル	千イスラエル・シケル 12,400	千イスラエル・シケル 13,792	467,886	0.4	—	0.3	—	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 26,240	千デンマーク・クローネ 32,275	579,343	0.5	—	0.4	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 15,990	千ノルウェー・クローネ 16,387	216,636	0.2	—	0.1	0.0	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 29,970	千スウェーデン・クローネ 32,254	426,403	0.4	—	0.2	0.1	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 146,330	千メキシコ・ペソ 156,447	863,211	0.7	—	0.4	0.2	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 19,880	千マレーシア・リンギット 20,748	555,350	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 22,995	千ポーランド・ズロチ 24,592	724,357	0.6	—	0.3	0.2	0.1
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 6,488	千ユーロ 7,481	998,424	0.8	—	0.6	0.2	0.1
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 14,220	千ユーロ 17,037	2,273,693	1.9	—	1.4	0.3	0.2

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	額 面 金 額	当 期			未				
		評 価 額		組入比率	うちBBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 17,664	千ユーロ 21,119	千円 2,818,449	% 2.4	% —	% 1.7	% 0.6	% 0.1	
ユーロ (フランス)	千ユーロ 75,446	千ユーロ 89,387	11,928,750	10.1	—	6.4	2.9	0.8	
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 53,805	千ユーロ 66,473	8,870,864	7.5	—	4.9	1.9	0.7	
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 43,648	千ユーロ 53,206	7,100,348	6.0	—	4.0	1.6	0.5	
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 69,867	千ユーロ 84,301	11,250,096	9.5	—	5.9	2.8	0.8	
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 5,450	千ユーロ 5,879	784,555	0.7	—	0.4	0.2	0.1	
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 10,660	千ユーロ 12,967	1,730,458	1.5	—	1.0	0.4	0.1	
ユーロ (小計)	297,248	357,854	47,755,639	40.5	—	26.3	10.9	3.3	
合計	—	—	116,454,613	98.8	—	55.6	29.9	13.3	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期			未		償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額				
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円			
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	34,000	34,727	3,823,856		2022/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	11,000	11,339	1,248,539		2023/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	15,520	15,993	1,761,028		2023/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	11,310	11,876	1,307,748		2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	13,905	14,754	1,624,613		2023/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	15,000	16,000	1,761,765		2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	9,580	10,195	1,122,628		2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	3,300	3,734	411,181		2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	7,450	9,800	1,079,097		2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	800	1,038	114,328		2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	2,700	3,474	382,582		2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	1,400	1,975	217,525		2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	1,130	1,534	168,914		2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	830	1,023	112,717		2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,410	1,934	212,964		2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,390	1,966	216,569		2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	2,270	3,279	361,059		2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,170	2,546	280,406		2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,500	5,087	560,216		2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,100	1,393	153,420		2043/08/15	

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	当 期		末		償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,532	3,268	359,909	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,000	1,270	139,942	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,200	3,919	431,532	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,940	4,642	511,194	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	7,810	8,295	913,396	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	10,300	10,929	1,203,417	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	370	428	47,147	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	14,820	15,673	1,725,774	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	25,220	25,757	2,836,179	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	13,800	14,757	1,624,987	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,400	1,623	178,812	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	12,000	12,497	1,376,075	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	9,165	9,540	1,050,503	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,070	1,136	125,088	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,750	5,944	654,595	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,000	5,133	565,255	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,850	6,196	682,257	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,330	2,649	291,712	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,670	5,010	551,653	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,500	4,073	448,491	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,550	3,835	422,314	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,250	2,621	288,662	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	13,500	14,485	1,594,998	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	12,200	12,877	1,417,951	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,310	3,687	405,976	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	7,000	7,334	807,620	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	13,300	14,267	1,570,973	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,698	297,101	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,500	5,373	591,670	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,300	7,013	772,302	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,500	1,752	192,996	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	6,300	7,136	785,850	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	1,850	2,312	254,596	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,000	4,389	483,365	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,200	3,746	412,551	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	2,288	252,030	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,000	4,212	463,800	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,100	2,122	233,732	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,400	5,568	613,127	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,909	320,409	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,500	4,537	499,597	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,393	263,564	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,400	2,698	297,114	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	11,800	9,981	1,099,011	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,500	5,108	562,546	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,800	1,475	162,474	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	6,900	6,537	719,841	2030/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,800	3,320	365,622	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,500	6,305	694,243	2027/11/30

区 分	当 期				末			償還年月日
	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,300	2,242	246,929	2028/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,100	3,809	419,474	2051/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	4,900	4,738	521,788	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	1,900	1,825	201,018	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	5,026	553,451	2028/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,700	1,719	189,328	2031/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,000	1,040	114,560	2051/05/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	76銘柄		443,652	469,818	51,731,693		
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル			
	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	860	1,042	94,501	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	907	1,219	110,558	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,050	1,528	138,623	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	770	1,054	95,597	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,500	1,536	139,353	2022/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	740	972	88,227	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,038	4,130	374,576	2023/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	730	773	70,101	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,100	1,292	117,167	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,492	1,584	143,727	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	820	845	76,677	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	930	930	84,398	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	636	57,730	2028/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,400	2,459	223,046	2023/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	300	324	29,388	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,000	1,048	95,069	2024/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,442	130,806	2024/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,700	1,688	153,141	2030/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	890	80,768	2025/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,105	100,222	2030/12/01	
通貨小計	銘柄数 金 額	20銘柄		24,437	26,507	2,403,686		
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル			
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,083	1,193	101,314	2023/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	889	1,090	92,558	2027/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,156	1,245	105,724	2024/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	320	370	31,469	2029/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,000	3,331	282,844	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	359	473	40,204	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,398	2,817	239,262	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	725	906	77,010	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	800	896	76,100	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	684	805	68,414	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,300	1,449	123,048	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,158	1,254	106,501	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	575	649	55,190	2047/03/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,250	1,398	118,784	2028/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,238	105,175	2022/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,100	2,310	196,206	2030/05/21	

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	510	557	47,327	2041/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,800	1,810	153,725	2031/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,200	1,166	99,056	2032/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,800	3,664	311,132	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,000	865	73,452	2051/06/21
通貨小計	銘柄数 金 額	21銘柄			27,307	29,496	2,504,506	
					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	203	231	19,208	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	1,000	1,034	85,860	2022/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	150	161	13,434	2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	600	676	56,154	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	239	277	23,067	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	209	17,409	2023/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	420	500	41,513	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	400	427	35,503	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	330	390	32,398	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	200	213	17,678	2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	260	277	23,057	2036/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	800	880	73,064	2028/05/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	500	520	43,196	2024/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	300	327	27,204	2039/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	350	356	29,582	2050/03/01
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄			5,952	6,486	538,334	
					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,350	1,451	225,474	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	960	1,394	216,632	2065/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,175	1,244	193,326	2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	250	251	39,050	2022/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	950	998	155,097	2047/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	720	784	121,880	2037/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,100	1,265	196,706	2057/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	350	367	57,031	2027/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	800	861	133,908	2028/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	597	714	110,985	2071/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	800	820	127,428	2024/04/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	800	889	138,242	2049/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	934	145,156	2054/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	600	609	94,722	2029/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	400	400	62,234	2041/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,200	1,201	186,665	2023/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	500	482	74,917	2030/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	250	194	30,293	2061/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,300	1,219	189,514	2035/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	500	470	73,138	2031/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	750	685	106,468	2046/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	513	715	111,250	2028/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,300	1,760	273,600	2032/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,275	1,503	233,576	2025/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	915	1,312	203,998	2036/03/07

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分		当 期				末		償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
				%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	950	1,494	232,289	2038/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	850	1,568	243,689	2055/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	770	1,270	197,376	2046/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,000	2,482	385,681	2027/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	911	1,474	229,081	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	907	1,240	192,789	2030/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	843	1,446	224,812	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,130	1,702	264,585	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	300	430	66,900	2034/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	407	758	117,824	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,000	1,531	237,975	2040/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	700	1,149	178,555	2052/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,080	2,123	330,005	2022/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,175	1,637	254,389	2044/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	2,490	2,611	405,744	2023/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	908	1,679	260,908	2068/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,500	1,625	252,591	2024/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	490	714	111,059	2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	43銘柄			39,617	49,472	7,687,562	
					千イスラエル・シケケル	千イスラエル・シケケル		
イスラエル		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	4.2500	3,500	3,757	127,473	2023/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,200	1,881	63,825	2042/01/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	4,000	4,288	145,487	2027/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	1,000	1,260	42,764	2047/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	1,700	1,668	56,590	2030/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,000	935	31,743	2037/05/31
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄			12,400	13,792	467,886	
					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
デンマーク		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	6,740	11,842	212,576	2039/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,670	2,803	50,326	2023/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,330	4,756	85,380	2025/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,200	5,460	98,024	2027/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,700	4,941	88,701	2029/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,476	26,507	2052/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	993	17,824	2031/11/15
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄			26,240	32,275	579,343	
					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
ノルウェー		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,610	1,655	21,886	2023/05/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,300	1,377	18,216	2024/03/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	150	154	2,040	2025/03/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,430	1,457	19,269	2026/02/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,000	3,093	40,893	2027/02/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	4,000	4,189	55,389	2028/04/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	2,500	2,494	32,981	2030/08/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,000	1,963	25,958	2031/09/17
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄			15,990	16,387	216,636	

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

		当 期			末			
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	千スウェーデン・クローネ 2,520	千スウェーデン・クローネ 3,688	千円 48,757	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	6,950	7,206	95,273	2022/06/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,150	4,332	57,273	2023/11/13	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,020	2,236	29,566	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,780	5,061	66,913	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,550	2,669	35,292	2028/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,000	3,138	41,490	2029/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	4,000	3,921	51,835	2031/05/12	
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄		29,970	32,254	426,403		
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 9,200	千メキシコ・ペソ 9,100	50,210	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	11,450	12,242	67,549	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,900	29,834	164,613	2024/09/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	6,740	7,169	39,557	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,340	7,200	39,729	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	11,800	12,546	69,225	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	2,750	3,503	19,329	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,500	7,318	40,379	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	5,000	5,609	30,950	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,700	24,528	135,338	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	15,900	16,173	89,238	2022/06/09	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	9,750	10,178	56,160	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,300	11,042	60,927	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数 金 額	13銘柄		146,330	156,447	863,211		
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	千マレーシア・リンギット 1,760	千マレーシア・リンギット 1,921	51,436	2030/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	500	532	14,257	2031/06/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	1,250	1,325	35,468	2027/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,000	1,013	27,124	2033/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,500	1,571	42,058	2028/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,150	1,217	32,574	2025/09/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,100	1,128	30,194	2022/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,600	1,658	44,398	2023/08/17	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	1,420	1,500	40,155	2046/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	2,000	2,108	56,425	2024/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,000	1,082	28,962	2037/04/07	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	1,500	1,597	42,764	2026/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,200	1,261	33,758	2029/08/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,301	34,823	2034/07/05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	700	663	17,752	2040/05/22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	900	866	23,194	2050/06/15	
	通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄		19,880	20,748	555,350	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	千ポーランド・ズロチ 1,200	千ポーランド・ズロチ 1,285	37,870	2022/09/23	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,640	2,813	82,871	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,815	1,938	57,108	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,108	91,567	2023/01/25	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,900	3,063	90,236	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	2,300	2,508	73,885	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	1,800	1,726	50,865	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	600	789	23,251	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	710	770	22,704	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	1,800	1,959	57,719	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,230	4,626	136,275	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	11銘柄		22,995	24,592	724,357	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	688	841	112,267	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	420	453	60,511	2023/03/20
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	300	332	44,437	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	680	826	110,319	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	710	908	121,247	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	820	877	117,119	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	570	677	90,424	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	500	538	71,842	2028/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	150	168	22,514	2033/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	1,100	1,238	165,305	2031/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	300	328	43,787	2029/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	250	289	38,648	2050/05/15
国小計	銘柄数 金 額	12銘柄		6,488	7,481	998,424	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	580	809	108,040	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,200	1,928	257,314	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,170	1,253	167,287	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,080	1,853	247,314	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	500	515	68,854	2022/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	290	376	50,227	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	750	788	105,280	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	840	1,351	180,325	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	980	1,061	141,706	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	690	714	95,404	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,170	1,232	164,536	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,470	1,578	210,709	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	407	54,366	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	600	648	86,490	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	729	97,404	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	263	35,152	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	750	762	101,806	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	356	47,531	2052/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	404	53,938	2031/07/15
国小計	銘柄数 金 額	19銘柄		14,220	17,037	2,273,693	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,170	1,235	164,814	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	610	749	99,996	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	595	639	85,366	2026/06/22

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	764	900	120,128	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	570	794	106,067	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	400	408	54,461	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	730	782	104,413	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	500	519	69,271	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	310	430	57,481	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	700	807	107,697	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	580	624	83,317	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	500	564	75,292	2033/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	700	759	101,397	2029/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	350	421	56,268	2050/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	900	913	121,953	2030/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	200	192	25,642	2040/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	800	817	109,042	2027/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	500	495	66,130	2031/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,000	1,402	187,152	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	750	1,229	164,064	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	815	1,367	182,471	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	700	870	116,177	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	730	776	103,651	2022/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	300	427	57,011	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,000	1,059	141,408	2023/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	390	647	86,351	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	800	879	117,314	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	300	405	54,102	2034/06/22
国 小 計	銘柄数 金 額	28銘柄		17,664	21,119	2,818,449	
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,415	4,402	587,524	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,000	3,271	436,611	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,210	3,549	473,690	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,232	2,323	310,013	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,065	1,691	225,797	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,200	1,339	178,801	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,943	3,370	449,848	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,000	1,968	262,673	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,540	4,232	564,802	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,410	4,087	545,417	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	195	202	27,063	2022/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	840	1,307	174,423	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,730	4,951	660,822	2023/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,000	3,255	434,439	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,986	2,441	325,814	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,360	3,632	484,779	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,400	3,540	472,441	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,650	3,031	404,552	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,800	2,933	391,506	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,350	1,513	201,969	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,100	1,377	183,828	2066/05/25

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					末		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,570	1,625	216,987	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	2,183	291,449	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,513	202,004	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,800	2,308	308,045	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,820	242,994	2023/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,000	2,139	285,564	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	2,017	269,210	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,750	2,945	393,072	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,237	298,601	2024/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,200	1,388	185,257	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,100	3,256	434,619	2029/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,421	456,656	2029/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	700	664	88,703	2052/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	783	104,583	2040/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,195	292,999	2030/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	100	76	10,234	2072/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	400	381	50,944	2044/06/25
国 小 計	銘柄数 金 額	38銘柄		75,446	89,387	11,928,750	
ユーロ（ドイツ）				千ユーロ	千ユーロ		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	455	654	87,343	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	800	1,131	151,050	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	800	1,103	147,275	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	3,696	5,851	780,844	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,660	2,609	348,196	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	3,270	5,390	719,366	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	990	1,612	215,181	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	720	1,268	169,242	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,810	3,426	457,258	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	356	589	78,644	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,542	1,581	211,070	2022/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,648	2,524	336,853	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,150	1,192	159,151	2023/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,460	1,546	206,408	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,800	4,053	540,883	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,625	2,537	338,647	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	990	1,054	140,762	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,000	2,109	281,571	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,243	165,886	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,300	4,604	614,439	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	883	931	124,246	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,050	2,115	282,280	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	550	576	76,890	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,100	3,302	440,721	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,260	1,584	211,505	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	750	801	106,923	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,999	266,793	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,400	1,473	196,638	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,190	158,825	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	721	96,233	2030/02/15

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

区 分		当 期			未		償還年月日	
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額		邦貨換算金額
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	308	41,154	2030/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	369	49,373	2050/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,816	242,395	2022/10/07
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,650	1,671	223,035	2023/04/14
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,016	135,715	2023/10/13
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	509	68,052	2024/04/05
国 小 計	銘柄数 金 額	36銘柄			53,805	66,473	8,870,864	
				千ユーロ	千ユーロ			
ユーロ (スペイン)		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,420	2,061	275,173	2029/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,100	2,264	302,263	2025/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,410	1,624	216,746	2030/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,565	2,849	380,246	2025/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,000	1,110	148,141	2026/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	589	799	106,640	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,530	2,375	316,976	2066/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,649	1,786	238,387	2026/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,100	1,208	161,248	2027/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,320	1,593	212,640	2033/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,670	1,833	244,630	2027/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,150	2,358	314,693	2028/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	550	724	96,692	2048/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	500	552	73,689	2029/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,200	1,376	183,659	2035/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,200	1,241	165,695	2029/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	1,022	136,388	2030/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,200	1,303	174,000	2030/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	500	509	68,041	2040/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	300	291	38,924	2031/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,480	2,330	310,941	2032/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	900	1,348	179,890	2037/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	900	1,514	202,130	2040/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,243	2,064	275,445	2041/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,000	1,318	175,935	2026/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	3,810	4,181	558,002	2023/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	2,188	2,447	326,627	2023/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,300	1,789	238,798	2028/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,090	1,978	264,026	2044/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	2,700	3,035	405,098	2024/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,084	2,312	308,568	2024/10/31
国 小 計	銘柄数 金 額	31銘柄			43,648	53,206	7,100,348	
				千ユーロ	千ユーロ			
ユーロ (イタリア)		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,300	1,798	239,973	2026/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,635	2,276	303,856	2027/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,100	3,386	451,974	2024/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,105	1,466	195,734	2046/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	920	978	130,605	2025/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,500	1,626	216,995	2032/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	900	981	131,008	2025/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	818	109,269	2022/09/15

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,200	1,456	194,329	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,200	1,228	163,920	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,150	2,466	329,105	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	2,400	2,456	327,761	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,300	1,573	210,026	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,300	1,519	202,838	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,700	1,900	253,596	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	650	894	119,381	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,550	1,719	229,517	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	700	710	94,843	2022/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,500	2,775	370,403	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,400	1,643	219,351	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,300	1,445	192,958	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	500	642	85,714	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	800	1,179	157,395	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	400	479	63,948	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	900	992	132,463	2026/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	500	531	70,982	2030/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,600	2,668	356,154	2030/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	600	632	84,399	2041/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,100	1,082	144,424	2031/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	250	250	33,402	2072/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	1,540	2,135	285,048	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	1,988	2,989	398,948	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,000	1,534	204,817	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,650	2,446	326,543	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	1,270	1,764	235,497	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,640	2,600	346,990	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	3,870	4,293	573,028	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,400	2,858	381,517	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,014	3,222	430,077	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	3,250	3,939	525,728	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	500	535	71,523	2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	3,170	3,428	457,590	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,080	1,413	188,604	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	725	1,170	156,253	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,030	2,293	306,069	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,110	2,379	317,500	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,370	1,708	228,015	2030/03/01
国 小 計	銘柄数 金 額	47銘柄		69,867	84,301	11,250,096	
ユーロ（フィンランド）				千ユーロ	千ユーロ		
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	690	744	99,368	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	800	849	113,387	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	180	189	25,230	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	270	328	43,875	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	200	211	28,211	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	150	168	22,480	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	529	70,596	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	316	42,300	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	150	146	19,562	2036/04/15

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分		当 期				末		償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	150	145	19,416	2040/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	200	174	23,302	2052/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	200	237	31,741	2025/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	120	146	19,537	2028/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	980	1,008	134,569	2022/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	210	304	40,685	2042/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	350	376	50,287	2024/04/15	
国 小 計	銘柄数 金 額	16銘柄		5,450	5,879	784,555		
ユーロ（オーストリア）				千ユーロ	千ユーロ			
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	140	150	20,126	2025/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	490	522	69,706	2026/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	120	146	19,580	2047/02/20	
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	280	365	48,727	2086/11/02	
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,000	1,054	140,672	2027/04/20	
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	150	246	32,914	2117/09/20	
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	643	85,851	2028/02/20	
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	700	738	98,584	2029/02/20	
	Austria Government Bond	国債証券	—	150	151	20,220	2030/02/20	
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	616	82,294	2051/03/20	
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	380	536	71,549	2027/07/15	
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	700	1,121	149,618	2037/03/15	
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	700	881	117,674	2026/03/15	
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	860	910	121,483	2022/11/22	
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	370	768	102,489	2062/01/26	
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	630	1,001	133,697	2044/06/20	
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	1,280	1,352	180,492	2023/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	630	811	108,285	2034/05/23	
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	880	947	126,490	2024/10/21	
国 小 計	銘柄数 金 額	19銘柄		10,660	12,967	1,730,458		
通貨小計	銘柄数 金 額	246銘柄		297,248	357,854	47,755,639		
合 計	銘柄数 金 額	490銘柄				116,454,613		

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	116,454,613	98.0
コール・ローン等、その他	2,428,335	2.0
投資信託財産総額	118,882,949	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=110.11円、1カナダ・ドル=90.68円、1オーストラリア・ドル=84.91円、1シンガポール・ドル=82.99円、1イギリス・ポンド=155.39円、1イスラエル・シェケル=33.923円、1デンマーク・クローネ=17.95円、1ノルウェー・クローネ=13.22円、1スウェーデン・クローネ=13.22円、1メキシコ・ペソ=5.517円、1マレーシア・リンギット=26.765円、1南アフリカ・ランド=7.99円、1ポーランド・ズロチ=29.454円、1ユーロ=133.45円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(117,429,476千円)の投資信託財産総額(118,882,949千円)に対する比率は、98.8%です。

■損益の状況

当期 自 2020年6月16日 至 2021年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,495,845,058円
受取利息	2,497,977,180
支払利息	△ 2,132,122
(B) 有価証券売買損益	△ 4,843,569,031
売買益	15,143,958,619
売買損	△ 19,987,527,650
(C) 先物取引等損益	△ 1,738,460
取引益	3,702,529
取引損	△ 5,440,989
(D) その他費用	△ 10,655,033
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 2,360,117,466
(F) 前期繰越損益金	6,558,539,080
(G) 解約差損益金	△ 1,657,611,174
(H) 追加信託差損益金	1,973,847,341
(I) 合計 (E + F + G + H)	4,514,657,781
次期繰越損益金 (I)	4,514,657,781

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	235,859,710,597円
コール・ローン等	1,335,120,176
公社債 (評価額)	116,454,613,580
未収入金	117,111,558,041
未取利息	691,495,343
前払費用	29,810,030
差入委託証拠金	237,113,427
(B) 負債	117,941,822,997
未払金	117,920,150,415
未払解約金	21,672,582
(C) 純資産総額 (A - B)	117,917,887,600
元本	113,403,229,819
次期繰越損益金	4,514,657,781
(D) 受益権総口数	113,403,229,819口
1万口当り基準価額 (C / D)	10,398円

\* 期首における元本額は107,167,679,077円、当作成期間中における追加設定元本額は34,627,106,696円、同解約元本額は28,391,555,954円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、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）94,364,692,141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）4,709,710,877円、ダイワバランスファンド2020-07（適格機関投資家専用）3,285,353,528円、ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）3,199,296,043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）7,844,177,230円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,398円です。

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

## 運用報告書 (全体版) 第5期

(決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日~2021年11月30日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券		
信託期間	無期限		
運用方針	海外の債券市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	イ. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券 ロ. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券	
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債	
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	新興国通貨建ての債券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	外国債券インデックスマザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の30%以下	
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下	
分配方針	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、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、海外の債券指数に連動する投資成果をめざす複数のマザーファンドに投資し、海外の債券市場の動きを反映した投資成果をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

### 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先(コールセンター)  
TEL 0120-106212  
(営業日の9:00~17:00)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			公社債 組入比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税 分 込 配 金	期 騰 落 中 率			
1期末 (2017年11月30日)	円 10,477	円 0	% 4.8	% 97.9	% -	百万円 1,406
2期末 (2018年11月30日)	10,222	0	△2.4	97.4	-	2,442
3期末 (2019年12月2日)	10,673	0	4.4	97.9	-	2,833
4期末 (2020年11月30日)	11,005	0	3.1	98.0	-	2,462
5期末 (2021年11月30日)	11,365	0	3.3	97.9	-	3,297

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)を除きます。

(注4) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

(注5) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



\*分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

\*分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

#### ■ 基準価額・騰落率

期 首：11,005円

期 末：11,365円（分配金0円）

騰落率：3.3%（分配金込み）

#### ■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国債券インデックスマザーファンド	4.2%	80.2%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	1.0%	19.6%

#### ■ 基準価額の主な変動要因

主に海外の債券に投資した結果、債券市場で金利は上昇（債券価格は下落）したものの、為替市場で円安が進んだため、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率	債 券 先 物 率
	騰 落 率	率		
(期首) 2020年11月30日	円 11,005	% -	% 98.0	% -
12月末	11,135	1.2	97.9	-
2021年 1 月末	11,107	0.9	97.7	-
2 月末	11,022	0.2	97.9	-
3 月末	11,207	1.8	97.9	-
4 月末	11,246	2.2	97.9	-
5 月末	11,417	3.7	98.1	-
6 月末	11,398	3.6	98.0	-
7 月末	11,426	3.8	98.1	-
8 月末	11,430	3.9	97.8	-
9 月末	11,339	3.0	97.9	-
10月末	11,545	4.9	97.9	-
(期末) 2021年11月30日	11,365	3.3	97.9	-

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

**投資環境について**

(2020.12.1～2021.11.30)

**■海外債券市況**

海外債券の金利は、当作成期を通して見ると上昇しました。

当作成期首より、米国の財政拡大観測の高まりなどから各国の金利は上昇しました。また、米国で今後の金融緩和策の後退が市場で意識されたことも、さらなる金利上昇要因となりました。その後はレンジ内で推移しましたが、2021年6月には、米国で将来の利上げ後の経済回復ペースや物価上昇圧力の鈍化が意識されたことで、長期ゾーンを中心に金利は低下しました。しかし9月には、F R B (米国連邦準備制度理事会) の利上げ見通しが市場予想を上回ったことなどから、金利は上昇に転じました。10月に入っても、物資の供給制約の長期化を背景にインフレへの懸念が高まったことが、主要国の金利上昇圧力となりました。

新興国の債券市場でも、おおむね同様の動きとなり、金利は上昇しました。インフレ圧力に対抗するため各国で利上げが行われたことなども、金利上昇要因となりました。

**■為替相場**

為替相場は、当作成期を通して見ると円安が進みました。

先進国の為替相場は、当作成期首より、米国において民主党が大統領府および議会上下両院を制したことから、株価が上昇するなど市場のリスク選好姿勢が強まり、円安となりました。2021年3月には、米国での追加経済対策の成立や、経済指標の改善により米国金利が上昇したことなどを背景に米ドルが買い進められ、一般的に円安が進行しました。7月以降は、新型コロナウイルスの新規感染者数の増加を受けた景気への懸念などを受け、円高が進みました。9月以降は、日本以外の各国で利上げ観測が高まり、金融政策の方向性の違いを要因として、円安となりました。

新興国の為替相場は、米国の利上げ観測の高まりは下落要因となりましたが、円安が進んだため対円では多くの通貨が上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を純資産総額の80%程度、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」を純資産総額の20%程度組み入れます。

### ■外国債券インデックスマザーファンド

ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

### ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

## ポートフォリオについて

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を純資産総額の80%程度、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」を純資産総額の20%程度組み入れました。

### ■外国債券インデックスマザーファンド

ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

### ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックスマザーファンド	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	JPMorgan ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド (円換算)

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークおよび参考指数を設けておりません。

## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2020年12月1日 ～2021年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	1,364

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を純資産総額の80%程度、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」を純資産総額の20%程度組み入れます。

### ■外国債券インデックスマザーファンド

ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

### ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020.12.1~2021.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	31円	0.275%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は11,293円です。
(投 信 会 社)	(22)	(0.198)	投信会社分は、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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	4	0.034	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(3)	(0.025)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	35	0.309	

(注1) 当作成期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

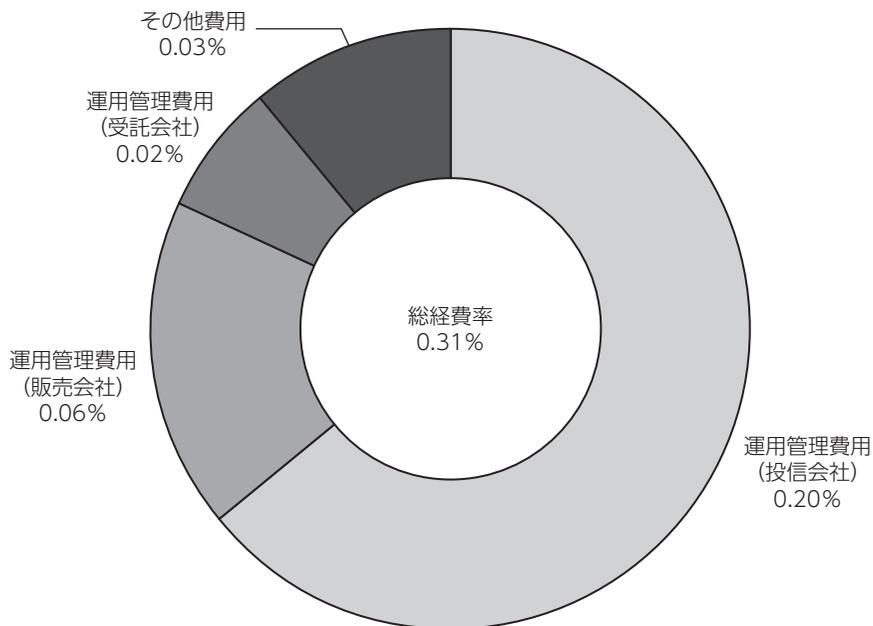
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.31%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	149,048	212,069	40,445	57,877
外国債券インデックス・マザーファンド	227,399	698,857	38,672	119,239

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	□ 数	評 価 額	□ 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	356,825	465,428	465,428	647,317
外国債券インデックス・マザーファンド	654,015	842,742	842,742	2,643,683

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	647,317	19.6
外国債券インデックス・マザーファンド	2,643,683	80.0
コール・ローン等、その他	11,653	0.4
投資信託財産総額	3,302,654	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1シンガポール・ドル=83.21円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シェケル=36.011円、1トルコ・リラ=8.926円、1デンマーク・クローネ=17.27円、1ノルウェー・クローネ=12.61円、1スウェーデン・クローネ=12.53円、1メキシコ・ペソ=5.252円、1フィリピン・ペソ=2.258円、1アルゼンチン・ペソ=1.127円、100チリ・ペソ=13.505円、100コロンビア・ペソ=2.82円、100インドネシア・ルピア=0.80円、1ブラジル・レアル=20.288円、1チェコ・コルナ=5.021円、1ルーマニア・レイ=25.947円、1オフショア人民元=17.83円、1ロシア・ルーブル=1.52円、1マレーシア・リンギット=26.851円、1南アフリカ・ランド=7.05円、1タイ・バツ=3.38円、1ペルー・ソル=28.017円、1ポーランド・ズロチ=27.465円、100ハンガリー・フォリント=34.967円、1ウクライナ・ペソ=2.585円、1ドミニカ・ペソ=2.009円、1ユーロ=128.41円です。

(注3) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(21,637,433千円)の投資信託財産総額(22,263,165千円)に対する比率は、97.2%です。外国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(232,057,536千円)の投資信託財産総額(233,916,004千円)に対する比率は、99.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,302,654,631円
コール・ローン等	11,653,159
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	647,317,961
外国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	2,643,683,511
(B) 負債	5,149,282
未払解約金	550,773
未払信託報酬	4,464,653
その他未払費用	133,856
(C) 純資産総額(A-B)	3,297,505,349
元本	2,901,476,819
次期繰越損益金	396,028,530
(D) 受益権総口数	2,901,476,819口
1万口当り基準価額(C/D)	11,365円

\* 期首における元本額は2,237,982,504円、当作成期間中における追加設定元本額は1,085,864,243円、同解約元本額は422,369,928円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,365円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月1日 至2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,362円
受取利息	102
支払利息	△ 2,464
(B) 有価証券売買損益	86,790,458
売買益	97,004,522
売買損	△ 10,214,064
(C) 信託報酬等	△ 8,432,621
(D) 当期損益金(A+B+C)	78,355,475
(E) 前期繰越損益金	113,970,088
(F) 追加信託差損益金(配当等相当額)	203,702,967 ( 146,691,832)
(売買損益相当額)	( 57,011,135)
(G) 合計(D+E+F)	396,028,530
次期繰越損益金(G)	396,028,530
追加信託差損益金(配当等相当額)	203,702,967 ( 146,691,832)
(売買損益相当額)	( 57,011,135)
分配準備積立金	192,327,925
繰越損益金	△ 2,362

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	78,356,116
(c) 収益調整金	203,702,967
(d) 分配準備積立金	113,971,809
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	396,030,892
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	396,030,892
(h) 受益権総口数	2,901,476,819口

<補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の決算日（2021年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年11月30日）現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄  
公 社 債

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

買			付			売			付		
銘	柄	金額	銘	柄	金額	銘	柄	金額	銘	柄	金額
		千円			千円			千円			千円
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル)	2024/1/1	247,514	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル)	2022/1/1	134,458	Colombian TES (コロンビア) 7%	2022/5/4	126,466			
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル)	2024/7/1	155,859	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10%	2023/1/1	123,208	Malaysia Government Investment Issue (マレーシア) 3.948%	2022/4/14	94,312			
Mexican Bonos (メキシコ) 5.75%	2026/3/5	128,083	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 6.5%	2023/3/9	123,869	Poland Government Bond (ポーランド) 2.25%	2022/4/25	93,023			
Mexican Bonos (メキシコ) 6.75%	2023/3/9	123,869	China Government Bond (中国) 3.27%	2030/11/19	121,040	Thailand Government Bond (タイ) 3.65%	2021/12/17	92,991			
Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 6.5%	2031/2/15	121,846	Thailand Government Bond (タイ) 0.75%	2024/6/17	120,799	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 7%	2022/5/15	90,178			
China Government Bond (中国) 3.27%	2030/11/19	121,040	Thailand Government Bond (タイ) 0.95%	2025/6/17	118,533	China Government Bond (中国) 2.36%	2023/7/2	85,852			
Thailand Government Bond (タイ) 0.75%	2024/6/17	120,799	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 5.5%	2026/4/15	117,746	China Government Bond (中国) 2.68%	2030/5/21	72,652			
Thailand Government Bond (タイ) 0.95%	2025/6/17	118,533	Poland Government Bond (ポーランド) 0.25%	2026/10/25	116,239	Russian Federal Bond - OFZ (ロシア) 7%	2021/12/15	70,878			
Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 5.5%	2026/4/15	117,746									
Poland Government Bond (ポーランド) 0.25%	2026/10/25	116,239									

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2021年11月30日現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（15,940,538千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	2021年11月30日現在								
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額				5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
トルコ	千トルコ・リラ 36,710	千トルコ・リラ 28,292	千円 252,539	% 1.1	% 1.1	% 0.4	% 0.4	% 0.4	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 363,200	千メキシコ・ペソ 366,710	1,926,291	8.7	-	4.5	3.0	1.2	
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 11,427	25,809	0.1	-	0.1	-	-	
チリ	千チリ・ペソ 3,215,000	千チリ・ペソ 3,046,071	411,371	1.9	-	1.0	0.7	0.1	
コロンビア	千コロンビア・ペソ 32,795,000	千コロンビア・ペソ 30,590,283	862,707	3.9	-	2.6	1.3	0.0	
インドネシア	千インドネシア・ルピア 257,329,000	千インドネシア・ルピア 277,385,653	2,219,085	10.0	-	6.8	2.8	0.4	
ブラジル	千ブラジル・レアル 105,850	千ブラジル・レアル 92,600	1,878,728	8.5	-	1.8	3.5	3.2	
チェコ	千チェコ・コルナ 199,500	千チェコ・コルナ 190,524	956,625	4.3	-	2.7	1.2	0.4	
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 22,370	千ルーマニア・レイ 21,782	565,195	2.5	-	1.1	1.0	0.5	
中国	千オフショア人民元 123,950	千オフショア人民元 125,771	2,242,519	10.1	-	5.7	3.2	1.2	

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2021年11月30日現在									
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
ロシア	千ロシア・ルーブル 1,137,330	千ロシア・ルーブル 1,070,443	千円 1,627,073	% 7.3	% -	% 4.0	% 2.4	% 0.9	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 66,030	千マレーシア・リンギット 67,108	1,801,970	8.1	-	4.8	2.7	0.7	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 273,890	千南アフリカ・ランド 240,063	1,692,446	7.6	-	7.3	-	0.3	
タイ	千タイ・バーツ 553,060	千タイ・バーツ 583,462	1,972,104	8.9	-	5.5	2.4	1.0	
ペルー	千ペルー・ソル 15,850	千ペルー・ソル 16,119	451,638	2.0	-	1.7	0.3	-	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 59,670	千ポーランド・ズロチ 57,600	1,582,033	7.1	-	2.4	3.3	1.5	
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 2,318,800	千ハンガリー・フォリント 2,168,581	758,296	3.4	-	1.6	1.2	0.6	
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 9,800	千ウルグアイ・ペソ 9,539	24,667	0.1	-	0.1	-	-	
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 12,699	25,520	0.1	0.1	-	0.1	-	
合 計	-	-	21,276,625	96.0	1.3	54.0	29.6	12.4	

(注1) 邦貨換算金額は、2021年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものである。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

2021年11月30日現在									
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
トルコ	Turkey Government Bond		国 債 証 券	8.5000	千トルコ・リラ 790	千トルコ・リラ 732	千円 6,538	2022/09/14	
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	7.1000	2,780	2,393	21,360	2023/03/08	
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	10.4000	680	560	5,002	2024/03/20	
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	9.0000	1,630	1,258	11,237	2024/07/24	
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	8.0000	2,690	1,908	17,032	2025/03/12	
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	10.6000	2,570	1,851	16,526	2026/02/11	
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	11.0000	2,970	2,057	18,361	2027/02/24	
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	10.7000	1,900	1,799	16,066	2022/08/17	
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	10.5000	2,500	1,656	14,786	2027/08/11	
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	12.2000	1,400	1,297	11,580	2023/01/18	
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	12.4000	2,000	1,429	12,758	2028/03/08	
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	16.2000	2,800	2,659	23,735	2023/06/14	
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	12.6000	6,100	4,816	42,996	2025/10/01	
	Turkey Government Bond		国 債 証 券	11.7000	5,900	3,871	34,554	2030/11/13	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	14銘柄			36,710	28,292	252,539		
メキシコ	Mexican Bonos		国 債 証 券	5.7500	千メキシコ・ペソ 42,400	千メキシコ・ペソ 39,897	209,575	2026/03/05	
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.0000	24,800	24,350	127,908	2047/11/07	
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.0000	29,000	29,528	155,111	2024/09/05	
	Mexican Bonos		国 債 証 券	6.7500	23,000	23,108	121,386	2023/03/09	
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.0000	27,250	27,822	146,148	2023/12/07	
	Mexican Bonos		国 債 証 券	10.0000	26,550	28,474	149,574	2024/12/05	
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.5000	34,230	34,311	180,234	2027/06/03	
	Mexican Bonos		国 債 証 券	10.0000	7,390	8,815	46,307	2036/11/20	
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.5000	30,730	32,379	170,086	2029/05/31	
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.5000	24,900	25,756	135,294	2038/11/18	
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.7500	30,950	31,141	163,583	2031/05/29	
	Mexican Bonos		国 債 証 券	6.5000	28,450	28,528	149,855	2022/06/09	

2021年11月30日現在											
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日			
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額				
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.7500	% 千メキシコ・ペソ	23,120	千メキシコ・ペソ	22,148	千円	116,346	2042/11/13
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.7500		10,430		10,447		54,877	2034/11/23
通貨小計	銘 柄 数 額	14銘柄				363,200	366,710	1,926,291			
フィリピン	Philippine Government International Bond		国 債 証 券	6.2500	千フィリピン・ペソ	10,000	千フィリピン・ペソ	11,427		25,809	2036/01/14
通貨小計	銘 柄 数 額	1銘柄				10,000	11,427	25,809			
チリ	BONOS TESORERIA PESOS		国 債 証 券	4.5000	千チリ・ペソ	500,000	千チリ・ペソ	484,215		65,393	2026/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS		国 債 証 券	5.0000		570,000		530,880		71,695	2035/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS		国 債 証 券	6.0000		410,000		413,964		55,905	2043/01/01
	BONOS TESORERIA PESOS		国 債 証 券	4.7000		535,000		501,557		67,735	2030/09/01
	BONOS TESORERIA PESOS		国 債 証 券	4.0000		250,000		245,610		33,169	2023/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS		国 債 証 券	2.5000		650,000		594,477		80,284	2025/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS		国 債 証 券	2.3000		100,000		81,563		11,015	2028/10/01
	BONOS TESORERIA PESOS		国 債 証 券	5.0000		200,000		193,804		26,173	2028/10/01
通貨小計	銘 柄 数 額	8銘柄				3,215,000	3,046,071	411,371			
コロンビア	Colombia Government International Bond		国 債 証 券	9.8500	千コロンビア・ペソ	90,000	千コロンビア・ペソ	102,313		2,885	2027/06/28
	Colombia Government International Bond		国 債 証 券	4.3750		45,000		44,840		1,264	2023/03/21
	Colombian TES		国 債 証 券	10.0000		3,850,000		4,147,990		116,981	2024/07/24
	Colombian TES		国 債 証 券	6.0000		4,290,000		3,849,803		108,572	2028/04/28
	Colombian TES		国 債 証 券	7.5000		3,710,000		3,686,627		103,970	2026/08/26
	Colombian TES		国 債 証 券	7.7500		2,700,000		2,602,584		73,398	2030/09/18
	Colombian TES		国 債 証 券	7.0000		3,800,000		3,402,938		95,969	2032/06/30
	Colombian TES		国 債 証 券	6.2500		2,700,000		2,603,043		73,411	2025/11/26
	Colombian TES		国 債 証 券	7.2500		3,400,000		3,041,878		85,787	2034/10/18
	Colombian TES		国 債 証 券	5.7500		2,400,000		2,153,880		60,743	2027/11/03
	Colombian TES		国 債 証 券	7.2500		2,310,000		1,906,997		53,781	2050/10/26
	Colombian TES		国 債 証 券	6.2500		1,200,000		958,620		27,035	2036/07/09
	COLOMBIAN TES		国 債 証 券	7.0000		2,300,000		2,088,768		58,907	2031/03/26
通貨小計	銘 柄 数 額	13銘柄				32,795,000	30,590,283	862,707			
インドネシア	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	8.2500	千インドネシア・ルピア	8,250,000	千インドネシア・ルピア	9,274,567		74,196	2036/05/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	8.7500		6,000,000		7,016,040		56,128	2031/05/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	7.5000		5,500,000		5,913,215		47,305	2032/08/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	7.5000		7,300,000		7,683,688		61,469	2038/05/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	8.1250		10,000,000		10,949,500		87,596	2024/05/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	8.3750		7,200,000		8,169,912		65,359	2039/04/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	8.2500		12,000,000		13,544,520		108,356	2029/05/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	7.0000		14,300,000		14,997,125		119,977	2030/09/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	6.5000		16,000,000		16,909,120		135,272	2025/06/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	7.5000		9,300,000		9,893,991		79,151	2035/06/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	7.5000		10,000,000		10,596,500		84,772	2040/04/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	5.5000		15,400,000		15,685,208		125,481	2026/04/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	6.5000		15,800,000		16,107,310		128,858	2031/02/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	6.2500		4,300,000		4,304,687		34,437	2036/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND		国 債 証 券	6.3750		6,100,000		6,238,043		49,904	2032/04/15
	INDONESIA TREASURY BOND		国 債 証 券	5.1250		6,000,000		6,070,200		48,561	2027/04/15
	INDONESIA TREASURY BOND		国 債 証 券	7.1250		4,000,000		4,146,520		33,172	2042/06/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	11.0000		3,600,000		4,349,772		34,798	2025/09/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	10.5000		2,180,000		2,785,734		22,285	2030/08/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	9.5000		2,970,000		3,621,677		28,973	2031/07/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	8.3750		12,824,000		14,543,698		116,349	2026/09/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	8.2500		4,750,000		5,384,647		43,077	2032/06/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	7.0000		10,330,000		11,100,411		88,803	2027/05/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	5.6250		10,910,000		11,202,606		89,620	2023/05/15
	Indonesia Treasury Bond		国 債 証 券	6.1250		11,450,000		11,705,449		93,643	2028/05/15

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2021年11月30日現在								
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円	2033/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	7,075,000	7,117,733	56,941	2034/03/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,520,000	14,183,782	113,470	2024/03/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	13,150,000	14,394,384	115,155	2029/03/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	8,120,000	9,495,609	75,964	2029/03/15	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	29銘柄		257,329,000	277,385,653	2,219,085		
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル		2023/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,910	10,710	217,305	2025/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,690	10,283	208,633	2027/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	11,550	10,907	221,291	2029/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	5,300	4,928	99,997	2031/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	3,600	3,309	67,143	2022/07/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	-	10,300	9,681	196,424	2023/07/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	-	17,500	14,622	296,668	2024/01/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	-	26,700	21,165	429,418	2024/07/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	-	9,300	6,991	141,844	2024/07/01	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	9銘柄		105,850	92,600	1,878,728		
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ		2028/08/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	15,600	15,522	77,936	2024/05/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	8,600	9,200	46,193	2022/09/12	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	8,700	8,845	44,413	2025/09/17	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	16,100	15,890	79,786	2026/06/26	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	17,900	16,614	83,422	2030/05/15	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	16,000	14,087	70,734	2023/10/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	9,900	9,462	47,512	2027/02/10	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	15,500	13,697	68,775	2029/07/23	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	15,000	15,118	75,909	2031/03/13	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	17,000	16,040	80,536	2029/11/29	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	16,200	14,384	72,225	2036/12/04	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	6,000	4,940	24,808	2032/06/23	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	9,500	11,391	57,197	2025/02/14	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	7,000	6,529	32,785	2025/02/14	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	14,000	13,381	67,187	2040/04/24	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	6,500	5,417	27,200		
通貨小計	銘 柄 数 金 額	16銘柄		199,500	190,524	956,625		
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	5.8500	千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ		2023/04/26	
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,430	1,458	37,854	2025/02/24	
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,151	29,886	2027/07/26	
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,100	2,166	56,224	2022/12/19	
	Romania Government Bond	国債証券	3.5000	1,090	1,083	28,102	2024/04/29	
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,600	1,555	40,367	2023/06/28	
	Romania Government Bond	国債証券	4.2500	1,500	1,497	38,860	2029/02/12	
	Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,543	65,992	2026/04/22	
	Romania Government Bond	国債証券	4.8500	1,600	1,596	41,424	2031/09/24	
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,400	1,207	31,328	2024/06/17	
	Romania Government Bond	国債証券	4.5000	900	898	23,319	2025/07/28	
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,500	1,447	37,565	2028/01/26	
	Romania Government Bond	国債証券	4.1500	1,600	1,514	39,289	2024/11/25	
	Romania Government Bond	国債証券	3.7000	1,300	1,268	32,913	2026/06/24	
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	800	746	19,362	2030/10/24	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1500	1,000	909	23,609	2034/10/11	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	800	735	19,095		
通貨小計	銘 柄 数 金 額	16銘柄		22,370	21,782	565,195		
中国	China Government Bond	国債証券	3.2900	千オフショア人民元	千オフショア人民元		2023/10/18	
	China Government Bond	国債証券	3.2200	3,900	3,961	70,642	2025/12/06	
	China Government Bond	国債証券	3.2500	3,700	3,780	67,404	2028/11/22	
	China Government Bond	国債証券	3.1900	4,800	4,914	87,621	2024/04/11	
	China Government Bond	国債証券	3.1900	5,300	5,385	96,021		

2021年11月30日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千オフショア人民元	千オフショア人民元	千円		
	China Government Bond	国債証券	3.2900	8,200	8,428	150,272	2029/05/23	
	China Government Bond	国債証券	3.2500	6,800	6,958	124,070	2026/06/06	
	China Government Bond	国債証券	3.1200	7,000	7,131	127,147	2026/12/05	
	China Government Bond	国債証券	3.1300	7,000	7,107	126,725	2029/11/21	
	China Government Bond	国債証券	2.9400	4,500	4,544	81,034	2024/10/17	
	China Government Bond	国債証券	2.8500	8,600	8,626	153,808	2027/06/04	
	China Government Bond	国債証券	2.6800	8,000	7,853	140,031	2030/05/21	
	China Government Bond	国債証券	1.9900	6,500	6,359	113,399	2025/04/09	
	China Government Bond	国債証券	2.3600	6,150	6,139	109,470	2023/07/02	
	China Government Bond	国債証券	2.8800	4,900	4,937	88,041	2023/11/05	
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,091	126,444	2025/10/22	
	China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,141	91,673	2027/12/03	
	China Government Bond	国債証券	3.2700	7,300	7,524	134,167	2030/11/19	
	China Government Bond	国債証券	3.0300	1,700	1,724	30,753	2026/03/11	
	China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	6,195	110,464	2050/09/14	
	China Government Bond	国債証券	2.8400	2,500	2,518	44,903	2024/04/08	
	China Government Bond	国債証券	3.0100	1,000	1,010	18,020	2028/05/13	
	China Government Bond	国債証券	3.7200	1,000	1,054	18,803	2051/04/12	
	China Government Bond	国債証券	3.0200	5,800	5,878	104,822	2031/05/27	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	1,500	1,501	26,774	2026/08/12	
通貨小計	銘 柄 数 額	24銘柄			123,950	125,771	2,242,519	
ロシア				千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル			
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	46,760	46,256	70,310	2027/02/03	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	32,910	32,811	49,874	2022/07/20	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	24,400	23,995	36,473	2023/01/25	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	46,160	43,243	65,730	2028/01/19	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	33,800	33,037	50,216	2023/08/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	31,000	31,697	48,180	2031/09/17	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	45,600	44,457	67,575	2026/09/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	44,000	43,581	66,243	2022/12/07	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	46,100	44,505	67,648	2033/03/23	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	48,600	46,905	71,296	2024/10/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	48,000	46,080	70,043	2024/02/28	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.2500	55,000	51,009	77,534	2034/05/10	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.9000	51,000	47,084	71,568	2029/05/23	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.9500	46,000	45,097	68,547	2026/10/07	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	55,000	53,529	81,365	2024/07/17	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1500	59,000	56,483	85,855	2025/11/12	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6500	65,000	62,615	95,176	2030/04/10	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	38,000	36,591	55,619	2039/03/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.0000	68,000	60,504	91,966	2027/10/06	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	4.5000	71,000	62,434	94,900	2025/07/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.1000	63,000	52,453	79,728	2035/07/18	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	5.7000	65,000	56,615	86,054	2028/05/17	
	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ	国債証券	6.9000	54,000	49,449	75,163	2031/07/23	
通貨小計	銘 柄 数 額	23銘柄			1,137,330	1,070,443	1,627,073	
マレーシア				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット			
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,884	50,589	2027/07/26	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0940	2,000	2,066	55,487	2023/11/30	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	1,700	1,793	48,149	2028/10/31	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1280	1,900	1,970	52,911	2025/08/15	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	1,600	1,660	44,580	2029/07/09	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.6550	1,700	1,741	46,753	2024/10/15	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	3,300	3,380	90,766	2026/03/31	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	2,500	2,478	66,544	2030/10/15	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4220	2,200	2,204	59,201	2027/09/30	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4470	1,500	1,404	37,700	2036/07/15	
	MALAYSIA T-BILL	国債証券	4.4170	1,100	1,130	30,351	2041/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	1,750	1,771	47,558	2027/05/31	

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2021年11月30日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.4800	千マレーシア・リンギット 2,500	千マレーシア・リンギット 2,538	千円 68,169	2023/03/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.7330	3,250	3,310	88,880	2028/06/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	4.1810	1,740	1,809	48,575	2024/07/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.9550	3,850	3,997	107,335	2025/09/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	4.2540	1,800	1,867	50,141	2035/05/31
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.8000	1,400	1,432	38,475	2023/08/17
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.9000	2,000	2,070	55,590	2026/11/30
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	4.0590	3,020	3,134	84,174	2024/09/30
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.8990	2,520	2,598	69,767	2027/11/16
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	4.7620	2,600	2,773	74,475	2037/04/07
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.7570	1,400	1,428	38,344	2023/04/20
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.9060	2,000	2,070	55,599	2026/07/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.8850	2,950	3,023	81,199	2029/08/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.4780	2,100	2,140	57,470	2024/06/14
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.8280	2,350	2,317	62,218	2034/07/05
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	3.7570	2,800	2,653	71,257	2040/05/22
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	4.0650	2,800	2,692	72,293	2050/06/15
	MALYSIAN GOVERNMENT		国 債 証 券	2.6320	1,900	1,765	47,406	2031/04/15
通貨小計	銘	柄	数					
	金	額	額		66,030	67,108	1,801,970	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	10.5000	千南アフリカ・ランド 40,550	千南アフリカ・ランド 44,552	314,093	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	6.2500	11,220	7,638	53,848	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	6.5000	9,780	6,311	44,496	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	7.0000	16,040	13,111	92,433	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	7.7500	8,880	9,161	64,591	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.7500	38,020	30,893	217,796	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.5000	23,900	19,740	139,168	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.0000	35,400	31,870	224,687	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.7500	23,100	18,851	132,905	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.2500	25,600	22,328	157,416	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	8.8750	23,800	20,717	146,056	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国 債 証 券	9.0000	17,600	14,886	104,953	2040/01/31
通貨小計	銘	柄	数					
	金	額	額		273,890	240,063	1,692,446	
タイ	Thailand Government Bond		国 債 証 券	4.8750	千タイ・バーツ 30,050	千タイ・バーツ 37,053	125,239	2029/06/22
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	3.6250	23,300	24,373	82,381	2023/06/16
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	3.8500	26,610	29,588	100,010	2025/12/12
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	3.6500	28,700	33,226	112,306	2031/06/20
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	1.8750	17,200	17,328	58,570	2022/06/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	3.4000	29,600	32,967	111,431	2036/06/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	2.1250	35,400	37,018	125,123	2026/12/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	2.0000	24,000	24,370	82,373	2022/12/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	3.7750	32,500	38,070	128,678	2032/06/25
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	2.8750	24,900	25,275	85,432	2046/06/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	2.4000	24,500	25,353	85,695	2023/12/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	2.8750	26,500	28,864	97,560	2028/12/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	3.3000	35,500	38,904	131,497	2038/06/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	1.4500	30,000	30,550	103,260	2024/12/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	1.6000	27,500	27,412	92,654	2029/12/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	1.6000	15,500	14,216	48,052	2035/06/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	0.9500	34,000	34,021	114,991	2025/06/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	0.7500	34,900	34,902	117,970	2024/06/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	1.5850	17,400	15,823	53,483	2035/12/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	2.0000	16,000	16,132	54,527	2031/12/17
	Thailand Government Bond		国 債 証 券	2.0000	7,000	6,184	20,904	2042/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.0000	12,000	11,822	39,958	2027/06/17
通貨小計	銘	柄	数					
	金	額	額		553,060	583,462	1,972,104	

2021年11月30日現在									
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
ペルー	Peru Government Bond		国債証券	5.700%	千ペルー・ソル 730	千ペルー・ソル 754	千円 21,125	2024/08/12	
	Peru Government Bond		国債証券	6.3500	1,970	2,077	58,214	2028/08/12	
	Peru Government Bond		国債証券	6.1500	1,850	1,860	52,129	2032/08/12	
	Peru Government Bond		国債証券	5.9400	2,700	2,773	77,709	2029/02/12	
	Peru Government Bond		国債証券	5.4000	2,050	1,869	52,372	2034/08/12	
	Peru Government Bond		国債証券	5.3500	1,000	845	23,685	2040/08/12	
	Peru Government Bond		国債証券	8.2000	1,565	1,781	49,927	2026/08/12	
	Peru Government Bond		国債証券	6.9000	2,065	2,089	58,540	2037/08/12	
	Peru Government Bond		国債証券	6.9500	1,920	2,067	57,933	2031/08/12	
通貨小計	銘	柄	数						
	金		額		15,850	16,119	451,638		
ポーランド	Poland Government Bond		国債証券	5.7500	3,610	3,718	102,118	2022/09/23	
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	5,990	5,828	160,090	2026/07/25	
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	4,140	3,983	109,413	2027/07/25	
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	4,500	4,501	123,637	2023/01/25	
	Poland Government Bond		国債証券	2.5000	4,700	4,659	127,978	2024/04/25	
	Poland Government Bond		国債証券	2.7500	6,450	6,264	172,067	2029/10/25	
	Poland Government Bond		国債証券	2.2500	3,700	3,626	99,615	2024/10/25	
	Poland Government Bond		国債証券	0.7500	4,000	3,706	101,793	2025/04/25	
	Poland Government Bond		国債証券	1.2500	4,600	3,935	108,090	2030/10/25	
	Poland Government Bond		国債証券	0.2500	4,300	3,726	102,347	2026/10/25	
	Poland Government Bond		国債証券	4.0000	3,530	3,606	99,067	2023/10/25	
	Poland Government Bond		国債証券	2.7500	5,000	4,867	133,695	2028/04/25	
	Poland Government Bond		国債証券	3.2500	5,150	5,174	142,119	2025/07/25	
	通貨小計	銘	柄	数					
	金		額		59,670	57,600	1,582,033		
ハンガリー	Hungary Government Bond		国債証券	3.0000	98,500	95,919	33,540	2024/06/26	
	Hungary Government Bond		国債証券	3.0000	170,000	158,742	55,508	2027/10/27	
	Hungary Government Bond		国債証券	1.7500	140,000	138,129	48,300	2022/10/26	
	Hungary Government Bond		国債証券	2.7500	130,000	121,680	42,548	2026/12/22	
	Hungary Government Bond		国債証券	6.7500	88,000	100,456	35,126	2028/10/22	
	Hungary Government Bond		国債証券	3.0000	145,000	131,191	45,874	2030/08/21	
	Hungary Government Bond		国債証券	2.5000	160,000	152,924	53,473	2024/10/24	
	Hungary Government Bond		国債証券	3.2500	202,000	183,830	64,280	2031/10/22	
	Hungary Government Bond		国債証券	1.5000	40,000	38,676	13,523	2023/08/23	
	Hungary Government Bond		国債証券	1.0000	130,000	115,219	40,289	2025/11/26	
	Hungary Government Bond		国債証券	3.0000	127,000	106,273	37,161	2038/10/27	
	Hungary Government Bond		国債証券	1.5000	169,000	151,300	52,905	2026/04/22	
	Hungary Government Bond		国債証券	2.0000	135,000	115,380	40,345	2029/05/23	
	Hungary Government Bond		国債証券	2.2500	145,000	117,703	41,157	2033/04/20	
	Hungary Government Bond		国債証券	1.5000	100,000	88,885	31,080	2026/08/26	
	Hungary Government Bond		国債証券	6.0000	131,800	137,111	47,944	2023/11/24	
	Hungary Government Bond		国債証券	7.0000	65,000	66,472	23,243	2022/06/24	
Hungary Government Bond		国債証券	5.5000	142,500	148,684	51,991	2025/06/24		
通貨小計	銘	柄	数						
	金		額		2,318,800	2,168,581	758,296		
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond		国債証券	8.5000	2,800	2,805	7,254	2028/03/15	
	Uruguay Government International Bond		国債証券	8.2500	7,000	6,734	17,412	2031/05/21	
通貨小計	銘	柄	数						
	金		額		9,800	9,539	24,667		
ドミニカ共和国	Dominican Republic International Bond		国債証券	9.7500	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 12,699	25,520	2026/06/05	
通貨小計	銘	柄	数						
	金		額		11,000	12,699	25,520		
合 計	銘	柄	数						
	金		額				21,276,625		

(注1) 邦貨換算金額は、2021年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

# 外国債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第22期 (決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日)

外国債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	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
株式組入制限	純資産総額の30%以下

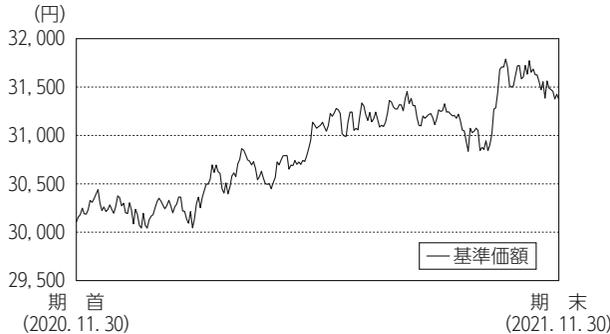
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：30,106円 期末：31,370円 騰落率：4.2%

【基準価額の主な変動要因】

日本を除く先進国国債に主に投資した結果、債券市場で金利は上昇（債券価格は下落）したものの、為替市場で円安が進んだため、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると上昇しました。

当作成期首より、米国の財政拡大観測の高まりなどから各国の金利は上昇しました。また、米国で今後の金融緩和策の後退が市場で意識されたことも、さらなる金利上昇要因となりました。その後はレンジ内で推移しましたが、2021年6月には、米国で将来の利上げ後の経済回復ペースや物価上昇圧力の鈍化が意識されたことで、長期ゾーンを中心に金利は低下しました。しかし9月には、F R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げ見通しが市場予想を上回ったことなどから、金利は上昇に転じました。10月に入っても、物資の供給制約の長期化を背景にインフレへの懸念が高まったことが、主要国の金利上昇圧力となりました。

○為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると円安が進みました。

対円為替相場は、当作成期首より、米国において民主党が大統領府および議会上下両院を制したこと、株価が上昇するなど市場のリスク選好姿勢が強まり、円安となりました。2021年3月には、米国での追加経済対策の成立や経済指標の改善により米国金利が上昇したことなどを背景に米ドルが買い進められ、全般的に円安が進行しました。7月以降は、新型コロナウイルスの新規感染者数の増加を受けた景気への懸念を受け、円高が進みました。9月以降は、日本以外の各国で利上げ観測が高まり、金融政策の方向性の違いを要因として、円安となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

今後も、ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

◆ポートフォリオについて

当作成期におきましては、ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は4.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.2%となりました。

当作成期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.1%程度でした。なお、この値は、ファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正したものです。

\*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。

《今後の運用方針》

今後も、ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

年 月 日	基準価額		FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率		
(期首) 2020年11月30日	30,106	—	30,435	—	98.5	—
12月末	30,356	0.8	30,690	0.8	98.5	—
2021年1月末	30,316	0.7	30,621	0.6	98.2	—
2月末	30,045	△ 0.2	30,493	0.2	98.5	—
3月末	30,706	2.0	30,924	1.6	98.4	—
4月末	30,696	2.0	31,035	2.0	98.5	—
5月末	31,109	3.3	31,499	3.5	98.8	—
6月末	31,058	3.2	31,389	3.1	98.6	—
7月末	31,273	3.9	31,662	4.0	98.7	—
8月末	31,264	3.8	31,613	3.9	98.3	—
9月末	31,051	3.1	31,407	3.2	98.4	—
10月末	31,722	5.4	31,985	5.1	98.4	—
(期末) 2021年11月30日	31,370	4.2	31,642	4.0	98.6	—

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）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）の原データをもとに、当ファンドの設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）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。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

# 外国債券インデックスマザーファンド

## ■ 1万円当りの費用の明細

項目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	3 ( 3)
(その他)	( 0)
合 計	3

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■ 売買および取引の状況

### 公 社 債

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカ・ドル 290,158	千アメリカ・ドル 194,720 ( — )
	カナダ	千カナダ・ドル 12,555	千カナダ・ドル 12,968 ( — )
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 3,221	千オーストラリア・ドル 25,367 ( — )
	シンガポール	千シンガポール・ドル 1,966	千シンガポール・ドル 1,383 ( — )
	イギリス	千イギリス・ポンド 7,995	千イギリス・ポンド 14,829 ( — )
	イスラエル	千イスラエル・シケル 4,974	千イスラエル・シケル 3,106 ( — )
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 2,013	千デンマーク・クローネ 7,808 ( — )
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 5,487	千ノルウェー・クローネ — ( — )
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 5,442	千スウェーデン・クローネ 8,760 ( — )
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 44,370	千メキシコ・ペソ 68,282 ( — )
中国	千オフショア・人民元 26,878	千オフショア・人民元 — ( — )	

		買付額	売付額
外	マレーシア	千マレーシア・リンギット 4,471	千マレーシア・リンギット 4,895 ( — )
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 5,211	千ポーランド・ズロチ 9,327 ( — )
	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 2,269	千ユーロ 1,287 ( — )
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 4,757	千ユーロ 3,976 ( — )
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 3,234	千ユーロ 5,045 ( — )
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 25,245	千ユーロ 21,124 ( — )
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 19,386	千ユーロ 15,981 ( — )
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 13,911	千ユーロ 10,877 ( — )
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 24,037	千ユーロ 22,394 ( — )
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 2,007	千ユーロ 1,677 ( — )
国	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 3,575	千ユーロ 2,505 ( — )
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 98,425	千ユーロ 84,871 ( — )

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2031/2/15	1,124,989	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2023/4/15	1,037,740
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.25% 2031/8/15	1,032,228	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.125% 2022/6/30	604,766
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.875% 2030/11/15	1,019,561	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.125% 2028/11/15	575,884
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2031/5/15	974,457	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2022/5/25	529,651
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 0.375% 2024/9/15	848,795	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 3% 2022/4/25	502,618
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2023/11/15	842,947	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2.25% 2022/10/25	487,862
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.25% 2028/9/30	785,770	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2022/7/31	474,174
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2% 2051/8/15	781,896	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2022/2/15	457,380
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2028/3/31	760,295	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/7/15	446,593
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.75% 2028/1/31	751,258	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2021/12/31	426,726

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国(外貨建)公社債(通貨別)

作 成 期	当 期			未				
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 比	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカ・ドル 922,829	千アメリカ・ドル 955,962	千円 108,759,849	% 46.6	% —	% 21.2	% 16.7	% 8.6
カナダ	千カナダ・ドル 48,671	千カナダ・ドル 50,556	4,512,686	1.9	—	0.9	0.6	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 46,852	千オーストラリア・ドル 49,050	3,987,292	1.7	—	1.2	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 10,980	千シンガポール・ドル 11,571	962,856	0.4	—	0.3	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 73,322	千イギリス・ポンド 93,472	14,166,718	6.1	—	4.8	0.8	0.5
イスラエル	千イスラエル・シユケル 27,300	千イスラエル・シユケル 30,584	1,101,379	0.5	—	0.2	0.2	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 50,511	千デンマーク・クローネ 63,327	1,093,665	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 42,134	千ノルウェー・クローネ 42,491	535,815	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 47,205	千スウェーデン・クローネ 52,123	653,106	0.3	—	0.2	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 282,935	千メキシコ・ペソ 286,643	1,505,707	0.6	—	0.4	0.2	0.0
中国	千オフショア・人民元 26,800	千オフショア・人民元 27,057	482,437	0.2	—	0.1	0.0	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 38,656	千マレーシア・リンギット 39,646	1,064,579	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 41,500	千ポーランド・ズロチ 40,366	1,108,694	0.5	—	0.2	0.2	0.1

## 外国債券インデックスマザーファンド

作成期		当 期				末			
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ユ ー ロ	アイルランド	千ユーロ 12,877	千ユーロ 14,293	千円 1,835,439	% 0.8	% —	% 0.6	% 0.2	% 0.0
	オランダ	千ユーロ 28,587	千ユーロ 33,774	千円 4,337,032	1.9	—	1.3	0.4	0.2
	ベルギー	千ユーロ 33,676	千ユーロ 40,353	千円 5,181,793	2.2	—	1.7	0.4	0.1
	フランス	千ユーロ 152,793	千ユーロ 178,981	千円 22,982,963	9.8	—	6.4	2.6	0.9
	ドイツ	千ユーロ 110,312	千ユーロ 130,913	千円 16,810,567	7.2	—	4.6	1.7	0.8
	スペイン	千ユーロ 90,321	千ユーロ 105,873	千円 13,595,192	5.8	—	3.7	1.6	0.6
	イタリア	千ユーロ 142,231	千ユーロ 162,937	千円 20,922,845	9.0	—	5.5	2.4	1.0
	フィンランド	千ユーロ 10,032	千ユーロ 10,846	千円 1,392,797	0.6	—	0.4	0.2	0.1
	オーストリア	千ユーロ 22,501	千ユーロ 26,075	千円 3,348,351	1.4	—	0.9	0.3	0.2
	小計	603,330	704,049	90,406,985	38.7	—	25.0	9.7	4.0
合 計	—	—	230,341,773	98.6	—	55.2	29.3	14.1	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社よりデータを入手しています。

### (2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ア メ リ カ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	千アメリカ・ドル 6,668	千アメリカ・ドル 6,758	千円 768,958	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,441	505,277	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,781	543,939	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,568	4,729	538,129	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,241	596,339	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,478	623,274	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	5,131	583,829	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	718	81,796	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,029	117,099	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	906	103,134	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	884	100,662	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	928	105,955	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	989	112,537	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	3,203	364,425	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,627	185,146	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	1,239	141,043	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	758	86,344	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	729	82,969	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	1,319	150,159	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,540	175,242	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,500	170,708	2039/08/15

区 分	銘 柄	種 類	当 期		末			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,688	192,123	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,453	165,314	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	2,352	267,640	2040/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,440	163,890	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	2,030	230,976	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,843	209,692	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,924	218,955	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,981	225,430	2041/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,742	198,294	2041/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,954	222,414	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,601	182,226	2042/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,231	2,541	289,137	2042/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	1,858	211,420	2042/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	3,168	360,471	2043/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	2,672	304,090	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	4,178	475,379	2043/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	2,758	313,793	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	4,315	490,989	2044/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	4,198	477,633	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	6,430	731,637	2024/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	2,348	267,142	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	6,169	701,917	2024/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,746	3,284	373,723	2044/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,946	676,504	2025/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	2,829	321,958	2045/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	6,019	684,886	2025/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,835	3,405	387,497	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,950	677,013	2025/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,873	2,209	251,396	2045/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	6,112	695,425	2025/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	659	795	90,461	2045/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,597	295,511	2022/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,287	6,399	728,039	2022/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,992	5,094	579,559	2022/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,866	4,970	565,540	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,605	296,428	2023/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,148	3,496	397,766	2046/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,962	3,006	342,105	2023/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,623	3,680	418,738	2023/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,729	7,896	898,356	2026/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,107	239,818	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,823	3,136	356,877	2046/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,547	289,789	2023/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	3,047	346,709	2023/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	5,485	624,052	2026/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,780	2,955	336,244	2046/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,819	320,774	2023/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,439	277,547	2023/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,547	289,824	2023/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,508	626,672	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,554	290,633	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,500	1,785	203,157	2046/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,570	292,437	2023/11/30	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	当 期		未 評 価 額			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額			
					千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,588	294,468	2023/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,640	3,831	435,876	2027/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,569	292,332	2024/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,845	3,466	394,350	2047/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,379	270,675	2024/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,550	4,706	535,507	2024/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	6,778	771,189	2027/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	2,445	278,183	2047/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	3,097	352,388	2024/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,473	622,692	2024/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,479	282,124	2024/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	6,212	706,745	2027/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,110	353,907	2024/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,950	3,458	393,435	2047/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	2,060	234,461	2024/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,500	2,594	295,210	2024/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,541	289,123	2022/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,797	659,612	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,500	4,104	467,007	2047/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,646	414,883	2024/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,324	378,196	2024/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	2,919	332,142	2024/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,586	408,038	2023/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,350	6,879	782,712	2028/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,396	386,452	2023/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,734	311,053	2025/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,862	325,655	2025/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,800	4,672	531,588	2048/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,900	2,984	339,534	2023/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	3,064	348,594	2025/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,200	5,290	601,917	2048/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	7,101	807,909	2028/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,585	294,123	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	2,024	230,330	2025/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,784	430,576	2025/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,589	294,621	2023/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,588	294,533	2023/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	3,187	362,693	2025/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,850	4,000	455,171	2023/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	7,335	834,612	2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,220	5,202	591,845	2048/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,670	303,845	2025/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,745	426,081	2023/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,829	435,710	2025/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,685	305,577	2025/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,132	356,361	2023/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,688	305,845	2025/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,182	475,822	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,700	4,121	468,928	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,520	5,962	678,391	2048/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,214	365,761	2025/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	2,094	238,250	2023/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,500	3,718	423,018	2025/12/31	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,607	296,700	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	7,141	812,476	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	4,166	474,011	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,656	302,244	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	5,824	662,671	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,644	300,890	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,431	390,353	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,620	298,176	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	5,646	642,354	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	4,155	472,783	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,634	413,453	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,951	335,777	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,132	356,399	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,593	408,846	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	2,892	329,055	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,500	5,650	642,867	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,583	293,910	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,767	542,381	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	4,961	564,429	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,828	321,827	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	4,053	461,173	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,555	290,710	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,060	348,228	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	1,020	116,085	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,066	348,829	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,850	5,988	681,334	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	4,988	567,559	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	2,045	232,675	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,061	348,269	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,043	346,282	2022/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,571	292,590	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,569	292,377	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	4,056	461,546	2023/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,700	1,726	196,474	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,250	2,280	259,481	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,000	5,016	570,755	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,200	3,250	369,808	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	5,533	629,520	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	298	33,978	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	5,241	596,271	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,200	4,209	478,971	2023/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,500	1,479	168,340	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,200	3,197	363,750	2023/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,551	176,512	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	7,800	7,272	827,435	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,488	396,900	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,649	301,440	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,400	2,306	262,445	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	4,799	546,068	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,370	497,254	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,360	382,267	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,926	332,910	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,500	5,489	624,583	2023/06/15

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	7,500	7,308	831,439	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,357	382,016	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	995	113,285	2023/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,308	376,435	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,500	5,472	622,625	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	10,000	9,301	1,058,186	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,760	541,647	2027/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	6,700	5,920	673,585	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	6,000	5,227	594,732	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,347	380,897	2027/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,988	226,277	2023/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	6,312	718,125	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,794	431,720	2027/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,400	386,870	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,200	4,173	474,809	2023/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	7,700	7,663	871,885	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	9,800	9,301	1,058,273	2030/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,498	397,975	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,877	441,140	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,000	3,815	434,064	2027/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,800	6,389	726,908	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,100	4,635	527,368	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,997	341,026	2022/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,100	4,960	564,381	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,799	546,004	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,975	338,494	2023/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,793	545,339	2027/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	1,000	971	110,565	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,700	1,697	193,173	2022/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,000	3,963	450,884	2024/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	7,000	6,755	768,516	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,900	5,879	668,933	2051/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	10,700	10,369	1,179,723	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,000	4,950	563,269	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,997	227,228	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,852	552,091	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,936	561,602	2028/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,700	4,648	528,869	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,000	2,924	332,695	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,996	227,121	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,983	225,662	2024/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,992	340,466	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	7,000	6,956	791,412	2028/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,937	447,967	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	3,000	2,980	339,053	2024/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	8,700	8,800	1,001,280	2031/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,100	5,046	574,175	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,500	4,426	503,625	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,400	3,390	385,684	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,956	677,711	2028/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,100	6,787	772,231	2051/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,800	3,990	453,972	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	996	113,369	2023/05/31

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,968	451,484	2028/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	3,000	2,949	335,589	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,977	224,987	2024/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,500	1,494	170,008	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	4,955	563,827	2028/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	5,000	4,939	562,001	2026/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	5,500	5,450	620,134	2024/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	3,000	2,971	338,040	2024/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	9,300	9,076	1,032,635	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	6,900	7,083	805,862	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	3,000	2,901	330,135	2041/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.1250	2,500	2,488	283,102	2023/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	6,000	5,855	666,162	2026/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	5,000	4,871	554,270	2028/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.1250	3,000	2,984	339,548	2023/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	5,000	4,908	558,405	2028/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	5,000	4,904	557,979	2026/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	7,500	7,421	844,375	2024/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	7,000	6,926	788,051	2028/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,500	3,451	392,640	2026/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,494	170,061	2023/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	2,000	1,991	226,570	2024/10/15
通貨小計	銘柄数	255銘柄					
	金額			922,829	955,962	108,759,849	
				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	405	487	43,542	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,280	114,286	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,581	141,163	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,444	128,961	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	913	1,226	109,472	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	961	1,251	111,737	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,265	112,953	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,454	129,802	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,566	139,843	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,196	106,802	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	974	87,022	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,211	108,142	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	650	671	59,960	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,300	4,352	388,485	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,300	1,324	118,226	2023/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,710	3,760	335,701	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,287	114,949	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,232	110,024	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,414	126,263	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	3,377	301,477	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	700	701	62,587	2025/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,806	250,511	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	697	62,243	2022/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,000	1,820	162,510	2030/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,100	2,004	178,924	2026/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,177	105,147	2024/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,491	133,114	2023/02/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,100	1,091	97,400	2023/05/01

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
通貨小計		銘柄数 金 額			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
				%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	300	294	26,272	2026/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,400	2,374	211,983	2031/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	100	98	8,832	2023/08/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,000	988	88,262	2024/10/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	700	663	59,225	2053/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	991	88,498	2023/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	200	197	17,649	2027/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	500	497	44,372	2024/02/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	300	295	26,331	2031/12/01
通貨小計		37銘柄			48,671	50,556	4,512,686	
					千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
オーストラリア		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,168	1,251	101,734	2023/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,989	2,336	189,943	2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,973	2,071	168,357	2024/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,754	1,959	159,294	2029/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,798	1,928	156,732	2025/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,258	1,609	130,867	2033/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,748	3,098	251,855	2026/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,361	110,639	2037/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,307	1,433	116,498	2035/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	914	74,318	2039/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,672	1,795	145,980	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,178	1,232	100,194	2028/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	1,400	113,847	2047/03/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,800	1,943	158,008	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,350	1,377	111,954	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,900	2,060	167,482	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,870	3,061	248,900	2030/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,390	1,491	121,264	2041/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	2,784	226,364	2031/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,300	1,236	100,484	2032/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,353	191,356	2024/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,200	3,011	244,772	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,400	1,217	98,938	2051/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,540	125,213	2025/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,330	189,476	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,153	93,771	2026/09/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,100	1,095	89,038	2032/11/21
通貨小計		27銘柄			46,852	49,050	3,987,292	
					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	850	70,758	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	923	973	81,010	2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	809	882	73,442	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	448	37,348	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	671	692	57,621	2023/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	655	54,518	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	678	56,478	2029/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	546	45,433	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	775	64,519	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	465	38,755	2026/06/01

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
通貨小計		銘柄数 金 額	19銘柄		千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	750	779	64,825	2036/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	450	456	37,946	2023/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	585	48,740	2028/05/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	490	502	41,814	2024/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	370	30,827	2039/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	710	685	57,011	2050/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	750	729	60,710	2025/11/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	300	297	24,753	2031/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	200	196	16,342	2051/10/01
通貨小計		銘柄数 金 額	19銘柄		10,980	11,571	962,856	
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	921	971	147,252	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,682	2,767	419,439	2065/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,528	231,649	2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,940	2,161	327,604	2047/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,350	2,596	393,488	2037/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,810	2,303	349,090	2057/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,410	1,461	221,510	2027/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	3,000	3,017	457,376	2023/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,500	1,599	242,424	2028/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	940	1,325	200,886	2071/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	1,800	1,824	276,553	2024/04/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,210	1,435	217,549	2049/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	1,018	154,341	2054/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	800	809	122,721	2029/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,900	1,910	289,593	2025/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,190	1,232	186,728	2041/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	2,300	2,294	347,765	2023/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	2,300	2,219	336,418	2030/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	750	679	102,953	2061/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,474	223,457	2026/01/30
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,600	1,551	235,085	2028/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	1,014	153,753	2050/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,300	1,234	187,068	2035/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,300	1,289	195,504	2024/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	1,300	1,227	186,102	2031/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	500	483	73,323	2046/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	100	98	14,962	2026/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	300	322	48,837	2051/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.2500	100	99	15,011	2025/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	600	606	91,845	2039/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.5000	100	98	14,918	2029/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.8750	300	298	45,312	2033/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	300	348	52,812	2053/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,296	196,550	2028/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,240	3,000	454,762	2032/06/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,685	255,494	2025/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,662	2,386	361,660	2036/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,357	2,155	326,716	2038/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,908	3,794	575,079	2055/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,366	2,341	354,915	2046/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,494	226,560	2027/12/07	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,416	4,009	607,628	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,600	2,155	326,678	2030/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	2,427	367,948	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	2,207	334,626	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,560	2,224	337,187	2034/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,174	2,403	364,198	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,454	372,045	2040/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	2,714	411,397	2052/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,166	3,124	473,503	2044/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,582	1,632	247,411	2023/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,386	2,889	437,971	2068/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,092	1,160	175,847	2024/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,724	2,607	395,192	2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	54銘柄			73,322	93,472	14,166,718	
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	2,000	2,567	92,447	2026/10/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	4.2500	1,800	1,901	68,481	2023/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,900	3,080	110,934	2042/01/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,000	2,168	78,085	2024/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,422	87,223	2025/08/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,941	69,928	2027/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.2500	1,000	1,012	36,478	2022/11/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,400	3,166	114,016	2047/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,800	1,987	71,563	2028/09/28	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,500	1,541	55,502	2023/11/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	2,400	2,413	86,922	2030/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.5000	1,600	1,611	58,044	2025/04/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,700	1,660	59,799	2037/05/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.1500	2,000	2,002	72,120	2023/07/31	
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.5000	200	200	7,234	2026/02/27		
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.4000	900	905	32,594	2024/10/31		
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄			27,300	30,584	1,101,379	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	13,662	24,709	426,740	2039/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,053	87,265	2023/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	6,555	113,207	2025/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	7,900	8,302	143,377	2027/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	9,590	10,134	175,029	2029/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,300	4,338	74,924	2022/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,700	2,714	46,877	2052/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	502	8,681	2031/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,016	17,561	2024/11/15	
	通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄			50,511	63,327	1,093,665
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	8,204	8,311	104,811	2023/05/24	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,254	53,647	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	5,395	5,457	68,817	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,340	4,347	54,826	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,450	4,505	56,810	2027/02/17	

		当 期			未		
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,600	45,401	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	3,898	49,162	2029/09/06
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	4,800	4,721	59,540	2030/08/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,500	3,393	42,797	2031/09/17
通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄		42,134	42,491	535,815	
<b>スウェーデン</b>				千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ		
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,655	7,006	87,785	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	8,025	8,305	104,072	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,595	8,291	103,894	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	7,537	94,447	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,050	5,268	66,008	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,300	3,991	50,009	2032/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	7,400	7,757	97,197	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	4,000	3,965	49,690	2031/05/12
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄		47,205	52,123	653,106	
<b>メキシコ</b>				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	31,290	29,442	154,660	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	19,300	18,949	99,541	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	23,800	24,233	127,298	2024/09/05
	Mexican Bonos	国債証券	6.7500	17,200	17,281	90,776	2023/03/09
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	3,000	2,747	14,430	2027/03/04
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	30,033	30,663	161,074	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	23,919	25,652	134,752	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	27,968	28,034	147,262	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	10,585	55,606	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,544	31,129	163,522	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	16,894	17,474	91,793	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	23,515	23,660	124,286	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	19,654	18,828	98,904	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,944	7,956	41,797	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄		282,935	286,643	1,505,707	
<b>中国</b>				千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		
	China Government Bond	国債証券	3.7200	3,000	3,163	56,409	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.0200	3,800	3,851	68,676	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,504	80,324	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5700	10,000	10,019	178,641	2023/05/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	5,500	5,517	98,385	2028/10/14
通貨小計	銘柄数 金 額	5銘柄		26,800	27,057	482,437	
<b>マレーシア</b>				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,401	64,488	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,253	33,667	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,595	42,836	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,362	36,593	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	754	20,265	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	1,016	27,294	2023/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,432	38,470	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,920	51,578	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	800	864	23,208	2043/09/30

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,098	29,508	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,803	48,426	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,265	33,984	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,302	1,332	35,781	2023/08/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	979	26,289	2046/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650	672	18,066	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,550	1,608	43,202	2024/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,226	32,945	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,950	2,080	55,856	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,241	33,347	2025/03/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,700	1,734	46,560	2023/04/20
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,284	34,484	2033/11/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	600	644	17,308	2038/06/08
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	672	18,069	2026/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,910	1,957	52,573	2029/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,297	34,830	2048/07/06
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400	407	10,946	2024/06/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,281	34,418	2034/07/05
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,658	44,535	2040/05/22
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	1,650	1,586	42,601	2050/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,300	1,207	32,436	2031/04/15
通貨小計	銘柄数 金 額	30銘柄			38,656	39,646	1,064,579	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,377	4,259	116,980	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	3,050	83,778	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,850	3,851	105,778	2023/01/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,870	2,845	78,148	2024/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840	4,701	129,116	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,400	3,332	91,538	2024/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.7500	2,000	1,853	50,896	2025/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,566	70,493	2030/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	—	1,000	961	26,417	2023/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.2500	1,300	1,126	30,942	2026/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	970	26,642	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,625	2,682	73,668	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,650	3,553	97,597	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,591	4,612	126,693	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄			41,500	40,366	1,108,694	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (アイルランド)		IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,031	1,235	158,692	2025/03/13
		IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	624	661	84,915	2023/03/20
		IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	664	85,337	2024/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	961	1,159	148,937	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	931	1,211	155,512	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,144	146,945	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	653	83,973	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	856	109,992	2028/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	750	838	107,664	2033/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	750	839	107,858	2031/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	950	1,033	132,648	2029/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	700	824	105,832	2050/05/15

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	350	351	45,186	2035/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	822	105,623	2027/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	811	104,176	2030/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	—	800	786	100,959	2031/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	400	398	51,181	2041/04/22
国 小 計	銘柄数	17銘柄						
	金 額				12,877	14,293	1,835,439	
ユーロ (オランダ)					千ユーロ	千ユーロ		
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	548	599	77,044	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,139	1,562	200,633	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,555	2,507	322,002	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	832	106,904	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,729	3,023	388,241	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,509	193,881	2033/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,443	185,388	2023/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,929	3,226	414,283	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,624	208,663	2024/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,850	237,606	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,938	2,038	261,732	2026/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,358	302,836	2027/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,422	182,675	2024/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,457	187,112	2028/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,253	160,990	2029/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	980	125,867	2040/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,431	183,793	2030/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	821	105,480	2027/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,050	1,002	128,710	2052/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,322	169,772	2031/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	892	114,575	2038/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	600	613	78,837	2029/01/15
国 小 計	銘柄数	22銘柄						
	金 額				28,587	33,774	4,337,032	
ユーロ (ベルギー)					千ユーロ	千ユーロ		
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,699	1,786	229,408	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	1,952	250,677	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	1,311	168,357	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,863	1,995	256,184	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	1,506	193,426	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	640	935	120,071	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	940	957	122,930	2023/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,100	1,176	151,113	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,087	139,634	2024/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	580	831	106,772	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	600	696	89,412	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,490	1,603	205,858	2028/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	650	737	94,713	2033/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,630	209,372	2029/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	700	870	111,814	2050/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,244	159,807	2030/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	660	644	82,824	2040/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,228	157,777	2027/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,600	1,594	204,704	2031/10/22

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	680	596	76,655	2071/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,357	302,698	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,904	3,103	398,469	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	2,705	347,415	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,226	157,496	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	1,103	141,758	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,401	180,020	2023/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	843	1,424	182,883	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,634	209,938	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	1,009	129,595	2034/06/22
国 小 計	銘柄数	29銘柄						
	金 額				33,676	40,353	5,181,793	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	1,985	2,243	288,101	2023/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	3,815	489,959	2025/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	4,758	611,022	2029/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,227	5,242	673,220	2032/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	4,263	547,451	2035/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,764	3,453	443,514	2055/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	3,808	489,063	2038/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	4,997	5,478	703,469	2023/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,664	6,425	825,044	2041/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,717	3,534	453,888	2060/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,646	4,298	551,978	2026/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	5,699	6,777	870,339	2027/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,588	4,121	529,197	2045/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,047	4,198	539,137	2023/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	5,086	5,462	701,487	2024/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,087	6,243	801,757	2030/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,899	5,255	674,877	2024/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,627	465,850	2025/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	5,421	696,207	2025/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,420	6,210	797,553	2031/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,787	3,959	508,487	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	4,169	4,724	606,616	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,387	1,838	236,106	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,050	4,196	538,912	2026/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	3,182	408,649	2039/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,668	471,041	2027/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,850	3,790	486,690	2048/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,424	311,339	2023/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,400	4,709	604,712	2028/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	4,454	571,986	2034/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	5,307	681,572	2028/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,456	443,789	2024/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,950	3,556	456,741	2050/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,350	4,586	588,892	2029/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,830	3,909	501,995	2025/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	4,253	546,219	2029/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,424	311,272	2023/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,770	2,769	355,592	2052/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,067	393,859	2026/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	2,203	282,976	2040/05/25	

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
銘柄数 金 額		47銘柄	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	4,024	516,788	2030/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	880	731	93,876	2072/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	13,041	2024/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	985	126,557	2044/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,700	3,684	473,140	2031/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	1,634	209,920	2027/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	700	693	89,060	2053/05/25
国 小 計					152,793	178,981	22,982,963	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (ドイツ)		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,120	143,912	2024/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,646	211,378	2027/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	3,008	386,344	2028/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,293	166,104	2028/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	3,049	391,545	2030/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,448	5,369	689,555	2031/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,305	3,819	490,479	2034/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,571	5,918	759,935	2037/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	2,394	307,518	2039/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,739	3,384	434,580	2040/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,574	4,431	569,108	2042/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	4,525	581,099	2044/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,450	186,220	2023/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,879	241,377	2023/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,677	215,388	2023/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,650	211,915	2024/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	4,435	569,540	2046/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,684	216,368	2024/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,042	4,239	544,336	2024/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,283	293,243	2025/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,134	3,336	428,490	2025/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,368	2,488	319,591	2026/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,497	320,721	2026/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,200	4,393	564,217	2027/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,446	314,171	2027/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,770	3,738	480,064	2048/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	2,028	260,437	2028/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,100	3,267	419,519	2028/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,323	298,378	2029/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,112	399,626	2029/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,250	2,261	290,335	2050/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,815	233,135	2030/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,946	249,971	2035/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,070	265,826	2027/11/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,867	239,805	2030/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,251	160,705	2030/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	931	119,606	2031/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	917	117,819	2036/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,553	199,510	2028/11/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,118	143,566	2050/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,600	2,682	344,469	2031/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	724	93,011	2031/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	12,947	2022/12/15

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,010	129,728	2023/03/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,012	130,042	2023/06/16	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	13,028	2023/09/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	696	89,486	2052/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,730	5,795	744,206	2023/04/14	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,929	247,802	2023/10/13	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,956	251,216	2024/04/05	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,738	223,178	2024/10/18	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,460	315,940	2025/04/11	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,364	303,639	2025/10/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	103	13,226	2025/10/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,266	291,047	2026/04/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,340	172,141	2026/10/09	
国 小 計	銘柄数 金 額	56銘柄		110,312	130,913	16,810,567		
				千ユーロ	千ユーロ			
ユーロ (スペイン)	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	3,792	486,939	2029/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	2,189	281,145	2025/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	2,352	302,131	2030/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,411	309,661	2025/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	3,006	386,053	2026/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	2,715	348,693	2046/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	2,433	312,457	2066/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,630	2,833	363,830	2026/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	2,073	266,317	2027/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,750	2,107	270,600	2033/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	2,237	287,324	2027/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,600	1,617	207,752	2022/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,400	2,617	336,154	2028/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,300	1,763	226,478	2048/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	2,400	2,439	313,272	2023/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,900	3,171	407,315	2028/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,760	226,067	2029/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,850	2,126	273,011	2035/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,346	301,288	2024/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,900	372,398	2029/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,360	1,391	178,706	2030/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,460	2,483	318,892	2023/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,536	325,737	2025/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,321	169,692	2050/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,521	323,845	2027/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,900	3,146	404,094	2030/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,300	1,350	173,378	2040/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	506	65,020	2026/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	2,200	2,148	275,908	2031/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	303	38,988	2024/05/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	650	594	76,295	2071/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	500	64,272	2028/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	900	898	115,415	2037/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,400	1,410	181,064	2031/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	600	600	77,080	2042/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	302	38,827	2027/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,179	3,393	435,771	2032/07/30	

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	2,254	3,384	434,594	2037/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	2,158	3,666	470,871	2040/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	1,881	241,646	2024/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,973	3,321	426,539	2041/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,789	3,311	425,203	2025/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,537	325,845	2026/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	1,958	2,096	269,174	2023/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	2,087	268,044	2023/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,397	307,867	2028/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	2,399	308,119	2044/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,180	280,009	2024/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,300	295,387	2024/10/31
国 小 計	銘柄数	49銘柄						
	金 額				90,321	105,873	13,595,192	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (イタリア)	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	906	1,069	137,360	2023/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,495	192,048	2026/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,248	417,195	2027/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,957	251,402	2024/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	1,968	252,752	2046/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,621	336,690	2025/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	2,198	282,349	2032/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,891	2,040	261,957	2025/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	1,923	246,936	2047/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,359	1,384	177,746	2023/03/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,386	2,543	326,595	2026/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	2,617	336,145	2036/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	1,123	144,280	2026/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	1,550	1,580	203,010	2023/10/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	1,112	142,796	2067/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,719	220,752	2033/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,667	214,095	2027/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,367	175,565	2024/05/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,850	2,506	321,860	2048/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,700	2,959	380,035	2027/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,675	215,137	2024/11/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,597	205,142	2038/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	2,303	295,739	2028/02/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,933	248,343	2023/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,367	175,648	2025/05/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,550	2,947	378,471	2028/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	2,200	2,316	297,452	2023/10/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,702	218,594	2025/11/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,595	204,842	2035/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,650	2,388	306,644	2049/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	2,236	287,224	2029/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,200	2,311	296,830	2024/07/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	2,100	2,289	293,933	2026/07/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	1,250	1,565	201,072	2040/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	1,993	255,994	2030/04/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	740	744	95,648	2023/01/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,300	1,318	169,350	2025/02/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,421	310,949	2027/01/15	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,550	1,764	226,597	2050/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,533	196,954	2036/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,000	2,034	261,211	2023/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,300	2,454	315,172	2025/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	2,025	260,058	2030/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,400	2,567	329,695	2030/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3000	1,300	1,316	169,054	2023/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,200	2,273	291,923	2027/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,729	222,080	2026/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,300	1,346	172,924	2041/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	2,300	2,302	295,685	2031/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,107	142,217	2024/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	1,200	1,167	149,857	2051/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	700	661	84,960	2037/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,874	240,741	2028/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,700	2,619	336,357	2031/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	700	677	86,947	2045/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,093	140,428	2026/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,508	193,680	2024/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	12,906	2022/11/29
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	460	446	57,300	2072/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	798	102,573	2028/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,895	243,369	2031/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,008	257,854	2024/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	502	64,561	2024/01/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,089	139,920	2026/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	3,254	4,421	567,748	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,184	537,331	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,707	347,707	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	3,331	427,771	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	3,734	479,488	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	3,162	406,138	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,448	314,472	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,470	317,174	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	3,523	452,392	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,460	315,934	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,960	2,068	265,624	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	3,089	396,666	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,029	260,607	2023/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	2,880	369,842	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,431	312,186	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,439	313,295	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,318	2,841	364,826	2030/03/01
国 小 計	銘柄数 金 額	81銘柄		142,231	162,937	20,922,845	
ユーロ (フィンランド)				千ユーロ	千ユーロ		
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	364	393	50,570	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	295	37,917	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	850	109,179	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	700	709	91,084	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	455	58,553	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	843	108,361	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	670	757	97,213	2034/04/15

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千ユーロ	千円	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	528	67,823	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	529	67,996	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	203	26,194	2024/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	307	39,438	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	399	51,266	2040/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	500	506	64,988	2030/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	371	47,674	2052/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	610	78,380	2031/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	204	26,301	2026/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	781	100,334	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	470	60,445	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	460	59,108	2023/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	603	77,514	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	564	72,448	2024/04/15
国 小 計	銘柄数 金 額	21銘柄		10,032	10,846	1,392,797	
ユーロ (オーストリア)	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	1,373	1,471	188,907	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,196	153,672	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	988	126,904	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	325	41,782	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	—	900	911	117,017	2023/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,347	172,977	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	894	114,873	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	1,283	164,849	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	980	1,033	132,720	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	800	814	104,592	2024/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	—	980	991	127,339	2030/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,000	1,009	129,692	2023/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	747	96,037	2051/03/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	374	48,070	2040/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.8500	350	328	42,241	2120/06/30
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,200	1,206	154,959	2031/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	480	489	62,891	2025/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	599	76,933	2036/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,144	146,949	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,373	2,201	282,667	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,082	138,967	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	906	116,455	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	723	92,859	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	1,008	129,455	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,005	129,096	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	992	127,477	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	996	127,958	2024/10/21
国 小 計	銘柄数 金 額	27銘柄		22,501	26,075	3,348,351	
通貨小計	銘柄数 金 額	349銘柄		603,330	704,049	90,406,985	
合 計	銘柄数 金 額	846銘柄				230,341,773	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

# 外国債券インデックスマザーファンド

## ■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	230,341,773	98.5
コール・ローン等、その他	3,574,230	1.5
投資信託財産総額	233,916,004	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1シンガポール・ドル=83.21円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シケル=36.011円、1デンマーク・クローネ=17.27円、1ノルウェー・クローネ=12.61円、1スウェーデン・クローネ=12.53円、1メキシコ・ペソ=5.252円、1オフショア・人民元=17.83円、1マレーシア・リンギット=26.851円、1ポーランド・ズロチ=27.465円、1ユーロ=128.41円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(232,057,536千円)の投資信託財産総額(233,916,004千円)に対する比率は、99.2%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項目	当 期 末
(A) 資産	235,621,577,410円
コール・ローン等	2,308,332,577
公社債(評価額)	230,341,773,353
未収入金	1,708,792,363
未収利息	1,240,818,660
前払費用	21,860,457
(B) 負債	1,989,462,808
未払金	1,964,328,808
未払解約金	25,134,000
(C) 純資産総額(A-B)	233,632,114,602
元本	74,475,307,643
次期繰越損益金	159,156,806,959
(D) 受益権総口数	74,475,307,643口
1万口当り基準価額(C/D)	31,370円

\* 期首における元本額は72,688,498,430円、当作成期間中における追加設定元本額は10,294,827,028円、同解約元本額は8,508,017,815円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワ外国債券インデックスVA	498,388,691円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	10,756,510円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	79,498,163円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	22,023,940円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	312,397,465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)	211,430,078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)	505,972,682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)	2,311,980,333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)	842,742,592円
D-1's外国債券インデックス	744,003円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	7,190,607円

iFree 外国債券インデックス	1,686,822,876円
iFree 8資産バランス	1,443,360,479円
iFree 年金バランス	229,923,693円
DCダイワ外国債券インデックス	49,590,694,433円
ダイワ・ライフ・バランス30	964,870,268円
ダイワ・ライフ・バランス50	601,682,079円
ダイワ・ライフ・バランス70	393,993,399円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	578,219,728円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	439,097,748円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	160,496,213円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	28,543,954円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	10,558,255円
ダイワつみたてインデックス外国債券	599,439,774円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,367,466円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,453,811円
ダイワつみたてインデックスバランス70	1,909,053円
ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	317,987円
ダイワ世界バランスファンド40VA	163,610,849円
ダイワ世界バランスファンド60VA	135,308,646円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,912,241,392円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	231,133,046円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	143,219,876円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	43,309,779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)	2,367,106,464円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,825,688,039円
ダイワライフスタイル25	33,014,942円
ダイワライフスタイル50	65,372,616円
ダイワライフスタイル75	17,425,714円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は31,370円です。

## ■損益の状況

当期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日

項目	当 期
(A) 配当等収益	4,032,833,956円
受取利息	4,035,525,127
その他収益金	139,937
支払利息	△ 2,831,108
(B) 有価証券売買損益	5,115,214,393
売買益	14,985,731,779
売買損	△ 9,870,517,386
(C) その他費用	△ 24,346,635
(D) 当期損益金(A+B+C)	9,123,701,714
(E) 前期繰越損益金	146,146,957,181
(F) 解約差損益金	△ 17,570,758,729
(G) 追加信託差損益金	21,456,906,793
(H) 合計(D+E+F+G)	159,156,806,959
次期繰越損益金(H)	159,156,806,959

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

# ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第11期（決算日 2021年7月5日）

（作成対象期間 2020年7月7日～2021年7月5日）

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ない ます。
主要投資対象	新興国通貨建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

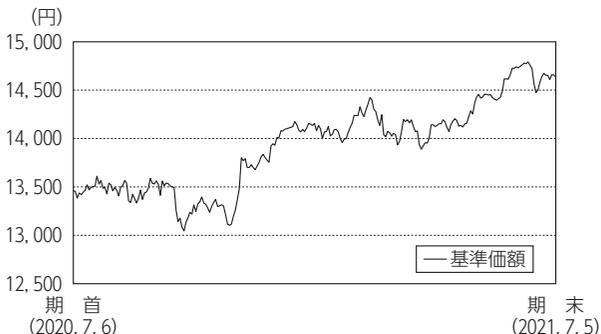
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



【運用経過】

【基準価額・騰落率】

期首：13,460円 期末：14,635円 騰落率：8.7%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券からの利息収入や、多くの投資対象国通貨の対円為替レートが上昇（円安）したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

◆ 投資環境について

○ 新興国債券市況

新興国債券価格は、多くの国で下落（金利は上昇）しました。

新興国債券価格は、当作成期首より2020年10月にかけて、緩和的な金融環境を背景に横ばい圏で推移しました。11月には、新型コロナウイルスのワクチン開発で進展があったことにより、新興国債券価格は上昇しました。2021年2月以降は、米国債が金利上昇したことに連動して新興国の金利も上昇し、債券価格は下落しました。個別国では、感染者数および死者数が新興国最多で財政悪化が懸念され、また2022年の大統領選挙の見通しに不透明感が高まったブラジルや、エルドアン大統領による中央銀行人事への介入で中央銀行の独立性が懸念されたトルコなどの債券価格が大きく下落しました。

○ 為替相場

新興国為替市場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

新興国通貨は、当作成期首より、緩和的な金融環境を背景に堅調に推移しました。2020年11月には、新型コロナウイルスのワクチン開発で進展があったことにより、一段と上昇しました。2021年2月以降は、ウイルスの変異種の感染拡大や米国金利上昇に伴う新興国からの資金流出への懸念で、上昇幅を縮小させる局面もありました。米ドル円相場が円安米ドル高方向に進行したことで、多くの新興国通貨は対円で上昇しました。個別国では、いち早く景気回復局面に入り、また株式や債券の国際的なインデックス入りに伴う資金流入が期待された中国・人民元、米国の大型財政出動や景気回復の恩恵を強く受けたと期待されたメキシコ・ペソ、財政再建の進展が期待された南アフリカ・ランドなどが大きく上昇しました。

◆ 前作成期における「今後の運用方針」

今後も、新興国通貨建ての債券に投資し、ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

◆ ポートフォリオについて

新興国通貨建ての債券に投資し、ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

◆ ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は9.0%となりました。一方、ファンドの基準価額の騰落率は8.7%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、税金、売買に伴う費用などが主な要因です。

\* ベンチマークはJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼン・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）です。

【今後の運用方針】

今後も、新興国通貨建ての債券に投資し、ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

年 月 日	基準 価 額		騰落率		JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼン・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) (ベンチマーク)	騰落率	公社債 組 入 率 比
	円	%	円	%			
(期首) 2020年7月6日	13,460	—	14,417	—	14,417	—	95.5
7月末	13,428	△ 0.2	14,349	△ 0.5	14,349	△ 0.5	95.0
8月末	13,448	△ 0.1	14,390	△ 0.2	14,390	△ 0.2	95.5
9月末	13,133	△ 2.4	14,080	△ 2.3	14,080	△ 2.3	95.9
10月末	13,103	△ 2.7	14,062	△ 2.5	14,062	△ 2.5	96.1
11月末	13,777	2.4	14,777	2.5	14,777	2.5	96.4
12月末	14,148	5.1	15,170	5.2	15,170	5.2	96.0
2021年1月末	14,062	4.5	15,108	4.8	15,108	4.8	96.0
2月末	14,039	4.3	15,158	5.1	15,158	5.1	96.4
3月末	14,005	4.0	15,054	4.4	15,054	4.4	96.6
4月末	14,287	6.1	15,347	6.4	15,347	6.4	96.2
5月末	14,617	8.6	15,731	9.1	15,731	9.1	96.3
6月末	14,609	8.5	15,710	9.0	15,710	9.0	96.6
(期末) 2021年7月5日	14,635	8.7	15,713	9.0	15,713	9.0	97.1

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼン・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) は、JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼン・マーケット グローバル ダイバーシファイド (米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大アセットマネジメントが計算したものです。JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼン・マーケット グローバル ダイバーシファイド (米ドルベース) 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.

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 公社債組入率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	13 ( 12)
(その他)	( 1)
合 計	13

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

		買 付 額	売 付 額
外	トルコ	千トルコ・リラ 7,490	千トルコ・リラ ( 3,507 —)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 73,031	千メキシコ・ペソ ( 20,003 —)
	チリ	千チリ・ペソ 687,215	千チリ・ペソ ( 57,691 —)
国	コロンビア	千コロンビア・ペソ 6,549,900	千コロンビア・ペソ ( 2,892,000 —)
	インドネシア	千インドネシア・ルピア 62,416,644	千インドネシア・ルピア ( 3,465,000 —)
	ブラジル	千ブラジル・リアル 29,279	千ブラジル・リアル ( 15,421 —)

■ 主要な売買銘柄

公 社 債

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

買 付		当 期	売 付	
銘 柄	金 額		銘 柄	金 額
		千円		
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	309,188	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2022/1/1	134,458	
China Government Bond (中国) 2.36% 2023/7/2	176,741	Thailand Government Bond (タイ) 3.65% 2021/12/17	108,962	
China Government Bond (中国) 2.68% 2030/5/21	143,302	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	98,282	
Mexican Bonos (メキシコ) 6.75% 2023/3/9	123,869	China Government Bond (中国) 2.36% 2023/7/2	85,852	
Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 6.5% 2031/2/15	122,145	Russian Federal Bond - OFZ (ロシア) 7% 2021/12/15	70,878	
China Government Bond (中国) 3.27% 2030/11/19	121,040	Mexican Bonos (メキシコ) 7.25% 2021/12/9	53,367	
Poland Government Bond (ポーランド) 0.75% 2025/4/25	115,880	Poland Government Bond (ポーランド) 5.75% 2021/10/25	50,962	
China Government Bond (中国) 3.02% 2025/10/22	110,931	China Government Bond (中国) 2.68% 2030/5/21	48,410	
Poland Government Bond (ポーランド) 1.25% 2030/10/25	109,534	Poland Government Bond (ポーランド) 2.75% 2028/4/25	48,104	
China Government Bond (中国) 2.85% 2027/6/4	107,997	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	45,491	

(注1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

		買 付 額	売 付 額
外	チェコ	千チェコ・コルナ 29,444	千チェコ・コルナ ( 15,794 —)
	ルーマニア	千ルーマニア・レイ 4,869	千ルーマニア・レイ ( 1,012 —)
	中国	千オフショア・人民元 89,993	千オフショア・人民元 ( 9,471 —)
	ロシア	千ロシア・ルーブル 298,895	千ロシア・ルーブル ( 104,221 —)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 21,127	千マレーシア・リンギット ( 2,197 —)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 30,142	千南アフリカ・ランド ( 5,607 —)
国	タイ	千タイ・バーツ 166,995	千タイ・バーツ ( 38,130 —)
	ペルー	千ペルー・ソル 764	千ペルー・ソル ( 926 —)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 20,869	千ポーランド・ズロチ ( 3,613 —)
	ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 789,018	千ハンガリー・フォリント ( 90,602 —)
	ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 6,996	千ウルグアイ・ペソ ( 5,464 —)

(注1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

作成期 区分	当 期			末		残存期間別組入比率		
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	5年以上	2年以上	2年未満
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額					
トルコ	千トルコ・リラ 33,510	千トルコ・リラ 27,790	千円 356,260	1.7 %	1.7 %	0.5 %	0.5 %	0.6 %
メキシコ	千メキシコ・ペソ 324,900	千メキシコ・ペソ 341,228	1,915,315	9.0	—	4.5	3.1	1.4
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 11,966	27,025	0.1	—	0.1	—	—
チリ	千チリ・ペソ 2,790,000	千チリ・ペソ 2,834,115	428,297	2.0	—	1.0	0.8	0.2
コロンビア	千コロンビア・ペソ 31,630,000	千コロンビア・ペソ 31,986,957	948,573	4.5	—	3.1	0.9	0.5
インドネシア	千インドネシア・ルピア 244,089,000	千インドネシア・ルピア 260,230,570	2,003,775	9.4	—	6.6	2.0	0.8
ブラジル	千ブラジル・レアル 85,150	千ブラジル・レアル 79,736	1,751,898	8.2	—	1.8	3.6	2.8
チェコ	千チェコ・コルナ 163,800	千チェコ・コルナ 165,613	853,073	4.0	—	2.5	1.3	0.2
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 20,170	千ルーマニア・レイ 21,520	574,354	2.7	—	1.0	1.0	0.7
中国	千オフショア・人民元 121,450	千オフショア・人民元 121,621	2,088,833	9.8	—	5.3	4.1	0.5
ロシア	千ロシア・ルーブル 1,019,330	千ロシア・ルーブル 1,025,580	1,548,626	7.3	—	4.6	1.9	0.7
マレーシア	千マレーシア・リンギット 57,030	千マレーシア・リンギット 59,115	1,581,530	7.4	—	4.5	2.1	0.8
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 233,090	千南アフリカ・ランド 211,551	1,647,990	7.7	—	7.3	—	0.4
タイ	千タイ・バーツ 487,060	千タイ・バーツ 524,481	1,814,706	8.5	—	5.2	2.2	1.1
ペルー	千ペルー・ソル 15,050	千ペルー・ソル 16,037	456,833	2.1	—	2.0	0.1	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 58,370	千ポーランド・ズロチ 61,151	1,786,658	8.4	—	3.9	2.8	1.6
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 2,152,800	千ハンガリー・フォリント 2,237,781	838,465	3.9	—	2.0	1.5	0.5
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 9,800	千ウルグアイ・ペソ 10,088	25,669	0.1	—	0.1	—	—
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 12,443	24,280	0.1	0.1	—	0.1	—
合計	—	—	20,672,166	97.1	1.8	56.1	28.1	12.8

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入力しています。

(2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分		銘 柄	種 類	当 期		末		償還年月日
				年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千トルコ・リラ	千トルコ・リラ	千円		
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	790	714	9,157	2022/09/14	
	Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	2,780	2,367	30,350	2023/03/08	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	579	7,428	2024/03/20	
	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	1,630	1,313	16,840	2024/07/24	
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	2,690	2,012	25,800	2025/03/12	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	2,570	2,014	25,820	2026/02/11	
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,400	2,299	29,483	2022/03/02	
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,291	29,373	2027/02/24	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	1,900	1,766	22,639	2022/08/17	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	2,500	1,862	23,876	2027/08/11	
	Turkey Government Bond	国債証券	12.2000	1,400	1,301	16,686	2023/01/18	
	Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	2,000	1,638	21,001	2028/03/08	
	Turkey Government Bond	国債証券	16.2000	1,400	1,366	17,518	2023/06/14	
	Turkey Government Bond	国債証券	12.6000	3,500	2,989	38,328	2025/10/01	
	Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	4,300	3,272	41,954	2030/11/13	
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		33,510	27,790	356,260		
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	34,400	33,456	187,788	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	20,500	21,529	120,847	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	26,000	27,356	153,551	2024/09/05	
	Mexican Bonos	国債証券	6.7500	23,000	23,427	131,497	2023/03/09	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,250	28,553	160,271	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	26,550	29,628	166,306	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	30,230	31,418	176,354	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	9,257	51,963	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	27,730	30,354	170,380	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	20,400	22,403	125,753	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,450	23,581	132,365	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	28,450	28,719	161,202	2022/06/09	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	20,120	20,587	115,560	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,430	10,951	61,472	2034/11/23	
	通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄		324,900	341,228	1,915,315	
フィリピン	Philippine Government International Bond	国債証券	6.2500	10,000	11,966	27,025	2036/01/14	
通貨小計	銘柄数 金 額	1銘柄		10,000	11,966	27,025		
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	500,000	516,710	78,086	2026/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	570,000	571,305	86,336	2035/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	410,000	451,594	68,245	2043/01/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	410,000	407,330	61,556	2030/09/01	

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.0000	千チリ・ペソ 250,000	千チリ・ペソ 257,000	千円 38,838	2023/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	650,000	630,175	95,233	2025/03/01
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄			2,790,000	2,834,115	428,297	
					千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ		
コロンビア		Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	90,000	106,914	3,170	2027/06/28
		Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	46,078	1,366	2023/03/21
		Colombian TES	国債証券	7.0000	3,635,000	3,754,773	111,347	2022/05/04
		Colombian TES	国債証券	10.0000	3,050,000	3,480,904	103,226	2024/07/24
		Colombian TES	国債証券	6.0000	4,290,000	4,131,827	122,529	2028/04/28
		Colombian TES	国債証券	7.5000	3,710,000	3,927,702	116,476	2026/08/26
		Colombian TES	国債証券	7.7500	2,700,000	2,821,311	83,665	2030/09/18
		Colombian TES	国債証券	7.0000	3,000,000	2,946,090	87,366	2032/06/30
		Colombian TES	国債証券	6.2500	2,700,000	2,746,386	81,444	2025/11/26
		Colombian TES	国債証券	7.2500	3,400,000	3,371,270	99,975	2034/10/18
		Colombian TES	国債証券	5.7500	2,400,000	2,306,040	68,385	2027/11/03
		Colombian TES	国債証券	7.2500	1,410,000	1,294,323	38,383	2050/10/26
		Colombian TES	国債証券	6.2500	1,200,000	1,053,336	31,236	2036/07/09
通貨小計	銘柄数 金 額	13銘柄			31,630,000	31,986,957	948,573	
					千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア		
インドネシア		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	8,250,000	9,070,050	69,839	2036/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	6,000,000	6,906,360	53,178	2031/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	5,791,940	44,597	2032/08/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,486,734	57,647	2038/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	10,917,500	84,064	2024/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	7,200,000	7,973,424	61,395	2039/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	12,000,000	13,383,720	103,054	2029/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	14,300,000	14,802,073	113,975	2030/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	16,000,000	16,792,160	129,299	2025/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	9,300,000	9,618,246	74,060	2035/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	10,000,000	10,241,900	78,862	2040/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	9,200,000	9,239,284	71,142	2026/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	15,800,000	15,727,636	121,102	2031/02/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	2,300,000	2,267,064	17,456	2036/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	3,600,000	4,337,496	33,398	2025/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	2,180,000	2,756,174	21,222	2030/08/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,561,000	27,419	2031/07/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,824,000	14,441,234	111,197	2026/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,278,627	40,645	2032/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	10,330,000	10,953,518	84,342	2027/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	11,060,000	11,397,661	87,761	2022/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	10,910,000	11,163,766	85,961	2023/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	11,450,000	11,454,236	88,197	2028/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	7,075,000	7,055,968	54,330	2033/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,520,000	13,825,961	106,459	2034/03/15

区 分		当 期				末		
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
					千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円	
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	13,150,000	14,375,185	110,688	2024/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	8,120,000	9,411,648	72,469	2029/03/15
通貨小計	銘柄数	27銘柄						
	金 額				244,089,000	260,230,570	2,003,775	
					千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル		
ブラジル		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,210	10,590	232,688	2023/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,690	11,250	247,193	2025/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	9,150	9,660	212,242	2027/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	5,300	5,608	123,221	2029/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	2,400	2,521	55,404	2031/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	6,100	5,721	125,705	2022/07/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	12,700	10,957	240,739	2023/07/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	23,200	19,157	420,911	2024/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	5,400	4,268	93,792	2024/07/01
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金 額				85,150	79,736	1,751,898	
					千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ		
チェコ		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	15,600	16,388	84,415	2028/08/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	8,600	9,670	49,813	2024/05/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	8,700	9,143	47,099	2022/09/12
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	16,100	16,614	85,580	2025/09/17
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	17,900	17,356	89,405	2026/06/26
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	16,000	14,903	76,768	2030/05/15
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	9,900	9,723	50,085	2023/10/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	15,500	14,331	73,820	2027/02/10
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	12,000	12,883	66,365	2029/07/23
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	17,000	17,306	89,143	2033/10/13
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	13,000	12,302	63,372	2031/03/13
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	6,000	5,198	26,775	2029/11/29
		Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	7,500	9,789	50,427	2036/12/04
通貨小計	銘柄数	13銘柄						
	金 額				163,800	165,613	853,073	
					千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ		
ルーマニア		Romania Government Bond	国債証券	5.8500	1,430	1,521	40,607	2023/04/26
		Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,237	33,017	2025/02/24
		Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,100	2,452	65,462	2027/07/26
		Romania Government Bond	国債証券	3.5000	1,090	1,111	29,661	2022/12/19
		Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,600	1,636	43,687	2024/04/29
		Romania Government Bond	国債証券	3.4000	1,700	1,716	45,815	2022/03/08
		Romania Government Bond	国債証券	4.2500	1,500	1,557	41,573	2023/06/28
		Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,918	77,892	2029/02/12
		Romania Government Bond	国債証券	4.8500	1,600	1,750	46,715	2026/04/22
		Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,400	1,423	37,995	2031/09/24
		Romania Government Bond	国債証券	4.5000	900	952	25,424	2024/06/17
		Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,500	1,564	41,754	2025/07/28
		Romania Government Bond	国債証券	4.1500	800	856	22,857	2028/01/26

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		Romania Government Bond	国債証券	3.2500	千ルーマニア・レイ 800	千ルーマニア・レイ 820	千円 21,887	2026/06/24
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄			20,170	21,520	574,354	
					千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		
中国		China Government Bond	国債証券	3.2900	3,900	3,958	67,983	2023/10/18
		China Government Bond	国債証券	3.2200	5,700	5,776	99,215	2025/12/06
		China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,853	83,356	2028/11/22
		China Government Bond	国債証券	3.1900	6,700	6,782	116,487	2024/04/11
		China Government Bond	国債証券	3.2900	8,200	8,309	142,714	2029/05/23
		China Government Bond	国債証券	3.2500	6,800	6,900	118,508	2026/06/06
		China Government Bond	国債証券	3.1200	7,000	7,051	121,109	2026/12/05
		China Government Bond	国債証券	3.1300	7,000	6,996	120,155	2029/11/21
		China Government Bond	国債証券	2.9400	4,500	4,519	77,615	2024/10/17
		China Government Bond	国債証券	2.8500	8,600	8,512	146,206	2027/06/04
		China Government Bond	国債証券	2.6800	9,400	9,051	155,459	2030/05/21
		China Government Bond	国債証券	1.9900	8,000	7,738	132,913	2025/04/09
		China Government Bond	国債証券	2.3600	6,150	6,110	104,945	2023/07/02
		China Government Bond	国債証券	2.8800	4,900	4,919	84,486	2023/11/05
		China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,028	120,716	2025/10/22
		China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,071	87,099	2027/12/03
		China Government Bond	国債証券	3.2700	7,300	7,394	127,006	2030/11/19
		China Government Bond	国債証券	3.0300	1,700	1,707	29,334	2026/03/11
		China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	5,931	101,869	2050/09/14
		China Government Bond	国債証券	2.8400	1,000	1,002	17,215	2024/04/08
		China Government Bond	国債証券	3.0100	1,000	995	17,094	2028/05/13
		China Government Bond	国債証券	3.7200	1,000	1,009	17,340	2051/04/12
通貨小計	銘柄数 金 額	22銘柄			121,450	121,621	2,088,833	
					千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル		
ロシア		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	46,760	49,399	74,592	2027/02/03
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	32,910	33,371	50,391	2022/07/20
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	14,400	14,453	21,824	2023/01/25
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	46,160	46,513	70,234	2028/01/19
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	33,800	33,977	51,305	2023/08/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	31,000	34,234	51,693	2031/09/17
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	51,600	53,618	80,963	2026/09/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	51,000	51,669	78,020	2022/12/07
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	46,100	48,232	72,830	2033/03/23
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	48,600	49,001	73,992	2024/10/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	38,000	37,718	56,955	2024/02/28
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.2500	45,000	45,598	68,853	2034/05/10
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.9000	51,000	50,885	76,836	2029/05/23
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.9500	51,000	53,381	80,606	2026/10/07
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	55,000	55,784	84,235	2024/07/17
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1500	59,000	59,551	89,922	2025/11/12
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6500	65,000	67,699	102,226	2030/04/10
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	38,000	40,211	60,718	2039/03/16

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル	千円	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.0000	58,000	55,369	83,608	2027/10/06
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	4.5000	39,000	35,787	54,038	2025/07/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.1000	53,000	48,373	73,044	2035/07/18
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	5.7000	65,000	60,749	91,730	2028/05/17
通貨小計	銘柄数 金 額	22銘柄			1,019,330	1,025,580	1,548,626	
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.9480	3,400	3,457	92,510	2022/04/14
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,930	51,657	2027/07/26
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0940	2,000	2,098	56,142	2023/11/30
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	1,700	1,836	49,128	2028/10/31
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	1,600	1,703	45,566	2029/07/09
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.6550	1,700	1,774	47,471	2024/10/15
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	2,200	2,310	61,816	2026/03/31
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	2,500	2,532	67,755	2030/10/15
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4220	2,200	2,261	60,493	2027/09/30
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4470	900	849	22,714	2036/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	1,750	1,809	48,412	2027/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	2,350	2,463	65,899	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,835	49,094	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	2,950	3,114	83,320	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,800	1,886	50,471	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,400	1,451	38,843	2023/08/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	2,000	2,132	57,044	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	1,200	1,208	32,340	2021/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	3,020	3,183	85,170	2024/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	2,520	2,662	71,222	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	2,600	2,816	75,344	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,445	38,664	2023/04/20
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	2,000	2,117	56,648	2026/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,150	2,266	60,648	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	1,100	1,139	30,476	2024/06/14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	2,350	2,350	62,869	2034/07/05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,800	1,698	45,451	2040/05/22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	1,900	1,832	49,025	2050/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,000	946	25,322	2031/04/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	29銘柄			57,030	59,115	1,581,530	
					千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
南アフリカ		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	34,550	39,114	304,698	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	11,220	7,951	61,938	2036/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	12,580	8,450	65,830	2041/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	12,440	10,643	82,914	2031/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	11,380	11,811	92,010	2023/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	31,520	26,664	207,712	2048/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	20,900	17,941	139,765	2037/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	26,900	25,449	198,254	2030/01/31

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分		当 期				末		
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	17,600	14,911	116,159	2044/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	19,600	17,845	139,014	2032/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	20,600	18,654	145,320	2035/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	13,800	12,114	94,371	2040/01/31
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄			233,090	211,551	1,647,990	
タイ					千タイ・パーツ	千タイ・パーツ		
		Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	30,050	37,447	129,566	2029/06/22
		Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	23,300	24,707	85,486	2023/06/16
		Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	26,610	30,235	104,615	2025/12/12
		Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	22,700	26,734	92,500	2031/06/20
		Thailand Government Bond	国債証券	1.8750	17,200	17,432	60,316	2022/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	23,600	26,977	93,340	2036/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	29,400	31,300	108,298	2026/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	24,000	24,530	84,876	2022/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	32,500	38,725	133,988	2032/06/25
		Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	24,900	26,233	90,766	2046/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.4000	24,500	25,611	88,614	2023/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	26,500	29,363	101,598	2028/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	31,500	35,587	123,131	2038/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1.4500	30,000	30,844	106,721	2024/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	27,500	27,615	95,548	2029/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	15,500	14,550	50,344	2035/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	0.9500	28,000	28,310	97,954	2025/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	0.7500	20,900	21,005	72,679	2024/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1.5850	12,400	11,536	39,915	2035/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	9,000	9,215	31,887	2031/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	7,000	6,518	22,554	2042/06/17
通貨小計	銘柄数 金 額	21銘柄			487,060	524,481	1,814,706	
ペルー					千ペルー・ソル	千ペルー・ソル		
		Peru Government Bond	国債証券	5.7000	730	811	23,105	2024/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.3500	1,970	2,191	62,418	2028/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.1500	1,850	1,919	54,670	2032/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	5.9400	1,900	2,066	58,854	2029/02/12
		Peru Government Bond	国債証券	5.4000	2,050	1,925	54,841	2034/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	5.3500	1,000	877	24,999	2040/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	8.2000	1,565	1,937	55,203	2026/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.9000	2,065	2,172	61,899	2037/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.9500	1,920	2,135	60,839	2031/08/12
通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄			15,050	16,037	456,833	
ポーランド					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	3,610	3,858	112,726	2022/09/23
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,990	6,350	185,551	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,140	4,398	128,511	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,200	3,261	95,279	2022/04/25

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ポーランド・ズロチ	千円	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,500	4,658	136,096	2023/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,500	5,784	169,008	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	6,450	7,025	205,258	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,100	3,248	94,921	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,978	116,250	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,900	3,757	109,780	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	2,400	2,274	66,439	2026/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	3,530	3,818	111,572	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,500	4,873	142,395	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	3,550	3,863	112,866	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金 額			58,370	61,151	1,786,658	
ハンガリー	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	98,500	102,454	38,388	2024/06/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	170,000	177,242	66,410	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.7500	140,000	141,610	53,059	2022/10/26
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000	134,329	50,331	2026/12/22
	Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	88,000	113,546	42,544	2028/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	145,000	150,913	56,545	2030/08/21
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	160,000	164,003	61,449	2024/10/24
	Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	202,000	213,354	79,940	2031/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	40,000	40,205	15,064	2023/08/23
	Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	130,000	124,800	46,760	2025/11/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	75,000	73,125	27,398	2038/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	95,000	92,569	34,684	2026/04/22
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	80,000	77,824	29,159	2029/05/23
	Hungary Government Bond	国債証券	2.2500	100,000	94,008	35,223	2033/04/20
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	100,000	97,222	36,427	2026/08/26
	Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	131,800	146,192	54,776	2023/11/24
Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	125,000	132,406	49,610	2022/06/24	
Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	142,500	161,975	60,689	2025/06/24	
通貨小計	銘柄数	18銘柄					
	金 額			2,152,800	2,237,781	838,465	
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	2,800	2,923	7,438	2028/03/15
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.2500	7,000	7,165	18,230	2031/05/21
通貨小計	銘柄数	2銘柄					
	金 額			9,800	10,088	25,669	
ドミニカ共和国	Dominican Republic International Bond	国債証券	9.7500	11,000	12,443	24,280	2026/06/05
通貨小計	銘柄数	1銘柄					
	金 額			11,000	12,443	24,280	
合 計	銘柄数	262銘柄					
	金 額					20,672,166	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	20,672,166	95.5
コール・ローン等、その他	983,961	4.5
投資信託財産総額	21,656,127	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=111.16円、1トルコ・リラ=12.819円、1メキシコ・ペソ=5.613円、1フィリピン・ペソ=2.258円、1アルゼンチン・ペソ=1.16円、100チリ・ペソ=15.112円、100コロンビア・ペソ=2.965円、100インドネシア・ルピア=0.77円、1ブラジル・レアル=21.971円、1チエコ・コルナ=5.151円、1ルーマニア・レイ=26.689円、1オフショア・人民元=17.174円、1ロシア・ルーブル=1.51円、1マレーシア・リンギット=26.753円、1南アフリカ・ランド=7.79円、1タイ・バーツ=3.46円、1ペルー・ソル=28.486円、1ポーランド・ズロチ=29.216円、100ハンガリー・フォリント=37.468円、1ウルグアイ・ペソ=2.544円、1ドミニカ・ペソ=1.951円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(20,973,875千円)の投資信託財産総額(21,656,127千円)に対する比率は、96.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年7月5日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>22,222,755,636円</b>
コール・ローン等	674,373,087
公社債(評価額)	20,672,166,113
未収入金	604,557,331
未収利息	255,476,931
前払費用	16,182,174
<b>(B) 負債</b>	<b>923,205,227</b>
未払金	919,638,550
未払解約金	3,560,737
その他未払費用	5,940
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>21,299,550,409</b>
元本	14,553,919,275
次期繰越損益金	6,745,631,134
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>14,553,919,275口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	14,635円

\* 期首における元本額は11,831,677,635円、当作成期間中における追加設定元本額は3,356,035,460円、同解約元本額は633,793,820円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、新興国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)139,125,730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)264,519,469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)431,390,249円、D-1's 新興国債券インデックス54,698,190円、i F r e e 新興国債券インデックス3,803,181,162円、i F r e e 8資産バランス2,737,955,446円、D Cダイワ新興国債券インデックスファンド6,926,685,621円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券162,851,958円、ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド33,511,450円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,635円です。

■損益の状況

当期 自 2020年7月7日 至 2021年7月5日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>967,591,713円</b>
受取利息	967,675,396
支払利息	△ 83,683
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>617,999,402</b>
売買益	1,665,193,821
売買損	△ 1,047,194,419
<b>(C) その他費用</b>	<b>△ 16,880,636</b>
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>1,568,710,479</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>4,093,541,775</b>
<b>(F) 解約差損益金</b>	<b>△ 253,784,839</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>1,337,163,719</b>
<b>(H) 合計(D+E+F+G)</b>	<b>6,745,631,134</b>
次期繰越損益金(H)	6,745,631,134

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

# ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス

## 運用報告書（全体版） 第5期

（決算日 2021年11月30日）

（作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日）

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の金融商品取引所上場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）に連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

### 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先（コールセンター）  
TEL 0120-106212  
(営業日の9:00～17:00)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／不動産投信（リート）／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果を東証REIT指数（配当込み）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	ベビーファンド	ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券
	ダイワJ-REITマザーファンド	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
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	
分配方針	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、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			東証REIT指数(配当込み)		投資信託証券 組入比率	不 動 産 投 信 指 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 中 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2017年11月30日)	9,372	0	△ 6.3	3,189.89	△ 6.1	98.0	1.6	564
2 期末 (2018年11月30日)	10,585	0	12.9	3,610.49	13.2	98.2	1.5	1,027
3 期末 (2019年12月 2 日)	13,333	0	26.0	4,562.74	26.4	98.1	1.8	1,183
4 期末 (2020年11月30日)	10,596	0	△20.5	3,635.82	△20.3	97.5	2.4	1,177
5 期末 (2021年11月30日)	12,998	0	22.7	4,470.13	22.9	97.4	2.5	1,679

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

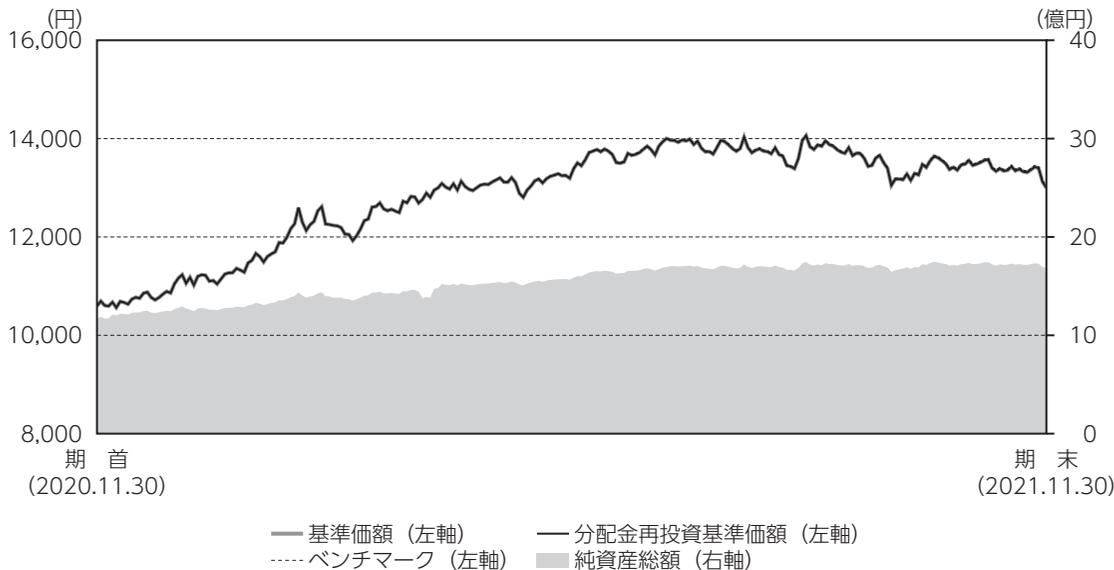
(注3) 投資信託証券および不動産投信指数先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注4) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- \*分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- \*分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- \*ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。

### ■基準価額・騰落率

期首：10,596円

期末：12,998円（分配金0円）

騰落率：22.7%（分配金込み）

### ■基準価額の主な変動要因

ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、新型コロナウイルスのワクチン接種が開始したことによる経済活動正常化への期待感などを背景に、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス

年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数(配当込み) (ベンチマーク)		投資信託証券 組入比率	不動産投信指数 先物比率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2020年11月30日	円 10,596	% -	3,635.82	% -	% 97.5	% 2.4
12月末	11,232	6.0	3,854.76	6.0	97.6	2.4
2021年 1 月末	11,665	10.1	4,004.00	10.1	97.6	2.4
2 月末	12,263	15.7	4,207.24	15.7	97.6	2.4
3 月末	12,814	20.9	4,399.26	21.0	97.5	2.4
4 月末	13,159	24.2	4,518.99	24.3	97.5	2.4
5 月末	13,249	25.0	4,551.00	25.2	97.5	2.4
6 月末	13,774	30.0	4,732.24	30.2	97.5	2.4
7 月末	13,873	30.9	4,767.40	31.1	96.3	2.4
8 月末	13,835	30.6	4,755.00	30.8	97.1	2.5
9 月末	13,398	26.4	4,605.71	26.7	97.0	2.5
10月末	13,555	27.9	4,660.54	28.2	97.5	2.5
(期末) 2021年11月30日	12,998	22.7	4,470.13	22.9	97.4	2.5

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■国内リート市況

国内リート市況は上昇しました。

国内リート市況は、当作成期首より、F T S Eグローバル株式指数による国内リートの組入比率引き上げや、新型コロナウイルスのワクチン接種が開始したことによる経済活動正常化への期待感などを背景に、国内リート市場は上昇しました。2021年8月に入ると、公募増資の発表が相次ぎ、株式需給の悪化懸念から下落に転じ、やや軟調に推移しました。9月下旬以降は、国内外で長期金利が上昇したことや中国大手不動産会社の資金繰り懸念などから投資家のリスク回避姿勢が強まり、下落が続きました。その後は、割安感から買いが入り上昇に転じましたが、11月に南アフリカにおいて新型コロナウイルスの新しい変異株であるオミクロン株が確認されたことが懸念され、当作成期末にかけて下落しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

### ■ダイワJ-REITマザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

## ポートフォリオについて

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■当ファンド

国内リートへの投資は、「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券を組み入れることにより行いました。

### ■ダイワJ-REITマザーファンド

ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）については、当作成期を通じて99～100%程度としました。

\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

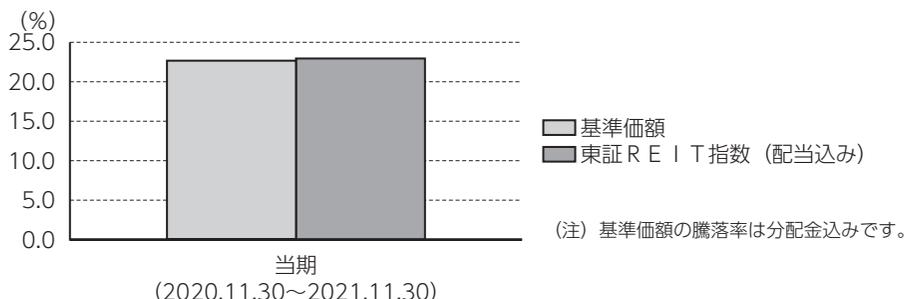
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワJ-REITマザーファンド	東証REIT指数（配当込み）

## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は22.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は22.7%となりました。

ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との違い、先物取引の影響、運用管理費用、売買等のコストが控除されたことが差異の要因となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\*ベンチマークは東証REIT指数 (配当込み) です。

## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### 分配原資の内訳 (1万口当り)

項目	当 期 2020年12月1日 ～2021年11月30日
当期分配金 (税込み) (円)	—
対基準価額比率 (%)	—
当期の収益 (円)	—
当期の収益以外 (円)	—
翌期繰越分配対象額 (円)	4,061

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売却等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金 (税込み) に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金 (税込み) の期末基準価額 (分配金込み) に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

### ■ダイワJ-REITマザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2020.12.1~2021.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	30円	0.231%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12,862円です。
(投 信 会 社)	(20)	(0.154)	投信会社分は、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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(7)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	31	0.238	

(注1) 当作成期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

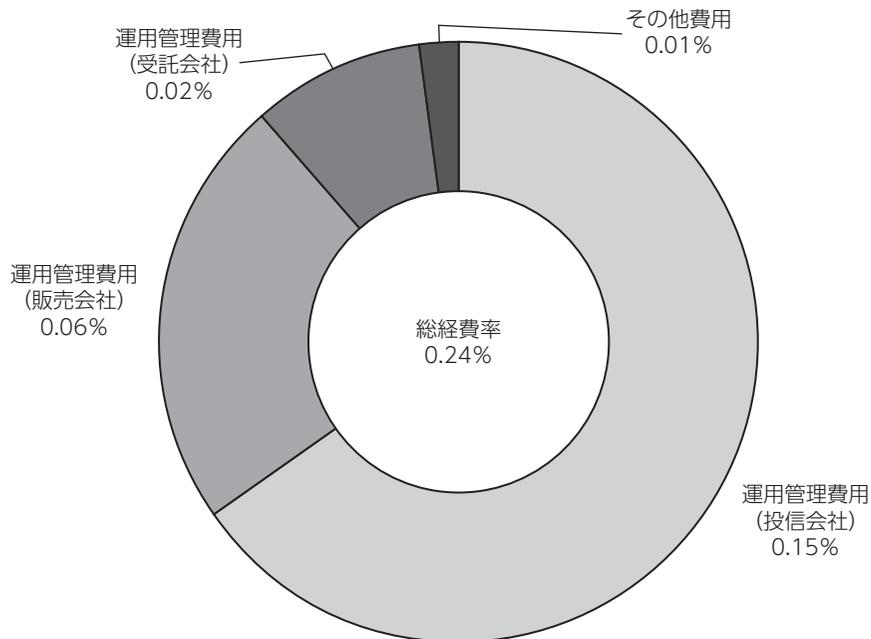
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.24%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワJ-REIT マザーファンド	134,144	433,730	64,241	202,270

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
投資信託証券	百万円 86,066	百万円 2,587	% 3.0	百万円 72,955	百万円 402	% 0.6
不動産投信指数 先物取引	54,407	-	-	54,236	-	-
コール・ローン	2,173,615	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合0.3%

\*平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

種 類	当 期		
	ダイワJ-REITマザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
投資信託証券	百万円 2,541	百万円 2,030	百万円 12,932

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

種 類	当 期
	ダイワJ-REITマザーファンド 買 付 額
投資信託証券	百万円 1,132

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期中における売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払いはありません。

\*利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、大和証券オフィス投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、大和証券リビング投資法人です。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
ダイワJ-REITマザーファンド	千口 436,537	千口 506,440	千円 1,678,496

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ダイワJ-REITマザーファンド	千円 1,678,496	% 99.8
コール・ローン等、その他	3,401	0.2
投資信託財産総額	1,681,897	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,681,897,788円
コール・ローン等	3,401,115
ダイワJ-REITマザーファンド(評価額)	1,678,496,673
(B) 負債	2,552,983
未払解約金	545,692
未払信託報酬	1,960,707
その他未払費用	46,584
(C) 純資産総額(A - B)	1,679,344,805
元本	1,291,974,799
次期繰越損益金	387,370,006
(D) 受益権総口数	1,291,974,799口
1万口当り基準価額(C / D)	12,998円

\*期首における元本額は1,110,904,033円、当作成期間中における追加設定元本額は469,805,021円、同解約元本額は288,734,255円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は12,998円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月1日 至2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 715円
受取利息	32
支払利息	△ 747
(B) 有価証券売買損益	221,957,184
売買益	268,504,887
売買損	△ 46,547,703
(C) 信託報酬等	△ 3,642,719
(D) 当期損益金(A + B + C)	218,313,750
(E) 前期繰越損益金	31,836,722
(F) 追加信託差損益金	137,219,534
(配当等相当額)	( 274,612,886)
(売買損益相当額)	(△137,393,352)
(G) 合計(D + E + F)	387,370,006
次期繰越損益金(G)	387,370,006
追加信託差損益金	137,219,534
(配当等相当額)	( 274,612,886)
(売買損益相当額)	(△137,393,352)
分配準備積立金	250,151,187
繰越損益金	△ 715

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	82,237,949
(c) 収益調整金	274,612,886
(d) 分配準備積立金	167,913,238
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	524,764,073
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	524,764,073
(h) 受益権総口数	1,291,974,799口

# ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

## <補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の決算日（2021年9月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年11月30日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

## ■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの主要な売買銘柄 投資信託証券

（2020年12月1日から2021年11月30日まで）

買				売					
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
ＧＬＰ投資法人		33.861	5,910,897	174,563	インベスコ・オフィス・Ｊリート		284.311	6,375,508	22,424
日本ビルファンド		7.281	4,872,893	669,261	日本ビルファンド		6.703	4,613,295	688,243
日本プロロジスリート		12.675	4,380,694	345,616	ジャパンリアルエステイト		6.221	4,127,579	663,491
ジャパンリアルエステイト		6.458	4,224,540	654,156	ＧＬＰ投資法人		18.751	3,437,475	183,322
大和ハウスリート投資法人		12.057	3,677,761	305,031	日本プロロジスリート		9.491	3,381,705	356,306
野村不動産マスターＦ		20.881	3,446,907	165,073	野村不動産マスターＦ		20.116	3,365,622	167,310
日本都市ファンド投資法人		25.797	3,184,730	123,453	日本都市ファンド投資法人		25.105	2,897,527	115,416
アドバンス・レジデンス		7.747	2,691,277	347,396	大和ハウスリート投資法人		8.753	2,712,454	309,888
ユナイテッド・アーバン投資法人		17.447	2,638,424	151,225	オリックス不動産投資		12.399	2,379,571	191,916
オリックス不動産投資		12.87	2,429,600	188,780	アドバンス・レジデンス		5.537	1,935,794	349,610

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

下記は、2021年11月30日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（134,790,265千口）の内容です。

### (1) 国内投資信託証券

銘柄	柄	2021年11月30日現在	
		口数	評価額
		千口	千円
エスコンジャパンリート		7.996	1,086,656
サンケイリアルエステート		12.578	1,560,929
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投		16.669	2,667,040
東海道リート投資法		3.041	321,433
日本アコモデーションファンド投資法人		13.712	8,501,440
森ヒルズリート		46.696	7,023,078
産業ファンド		56.375	11,432,850
アドバンス・レジデンス		39.705	13,837,192
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		27.122	5,589,844
ＡＰＩ投資法人		21.164	9,142,848
ＧＬＰ投資法人		128.612	23,188,743
コンフォリア・レジデンシャル		17.88	5,703,720
日本プロロジスリート		62.913	23,246,353
星野リゾート・リート		6.655	4,239,235
Oneリート投資法人		6.891	2,027,332

銘柄	柄	2021年11月30日現在	
		口数	評価額
		千口	千円
イオンリート投資		46.7	7,098,400
ヒューリックリート投資法		37.045	6,175,401
日本リート投資法人		12.253	5,164,639
積水ハウス・リート投資		120.543	9,944,797
トーセイ・リート投資法人		8.297	1,049,570
ケネディクス商業リート		15.855	4,440,985
ヘルスケア&メディカル投資		8.47	1,308,615
サムティ・レジデンシャル		8.995	1,068,606
野村不動産マスターＦ		128.415	20,726,181
いちごホテルリート投資		6.579	538,820
ラサールロジポート投資		48.613	9,100,353
スターアジア不動産投		41.038	2,523,837
マリモ地方創生リート		3.72	500,340
三井不ロジパーク		14.761	8,605,663
大江戸温泉リート		6.409	480,675

銘 柄	2021年11月30日現在	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
投資法人みらい	45.27	2,408,364
森トラスト・ホテルリート投	9.317	1,180,463
三菱地所物流ＲＥＩＴ	10.092	4,773,516
ＣＲＥロジスティクスファンド	15.379	3,368,001
ザイマックス・リート	5.764	639,804
タカラレーベン不動産投	15.66	1,742,958
伊藤忠アドバンスロジ	15.484	2,660,151
日本ビルファンド	45.004	31,502,800
ジャパンリアルエステイト	39.711	26,010,705
日本都市ファンド投資法人	200.36	19,595,208
オリックス不動産投資	79.122	14,281,521
日本プライムリアルティ	26.097	10,556,236
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	38.062	5,716,912
東急リアル・エステート	26.624	4,962,713
グローバル・ワン不動産投資法人	27.575	3,286,940
ユナイテッド・アーバン投資法人	89.395	12,926,517
森トラスト総合リート	28.381	4,018,749
インヴィンシブル投資法人	174.782	6,650,455
フロンティア不動産投資	13.921	6,918,737
平和不動産リート	25.725	3,876,757
日本ロジスティクスファンド投資法人	25.946	8,147,044
福岡リート投資法人	20.537	3,351,638
ケネディクス・オフィス投資法人	12.284	8,463,676
いちごオフィスリート投資法人	32.538	2,785,252
大和証券オフィス投資法人	8.395	5,994,030
阪急阪神リート投資法人	17.937	2,837,633
スターツプロシード投資法人	6.184	1,393,873
大和ハウスリート投資法人	59.625	19,288,687
ジャパン・ホテル・リート投資法人	121.655	7,128,983
大和証券リビング投資法人	53.658	5,870,185
ジャパンエクセレント投資法人	36.848	4,893,414
合 計	口 数、金 額 銘 柄 数<比率>	2,303,034 435,527,511 61銘柄 <97.5%>

(注1) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

## (2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘 柄 別	2021年11月30日現在	
	買 建 額	売 建 額
国内	百万円	百万円
東証ＲＥＩＴ	11,214	-

(注) 単位未満は切捨て。

# ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

## 運用報告書 第35期（決算日 2021年9月15日）

（作成対象期間 2021年3月16日～2021年9月15日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

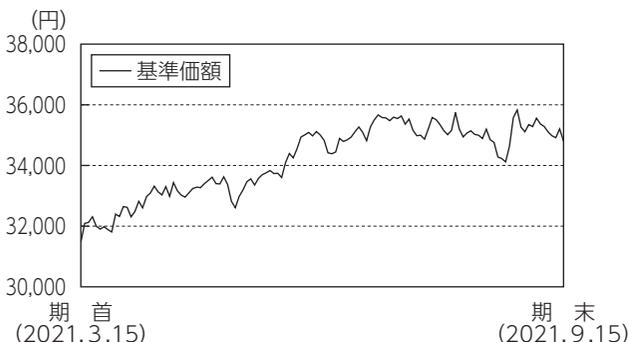
運用方針	東京証券取引所が算出・公表する「東証ＲＥＩＴ指数」（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数(配当込み)		投資信託	不動産投信
	円	%	ベンチマーク	%	組入比率	先物比率
(期首)2021年3月15日	31,472	-	4,243.77	-	97.0	2.5
3月末	32,620	3.6	4,399.26	3.7	97.5	2.5
4月末	33,506	6.5	4,518.99	6.5	97.6	2.4
5月末	33,743	7.2	4,551.00	7.2	97.5	2.4
6月末	35,087	11.5	4,732.24	11.5	97.6	2.4
7月末	35,347	12.3	4,767.40	12.3	96.3	2.4
8月末	35,257	12.0	4,755.00	12.0	97.1	2.5
(期末)2021年9月15日	34,797	10.6	4,692.90	10.6	96.7	2.5

(注1) 騰落率は期首比。  
 (注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。  
 (注3) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：31,472円 期末：34,797円 騰落率：10.6%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、新型コロナウイルスのワクチン接種が開始したことによる経済活動正常化への期待感などを背景に国内リート市況が上昇したことにより、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内リート市況

国内リート市況は上昇しました。

国内リート市況は、当作成期首より、FTSEグローバル株式指数による国内リートの組入比率引き上げや、新型コロナウイルスのワクチン接種が開始したことによる経済活動正常化への期待感などを背景に、上昇を続けました。2021年8月に入ると、公募増資の発表が相次ぎ、株式需給の悪化懸念から下落に転じ、当作成期末にかけてやや軟調に推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

◆ポートフォリオについて

ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）については、当作成期を通じて99~100%程度としました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は10.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は10.6%となりました。ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率の違い、先物取引の影響、売買等のコストが控除されたことが差異の要因となりました。  
 \*ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。

《今後の運用方針》

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

■1万円当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (先物・オプション)	0円 (0)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	0

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。  
 (注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2021年3月16日から2021年9月15日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内	247.331	45,311,585	( 475.281 )	( 45,591,284 )

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 売付( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2021年3月16日から2021年9月15日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	百万円	百万円	百万円	百万円
不動産投信指数先物取引	23,750	23,949	-	-

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託証券

(2021年3月16日から2021年9月15日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘	柄	□ 数	金 額	平均単価	銘	柄	□ 数	金 額	平均単価
		千□	千円	円			千□	千円	円
GLP投資法人		13.607	2,563,723	188,412	インバスコ・オフィス・Jリート		274.611	6,225,924	22,671
日本ビルファンド		3.416	2,384,048	697,906	日本ビルファンド		3.704	2,632,522	710,724
大和ハウスリート投資法人		7.114	2,273,534	319,585	ジャパンリアルエステイト		3.564	2,431,262	682,172
ジャパンリアルエステイト		3.027	2,044,014	675,260	GLP投資法人		10.704	2,044,950	191,045
日本プロロジスリート		4.789	1,723,936	359,978	日本プロロジスリート		5.504	2,011,301	365,425
日本都市ファンド投資法人		15.198	1,700,293	111,876	野村不動産マスターF		11.529	1,993,634	172,923
野村不動産マスターF		9.791	1,688,654	172,470	日本都市ファンド投資法人		15.279	1,692,619	110,780
アドバンス・レジデンス		4.457	1,630,337	365,792	大和ハウスリート投資法人		4.877	1,576,257	323,202
ユナイテッド・アーバン投資法人		10.04	1,603,447	159,705	オリックス不動産投資		7.105	1,436,992	202,250
イオンリート投資		9	1,395,373	155,041	ジャパン・ホテル・リート投資法人		17.722	1,159,092	65,404

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内投資信託証券

銘柄	期首		当期末	
	□数	□数	□数	評価額
	千口	千口	千口	千円
エスコンジャパンリート	6.659	8.096	1,113,200	
サンケイリアルエステート	9.97	12.735	1,614,798	
S O S I L A 物流リート投	10.714	16.867	2,980,398	
東海道リート投資法	-	3.079	329,145	
日本アコモデーションファンド投資法人	14.042	13.883	9,010,067	
森ヒルズリート	47.861	47.279	7,460,626	
産業ファンド	57.593	57.079	12,254,861	
アドバンス・レジデンス	38.701	40.201	14,954,772	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	27.769	27.461	6,189,709	
A P I 投資法人	20.416	21.428	9,921,164	
G L P 投資法人	127.316	130.219	24,832,763	
コンフォリア・レジデンシャル	18.319	18.103	6,363,204	
日本プロロジスリート	64.414	63.699	24,810,760	
星野リゾート・リート	6.2	6.203	4,453,754	
Oneリート投資法人	6.351	6.267	1,863,805	
イオンリート投資	41.326	47.284	6,931,834	
ヒューリックリート投資法	32.802	35.345	6,312,617	
日本リート投資法人	13.234	12.407	5,452,876	
インベスコ・オフィス・Jリート	261.761	-	-	
積水ハウス・リート投資	119.839	118.257	11,127,983	
トーセイ・リート投資法人	9.014	8.401	1,167,739	
ケネディクス商業リート	14.982	16.053	4,811,084	
ヘルスケア&メディカル投資	8.69	8.576	1,282,969	
サムティ・レジデンシャル	7.843	9.108	1,105,711	
野村不動産マスターF	131.757	130.019	21,401,127	
いちごホテルリート投資	7.125	6.661	608,815	
ラサールロジポート投資	45.405	49.22	9,642,198	
スターアジア不動産投	41.863	41.551	2,372,562	
マリモ地方創生リート	3.817	3.767	491,593	
三井不ロジパーク	14.221	14.945	9,340,625	
大江戸温泉リート	6.576	6.49	525,041	
投資法人みらい	44.003	45.835	2,493,424	
森トラスト・ホテルリート投	8.824	9.433	1,270,625	
三菱地所物流REIT	10.247	10.218	5,160,090	
C R E ロジスティクスファンド	13.036	15.541	3,277,596	
ザイマックス・リート	6.242	5.836	668,222	
タカラレーベン不動産投	12.243	15.855	1,718,682	
伊藤忠アドバンスロジ	15.804	15.677	2,473,830	
日本ビルファンド	45.855	45.567	32,899,374	
ジャパンリアルエステイト	40.744	40.207	27,582,002	
日本都市ファンド投資法人	202.944	202.863	21,888,917	
オリックス不動産投資	81.182	80.111	15,749,822	
日本プライムリアルティ	25.367	26.423	10,701,315	

銘柄	期首		当期末	
	□数	□数	□数	評価額
	千口	千口	千口	千円
NTT都市開発リート投資法人	36.801	36.315	5,596,141	
東急リアル・エステート	27.317	26.957	5,094,873	
グローバル・ワン不動産投資法人	28.293	27.919	3,386,574	
ユナイテッド・アーバン投資法人	87.136	90.512	13,966,001	
森トラスト総合リート	29.12	28.735	4,422,316	
インヴェンシブル投資法人	170.365	176.965	7,450,226	
フロンティア不動産投資	13.521	14.095	6,730,362	
平和不動産リート	25	26.047	4,235,242	
日本ロジスティクスファンド投資法人	26.622	26.27	8,997,475	
福岡リート投資法人	21.072	20.794	3,607,759	
ケネディクス・オフィス投資法人	12.604	12.438	9,589,698	
いちごオフィスリート投資法人	33.803	32.945	3,030,940	
大和証券オフィス投資法人	8.681	8.5	6,579,000	
阪急阪神リート投資法人	18.404	18.161	3,021,990	
スターツプロシード投資法人	6.345	6.261	1,617,216	
大和ハウスリート投資法人	58.133	60.37	20,586,170	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	131.255	123.175	7,920,152	
大和証券リビング投資法人	53.205	52.589	6,242,314	
ジャパンエクセレント投資法人	37.807	37.308	5,223,120	
合計	□数、金額	2,548,555	2,320,605	463,909,283
	銘柄数<比率>	61銘柄	61銘柄	<96.7%>

(注1) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
東証REIT	11,776	-

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年9月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託証券	463,909,283	96.0
コール・ローン等、その他	19,221,659	4.0
投資信託財産総額	483,130,943	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年9月15日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>488,160,318,274円</b>
コール・ローン等	10,293,486,593
投資信託証券(評価額)	463,909,283,800
未収入金	4,010,413,309
未収配当金	4,805,199,572
差入委託証拠金	5,141,935,000
<b>(B) 負債</b>	<b>8,177,694,000</b>
未払金	594,143,000
未払解約金	2,554,176,000
差入委託証拠金代用有価証券	5,029,375,000
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>479,982,624,274</b>
元本	137,936,526,812
次期繰越損益金	342,046,097,462
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>137,936,526,812口</b>
1万口当り基準価額(C / D)	34,797円

\*期首における元本額は139,798,959,653円、当作成期間中における追加設定元本額は11,462,714,869円、同解約元本額は13,325,147,710円です。

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン5,120,775,200円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）121,801,822,086円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）335,285,974円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 6,720,386円、i F r e e J - R E I Tインデックス493,327,273円、i F r e e 8資産パランス1,199,986,678円、DC・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン5,382,262,591円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 5,187,885円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 4,159,323円、ダイワ・ノーロード J - R E I Tファンド100,608,905円、ダイワファンドラップ J - R E I Tインデックス1,850,819,639円、ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワSMA専用）148,705,391円、ダイワファンドラップオンライン J - R E I Tインデックス490,142,159円、ダイワ・インデックスセレクト J - R E I T 996,723,322円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は34,797円です。

■損益の状況

当期 自2021年3月16日 至2021年9月15日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>8,149,293,863円</b>
受取配当金	8,149,118,957
受取利息	91
その他収益金	1,583,559
支払利息	△ 1,408,744
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>37,479,164,062</b>
売買益	39,083,555,027
売買損	△ 1,604,390,965
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>1,148,896,000</b>
取引益	1,399,272,000
取引損	△ 250,376,000
<b>(D) その他費用</b>	<b>△ 4,250</b>
<b>(E) 当期損益金(A + B + C + D)</b>	<b>46,777,349,675</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>300,181,997,048</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△ 32,018,024,392</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>27,104,775,131</b>
<b>(I) 合計(E + F + G + H)</b>	<b>342,046,097,462</b>
次期繰越損益金(I)	<b>342,046,097,462</b>

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

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

## 運用報告書 (全体版) 第5期

(決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券に投資し、海外リート市場の動きを反映した投資成果をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

### 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先（コールセンター）  
TEL 0120-106212  
(営業日の9:00～17:00)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）	
信託期間	無期限	
運用方針	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。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	
分配方針	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、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (現地通貨ベース) (参考指数)		投資信託 組入比率	投信証 組入比率	不動産 指数比率	純資産額
	(分配落)	税金 分配	み 金 騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率				
1期末(2017年11月30日)	円 10,301	円 0	% 3.0	10,550	% 5.5	% 0.3	% 97.6	% 0.5	百万円 451
2期末(2018年11月30日)	10,317	0	0.2	10,866	3.0	0.8	98.9	1.0	767
3期末(2019年12月2日)	11,735	0	13.7	12,751	17.3	2.1	96.5	3.0	839
4期末(2020年11月30日)	10,306	0	△12.2	11,362	△10.9	0.5	97.0	2.5	822
5期末(2021年11月30日)	13,476	0	30.8	14,972	31.8	0.9	96.0	2.2	1,062

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P先進国REIT指数 (除く日本) (現地通貨ベース) は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。同指数の所有権およびその他一切の権利は、S&P Dow Jones Indices LLCが有しています。S&P Dow Jones Indices LLCは、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



\*分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

\*分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

#### ■基準価額・騰落率

期首：10,306円

期末：13,476円（分配金0円）

騰落率：30.8%（分配金込み）

#### ■基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、米国を中心としたリート市場の上昇等を受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

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)

年 月 日	基 準 価 額		S & P 先進国REIT指数 (除く日本) (現地通貨ベース) (参考指数)		投 資 信 託 資 産 組 入 証 比 率	投 信 託 証 資 組 入 証 率	不 動 産 投 信 物 指 数 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期首) 2020年11月30日	円 10,306	% -	11,362	% -	0.5	97.0	2.5
12月末	10,395	0.9	11,475	1.0	0.7	97.0	2.2
2021年 1 月末	10,533	2.2	11,645	2.5	1.0	97.7	2.4
2 月末	10,865	5.4	12,021	5.8	0.9	98.3	2.5
3 月末	11,273	9.4	12,461	9.7	0.8	100.2	2.4
4 月末	11,922	15.7	13,192	16.1	1.6	95.6	1.8
5 月末	12,082	17.2	13,377	17.7	0.7	98.3	1.7
6 月末	12,429	20.6	13,775	21.2	0.8	98.0	1.7
7 月末	12,876	24.9	14,287	25.7	2.0	95.0	1.6
8 月末	13,118	27.3	14,564	28.2	1.5	97.1	2.0
9 月末	12,623	22.5	14,029	23.5	0.5	98.7	2.0
10月末	13,445	30.5	14,923	31.3	1.4	98.2	2.9
(期末) 2021年11月30日	13,476	30.8	14,972	31.8	0.9	96.0	2.2

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2020.12.1～2021.11.30)

## ■海外リート市況

海外リート市況は上昇しました。

海外リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン開発で高い効果を示す結果が報告され、経済活動正常化への期待が高まったことなどから、上昇しました。2021年に入っても、各国におけるワクチン接種の進展や渡航制限、行動規制の緩和などにより、上昇傾向が続きました。しかし9月に入ると、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念から世界的に市場心理が悪化したことに加え、インフレの長期化が懸念されて長期金利が急上昇したことで、リートは売られる展開となりました。10月以降は、好調な決算発表や米国長期金利の低下に加え、中国の大手不動産会社に対する信用不安の後退などから、再度上昇に転じました。当作成期末にかけては、新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念から、不安定な相場展開となりました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

## ■当ファンド

引き続き「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

また、マザーファンドの保有外貨建資産の当ファンド相当分については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

## ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

## ポートフォリオについて

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資を90～110%の範囲で行いました。また、マザーファンド保有外貨建資産の当ファンド相当分については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。なお、マザーファンドの組入比率が100%程度にならないのは、為替の売りヘッジ予約による評価損益が発生する影響が主要因です。

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエートで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物を組み入れました。

\*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
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）

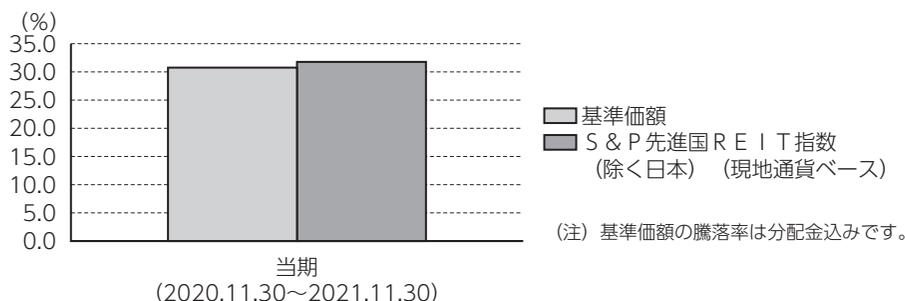
## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

マザーファンドについては、配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のズレも、かい離要因としてあげられます。

また、為替ヘッジを行う時に、通貨間の金利差等による損益（為替ヘッジコスト）が発生します。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2020年12月1日 ～2021年11月30日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	3,985

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

引き続き「ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

また、マザーファンドの保有外貨建資産の当ファンド相当分については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

### ■ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

また、運用の効率化を図るため、E T F（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

## 1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2020.12.1~2021.11.30)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	39円	0.324%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は11,967円です。
(投信会社)	(30)	(0.247)	投信会社分は、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、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(7)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	2	0.015	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.003)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.004)	
(投資信託証券)	(1)	(0.008)	
有価証券取引税	1	0.010	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(1)	(0.010)	
その他費用	9	0.072	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.024)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(5)	(0.042)	スピンオフに係る税金、信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	50	0.421	

(注1) 当作成期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

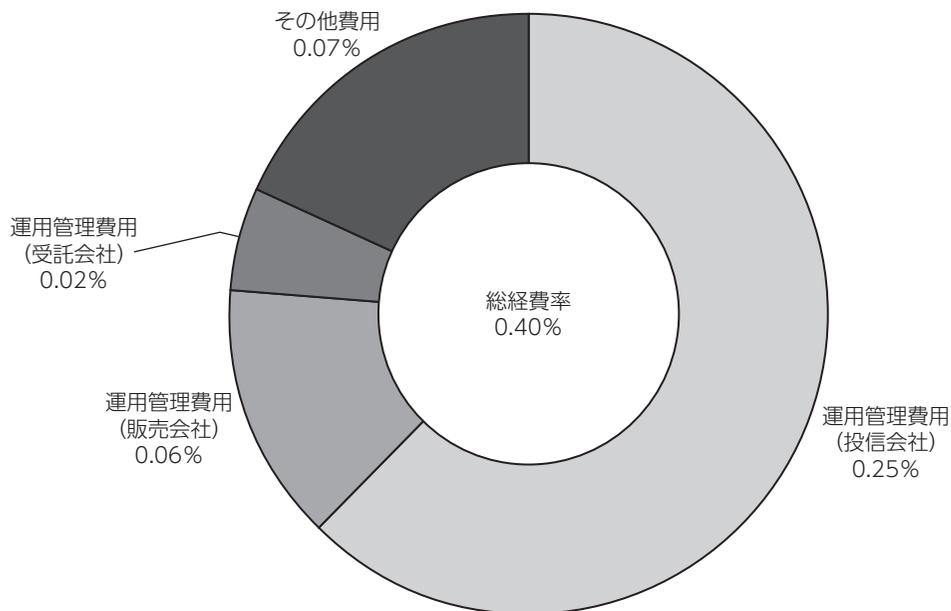
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.40%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	62,907	167,150	102,187	266,560

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	□ 数	金 額	評 価 額	□ 数	金 額	評 価 額
	千□	千円	千円	千□	千円	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	373,261	333,980	1,052,306			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	1,052,306	98.9
コール・ローン等、その他	12,096	1.1
投資信託財産総額	1,064,403	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1香港ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.21円、1ニュージーランド・ドル=77.53円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シェケル=36.011円、100韓国ウォン=9.58円、1ユーロ=128.41円です。

(注3) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(48,020,659千円)の投資信託財産総額(48,780,356千円)に対する比率は、98.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,117,294,352円
コール・ローン等	1,908,735
ダイワ・グローバルREITイン デックス・マザーファンド(評価額)	1,052,306,701
未収入金	1,063,078,916
(B) 負債	1,054,821,628
未払金	1,052,928,324
未払解約金	233,713
未払信託報酬	1,632,022
その他未払費用	27,569
(C) 純資産総額(A-B)	1,062,472,724
元本	788,413,204
次期繰越損益金	274,059,520
(D) 受益権総口数	788,413,204口
1万口当り基準価額(C/D)	13,476円

\* 期首における元本額は797,988,165円、当作成期間中における追加設定元本額は216,237,612円、同解約元本額は225,812,573円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,476円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月1日 至2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 276円
受取利息	17
支払利息	△ 293
(B) 有価証券売買損益	224,358,143
売買益	380,347,186
売買損	△155,989,043
(C) 信託報酬等	△ 3,083,199
(D) 当期損益金(A + B + C)	221,274,668
(E) 前期繰越損益金	20,322,632
(F) 追加信託差損益金	32,462,220
(配当等相当額)	( 72,637,864)
(売買損益相当額)	(△ 40,175,644)
(G) 合計(D + E + F)	274,059,520
次期繰越損益金(G)	274,059,520
追加信託差損益金	32,462,220
(配当等相当額)	( 72,637,864)
(売買損益相当額)	(△ 40,175,644)
分配準備積立金	241,597,576
繰越損益金	△ 276

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	186,626,873
(c) 収益調整金	72,637,864
(d) 分配準備積立金	54,970,703
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	314,235,440
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	314,235,440
(h) 受益権総口数	788,413,204口

# ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第17期 (決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日)

ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

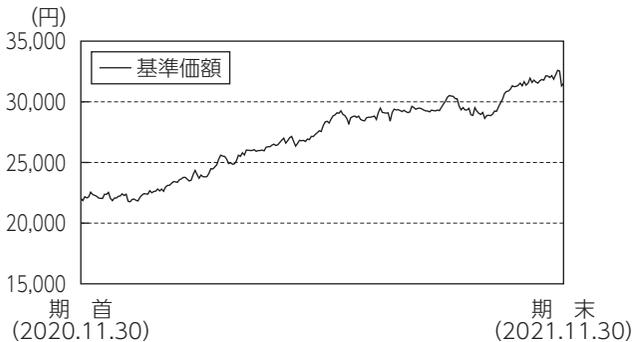
運用方針	S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (円ベース) に連動した投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場 (上場予定を含みます。) および店頭登録 (登録予定を含みます。) の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投資信託証券 組入制限	無制限

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託証券 購入比率	投資信託証券 売却比率	不動産 指数比率
	円	%	%	%	%	%	%
(期首)2020年11月30日	22,044	—	25,605	—	0.5	97.0	2.5
12月末	22,276	1.1	25,887	1.1	0.7	97.1	2.2
2021年1月末	22,806	3.5	26,474	3.4	1.0	96.6	2.4
2月末	24,006	8.9	27,999	9.3	0.9	96.6	2.4
3月末	25,793	17.0	29,872	16.7	0.7	97.0	2.3
4月末	27,005	22.5	31,406	22.7	1.6	96.7	1.8
5月末	27,611	25.3	32,186	25.7	0.7	97.7	1.7
6月末	28,466	29.1	33,118	29.3	0.8	97.6	1.7
7月末	29,191	32.4	34,044	33.0	2.0	96.3	1.7
8月末	29,804	35.2	34,715	35.6	1.5	97.0	2.0
9月末	29,119	32.1	33,918	32.5	0.5	97.5	2.0
10月末	31,656	43.6	36,792	43.7	1.3	95.9	2.9
(期末)2021年11月30日	31,508	42.9	36,654	43.1	0.9	97.0	2.3

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) は、S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。
- (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (注5) 不動産投資信託先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：22,044円 期末：31,508円 騰落率：42.9%

【基準価額の主な変動要因】

米国を中心としたリート市況の上昇等を受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は上昇しました。

海外リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン開発で高い効果を示す結果が報告され、経済活動正常化への期待が高まったことなどから、上昇しました。2021年に入っても、各国におけるワクチン接種の進展や渡航制限、行動規制の緩和などにより、上昇傾向が続きました。しかし9月に入ると、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念から世界的に市場心理が悪化したことに加えインフレの長期化が懸念されて長期金利が急上昇したことで、売られる展開となりました。10月以降は、好調な決算発表や米国長期金利の低下に加え、中国大手不動産会社に対する信用不安の後退などから、再度上昇に転じました。当作成期末にかけては、新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念から、不安定な相場展開となりました。

○為替相場

為替相場は上昇 (円安) しました。

対円為替相場は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展などで市場のリスク選好度が強まったことで、おおむね上昇しました。2021年に入っても、米国の追加経済対策への期待が高まったことや、世界的にワクチン接種が進み感染状況が改善基調にあったことなどから、おおむね円安傾向となりました。7月以降は、新型コロナウイルスの変異株の影響により世界的に感染が再拡大し、景気回復への不透明感が高まったことなどから、円高に転じました。しかし9月以降は、インフレ懸念から世界的に金利が上昇したことと日本との金利差拡大などが意識され、再度円安が進行しました。当作成期末にかけては、新たな変異株への懸念から、おおむね円高となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

また、運用の効率化を図るため、ETF (上場投資信託証券) ならびに不動産投資信託先物取引を利用することがあります。

◆ポートフォリオについて

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエートで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

また、運用の効率化を図るため、ETF (上場投資信託証券) および不動産投資信託先物を組み入れました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は43.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は42.9%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。

なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

\*ベンチマークはS & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) です。

《今後の運用方針》

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（「当インデックス」）は S & P Dow Jones Indices LLC（「S P D J I」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's® および S & P® は Standard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones® は Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが S P D J I に、特定目的での利用を許諾するサプライセンサが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、S P D J I、Dow Jones、S & P またはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいづれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行なわず、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

■ 1 万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (先物・オプション)	4円 ( 1 )
(投資信託受益証券)	( 1 )
(投資信託証券)	( 2 )
有価証券取引税 (投資信託受益証券)	3 ( 0 )
(投資信託証券)	( 3 )
その他費用 (保管費用)	17 ( 7 )
(その他)	(10)
合計	23

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	買 付		売 付	
	口数	金額	口数	金額
外 国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	716.6 ( - )	70,733 ( - )	700.15 ( - )	69,035 ( - )

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付( )内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 売付( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	買 付		売 付	
	口数	金額	口数	金額
外 国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	1,438.7 (△ 249.81)	59,811 (△ 1,626)	217.753 ( - )	12,693 ( - )
カナダ	119.6 (△ 10.8)	2,136 (△ 198)	15.2 ( - )	327 ( - )
オーストラリア	1,952.08 ( 4,741)	8,098 ( 27)	586.648 ( - )	2,691 ( - )
香港	329.7 ( - )	8,843 ( - )	19 ( - )	1,361 ( - )
シンガポール	3,018.1 (△ 891.885)	4,660 ( 42)	2,182.22 ( - )	1,219 ( - )
ニュージーランド	291.95 ( - )	526 ( - )	( - )	( - )
イギリス	1,536.61 (△ 69.036)	3,619 (△ 65)	128.23 ( - )	616 ( - )
イスラエル	20 ( - )	349 ( - )	( - )	( - )
韓国	93.93 ( 20.575)	577,802 ( 34,813)	( - )	( - )
ユーロ (アイルランド)	63 ( - )	80 ( - )	( - )	( - )
ユーロ (オランダ)	5.55 ( 0.457)	106 ( - )	( - )	( - )
ユーロ (ベルギー)	21.07 ( 0.68)	1,141 ( 28)	2.88 ( - )	194 ( - )
ユーロ (フランス)	37.9 ( 0.13)	1,661 ( 17)	9.98 ( - )	613 ( - )
ユーロ (ドイツ)	16.94 ( - )	226 (△ 21)	2.6 ( - )	46 ( - )
ユーロ (スペイン)	43.07 ( - )	357 (△ 37)	9.5 ( - )	89 ( - )
ユーロ (イタリア)	12.19 ( - )	62 ( - )	( - )	( - )
ユーロ (その他)	70 (△ 283.68)	54 ( - )	( - )	( - )
ユーロ (ユーロ 通貨計)	269.72 (△ 282.413)	3,690 (△ 13)	24.96 ( - )	945 ( - )

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付( )内は分割割当、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 売付( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 不動産投信指数先物取引	百万円 4,583	百万円 4,460	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当					期				
買			付		売			付	
銘	柄	口数	金額	平均単価	銘	柄	口数	金額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)		716.6	7,762,024	10,831	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)		700.15	7,590,754	10,841

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当					期				
買			付		売			付	
銘	柄	口数	金額	平均単価	銘	柄	口数	金額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
PROLOGIS INC (アメリカ)		36.6	448,224	12,246	PROLOGIS INC (アメリカ)		9.3	126,652	13,618
EQUINIX INC (アメリカ)		4.7	378,799	80,595	EQUINIX INC (アメリカ)		1.1	93,308	84,825
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		16.8	259,246	15,431	GOODMAN GROUP (オーストラリア)		42.049	74,392	1,769
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT (アメリカ)		11.3	221,399	19,592	PUBLIC STORAGE (アメリカ)		2	65,114	32,557
PUBLIC STORAGE (アメリカ)		7.6	221,005	29,079	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		4.4	61,403	13,955
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		17.4	212,800	12,229	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		3.6	59,690	16,580
REALTY INCOME CORP (アメリカ)		28.2	199,312	7,067	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD (フランス)		6.46	56,998	8,823
WELLTOWER INC (アメリカ)		21.1	172,105	8,156	UDR INC (アメリカ)		8.6	49,608	5,768
GOODMAN GROUP (オーストラリア)		104.78	170,916	1,631	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)		5.7	49,572	8,696
SUN COMMUNITIES INC (アメリカ)		9.5	167,703	17,653	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		2	46,515	23,257

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国投資信託受益証券

銘	柄	期 首	当 期 末		
		口数	口数	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
VANGUARD REAL ESTATE ETF		17.5	33.95	3,693	420,239
合 計		口数、金額 銘柄数<比率>	17.5 1銘柄	33.95 1銘柄	3,693 <0.9%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円
(シンガポール)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
MANULIFE US REAL ESTATE INV	320,562	364,562	258	29,448
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	151.4	193.4	152	17,382
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90	90	3	350
PRIME US REIT	99	147	121	13,797
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	29.5	33.2	714	81,246
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13.7	-	-	-
URBAN EDGE PROPERTIES	21,982	28,682	499	56,876
XENIA HOTELS & RESORTS INC	25.4	28.8	461	52,523
AVALONBAY COMMUNITIES INC	31.4	36	8,668	986,167
SIMON PROPERTY GROUP INC	71,847	84,847	13,570	1,543,907
BOSTON PROPERTIES INC	31.4	36.7	4,049	460,709
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	32,467	36,789	280	31,893
VORNADO REALTY TRUST	35,064	41,064	1,707	194,255
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	18	21.2	444	50,529
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13.9	21.1	1,307	148,761
NEXPOINT RESIDENTIAL	4.8	5.5	423	48,187
QTS REALTY TRUST INC-CL A	13.6	-	-	-
EQUITY RESIDENTIAL	76.5	88	7,587	863,213
APPLE HOSPITALITY REIT INC	43.8	54.8	843	95,950
EPR PROPERTIES	16.1	18.9	895	101,878
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.5	7.1	106	12,164
CITY OFFICE REIT INC	9.3	10.9	184	20,945
GLOBAL NET LEASE INC	19,833	25,933	374	42,603
EQUINIX INC	19.6	23.2	19,024	2,164,360
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	15,529	19,829	539	61,361
CHATHAM LODGING TRUST	7.4	10.8	133	15,137
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	7.1	8.8	129	14,697
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	12.3	14.2	1,153	131,213
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	25.7	31.4	558	63,516
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4.9	6	261	29,700
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	-	13.1	60	6,900
HOST HOTELS & RESORTS INC	157.6	184.3	3,026	344,291
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	59,008	70,708	2,874	327,006
CORESITE REALTY CORP	9.5	11.4	1,953	222,263
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	34.1	39.4	973	110,718
RLJ LODGING TRUST	35,871	41,871	540	61,498
FARMLAND PARTNERS INC	2.9	6.7	78	8,987
PHYSICIANS REALTY TRUST	46.1	56.1	1,015	115,587
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	14	15.7	224	25,506
CYRUSONE INC	25.9	32	2,860	325,400
KIMCO REALTY CORP	94.4	158.362	3,686	419,432
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9.8	15.6	256	29,142
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	48.85	56.55	1,923	218,874
WHITESTONE REIT	8.5	11.2	106	12,066
GAMING AND LEISURE PROPTIE	46,349	57,437	2,629	299,154
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	27.2	32.3	575	65,447
PARK HOTELS & RESORTS INC	51.68	61.08	1,097	124,874
DIGITALBRIDGE GROUP INC	105,011	126,711	1,046	119,075
INVITATION HOMES INC	125,297	148,797	6,140	698,644
JBG SMITH PROPERTIES	25,132	29,932	857	97,597
ALEXANDER & BALDWIN INC	16.5	18.7	417	47,507
CLIPPER REALTY INC	1.4	1.4	12	1,427

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円
GLADSTONE LAND CORP	4.5	6.4	183	20,889
AMERICOLD REALTY TRUST	45.1	67.4	2,183	248,446
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	14.3	16.9	376	42,818
VICI PROPERTIES INC	118.2	157.4	4,427	503,735
RETAIL VALUE INC	2,815	4.49	27	3,075
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12.5	-	-	-
BRT APARTMENTS CORP	1.3	2.9	54	6,222
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10.1	-	-	-
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4.9	6.1	1,619	184,290
SAFEHOLD INC	3.2	3.3	233	26,599
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29.96	-	-	-
AMERICAN FINANCE TRUST INC	22.4	29.6	239	27,243
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	22.9	30.5	834	94,973
CORECIVIC INC	25,224	-	-	-
COREPOINT LODGING INC	6.7	10.7	165	18,832
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3.4	7.4	225	25,661
STORE CAPITAL CORP	50.5	63.1	2,128	242,215
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2.4	5.9	41	4,752
BROADSTONE NET LEASE INC	-	41	1,042	118,573
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	22.4	25.3	231	26,337
LIFE STORAGE INC	10.4	20.25	2,708	308,138
AMERICAN ASSETS TRUST INC	10.1	13.2	464	52,892
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	20.082	26.582	664	75,545
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	9.2	12.2	165	18,835
PARAMOUNT GROUP INC	36.4	40.2	332	37,869
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29.2	36.5	346	39,366
NETSTREIT CORP	-	9.9	216	24,655
APARTMENT INCOME REIT CO	-	40.489	2,100	238,935
CTO REALTY GROWTH INC	-	1.2	66	7,605
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	27.4	35.6	2,527	287,565
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	23.7	29.7	568	64,639
STAG INDUSTRIAL INC	32.5	41.8	1,816	206,630
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	-	2.6	46	5,324
INDUS REALTY TRUST INC	-	1.1	81	9,324
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	-	3.2	56	6,411
ORION OFFICE REIT INC	-	14.223	264	30,097
VENTAS INC	83,379	101,629	4,992	567,941
CARETRUST REIT INC	21,503	24,503	494	56,255
GEO GROUP INC/THE	27.4	31.6	269	30,630
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	64.3	76.7	1,794	204,104
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	10.6	11.8	284	32,313
SABRA HEALTH CARE REIT INC	44,987	56,987	742	84,478
UMH PROPERTIES INC	8.6	10.6	245	27,966
IRON MOUNTAIN INC	63.8	74.7	3,500	398,245
TERRENO REALTY CORP	15.2	18.2	1,389	158,049
VEREIT INC	240,908	-	-	-
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22.32	30.72	1,406	160,071
SUN COMMUNITIES INC	21.8	29.9	5,882	669,289
ACADIA REALTY TRUST	17,011	22,811	487	55,433
ALEXANDER'S INC	0.4	0.5	129	14,760
PROLOGIS INC	163,619	190,919	29,264	3,329,372
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26.2	35.8	7,348	836,017
BRANDYWINE REALTY TRUST	38.3	43.3	578	65,814
SAUL CENTERS INC	2.4	3.2	160	18,316

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
MACK-CALI REALTY CORP	20.2	20.1	343	39,081
CAMDEN PROPERTY TRUST	21.8	26	4,390	499,461
COUSINS PROPERTIES INC	32,906	38,406	1,480	168,486
SITE CENTERS CORP	31,878	46,278	722	82,240
DUKE REALTY CORP	82.1	97.7	5,808	660,806
EASTGROUP PROPERTIES INC	8.7	10.4	2,128	242,202
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,467	16,767	5,809	660,977
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	27.8	33.3	2,032	231,290
FEDERAL REALTY INVS TRUST	15.4	18.1	2,280	259,443
GETTY REALTY CORP	7,703	9,803	302	34,440
WELLTOWER INC	93.2	109.1	8,950	1,018,305
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	120.3	139.2	4,741	539,400
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23.1	26.9	1,182	134,505
SERVICE PROPERTIES TRUST	36.5	41.7	372	42,413
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30.1	37.6	1,187	135,048
EQUITY COMMONWEALTH	27,375	31,475	804	91,563
KILROY REALTY CORP	23.2	27.1	1,762	200,560
LTC PROPERTIES INC	8.4	9.6	306	34,851
LEXINGTON REALTY TRUST	60	70.1	1,055	120,027
MID-AMERICA APARTMENT COMM	25,328	29,928	6,284	715,030
MACERICH CO/THE	21,979	54,979	1,089	123,910
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	37.5	44.1	3,740	425,563
NATL HEALTH INVESTORS INC	9.6	11.9	622	70,793
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	38.4	45.3	2,057	234,084
REALTY INCOME CORP	77,117	142,239	9,928	1,129,540
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	24	28.5	731	83,233
PENN REAL ESTATE INVEST TST	-	17	20	2,359
PUBLIC STORAGE	33.8	39.4	13,076	1,487,709
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4.3	5.1	892	101,586
REGENCY CENTERS CORP	34.92	39.52	2,796	318,150
RPT REALTY	17.8	21.1	276	31,471
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17.6	26.3	532	60,620
SL GREEN REALTY CORP	16.4	17,357	1,222	139,118
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	49	57.5	162	18,513
TAUBMAN CENTERS INC	13.3	-	-	-
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6	7.6	144	16,462
UDR INC	65.3	72	4,137	470,762
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2.6	3.1	173	19,753
WP CAREY INC	38.5	47.6	3,748	426,466
WASHINGTON REIT	17.8	21.6	553	62,934
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	25.9	-	-	-
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	-	7	78	8,903
AGREE REALTY CORP	11.7	17.8	1,236	140,684
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50,748	61,648	1,711	194,700
CUBESMART	43.3	52.1	2,862	325,711
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45,526	56,326	636	72,412
DIGITAL REALTY TRUST INC	59,778	72,978	12,317	1,401,413
CEDAR REALTY TRUST INC	-	3.1	68	7,783
EXTRA SPACE STORAGE INC	28.6	34.5	7,005	796,984
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7.875	7.875	72	8,206
CENTERSPACE	2.46	3.66	377	42,930
KITE REALTY GROUP TRUST	18.95	55,741	1,133	128,925
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	21	24.9	517	58,838
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,233	3,633	120	13,726

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	30.5	35.9	1,884	214,428
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6.3	8.8	193	22,025
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	42,342	54,342	498	56,693
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	117.1	153.8	3,305	376,028
FRANKLIN STREET PROPERTIES CT	21	21	124	14,167
DOUGLAS EMMETT INC	36.5	45.3	1,517	172,651
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	46.7	-	-	-
アメリカ・ドル 通貨計	□ 数、金額 155銘柄	5,540,075 6,511,212	315,743 315,743	35,922,148 <73.9%>
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	-	4.2	39	3,557
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	-	9.4	38	3,431
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	-	11.4	50	4,477
NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT UNITS	-	4.3	52	4,694
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13.1	17.1	197	17,614
SLATE GROCERY REIT	8.1	7	93	8,335
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10.2	14.7	337	30,126
SLATE OFFICE REIT	5.1	5.1	25	2,262
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4.2	4.2	93	8,311
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	19.7	28	382	34,115
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	17.6	22.2	514	45,952
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11.2	11.2	81	7,277
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	8.5	-	-	-
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4.1	4.1	55	4,940
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6.2	8.5	858	76,622
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	18.3	27	452	40,416
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	16.2	17.5	298	26,617
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	24.7	27.6	508	45,379
CHOICE PROPERTIES REIT	36.8	43.2	628	56,143
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4.2	4.2	75	6,718
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11.9	14.1	244	21,785
PLAZA RETAIL REIT	11.1	11.1	51	4,587
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	16.3	19.1	592	52,850
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	19.5	22.8	1,332	118,973
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21.79	21.79	252	22,522
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	32,566	38,166	620	55,358
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	34.3	42	929	82,926
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5.4	7.2	162	14,460
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4.7	5.9	325	29,033
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9.5	12.3	216	19,355
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13.3	16.8	723	64,541
カナダ・ドル 通貨計	□ 数、金額 27銘柄	388,556 482,156	10,232 30銘柄	913,388 <1.9%>
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU	-	284,343	3,085	250,789
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	78.38	93.38	344	28,010
CROMWELL PROPERTY GROUP	435,284	371,284	317	25,805
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	95.11	144.87	533	43,337
AVENTUS GROUP	88	103	342	27,881
RURAL FUNDS GROUP	78,595	108,595	321	26,129
WAYPOINT REIT	177.83	202,491	532	43,291
CHARTER HALL LONG WALE REIT	98,668	149,458	720	58,560
CENTURIA OFFICE REIT	84.95	118.83	263	21,444
CENTURIA CAPITAL GROUP	97.59	166.05	524	42,654

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	オーストラリア・ドル	千円
IRONGATE GROUP	119.63	149.63	235	19,157
HOME CONSORTIUM	35	48	363	29,537
HOMECO DAILY NEEDS REIT	17.5	130.34	183	14,939
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	241.86	291.52	816	66,353
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	70.547	79.167	323	26,256
NATIONAL STORAGE REIT	206.195	288.195	708	57,631
DEXUS INDUSTRIA REIT STARPLED UNIT	29.76	54.67	179	14,576
GDI PROPERTY GROUP	123.31	123.31	135	10,976
SCENTRE GROUP	1,194.91	1,372.159	4,171	339,090
ARENA REIT	79.89	93.89	415	33,811
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38.3	47.12	160	13,023
BWP TRUST	105.55	123.87	510	41,485
DEXUS	251.73	-	-	-
GPT GROUP	444	506.413	2,628	213,653
CHARTER HALL RETAIL REIT	120.4	139.51	574	46,723
MIRVAC GROUP	908.06	1,042.307	3,022	245,714
STOCKLAND	550.01	631.087	2,745	223,159
ABACUS PROPERTY GROUP	81.12	107.93	385	31,321
GOODMAN GROUP	381.71	444.441	10,911	886,957
VICINITY CENTRES	878.9	1,022.946	1,733	140,948
CHARTER HALL GROUP	105.06	123.136	2,335	189,884
INGENIA COMMUNITIES GROUP	68.66	94.74	582	47,363
オーストラリア・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	7,286,509 31銘柄	8,656,682 31銘柄	40,109 3,260,470 < 6.7%>
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	349	398	1,337	19,510
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193	250	1,135	16,559
FORTUNE REIT	311	378	3,046	44,451
PROSPERITY REIT	300	300	930	13,568
LINK REIT	476.9	564.6	38,788	565,917
CHAMPION REIT	431	481	1,972	28,772
香港ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	2,060.9 6銘柄	2,371.6 6銘柄	47,209 688,780 < 1.4%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
KEPPEL DC REIT	293.783	331.683	786	65,410
FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	126.2	419.876	123	10,306
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	455	583.9	589	49,072
AIMS APAC REIT	89	119	166	13,862
FRASERS HOSPITALITY TRUST	121.8	-	-	-
FRASERS LOGISTICS & COMMERC	591.19	783.99	1,160	96,548
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86	134	119	9,923
LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	208.9	208.9	181	15,122
EC WORLD REIT	57	57	46	3,889
IREIT GLOBAL	105.124	175.124	111	9,253
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	722.377	905.877	2,708	225,380
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,029.422	1,346.522	2,881	239,774
SUNTEC REIT	473.4	565.4	853	71,040
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	608.2	770.8	1,472	122,504
KEPPEL REIT	375.4	501.4	556	46,310
ASCOTT RESIDENCE TRUST	417.456	505.456	505	42,058
ESR-REIT	559.902	709.902	340	28,354
CDL HOSPITALITY TRUSTS	161.6	191.6	216	18,015
FRASERS CENTREPOINT TRUST	211.776	281.176	649	54,046
STARHILL GLOBAL REIT	308.8	383.8	247	20,598

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND CHINA TRUST	179.396	269.442	320	26,680
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	86.3	98.3	491	40,897
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	467.2	-	-	-
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	384.78	513.769	1,376	114,571
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	244.5	354.5	317	26,400
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	498.484	579.884	1,211	100,846
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182.1	248.1	145	12,076
SPH REIT	220.6	275.6	278	23,162
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	202.1	-	-	-
SABANA INDUSTRIAL REIT TRUST	219.4	-	-	-
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I (非上場)	541.063	651.063	289	24,107
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	10.046	-	-	-
シンガポール・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	10,238,299 32銘柄	11,966,064 27銘柄	18,149 1,510,218 < 3.1%>
(ニュージーランド)	千口	千口	千ニュージーランド・ドル	千円
ARGOSY PROPERTY LTD	158.52	224.47	317	24,625
KIWI PROPERTY GROUP LTD	357.92	423.8	483	37,457
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	76.8	102.92	293	22,781
GOODMAN PROPERTY TRUST	248.22	299.22	725	56,256
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	245.82	328.82	506	39,259
ニュージーランド・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	1,087.28 5銘柄	1,379.23 5銘柄	2,326 180,380 < 0.4%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
ASSURA PLC	594.52	707.1	483	73,249
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	129.57	159.57	129	19,613
STANDARD LIFE INV PROP INC	100	100	74	11,276
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	177.71	220.71	168	25,589
PICTON PROPERTY INCOME LTD	121.11	146.11	145	22,011
REGIONAL REIT LTD	81.31	111.31	100	15,166
NEWRIVER REIT PLC	69.33	69.33	61	9,288
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	183.29	224.81	374	56,696
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	135.49	155.49	143	21,680
CUSTODIAN REIT PLC	89.42	109.42	106	16,086
GCP STUDENT LIVING PLC	96.86	112.86	237	36,006
PRS REIT PLC/THE	-	119.64	123	18,676
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	67.9	90.9	107	16,366
LXI REIT PLC	118.038	180.188	269	40,800
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	75.2	98.2	93	14,124
AEW UK REIT PLC	25.61	49.61	55	8,451
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	180	201.12	206	31,274
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	150	207	251	38,118
HOME REIT PLC	-	60	70	10,684
RDI REIT PLC	41.036	-	-	-
LAND SECURITIES GROUP PLC	166.381	198.461	1,490	225,891
SEGRO PLC	263.74	317.05	4,494	681,138
HAMMERTON PLC	811.984	1,076.984	332	50,453
UNITE GROUP PLC/THE	87.26	105.39	1,143	173,306
BRITISH LAND CO PLC	208.52	247.76	1,291	195,788
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	53.581	67.061	483	73,280
DERWENT LONDON PLC	24.39	29.63	1,014	153,807
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	283.37	346.37	519	78,796
WORKSPACE GROUP PLC	26.46	32.26	263	39,896
SAFESTORE HOLDINGS PLC	46.35	54.57	731	110,826

銘柄	期首 口数	当期 口数	期末 評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
SHAFTESBURY PLC	千口 53.85	千口 75.77	千円 484	千円 73,495
BIG YELLOW GROUP PLC	36.96	45.64	739	112,058
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	203.15	237.15	645	97,763
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121.6	121.6	63	9,657
TRITAX BIG BOX REIT PLC	370.26	454.53	1,088	164,919
イギリス・ポンド 通貨計	口数、金額 5,194.25 銘柄数<比率>	6,533.594 34銘柄	17,987	2,726,240 < 5.6%>
(イスラエル) REIT 1 LTD	千口 28.84	千口 48.84	千円 1,050	千円 37,813
イスラエル・シケル 通貨計	口数、金額 28.84 銘柄数<比率>	48.84 1銘柄	1,050	37,813 < 0.1%>
(韓国) ESR KENDALL SQUARE REIT LTD	千口 -	千口 13.16	千韓国ウォン 987	千円 94
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6	11.44	91,520	8,767
LOTTE REIT CO LTD	17.96	34.375	192,500	18,441
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	17.96	25.06	122,418	11,727
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	-	5.6	32,704	3,133
JR REIT XXVII	-	31.29	168,340	16,126
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	-	8.5	55,760	5,341
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	-	27	175,500	16,812
韓国ウォン 通貨計	口数、金額 41.92 銘柄数<比率>	156.425 8銘柄	839,729	80,446 < 0.2%>
ユーロ (アイルランド) IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	千口 82.05	千口 102.05	千ユーロ 156	千円 20,075
HIBERNIA REIT PLC	116.24	159.24	207	26,582
国小計	口数、金額 198.29 銘柄数<比率>	261.29 2銘柄	363	46,658 < 0.1%>
ユーロ (オランダ) EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	千口 -	千口 9.887	千ユーロ 176	千円 22,725
WERELDHAVE NV	6.47	8.97	107	13,833
EUROCOMMERCIAL PROPRIET-CV	8.23	-	-	-
NSI NV	3.231	4.131	141	18,115
VASTNED RETAIL NV	3.75	4.7	105	13,609
国小計	口数、金額 21.681 銘柄数<比率>	27.688 4銘柄	531	68,284 < 0.1%>
ユーロ (ベルギー) AEDIFICA	千口 6.256	千口 8.886	千ユーロ 1,060	千円 136,127
COFINIMMO	5.3	6.88	961	123,419
BEFIMMO	5.07	5.86	186	23,891
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	4.61	5.48	148	19,034
RETAIL ESTATES	1.94	2.54	175	22,537
WAREHOUSES DE PAUW SCA	25.48	34.45	1,420	182,345
CARE PROPERTY INVEST	4.9	6.1	156	20,052
XIOR STUDENT HOUSING NV	2.7	4.58	224	28,817
MONTEA NV	2.15	2.5	320	41,091
国小計	口数、金額 58.406 銘柄数<比率>	77.276 9銘柄	4,651	597,318 < 1.2%>
ユーロ (フランス) ALTAREA RIGHTS	千口 -	千口 0.01	千ユーロ 0	千円 2
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	26.77	28.68	1,720	220,967
ICADE	5.94	7.67	488	62,689
CARMILA	10	11.8	151	19,455

銘柄	期首 口数	当期 口数	期末 評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
ALTAREA	千口 0.74	千口 1.01	千ユーロ 162	千円 20,880
GECINA SA	10.521	13.391	1,598	205,226
KLEPIERRE	39.94	48.64	926	119,014
COVIVIO	8.992	11.652	854	109,763
MERCIALYS	4.03	12.13	102	13,138
国小計	口数、金額 106.933 銘柄数<比率>	134.983 9銘柄	6,005	771,140 < 1.6%>
ユーロ (ドイツ) ALSTRIA OFFICE REIT-AG	千口 34.82	千口 43.86	千ユーロ 853	千円 109,656
HAMBORNER REIT AG	11.98	17.28	163	21,050
国小計	口数、金額 46.8 銘柄数<比率>	61.14 2銘柄	1,017	130,707 < 0.3%>
ユーロ (スペイン) LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	千口 10.53	千口 14.53	千ユーロ 68	千円 8,853
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	50.033	63.533	522	67,101
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	66.1	82.17	815	104,775
国小計	口数、金額 126.663 銘柄数<比率>	160.233 3銘柄	1,407	180,730 < 0.4%>
ユーロ (イタリア) COIMA RES SPA	千口 -	千口 5.19	千ユーロ 37	千円 4,818
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6.24	13.24	46	5,993
国小計	口数、金額 6.24 銘柄数<比率>	18.43 2銘柄	84	10,811 < 0.0%>
ユーロ (その他) CROMWELL REIT EUR	千口 294.6	千口 80.92	千ユーロ 204	千円 26,289
国小計	口数、金額 294.6 銘柄数<比率>	80.92 1銘柄	204	26,289 < 0.1%>
ユーロ通貨計	口数、金額 859.613 銘柄数<比率>	821.96 32銘柄	14,266	1,831,939 < 3.8%>
合計	口数、金額 32,726.242 銘柄数<比率>	38,927.763 331銘柄	-	47,151,826 < 97.0%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

### (3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外	DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	百万円 892	百万円 -
国	STOXX 600 REAL (ドイツ)	210	-

(注1) 外貨建の評価額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	420,239	0.9
投資信託証券	47,151,826	96.7
コール・ローン等、その他	1,208,291	2.4
投資信託財産総額	48,780,356	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1香港ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.21円、1ニュージーランド・ドル=77.53円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シケル=36.011円、100韓国ウォン=9.58円、1ユーロ=128.41円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(48,020,659千円)の投資信託財産総額(48,780,356千円)に対する比率は、98.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	49,434,462,118円
コール・ローン等	751,562,447
投資信託受益証券(評価額)	420,239,075
投資信託証券(評価額)	47,151,826,564
未収入金	668,763,396
未収配当金	56,716,807
差入委託証拠金	385,353,829
(B) 負債	805,521,183
未払金	803,305,110
未払株式払込金	2,215,073
未払解約金	1,000
(C) 純資産総額(A-B)	48,628,940,935
元本	15,433,680,362
次期繰越損益金	33,195,260,573
(D) 受益権総口数	15,433,680,362口
1万口当り基準価額(C/D)	31,508円

\* 期首における元本額は13,110,290,968円、当作成期間中における追加設定元本額は5,480,584,788円、同解約元本額は3,157,195,394円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワファンドラップ 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジあり)	6,291,808,323円
ダイワファンドラップ 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし)	1,162,934,430円
ダイワファンドラップオンライン 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジあり)	333,980,799円
ダイワファンドラップオンライン 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし)	289,623,388円
D-1's グローバル R E I T インデックス	2,223,608円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	8,326,903円
i Free 外国 R E I T インデックス	632,249,938円
i Free 8資産バランス	1,462,352,614円
グローバル・リート・インデックスファンド (資産形成型)	236,948,723円
グローバル・リート・インデックスファンド (毎月決算型)	113,742,003円
DCダイワ・グローバル R E I T インデックスファンド	3,300,676,766円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,106,352円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	5,186,807円
ダイワバランスファンド2020-07 (適格機関投資家専用)	183,749,014円
ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用)	184,925,099円
ダイワ・インデックスセレクト グローバル R E I T	243,151,995円
ダイワ・ノーロード グローバル R E I T ファンド	59,517,654円
ダイワ外国 R E I T インデックス (為替ヘッジあり) (ダイワSMA専用)	912,182,345円
ダイワ外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用)	3,993,601円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は31,508円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月1日 至2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,170,369,078円
受取配当金	1,166,078,286
受取利息	273
その他収益金	4,393,512
支払利息	△ 102,993
(B) 有価証券売買損益	12,530,341,971
売買益	12,953,251,906
売買損	△ 422,909,935
(C) 先物取引等損益	199,972,869
取引益	211,186,295
取引損	△ 11,213,426
(D) その他費用	△ 24,978,913
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	13,875,705,005
(F) 前期繰越損益金	15,789,555,929
(G) 解約差損益金	△ 5,533,781,623
(H) 追加信託差損益金	9,063,781,262
(I) 合計(E+F+G+H)	33,195,260,573
次期繰越損益金(I)	33,195,260,573

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

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

## 運用報告書 (全体版) 第5期

(決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日~2021年11月30日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先（コールセンター）  
TEL 0120-106212  
(営業日の9:00~17:00)  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	
分配方針	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、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 組入比率	投信証券 組入比率	不動産 指数比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中騰落 率	(ベンチマーク)	期中騰落 率				
1期末(2017年11月30日)	円 10,273	円 0	% 2.7	10,407	% 4.1	% 0.3	% 98.9	% 0.5	百万円 312
2期末(2018年11月30日)	10,501	0	2.2	10,745	3.2	0.8	97.9	0.9	561
3期末(2019年12月2日)	11,725	0	11.7	12,100	12.6	2.0	95.1	2.9	595
4期末(2020年11月30日)	9,969	0	△15.0	10,369	△14.3	0.5	97.0	2.5	602
5期末(2021年11月30日)	14,202	0	42.5	14,843	43.1	0.9	97.0	2.3	912

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P 先進国 REIT 指数 (除く日本) (円ベース) は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。

S & P 先進国 REIT 指数 (除く日本) (「当インデックス」) は S&P Dow Jones Indices LLC (「S P D J I」) の商品であり、これを利用するライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's® および S & P® は Standard & Poor's Financial Services LLC (「S & P」) の登録商標で、Dow Jones® は Dow Jones Trademark Holdings LLC (「Dow Jones」) の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが S P D J I に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、S P D J I、Dow Jones、S & P またはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 REIT 指数 (除く日本) の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- \* 分配金再投資基準価額は、分配金 (税込み) を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- \* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります (分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります)。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- \* ベンチマークはS & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) です。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：9,969円

期末：14,202円 (分配金0円)

騰落率：42.5% (分配金込み)

#### ■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、米国を中心としたリート市場の上昇と為替の円安等を受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

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)

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投 資 信 託 資 不 動 産 受 益 証 券 信 託 券 投 先 物 組 入 比 率 組 入 比 率 指 数	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率
	円	%	(ベンチマーク)	%				
(期首) 2020年11月30日	9,969	—	10,369	—	0.5	97.0	—	2.5
12月末	10,071	1.0	10,483	1.1	0.7	97.1	—	2.2
2021年 1 月末	10,308	3.4	10,721	3.4	1.0	96.6	—	2.4
2 月末	10,848	8.8	11,338	9.3	0.9	96.6	—	2.4
3 月末	11,652	16.9	12,097	16.7	0.7	97.0	—	2.3
4 月末	12,196	22.3	12,718	22.7	1.6	96.7	—	1.8
5 月末	12,466	25.0	13,034	25.7	0.7	97.7	—	1.7
6 月末	12,848	28.9	13,411	29.3	0.8	97.6	—	1.7
7 月末	13,172	32.1	13,787	33.0	2.0	96.3	—	1.7
8 月末	13,445	34.9	14,058	35.6	1.5	97.0	—	2.0
9 月末	13,132	31.7	13,735	32.5	0.5	97.5	—	2.0
10月末	14,272	43.2	14,899	43.7	1.3	95.9	—	2.9
(期末) 2021年11月30日	14,202	42.5	14,843	43.1	0.9	97.0	—	2.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■海外リート市況

海外リート市況は上昇しました。

海外リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン開発で高い効果を示す結果が報告され、経済活動正常化への期待が高まったことなどから、上昇しました。2021年に入っても、各国におけるワクチン接種の進展や渡航制限、行動規制の緩和などにより、上昇傾向が続きました。しかし9月に入ると、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念から世界的に市場心理が悪化したことに加え、インフレの長期化が懸念されて長期金利が急上昇したことで、リートは売られる展開となりました。10月以降は、好調な決算発表や米国長期金利の低下に加え、中国の大手不動産会社に対する信用不安の後退などから、再度上昇に転じました。当作成期末にかけては、新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念から、不安定な相場展開となりました。

### ■為替相場

為替相場は上昇（円安）しました。

対円為替相場は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展などで市場のリスク選好度が強まったことで、おおむね上昇しました。2021年に入っても、米国の追加経済対策への期待が高まったことや、世界的にワクチン接種が進み感染状況が改善基調にあったことなどから、おおむね円安傾向となりました。7月以降は、新型コロナウイルスの変異株の影響により世界的に感染が再拡大し、景気回復への不透明感が高まったことなどから、円高に転じました。しかし9月以降は、インフレ懸念から世界的に金利が上昇したことで日本との金利差拡大などが意識され、再度円安が進行しました。当作成期末にかけては、新たな変異株への懸念から、おおむね円高となりました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

主として「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

## ポートフォリオについて

(2020.12.1～2021.11.30)

### ■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ100%行いました。

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエートで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物を組み入れました。

\*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
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）

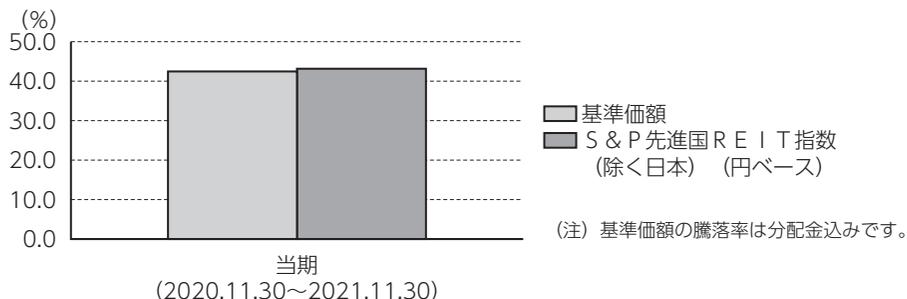
## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は43.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は42.5%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。

なお、マザーファンドで組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\*ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）です。

## 分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2020年12月1日 ～2021年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	4,989

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

主として「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020.12.1~2021.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	40円	0.324%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12,221円です。
(投 信 会 社)	(30)	(0.247)	投信会社分は、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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(7)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	2	0.014	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.003)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.004)	
(投資信託証券)	(1)	(0.008)	
有 価 証 券 取 引 税	1	0.010	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(1)	(0.009)	
そ の 他 費 用	8	0.066	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(3)	(0.024)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(5)	(0.037)	スピンオフに係る税金、信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	51	0.414	

(注1) 当作成期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

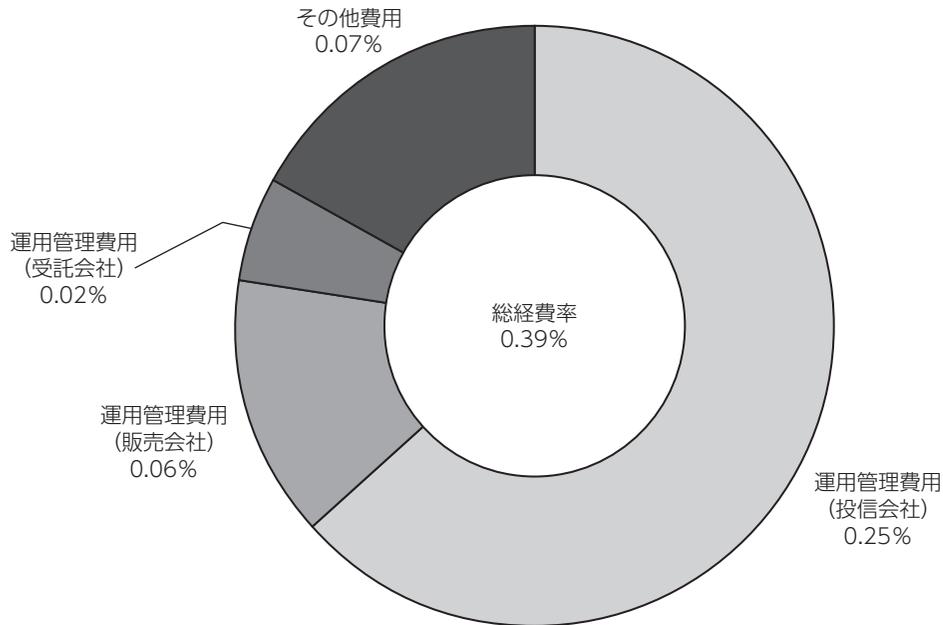
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.39%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	58,240	153,954	42,060	108,226

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	273,443	289,623	912,545

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	912,545	99.8
コール・ローン等、その他	1,680	0.2
投資信託財産総額	914,225	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1香港ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.21円、1ニュージーランド・ドル=77.53円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シユケル=36.011円、100韓国ウォン=9.58円、1ユーロ=128.41円です。

(注3) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(48,020,659千円)の投資信託財産総額(48,780,356千円)に対する比率は、98.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	914,225,803円
コール・ローン等	1,680,433
ダイワ・グローバルREITイン デックス・マザーファンド(評価額)	912,545,370
(B) 負債	1,597,033
未払解約金	186,371
未払信託報酬	1,387,237
その他未払費用	23,425
(C) 純資産総額(A-B)	912,628,770
元本	642,622,346
次期繰越損益金	270,006,424
(D) 受益権総口数	642,622,346口
1万口当り基準価額(C/D)	14,202円

\* 期首における元本額は604,694,831円、当作成期間中における追加設定元本額は194,621,133円、同解約元本額は156,693,618円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,202円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月1日 至2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 144円
受取利息	2
支払利息	△ 146
(B) 有価証券売買損益	239,024,053
売買益	263,398,433
売買損	△ 24,374,380
(C) 信託報酬等	△ 2,499,046
(D) 当期損益金(A + B + C)	236,524,863
(E) 前期繰越損益金	8,194,814
(F) 追加信託差損益金	25,286,747
(配当等相当額)	( 75,898,156)
(売買損益相当額)	(△ 50,611,409)
(G) 合計(D + E + F)	270,006,424
次期繰越損益金(G)	270,006,424
追加信託差損益金	25,286,747
(配当等相当額)	( 75,898,156)
(売買損益相当額)	(△ 50,611,409)
分配準備積立金	244,719,821
繰越損益金	△ 144

- (注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
- (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
- (注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程 (総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	198,866,305
(c) 収益調整金	75,898,156
(d) 分配準備積立金	45,853,516
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	320,617,977
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	320,617,977
(h) 受益権総口数	642,622,346口

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の第17期にかかる運用状況については、299～307ページをご参照ください。