

DCダイワ・ワールドアセット
(六つの羽／安定コース)
DCダイワ・ワールドアセット
(六つの羽／6分散コース)
DCダイワ・ワールドアセット
(六つの羽／成長コース)

(以下、上記のファンドを総称して「DCダイワ・ワールドアセット」といいます。)

運用報告書 (全体版)
第16期

(決算日 2022年1月11日)
(作成対象期間 2021年1月13日～2022年1月11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、内外の債券、リート（不動産投資信託）および株式に投資し、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長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/>
<3719>
<3720>
<3721>

★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／内外／資産複合	
信託期間	無期限（設定日：2006年1月12日）	
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長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	下記の各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
	ダイワ日本債券インデックス マザーファンド（BPI）	内外の公社債等（各種の債権や 資産を担保・裏付けとして発行 された証券を含みます。）
	ダイワ・グローバル REIT・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 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
	ダイワJ－REIT アクティブ・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
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	北米の金融商品取引所上場また は店頭登録の株式およびハイブ リッド優先証券（上場予定およ び店頭登録予定を含みます。）
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	欧州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 す。）
	ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド	アジア・オセアニアの金融商品 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。）
ダイワ好配当日本株マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株 式（上場予定を含みます。）	
組入制限	株式組入上限比率	
	外国債券インデックスマザーファンド	純資産総額の30％以下
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	純資産総額の10％以下
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	無制限
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	
投資信託証券組入上限比率		
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	無制限	
ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とし、原則として、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、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			合 成 指 数		株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不 動 産 投 信 指 数 先物比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
12期末(2018年1月10日)	16,400	0	5.4	17,340	5.2	17.7	0.5	49.9	28.8	－	3,190
13期末(2019年1月10日)	15,715	0	△ 4.2	16,858	△ 2.8	16.8	－	50.7	29.0	－	3,597
14期末(2020年1月10日)	17,628	0	12.2	19,069	13.1	18.0	－	50.3	28.9	0.3	4,925
15期末(2021年1月12日)	17,702	0	0.4	19,048	△ 0.1	19.0	－	49.4	28.6	0.4	5,838
16期末(2022年1月11日)	19,976	0	12.8	21,707	14.0	18.0	－	49.9	28.7	0.3	7,477

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注2) 合成指数は、下記の指数と配分比率をもとに、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。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。

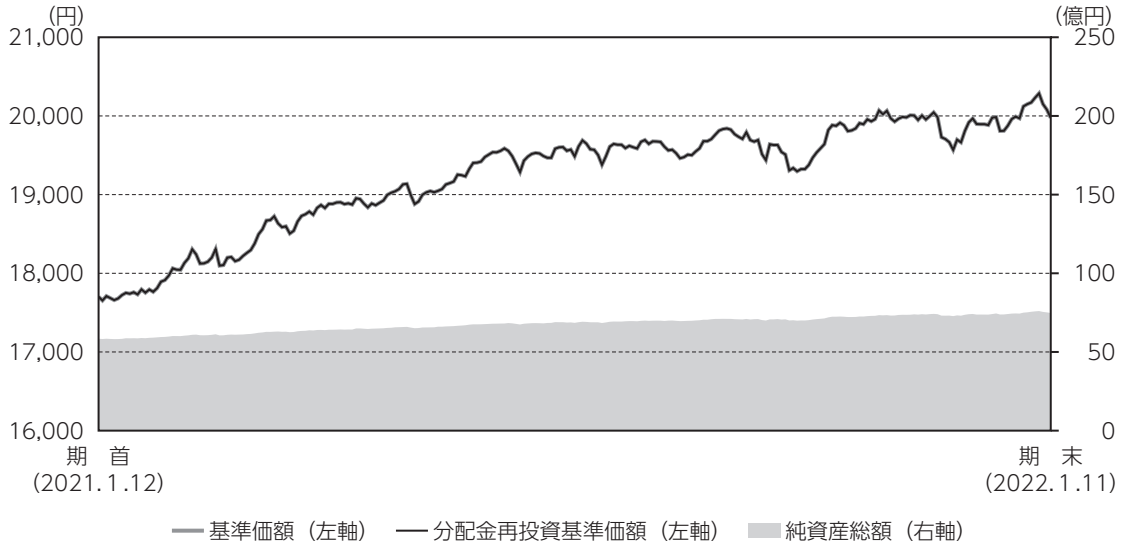
投資対象資産	指 数	配 分 比 率
海 外 債 券	F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）	25%
国 内 債 券	NOMURA－B P I 総合指数	25%
海 外 リ ー ト	S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）	15%
国 内 リ ー ト	東証 R E I T 指数（配当込み）	15%
海 外 株 式	M S C I コクサイ指数（グロス配当込み）	10%
国 内 株 式	T O P I X（配当込み）	10%

(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) 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) 先物比率は買建比率－売建比率です。
(注6) 公社債組入比率はハイブリッド優先証券を含みます。また、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。



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：17,702円

期 末：19,976円（分配金0円）

騰落率：12.8%（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	3.5%	24.6%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	△0.5%	24.5%
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	42.3%	15.1%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	18.4%	14.7%
ダイワ好配当日本株マザーファンド	18.8%	10.1%
ダイワ北米好配当株マザーファンド	32.9%	7.8%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	24.6%	2.0%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	9.5%	0.3%

■ 基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、内外のリートおよび株式の価格上昇などがプラス要因となり、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。

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）

年 月 日	基 準 価 額		合 成 指 数		株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
	騰 落 率		(参考指数)	騰 落 率					
(期首)2021年 1 月12日	円	%		%	%	%	%	%	%
	17,702	－	19,048	－	19.0	－	49.4	28.6	0.4
1 月末	17,794	0.5	19,222	0.9	18.2	－	49.5	29.2	0.4
2 月末	18,097	2.2	19,598	2.9	18.2	－	49.2	29.5	0.4
3 月末	18,784	6.1	20,283	6.5	18.4	－	49.0	29.4	0.3
4 月末	19,024	7.5	20,576	8.0	18.2	－	49.0	29.6	0.3
5 月末	19,247	8.7	20,808	9.2	18.0	－	49.8	29.0	0.3
6 月末	19,468	10.0	21,094	10.7	17.7	－	50.0	28.7	0.3
7 月末	19,591	10.7	21,256	11.6	17.7	－	50.3	28.6	0.3
8 月末	19,679	11.2	21,421	12.5	17.8	－	50.1	29.0	0.3
9 月末	19,510	10.2	21,238	11.5	17.9	－	50.4	28.3	0.3
10月末	19,957	12.7	21,772	14.3	17.6	－	49.6	29.1	0.3
11月末	19,706	11.3	21,489	12.8	17.3	－	50.5	28.4	0.3
12月末	20,171	13.9	22,009	15.5	17.7	－	49.7	29.0	0.3
(期末)2022年 1 月11日	19,976	12.8	21,707	14.0	18.0	－	49.9	28.7	0.3

(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

(2021.1.13～2022.1.11)

■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（債券価格は下落）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。その後いったん金利は低下しましたが、12月後半以降は、米国の早期利上げ観測が高まったことなどから上昇しました。

■国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇しました。

国内長期金利は、当作成期首より、日銀が2021年3月の金融政策決定会合で各種施策の点検を実施する際に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ため、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により、8月には一時ゼロ%程度まで低下しました。9月以降は、物資の供給制約の長期化を背景に世界的なインフレ懸念が高まったことで国内長期金利も0.1%程度まで上昇しました。しかし、11月に入り先進各国で金融引き締め動きが強まると、長期金利は将来的なインフレ鈍化や景気減速を織り込む動きとなり低下しました。12月後半以降は、米国の早期利上げ観測が高まったことなどから国内の長期金利も上昇しました。

■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、米国では、新型コロナウイルスのワクチン普及や米国リートの好調な業績発表などを好感し、上昇しました。欧州では、新型コロナウイルスの感染再拡大が懸念されたものの、ワクチン接種の進展や隔離措置の緩和などから、ドイツや英国を中心に上昇しました。アジア・オセアニアでは、業績期待の高まりを背景に、オーストラリアが上昇しました。

■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2021年2月までは、新型コロナウイルスの新規感染者数が減少に転じたことを好感し上昇基調が続きました。3月には国内外での金利上昇懸念から調整する局面もありましたが、4月に米国投資ファンドによる中堅オフィス銘柄へのT O B（投資口公開買い付け）が発

表され、国内リート市場の資産価値から見た割安感に注目が集まり、上昇しました。その後は、ワクチン接種の進展による経済活動の正常化期待から、上昇基調が7月まで続きましたが、8月に入ると、公募増資の増加による需給悪化で上値が重い展開となりました。10月初めには中国大手不動産会社の資金繰り懸念などから下落しましたが、割安感から国内金融機関とみられる買いが入り、国内リート市場は底堅い推移となりました。11月下旬には、新型コロナウイルスの新変異株の感染拡大懸念から下落しましたが、変異株への過度な懸念が後退すると上昇に転じました。2022年に入ると、米国金融政策の引き締めペース加速への懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まり、下落して当作成期末を迎えました。

■海外株式市況

・北米

北米株式市況は上昇しました。

北米株式市況は、当作成期首より、米国のバイデン新政権の大型経済対策への期待が高まったことや、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3月に大型経済対策が実現したことや、ワクチン接種が進んで6月にかけて新規感染者数が大幅に減少したこと、その後も堅調な経済指標の発表が続いたことなどにより、9月初めにかけて主要株価指数は断続的に史上最高値を更新しました。しかし、世界的なインフレ懸念を受けて米国の量的金融緩和の早期縮小観測が強まり金利が上昇したことや、債務上限問題および増税に対する不透明感が高まったことなどから、9月末にかけて株価は下落しました。10月に入ると、債務上限の適用が一時的に先送りされたことや、良好な企業決算の発表が相次いだことなどから、株価は再び上昇しました。その後は、C P I（消費者物価指数）の上昇加速を受けて早期利上げ観測が強まったことや、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一時的に下落する局面はあったものの、良好な経済指標の発表が相次いだことなどから、当作成期末にかけて株価は上昇基調を維持しました。

米国ハイブリッド優先証券市況は上昇しました。

米国ハイブリッド優先証券市況は、当作成期首より2021年2月にかけて、大規模な財政政策への期待から金利上昇が進み、下落しました。10月末にかけては、各国での金融政策引き締め懸念が和らいだことを背景に金利が低下したことがプラス要因となり、上昇しました。また、次期四半期の世界経済成長への期待も、投資家心理を支えました。11月は、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やF R B（米国連邦準備制度理事会）のタカ派寄りの姿勢などが重しとなり下落しました。当作成期末にかけては、新変異株への過度な懸念が後退したことなどにより反発しました。

・欧州

欧州株式市況は上昇しました。

欧州株式市場は、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展やE C B（欧州中央銀行）による緩和的な金融政策が下支えとなり、当作成期首から2021年8月にかけて上昇基調で推移しました。その後は、世界的にインフレの長期化が懸念されて長期金利が上昇したことや、新型コロナウイルスの新

変異株が発見されてリスク回避の動きが広がったことなどは相場の重しとなりましたが、欧州圏内において堅調な経済指標が確認されたほか、良好な企業決算発表などに後押しされ、当作成期末にかけておおむね上昇基調で推移しました。

・アジア・オセアニア

アジア・オセアニア株式市況は上昇しました。

アジア・オセアニア株式市況は、当作成期首から2021年5月初めにかけて、米国における大規模な財政政策に対する期待の高まりや、新型コロナウイルスのワクチン普及による世界経済の回復期待などが追い風となり、堅調な推移となりました。8月にかけては、米国におけるインフレの動向や早期利上げへの警戒感に加え、各国における感染拡大への懸念から軟調に推移しました。その後も、中国大手不動産会社の債務問題や米国金利の上昇に対する警戒感から、不安定な相場展開となりました。2021年末にかけては米国株高を支援材料に上昇したものの、当作成期末にかけては、米国の早期利上げに対する懸念から反落しました。

■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、米国の大型経済対策への期待が高まったことや、欧米に続き国内でも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、2021年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から、上値の重い展開となりました。しかし、8月下旬に国内の感染状況が改善したことを受けて上昇に転じると、9月初めには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急騰し、年初来高値を更新しました。10月に入ると、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不安などが懸念され、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保ち、単独で絶対安定多数を維持したことが好感され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、当作成期末にかけても上値の重い展開となりました。

■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。その後いったん円高となりましたが、12月後半以降は、米国の早期利上げ観測の高まりなどから円安が進みました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行い、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行います。

- | | |
|--------------------------------|---------------------------|
| ・外国債券インデックスマザーファンド | …純資産総額の25% |
| ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I） | …純資産総額の25% |
| ・ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド | …純資産総額の15% |
| ・ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド | …純資産総額の15% |
| ・ダイワ北米好配当株マザーファンド | } … 3 ファンド合計で純資産総額の10%（*） |
| ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ好配当日本株マザーファンド | …純資産総額の10% |

* 外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

■外国債券インデックスマザーファンド

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。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

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ってまいります。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、売買コストなどに十分配慮しつつ、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、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド

安定的な配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。外貨建資産の運用にあたっては、C & S に運用の指図にかかる権限を委託します。海外リートへの投資にあたっては、個別銘柄の投資価値を分析して、配当利回り、期待される成長性、割安度などを勘案し投資銘柄を選定し、分散投資を行います。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

個別銘柄ごとの流動性を勘案しつつ国内リートに幅広く分散投資を行い、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。ポートフォリオ構築にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資します。

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、Ｃ＆Ｓに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行ってまいります。普通株式については、今後も企業のファンダメンタルズ、キャッシュフローおよび配当の成長、配当利回り、バリュエーションなどを考慮しながら、ポートフォリオを構築します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築します。

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・アイルランドに運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行ってまいります。銘柄選定では、収益基盤が強固で安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

当ファンドでは、主としてオーストラリアや中国（香港）、台湾、韓国を中心にアジア・オセアニア地域に上場する株式に投資し、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。ポートフォリオの構築にあたっては、各国の投資比率の分散に配慮しつつ、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮して銘柄選択を行います。

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

世界的な金融緩和政策による過剰流動性から、これまで一部の成長株が株式市場をけん引し、当ファンドが注目する高配当利回り株などの割安株の出遅れが続いてまいりましたが、グローバル経済の正常化期待を背景にして割安株の見直しが徐々に進んでいくと考えます。個別銘柄の選別にあたりましては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、中長期的な業績の回復・成長が期待される銘柄や、配当政策・自社株買いなどの株主還元策を向上させる銘柄などに注目してまいります。

※Ｃ＆Ｓ：コーヘン＆スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

※アムンディ・アイルランド：アムンディ・アイルランド・リミテッド

ポートフォリオについて

(2021.1.13～2022.1.11)

■当ファンド

当ファンドは、各マザーファンドの受益証券を通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行いました。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、以下の標準組入比率をめどに投資を行いました。

- | | |
|--------------------------------|---------------------------|
| ・外国債券インデックスマザーファンド | …純資産総額の25% |
| ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I） | …純資産総額の25% |
| ・ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド | …純資産総額の15% |
| ・ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド | …純資産総額の15% |
| ・ダイワ北米好配当株マザーファンド | } … 3 ファンド合計で純資産総額の10%（*） |
| ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ好配当日本株マザーファンド | …純資産総額の10% |

* 外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分しました。

■外国債券インデックスマザーファンド

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。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

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99%前後の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、ファンドへ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応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

■ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、C & Sに運用の指図にかかる権限を委託しております。当ファンドでは、信託財産の中長期的な成長をめざし保有不動産の価値などと比べて魅力的であると考えられる銘柄に着目するとともに、安定的な配当利回りの確保をめざしてポートフォリオを構築しました。国・地域別配分では大きなリスクを取らず、各地域に分散して投資を行いました。米国では、移住増加などから新規物件供給を上回る需要が見込まれた貸倉庫や、需給改善が期待されたヘルスケアリートなどに注目しました。欧州では、安定したキャッシュフロー成長が見込まれるセクターである貸倉庫を保有するリートやヘルスケアリートに、アジア・オセアニアでは、オーストラリアの産業施設リートなどに注目しました。

■ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

リートの組入比率につきましては、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ており、おおむね95～98%台程度で推移させました。また、東証REIT指数先物への投資も行い、先物と合計で95～100%程度で推移させました。リート銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資しました。個別銘柄では、当作成期を通じて見ると、三菱地所物流リート、ジャパンリアルエステイト、森ヒルズリートなどを東証REIT指数と比較してオーバーウエートとし、大和証券リビング、日本ロジスティクスファンド、NTT都市開発リートなどをアンダーウエートとしました。

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、C & Sに運用の指図にかかる権限を委託しております。有価証券の組入比率は、株式を74～83%程度、ハイブリッド優先証券等を14～20%程度としました。普通株式については、企業のファンダメンタルズやキャッシュフローの成長性、配当利回りやバリュエーション等を考慮し、キャッシュフローを生み出し、魅力的な配当利回りを将来にわたって提供できると考える銘柄を中心としたポートフォリオとしました。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心としたポートフォリオとしました。

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、アムンディ・アイルランドに運用の指図にかかる権限を委託しております。株式組入比率は高位に維持しました。銘柄選定にあたって、アムンディ・アイルランドは、収益基盤が強固で安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資しました。

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

オーストラリアや中国（香港）、台湾、韓国を中心に、高い利益成長が見込まれた銘柄や予想配当利回りが高いと判断された銘柄などを組み入れました。セクター別では、高い配当利回りが期待できた金融や高い利益成長見込みから情報技術などを高位に組み入れました。

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

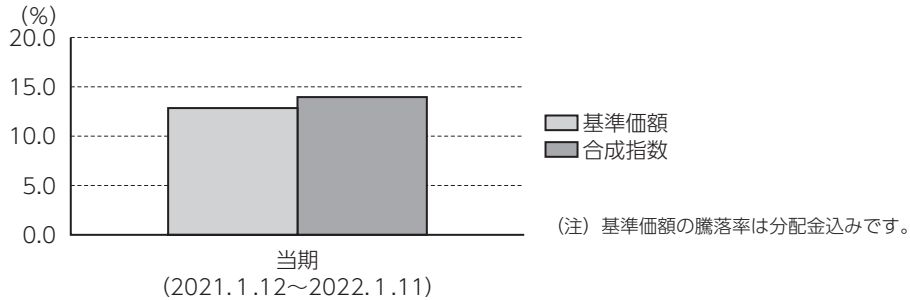
株式等の組入比率は、おおむね高位で推移させました。業種構成は輸送用機器、小売業、その他金融業などの比率を引き上げた一方、医薬品、機械、非鉄金属などの比率を引き下げました。個別銘柄では、業績見通しや配当利回りの水準などを総合的に勘案して、三菱商事、しまむら、大日本印刷などを買付けました。一方で、武田薬品、アドバンテスト、三井物産などを売却しました。

* マザーファンドのベンチマークおよび参考指数は以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク（参考指数）
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）（ベンチマーク）
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	NOMURA-BPI総合指数（ベンチマーク）
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	S&P先進国REIT指数（除く日本、円換算）（参考指数）
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	東証REIT指数（配当込み）（参考指数）
ダイワ北米好配当株マザーファンド	MSCIノースアメリカ指数（配当込み、円換算）（参考指数）
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	MSCIヨーロッパ指数（配当込み、円換算）（参考指数）
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	MSCIパシフィック指数（除く日本、配当込み、円換算）（参考指数）
ダイワ好配当日本株マザーファンド	TOPIX（参考指数）

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。
以下のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数（合成指数）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（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2021年1月13日 ～2022年1月11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)	—
翌期繰越分配可能額	(円)	10,397

(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。

※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等です。



今後の運用方針

■当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行い、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行います。

- | | |
|--------------------------------|---------------------------|
| ・外国債券インデックスマザーファンド | …純資産総額の25% |
| ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I） | …純資産総額の25% |
| ・ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド | …純資産総額の15% |
| ・ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド | …純資産総額の15% |
| ・ダイワ北米好配当株マザーファンド | } … 3 ファンド合計で純資産総額の10%（*） |
| ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ好配当日本株マザーファンド | …純資産総額の10% |

* 外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

■外国債券インデックスマザーファンド

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。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

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ってまいります。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、売買コストなどに十分配慮しつつ、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、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド

安定的な配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。外貨建資産の運用にあたっては、C & S に運用の指図にかかる権限を委託します。海外リートへの投資にあたっては、個別銘柄の投資価値を分析して、配当利回り、期待される成長性、割安度などを勘案し投資銘柄を選定し、分散投資を行います。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

個別銘柄ごとの流動性を勘案しつつ国内リートに幅広く分散投資を行い、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。ポートフォリオ構築にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資します。

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、Ｃ＆Ｓに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行ってまいります。普通株式については、今後も企業のファンダメンタルズ、キャッシュフローおよび配当の成長、配当利回り、バリュエーションなどを考慮しながら、ポートフォリオを構築します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築します。

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・アイルランドに運用の指図にかかる権限を委託し、今後の運用を行ってまいります。銘柄選定では、収益基盤が強固で安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

当ファンドでは、主としてオーストラリアや中国（香港）、台湾、韓国を中心にアジア・オセアニア地域に上場する株式に投資し、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。ポートフォリオの構築にあたっては、各国の投資比率の分散に配慮しつつ、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮して銘柄選択を行います。

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

株式等の組入比率は、高位を維持する方針です。個別銘柄の選別にあたりましては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、中長期的な業績回復・成長の動向やＰＥＲ（株価収益率）・ＰＢＲ（株価純資産倍率）などのバリュエーション指標、配当・自社株買いなどの株主還元政策や資本効率の向上に対する経営姿勢などに注目してまいります。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2021.1.13~2022.1.11)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	190円	0.987%	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19,246円です。
（投 信 会 社）	(95)	(0.494)	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）	(84)	(0.439)	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）	(11)	(0.055)	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	10	0.051	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)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.001)	
（投資信託証券）	(7)	(0.037)	
有 価 証 券 取 引 税	2	0.009	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)	(0.000)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(2)	(0.008)	
そ の 他 費 用	3	0.016	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)	(0.009)	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）	(2)	(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)	(△0.002)	税金の戻し、信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	204	1.062	

(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。

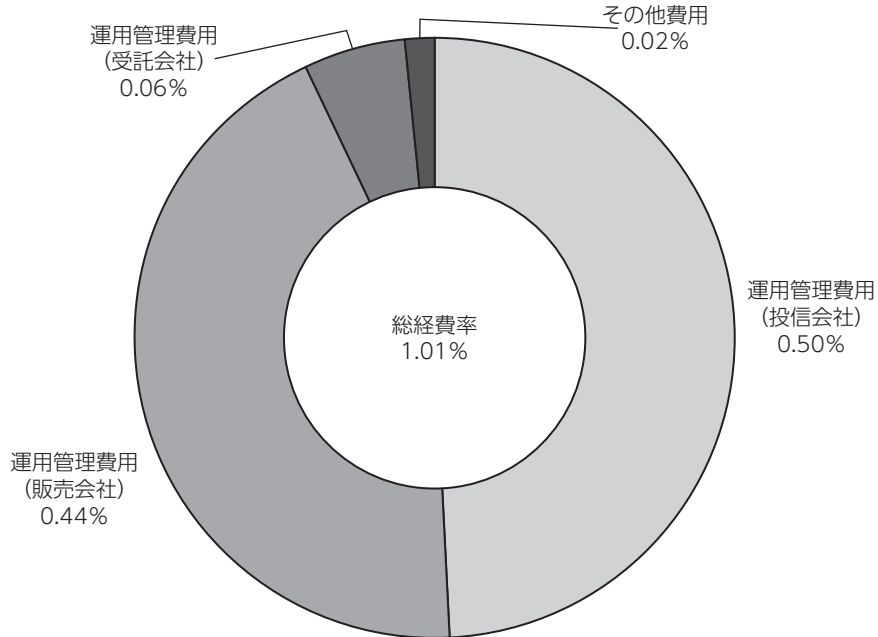
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

(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1.01%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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	118,095	365,181	3,261	10,211
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (BPI)	342,550	441,809	15,130	19,566
ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド	11,101	37,193	35,427	119,461
ダイワ好配当日本株 マザーファンド	24,763	82,360	13,767	44,711
ダイワ北米好配当株 マザーファンド	5,910	23,972	9,127	35,792
ダイワ欧州好配当株 マザーファンド	4,915	9,902	8,232	16,717
ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド	929	2,662	1,558	4,446
ダイワJ-REIT アクティブ・マザーファンド	35,198	125,465	18,950	63,603

(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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

項 目	当 期
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	12,718,848千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,227,269千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.83
	ダイワ北米好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	3,555,413千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,969,088千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.19
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	88,321千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,353,941千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.06
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	500,884千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	679,663千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.73

(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) 外国債券インデックス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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(3) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI) における当作成期中の利害関係人との取引状況

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	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
公社債	百万円 15,250	百万円 247	% 1.6	百万円 3,327	百万円 302	% 9.1
コール・ローン	48,385	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合5.2%

※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。

(4) ダイワ・グローバルREIT・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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(5) ダイワ好配当日本株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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	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 5,007	百万円 1,318	% 26.3	百万円 7,711	百万円 1,624	% 21.1
コール・ローン	87,754	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合4.3%

(6) ダイワ北米好配当株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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(7) ダイワ欧州好配当株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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(8) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(9) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

決 算 期	期					
	当			期		
区 分	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 101,300	百万円 28,568	% 28.2	百万円 82,161	百万円 25,627	% 31.2
不動産投信 指数先物取引	10,112	－	－	10,934	－	－
コール・ローン	740,248	－	－	－	－	－

(注) 平均保有割合0.8%

(10) 利害関係人の発行する有価証券等

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

種 類	当 期		
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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 188	百万円 －	百万円 1,553

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(11) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

種 類	当 期
	買 付 額
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド
投資信託証券	百万円 6,927
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)
公社債	百万円 300

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(12) 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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	3,434千円
うち利害関係人への支払額 (B)	782千円
(B)／(A)	22.8%

(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、大和証券オフィス投資法人です。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	評 価 額
	口 数	口 数	
	千口	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	471,628	586,462	1,835,687
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,101,820	1,429,239	1,835,143
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	325,929	301,604	1,131,680
ダイワ好配当日本株マザーファンド	203,970	214,965	756,593
ダイワ北米好配当株マザーファンド	132,401	129,184	582,285
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	70,482	67,165	147,092
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	9,134	8,505	25,211
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	299,003	315,250	1,096,505

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年1月11日現在

項 目	当 期 末	評 価 額 比 率
	評 価 額	
	千円	%
外国債券インデックスマザーファンド	1,835,687	24.4
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,835,143	24.4
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	1,131,680	15.1
ダイワ好配当日本株マザーファンド	756,593	10.1
ダイワ北米好配当株マザーファンド	582,285	7.7
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	147,092	2.0
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	25,211	0.3
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	1,096,505	14.6
コール・ローン等、その他	107,193	1.4
投資信託財産総額	7,517,394	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11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝115.34円、1カナダ・ドル＝91.08円、1オーストラリア・ドル＝82.93円、1香港ドル＝14.79円、1シンガポール・ドル＝85.12円、1ニュージーランド・ドル＝78.09円、1台湾ドル＝4.169円、1イギリス・ポンド＝156.63円、1イスラエル・シェケル＝36.781円、1スイス・フラン＝124.45円、1デンマーク・クローネ＝17.57円、1ノルウェー・クローネ＝13.01円、1スウェーデン・クローネ＝12.67円、1メキシコ・ペソ＝5.664円、100韓国ウォン＝9.66円、1オフショア人民元＝18.079円、1マレーシア・リンギット＝27.463円、1ポーランド・ズロチ＝28.781円、1ユーロ＝130.70円です。
(注3) 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 (233,707,540千円) の投資信託財産総額 (235,394,968千円) に対する比率は、99.3%です。
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (102,038,637千円) の投資信託財産総額 (105,149,825千円) に対する比率は、97.0%です。
ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (4,142,116千円) の投資信託財産総額 (4,295,487千円) に対する比率は、96.4%です。
ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (1,469,107千円) の投資信託財産総額 (1,473,315千円) に対する比率は、99.7%です。
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (690,993千円) の投資信託財産総額 (699,329千円) に対する比率は、98.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年1月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	7,517,394,585円
コール・ローン等	102,247,468
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,835,687,301
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)(評価額)	1,835,143,996
ダイワ・グローバルR E I T ・マザーファンド(評価額)	1,131,680,787
ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額)	756,593,935
ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額)	582,285,949
ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額)	147,092,664
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド(評価額)	25,211,063
ダイワJーR E I Tアクティブ・マザーファンド(評価額)	1,096,505,422
未収入金	4,946,000
(B) 負債	40,089,193
未払解約金	4,150,367
未払信託報酬	35,641,895
その他未払費用	296,931
(C) 純資産総額(A－B)	7,477,305,392
元本	3,743,206,897
次期繰越損益金	3,734,098,495
(D) 受益権総口数	3,743,206,897口
1万口当り基準価額(C／D)	19,976円

* 期首における元本額は3,298,446,758円、当作成期間中における追加設定元本額は842,864,166円、同解約元本額は398,104,027円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は19,976円です。

■損益の状況

当期 自2021年1月13日 至2022年1月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 19,554円
受取利息	931
支払利息	△ 20,485
(B) 有価証券売買損益	792,757,025
売買益	857,629,627
売買損	△ 64,872,602
(C) 信託報酬等	△ 67,550,714
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	725,186,757
(E) 前期繰越損益金	709,605,237
(F) 追加信託差損益金	2,299,306,501
(配当等相当額)	(2,457,016,855)
(売買損益相当額)	(△ 157,710,354)
(G) 合計(D＋E＋F)	3,734,098,495
次期繰越損益金(G)	3,734,098,495
追加信託差損益金	2,299,306,501
(配当等相当額)	(2,457,016,855)
(売買損益相当額)	(△ 157,710,354)
分配準備積立金	1,434,811,548
繰越損益金	△ 19,554

(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。
(注4) 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：8,394,720円（未監査）

■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	725,187,318
(c) 収益調整金	2,457,016,855
(d) 分配準備積立金	709,624,230
(e) 当期分配可能額(a＋b＋c＋d)	3,891,828,403
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e－f)	3,891,828,403
(h) 受益権総口数	3,743,206,897口

F T S E 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。

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			合 成 指 数		株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不 動 産 投 信 指 数 先物比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
12期末(2018年1月10日)	17,554	0	7.9	18,170	7.7	29.4	0.8	34.4	31.9	－	3,894
13期末(2019年1月10日)	16,467	0	△ 6.2	17,381	△ 4.3	28.0	－	35.4	32.3	－	4,290
14期末(2020年1月10日)	18,888	0	14.7	20,196	16.2	29.9	－	34.8	32.1	0.3	5,783
15期末(2021年1月12日)	18,830	0	△ 0.3	20,272	0.4	31.3	－	34.0	31.5	0.5	6,484
16期末(2022年1月11日)	21,960	0	16.6	23,850	17.6	29.9	－	34.5	31.7	0.3	8,604

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 合成指数は、下記の指数と配分比率をもとに、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。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。

投資対象資産	指 数	配 分 比 率
海 外 債 券	F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）	16.7%
国 内 債 券	N O M U R A - B P I 総合指数	16.7%
海 外 リ ー ト	S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）	16.7%
国 内 リ ー ト	東証 R E I T 指数（配当込み）	16.7%
海 外 株 式	M S C I コクサイ指数（グロス配当込み）	16.7%
国 内 株 式	T O P I X（配当込み）	16.7%

(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) 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。

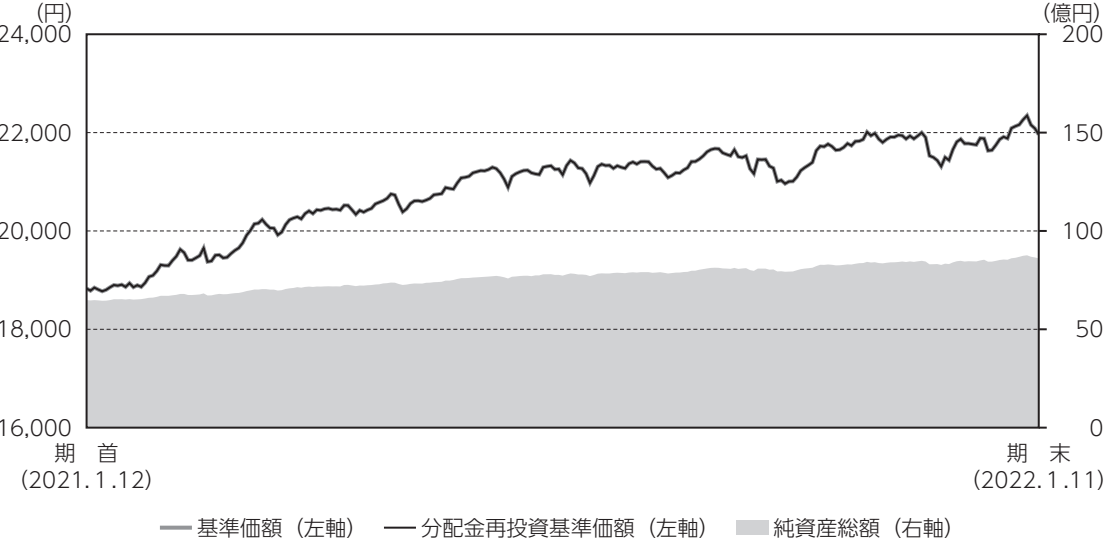
(注5) 先物比率は買建比率－売建比率です。

(注6) 公社債組入比率はハイブリッド優先証券を含みます。また、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。



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：18,830円
期 末：21,960円（分配金0円）
騰落率：16.6%（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
ダイワ好配当日本株マザーファンド	18.8%	16.8%
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	42.3%	16.7%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	△0.5%	16.3%
外国債券インデックスマザーファンド	3.5%	16.3%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	18.4%	16.2%
ダイワ北米好配当株マザーファンド	32.9%	12.9%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	24.6%	3.3%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	9.5%	0.6%

■ 基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、内外のリートおよび株式の価格上昇などがプラス要因となり、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。

年 月 日	基 準 価 額		合 成 指 数		株 式 組 入 比	株 式 先 物 率 比	公 社 債 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率					
(期首)2021年 1 月12日	円	%		%	%	%	%	%	%
	18,830	－	20,272	－	31.3	－	34.0	31.5	0.5
1 月末	18,897	0.4	20,442	0.8	30.1	－	34.3	32.4	0.5
2 月末	19,373	2.9	20,991	3.5	29.9	－	34.1	32.5	0.5
3 月末	20,287	7.7	21,898	8.0	30.2	－	33.9	32.3	0.4
4 月末	20,582	9.3	22,259	9.8	30.1	－	33.9	32.6	0.3
5 月末	20,864	10.8	22,536	11.2	29.9	－	34.2	32.2	0.4
6 月末	21,160	12.4	22,934	13.1	29.5	－	34.6	31.9	0.3
7 月末	21,273	13.0	23,086	13.9	29.6	－	34.8	31.8	0.3
8 月末	21,412	13.7	23,364	15.3	29.5	－	34.8	32.2	0.3
9 月末	21,279	13.0	23,194	14.4	29.8	－	35.0	31.3	0.3
10月末	21,822	15.9	23,873	17.8	29.2	－	34.1	32.3	0.3
11月末	21,497	14.2	23,497	15.9	28.9	－	35.0	31.7	0.3
12月末	22,161	17.7	24,214	19.4	29.4	－	34.2	32.1	0.3
(期末)2022年 1 月11日	21,960	16.6	23,850	17.6	29.9	－	34.5	31.7	0.3

(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

(2021.1.13～2022.1.11)

4～6 ページをご参照ください。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行い、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行います。

- | | |
|--------------------------------|-----------------------------|
| ・外国債券インデックスマザーファンド | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I） | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ北米好配当株マザーファンド | } … 3 ファンド合計で純資産総額の16.7%（*） |
| ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ好配当日本株マザーファンド | …純資産総額の16.7% |

* 外国株式の3 ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

- | | |
|--------------------------------|--------------------|
| ■外国債券インデックスマザーファンド | } 7～8 ページをご参照ください。 |
| ■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I） | |
| ■ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド | |
| ■ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド | |
| ■ダイワ北米好配当株マザーファンド | |
| ■ダイワ欧州好配当株マザーファンド | |
| ■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | |
| ■ダイワ好配当日本株マザーファンド | |

ポートフォリオについて

(2021.1.13～2022.1.11)

■当ファンド

当ファンドは、各マザーファンドの受益証券を通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行いました。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、以下の標準組入比率をめどに投資を行いました。

- | | |
|--------------------------------|-----------------------------|
| ・外国債券インデックスマザーファンド | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I） | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ・グローバル R E I T・マザーファンド | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ北米好配当株マザーファンド | } … 3 ファンド合計で純資産総額の16.7%（*） |
| ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ好配当日本株マザーファンド | …純資産総額の16.7% |

* 外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分しました。

■外国債券インデックスマザーファンド

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

■ダイワ・グローバル R E I T・マザーファンド

■ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

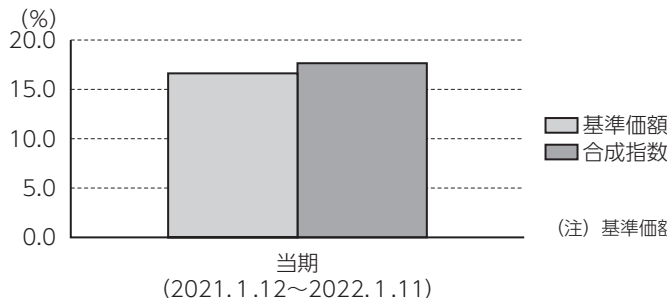
■ダイワ好配当日本株マザーファンド

9～11ページをご参照ください。

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。

以下のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数（合成指数）との騰落率の対比です。



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

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	
	2021年1月13日	～2022年1月11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）	—
翌期繰越分配可能額	（円）	12,680

（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。
※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等です。



今後の運用方針

当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行い、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行います。

- ・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の16.7%
- ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I） …純資産総額の16.7%
- ・ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド …純資産総額の16.7%
- ・ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド …純資産総額の16.7%
- ・ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド } …3 ファンド合計で純資産総額の16.7%（*）
- ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
- ・ダイワ好配当日本株マザーファンド …純資産総額の16.7%

* 外国株式の3 ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

- 外国債券インデックスマザーファンド
- ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）
- ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド
- ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド
- ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
- ダイワ好配当日本株マザーファンド

13～14ページをご参照ください。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2021.1.13~2022.1.11)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	241円	1.152%	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20,886円です。
（投 信 会 社）	(121)	(0.581)	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）	(108)	(0.516)	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）	(11)	(0.055)	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	13	0.064	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）	(4)	(0.021)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.002)	
（投資信託証券）	(8)	(0.041)	
有価証券取引税	2	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
（株 式）	(0)	(0.001)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(2)	(0.009)	
そ の 他 費 用	4	0.018	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)	(0.011)	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）	(2)	(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)	(△0.002)	税金の戻し、信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	260	1.243	

（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。

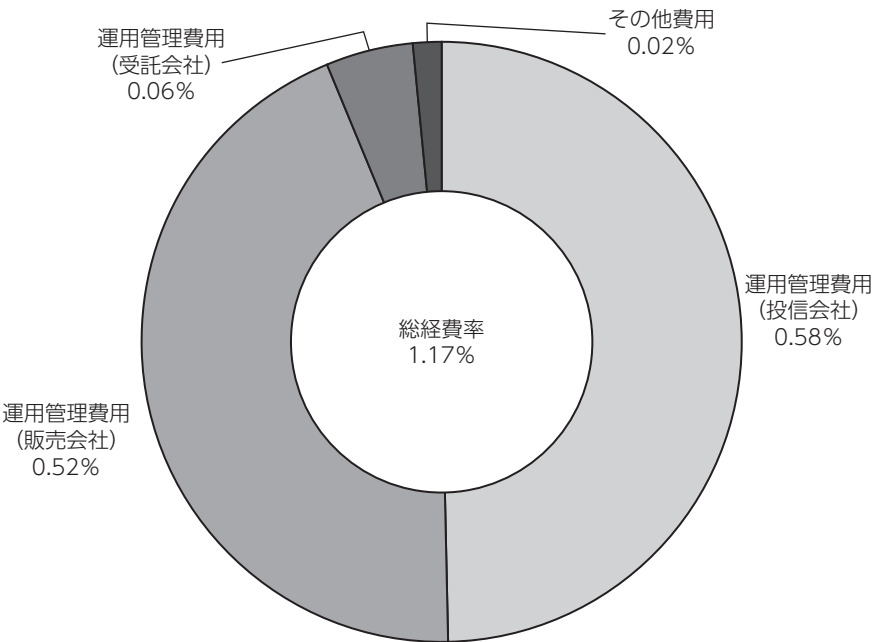
（注3）各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

（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1.17%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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	101,998	315,493	2,337	7,287
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (BPI)	286,750	369,877	8,261	10,689
ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド	17,521	55,803	31,279	105,694
ダイワ好配当日本株 マザーファンド	60,287	199,302	23,068	74,223
ダイワ北米好配当株 マザーファンド	17,165	68,939	13,038	50,427
ダイワ欧州好配当株 マザーファンド	10,625	21,061	11,708	23,546
ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド	2,322	6,637	2,709	7,692
ダイワJ-REIT アクティブ・マザーファンド	54,521	193,188	18,847	62,361

(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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

項 目	当 期
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	12,718,848千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,227,269千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.83
	ダイワ北米好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	3,555,413千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,969,088千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.19
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	88,321千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,353,941千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.06
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	500,884千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	679,663千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.73

(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) 外国債券インデックス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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(3) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI) における当作成期中の利害関係人との取引状況

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	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
公社債	百万円 15,250	百万円 247	% 1.6	百万円 3,327	百万円 302	% 9.1
コール・ローン	48,385	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合3.9%

※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。

(4) ダイワ・グローバルREIT・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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(5) ダイワ好配当日本株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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	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 5,007	百万円 1,318	% 26.3	百万円 7,711	百万円 1,624	% 21.1
コール・ローン	87,754	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合8.0%

(6) ダイワ北米好配当株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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(7) ダイワ欧州好配当株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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(8) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(9) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

決 算 期	期					
	当			期		
区 分	買付額等	うち利害関係人との取引状況	B／A	売付額等	うち利害関係人との取引状況	D／C
	A	B		C	D	
投資信託証券	百万円 101,300	百万円 28,568	% 28.2	百万円 82,161	百万円 25,627	% 31.2
不動産投信 指数先物取引	10,112	－	－	10,934	－	－
コール・ローン	740,248	－	－	－	－	－

(注) 平均保有割合1.1%

(10) 利害関係人の発行する有価証券等

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

種 類	当 期		
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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 188	百万円 －	百万円 1,553

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(11) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

種 類	当 期
	買 付 額
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド
投資信託証券	百万円 6,927
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)
公社債	百万円 300

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(12) 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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	4,874千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1,084千円
(B)／(A)	22.3%

(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、大和証券オフィス投資法人です。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	評 価 額
	口 数	口 数	
	千口	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	348,917	448,579	1,404,097
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	815,724	1,094,214	1,404,971
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	396,866	383,107	1,437,497
ダイワ好配当日本株マザーファンド	373,184	410,404	1,444,458
ダイワ北米好配当株マザーファンド	242,195	246,321	1,110,268
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	129,181	128,098	280,535
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	16,756	16,368	48,517
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	365,816	401,490	1,396,464

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年1月11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マザーファンド	1,404,097		% 16.2
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,404,971		16.2
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	1,437,497		16.6
ダイワ好配当日本株マザーファンド	1,444,458		16.7
ダイワ北米好配当株マザーファンド	1,110,268		12.8
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	280,535		3.2
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	48,517		0.6
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	1,396,464		16.1
コール・ローン等、その他	137,028		1.6
投資信託財産総額	8,663,838		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11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝115.34円、1カナダ・ドル＝91.08円、1オーストラリア・ドル＝82.93円、1香港ドル＝14.79円、1シンガポール・ドル＝85.12円、1ニュージーランド・ドル＝78.09円、1台湾ドル＝4.169円、1イギリス・ポンド＝156.63円、1イスラエル・シェケル＝36.781円、1スイス・フラン＝124.45円、1デンマーク・クローネ＝17.57円、1ノルウェー・クローネ＝13.01円、1スウェーデン・クローネ＝12.67円、1メキシコ・ペソ＝5.664円、100韓国ウォン＝9.66円、1オフショア人民元＝18.079円、1マレーシア・リンギット＝27.463円、1ポーランド・ズロチ＝28.781円、1ユーロ＝130.70円です。

(注3) 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 (233,707,540千円) の投資信託財産総額 (235,394,968千円) に対する比率は、99.3%です。
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (102,038,637千円) の投資信託財産総額 (105,149,825千円) に対する比率は、97.0%です。
ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (4,142,116千円) の投資信託財産総額 (4,295,487千円) に対する比率は、96.4%です。
ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (1,469,107千円) の投資信託財産総額 (1,473,315千円) に対する比率は、99.7%です。
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (690,993千円) の投資信託財産総額 (699,329千円) に対する比率は、98.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年1月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	8,663,838,896円
コール・ローン等	126,687,968
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,404,097,516
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド(B P I)(評価額)	1,404,971,129
ダイワ・グローバルR E I T・ マザーファンド(評価額)	1,437,497,526
ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額)	1,444,458,615
ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額)	1,110,268,127
ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額)	280,535,384
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド(評価額)	48,517,037
ダイワJーR E I Tアクティブ・ マザーファンド(評価額)	1,396,464,594
未収入金	10,341,000
(B) 負債	59,819,097
未払解約金	12,100,252
未払信託報酬	47,380,504
その他未払費用	338,341
(C) 純資産総額(A－B)	8,604,019,799
元本	3,918,064,052
次期繰越損益金	4,685,955,747
(D) 受益権総口数	3,918,064,052口
1万口当り基準価額(C／D)	21,960円

* 期首における元本額は3,443,846,915円、当作成期間中における追加設定元本額は906,065,649円、同解約元本額は431,848,512円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は21,960円です。

■損益の状況

当期 自2021年1月13日 至2022年1月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 22,947円
受取利息	1,048
支払利息	△ 23,995
(B) 有価証券売買損益	1,133,614,766
売買益	1,217,054,119
売買損	△ 83,439,353
(C) 信託報酬等	△ 88,901,501
(D) 当期損益金(A + B + C)	1,044,690,318
(E) 前期繰越損益金	845,140,704
(F) 追加信託差損益金	2,796,124,725
(配当等相当額)	(3,078,586,002)
(売買損益相当額)	(△ 282,461,277)
(G) 合計(D + E + F)	4,685,955,747
次期繰越損益金(G)	4,685,955,747
追加信託差損益金	2,796,124,725
(配当等相当額)	(3,078,586,002)
(売買損益相当額)	(△ 282,461,277)
分配準備積立金	1,889,853,969
繰越損益金	△ 22,947

(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。
(注4) 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：12,533,552円（未監査）

■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	1,044,691,555
(c) 収益調整金	3,078,586,002
(d) 分配準備積立金	845,162,414
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	4,968,439,971
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e－f)	4,968,439,971
(h) 受益権総口数	3,918,064,052口

F T S E 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。

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			合 成 指 数		株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
12期末(2018年1月10日)	18,809	0	11.1	19,164	10.9	43.8	1.2	13.0	38.1	－	4,081
13期末(2019年1月10日)	17,206	0	△ 8.5	17,971	△ 6.2	41.5	－	13.7	39.5	－	4,424
14期末(2020年1月10日)	20,384	0	18.5	21,668	20.6	44.8	－	13.1	38.5	0.4	6,327
15期末(2021年1月12日)	20,216	0	△ 0.8	21,740	0.3	46.5	－	12.4	37.6	0.6	7,237
16期末(2022年1月11日)	24,728	0	22.3	26,787	23.2	44.7	－	12.8	37.9	0.4	10,544

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注2) 合成指数は、下記の指数と配分比率をもとに、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。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。

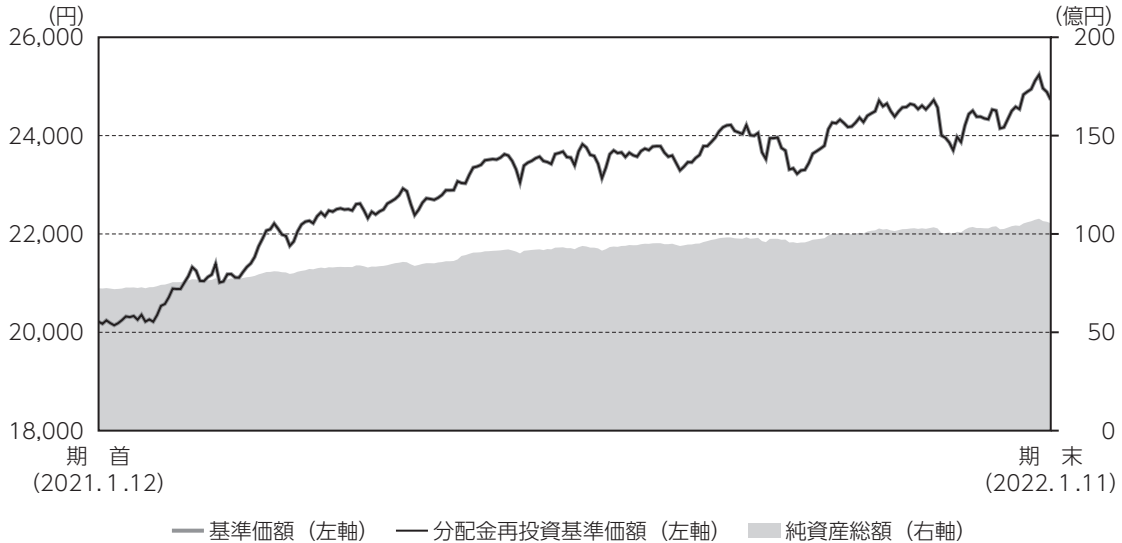
投資対象資産	指 数	配 分 比 率
海 外 債 券	F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）	5%
国 内 債 券	NOMURA－B P I 総合指数	5%
海 外 リ ー ト	S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）	20%
国 内 リ ー ト	東証 R E I T 指数（配当込み）	20%
海 外 株 式	M S C I コクサイ指数（グロス配当込み）	25%
国 内 株 式	T O P I X（配当込み）	25%

(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) 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) 先物比率は買建比率－売建比率です。
(注6) 公社債組入比率はハイブリッド優先証券を含みます。また、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。



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：20,216円

期 末：24,728円（分配金0円）

騰落率：22.3%（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
ダイワ好配当日本株マザーファンド	18.8%	25.1%
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	42.3%	19.9%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	18.4%	19.4%
ダイワ北米好配当株マザーファンド	32.9%	19.2%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	24.6%	4.9%
外国債券インデックスマザーファンド	3.5%	4.9%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	△0.5%	4.9%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	9.5%	0.8%

■ 基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、内外のリートおよび株式の価格上昇などがプラス要因となり、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。

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

年 月 日	基 準 価 額		合 成 指 数		株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
	騰 落 率		(参考指数)	騰 落 率					
(期首)2021年 1 月12日	円 20,216	% －	21,740	% －	% 46.5	% －	% 12.4	% 37.6	% 0.6
1 月末	20,262	0.2	21,924	0.8	45.0	－	12.6	38.9	0.6
2 月末	21,011	3.9	22,744	4.6	44.5	－	12.7	38.9	0.6
3 月末	22,268	10.2	23,990	10.3	45.0	－	12.5	38.4	0.4
4 月末	22,662	12.1	24,468	12.5	45.1	－	12.4	38.7	0.4
5 月末	23,036	13.9	24,812	14.1	45.0	－	12.4	38.3	0.4
6 月末	23,462	16.1	25,395	16.8	44.3	－	12.9	38.1	0.4
7 月末	23,565	16.6	25,535	17.5	44.4	－	13.0	38.2	0.4
8 月末	23,787	17.7	25,986	19.5	44.2	－	13.2	38.6	0.4
9 月末	23,697	17.2	25,824	18.8	44.6	－	13.2	37.6	0.4
10月末	24,403	20.7	26,741	23.0	43.5	－	12.7	38.5	0.4
11月末	23,957	18.5	26,215	20.6	43.5	－	13.1	38.2	0.4
12月末	24,945	23.4	27,252	25.4	43.8	－	12.7	38.3	0.4
(期末)2022年 1 月11日	24,728	22.3	26,787	23.2	44.7	－	12.8	37.9	0.4

(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

(2021.1.13～2022.1.11)

4～6 ページをご参照ください。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行い、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行います。

- | | |
|----------------------------|-------------------------|
| ・外国債券インデックスマザーファンド | …純資産総額の5% |
| ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI） | …純資産総額の5% |
| ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | …純資産総額の20% |
| ・ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | …純資産総額の20% |
| ・ダイワ北米好配当株マザーファンド | } …3ファンド合計で純資産総額の25%（*） |
| ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ好配当日本株マザーファンド | …純資産総額の25% |

*外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

■外国債券インデックスマザーファンド

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

■ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

■ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

7～8 ページをご参照ください。

ポートフォリオについて

(2021.1.13～2022.1.11)

■当ファンド

当ファンドは、各マザーファンドの受益証券を通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行いました。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、以下の標準組入比率をめどに投資を行いました。

- | | |
|----------------------------|-------------------------|
| ・外国債券インデックスマザーファンド | …純資産総額の5% |
| ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI） | …純資産総額の5% |
| ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド | …純資産総額の20% |
| ・ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド | …純資産総額の20% |
| ・ダイワ北米好配当株マザーファンド | } …3ファンド合計で純資産総額の25%（*） |
| ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ好配当日本株マザーファンド | …純資産総額の25% |

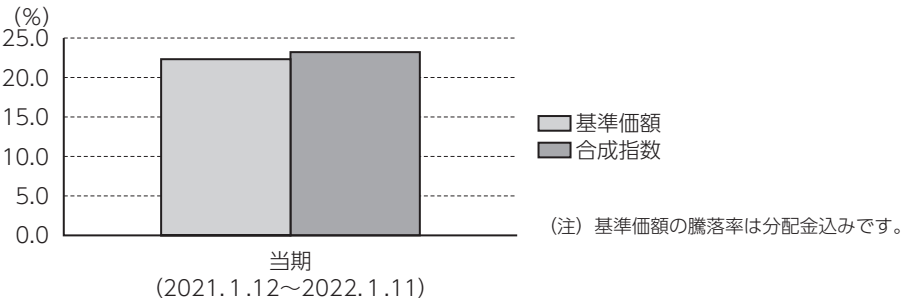
* 外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分しました。

- 外国債券インデックスマザーファンド
- ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）
- ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド
- ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド
- ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
- ダイワ好配当日本株マザーファンド

9～11ページをご参照ください。

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。
以下のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数（合成指数）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	(円)	当 期
		2021年1月13日 ～2022年1月11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)	—
翌期繰越分配可能額	(円)	15,962

(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。

※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等です。



今後の運用方針

当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行い、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行います。

- ・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の5%
 - ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI） …純資産総額の5%
 - ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド …純資産総額の20%
 - ・ダイワJーREITアクティブ・マザーファンド …純資産総額の20%
 - ・ダイワ北米好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド } …3ファンド合計で純資産総額の25%（*）
 - ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ好配当日本株マザーファンド …純資産総額の25%
- *外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

- 外国債券インデックスマザーファンド
- ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）
- ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド
- ダイワJーREITアクティブ・マザーファンド
- ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
- ダイワ好配当日本株マザーファンド

13～14ページをご参照ください。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2021.1.13~2022.1.11)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	304円	1.316%	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23,099円です。
（投 信 会 社）	(155)	(0.669)	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）	(137)	(0.592)	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）	(13)	(0.055)	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	19	0.083	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）	(7)	(0.032)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
（ハイブリッド優先証券）	(1)	(0.003)	
（投資信託証券）	(11)	(0.048)	
有価証券取引税	3	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）	(0)	(0.001)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(2)	(0.011)	
そ の 他 費 用	5	0.020	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)	(0.014)	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）	(2)	(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)	(△0.002)	税金の戻し、信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	331	1.431	

(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。

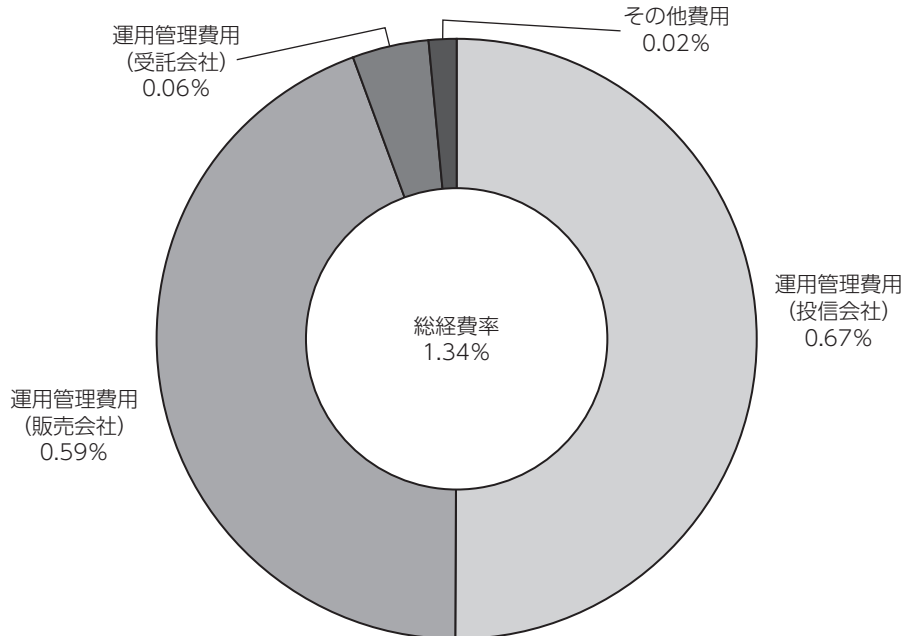
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して 100 を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

(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1.34%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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	49,722	153,782	1,686	5,272
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (BPI)	134,321	173,193	5,680	7,352
ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド	57,886	180,133	25,766	87,638
ダイワ好配当日本株 マザーファンド	160,835	527,334	28,565	92,817
ダイワ北米好配当株 マザーファンド	59,962	236,419	12,114	47,744
ダイワ欧州好配当株 マザーファンド	33,206	65,739	12,909	26,290
ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド	5,832	16,821	3,384	9,686
ダイワJ-REIT アクティブ・マザーファンド	116,598	412,468	15,651	53,569

(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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

項 目	当 期
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	12,718,848千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,227,269千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.83
	ダイワ北米好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	3,555,413千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,969,088千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.19
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	88,321千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,353,941千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.06
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	500,884千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	679,663千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.73

(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) 外国債券インデックス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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(3) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI) における当作成期中の利害関係人との取引状況

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	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
公社債	百万円 15,250	百万円 247	% 1.6	百万円 3,327	百万円 302	% 9.1
コール・ローン	48,385	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合1.4%

※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。

(4) ダイワ・グローバルREIT・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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(5) ダイワ好配当日本株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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	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 5,007	百万円 1,318	% 26.3	百万円 7,711	百万円 1,624	% 21.1
コール・ローン	87,754	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合14.2%

(6) ダイワ北米好配当株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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(7) ダイワ欧州好配当株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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(8) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(9) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

決 算 期	期					
区 分	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 101,300	百万円 28,568	% 28.2	百万円 82,161	百万円 25,627	% 31.2
不動産投信 指数先物取引	10,112	－	－	10,934	－	－
コール・ローン	740,248	－	－	－	－	－

(注) 平均保有割合1.5%

(10) 利害関係人の発行する有価証券等

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

種 類	当 期		
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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 188	百万円 －	百万円 1,553

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(11) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行する有価証券

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

種 類	当 期
	買 付 額
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド
投資信託証券	百万円 6,927
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）
公社債	百万円 300

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(12) 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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額（Ａ）	7,552千円
うち利害関係人への支払額（Ｂ）	1,661千円
（Ｂ）／（Ａ）	22.0%

(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、大和証券オフィス投資法人です。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期	期 末
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	116,184	164,219	514,024
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	271,665	400,305	513,992
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	526,567	558,687	2,096,305
ダイワ好配当日本株マザーファンド	620,355	752,625	2,648,942
ダイワ北米好配当株マザーファンド	401,865	449,713	2,027,040
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	214,804	235,101	514,872
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	27,574	30,022	88,987
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	487,272	588,220	2,045,947

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年1月11日現在

項 目	当 期	期 末
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックスマザーファンド	514,024	4.8
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	513,992	4.8
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	2,096,305	19.7
ダイワ好配当日本株マザーファンド	2,648,942	24.9
ダイワ北米好配当株マザーファンド	2,027,040	19.1
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	514,872	4.8
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	88,987	0.8
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	2,045,947	19.3
コール・ローン等、その他	177,975	1.8
投資信託財産総額	10,628,087	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11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝115.34円、1カナダ・ドル＝91.08円、1オーストラリア・ドル＝82.93円、1香港ドル＝14.79円、1シンガポール・ドル＝85.12円、1ニュージーランド・ドル＝78.09円、1台湾ドル＝4.169円、1イギリス・ポンド＝156.63円、1イスラエル・シェケル＝36.781円、1スイス・フラン＝124.45円、1デンマーク・クローネ＝17.57円、1ノルウェー・クローネ＝13.01円、1スウェーデン・クローネ＝12.67円、1メキシコ・ペソ＝5.664円、100韓国ウォン＝9.66円、1オフショア人民元＝18.079円、1マレーシア・リンギット＝27.463円、1ポーランド・ズロチ＝28.781円、1ユーロ＝130.70円です。

(注3) 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（233,707,540千円）の投資信託財産総額（235,394,968千円）に対する比率は、99.3%です。
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（102,038,637千円）の投資信託財産総額（105,149,825千円）に対する比率は、97.0%です。
ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（4,142,116千円）の投資信託財産総額（4,295,487千円）に対する比率は、96.4%です。
ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,469,107千円）の投資信託財産総額（1,473,315千円）に対する比率は、99.7%です。
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（690,993千円）の投資信託財産総額（699,329千円）に対する比率は、98.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年1月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	10,628,087,780円
コール・ローン等	165,287,633
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	514,024,270
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド(B P I)(評価額)	513,992,830
ダイワ・グローバルR E I T・ マザーファンド(評価額)	2,096,305,515
ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額)	2,648,942,297
ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額)	2,027,040,045
ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額)	514,872,915
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド(評価額)	88,987,238
ダイワJーR E I Tアクティブ・ マザーファンド(評価額)	2,045,947,037
未収入金	12,688,000
(B) 負債	83,300,060
未払解約金	17,385,252
未払信託報酬	65,505,488
その他未払費用	409,320
(C) 純資産総額(A－B)	10,544,787,720
元本	4,264,260,205
次期繰越損益金	6,280,527,515
(D) 受益権総口数	4,264,260,205口
1万口当り基準価額(C／D)	24,728円

* 期首における元本額は3,580,161,955円、当作成期間中における追加設定元本額は1,096,214,144円、同解約元本額は412,115,894円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,728円です。

■損益の状況

当期 自2021年1月13日 至2022年1月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 28,137円
受取利息	1,175
支払利息	△ 29,312
(B) 有価証券売買損益	1,735,154,394
売買益	1,841,683,157
売買損	△ 106,528,763
(C) 信託報酬等	△ 120,275,025
(D) 当期損益金(A + B + C)	1,614,851,232
(E) 前期繰越損益金	1,087,252,532
(F) 追加信託差損益金	3,578,423,751
(配当等相当額)	(4,104,543,539)
(売買損益相当額)	(△ 526,119,788)
(G) 合計(D + E + F)	6,280,527,515
次期繰越損益金(G)	6,280,527,515
追加信託差損益金	3,578,423,751
(配当等相当額)	(4,104,543,539)
(売買損益相当額)	(△ 526,119,788)
分配準備積立金	2,702,131,901
繰越損益金	△ 28,137

(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。
(注4) 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：19,884,417円（未監査）

■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	1,614,854,868
(c) 収益調整金	4,104,543,539
(d) 分配準備積立金	1,087,277,033
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	6,806,675,440
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e－f)	6,806,675,440
(h) 受益権総口数	4,264,260,205口

F T S E 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。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（2021年11月30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（2022年1月11日）現在における外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。

■外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

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	1.25% 2031/8/15	1,145,094	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.625% 2022/11/15	777,091
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)	2% 2022/11/30	735,613
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.625% 2031/5/15	974,457	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)	0.375% 2024/9/15	848,795	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	2022/5/25	529,651
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	1.375% 2031/11/15	799,222	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	3% 2022/4/25	502,618
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	1.25% 2028/9/30	785,770	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	2.25% 2022/10/25	487,862
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% 2022/7/31	474,174
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.375% 2051/5/15	764,055	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)	1.25% 2028/3/31	760,295	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2022/2/28	425,727
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)	2.25% 2022/4/15	414,472

(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、2022年1月11日現在における外国債券インデックスマザーファンド（75,012,242千口）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

2022年1月11日現在								
区 分	額 面 金 額	評 価		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
アメリカ	千アメリカ・ドル 940,916	千アメリカ・ドル 954,492	千円 110,091,192	% 46.9	% —	% 21.6	% 16.9	% 8.4
カナダ	千カナダ・ドル 49,471	千カナダ・ドル 51,106	4,654,750	2.0	—	1.0	0.6	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 43,402	千オーストラリア・ドル 44,819	3,716,912	1.6	—	1.2	0.4	0.0
シンガポール	千シンガポール・ドル 11,180	千シンガポール・ドル 11,635	990,406	0.4	—	0.3	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 72,672	千イギリス・ポンド 87,888	13,765,942	5.9	—	4.6	0.8	0.5
イスラエル	千イスラエル・シェケル 25,600	千イスラエル・シェケル 28,339	1,042,345	0.4	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 47,011	千デンマーク・クローネ 58,617	1,029,904	0.4	—	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 44,134	千ノルウェー・クローネ 43,995	572,378	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 51,361	650,746	0.3	—	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 293,935	千メキシコ・ペソ 294,808	1,669,822	0.7	—	0.4	0.2	0.1

外国債券インデックスマザーファンド

2022年1月11日現在								
区 分	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
中国	千オフショア人民元 82,600	千オフショア人民元 84,800	千円 1,533,122	% 0.7	% －	% 0.3	% 0.2	% 0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 41,256	千マレーシア・リンギット 42,269	1,160,848	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 39,068	1,124,441	0.5	－	0.2	0.2	0.1
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 12,877	千ユーロ 14,049	1,836,278	0.8	－	0.6	0.2	0.0
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 28,887	千ユーロ 33,365	4,360,927	1.9	－	1.3	0.4	0.2
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 33,876	千ユーロ 39,619	5,178,232	2.2	－	1.6	0.4	0.1
ユーロ (フランス)	千ユーロ 154,893	千ユーロ 177,253	23,167,024	9.9	－	6.3	2.6	0.9
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 111,612	千ユーロ 129,176	16,883,314	7.2	－	4.6	1.7	0.9
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 89,221	千ユーロ 102,844	13,441,828	5.7	－	3.7	1.6	0.5
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 139,571	千ユーロ 156,513	20,456,333	8.7	－	5.3	2.4	0.9
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 10,032	千ユーロ 10,633	1,389,765	0.6	－	0.4	0.2	0.1
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 21,679	千ユーロ 24,620	3,217,946	1.4	－	0.9	0.3	0.2
ユーロ (小計)	602,648	688,076	89,931,652	38.3	－	24.7	9.8	3.8
合 計	－	－	231,934,468	98.8	－	55.4	29.7	13.7

- (注1) 邦貨換算金額は、2022年1月11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)

2022年1月11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		
アメリカ			%	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	2.0000	4,350	4,420	509,821	2023/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	4,685	4,752	548,111	2023/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	4,568	4,693	541,341	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	5,021	5,192	598,957	2023/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	5,229	5,424	625,657	2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	4,912	5,081	586,045	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.2500	654	711	82,034	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.0000	855	1,010	116,597	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.1250	709	887	102,404	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.2500	738	908	104,765	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.2500	714	966	111,458	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.3750	2,391	3,132	361,269	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.5000	1,176	1,569	180,982	2036/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.0000	847	1,195	137,914	2037/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	548	731	84,380	2038/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.5000	519	703	81,093	2038/05/15	

2022年1月11日現在								
区 分	銘	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	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.5000	1,049	1,273	146,928	2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.2500	1,121	1,489	171,741	2039/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.5000	1,060	1,449	167,242	2039/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	1,210	1,633	188,417	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.6250	1,010	1,405	162,116	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	1,678	2,274	262,390	2040/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.8750	1,091	1,391	160,440	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.2500	1,469	1,964	226,538	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.7500	1,254	1,783	205,745	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	1,365	1,860	214,540	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.7500	1,517	1,917	221,166	2041/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	1,450	1,684	194,262	2041/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	1,623	1,888	217,863	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	1,353	1,548	178,548	2042/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	2,231	2,455	283,256	2042/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	1,630	1,793	206,906	2042/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	2,626	3,057	352,667	2043/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	2,298	2,579	297,520	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.6250	3,214	4,031	464,968	2043/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.7500	2,081	2,661	307,003	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.6250	3,307	4,160	479,883	2044/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.3750	3,327	4,046	466,745	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	6,162	6,363	734,015	2024/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	1,929	2,260	260,781	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	5,921	6,097	703,279	2024/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	2,746	3,159	364,428	2044/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	5,743	5,874	677,559	2025/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	2,563	2,715	313,235	2045/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	5,788	5,943	685,472	2025/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	2,835	3,270	377,198	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	5,743	5,872	677,301	2025/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	1,873	2,120	244,554	2045/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	5,840	6,023	694,790	2025/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	659	763	88,039	2045/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	4,992	5,070	584,816	2022/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	4,866	4,902	565,408	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,561	2,594	299,225	2023/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	3,148	3,348	386,179	2046/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	2,962	2,994	345,357	2023/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	3,623	3,662	422,398	2023/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	7,729	7,771	896,401	2026/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,070	2,096	241,783	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	2,823	3,002	346,336	2046/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,500	2,532	292,098	2023/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	3,000	3,028	349,355	2023/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	5,400	5,396	622,393	2026/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	2,780	2,825	325,878	2046/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	2,780	2,802	323,261	2023/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,400	2,422	279,409	2023/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,505	2,528	291,633	2023/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	5,300	5,415	624,622	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,500	2,534	292,314	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	1,500	1,708	197,054	2046/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	2,490	2,548	293,894	2023/11/30	

外国債券インデックスマザーファンド

2022年1月11日現在							
区 分	銘	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	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	2,500	2,565	295,907	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	3,640	3,763	434,137	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	2,480	2,546	293,729	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	2,845	3,316	382,515	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	2,300	2,356	271,807	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	4,550	4,662	537,769	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	6,400	6,659	768,101	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	2,000	2,335	269,390	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	3,000	3,067	353,791	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	5,300	5,419	625,031	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	2,400	2,455	283,182	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	5,900	6,103	703,949	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	3,000	3,078	355,061	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	2,950	3,301	380,763	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	2,000	2,040	235,355	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	2,500	2,565	295,927	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	5,500	5,689	656,274	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	2,500	2,799	322,905	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	3,500	3,604	415,784	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	3,200	3,284	378,846	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	2,800	2,885	332,827	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	3,500	3,568	411,590	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	6,350	6,753	778,924	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	3,300	3,377	389,539	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	2,600	2,698	311,267	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	2,700	2,825	325,917	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	3,800	4,460	514,475	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	2,900	2,966	342,205	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	2,900	3,024	348,832	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	4,200	5,047	582,141	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	6,500	6,969	803,884	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	2,500	2,568	296,288	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	1,900	1,998	230,462	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	3,550	3,732	430,470	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	2,500	2,571	296,616	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	2,500	2,569	296,400	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	3,000	3,145	362,750	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	3,850	3,969	457,793	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	6,700	7,195	829,948	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	4,220	4,965	572,672	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	2,500	2,634	303,868	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	3,600	3,713	428,345	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	3,600	3,774	435,300	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	2,500	2,647	305,333	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	3,000	3,105	358,141	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	2,500	2,648	305,515	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	4,000	4,144	478,028	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	3,700	4,039	465,964	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.3750	4,520	5,685	655,784	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	3,000	3,166	365,265	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	2,000	2,074	239,275	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	3,500	3,665	422,736	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	2,500	2,583	297,946	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	6,600	7,003	807,748	2029/02/15

2022年1月11日現在							
区 分	銘	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	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	4,000	4,127	476,008	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	2,500	2,616	301,775	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	4,700	5,552	640,391	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	2,500	2,604	300,356	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	3,300	3,398	391,994	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	2,500	2,579	297,562	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	4,650	5,377	620,256	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	3,900	4,078	470,419	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	3,500	3,597	414,932	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	2,800	2,904	335,011	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	3,000	3,082	355,535	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	3,500	3,557	410,375	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	2,800	2,846	328,325	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	5,500	5,589	644,748	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	2,500	2,542	293,237	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	4,700	4,674	539,170	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	4,600	4,721	544,570	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,800	2,784	321,133	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	4,000	4,013	462,924	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,500	2,512	289,768	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	3,000	3,028	349,331	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	1,000	1,009	116,389	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	3,000	3,014	347,722	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	5,850	5,875	677,633	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	4,500	4,743	547,088	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,000	2,010	231,833	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	3,000	3,026	349,113	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,500	2,527	291,570	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,500	2,539	292,943	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	4,000	4,040	466,005	2023/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	1,700	1,707	196,934	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,250	2,270	261,925	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	5,000	4,921	567,593	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	3,200	3,192	368,250	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	5,400	5,258	606,486	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	300	293	33,874	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	5,200	5,180	597,518	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.5000	4,200	4,198	484,219	2023/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.5000	1,500	1,464	168,866	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	3,200	3,185	367,397	2023/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	1,600	1,526	176,036	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	7,800	7,135	822,965	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	3,500	3,474	400,771	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.3750	2,700	2,620	302,243	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.5000	2,400	2,270	261,914	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	5,600	4,548	524,641	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	5,000	4,226	487,490	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.5000	3,500	3,304	381,139	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	3,000	2,895	333,909	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	5,500	5,465	630,379	2023/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	7,500	7,228	833,691	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.5000	3,500	3,301	380,760	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	1,000	990	114,281	2023/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	3,400	3,271	377,293	2025/07/31

外国債券インデックスマザーファンド

2022年1月11日現在								
区 分	銘	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	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	5,500	5,443	627,848	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	10,000	9,118	1,051,750	2030/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.3750	5,000	4,678	539,664	2027/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	6,700	5,616	647,804	2050/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	6,000	5,054	582,932	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.5000	3,500	3,291	379,654	2027/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	2,000	1,977	228,057	2023/09/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	6,500	6,235	719,249	2025/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.3750	4,000	3,729	430,107	2027/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	3,500	3,361	387,728	2025/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	4,200	4,147	478,353	2023/10/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	7,700	7,614	878,224	2023/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	9,800	9,110	1,050,801	2030/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	4,000	3,831	441,964	2025/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.5000	4,000	3,750	432,525	2027/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	6,800	6,062	699,198	2050/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	5,100	4,481	516,863	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.3750	5,100	4,898	564,975	2025/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	5,000	4,715	543,851	2027/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	3,000	2,956	340,975	2023/12/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	5,000	4,709	543,222	2027/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.3750	1,000	959	110,672	2025/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	1,700	1,694	195,387	2022/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	4,000	3,936	454,024	2024/01/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	7,000	6,635	765,363	2028/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	5,900	5,585	644,194	2051/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	10,700	10,150	1,170,740	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	5,000	4,915	566,965	2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	2,000	1,991	229,722	2023/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.3750	5,000	4,790	552,501	2026/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	5,000	4,849	559,306	2028/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	4,700	4,488	517,703	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.5000	3,000	2,883	332,635	2026/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	2,000	1,990	229,561	2023/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	2,000	1,968	227,046	2024/03/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	3,000	2,982	343,992	2023/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	7,000	6,828	787,631	2028/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	4,000	3,880	447,588	2026/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.3750	3,000	2,956	341,002	2024/04/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	8,700	8,608	992,951	2031/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	5,100	5,007	577,522	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	4,500	4,364	503,417	2026/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	3,400	3,376	389,489	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	6,000	5,849	674,683	2028/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	6,400	6,772	781,196	2051/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	3,800	3,855	444,726	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	1,000	992	114,438	2023/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	4,000	3,895	449,355	2028/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	4,400	4,260	491,433	2026/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	2,000	1,960	226,172	2024/06/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	1,500	1,486	171,508	2023/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	5,000	4,865	561,152	2028/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	5,000	4,864	561,065	2026/06/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.3750	5,500	5,403	623,217	2024/07/15	

2022年1月11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	0.3750	3,000	2,943	339,556	2024/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.2500	10,300	9,835	1,134,399	2031/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.0000	6,900	6,729	776,196	2051/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.7500	3,700	3,457	398,749	2041/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.1250	2,500	2,475	285,498	2023/07/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.6250	6,000	5,769	665,437	2026/07/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.0000	5,000	4,783	551,780	2028/07/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.1250	3,000	2,967	342,220	2023/08/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.1250	5,000	4,819	555,834	2028/08/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.7500	5,000	4,830	557,190	2026/08/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.3750	7,500	7,350	847,774	2024/09/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.2500	7,000	6,797	783,974	2028/09/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.8750	3,500	3,397	391,861	2026/09/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.2500	1,500	1,485	171,326	2023/09/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.6250	2,000	1,971	227,353	2024/10/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.7500	2,000	1,975	227,893	2024/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.3750	7,000	6,746	778,168	2031/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.8750	4,300	4,078	470,424	2051/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.0000	3,000	2,925	337,462	2041/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.3750	4,000	3,965	457,355	2023/10/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.3750	6,000	5,869	677,008	2028/10/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.1250	4,000	3,925	452,778	2026/10/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.2500	4,000	3,948	455,445	2026/11/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.5000	5,000	4,965	572,663	2023/11/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.5000	2,400	2,366	272,965	2028/11/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.0000	2,200	2,187	252,309	2024/12/15	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	258銘柄		940,916	954,492	110,091,192		
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	605	726	66,168	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	983	1,267	115,457	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	1,117	1,562	142,348	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.0000	1,012	1,429	130,184	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	913	1,216	110,842	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	961	1,245	113,421	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,253	1,262	114,950	2023/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,405	1,447	131,864	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,337	1,559	141,994	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,156	1,190	108,406	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	969	970	88,428	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	1,240	1,207	109,955	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	650	667	60,791	2028/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	4,300	4,340	395,348	2023/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	1,300	1,320	120,261	2023/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	3,710	3,742	340,863	2051/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,220	1,277	116,329	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,200	1,227	111,843	2024/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,400	1,409	128,385	2024/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	3,450	3,346	304,808	2030/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	700	697	63,571	2025/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,890	2,797	254,821	2025/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,000	1,806	164,526	2030/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	2,100	1,998	182,037	2026/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,200	1,175	107,094	2024/04/01	

外国債券インデックスマザーファンド

2022年1月11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		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	2023/02/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,500	1,489	135,686	2023/05/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,100	1,089	99,273	2026/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	300	293	26,701	2031/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	3,400	3,336	303,899	2023/08/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	100	98	9,000	2024/10/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	1,000	985	89,787	2053/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,000	941	85,774	2023/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,000	989	90,146	2027/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	200	196	17,937	2024/02/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	500	496	45,182	2031/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	300	292	26,654		
通貨小計	銘 柄 数 金 額	36銘柄		49,471	51,106	4,654,750		
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	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	468	498	41,303	2027/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,989	2,313	191,867	2024/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,973	2,063	171,165	2029/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,754	1,934	160,454	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,798	1,915	158,879	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.5000	1,258	1,583	131,348	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	1,748	1,954	162,080	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	1,113	1,334	110,680	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,307	1,408	116,774	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	792	893	74,131	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,672	1,780	147,634	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,178	1,219	101,129	2047/03/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	1,252	1,353	112,231	2028/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,800	1,920	159,246	2029/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,900	2,033	168,670	2030/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	2,870	3,019	250,418	2041/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,390	1,452	120,493	2031/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	2,840	2,745	227,706	2032/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,300	1,218	101,074	2024/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	2,400	2,349	194,872	2030/12/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	2,800	2,600	215,619	2051/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,400	1,164	96,592	2025/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,600	1,534	127,221	2031/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	2,500	2,298	190,651	2026/09/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,200	1,147	95,135	2032/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,100	1,079	89,528		
通貨小計	銘 柄 数 金 額	26銘柄		43,402	44,819	3,716,912		
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	3.5000	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		2027/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	3.0000	772	843	71,771	2024/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.8750	923	968	82,415	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	809	876	74,646	2042/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	400	439	37,412	2023/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	671	690	58,806	2033/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	3.3750	568	649	55,286	2029/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.8750	625	672	57,243	2025/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.3750	524	543	46,271	2046/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	688	755	64,301	2026/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.1250	450	462	39,376	2036/08/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.2500	750	767	65,317		

2022年1月11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		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	1.7500	% 千シンガポール・ドル 450	千シンガポール・ドル 455	千円 38,759	2023/02/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.6250	550	581	49,461	2028/05/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.0000	490	500	42,622	2024/02/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.3750	350	363	30,924	2039/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	1.8750	710	659	56,144	2050/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	0.5000	750	726	61,829	2025/11/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	1.6250	300	294	25,104	2031/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	1.8750	200	186	15,901	2051/10/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	1.2500	200	197	16,811	2026/11/01	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	20銘柄		11,180	11,635	990,406		
イギリス	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	2.0000	千イギリス・ポンド 921	千イギリス・ポンド 957	150,003	2025/09/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	2.5000	1,682	2,459	385,176	2065/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.5000	1,465	1,502	235,392	2026/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.5000	1,940	1,999	313,224	2047/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.7500	1,450	1,528	239,466	2037/09/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.7500	1,810	2,070	324,256	2057/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.2500	1,410	1,431	224,152	2027/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.7500	3,000	3,004	470,571	2023/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.6250	1,500	1,559	244,328	2028/10/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.6250	990	1,202	188,368	2071/10/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.0000	1,800	1,808	283,236	2024/04/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.7500	1,210	1,323	207,339	2049/01/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.6250	850	925	144,985	2054/10/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.8750	800	787	123,420	2029/10/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.6250	1,900	1,885	295,370	2025/06/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.2500	1,190	1,160	181,841	2041/10/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.1250	2,300	2,287	358,220	2023/01/31	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.3750	2,300	2,154	337,445	2030/10/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.5000	750	591	92,628	2061/10/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.1250	1,500	1,452	227,530	2026/01/30	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.1250	1,600	1,516	237,563	2028/01/31	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.6250	1,100	921	144,329	2050/10/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.6250	1,300	1,183	185,313	2035/07/31	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.1250	1,300	1,281	200,713	2024/01/31	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.2500	1,300	1,190	186,437	2031/07/31	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.8750	500	448	70,217	2046/01/31	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.3750	500	485	76,014	2026/10/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.2500	300	294	46,082	2051/07/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国 債 証 券	0.2500	100	98	15,350	2025/01/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国 債 証 券	1.1250	600	576	90,291	2039/01/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国 債 証 券	0.5000	100	96	15,037	2029/01/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国 債 証 券	0.8750	300	288	45,158	2033/07/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国 債 証 券	1.5000	300	316	49,602	2053/07/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国 債 証 券	1.0000	100	97	15,323	2032/01/31	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	6.0000	949	1,262	197,793	2028/12/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	2,240	2,904	454,994	2032/06/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	5.0000	1,472	1,658	259,782	2025/03/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,662	2,295	359,490	2036/03/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.7500	1,357	2,060	322,814	2038/12/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,908	3,465	542,810	2055/12/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,366	2,193	343,503	2046/12/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,232	1,460	228,698	2027/12/07	

外国債券インデックスマザーファンド

2022年1月11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	%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
					4.5000	2,416	593,980	
					4.7500	1,600	327,589	
					4.2500	1,343	353,007	
					4.2500	1,446	329,832	
					4.5000	1,560	336,362	
					4.0000	1,174	340,390	
					4.2500	1,577	365,516	
					3.7500	1,552	391,325	
					3.2500	1,866	396,007	
					2.2500	1,582	253,916	
					3.5000	1,386	401,371	
					2.7500	1,092	179,491	
					3.5000	1,724	382,867	
通貨小計	銘 柄 数	55銘柄			72,672	87,888	13,765,942	
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed		国 債 証 券		千イスラエル・シェケル	千イスラエル・シェケル		
					6.2500	1,800	83,764	
					4.2500	1,300	50,277	
					5.5000	1,900	109,638	
					3.7500	2,000	79,296	
					1.7500	2,300	88,408	
					2.0000	1,800	70,538	
					3.7500	2,400	112,221	
					2.2500	1,800	72,004	
					1.5000	1,500	56,547	
					1.0000	2,400	87,314	
					0.5000	1,600	58,936	
					1.5000	1,700	59,304	
					0.1500	2,000	73,601	
					0.5000	200	7,325	
					0.4000	900	33,165	
通貨小計	銘 柄 数	15銘柄			25,600	28,339	1,042,345	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券		千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
					4.5000	13,662	422,187	
					1.5000	4,846	88,452	
					1.7500	6,013	114,110	
					0.5000	7,900	144,119	
					0.5000	9,590	175,492	
					0.2500	3,500	59,064	
					—	500	8,674	
					—	1,000	17,803	
					—	—	—	
通貨小計	銘 柄 数	8銘柄			47,011	58,617	1,029,904	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券		千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
					2.0000	8,204	107,925	
					3.0000	4,095	55,042	
					1.7500	5,395	70,529	
					1.5000	4,340	56,105	
					1.7500	4,450	57,998	
					2.0000	3,500	46,236	
					1.7500	3,850	49,922	
					1.3750	6,800	85,383	

2022年1月11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	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
				1.2500	3,500	3,323	43,235	2031/09/17
通貨小計	銘 柄 数 額	9銘柄						
					44,134	43,995	572,378	
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	千スウェーデン・クローネ		
					4,655	6,811	86,305	2039/03/30
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	8,025	8,270	104,792	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	7,595	8,216	104,104	2025/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	7,180	7,449	94,388	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	5,050	5,195	65,823	2028/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	3,300	3,901	49,428	2032/06/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	7,400	7,629	96,660	2029/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.1250	4,000	3,886	49,244	2031/05/12
通貨小計	銘 柄 数 額	8銘柄						
					47,205	51,361	650,746	
メキシコ		Mexican Bonos	国 債 証 券	5.7500	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
					37,290	34,758	196,877	2026/03/05
		Mexican Bonos	国 債 証 券	8.0000	19,300	18,895	107,028	2047/11/07
		Mexican Bonos	国 債 証 券	8.0000	23,800	24,013	136,016	2024/09/05
		Mexican Bonos	国 債 証 券	6.7500	17,200	17,147	97,125	2023/03/09
		MEXICAN BONOS	国 債 証 券	5.5000	3,000	2,719	15,401	2027/03/04
		MEXICAN BONOS	国 債 証 券	5.0000	1,000	924	5,239	2025/03/06
		Mexican Bonos	国 債 証 券	8.0000	30,033	30,276	171,489	2023/12/07
		Mexican Bonos	国 債 証 券	10.0000	23,919	25,383	143,775	2024/12/05
		Mexican Bonos	国 債 証 券	7.5000	27,968	27,703	156,913	2027/06/03
		Mexican Bonos	国 債 証 券	10.0000	8,874	10,474	59,329	2036/11/20
		Mexican Bonos	国 債 証 券	8.5000	29,544	30,800	174,458	2029/05/31
		Mexican Bonos	国 債 証 券	8.5000	18,894	19,620	111,132	2038/11/18
		Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	25,515	25,418	143,971	2031/05/29
		Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	19,654	18,800	106,487	2042/11/13
		Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	7,944	7,870	44,578	2034/11/23
通貨小計	銘 柄 数 額	15銘柄						
					293,935	294,808	1,669,822	
中国		China Government Bond	国 債 証 券	3.2200	千オフショア人民元	千オフショア人民元		
					5,200	5,323	96,251	2025/12/06
		China Government Bond	国 債 証 券	3.2500	5,000	5,139	92,910	2026/06/06
		China Government Bond	国 債 証 券	2.6800	3,500	3,442	62,240	2030/05/21
		China Government Bond	国 債 証 券	2.8800	5,000	5,046	91,242	2023/11/05
		China Government Bond	国 債 証 券	3.7200	3,000	3,173	57,370	2051/04/12
		China Government Bond	国 債 証 券	3.0200	3,800	3,853	69,674	2031/05/27
		CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.6900	4,500	4,519	81,710	2026/08/12
		CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5700	11,000	11,320	204,672	2024/06/22
		CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5900	5,500	5,778	104,476	2027/08/03
		CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.6900	5,000	5,309	95,988	2028/05/17
		CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.6100	5,000	5,195	93,925	2025/06/07
		CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0800	3,100	3,480	62,918	2048/10/22
		CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5700	10,000	10,031	181,363	2023/05/20
		CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.9100	5,500	5,538	100,122	2028/10/14
		CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5300	3,500	3,617	65,406	2051/10/18
		CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.8900	4,000	4,029	72,847	2031/11/18
通貨小計	銘 柄 数 額	16銘柄						
					82,600	84,800	1,533,122	
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.5020	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
					2,373	2,397	65,844	2027/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.4980	1,178	1,249	34,313	2030/04/15

外国債券インデックスマザーファンド

2022年1月11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		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.3920	千マレーシア・リンギット1,514	千マレーシア・リンギット1,588	千円43,635	2026/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.2320	1,300	1,352	37,148	2031/06/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8920	731	753	20,703	2027/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.4800	1,001	1,015	27,900	2023/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8440	1,427	1,423	39,095	2023/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.7330	1,886	1,914	52,572	2028/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.9350	1,300	1,425	39,144	2043/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.1810	1,057	1,094	30,062	2024/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.9550	1,737	1,791	49,206	2025/09/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.2540	1,220	1,252	34,396	2035/05/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8000	1,302	1,330	36,541	2023/08/17	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.7360	930	989	27,162	2046/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.9000	1,550	1,593	43,758	2026/11/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.0590	1,550	1,601	43,985	2024/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8990	1,190	1,226	33,694	2027/11/16	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.7620	1,950	2,125	58,366	2037/04/07	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8820	1,200	1,234	33,897	2025/03/14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.7570	1,700	1,732	47,582	2023/04/20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.6420	1,200	1,285	35,316	2033/11/07	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.8930	600	655	18,005	2038/06/08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.9060	650	670	18,402	2026/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8850	2,610	2,665	73,214	2029/08/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.9210	1,200	1,303	35,794	2048/07/06	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.4780	400	405	11,148	2024/06/14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8280	1,300	1,280	35,171	2034/07/05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.7570	1,750	1,653	45,410	2040/05/22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.0650	1,650	1,602	44,009	2050/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2.6320	1,800	1,651	45,361	2031/04/15	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	30銘柄		41,256	42,269	1,160,848		
ポーランド	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.5000	千ポーランド・ズロチ4,377	千ポーランド・ズロチ4,110	118,316	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.5000	3,170	2,927	84,243	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.5000	3,850	3,813	109,758	2023/01/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.5000	2,870	2,798	80,541	2024/04/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.7500	4,840	4,425	127,384	2029/10/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.2500	3,400	3,271	94,166	2024/10/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	0.7500	2,000	1,812	52,154	2025/04/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	1.2500	3,000	2,405	69,243	2030/10/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	—	1,000	956	27,533	2023/04/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	0.2500	1,300	1,089	31,358	2026/10/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	5.7500	827	921	26,515	2029/04/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	4.0000	2,625	2,642	76,064	2023/10/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.7500	3,650	3,400	97,860	2028/04/25	
	Poland Government Bond	国 債 証 券	3.2500	4,591	4,492	129,300	2025/07/25	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	14銘柄		41,500	39,068	1,124,441		
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国 債 証 券	5.4000	千ユーロ1,031	千ユーロ1,221	159,674	2025/03/13	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	3.9000	624	657	85,898	2023/03/20	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	3.4000	607	659	86,190	2024/03/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	2.4000	961	1,140	149,096	2030/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	2.0000	931	1,173	153,385	2045/02/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	1.0000	1,073	1,132	148,051	2026/05/15	

2022年1月11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		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	1.7000	550	636	83,247	2037/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	0.9000	800	847	110,829	2028/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	1.3000	750	820	107,241	2033/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	1.3500	750	828	108,239	2031/03/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	1.1000	950	1,021	133,457	2029/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	1.5000	700	796	104,050	2050/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	0.4000	350	342	44,701	2035/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	0.2000	800	814	106,402	2027/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	0.2000	800	798	104,336	2030/10/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	—	800	773	101,092	2031/10/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	0.5500	400	385	50,384	2041/04/22	
国 小 計	銘 柄 数 金 額	17銘柄		12,877	14,049	1,836,278		
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	593	77,553	2023/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	1,139	1,535	200,723	2028/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,555	2,429	317,495	2037/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	791	826	108,030	2023/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	1,729	2,906	379,895	2042/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,468	1,852	242,165	2033/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,385	1,435	187,621	2023/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,929	3,073	401,738	2047/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	1,514	1,611	210,593	2024/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,791	1,833	239,645	2025/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,938	2,012	263,071	2026/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	2,200	2,325	303,892	2027/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,400	1,416	185,151	2024/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	1,350	1,434	187,501	2028/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,200	1,231	160,950	2029/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	900	940	122,878	2040/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,400	1,402	183,329	2030/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	800	811	106,045	2027/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,050	935	122,266	2052/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,300	1,293	169,011	2031/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	900	859	112,378	2038/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	600	604	78,986	2029/01/15	
国 小 計	銘 柄 数 金 額	22銘柄		28,887	33,365	4,360,927		
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	1,771	231,503	2025/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.0000	1,774	1,908	249,395	2031/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.9000	1,058	1,273	166,388	2038/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.0000	1,863	1,971	257,723	2026/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.6000	1,244	1,438	188,046	2047/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	2.1500	640	878	114,860	2066/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.2000	940	953	124,613	2023/10/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.8000	1,100	1,161	151,789	2027/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.5000	1,050	1,080	141,181	2024/10/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	2.2500	580	790	103,325	2057/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.4500	600	676	88,429	2037/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.8000	1,490	1,579	206,470	2028/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.2500	650	721	94,300	2033/04/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.9000	1,500	1,602	209,387	2029/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.7000	700	828	108,242	2050/06/22	

外国債券インデックスマザーファンド

2022年1月11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	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.1000	1,220	1,220	159,463	2030/06/22
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.4000	860	809	105,846	2040/06/22
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	—	1,200	1,212	158,478	2027/10/22
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	—	1,600	1,558	203,643	2031/10/22
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.6500	680	552	72,195	2071/06/22
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	5.5000	1,706	2,317	302,888	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	5.0000	1,904	3,029	396,006	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.2500	1,604	2,621	342,648	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.5000	1,001	1,210	158,218	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.0000	780	1,079	141,096	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	2.2500	1,338	1,394	182,230	2023/06/22
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	3.7500	843	1,370	179,167	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	2.6000	1,505	1,622	212,085	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	3.0000	747	983	128,604	2034/06/22
国 小 計	銘 柄 数 額	29銘柄		33,876	39,619	5,178,232	
ユーロ（フランス）	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	8.5000	千ユーロ	千ユーロ		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.0000	1,985	2,219	290,050	2023/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	3,025	3,766	492,295	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	3,323	4,669	610,266	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	3,227	5,112	668,250	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	2,659	4,146	541,888	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,764	3,289	429,996	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	2,374	3,684	481,622	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	4,997	5,434	710,307	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.5000	3,664	6,208	811,513	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,717	3,356	438,716	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	3,646	4,244	554,693	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	5,699	6,673	872,237	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	2,588	3,951	516,462	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	4,047	4,179	546,244	2023/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	5,086	5,424	708,965	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	5,087	6,113	798,975	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	4,899	5,214	681,515	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	3,492	3,598	470,283	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	5,101	5,367	701,549	2025/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	5,920	6,631	866,709	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	4,387	4,537	593,013	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	4,169	4,575	598,031	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,387	1,719	224,770	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	4,050	4,145	541,880	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	2,570	3,072	401,567	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	3,400	3,618	473,002	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	2,850	3,626	473,984	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,400	2,418	316,095	2023/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	4,400	4,637	606,128	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	3,950	4,332	566,223	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	4,950	5,219	682,244	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	3,400	3,440	449,685	2024/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	2,950	3,387	442,705	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	4,350	4,506	589,046	2029/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	3,830	3,880	507,163	2025/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	4,200	4,175	545,734	2029/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,400	2,417	315,982	2023/02/25

2022年1月11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		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	2,770	2,617	342,155	2052/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	3,000	3,037	396,938	2026/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,200	2,124	277,654	2040/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	4,000	3,936	514,466	2030/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	980	748	97,815	2072/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	100	101	13,217	2024/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,000	945	123,514	2044/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	4,600	4,474	584,866	2031/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,600	1,614	211,008	2027/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	700	654	85,582	2053/05/25	
国 小 計	銘 柄 数 額	47銘柄		154,893	177,253	23,167,024		
ユーロ (ドイツ)	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.2500	千ユーロ	千ユーロ			
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.5000	974	1,108	144,902	2024/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.6250	1,167	1,614	211,034	2027/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	2,162	2,948	385,370	2028/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	950	1,268	165,767	2028/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.2500	1,951	2,981	389,704	2030/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	3,448	5,245	685,615	2031/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	2,305	3,710	484,952	2034/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	3,571	5,722	747,925	2037/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	1,325	2,301	300,805	2039/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	1,739	3,249	424,718	2040/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	2,574	4,233	553,326	2042/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	2,808	4,301	562,193	2044/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,410	1,443	188,722	2023/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,817	1,869	244,347	2023/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	1,599	1,667	217,906	2023/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,561	1,640	214,348	2024/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	2,679	4,197	548,656	2046/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,594	1,673	218,729	2024/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	4,042	4,210	550,303	2024/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,194	2,264	296,035	2025/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	3,134	3,302	431,630	2025/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,368	2,459	321,515	2026/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,420	2,465	322,205	2026/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	4,200	4,333	566,335	2027/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,300	2,408	314,828	2027/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	2,770	3,507	458,381	2048/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,900	1,995	260,771	2028/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	3,100	3,210	419,666	2028/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	2,200	2,280	298,058	2029/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	3,000	3,051	398,883	2029/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,250	2,093	273,560	2050/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,750	1,778	232,450	2030/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,100	2,079	271,777	2035/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,000	2,038	266,387	2027/11/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,800	1,825	238,628	2030/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,200	1,223	159,857	2030/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	900	909	118,930	2031/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,400	1,377	180,054	2036/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,000	2,036	266,201	2028/11/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,100	1,034	135,219	2050/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,600	2,620	342,494	2031/08/15	

外国債券インデックスマザーファンド

2022年1月11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	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	700	707	92,422	2031/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,000	1,007	131,677	2023/03/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,000	1,008	131,873	2023/06/16	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	100	101	13,207	2023/09/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	700	641	83,904	2052/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	200	202	26,442	2023/12/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	5,730	5,777	755,119	2023/04/14	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,900	1,922	251,260	2023/10/13	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,920	1,946	254,447	2024/04/05	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,700	1,727	225,745	2024/10/18	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,400	2,440	318,931	2025/04/11	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,300	2,340	305,933	2025/10/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	100	101	13,330	2025/10/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,200	2,240	292,813	2026/04/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,300	1,323	172,995	2026/10/09	
国 小 計	銘 柄 数 金 額	56銘柄		111,612	129,176	16,883,314		
ユーロ（スペイン）	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.0000	千ユーロ	千ユーロ			
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.6000	2,652	3,734	488,035	2029/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.9500	2,045	2,172	283,957	2025/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.1500	2,052	2,311	302,080	2030/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.9500	2,192	2,388	312,210	2025/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.9000	2,733	2,972	388,526	2026/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.4500	1,952	2,610	341,167	2046/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.3000	1,550	2,313	302,412	2066/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	2,630	2,803	366,355	2026/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.3500	1,900	2,048	267,707	2027/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4500	1,750	2,058	269,035	2033/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4000	2,050	2,208	288,600	2027/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7000	2,400	2,583	337,645	2028/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.3500	1,300	1,687	220,619	2048/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4000	2,400	2,432	317,936	2023/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4500	2,900	3,130	409,151	2028/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.8500	1,600	1,734	226,688	2029/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,850	2,070	270,595	2035/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.6000	2,300	2,336	305,350	2024/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,800	2,856	373,326	2029/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,360	1,369	178,967	2030/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,460	2,478	323,875	2023/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,500	2,523	329,805	2025/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	1,400	1,254	163,929	2050/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.8000	2,400	2,491	325,646	2027/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	2,900	3,088	403,647	2030/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2000	1,300	1,301	170,066	2040/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	500	502	65,618	2026/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.1000	2,200	2,106	275,293	2031/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	300	302	39,542	2024/05/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4500	650	560	73,274	2071/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	500	494	64,627	2028/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.8500	900	870	113,757	2037/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,900	1,874	245,002	2031/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	600	579	75,773	2042/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	300	299	39,139	2027/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	2,179	3,318	433,757	2032/07/30	

2022年1月11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	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2000	2,254	3,289	429,877	2037/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.9000	2,158	3,554	464,557	2040/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.8000	1,682	1,865	243,863	2024/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7000	1,973	3,210	419,638	2041/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.6500	2,789	3,277	428,342	2025/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.9000	1,965	2,502	327,100	2026/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.4000	1,958	2,081	272,063	2023/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.4000	1,901	2,069	270,486	2023/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.1500	1,770	2,361	308,680	2028/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.1500	1,299	2,318	302,983	2044/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.8000	1,970	2,163	282,740	2024/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	2,097	2,282	298,363	2024/10/31	
国 小 計	銘 柄 数 金 額	48銘柄		89,221	102,844	13,441,828		
ユーロ (イタリア)	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	9.0000	千ユーロ 906	千ユーロ 1,056	138,081	2023/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	7.2500	1,110	1,469	192,128	2026/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.5000	2,392	3,188	416,685	2027/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,814	1,939	253,527	2024/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,509	1,868	244,152	2046/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	2,487	2,597	339,466	2025/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.6500	2,065	2,139	279,673	2032/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	1,891	2,016	263,562	2025/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7000	1,610	1,823	238,333	2047/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9500	1,359	1,380	180,452	2023/03/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.6000	2,386	2,510	328,131	2026/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	2,324	2,522	329,626	2036/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,068	1,108	144,834	2026/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.6500	1,550	1,574	205,725	2023/10/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.8000	968	1,048	137,007	2067/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.4500	1,500	1,668	218,113	2033/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2000	1,510	1,640	214,351	2027/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.8500	1,300	1,357	177,445	2024/05/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.4500	1,850	2,375	310,479	2048/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0500	2,700	2,910	380,341	2027/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4500	1,600	1,661	217,185	2024/11/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.9500	1,300	1,532	200,233	2038/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	2,100	2,261	295,620	2028/02/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9500	1,900	1,929	252,134	2023/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4500	1,300	1,354	177,046	2025/05/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.8000	2,550	2,889	377,628	2028/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.4500	2,200	2,302	300,916	2023/10/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,550	1,682	219,863	2025/11/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.3500	1,270	1,543	201,743	2035/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.8500	1,650	2,262	295,764	2049/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	1,900	2,189	286,143	2029/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	2,200	2,293	299,757	2024/07/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.1000	2,100	2,258	295,123	2026/07/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.1000	1,250	1,498	195,899	2040/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.3500	1,900	1,947	254,481	2030/04/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.0500	740	743	97,205	2023/01/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.3500	1,300	1,308	171,038	2025/02/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.8500	2,350	2,387	312,019	2027/01/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.4500	1,550	1,659	216,928	2050/09/01	

外国債券インデックスマザーファンド

2022年1月11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		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4500	1,500	1,477	193,170	2036/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.6000	2,000	2,028	265,059	2023/06/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.8500	2,300	2,429	317,498	2025/07/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9500	2,000	1,976	258,284	2030/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.6500	2,100	2,188	286,096	2030/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.3000	1,300	1,312	171,496	2023/08/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9500	2,200	2,236	292,370	2027/09/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,700	1,710	223,523	2026/02/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.8000	1,500	1,481	193,618	2041/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9000	2,300	2,241	292,944	2031/04/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,100	1,102	144,100	2024/01/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7000	1,200	1,091	142,672	2051/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9500	700	634	82,891	2037/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,900	1,842	240,847	2028/03/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.6000	2,700	2,547	332,997	2031/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	700	641	83,784	2045/04/30	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,100	1,081	141,381	2026/04/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,500	1,500	196,120	2024/04/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.1500	460	417	54,552	2072/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	800	784	102,554	2028/07/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9500	1,900	1,843	240,890	2031/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,000	998	130,492	2024/08/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	500	500	65,465	2024/01/30	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,100	1,076	140,709	2026/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9500	100	96	12,575	2032/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.4500	100	96	12,664	2029/02/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	300	298	39,043	2024/12/15	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.2500	3,254	4,323	565,144	2029/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	6.0000	2,849	4,080	533,259	2031/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.7500	1,805	2,629	343,631	2033/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	2,298	3,228	422,028	2034/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.0000	2,740	3,599	470,516	2037/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	2,044	3,043	397,808	2039/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.7500	2,251	2,428	317,400	2023/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	2,118	2,439	318,883	2025/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	2,243	3,384	442,308	2040/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000	2,070	2,424	316,918	2026/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.7500	2,410	3,027	395,677	2028/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000	1,894	2,015	263,376	2023/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.7500	1,813	2,750	359,493	2044/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000	2,194	2,408	314,771	2024/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.7500	2,201	2,416	315,822	2024/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.5000	2,318	2,774	362,631	2030/03/01	
国 小 計	銘 柄 数 額	82銘柄		139,571	156,513	20,456,333		
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.7500	千ユーロ	千ユーロ			
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.8750	364	385	50,376	2031/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.5000	279	292	38,210	2025/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	—	811	841	109,930	2026/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	—	700	707	92,425	2023/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	1.3750	360	434	56,850	2047/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.5000	800	832	108,829	2027/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	1.1250	670	737	96,337	2034/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.5000	500	520	67,986	2028/09/15	

2022年1月11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		
	Finland Government Bond	国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.5000	500	520	68,001	2029/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	—	200	202	26,519	2024/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.1250	310	297	38,850	2036/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.2500	400	383	50,125	2040/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	—	500	496	64,841	2030/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.1250	400	347	45,478	2052/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.1250	600	597	78,107	2031/09/15	
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	200	202	26,489	2026/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	4.0000	667	772	100,906	2025/07/04	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	2.7500	389	463	60,523	2028/07/04	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	1.5000	446	457	59,859	2023/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	2.6250	407	580	75,836	2042/07/04	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	2.0000	529	560	73,279	2024/04/15	
国 小 計	銘 柄 数 額	21銘柄		10,032	10,633	1,389,765		
ユーロ (オーストリア)	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.2000	1,373	1,458	190,648	2025/10/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.7500	1,126	1,181	154,455	2026/10/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.5000	784	940	122,979	2047/02/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.5000	240	295	38,655	2086/11/02	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	—	900	908	118,769	2023/07/15	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.5000	1,280	1,330	173,857	2027/04/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	2.1000	590	881	115,212	2117/09/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.7500	1,200	1,265	165,430	2028/02/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.5000	980	1,016	132,866	2029/02/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	—	800	811	106,015	2024/07/15	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	—	980	973	127,227	2030/02/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	—	1,000	1,008	131,776	2023/04/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.7500	700	705	92,195	2051/03/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	—	400	359	47,041	2040/10/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.8500	350	293	38,421	2120/06/30	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	—	1,200	1,180	154,335	2031/02/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	—	480	486	63,557	2025/04/20	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	600	578	75,626	2036/10/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	6.2500	825	1,124	147,029	2027/07/15	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	4.1500	1,373	2,139	279,615	2037/03/15	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	4.8500	875	1,069	139,762	2026/03/15	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.8000	338	680	89,006	2062/01/26	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.1500	623	970	126,902	2044/06/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.7500	959	1,000	130,709	2023/10/20	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	2.4000	771	968	126,534	2034/05/23	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.6500	932	989	129,311	2024/10/21	
国 小 計	銘 柄 数 額	26銘柄		21,679	24,620	3,217,946		
通貨小計	銘 柄 数 額	348銘柄		602,648	688,076	89,931,652		
合 計	銘 柄 数 額	858銘柄				231,934,468		

(注1) 邦貨換算金額は、2022年1月11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。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の決算日（2021年11月30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（2022年1月11日）現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の主要な売買銘柄
公 社 債

(2021年1月13日から2022年1月11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		
149	5年国債 0.005% 2026/9/20	452,041	419	2年国債 0.1% 2022/12/1	350,801						
147	5年国債 0.005% 2026/3/20	408,046	133	5年国債 0.1% 2022/9/20	230,538						
145	5年国債 0.1% 2025/9/20	363,545	132	5年国債 0.1% 2022/6/20	190,440						
364	10年国債 0.1% 2031/9/20	356,156	131	5年国債 0.1% 2022/3/20	190,423						
148	5年国債 0.005% 2026/6/20	341,952	413	2年国債 0.1% 2022/6/1	180,403						
363	10年国債 0.1% 2031/6/20	332,235	134	5年国債 0.1% 2022/12/20	170,397						
361	10年国債 0.1% 2030/12/20	329,948	414	2年国債 0.1% 2022/7/1	170,363						
362	10年国債 0.1% 2031/3/20	315,768	325	10年国債 0.8% 2022/9/20	161,552						
143	5年国債 0.1% 2025/3/20	272,149	418	2年国債 0.1% 2022/11/1	160,342						
140	5年国債 0.1% 2024/6/20	261,679	322	10年国債 0.9% 2022/3/20	141,489						

(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、2022年1月11日現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）（29,034,289千円）の内容です。

(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）

2022年1月11日現在								
区 分	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			
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
国債証券	31,759,000	33,228,681	89.1	—	58.6	19.7	10.8	
地方債証券	1,600,000	1,661,017	4.5	—	1.7	2.2	0.5	
特殊債券(除く金融債券)	800,000	832,738	2.2	—	0.6	1.4	0.3	
普通社債券	1,300,000	1,321,353	3.5	—	1.4	2.2	—	
合 計	35,459,000	37,043,789	99.4	—	62.3	25.5	11.6	

(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）

2022年1月11日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	421 2年国債	0.1000	130,000	130,260	2023/02/01
	422 2年国債	0.1000	240,000	240,501	2023/03/01
	135 5年国債	0.1000	420,000	420,919	2023/03/20
	328 10年国債	0.6000	60,000	60,486	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	40,000	40,514	2023/03/20
	423 2年国債	0.0050	30,000	30,032	2023/04/01
	424 2年国債	0.0050	150,000	150,175	2023/05/01
	425 2年国債	0.0050	130,000	130,161	2023/06/01
	136 5年国債	0.1000	380,000	381,007	2023/06/20
	329 10年国債	0.8000	200,000	202,528	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	16,000	16,202	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	30,000	30,810	2023/06/20
	426 2年国債	0.0050	60,000	60,079	2023/07/01
	427 2年国債	0.0050	90,000	90,125	2023/08/01
	428 2年国債	0.0050	170,000	170,249	2023/09/01
	137 5年国債	0.1000	590,000	591,840	2023/09/20
	330 10年国債	0.8000	81,000	82,204	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	40,000	40,459	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	35,000	36,171	2023/09/20
	429 2年国債	0.0050	180,000	180,277	2023/10/01
	430 2年国債	0.0050	250,000	250,405	2023/11/01
	138 5年国債	0.1000	560,000	562,004	2023/12/20
	332 10年国債	0.6000	65,000	65,857	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	42,000	43,613	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	30,000	31,094	2023/12/20
	139 5年国債	0.1000	580,000	582,343	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	83,000	84,234	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	19,000	19,820	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	25,000	26,243	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	12,000	12,570	2024/03/20
	140 5年国債	0.1000	450,000	451,975	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	320,000	325,308	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	18,000	19,087	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	17,000	17,943	2024/06/20
	141 5年国債	0.1000	520,000	522,516	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	210,000	213,280	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	53,000	56,104	2024/09/20
	142 5年国債	0.1000	200,000	201,030	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	300,000	303,309	2024/12/20
	143 5年国債	0.1000	550,000	553,069	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	80,000	81,199	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	14,000	14,966	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	25,000	26,567	2025/03/20
	144 5年国債	0.1000	400,000	402,480	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	135,000	137,184	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	17,000	18,150	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	14,000	14,995	2025/06/20
	145 5年国債	0.1000	480,000	482,923	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	190,000	193,264	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	65,000	69,948	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	28,000	30,235	2025/09/20

2022年1月11日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	146 5年国債	0.1000	170,000	171,038	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	15,000	15,210	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	406,000	406,848	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	140,000	140,849	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	31,000	33,779	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	6,000	6,588	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	35,000	38,285	2026/03/20
	148 5年国債	0.0050	340,000	340,676	2026/06/20
	343 10年国債	0.1000	270,000	271,679	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	33,000	36,423	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	15,000	16,489	2026/06/20
	149 5年国債	0.0050	450,000	450,738	2026/09/20
	344 10年国債	0.1000	90,000	90,549	2026/09/20
	345 10年国債	0.1000	410,000	412,632	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	60,000	66,302	2026/12/20
	346 10年国債	0.1000	250,000	251,620	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	18,000	19,891	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	45,000	49,963	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	400,000	402,608	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	30,000	33,787	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	63,000	70,267	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	360,000	362,354	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	25,000	28,152	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	34,000	38,093	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	250,000	251,557	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	53,000	59,625	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	400,000	402,472	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	35,000	39,761	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	18,000	20,671	2028/03/20
	351 10年国債	0.1000	350,000	352,138	2028/06/20
	102 20年国債	2.4000	10,000	11,540	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	21,000	24,100	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	64,000	72,625	2028/06/20
	352 10年国債	0.1000	390,000	392,343	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	38,000	43,307	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	16,000	18,341	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	350,000	352,061	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	40,000	45,779	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	68,000	76,882	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	330,000	331,890	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	60,000	68,091	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	27,000	31,028	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	320,000	321,660	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	35,000	40,634	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	40,000	46,142	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	300,000	301,377	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	70,000	81,051	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	250,000	250,987	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	45,000	52,292	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	42,000	49,138	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	9,000	10,707	2030/02/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

2022年1月11日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	358 10年国債	0.1000	360,000	361,170	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	27,000	31,718	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	77,000	89,828	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	4,000	4,744	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	340,000	340,853	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	13,000	15,110	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	23,000	26,347	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	98,000	110,620	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	350,000	350,602	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	8,000	9,983	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	330,000	330,290	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	42,000	49,506	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	100,000	116,985	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	315,000	314,855	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	25,000	29,777	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	21,000	24,630	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	110,000	128,016	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	8,000	9,551	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	330,000	329,382	2031/06/20
	128 20年国債	1.9000	32,000	37,349	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	95,000	109,992	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	355,000	353,810	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	28,000	32,488	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	172,612	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	9,000	10,987	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	25,000	28,822	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	150,000	174,403	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	15,000	17,482	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	20,000	23,109	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	150,000	171,814	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	12,000	14,622	2032/05/20
	137 20年国債	1.7000	18,000	20,834	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	190,000	217,969	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	65,000	75,399	2032/09/20
	141 20年国債	1.7000	48,000	55,795	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	165,000	193,564	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	25,000	27,461	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	100,000	115,377	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	70,000	79,998	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	9,000	10,503	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	190,000	221,737	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	11,000	13,371	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	165,000	192,934	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	11,000	13,277	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	195,000	226,168	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	22,000	27,674	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	175,000	201,220	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	21,000	26,746	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	195,000	224,532	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	26,000	33,214	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	185,000	211,033	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	17,000	21,580	2034/12/20

2022年1月11日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	151 20年国債	1.2000	190,000	212,220	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	20,000	25,200	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	200,000	223,536	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	15,000	18,947	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	180,000	203,641	2035/06/20
	20 30年国債	2.5000	16,000	20,696	2035/09/20
	154 20年国債	1.2000	205,000	229,407	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	16,000	20,321	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	165,000	180,330	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	17,000	22,118	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	150,000	151,524	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	16,000	20,884	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	196,000	192,356	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	15,000	19,628	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	205,000	209,587	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	17,000	21,813	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	155,000	160,499	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	32,000	41,607	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	165,000	173,075	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	135,000	139,533	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	32,000	42,294	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	175,000	180,699	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	160,000	165,040	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	34,000	45,161	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	230,000	233,493	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	155,000	157,146	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	43,000	56,674	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	170,000	177,559	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	125,000	126,381	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	56,000	73,166	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	155,000	153,885	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	135,000	131,512	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	76,000	98,353	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	125,000	121,528	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	130,000	126,135	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	45,000	59,241	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	185,000	182,371	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	150,000	147,592	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	95,000	120,486	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	195,000	191,665	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	135,000	134,882	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	110,000	143,865	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	150,000	149,607	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	128,000	125,177	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	120,000	152,947	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	170,000	169,090	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	138,000	176,434	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	135,000	170,594	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	85,000	105,962	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	88,000	111,635	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	70,000	87,547	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	65,000	80,102	2043/12/20

2022年1月11日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
42	30年国債	1.7000	73,000	90,042	2044/03/20
43	30年国債	1.7000	95,000	117,287	2044/06/20
44	30年国債	1.7000	75,000	92,677	2044/09/20
45	30年国債	1.5000	80,000	95,576	2044/12/20
46	30年国債	1.5000	90,000	107,579	2045/03/20
47	30年国債	1.6000	105,000	127,886	2045/06/20
48	30年国債	1.4000	110,000	129,323	2045/09/20
49	30年国債	1.4000	75,000	88,204	2045/12/20
50	30年国債	0.8000	85,000	88,589	2046/03/20
51	30年国債	0.3000	95,000	88,174	2046/06/20
52	30年国債	0.5000	102,000	99,166	2046/09/20
53	30年国債	0.6000	95,000	94,385	2046/12/20
54	30年国債	0.8000	100,000	103,920	2047/03/20
55	30年国債	0.8000	96,000	99,686	2047/06/20
56	30年国債	0.8000	88,000	91,307	2047/09/20
57	30年国債	0.8000	90,000	93,306	2047/12/20
1	40年国債	2.4000	30,000	42,556	2048/03/20
58	30年国債	0.8000	140,000	144,860	2048/03/20
59	30年国債	0.7000	97,000	97,983	2048/06/20
60	30年国債	0.9000	80,000	84,452	2048/09/20
61	30年国債	0.7000	70,000	70,398	2048/12/20
2	40年国債	2.2000	48,000	66,026	2049/03/20
62	30年国債	0.5000	82,000	78,254	2049/03/20
63	30年国債	0.4000	85,000	78,858	2049/06/20
64	30年国債	0.4000	90,000	83,350	2049/09/20
65	30年国債	0.4000	76,000	70,179	2049/12/20
3	40年国債	2.2000	19,000	26,296	2050/03/20
66	30年国債	0.4000	115,000	106,253	2050/03/20
67	30年国債	0.6000	90,000	87,553	2050/06/20
68	30年国債	0.6000	96,000	93,482	2050/09/20
69	30年国債	0.7000	106,000	105,871	2050/12/20
4	40年国債	2.2000	54,000	75,177	2051/03/20
70	30年国債	0.7000	166,000	165,598	2051/03/20
71	30年国債	0.7000	66,000	65,838	2051/06/20
72	30年国債	0.7000	203,000	202,252	2051/09/20
5	40年国債	2.0000	35,000	47,160	2052/03/20
6	40年国債	1.9000	40,000	53,170	2053/03/20
7	40年国債	1.7000	41,000	52,457	2054/03/20
8	40年国債	1.4000	33,000	39,539	2055/03/20
9	40年国債	0.4000	40,000	36,092	2056/03/20
10	40年国債	0.9000	91,000	96,002	2057/03/20
11	40年国債	0.8000	85,000	87,076	2058/03/20
12	40年国債	0.5000	99,000	91,803	2059/03/20
13	40年国債	0.5000	252,000	232,953	2060/03/20
14	40年国債	0.7000	225,000	221,256	2061/03/20
種別 小計	銘柄数 金額	251銘柄			
			31,759,000	33,228,681	
地方債証券					
24-16	愛知県公債	0.7570	100,000	100,764	2023/01/31
25-6	大阪市公債	0.6940	100,000	101,193	2023/11/22
3	兵庫県公債12年	0.5600	100,000	101,610	2025/04/16
401	大阪府公債	0.4770	100,000	101,538	2025/10/29
22-1	福岡県15年	1.6700	100,000	106,178	2025/11/21

2022年1月11日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	101,584	2025/11/27
	751 東京都公債	0.3700	100,000	101,197	2025/12/19
	27-15 北海道公債	0.2200	100,000	100,593	2026/02/26
	28-1 静岡県公債	0.0800	100,000	100,029	2026/03/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,925	2026/06/19
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,677	2027/03/25
	29-6 千葉県公債	0.2450	100,000	100,779	2028/01/25
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	115,359	2029/12/14
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	116,310	2030/05/24
	11 兵庫県公債20年	1.8400	100,000	113,953	2030/08/16
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	99,322	2031/06/30
種別 小計	銘柄数 金額	16銘柄			
			1,600,000	1,661,017	
特殊債券 (除く金融債)					
190	政保道路機構	0.6050	100,000	100,870	2023/05/31
65	地方公共団体	0.5350	100,000	101,344	2024/10/28
241	政保道路機構	0.4500	100,000	101,466	2025/03/31
261	政保道路機構	0.3810	100,000	101,441	2025/11/28
127	都市再生	0.0750	100,000	99,850	2026/09/18
80	住宅支援機構	1.5890	100,000	106,953	2026/09/18
81	政保道路機構	2.1000	100,000	114,474	2029/05/31
47	日本政策投資CO	1.0270	100,000	106,336	2029/09/20
種別 小計	銘柄数 金額	8銘柄			
			800,000	832,738	
普通社債券					
32	東日本旅客鉄道	2.2600	100,000	104,756	2024/03/19
25	西日本高速道	0.5240	100,000	101,308	2024/12/20
497	関西電力	1.0020	100,000	102,974	2025/06/20
14	セブンアンドアイ	0.1900	100,000	100,203	2025/12/19
20	成田国際空港	0.1050	100,000	99,922	2026/08/21
17	パナソニック	0.4700	100,000	101,149	2026/09/18
7	三井住友海上	0.1900	100,000	99,713	2026/11/13
6	楽天カード	0.6200	100,000	100,210	2026/12/17
80	三菱地所	2.3050	100,000	110,833	2027/03/19
9	ソフトバンク	0.4800	100,000	100,241	2027/12/03
65	東京瓦斯	0.2250	100,000	99,568	2030/09/10
18	楽天グループ	1.0500	100,000	99,776	2031/12/02
5	NTTファイナンス	0.4890	100,000	100,695	2032/09/17
種別 小計	銘柄数 金額	13銘柄			
			1,300,000	1,321,353	
合計	銘柄数 金額	288銘柄			
			35,459,000	37,043,789	

(注) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ・グローバル R E I T ・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（2022年1月11日）現在におけるダイワ・グローバル R E I T ・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・グローバル R E I T ・マザーファンドの主要な売買銘柄
投資信託証券

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

買				付				売				付			
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	
BRITISH LAND CO PLC（イギリス）		3,158.346		2,234,229		707		CYRUSONE INC（アメリカ）		198.334		2,022,394		10,196	
DIGITAL REALTY TRUST INC（アメリカ）		120.028		1,963,117		16,355		MIRVAC GROUP（オーストラリア）		8,517.471		1,998,414		234	
WELLTOWER INC（アメリカ）		202.381		1,880,067		9,289		EQUINIX INC（アメリカ）		19.547		1,646,382		84,226	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR（カナダ）		845.748		1,670,171		1,974		ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT（カナダ）		384.355		1,550,415		4,033	
AMERICAN TOWER CORP（アメリカ）		49.48		1,459,864		29,504		LAND SECURITIES GROUP PLC（イギリス）		1,592.875		1,457,163		914	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL（シンガポール）		11,180		1,381,392		123		KEPPEL DC REIT（シンガポール）		6,808.441		1,416,074		207	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA（スペイン）		1,110.887		1,361,934		1,225		WELLTOWER INC（アメリカ）		176.302		1,381,285		7,834	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD（フランス）		142.54		1,360,186		9,542		ALSTRIA OFFICE REIT-AG（ドイツ）		608.467		1,336,624		2,196	
INVITATION HOMES INC（アメリカ）		297.88		1,341,996		4,505		BRITISH LAND CO PLC（イギリス）		1,680.957		1,302,757		775	
AVALONBAY COMMUNITIES INC（アメリカ）		56.427		1,337,763		23,707		SUN COMMUNITIES INC（アメリカ）		58.625		1,232,509		21,023	

(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、2022年1月11日現在におけるダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド（27,937,030千口）の内容です。

外国投資信託証券

銘柄		2022年1月11日現在				銘柄		2022年1月11日現在			
		口	数	評	価			口	数	評	価
				外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)		千口	千アメリカ・ドル		千円			千口	千アメリカ・ドル		千円
DIGITAL CORE REIT UNITS		4,778.656		5,638	650,380			DUKE REALTY CORP	501.109	30,141	3,476,544
(アメリカ)								ESSEX PROPERTY TRUST INC	50.517	17,429	2,010,304
AVALONBAY COMMUNITIES INC		28.449		7,073	815,864			WELLTOWER INC	328.807	28,783	3,319,919
SIMON PROPERTY GROUP INC		190.762		30,689	3,539,760			HEALTHPEAK PROPERTIES INC	566.458	20,296	2,340,962
EQUINIX INC		23.487		17,951	2,070,562			HIGHWOODS PROPERTIES INC	99.524	4,658	537,336
AMERICAN TOWER CORP		33.534		8,866	1,022,688			REALTY INCOME CORP	325.59	23,322	2,689,960
HOST HOTELS & RESORTS INC		920.057		16,331	1,883,618			PUBLIC STORAGE	93.505	33,644	3,880,610
KIMCO REALTY CORP		490.972		12,338	1,423,079			REGENCY CENTERS CORP	83.446	6,365	734,169
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA		180.439		5,958	687,206			UDR INC	382.378	22,181	2,558,442
INVITATION HOMES INC		375.221		15,999	1,845,373			AGREE REALTY CORP	58.738	4,054	467,667
AMERICOLD REALTY TRUST		325.378		9,868	1,138,257			DIGITAL REALTY TRUST INC	88.132	14,034	1,618,697
VICI PROPERTIES INC		565.239		16,228	1,871,738			EXTRA SPACE STORAGE INC	63.98	13,340	1,538,689
APARTMENT INCOME REIT CO		184.174		9,884	1,140,091			アメリカ・ドル計	口数・金額	11,583,326	438,741
VENTAS INC		175.97		9,347	1,078,143			通 貨	銘柄数<比率>	30銘柄	<48.3%>
SPIRIT REALTY CAPITAL INC		137.874		6,640	765,858			(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円
SUN COMMUNITIES INC		72.072		14,054	1,620,992			RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	845.748	19,122	1,741,664
PROLOGIS INC		162.315		24,837	2,864,750			カナダ・ドル計	口数・金額	845,748	19,122
COUSINS PROPERTIES INC		159.414		6,591	760,294			通 貨	銘柄数<比率>	1銘柄	<1.7%>
SITE CENTERS CORP		137.129		2,188	252,430						

銘	柄	2022年1月11日現在		
		□ 数	評 価	額
			外貨建金額	邦貨換算金額
(オーストラリア)		千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU		2,240,246	25,157	2,086,349
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI		3,599,784	7,919	656,766
NATIONAL STORAGE REIT		5,153,278	13,604	1,128,233
MIRVAC GROUP		6,357,442	18,309	1,518,401
GOODMAN GROUP		2,264,981	54,948	4,556,874
CHARTER HALL GROUP		2,133,311	40,959	3,396,777
INGENIA COMMUNITIES GROUP		2,076,265	12,852	1,065,823
オーストラリア・ドル 通 貨 計	□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	23,825,307 7銘柄	173,751	14,409,225 <13.7%>
(香港)		千口	千香港ドル	千円
LINK REIT		2,856,792	193,976	2,868,907
香 港 ド ル 計	□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	2,856,792 1銘柄	193,976	2,868,907 < 2.7%>
(シンガポール)		千口	千シンガポール・ドル	千円
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI		11,043.4	16,012	1,363,020
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		9,404,432	18,620	1,585,000
KEPPEL REIT		13,319.8	15,051	1,281,172
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		5,034,577	25,172	2,142,715
シンガポール・ドル 通 貨 計	□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	38,802,209 4銘柄	74,857	6,371,909 < 6.1%>
(ニュージーランド)		千口	千ニュージーランド・ドル	千円
GOODMAN PROPERTY TRUST		4,272,952	11,451	894,248
ニュージーランド・ドル 通 貨 計	□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	4,272,952 1銘柄	11,451	894,248 < 0.9%>
(イギリス)		千口	千イギリス・ポンド	千円
INDUSTRIALS REIT LIMITED LTD		1,547,368	3,086	483,516
ASSURA PLC		9,613,649	6,676	1,045,768
URBAN LOGISTICS REIT PLC		1,603,999	2,855	447,197
SEGRO PLC		1,091,812	14,324	2,243,657
BRITISH LAND CO PLC		1,477,389	8,128	1,273,181
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		315,933	2,372	371,629
WORKSPACE GROUP PLC		361,727	2,978	466,572
SAFESTORE HOLDINGS PLC		653,508	8,822	1,381,845
BIG YELLOW GROUP PLC		245,719	3,943	617,715
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		1,203,686	3,235	506,777
TRITAX BIG BOX REIT PLC		5,348,035	12,321	1,929,974
イギリス・ポンド 通 貨 計	□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	23,462,825 11銘柄	68,746	10,767,838 <10.3%>
ユーロ (オランダ)		千口	千ユーロ	千円
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		454,738	9,047	1,182,503
NSI NV		54,911	1,982	259,084
国 小 計	□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	509,649 2銘柄	11,029	1,441,588 < 1.4%>
ユーロ (ベルギー)		千口	千ユーロ	千円
AEDIFICA		65.888	7,366	962,772
COFINIMMO		51.664	7,232	945,347
BEFIMMO		53.676	1,808	236,420
WAREHOUSES DE PAUW SCA		282,418	10,963	1,432,925
XIOR STUDENT HOUSING NV		75.166	3,656	477,947
国 小 計	□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	528,812 5銘柄	31,028	4,055,413 < 3.9%>

銘	柄	2022年1月11日現在		
		□ 数	評 価	額
			外貨建金額	邦貨換算金額
ユーロ (フランス)		千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		74.812	5,005	654,241
ICADE		118,909	7,800	1,019,516
ARGAN		54.69	6,267	819,158
GECINA SA		11,832	1,446	189,052
KLEPIERRE		704,489	16,160	2,112,239
国 小 計	□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	964,732 5銘柄	36,681	4,794,208 < 4.6%>
ユーロ (スペイン)		千口	千ユーロ	千円
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		1,171.339	11,399	1,489,910
国 小 計	□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	1,171.339 1銘柄	11,399	1,489,910 < 1.4%>
ユーロ 通貨 計		□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	3,174,532 13銘柄	90,138 11,781,121 <11.2%>
合 計	□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	108,823,691 68銘柄	—	99,439,316 <94.9%>

(注1) 邦貨換算金額は、2022年1月11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。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の決算日（2021年11月10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（2022年1月11日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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アクティブ・マザーファンドの主要な売買銘柄
投資信託証券

(2021年1月13日から2022年1月11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
		千口	千円	円			千口	千円	円
ＧＬＰ投資法人		28.507	5,275,765	185,069	日本ビルファンド		6.352	4,388,187	690,835
野村不動産マスターＦ		30.95	5,191,906	167,751	ジャパンリアルエステイト		6.044	4,065,801	672,700
ケネディクス・オフィス投資法人		6.98	5,005,150	717,070	野村不動産マスターＦ		23.164	3,908,044	168,712
日本ビルファンド		6.09	4,306,793	707,191	大和ハウスリート投資法人		12.155	3,807,286	313,228
ＡＰＩ投資法人		9.722	4,281,983	440,442	ケネディクス・オフィス投資法人		4.583	3,567,453	778,410
ジャパンリアルエステイト		6.011	3,994,061	664,458	アドバンス・レジデンス		9.351	3,383,347	361,816
ユナイテッド・アーバン投資法人		25.02	3,800,097	151,882	日本プロロジスリート		9.094	3,343,432	367,652
森ヒルズリート		23.019	3,504,297	152,234	ユナイテッド・アーバン投資法人		22.075	3,310,560	149,968
コンフォリア・レジデンシャル		9.587	3,219,746	335,845	産業ファンド		15.115	3,033,743	200,710
大和ハウスリート投資法人		10.127	3,191,120	315,110	イオンリート投資		16.68	2,581,632	154,774

(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、2022年1月11日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド（36,668,053千口）の内容です。

(1) 国内投資信託証券

銘	柄	2022年1月11日現在			
		口数	評	価	額
		千口			千円
エスコンジャパンリート		4.34			624,526
サンケイリアルエステート		4.332			527,204
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投		1.687			282,572
東海道リート投資法		2.145			232,947
日本アコモデーションファンド投資法人		4.664			3,050,256
森ヒルズリート		24.556			3,737,423
産業ファンド		11.767			2,454,596
アドバンス・レジデンス		7.621			2,819,770
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		18.078			3,866,884
ＡＰＩ投資法人		8.144			3,375,688
ＧＬＰ投資法人		40.12			7,506,452
コンフォリア・レジデンシャル		8.517			2,776,542
日本プロロジスリート		15.814			5,946,064
Ｏｎｅリート投資法人		1.743			529,000

銘	柄	2022年1月11日現在			
		口数	評	価	額
		千口			千円
イオンリート投資		11.16			1,785,600
ヒューリックリート投資法		11.52			1,968,768
日本リート投資法人		3.839			1,514,485
積水ハウス・リート投資		34.988			2,931,994
トーセイ・リート投資法人		3.726			487,733
ケネディクス商業リート		7.597			2,124,880
ヘルスケア&メディカル投資		1.428			224,910
野村不動産マスターＦ		43.906			7,024,960
ラサールロジポート投資		19.739			3,799,757
三井不ロジパーク		4.024			2,506,952
三菱地所物流ＲＥＩＴ		7.509			3,799,554
ザイマックス・リート		3.691			433,692
日本ビルファンド		14.275			9,464,325
ジャパンリアルエステイト		10.51			6,778,950

銘 柄	2022年1月11日現在	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
日本都市ファンド投資法人	65.777	6,413,257
オリックス不動産投資	20.96	3,640,752
日本プライムリアルティ	5.661	2,170,993
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	4.349	668,006
東急リアル・エステート	2.035	398,249
グローバル・ワン不動産投資法人	5.605	655,785
ユナイテッド・アーバン投資法人	30.04	4,109,472
森トラスト総合リート	3.833	545,052
インヴィンシブル投資法人	54.495	1,967,269
フロンティア不動産投資	3.552	1,736,928
平和不動産リート	1.533	229,643
日本ロジスティクスファンド投資法人	5.713	1,962,415
福岡リート投資法人	7.57	1,261,162
ケネディクス・オフィス投資法人	4.89	3,442,560
いちごオフィスリート投資法人	15.878	1,300,408
大和証券オフィス投資法人	2.21	1,553,630
スターツプロシード投資法人	0.756	173,728
大和ハウスリート投資法人	16.787	5,833,482
ジャパン・ホテル・リート投資法人	36.494	2,010,819
ジャパンエクセレント投資法人	12.159	1,634,169
合 計	口 数 、 金 額 銘 柄 数<比率>	----- 631.737 ----- 124,284,274 ----- 48銘柄 ----- <97.4%>

(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	2022年1月11日現在	
	買 建 額	売 建 額
国内	百万円	百万円
東証ＲＥＩＴ	2,397	－

(注) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の決算日（2021年10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（2022年1月11日）現在におけるダイワ北米好配当株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。

■ダイワ北米好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2021年1月13日から2022年1月11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
		千株	千円	円			千株	千円	円
META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)		3.47	112,313	32,367	FIRSTENERGY CORP (アメリカ)		42.568	167,926	3,944
RENEWABLE ENERGY GROUP INC (アメリカ)		16.791	111,257	6,626	NEXTERA ENERGY INC (アメリカ)		10.741	104,703	9,748
APPLE INC (アメリカ)		6.395	94,066	14,709	CONOCOPHILLIPS (アメリカ)		13.31	83,731	6,290
SUNCOR ENERGY INC (カナダ)		34.427	80,411	2,335	MASTERCARD INC - A (アメリカ)		2.113	83,245	39,397
ADOBE INC (アメリカ)		1.128	70,250	62,278	PFIZER INC (アメリカ)		14.537	82,625	5,683
EOG RESOURCES INC (アメリカ)		7.591	63,788	8,403	EOG RESOURCES INC (アメリカ)		7.591	75,100	9,893
MICRON TECHNOLOGY INC (アメリカ)		7.49	62,918	8,400	VISA INC-CLASS A SHARES (アメリカ)		3.264	74,642	22,868
NEXTERA ENERGY INC (アメリカ)		7.509	62,697	8,349	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP (アメリカ)		3.304	72,602	21,973
DOW INC (アメリカ)		9.163	61,531	6,715	RENEWABLE ENERGY GROUP INC (アメリカ)		8.408	68,416	8,137
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO (アメリカ)		7.68	54,299	7,070	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A (アメリカ)		1.192	68,268	57,272

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

買		付			売		付		
銘	柄	証券数	金 額	平均単価	銘	柄	証券数	金 額	平均単価
		千証券	千円	円			千証券	千円	円
WASHINGTON FEDERAL INC 4.875 A (アメリカ)		13.225	36,777	2,780	WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q (アメリカ)		8.938	26,223	2,933
FIRST HORIZON CORP 6.1 D (アメリカ)		10.983	32,374	2,947	JPMORGAN CHASE AND CO DS REPSTG T 4.2 (アメリカ)		7.301	20,801	2,849
JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ (アメリカ)		11.17	31,821	2,848	RENAISSANCERE HOLDINGS L 5.75 F (バミューダ)		6.45	19,061	2,955
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 4.8 J (アメリカ)		8.838	24,406	2,761	BANK OF HAWAII CORP 4.375 A (アメリカ)		6.416	18,595	2,898
WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA (アメリカ)		8.422	24,156	2,868	JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ (アメリカ)		6.371	18,581	2,916
JPMORGAN CHASE & CO 4.625 LL (アメリカ)		7.515	21,669	2,883	WASHINGTON FEDERAL INC 4.875 A (アメリカ)		6.722	18,461	2,746
WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC (アメリカ)		7.682	21,523	2,801	AMERICAN INTL GROUP 5.85 A (アメリカ)		5.825	18,271	3,136
JPMORGAN CHASE AND CO DS REPSTG T 4.2 (アメリカ)		7.301	20,414	2,796	REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B (アメリカ)		5.299	17,019	3,211
BANK OF HAWAII CORP 4.375 A (アメリカ)		6.416	17,947	2,797	MORGAN STANLEY 4.25 (アメリカ)		5.611	15,875	2,829
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B (アメリカ)		5.299	16,189	3,055	CULLEN/FROST BANKERS INC 4.45 B (アメリカ)		5.143	15,375	2,989

(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、2022年1月11日現在におけるダイワ北米好配当株マザーファンド（941,474千口）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	2022年1月11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	
ABBOTT LABORATORIES	10.34	139	16,131	ヘルスケア
ADOBE INC	16.08	845	97,523	情報技術
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	12.72	375	43,294	素材
ALBEMARLE CORP	12.17	276	31,859	素材
ATMOS ENERGY CORP	22.19	233	26,912	公益事業
CITIGROUP INC	65.7	433	50,036	金融
DANAHER CORP	9.29	281	32,469	ヘルスケア
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	34.34	451	52,084	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	64.85	453	52,306	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	21.51	340	39,266	情報技術
APPLE INC	102.5	1,764	203,569	情報技術
BOEING CO/THE	12.63	264	30,491	資本財・サービス
NISOURCE INC	83.83	232	26,850	公益事業
VERIZON COMMUNICATIONS INC	121.53	654	75,511	コミュニケーション・サービス
JPMORGAN CHASE & CO	47.39	792	91,456	金融
CATERPILLAR INC	13.78	305	35,227	資本財・サービス
ESSENTIAL UTILITIES INC	83.85	433	50,010	公益事業
MORGAN STANLEY	34.61	360	41,567	金融
BROADCOM INC	15.01	932	107,538	情報技術
DEERE & CO	10.59	402	46,398	資本財・サービス
TELEFLEX INC	5.28	170	19,702	ヘルスケア
COLGATE-PALMOLIVE CO	17.22	144	16,626	生活必需品
ACTIVISION BLIZZARD INC	29.47	185	21,451	コミュニケーション・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11.14	324	37,469	ヘルスケア
AMAZON.COM INC	2.59	836	96,481	一般消費財・サービス
FORD MOTOR CO	100.11	238	27,538	一般消費財・サービス
GENERAL ELECTRIC CO	13.25	131	15,193	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	38.78	236	27,315	一般消費財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	9.2	367	42,357	金融
ALPHABET INC-CL A	1.31	363	41,904	コミュニケーション・サービス
HOME DEPOT INC	8.17	316	36,511	一般消費財・サービス
JOHNSON & JOHNSON	29.77	515	59,433	ヘルスケア
RENEWABLE ENERGY GROUP INC	129.62	579	66,858	エネルギー
MCDONALD'S CORP	13.55	358	41,323	一般消費財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	29.02	952	109,810	コミュニケーション・サービス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22.01	563	64,996	情報技術
MERCK & CO. INC.	20.92	172	19,875	ヘルスケア
NIKE INC -CL B	11.97	180	20,770	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	19.9	573	66,096	資本財・サービス
NORTHROP GRUMMAN CORP	7.9	317	36,650	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	31.46	315	36,387	生活必需品
PFIZER INC	35.23	198	22,852	ヘルスケア
DOW INC	91.63	535	61,720	素材
PROCTER & GAMBLE CO/THE	15.93	255	29,493	生活必需品
TESLA INC	3.02	319	36,857	一般消費財・サービス
ORGANON & CO	2.09	6	776	ヘルスケア

銘柄	2022年1月11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	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	22.75	481	55,557	資本財・サービス
ANTHEM INC	4.21	184	21,260	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	18.01	282	32,530	コミュニケーション・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	24.25	386	44,586	資本財・サービス
WALMART INC	8.52	123	14,210	生活必需品
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5.32	284	32,853	情報技術
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13.67	317	36,677	金融
VISA INC-CLASS A SHARES	13.89	294	33,959	情報技術
NVIDIA CORP	18.5	506	58,465	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	12.88	286	33,046	金融
TYSON FOODS INC-CL A	16.71	151	17,494	生活必需品
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4.55	284	32,801	ヘルスケア
MASTERCARD INC - A	7.99	290	33,536	情報技術
BANK OF AMERICA CORP	131.81	644	74,388	金融
EATON CORP PLC	25.09	417	48,159	資本財・サービス
ECOLAB INC	10.24	231	26,673	素材
INTEL CORP	30.89	170	19,670	情報技術
MICROSOFT CORP	55.01	1,728	199,399	情報技術
MEDTRONIC PLC	31.78	335	38,715	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	121.33	1,139	131,391	情報技術
COMCAST CORP-CLASS A	42.2	213	24,589	コミュニケーション・サービス
アメリカ・ドル 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,115.05 67銘柄	27,890 <75.8%>	
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル	千円	
SUNCOR ENERGY INC	232.32	783	71,329	エネルギー
ENBRIDGE INC	36.43	188	17,131	エネルギー
カナダ・ドル 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	268.75 2銘柄	971 < 2.1%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,383.8 69銘柄	3,305,389 <77.9%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2022年1月11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) ハイブリッド優先証券

銘柄	2022年1月11日現在		
	証券数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千証券	千アメリカ・ドル	千円
CHS INC 7.5 4	4.575	130	15,096
REINSURANCE GRP OF AMER 5.75	2.558	74	8,576
ENTERGY LOUISIANA LLC 4.875 *	1.2	30	3,492
MORGAN STANLEY 5.85 K	0.633	18	2,080
AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	4.465	112	12,972
FIRST REPUBLIC BANK 5.125 H	2.582	65	7,591
VALLEY NATIONAL BANCORP 5.5 B	2.076	52	6,067
SOUTHERN CO 5.25	1.961	50	5,860
ENBRIDGE INC 6.375 B	0.497	13	1,525
BANK OF AMERICA CORP 6 GG	2.725	71	8,303
UNUM GROUP 6.25	4.012	104	12,110
KEYCORP 5.65 F	0.952	25	2,898
JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	2.235	59	6,911
ASSOC BANC-CORP 5.875 E	3.957	104	11,998
NISOURCE INC 6.5 B	2.81	76	8,773
JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	2.328	63	7,290
CMS ENERGY CORP 5.875	4.546	122	14,083
REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	1.367	38	4,446
ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.2 19-A	3.209	86	9,952
SPIRE INC 5.9 A	3.556	95	11,033
ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	1.1	31	3,650
SYNOVUS FINANCIAL CORP 5.875 E	4.851	131	15,112
ALLSTATE CORP 5.1 H	6.144	163	18,807
SEMPRA ENERGY 5.75	6.407	172	19,937
FIFTH THIRD BANCORP 6 A	1.923	49	5,742
AEGON FUNDING CO LLC 5.1	6.414	167	19,278
SYNCHRONY FINANCIAL 5.625 A	9.13	239	27,579
SOUTHERN CO 4.95 2020	8.035	212	24,503
WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	12.614	321	37,099
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 4.8 J	10.442	266	30,783
FIRST HORIZON CORP 6.5	3.936	106	12,248
ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	5.778	162	18,733
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	5.735	150	17,350
UNITED STATES CELLULAR C 6.25	2.438	65	7,524
BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	3.167	78	9,080
WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA	8.422	214	24,741
BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN 5.375 C	6.161	158	18,326
US CELLULAR CORP 5.5	1.667	43	4,970
WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC	7.682	188	21,778
WASHINGTON FEDERAL INC 4.875 A	6.503	167	19,351
SIGNATURE BANK NEW YORK 5 a	4.9	124	14,389
FIRST HORIZON CORP 6.1 D	10.983	292	33,721

銘柄	2022年1月11日現在		
	証券数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千証券	千アメリカ・ドル	千円
TELEPHONE & DATA SYS 6.625 UU	4.979	133	15,344
TEXAS CAPITAL BANCSHARES 5.75 B	5.524	144	16,654
JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ	4.799	122	14,086
CHARLES SCHWAB CORP 4.45 J	1.345	34	3,974
FIRST HORIZON CORP 4.7 F	4.185	105	12,188
REGIONS FINANCIAL CORP 4.45 E	1.326	32	3,803
JPMORGAN CHASE & CO 4.625 LL	7.515	191	22,094
HUNTINGTON BANCSHARES 5.7 C	0.4	10	1,192
ATHENE HOLDING LTD 4.875 D	5.141	130	15,090
FIRST REPUBLIC BANK 4.5	2.1	53	6,118
MORGAN STANLEY 6.875 F	1.589	43	5,025
PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P	1.29	33	3,834
MORGAN STANLEY 6.375 I	1.593	44	5,083
WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	2.892	76	8,879
合 計	証券数、金額	231,354	6,061
	銘柄数<比率>	56銘柄	<16.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、2022年1月11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) 外国投資信託証券

銘柄	柄	2022年1月11日現在		
		□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千□	千アメリカ・ドル	千円
UMH PROPERTIES INC 6.75 C		1.2	30	3,569
MONMOUTH REIT 6.125 C		2.875	72	8,353
SPIRIT REALTY CAPITAL IN 6 A		1.35	34	3,955
HUDSON PACIFIC PROPERTIE 4.75		2.012	51	5,940
合 計	□ 数、金額	7.437	189	21,818
	銘柄数<比率>	4銘柄		<0.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、2022年1月11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。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の決算日（2021年10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（2022年1月11日）現在におけるダイワ欧州好配当株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。

■ダイワ欧州好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2021年1月13日から2022年1月11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
TESCO PLC (イギリス)		千株	千円	円	SCHNEIDER ELECTRIC SE (フランス)		千株	千円	円
		32.194	11,480	356	NOKIA OYJ (フィンランド)		1.548	27,184	17,560
UNILEVER PLC (イギリス)		0.737	4,637	6,292	VODAFONE GROUP PLC (イギリス)		28.771	17,848	620
					MUENCHENER RUECKVER AG-REG (ドイツ)		33.866	6,680	197
					GIVAUDAN-REG (スイス)		0.202	6,437	31,869
					ENAGAS SA (スペイン)		0.013	6,108	469,911
					KONINKLIJKE DSM NV (オランダ)		1.57	4,007	2,552
					JACKSON FINANCIAL INC CLASS A (アメリカ)		0.144	2,823	19,610
							0.371	1,112	2,998

(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、2022年1月11日現在におけるダイワ欧州好配当株マザーファンド（671,590千口）の内容です。

外国株式

銘柄		2022年1月11日現在			業 種 等
		株数	評価額	金額	
(イギリス)		百株	千イギリス・ポンド	千円	
UNILEVER PLC		44.89	178	27,888	生活必需品
PRUDENTIAL PLC		148.44	192	30,132	金融
AVIVA PLC		406.69	176	27,639	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC		159	256	40,130	ヘルスケア
M&G PLC		687.65	142	22,327	金融
TESCO PLC		884.45	258	40,513	生活必需品
VODAFONE GROUP PLC		1,016.57	119	18,702	コミュニケーション・サービス
NATIONAL GRID PLC		178.73	188	29,489	公益事業
HSBC HOLDINGS PLC		434.04	213	33,447	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		117.61	203	31,879	エネルギー
イギリス・ポンド 通 貨 計		株数、金額 銘柄数<比率>	4,078.07 10銘柄	1,929 <20.5%>	
(スイス)		百株	千スイス・フラン	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		13.13	487	60,655	ヘルスケア
NESTLE SA-REG		55.78	679	84,620	生活必需品
ZURICH INSURANCE GROUP AG		9.03	382	47,580	金融
NOVARTIS AG-REG		43.89	361	45,002	ヘルスケア
GIVAUDAN-REG		0.95	418	52,079	素材
スイス・フラン 通 貨 計		株数、金額 銘柄数<比率>	122.78 5銘柄	2,329 <19.7%>	

銘柄		2022年1月11日現在			業 種 等
		株数	評価額	金額	
(スウェーデン)		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ELECTROLUX AB-SER B		24.86	529	6,705	一般消費財・サービス
スウェーデン・クローネ 通 貨 計		株数、金額 銘柄数<比率>	24.86 1銘柄	529 < 0.5%>	
ユーロ（オランダ）		百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE PHILIPS NV		77.85	259	33,892	ヘルスケア
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		65.06	198	25,960	生活必需品
KONINKLIJKE DSM NV		21.17	384	50,191	素材
KONINKLIJKE KPN NV		879.29	242	31,718	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>	1,043.37 4銘柄	1,084 < 9.6%>	
ユーロ（フランス）		百株	千ユーロ	千円	
TOTALENERGIES SE		62.99	294	38,480	エネルギー
MICHELIN（CGDE）		21.55	328	42,952	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		28.95	465	60,805	資本財・サービス
BNP PARIBAS		39.9	255	33,375	金融
CAPGEMINI SE		18.83	366	47,855	情報技術
AXA SA		121.26	332	43,433	金融
SANOFI		38.93	345	45,208	ヘルスケア
国 小 計		株数、金額 銘柄数<比率>	332.41 7銘柄	2,387 <21.2%>	

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

銘 柄		2022年1月11日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額	外貨建金額	
ユーロ（ドイツ）		百株	千ユーロ	千円	
SIEMENS AG-REG		28	414	54,118	資本財・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		29.96	291	38,061	一般消費財・サービス
BASF SE		36.76	242	31,753	素材
ALLIANZ SE-REG		11.45	255	33,432	金融
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		10.37	282	36,913	金融
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		211.45	328	42,913	コミュニケーション・サービス
DEUTSCHE POST AG-REG		68.23	365	47,718	資本財・サービス
国 小 計	株数、金額	396.22	2,179	284,910	
	銘柄数<比率>	7銘柄		<19.4%>	
ユーロ（スペイン）		百株	千ユーロ	千円	
ENAGAS SA		85.45	169	22,191	公益事業
国 小 計	株数、金額	85.45	169	22,191	
	銘柄数<比率>	1銘柄		< 1.5%>	
ユーロ（イタリア）		百株	千ユーロ	千円	
INTESA SANPAOLO		1,005.55	247	32,370	金融
ENI SPA		129.35	164	21,443	エネルギー
ENEL SPA		481.53	333	43,614	公益事業
国 小 計	株数、金額	1,616.43	745	97,428	
	銘柄数<比率>	3銘柄		< 6.6%>	
ユーロ通貨計	株数、金額	3,473.88	6,567	858,405	
	銘柄数<比率>	22銘柄		<58.4%>	
ファンド合計	株数、金額	7,699.59	—	1,457,201	
	銘柄数<比率>	38銘柄		<99.1%>	

（注1） 邦貨換算金額は、2022年1月11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。

＜補足情報＞

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の決算日（2021年10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（2022年1月11日）現在におけるダイワ・アジア・オセアニア好配当株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・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2021年1月13日から2022年1月11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
UNITED MICROELECTRONICS CORP (台湾)	87	16,526	189	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	9	21,582	2,398								
CHINA MERCHANTS BANK-H (中国)	13.5	13,221	979	MEDIATEK INC (台湾)	4	15,270	3,817								
AIA GROUP LTD (香港)	8.2	11,108	1,354	BHP GROUP LTD (オーストラリア)	4.5	14,624	3,249								
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL (オーストラリア)	1.3	10,927	8,405	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR (香港)	1.8	12,094	6,719								
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD (香港)	6	10,478	1,746	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD (韓国)	1.5	11,691	7,794								
SUN HUNG KAI PROPERTIES (香港)	6	9,963	1,660	MACQUARIE GROUP LTD (オーストラリア)	1	10,630	10,630								
HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	23	9,824	427	WIN SEMICONDUCTORS CORP (台湾)	7	10,456	1,493								
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD (オーストラリア)	3.5	8,275	2,364	SOUTH32 LTD (オーストラリア)	40.9	10,207	249								
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H (中国)	62.2	7,646	122	WILMAR INTERNATIONAL LTD (シンガポール)	22.1	9,564	432								
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP (ケイマン諸島)	2	7,009	3,504	WOODSIDE PETROLEUM LTD (オーストラリア)	4.6	9,408	2,045								

(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、2022年1月11日現在におけるダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド（233,981千口）の内容です。

外国株式

銘 柄	株 数	2022年1月11日現在		業 種 等
		評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株		千円	
BHP GROUP LTD	63	282	23,395	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	34	78	6,549	エネルギー
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	139	408	33,878	金融
WESTPAC BANKING CORP	96	209	17,379	金融
SANTOS LTD	117.34	80	6,656	エネルギー
RIO TINTO LTD	7	74	6,152	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	41.5	428	35,558	金融
MACQUARIE GROUP LTD	10	207	17,247	金融
CSL LTD	4	112	9,288	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	42	239	19,895	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>	553.84 10銘柄	2,122 <25.4%>	176,002
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	60	570	8,430	不動産
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	22	1,008	14,908	金融
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	230	174	2,585	資本財・サービス

銘 柄		2022年1月11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	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H		1,430	822	12,161	金融
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H		622	335	4,967	資本財・サービス
AIA GROUP LTD		202	1,616	23,900	金融
SANDS CHINA LTD		208	359	5,309	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		55	764	11,306	資本財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H		120	188	2,789	資本財・サービス
ZUIJIN MINING GROUP CO LTD-H		180	163	2,422	素材
CHINA MERCHANTS BANK-H		135	846	12,518	金融
香 港 ド ル	株数・金額	3,264	6,849	101,302	
通 貨 計	銘柄数<比率>	11銘柄	<14.6%>		
(シンガポール)		百株	千シンガポール・ドル	千円	
CAPITALAND INVESTMENT LTD		239	85	7,242	不動産
DBS GROUP HOLDINGS LTD		58	203	17,313	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD		170	73	6,222	生活必需品
シンガポール・ドル	株数・金額	467	361	30,778	
通 貨 計	銘柄数<比率>	3銘柄	< 4.4%>		

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

銘 柄		2022年1月11日現在		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(台湾)		百株	千台湾ドル	千円	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD		30	1,207	5,034	一般消費財・サービス
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP		20	1,954	8,147	資本財・サービス
DELTA ELECTRONICS INC		30	850	3,546	情報技術
NANYA TECHNOLOGY CORP		100	749	3,122	情報技術
MEDIATEK INC		60	6,570	27,392	情報技術
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT		850	3,072	12,811	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT		1,280	3,379	14,089	金融
NOVATEK MICROELECTRONICS COR		30	1,530	6,379	情報技術
WIN SEMICONDUCTORS CORP		40	1,418	5,912	情報技術
MERIDA INDUSTRY CO LTD		110	3,575	14,905	一般消費財・サービス
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC		240	15,432	64,342	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY		210	2,194	9,149	情報技術
UNITED MICROELECTRONICS CORP		870	5,402	22,526	情報技術
台 湾 ド ル 株数、金額		3,870	47,335	197,359	
通 貨 計 銘柄数<比率>		13銘柄		<28.5%>	
(韓国)		百株	千韓国ウォン	千円	
KIA CORP		7	58,660	5,666	一般消費財・サービス
SK HYNIX INC		18	224,100	21,648	情報技術
HYUNDAI MOTOR CO		5	104,750	10,118	一般消費財・サービス
POSCO		3.3	100,320	9,690	素材
HYUNDAI MOBIS CO LTD		2.3	60,260	5,821	一般消費財・サービス
E-MART INC		4	59,600	5,757	生活必需品
NAVER CORP		3.9	130,650	12,620	コミュニケーション・サービス
LG CHEM LTD		0.9	63,900	6,172	素材
KB FINANCIAL GROUP INC		32	184,960	17,867	金融
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD		66	514,800	49,729	情報技術
SK TELECOM		6.07	34,295	3,312	コミュニケーション・サービス
HANA FINANCIAL GROUP		34	154,360	14,911	金融
韓 国 ウォン 株数、金額		182.47	1,690,655	163,317	
通 貨 計 銘柄数<比率>		12銘柄		<23.5%>	
ファンド合計 株数、金額		8,337.31	—	668,759	
銘柄数<比率>		49銘柄		<96.4%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2022年1月11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。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の決算日（2021年10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（2022年1月11日）現在におけるダイワ好配当日本株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。

■ダイワ好配当日本株マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2021年1月13日から2022年1月11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
しまむら		34.6	354,407	10,242	武田薬品		110	349,628	3,178										
三菱商事		101.7	341,382	3,356	アドバンテス		33.9	315,735	9,313										
伊藤忠		99.3	339,661	3,420	本田技研		92.6	309,515	3,342										
いすゞ自動車		178.6	261,313	1,463	三井物産		119	269,373	2,263										
日本電信電話		75.7	243,675	3,218	日本電信電話		82.4	244,728	2,970										
山九		34	161,290	4,743	伊藤忠		72.7	236,513	3,253										
丸井グループ		71.2	160,943	2,260	大塚ホールディングス		50	227,255	4,545										
日本製鉄		72.3	155,634	2,152	ソフトバンク		149.2	208,705	1,398										
ツガミ		95.5	147,680	1,546	三井住友トラストHD		45.1	166,238	3,686										
エア・ウォーター		76.9	146,766	1,908	リコー		142	158,242	1,114										

(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、2022年1月11日現在におけるダイワ好配当日本株マザーファンド（4,588,117千口）の内容です。

国内株式

2022年1月11日現在				2022年1月11日現在				2022年1月11日現在			
銘	柄	株 数	評 価 額	銘	柄	株 数	評 価 額	銘	柄	株 数	評 価 額
		千株	千円			千株	千円			千株	千円
建設業 (3.0%)				エア・ウォーター		54.6	98,007	ファインシンター		18.9	30,807
オリエンタル白石		294.4	69,184	四国化成		45.2	62,918	機械 (4.3%)			
住友林業		79.5	173,707	東京応化工業		10.9	70,087	ツガミ		95.5	158,148
大和ハウス		34.4	115,068	住友ベークライト		22.8	133,380	ソディック		84.4	68,026
九電工		29.3	101,378	旭有機材		23.1	40,124	フリーウ		45.4	57,249
食料品 (1.8%)				第一工業製薬		45.3	143,827	三精テクノロジーズ		28.5	21,403
ブルボン		22.4	54,969	富士フィルムHLDGS		43.2	366,940	キトー		56.6	108,502
アサヒグループホールディン		23.7	108,711	デクセリアルズ		100	369,500	I H I		68.4	167,716
太陽化学		22.3	38,133	藤森工業		10	40,850	スター精密		52.5	81,165
日本たばこ産業		34.4	81,373	信越ポリマー		123.7	134,338	電気機器 (11.4%)			
繊維製品 (2.0%)				ガラス・土石製品 (3.5%)				日立		88.5	600,384
富士紡ホールディングス		16.1	65,849	A G C		77.2	409,160	富士電機		57.1	354,020
帝国繊維		15.1	31,725	ニチアス		50.7	140,033	I D E C		35.5	93,223
セーレン		40.6	103,733	鉄鋼 (0.7%)				T D K		33.9	149,329
ワコールホールディングス		51.3	107,883	日本製鉄		35.6	72,926	村田製作所		17.7	159,795
化学 (14.2%)				三菱製鋼		30.1	32,146	東京エレクトロン		6.6	414,150
旭化成		260.2	292,204	非鉄金属 (0.8%)				輸送用機器 (9.2%)			
共和レザー		64.4	42,568	三井金属		37.3	118,987	トヨタ紡織		57.6	138,297
昭和電工		27.8	71,779	金属製品 (1.5%)				豊田自動織機		19	178,600
日本曹達		30.9	102,124	三和ホールディングス		69.2	86,292	デンソー		29.8	299,788
大阪ソーダ		21.2	63,706	日東精工		77.4	47,446	いすゞ自動車		110.5	161,882
信越化学		8.8	170,588	マルゼン		30.9	67,980	トヨタ自動車		243.5	565,407

ダイワ好配当日本株マザーファンド

銘柄	2022年1月11日現在			銘柄	2022年1月11日現在		
	株数	評価額			株数	評価額	
	千株	千円			千株	千円	
プレス工業	116	47,676		不動産業 (1.1%)			
ミクニ	67.4	26,623			AND DOホールディングス	46.8	40,716
精密機器 (0.5%)					東京建物	80.6	136,536
セイコーHD	38.9	85,035		サービス業 (2.2%)			
その他製品 (3.3%)					ディップ	26.5	97,917
フジシールインターナショナル	49.4	109,915			日本空調サービス	74.6	59,605
大日本印刷	119.9	344,592			フルキャストホールディングス	38.7	80,573
リンテック	22.4	60,345			ベルシステム24HLDGS	72.1	86,736
陸運業 (1.3%)					日本管財	5.9	16,732
山九	33.3	157,342		合計	株数、金額	千株	千円
丸全昭和運輸	13.8	43,539			銘柄数<比率>	6,478.3	15,474,691
倉庫・運輸関連業 (0.9%)						103銘柄	<95.8%>
三井倉庫HOLD	54.6	133,169		(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。			
情報・通信業 (7.8%)				(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。			
SRAホールディングス	7.5	21,105		(注3) 評価額の単位未満は切捨て。			
伊藤忠テクノソリューション	29.2	100,886					
アルゴグラフィックス	31.1	100,919					
日本ユニシス	48.9	150,612					
日本電信電話	125.3	414,367					
KDDI	108.6	390,199					
シーイーシー	27.5	29,645					
卸売業 (10.4%)							
エレマテック	21.7	23,479					
アルコニックス	29.6	40,640					
ダイワボウHD	60.1	106,256					
レスターホールディングス	11.1	21,545					
TOKAIホールディングス	184.6	161,155					
三洋貿易	84	84,000					
コメダホールディングス	31.6	64,464					
萩原電気HLDGS	17.3	34,582					
ダイトロン	42.5	89,165					
伊藤忠	99.3	350,330					
スターゼン	20.8	41,579					
三菱商事	101.7	383,612					
稲畑産業	40.8	68,380					
日鉄物産	28	145,040					
小売業 (3.8%)							
パルグループHLDGS	67.3	107,747					
しまむら	34.3	330,309					
丸井グループ	69.9	155,317					
銀行業 (5.4%)							
三菱UFJフィナンシャルG	609.2	427,292					
三井住友フィナンシャルG	95.4	405,927					
証券・商品先物取引業 (0.7%)							
SBIホールディングス	35.6	111,962					
保険業 (5.7%)							
MS&AD	52.2	203,475					
第一生命HLDGS	78.9	210,781					
東京海上HD	67.3	471,773					
その他金融業 (4.3%)							
プレミアグループ	60.4	215,326					
オリックス	181.8	448,227					

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。

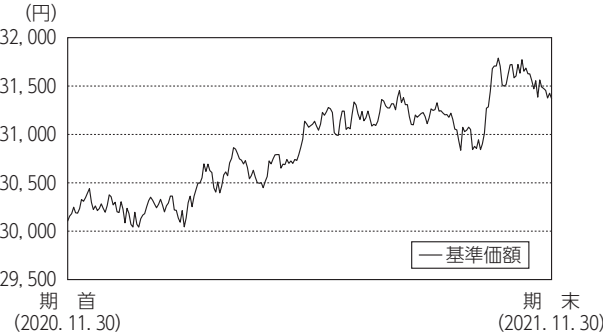
運用方針	投資成果を FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の公社債
株式組入制限	純資産総額の30%以下

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



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	債 券
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	組入比率	先物比率
		%		%	%	%
(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。

《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。

■ 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)	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
			千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル
外 国	アメリカ	国債証券	290, 158 (—)	194, 720 (—)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 12, 555	千カナダ・ドル 12, 968 (—)
	オーストラリア	国債証券	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	国債証券	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	国債証券	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	国債証券	千イスラエル・シェケル 4, 974	千イスラエル・シェケル 3, 106 (—)
	デンマーク	国債証券	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	国債証券	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	国債証券	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	国債証券	千メキシコ・ペソ 44, 370	千メキシコ・ペソ 68, 282 (—)
国	中国	国債証券	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 国	マレーシア	国債証券	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	国債証券	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)	国債証券	千ユーロ 2, 269	千ユーロ 1, 287 (—)
	ユーロ (オランダ)	国債証券	千ユーロ 4, 757	千ユーロ 3, 976 (—)
	ユーロ (ベルギー)	国債証券	千ユーロ 3, 234	千ユーロ 5, 045 (—)
	ユーロ (フランス)	国債証券	千ユーロ 25, 245	千ユーロ 21, 124 (—)
	ユーロ (ドイツ)	国債証券	千ユーロ 19, 386	千ユーロ 15, 981 (—)
	ユーロ (スペイン)	国債証券	千ユーロ 13, 911	千ユーロ 10, 877 (—)
	ユーロ (イタリア)	国債証券	千ユーロ 24, 037	千ユーロ 22, 394 (—)
	ユーロ (フィンランド)	国債証券	千ユーロ 2, 007	千ユーロ 1, 677 (—)
国	ユーロ (オーストリア)	国債証券	千ユーロ 3, 575	千ユーロ 2, 505 (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	国債証券	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		売 付	
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% 2027/2/15	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				
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
			千円	%	%	%	%	%
アメリカ	千アメリカ・ドル 922,829	千アメリカ・ドル 955,962	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・シェケル 27,300	千イスラエル・シェケル 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

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 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
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	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	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	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	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	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	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	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	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）

		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	
			%	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	6, 668	6, 758	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, 595	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

外国債券インデックスマザーファンド

当			期		末			償還年月日
区 分	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	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	

当			期		未			償還年月日
区 分	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	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	

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	年利率	額 面 金 額	未 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	%	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	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

当			未			償還年月日	
区 分	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	0.2500	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

外国債券インデックスマザーファンド

当 期				未			償還年月日
区 分	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	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 2500	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	2028/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0. 7500	3, 000	3, 968	451, 484	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0. 2500	2, 000	2, 949	335, 589	2024/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0. 1250	1, 500	1, 977	224, 987	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 2500	5, 000	1, 494	170, 008	2028/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0. 8750	5, 000	4, 955	563, 827	2026/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 3750	5, 500	4, 939	562, 001	2024/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 3750	3, 000	5, 450	620, 134	2024/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1. 2500	9, 300	2, 971	338, 040	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2. 0000	6, 900	9, 076	1, 032, 635	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1. 7500	3, 000	7, 083	805, 862	2041/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 1250	2, 500	2, 901	330, 135	2023/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 6250	6, 000	2, 488	283, 102	2026/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1. 0000	5, 000	5, 855	666, 162	2028/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 1250	3, 000	4, 871	554, 270	2023/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1. 1250	5, 000	2, 984	339, 548	2028/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 7500	5, 000	4, 908	558, 405	2026/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 3750	7, 500	4, 904	557, 979	2024/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1. 2500	7, 000	7, 421	844, 375	2028/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 8750	3, 500	6, 926	788, 051	2026/09/30
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 2500	1, 500	3, 451	392, 640	2023/09/30	
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 6250	2, 000	1, 494	170, 061	2024/10/15	
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券			1, 991	226, 570		
通貨小計	銘柄数	255銘柄					
	金 額			922, 829	955, 962	108, 759, 849	
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2. 7500	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 7500	405	487	43, 542	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 7500	983	1, 280	114, 286	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 0000	1, 117	1, 581	141, 163	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 0000	913	1, 444	128, 961	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 5000	961	1, 226	109, 472	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	1, 253	1, 251	111, 737	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 5000	1, 405	1, 265	112, 953	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	1, 337	1, 454	129, 802	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	1, 156	1, 566	139, 843	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	969	1, 196	106, 802	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 0000	1, 240	974	87, 022	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0000	650	1, 211	108, 142	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 7500	4, 300	671	59, 960	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0000	1, 300	4, 352	388, 485	2023/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0000	3, 710	1, 324	118, 226	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	1, 220	3, 760	335, 701	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	1, 200	1, 287	114, 949	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	1, 400	1, 232	110, 024	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2500	3, 450	1, 414	126, 263	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2500	700	3, 377	301, 477	2025/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 5000	2, 890	701	62, 587	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	700	2, 806	250, 511	2022/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 5000	2, 000	697	62, 243	2030/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	2, 100	1, 820	162, 510	2026/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	1, 200	2, 004	178, 924	2024/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	1, 500	1, 177	105, 147	2023/02/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	1, 100	1, 491	133, 114	2023/05/01

		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			
				%	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	銘柄数	37銘柄								
	金 額				48,671	50,556	4,512,686			
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	1,168	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	銘柄数	27銘柄								
	金 額				46,852	49,050	3,987,292			
シンガポール					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル				
	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			

外国債券インデックスマザーファンド

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	
			%	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				千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
	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

当 期				未 評 価 額				
区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	償 還 年 月 日
				%	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	54銘柄						
	金 額				73,322	93,472	14,166,718	
イスラエル					千イスラエル・シェケル	千イスラエル・シェケル		
		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	16銘柄						
	金 額				27,300	30,584	1,101,379	
デンマーク					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
		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	9銘柄						
	金 額				50,511	63,327	1,093,665	
ノルウェー					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
		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

外国債券インデックスマザーファンド

		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	
			%	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	
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	千スウェーデン・クローネ		
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	4, 655	7, 006	87, 785	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 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	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5. 7500	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
	Mexican Bonos	国債証券	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	
中国	China Government Bond	国債証券	3. 7200	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. 0200	3, 000	3, 163	56, 409	2051/04/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 6900	3, 800	3, 851	68, 676	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 5700	4, 500	4, 504	80, 324	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 9100	10, 000	10, 019	178, 641	2023/05/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券		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	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 5020	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	4. 4980	2, 373	2, 401	64, 488	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 3920	1, 178	1, 253	33, 667	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 2320	1, 514	1, 595	42, 836	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 8920	1, 300	1, 362	36, 593	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 4800	731	754	20, 265	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 8440	1, 001	1, 016	27, 294	2023/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 7330	1, 427	1, 432	38, 470	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 9350	1, 886	1, 920	51, 578	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券		800	864	23, 208	2043/09/30

		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	
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	
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

外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	
						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
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	822	105,623
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	811	104,176
		IRISH TREASURY	国債証券	—	800	786	100,959
		IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	400	398	51,181
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
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,139	1,562	200,633
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,555	2,507	322,002
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	832	106,904
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,729	3,023	388,241
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,509	193,881
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,443	185,388
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,929	3,226	414,283
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,624	208,663
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,850	237,606
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,938	2,038	261,732
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,358	302,836
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,422	182,675
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,457	187,112
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,253	160,990
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	980	125,867
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,431	183,793
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	821	105,480
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,050	1,002	128,710
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,322	169,772
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	892	114,575
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	600	613	78,837
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
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	1,952	250,677
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	1,311	168,357
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,863	1,995	256,184
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	1,506	193,426
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	640	935	120,071
		Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	940	957	122,930
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,100	1,176	151,113
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,087	139,634
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	580	831	106,772
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	600	696	89,412
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,490	1,603	205,858
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	650	737	94,713
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,630	209,372
		Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	700	870	111,814
		Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,244	159,807
		Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	660	644	82,824
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,228	157,777
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,600	1,594	204,704

		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	
			%	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	
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

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	未		償還年月日
						評 価	額	
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	千ユーロ 4,000	千ユーロ 4,024	千円 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	銘柄数 金 額	47銘柄			152,793	178,981	22,982,963	
ユーロ（ドイツ）		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	千ユーロ 974	千ユーロ 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	2031/02/1

区 分		当 期			末		
		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
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,012	130,042
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	13,028
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	696	89,486
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,730	5,795	744,206
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,929	247,802
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,956	251,216
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,738	223,178
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,460	315,940
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,364	303,639
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	103	13,226
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,266	291,047
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,340	172,141
国 小 計	銘柄数 金 額	56銘柄			110,312	130,913	16,810,567
ユーロ (スペイン)					千ユーロ	千ユーロ	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	3,792	486,939
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	2,189	281,145
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	2,352	302,131
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,411	309,661
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	3,006	386,053
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	2,715	348,693
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	2,433	312,457
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,630	2,833	363,830
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	2,073	266,317
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,750	2,107	270,600
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	2,237	287,324
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,600	1,617	207,752
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,400	2,617	336,154
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,300	1,763	226,478
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	2,400	2,439	313,272
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,900	3,171	407,315
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,760	226,067
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,850	2,126	273,011
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,346	301,288
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,900	372,398
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,360	1,391	178,706
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,460	2,483	318,892
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,536	325,737
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,321	169,692
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,521	323,845
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,900	3,146	404,094
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,300	1,350	173,378
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	506	65,020
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	2,200	2,148	275,908
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	303	38,988
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	650	594	76,295
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	500	64,272
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	900	898	115,415
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,400	1,410	181,064
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	600	600	77,080
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	302	38,827
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,179	3,393	435,771

外国債券インデックスマザーファンド

		当			期		末		
区 分		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価		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 金 額	49銘柄			90, 321	105, 873	13, 595, 192
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			

区 分		当 期			未		
		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
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,550	1,764	226,597
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,533	196,954
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,000	2,034	261,211
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,300	2,454	315,172
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	2,025	260,058
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,400	2,567	329,695
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3000	1,300	1,316	169,054
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,200	2,273	291,923
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,729	222,080
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,300	1,346	172,924
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	2,300	2,302	295,685
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,107	142,217
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	1,200	1,167	149,857
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	700	661	84,960
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,874	240,741
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,700	2,619	336,357
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	700	677	86,947
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,093	140,428
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,508	193,680
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	12,906
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	460	446	57,300
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	798	102,573
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,895	243,369
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,008	257,854
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	502	64,561
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,089	139,920
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	3,254	4,421	567,748
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,184	537,331
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,707	347,707
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	3,331	427,771
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	3,734	479,488
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	3,162	406,138
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,448	314,472
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,470	317,174
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	3,523	452,392
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,460	315,934
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,960	2,068	265,624
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	3,089	396,666
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,029	260,607
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	2,880	369,842
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,431	312,186
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,439	313,295
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,318	2,841	364,826
国 小 計	銘柄数	81銘柄					
	金 額				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
		Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	295	37,917
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	850	109,179
		Finland Government Bond	国債証券	—	700	709	91,084
		Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	455	58,553
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	843	108,361
		Finland Government Bond	国債証券	1.1250	670	757	97,213

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	未 評 価 額		償還年月日
							外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
		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。

■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	%
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
未收利息	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3 0 VA (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5 0 VA (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3 0 VA (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5 0 VA (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

- i Free 外国債券インデックス 1, 686, 822, 876円
- i Free 8 資産バランス 1, 443, 360, 479円
- i Free 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3 0 964, 870, 268円
- ダイワ・ライフ・バランス5 0 601, 682, 079円
- ダイワ・ライフ・バランス7 0 393, 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3 0 3, 367, 466円
- ダイワつみたてインデックスバランス5 0 1, 453, 811円
- ダイワつみたてインデックスバランス7 0 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4 0 VA 163, 610, 849円
- ダイワ世界バランスファンド6 0 VA 135, 308, 646円
- ダイワ・バランスファンド3 5 VA 3, 912, 241, 392円
- ダイワ・バランスファンド2 5 VA (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2 5 33, 014, 942円
- ダイワライフスタイル5 0 65, 372, 616円
- ダイワライフスタイル7 5 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。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

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）

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）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。

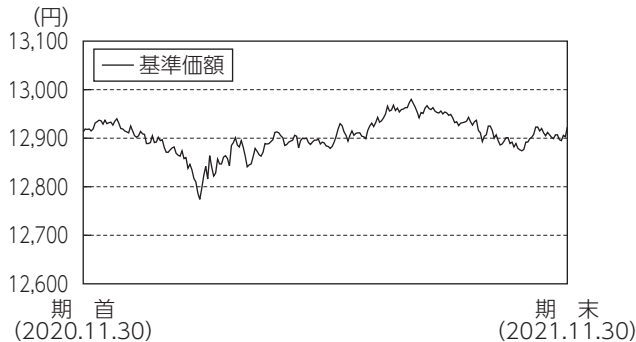
運 用 方 針	投資成果をNOMURA－BPI総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

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



年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総合指数		公社債組入比率		債券先物比率	
	円	騰落率	円	騰落率	%	%	%	%
(期首)2020年11月30日	12,913	—	12,936	—	99.2	—	—	—
12月末	12,913	0.0	12,939	0.0	98.9	—	—	—
2021年1月末	12,881	△0.2	12,907	△0.2	99.3	—	—	—
2月末	12,774	△1.1	12,800	△1.0	99.4	—	—	—
3月末	12,863	△0.4	12,889	△0.4	99.5	—	—	—
4月末	12,887	△0.2	12,913	△0.2	99.0	—	—	—
5月末	12,892	△0.2	12,919	△0.1	99.5	—	—	—
6月末	12,899	△0.1	12,929	△0.1	99.1	—	—	—
7月末	12,963	0.4	12,993	0.4	99.2	—	—	—
8月末	12,952	0.3	12,981	0.3	99.2	—	—	—
9月末	12,907	△0.0	12,936	△0.0	99.4	—	—	—
10月末	12,892	△0.2	12,923	△0.1	99.1	—	—	—
(期末)2021年11月30日	12,923	0.1	12,954	0.1	98.9	—	—	—

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) NOMURA-BPI 総合指数は、同指数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。NOMURA-BPIは、野村證券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

(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：12,913円 期末：12,923円 騰落率：0.1%

【基準価額の主な変動要因】

金利は上昇（債券価格は下落）したものの、債券の利息収入を得たため、基準価額は当作成期首と同程度の水準となりました。

◆投資環境について

○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、日銀の短長金利操作の下、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」

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ってまいります。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、売買コストなどに十分配慮しつつ、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、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は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99%前後の高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデデュレーション、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、ファンドへ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は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0.0%程度で、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（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NOMURA-BPI 総合指数です。

《今後の運用方針》

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ってまいります。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、売買コストなどに十分配慮しつつ、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、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は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
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	15,001,750	2,892,501 (－)
	地方債証券	320,741	201,659 (－)
	特殊債券	107,841	100,953 (－)
	社債券	300,719	(－)

(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				
買 付		売 付		
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額	
	千円		千円	
145 5年国債 0.1% 2025/9/20	467,599	130 5年国債 0.1% 2021/12/20	247,526	
147 5年国債 0.005% 2026/3/20	408,046	133 5年国債 0.1% 2022/9/20	230,538	
143 5年国債 0.1% 2025/3/20	352,941	132 5年国債 0.1% 2022/6/20	190,440	
419 2年国債 0.1% 2022/12/1	351,454	131 5年国債 0.1% 2022/3/20	190,423	
148 5年国債 0.005% 2026/6/20	341,952	413 2年国債 0.1% 2022/6/1	180,403	
363 10年国債 0.1% 2031/6/20	332,235	414 2年国債 0.1% 2022/7/1	170,363	
361 10年国債 0.1% 2030/12/20	329,948	325 10年国債 0.8% 2022/9/20	161,552	
362 10年国債 0.1% 2031/3/20	315,768	408 2年国債 0.1% 2022/1/1	160,349	
140 5年国債 0.1% 2024/6/20	312,102	418 2年国債 0.1% 2022/11/1	160,342	
138 5年国債 0.1% 2023/12/20	281,762	319 10年国債 1.1% 2021/12/20	141,786	

(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）

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年末満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	30,736,000	32,422,792	88.7	－	58.7	19.4	10.6
地方債証券	1,600,000	1,669,140	4.6	－	1.8	2.2	0.6
特殊債券 (除く金融債券)	800,000	836,281	2.3	－	0.6	1.4	0.3
普通社債券	1,200,000	1,226,423	3.4	－	1.4	1.9	－
合 計	34,336,000	36,154,637	98.9	－	62.5	24.9	11.4

(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）

		当 期			末		
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日		
		%	千円	千円			
国債証券	419 2年国債	0.1000	350,000	350,805	2022/12/01		
	134 5年国債	0.1000	170,000	170,402	2022/12/20		
	326 10年国債	0.7000	100,000	100,863	2022/12/20		
	327 10年国債	0.8000	90,000	90,872	2022/12/20		
	59 20年国債	1.7000	3,000	3,057	2022/12/20		
	420 2年国債	0.1000	100,000	100,249	2023/01/01		
	421 2年国債	0.1000	130,000	130,349	2023/02/01		
	422 2年国債	0.1000	200,000	200,574	2023/03/01		
	135 5年国債	0.1000	420,000	421,226	2023/03/20		
	328 10年国債	0.6000	60,000	60,565	2023/03/20		
	61 20年国債	1.0000	40,000	40,585	2023/03/20		
	423 2年国債	0.0050	30,000	30,054	2023/04/01		
	424 2年国債	0.0050	150,000	150,286	2023/05/01		
	425 2年国債	0.0050	130,000	130,262	2023/06/01		
	136 5年国債	0.1000	380,000	381,356	2023/06/20		
	329 10年国債	0.8000	200,000	202,874	2023/06/20		
	62 20年国債	0.8000	16,000	16,229	2023/06/20		
	63 20年国債	1.8000	30,000	30,897	2023/06/20		
	426 2年国債	0.0050	60,000	60,127	2023/07/01		
	427 2年国債	0.0050	90,000	90,202	2023/08/01		
	428 2年国債	0.0050	170,000	170,401	2023/09/01		
	137 5年国債	0.1000	590,000	592,501	2023/09/20		
	330 10年国債	0.8000	81,000	82,360	2023/09/20		
	331 10年国債	0.6000	40,000	40,527	2023/09/20		
	64 20年国債	1.9000	35,000	36,283	2023/09/20		
	429 2年国債	0.0050	180,000	180,446	2023/10/01		
	138 5年国債	0.1000	560,000	562,648	2023/12/20		
	332 10年国債	0.6000	65,000	65,969	2023/12/20		
	65 20年国債	1.9000	42,000	43,749	2023/12/20		
	66 20年国債	1.8000	30,000	31,188	2023/12/20		
	139 5年国債	0.1000	500,000	502,650	2024/03/20		
	333 10年国債	0.6000	83,000	84,386	2024/03/20		
	67 20年国債	1.9000	19,000	19,884	2024/03/20		
	68 20年国債	2.2000	25,000	26,336	2024/03/20		
	69 20年国債	2.1000	12,000	12,614	2024/03/20		
	140 5年国債	0.1000	450,000	452,587	2024/06/20		
	334 10年国債	0.6000	320,000	325,936	2024/06/20		
	70 20年国債	2.4000	18,000	19,162	2024/06/20		
	71 20年国債	2.2000	17,000	18,011	2024/06/20		
	141 5年国債	0.1000	460,000	462,907	2024/09/20		
	335 10年国債	0.5000	210,000	213,689	2024/09/20		
	72 20年国債	2.1000	53,000	56,308	2024/09/20		
	142 5年国債	0.1000	200,000	201,378	2024/12/20		
	337 10年国債	0.3000	300,000	303,906	2024/12/20		

当		期		末		償還年月日
区 分	銘柄	年利	額面金額	評価額	評価額	
		%	千円	千円		
143	5年国債	0.1000	550,000	554,097	2025/03/20	
338	10年国債	0.4000	80,000	81,377	2025/03/20	
75	20年国債	2.1000	14,000	15,029	2025/03/20	
76	20年国債	1.9000	25,000	26,672	2025/03/20	
144	5年国債	0.1000	400,000	403,136	2025/06/20	
339	10年国債	0.4000	135,000	137,502	2025/06/20	
78	20年国債	1.9000	17,000	18,221	2025/06/20	
79	20年国債	2.0000	14,000	15,055	2025/06/20	
145	5年国債	0.1000	480,000	483,940	2025/09/20	
340	10年国債	0.4000	190,000	193,773	2025/09/20	
81	20年国債	2.0000	65,000	70,237	2025/09/20	
82	20年国債	2.1000	28,000	30,362	2025/09/20	
146	5年国債	0.1000	170,000	171,451	2025/12/20	
341	10年国債	0.3000	15,000	15,253	2025/12/20	
147	5年国債	0.0050	406,000	407,924	2026/03/20	
342	10年国債	0.1000	140,000	141,269	2026/03/20	
85	20年国債	2.1000	31,000	33,958	2026/03/20	
86	20年国債	2.3000	6,000	6,624	2026/03/20	
87	20年国債	2.2000	35,000	38,491	2026/03/20	
148	5年国債	0.0050	340,000	341,706	2026/06/20	
343	10年国債	0.1000	270,000	272,592	2026/06/20	
88	20年国債	2.3000	33,000	36,628	2026/06/20	
89	20年国債	2.2000	15,000	16,580	2026/06/20	
149	5年国債	0.0050	70,000	70,337	2026/09/20	
344	10年国債	0.1000	90,000	90,868	2026/09/20	
345	10年国債	0.1000	410,000	414,161	2026/12/20	
92	20年国債	2.1000	60,000	66,702	2026/12/20	
346	10年国債	0.1000	250,000	252,662	2027/03/20	
93	20年国債	2.0000	18,000	20,013	2027/03/20	
94	20年国債	2.1000	45,000	50,273	2027/03/20	
347	10年国債	0.1000	400,000	404,352	2027/06/20	
95	20年国債	2.3000	30,000	34,009	2027/06/20	
96	20年国債	2.1000	63,000	70,716	2027/06/20	
348	10年国債	0.1000	360,000	364,093	2027/09/20	
97	20年国債	2.2000	25,000	28,339	2027/09/20	
98	20年国債	2.1000	34,000	38,343	2027/09/20	
349	10年国債	0.1000	250,000	252,965	2027/12/20	
99	20年国債	2.1000	53,000	60,062	2027/12/20	
350	10年国債	0.1000	350,000	354,210	2028/03/20	
100	20年国債	2.2000	35,000	40,064	2028/03/20	
101	20年国債	2.4000	18,000	20,832	2028/03/20	
351	10年国債	0.1000	350,000	354,263	2028/06/20	
102	20年国債	2.4000	10,000	11,633	2028/06/20	
103	20年国債	2.3000	21,000	24,291	2028/06/20	
104	20年国債	2.1000	64,000	73,187	2028/06/20	
352	10年国債	0.1000	390,000	394,933	2028/09/20	
105	20年国債	2.1000	38,000	43,666	2028/09/20	
106	20年国債	2.2000	16,000	18,495	2028/09/20	
353	10年国債	0.1000	320,000	324,198	2028/12/20	
107	20年国債	2.1000	40,000	46,184	2028/12/20	
108	20年国債	1.9000	68,000	77,548	2028/12/20	
354	10年国債	0.1000	330,000	334,359	2029/03/20	
109	20年国債	1.9000	60,000	68,696	2029/03/20	
110	20年国債	2.1000	27,000	31,309	2029/03/20	
355	10年国債	0.1000	250,000	253,320	2029/06/20	
111	20年国債	2.2000	35,000	41,030	2029/06/20	
112	20年国債	2.1000	40,000	46,588	2029/06/20	
356	10年国債	0.1000	270,000	273,493	2029/09/20	
113	20年国債	2.1000	70,000	81,885	2029/09/20	
357	10年国債	0.1000	250,000	253,132	2029/12/20	
114	20年国債	2.1000	45,000	52,843	2029/12/20	
115	20年国債	2.2000	42,000	49,659	2029/12/20	
2	30年国債	2.4000	9,000	10,820	2030/02/20	
358	10年国債	0.1000	310,000	313,741	2030/03/20	
116	20年国債	2.2000	27,000	32,049	2030/03/20	
117	20年国債	2.1000	77,000	90,757	2030/03/20	
3	30年国債	2.3000	4,000	4,793	2030/05/20	
359	10年国債	0.1000	340,000	343,787	2030/06/20	

当		期		末		償還年月日
区 分	銘柄	年利	額面金額	評価額	評価額	
		%	千円	千円		
118	20年国債	2.0000	13,000	15,262	2030/06/20	
119	20年国債	1.8000	23,000	26,608	2030/06/20	
120	20年国債	1.6000	98,000	111,693	2030/06/20	
360	10年国債	0.1000	350,000	353,545	2030/09/20	
4	30年国債	2.9000	8,000	10,080	2030/11/20	
361	10年国債	0.1000	330,000	332,834	2030/12/20	
123	20年国債	2.1000	42,000	49,961	2030/12/20	
124	20年国債	2.0000	100,000	118,050	2030/12/20	
362	10年国債	0.1000	315,000	317,337	2031/03/20	
125	20年国債	2.2000	25,000	30,058	2031/03/20	
126	20年国債	2.0000	21,000	24,859	2031/03/20	
127	20年国債	1.9000	110,000	129,192	2031/03/20	
5	30年国債	2.2000	8,000	9,638	2031/05/20	
363	10年国債	0.1000	330,000	331,881	2031/06/20	
128	20年国債	1.9000	32,000	37,680	2031/06/20	
129	20年国債	1.8000	95,000	110,960	2031/06/20	
364	10年国債	0.1000	115,000	115,503	2031/09/20	
130	20年国債	1.8000	28,000	32,779	2031/09/20	
131	20年国債	1.7000	150,000	174,142	2031/09/20	
6	30年国債	2.4000	9,000	11,092	2031/11/20	
132	20年国債	1.7000	25,000	29,082	2031/12/20	
133	20年国債	1.8000	150,000	175,990	2031/12/20	
134	20年国債	1.8000	15,000	17,644	2032/03/20	
135	20年国債	1.7000	20,000	23,321	2032/03/20	
136	20年国債	1.6000	150,000	173,377	2032/03/20	
7	30年国債	2.3000	12,000	14,764	2032/05/20	
137	20年国債	1.7000	18,000	21,039	2032/06/20	
139	20年国債	1.6000	160,000	185,347	2032/06/20	
140	20年国債	1.7000	65,000	76,155	2032/09/20	
141	20年国債	1.7000	48,000	56,364	2032/12/20	
142	20年国債	1.8000	165,000	195,554	2032/12/20	
10	30年国債	1.1000	25,000	27,731	2033/03/20	
143	20年国債	1.6000	100,000	116,563	2033/03/20	
144	20年国債	1.5000	70,000	80,812	2033/03/20	
11	30年国債	1.7000	9,000	10,613	2033/06/20	
145	20年国債	1.7000	190,000	224,072	2033/06/20	
12	30年国債	2.1000	11,000	13,519	2033/09/20	
146	20年国債	1.7000	165,000	194,998	2033/09/20	
13	30年国債	2.0000	11,000	13,424	2033/12/20	
147	20年国債	1.6000	195,000	228,606	2033/12/20	
14	30年国債	2.4000	22,000	27,977	2034/03/20	
148	20年国債	1.5000	155,000	180,159	2034/03/20	
15	30年国債	2.5000	21,000	27,045	2034/06/20	
149	20年国債	1.5000	195,000	227,009	2034/06/20	
16	30年国債	2.5000	26,000	33,611	2034/09/20	
150	20年国債	1.4000	185,000	213,377	2034/09/20	
17	30年国債	2.4000	17,000	21,826	2034/12/20	
151	20年国債	1.2000	190,000	214,576	2034/12/20	
18	30年国債	2.3000	20,000	25,506	2035/03/20	
152	20年国債	1.2000	160,000	180,960	2035/03/20	
19	30年国債	2.3000	15,000	19,181	2035/06/20	
153	20年国債	1.3000	180,000	206,121	2035/06/20	
20	30年国債	2.5000	16,000	20,956	2035/09/20	
154	20年国債	1.2000	205,000	232,221	2035/09/20	
21	30年国債	2.3000	16,000	20,578	2035/12/20	
155	20年国債	1.0000	165,000	182,541	2035/12/20	
22	30年国債	2.5000	17,000	22,388	2036/03/20	
156	20年国債	0.4000	150,000	153,316	2036/03/20	
23	30年国債	2.5000	16,000	21,128	2036/06/20	
157	20年国債	0.2000	196,000	194,486	2036/06/20	
24	30年国債	2.5000	15,000	19,874	2036/09/20	
158	20年国債	0.5000	205,000	212,162	2036/09/20	
25	30年国債	2.3000	17,000	22,087	2036/12/20	
159	20年国債	0.6000	145,000	152,031	2036/12/20	
26	30年国債	2.4000	32,000	42,168	2037/03/20	
160	20年国債	0.7000	165,000	175,423	2037/03/20	
161	20年国債	0.6000	135,000	141,331	2037/06/20	
27	30年国債	2.5000	32,000	42,847	2037/09/20	

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

当		期		末			
区	分	銘	柄	年利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
				%	千円	千円	
	162	20年国債		0.6000	175,000	183,058	2037/09/20
	163	20年国債		0.6000	120,000	125,416	2037/12/20
	28	30年国債		2.5000	34,000	45,765	2038/03/20
	164	20年国債		0.5000	185,000	190,305	2038/03/20
	165	20年国債		0.5000	155,000	159,259	2038/06/20
	29	30年国債		2.4000	43,000	57,490	2038/09/20
	166	20年国債		0.7000	170,000	180,013	2038/09/20
	167	20年国債		0.5000	125,000	128,120	2038/12/20
	30	30年国債		2.3000	56,000	74,235	2039/03/20
	168	20年国債		0.4000	155,000	156,009	2039/03/20
	169	20年国債		0.3000	115,000	113,578	2039/06/20
	31	30年国債		2.2000	76,000	99,896	2039/09/20
	170	20年国債		0.3000	125,000	123,228	2039/09/20
	171	20年国債		0.3000	130,000	127,918	2039/12/20
	32	30年国債		2.3000	45,000	60,142	2040/03/20
	172	20年国債		0.4000	165,000	165,000	2040/03/20
	173	20年国債		0.4000	150,000	149,740	2040/06/20
	33	30年国債		2.0000	95,000	122,221	2040/09/20
	174	20年国債		0.4000	195,000	194,319	2040/09/20
	175	20年国債		0.5000	135,000	136,783	2040/12/20
	34	30年国債		2.2000	110,000	145,864	2041/03/20
	176	20年国債		0.5000	150,000	151,735	2041/03/20
	177	20年国債		0.4000	128,000	126,963	2041/06/20
	35	30年国債		2.0000	120,000	155,229	2041/09/20
	178	20年国債		0.5000	60,000	60,545	2041/09/20
	36	30年国債		2.0000	118,000	153,158	2042/03/20
	37	30年国債		1.9000	135,000	173,057	2042/09/20
	38	30年国債		1.8000	85,000	107,615	2043/03/20
	39	30年国債		1.9000	88,000	113,401	2043/06/20
	40	30年国債		1.8000	70,000	88,850	2043/09/20
	41	30年国債		1.7000	65,000	81,299	2043/12/20
	42	30年国債		1.7000	73,000	91,398	2044/03/20
	43	30年国債		1.7000	70,000	87,733	2044/06/20
	44	30年国債		1.7000	75,000	94,095	2044/09/20
	45	30年国債		1.5000	80,000	97,036	2044/12/20
	46	30年国債		1.5000	90,000	109,236	2045/03/20
	47	30年国債		1.6000	105,000	129,881	2045/06/20
	48	30年国債		1.4000	110,000	131,197	2045/09/20
	49	30年国債		1.4000	75,000	89,492	2045/12/20
	50	30年国債		0.8000	85,000	89,843	2046/03/20
	51	30年国債		0.3000	95,000	89,475	2046/06/20
	52	30年国債		0.5000	102,000	100,556	2046/09/20
	53	30年国債		0.6000	95,000	95,729	2046/12/20
	54	30年国債		0.8000	84,000	88,467	2047/03/20
	55	30年国債		0.8000	96,000	101,036	2047/06/20
	56	30年国債		0.8000	88,000	92,448	2047/09/20
	57	30年国債		0.8000	90,000	94,481	2047/12/20
	1	40年国債		2.4000	30,000	43,147	2048/03/20
	58	30年国債		0.8000	140,000	146,860	2048/03/20
	59	30年国債		0.7000	97,000	99,221	2048/06/20
	60	30年国債		0.9000	80,000	85,540	2048/09/20
	61	30年国債		0.7000	70,000	71,297	2048/12/20
	2	40年国債		2.2000	48,000	66,797	2049/03/20
	62	30年国債		0.5000	82,000	79,239	2049/03/20
	63	30年国債		0.4000	85,000	79,847	2049/06/20
	64	30年国債		0.4000	90,000	84,304	2049/09/20
	65	30年国債		0.4000	76,000	71,069	2049/12/20
	3	40年国債		2.2000	19,000	26,579	2050/03/20
	66	30年国債		0.4000	115,000	107,484	2050/03/20
	67	30年国債		0.6000	90,000	88,596	2050/06/20
	68	30年国債		0.6000	96,000	94,490	2050/09/20
	69	30年国債		0.7000	106,000	107,163	2050/12/20
	4	40年国債		2.2000	54,000	76,097	2051/03/20
	70	30年国債		0.7000	166,000	167,630	2051/03/20
	71	30年国債		0.7000	66,000	66,652	2051/06/20
	72	30年国債		0.7000	43,000	43,374	2051/09/20
	5	40年国債		2.0000	35,000	47,745	2052/03/20
	6	40年国債		1.9000	40,000	53,772	2053/03/20

		当 期		未		
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千 円	千 円		
	7 40年国債	1.7000	41,000	53,129	2054/03/20	
	8 40年国債	1.4000	33,000	40,048	2055/03/20	
	9 40年国債	0.4000	40,000	36,529	2056/03/20	
	10 40年国債	0.9000	91,000	96,974	2057/03/20	
	11 40年国債	0.8000	85,000	87,841	2058/03/20	
	12 40年国債	0.5000	99,000	92,460	2059/03/20	
	13 40年国債	0.5000	252,000	234,649	2060/03/20	
	14 40年国債	0.7000	225,000	223,620	2061/03/20	
種別	銘柄数	256銘柄				
小計	金 額		30,736,000	32,422,792		
地方債証券	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	100,888	2023/01/31	
	25-6 大阪市公債	0.6940	100,000	101,361	2023/11/22	
	3 兵庫県公債12年	0.5600	100,000	101,843	2025/04/16	
	40-1 大阪府公債	0.4770	100,000	101,830	2025/10/29	
	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	
	75-1 東京都公債	0.3700	100,000	101,482	2025/12/19	
	27-15 北海道公債	0.2200	100,000	100,901	2026/02/26	
	28-1 静岡県公債	0.0800	100,000	100,347	2026/03/19	
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	100,259	2026/06/19	
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	101,119	2027/03/25	
	29-6 千葉県公債	0.2450	100,000	101,351	2028/01/25	
	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	
	11 兵庫県公債20年	1.8400	100,000	115,133	2030/08/16	
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	100,139	2031/06/30	
種別	銘柄数	16銘柄				
小計	金 額		1,600,000	1,669,140		
特殊債券 除く金融債券	190 政保道路機構	0.6050	100,000	100,960	2023/05/31	
	645 地方公共団体	0.5350	100,000	101,524	2024/10/28	
	241 政保道路機構	0.4500	100,000	101,599	2025/03/31	
	261 政保道路機構	0.3810	100,000	101,642	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	
	81 政保道路機構	2.1000	100,000	115,643	2029/05/31	
	47 日本政策投資CO	1.0270	100,000	107,254	2029/09/20	
種別	銘柄数	8銘柄				
小計	金 額		800,000	836,281		
普通社債券	32 東日本旅客鉄道	2.2600	100,000	105,124	2024/03/19	
	25 西日本高速道	0.5240	100,000	101,504	2024/12/20	
	497 関西電力	1.0020	100,000	103,128	2025/06/20	
	14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	100,443	2025/12/19	
	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	
	80 三菱地所	2.3050	100,000	111,514	2027/03/19	
	9 ソフトバンク	0.4800	100,000	100,741	2027/12/03	
	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	
	5 NTTファイナンス	0.4890	100,000	101,583	2032/09/17	
種別	銘柄数	12銘柄				
小計	金 額		1,200,000	1,226,423		
合計	銘柄数	292銘柄				
小計	金 額		34,336,000	36,154,637		

（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	%
公社債	36,154,637	98.2
コール・ローン等、その他	668,811	1.8
投資信託財産総額	36,823,449	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	36,823,449,026円
コール・ローン等	501,425,122
公社債(評価額)	36,154,637,480
未収入金	100,780,000
未収利息	63,459,509
前払費用	3,146,915
(B) 負債	255,573,050
未払金	255,573,050
(C) 純資産総額(A－B)	36,567,875,976
元本	28,295,749,520
次期繰越損益金	8,272,126,456
(D) 受益権総口数	28,295,749,520口
1万口当り基準価額(C／D)	12,923円

* 期首における元本額は18,557,007,274円、当作成期間中における追加設定元本額は10,127,411,494円、同解約元本額は388,669,248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：

日本債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	770,013,279円
iFree 日本債券インデックス	3,390,931,023円
iFree 8資産バランス	3,530,311,974円
ダイワ・ライフ・バランス30	8,635,471,870円
ダイワ・ライフ・バランス50	5,874,053,364円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,922,377,924円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／安定コース)	1,413,238,761円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／6分散コース)	1,072,161,188円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／成長コース)	392,417,838円
ダイワつみたてインデックス日本債券	753,843,841円
ダイワつみたてインデックスバランス30	30,126,272円
ダイワつみたてインデックスバランス50	14,185,342円
ダイワつみたてインデックスバランス70	9,313,400円
ダイワ世界バランスファンド40VA	287,546,791円
ダイワ世界バランスファンド60VA	199,756,653円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,923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	203,032,215円
受取利息	203,089,007
支払利息	△ 56,792
(B) 有価証券売買損益	△ 159,820,700
売買益	28,848,030
売買損	△ 188,668,730
(C) その他費用	△ 126
(D) 当期損益金(A + B + C)	43,211,389
(E) 前期繰越損益金	5,405,410,806
(F) 解約差損益金	△ 113,476,438
(G) 追加信託差損益金	2,936,980,699
(H) 合計(D + E + F + G)	8,272,126,456
次期繰越損益金(H)	8,272,126,456

(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・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

運用報告書 第33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・グローバル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。

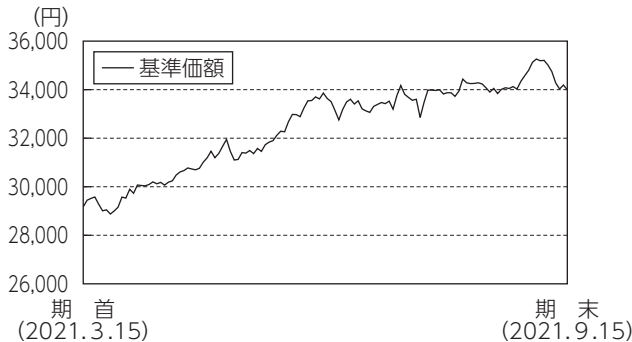
運 用 方 針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投 資 信 託 証 券 組 入 制 限	無制限

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 R E I T 指数 (除く日本、円換算)		投資信託証券 組入比率
	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首)2021年3月15日	円	%	25,641	%	%
3月末	29,895	2.5	26,149	2.0	95.3
4月末	31,462	7.9	27,387	6.8	95.2
5月末	32,288	10.7	28,016	9.3	96.0
6月末	33,125	13.6	28,904	12.7	95.0
7月末	33,823	15.9	29,657	15.7	94.1
8月末	34,574	18.5	30,275	18.1	96.7
(期末)2021年9月15日	33,990	16.5	29,786	16.2	96.9

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本、円換算) は、S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本、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。S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本、米ドルベース) の所有権およびその他の権利は、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。

《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：29,171円 期末：33,990円 騰落率：16.5%

【基準価額の主な変動要因】

海外リート市況が総じて上昇したことなどが主なプラス要因となり、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

○海外リート市況

海外リート市況は、総じて上昇となりました。

海外リート市況は、米国では、長期金利の低下や新型コロナウイルスのワクチン普及、米国リートの好調な業績発表などを好感し、上昇しました。欧州では、感染再拡大が懸念されたものの、ワクチン接種の進展や隔離措置の緩和などから、英国やドイツを中心に上昇しました。アジア・オセアニアでは、長期金利の安定や業績期待

の高まりを背景に、オーストラリアやシンガポールが上昇しました。

○為替相場

為替相場において、主要通貨は対円でまちまちの展開となりました。

当作成期首から2021年6月にかけては、利上げ観測の高まりから米ドルは上昇 (円安) 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が増加し、景気減速懸念から米国金利が低下したことなどを受けて、米ドルは弱含みしました。当作成期首と比較して、米ドルは対円で上昇し、ユーロ、オーストラリア・ドルは対円で下落 (円高) しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。外貨建資産の運用にあたっては、C & S に運用の指図にかかる権限を委託します。海外リートへの投資にあたっては、個別銘柄の投資価値を分析して、配当利回り、期待される成長性、割安度などを勘案し投資銘柄を選定し、分散投資を行います。

※C & S：コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

◆ポートフォリオについて

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、C & S に運用の指図にかかる権限を委託しております。

当ファンドでは、信託財産の中長期的な成長をめざし保有不動産の価値などと比べて魅力的であると考える銘柄に着目するとともに、安定的な配当利回りの確保をめざしてポートフォリオを構築しました。

国・地域別配分では、大きなリスクを取らず各地域にバランス良く投資を行いました。米国では、需給改善が期待されたヘルスケアリートなどに注目しました。欧州では、安定したキャッシュフロー成長が見込まれるセクターである貸倉庫を保有するリートやヘルスケアリートに、アジア・オセアニアでは、オーストラリアの各種不動産リートなどに注目しました。

◆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。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。

《今後の運用方針》

安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。外貨建資産の運用にあたっては、C & S に運用の指図にかかる権限を委託します。海外リートへの投資にあたっては、個別銘柄の投資価値を分析して、配当利回り、期待される成長性、割安度などを勘案し投資銘柄を選定し、分散投資を行います。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (投資信託証券)	11円 (11)
有価証券取引税 (投資信託証券)	9 (9)
その他費用 (保管費用) (その他)	4 (4) (1)
合 計	24

(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
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	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	アメリカ	千口 1,896.578 ()	千アメリカ・ドル 105,120 ()	千口 1,660.125 ()	千アメリカ・ドル 113,062 ()
	カナダ	千口 845.748 ()	千カナダ・ドル 18,884 ()	千口 384.355 ()	千カナダ・ドル 17,499 ()
国	オーストラリア	千口 5,651.562 ()	千オーストラリア・ドル 24,318 (△ 237)	千口 7,251.183 ()	千オーストラリア・ドル 31,033 ()

■ 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	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
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR (カナダ)		845.748	1,670,171	1,974	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT (カナダ)		384.355	1,550,415	4,033
WELLTOWER INC (アメリカ)		146.866	1,348,493	9,181	EQUINIX INC (アメリカ)		13.428	1,206,294	89,834
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		56.427	1,337,763	23,707	KEPPEL DC REIT (シンガポール)		5,282.5	1,100,328	208
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD (フランス)		123.631	1,200,224	9,708	INVITATION HOMES INC (アメリカ)		285.219	1,069,061	3,748
EQUINIX INC (アメリカ)		13.115	1,035,441	78,950	MIRVAC GROUP (オーストラリア)		4,285.036	974,416	227
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		59.457	1,033,136	17,376	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		56.042	958,336	17,100
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI (シンガポール)		8,118	994,322	122	EXTRA SPACE STORAGE INC (アメリカ)		49.117	894,282	18,207
DEXUS (オーストラリア)		978.169	834,210	852	KLEPIERRE (フランス)		299.889	890,857	2,970
KLEPIERRE (フランス)		297.573	817,997	2,748	WELLTOWER INC (アメリカ)		104.49	847,126	8,107
EUROCOMMERCIAL PROPRIETIE-CV (オランダ)		280.595	797,926	2,843	SUN COMMUNITIES INC (アメリカ)		40.229	825,370	20,516

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	香港	千口 232.9 ()	千香港ドル 17,505 ()	千口 240.3 ()	千香港ドル 18,031 ()
	シンガポール	千口 16,682.9 ()	千シンガポール・ドル 28,883 (△ 43)	千口 10,847.5 ()	千シンガポール・ドル 22,405 ()
	ニュージーランド	千口 449.322 ()	千ニュージーランド・ドル 1,102 ()	千口 155.238 ()	千ニュージーランド・ドル 352 ()
	イギリス	千口 7,189.365 (7.693)	千イギリス・ポンド 21,150 (63)	千口 3,614.823 ()	千イギリス・ポンド 20,688 ()
国	ユーロ (オランダ)	千口 305.206 (7.62)	千ユーロ 6,935 ()	千口 7.553 ()	千ユーロ 236 ()
	ユーロ (ベルギー)	千口 295.743 (4.366)	千ユーロ 14,783 (227)	千口 82.132 ()	千ユーロ 5,142 ()
	ユーロ (フランス)	千口 426.929 (3.223)	千ユーロ 15,857 (144)	千口 393.582 ()	千ユーロ 15,377 ()
	ユーロ (ドイツ)	千口 — ()	千ユーロ — (△ 145)	千口 287.301 ()	千ユーロ 4,208 ()
	ユーロ (スペイン)	千口 248.91 ()	千ユーロ 2,342 (△ 97)	千口 264.432 ()	千ユーロ 2,438 ()
	ユーロ (ユーロ 通貨計)	千口 1,276.788 (15.218)	千ユーロ 39,918 (129)	千口 1,035 ()	千ユーロ 27,404 ()

(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。

■組入資産明細表
外国投資信託証券

銘柄	期 首		当 期		期 末	
	口 数	口 数	口 数	口 数	口 数	口 数
	口 数	口 数	口 数	口 数	口 数	口 数
(アメリカ)	千口	千口	千口	千口	千口	千口
AVALONBAY COMMUNITIES INC	—	37,698	8,455	927,121	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	161.276	193.376	25.053	2,747,148	—	—
EQUINIX INC	23.504	23.191	19,361	2,123,036	—	—
HOST HOTELS & RESORTS INC	808.072	1,094.434	18,200	1,995,677	—	—
CYRUSONE INC	198.334	198.334	15,184	1,664,975	—	—
KIMCO REALTY CORP	124.934	444.274	9,654	1,058,569	—	—
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	234.015	275.382	8,448	926,402	—	—
PARK HOTELS & RESORTS INC	85.053	—	—	—	—	—
INVITATION HOMES INC	362.56	235.172	9,543	1,046,420	—	—
AMERICOLD REALTY TRUST	197.746	217.467	7,678	841,976	—	—
VICI PROPERTIES INC	547.735	557.328	16,675	1,828,441	—	—
APARTMENT INCOME REIT CO	130.885	184.174	9,286	1,018,215	—	—
VENTAS INC	323.698	236.197	13,555	1,486,343	—	—
WEYERHAEUSER CO	129.012	129.012	4,398	482,242	—	—
VEREIT INC	377.427	424.905	20,348	2,231,235	—	—
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	142.579	131.771	6,542	717,377	—	—
SUN COMMUNITIES INC	98.014	61.05	12,194	1,337,086	—	—
PROLOGIS INC	158.871	135.689	17,985	1,972,118	—	—
COUSINS PROPERTIES INC	—	159.414	5,949	652,344	—	—
SITE CENTERS CORP	137.129	137.129	2,150	235,767	—	—
DUKE REALTY CORP	523.253	504.87	25,531	2,799,504	—	—
ESSEX PROPERTY TRUST INC	52.483	50.517	16,390	1,797,245	—	—
WELLTOWER INC	230.916	273.292	23,923	2,623,264	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	543.107	559.38	19,785	2,169,454	—	—
KILROY REALTY CORP	80.413	—	—	—	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	38.486	—	—	—	—	—
REALTY INCOME CORP	—	22.628	1,543	169,239	—	—
PUBLIC STORAGE	105.243	92.735	29,435	3,227,651	—	—
REGENCY CENTERS CORP	37.451	86.647	5,849	641,401	—	—
UDR INC	383.75	385.502	20,608	2,259,769	—	—
AGREE REALTY CORP	51.679	55.255	3,929	430,834	—	—
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	94.435	—	—	—	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	82.008	85.423	13,173	1,444,428	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	110.391	63.98	11,744	1,287,748	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	245.314	—	—	—	—	—
アメリカ・ドル 通 貨 計	6,819,773 32銘柄	7,056,226 30銘柄	402,581 —	44,143,043 <48.1%>	—	—
(カナダ)	千口	千口	千口	千口	千口	千口
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	—	845.748	—	1,647,024	—	—
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	384.355	—	19,071	—	—	—
カナダ・ドル 通 貨 計	384.355 1銘柄	845.748 1銘柄	19,071 —	1,647,024 < 1.8%>	—	—
(オーストラリア)	千口	千口	千口	千口	千口	千口
DEXUS/AU	—	1,149.34	12,378	992,747	—	—
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	—	3,369.909	7,615	610,802	—	—
NATIONAL STORAGE REIT	6,328.86	5,158.763	12,174	976,409	—	—
MIRVAC GROUP	14,015.541	10,182.341	30,954	2,482,536	—	—
GOODMAN GROUP	2,177.062	2,080.452	46,830	3,755,844	—	—
CHARTER HALL GROUP	2,544.576	2,076.183	36,582	2,933,904	—	—
INGENIA COMMUNITIES GROUP	2,316.471	1,765.901	11,266	903,569	—	—
オーストラリア・ドル 通 貨 計	27,382.51 5銘柄	25,782.889 7銘柄	157,803 —	12,655,812 <13.8%>	—	—
(香港)	千口	千口	千口	千口	千口	千口
LINK REIT	2,846.392	2,838.992	196,174	2,766,058	—	—
香港・ドル 通 貨 計	2,846.392 1銘柄	2,838.992 1銘柄	196,174 —	2,766,058 < 3.0%>	—	—
(シンガポール)	千口	千口	千口	千口	千口	千口
KEPPEL DC REIT	5,595.841	1,275.541	3,239	264,308	—	—
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	3,826.9	7,981.4	11,892	970,172	—	—
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	10,213.932	12,322.932	24,892	2,030,715	—	—
KEPPEL REIT	9,893.8	13,322.6	14,255	1,162,937	—	—
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	4,528.477	4,991.877	23,711	1,334,377	—	—
シンガポール・ドル 通 貨 計	34,058.95 5銘柄	39,894.35 5銘柄	77,991 —	6,362,512 < 6.9%>	—	—

銘柄	期 首		当 期		期 末	
	口 数	口 数	口 数	口 数	口 数	口 数
	口 数	口 数	口 数	口 数	口 数	口 数
(ニュージーランド)	千口	千口	千口	千口	千口	千口
GOODMAN PROPERTY TRUST	3,978.868	4,272.952	11,109	863,443	—	—
ニュージーランド・ドル 通 貨 計	3,978.868 1銘柄	4,272.952 1銘柄	11,109 —	863,443 < 0.9%>	—	—
(イギリス)	千口	千口	千口	千口	千口	千口
ASSURA PLC	8,042.487	8,252.211	6,255	946,971	—	—
NEWWRIVER REIT PLC	—	1,733.771	1,288	195,019	—	—
SEGRO PLC	1,328.353	1,000.647	12,778	1,934,501	—	—
UNITE GROUP PLC/THE	160.534	—	—	—	—	—
BRITISH LAND CO PLC	2,321.315	2,318.198	11,998	1,816,527	—	—
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	—	376.154	2,890	437,629	—	—
DERWENT LONDON PLC	115.04	56.093	2,068	313,097	—	—
WORKSPACE GROUP PLC	280.213	412.194	3,662	554,442	—	—
SAFESTORE HOLDINGS PLC	628.741	548.558	6,176	935,100	—	—
BIG YELLOW GROUP PLC	276.065	138.012	2,017	305,464	—	—
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,670.591	2,400.754	6,049	915,894	—	—
TRITAX BIG BOX REIT PLC	2,574.076	3,743.058	8,826	1,336,187	—	—
イギリス・ポンド 通 貨 計	17,397.415 10銘柄	20,979.65 11銘柄	64,012 —	9,690,835 <10.6%>	—	—
ユーロ (オランダ)	千口	千口	千口	千口	千口	千口
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	—	286.575	5,760	745,767	—	—
NSI NV	49.399	68.097	2,264	293,149	—	—
国 小 計	49.399 1銘柄	354.672 2銘柄	8,024 —	1,038,916 < 1.1%>	—	—
ユーロ (ベルギー)	千口	千口	千口	千口	千口	千口
AEDIFICA	93.751	87.718	10,289	1,332,158	—	—
COFINIMMO	32.046	53.555	7,171	928,431	—	—
BEFIMMO	—	99.277	3,469	449,226	—	—
WAREHOUSES DE PAUW SCA	173.879	282.418	10,720	1,387,994	—	—
XIOR STUDENT HOUSING NV	57.495	52.18	2,650	343,191	—	—
国 小 計	357.171 4銘柄	575.148 5銘柄	34,301 —	4,441,002 < 4.8%>	—	—
ユーロ (フランス)	千口	千口	千口	千口	千口	千口
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	93.593	6,255	809,932	—	—
ICADE	113.889	117.768	8,284	1,072,656	—	—
ARGAN	37.609	27.408	3,151	408,079	—	—
GEICINA SA	37.974	11.832	1,469	190,260	—	—
KLEPIERRE	706.805	704.489	13,554	1,754,884	—	—
COVIVIO	22.234	—	—	—	—	—
国 小 計	918.511 5銘柄	955.09 5銘柄	32,716 —	4,235,812 < 4.6%>	—	—
ユーロ (ドイツ)	千口	千口	千口	千口	千口	千口
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	524.189	236.888	3,797	491,638	—	—
国 小 計	524.189 1銘柄	236.888 1銘柄	3,797 —	491,638 < 0.5%>	—	—
ユーロ (スペイン)	千口	千口	千口	千口	千口	千口
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	495.679	480.157	4,488	581,127	—	—
国 小 計	495.679 1銘柄	480.157 1銘柄	4,488 —	581,127 < 0.6%>	—	—
ユーロ通貨計	2,344.949 12銘柄	2,601.955 14銘柄	83,328 —	10,788,497 <11.8%>	—	—
合 計	95,213.212 67銘柄	104,272.762 70銘柄	—	88,917,228 <96.9%>	—	—

(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。

■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	88,917,228	96.5
コール・ローン等、その他	3,220,391	3.5
投資信託財産総額	92,137,619	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、9月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝109.65円、1カナダ・ドル＝86.36円、1オーストラリア・ドル＝80.20円、1香港ドル＝14.10円、1シンガポール・ドル＝81.58円、1ニュージーランド・ドル＝77.72円、1イギリス・ポンド＝151.39円、1ユーロ＝129.47円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産（91,528,186千円）の投資信託財産総額（92,137,619千円）に対する比率は、99.3％です。

■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
(A) 資産	92,172,707,743円
コール・ローン等	2,771,145,853
投資信託証券(評価額)	88,917,228,181
未収入金	345,750,666
未収配当金	138,583,043
(B) 負債	413,780,221
未払金	194,180,221
未払解約金	219,600,000
(C) 純資産総額(A－B)	91,758,927,522
元本	26,996,164,609
次期繰越損益金	64,762,762,913
(D) 受益権総口数	26,996,164,609口
1万口当り基準価額(C／D)	33,990円

* 期首における元本額は27,318,269,740円、当作成期間中における追加設定元本額は1,496,886,210円、同解約元本額は1,818,991,341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・グローバル R E I T ・オープン（毎月分配型）22,905,398,116円、ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）24,486,401円、安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）9,977,561円、インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）8,856,399円、成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）45,513,945円、6資産バランスファンド（分配型）89,777,921円、6資産バランスファンド（成長型）233,525,356円、リゾなワールド・リート・ファンド1,098,056,267円、世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）26,060,531円、常陽3分法ファンド112,412,478円、ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）27,830,203円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）302,982,607円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）384,976,578円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）555,105,736円、グローバル R E I Tファンド2021－07（適格機関投資家専用）881,939,728円、ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（分配型）246,449,138円、ダイワ外国3資産バランス・ファンド（部分為替ヘッジあり）19,595,332円、ダイワ外国3資産バランス・ファンド（為替ヘッジなし）23,220,312円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は33,990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
(A) 配当等収益	1,159,945,113円
受取配当金	1,160,509,494
受取利息	6,553
支払利息	△ 570,934
(B) 有価証券売買損益	11,682,752,427
売買益	13,358,479,618
売買損	△ 1,675,727,191
(C) その他費用	△ 11,143,469
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	12,831,554,071
(E) 前期繰越損益金	52,370,563,565
(F) 解約差損益金	△ 4,007,443,513
(G) 追加信託差損益金	3,568,088,790
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	64,762,762,913
次期繰越損益金(H)	64,762,762,913

(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Ｊ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

運用報告書 第32期（決算日 2021年11月10日）

（作成対象期間 2021年5月11日～2021年11月10日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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。

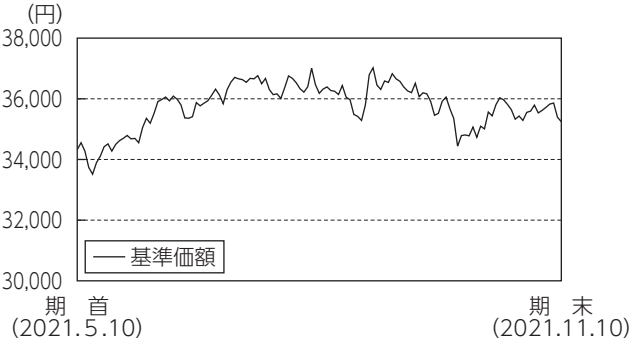
運 用 方 針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

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)2021年 5月10日	円 34,325	% -	4,503.65	% -	% 96.7	% 2.0
5月末	34,695	1.1	4,551.00	1.1	96.5	2.1
6月末	36,127	5.2	4,732.24	5.1	96.6	2.1
7月末	36,529	6.4	4,767.40	5.9	96.9	2.1
8月末	36,454	6.2	4,755.00	5.6	96.9	2.0
9月末	35,353	3.0	4,605.71	2.3	96.9	1.9
10月末	35,791	4.3	4,660.54	3.5	96.6	1.9
(期末)2021年11月10日	35,243	2.7	4,585.80	1.8	96.7	1.9

(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) 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：34,325円 期末：35,243円 騰落率：2.7%

【基準価額の主な変動要因】

経済活動の正常化期待を受けてＪリート市況が上昇したことにより、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

○ Ｊリート（不動産投信）市況

Ｊリート市況は上昇しました。

Ｊリート市況は、当作成期首より2021年7月までは、国内外での長期金利の低下が続いたことや、国内での新型コロナウイルスワクチン接種の進展を受けた経済活動の正常化期待もあり、上昇基調が続きました。8月に入ると、公募増資の増加による需給悪化で上値が重い展開となりました。また、夏枯れで売買代金が低下する中で大口の売買があり、ボラティリティがやや拡大しました。9月下旬以降は、国内外での長期金利の上昇や中国大手不動産会社の恒大集団の資金繰り懸念から下落しましたが、その後は割安感から買いが入ったことから反発し、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」

個別銘柄ごとの流動性を勘案しつつＪリートに幅広く分散投資を行い、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資します。

◆ ポートフォリオについて

リーートの組入比率につきましては、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ており、おおむね95～98%台程度で推移させました。また、東証REIT指数先物への投資も行い、先物と合計で95～100%程度で推移させました。リート銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資しました。個別銘柄では、当作成期を通じて見ると、ジャパンリアルエステイト、三菱地所物流リート、森ヒルズリートなどを東証REIT指数と比較してオーバーウエートとし、大和証券リビング、平和不動産リート、星野リゾート・リートなどをアンダーウエートとしました。

◆ 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。

当ファンドは、参考指数として東証REIT指数（配当込み）を用いています。当作成期における参考指数の騰落率は1.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は2.7%となりました。

投資口価格のパフォーマンスが参考指数を上回ったラサールロジポート、大和ハウスリート、三菱地所物流リート、イオンリートをオーバーウエートとしていたことなどがプラスに寄与しました。他方、投資口価格のパフォーマンスが参考指数を上回った星野リゾート・リート、伊藤忠アドバンスロジスティクス、日本ロジスティクスファンド、ＳＯＳｉＬＡ物流リートをアンダーウエートとしていたことなどが、マイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

個別銘柄ごとの流動性を勘案しつつＪリートに幅広く分散投資を行い、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資します。

■ 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) (投資信託証券)	31円 (0) (31)
有価証券取引税	—
その他費用	—
合 計	31

(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 5月11日から2021年11月10日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内	318.803	53,937,306	246.899 (—)	42,552,365 (—)

(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 5月11日から2021年11月10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	5,245	5,132	—	—

(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 5月11日から2021年11月10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
G L P 投資法人	16.928	3,258,972	192,519	大和ハウスリート投資法人	8.287	2,706,163	326,555
ユナイテッド・アーバン投資法人	17.139	2,655,040	154,912	アドバンス・レジデンス	7.21	2,620,019	363,386
日本ビルファンド	3.46	2,497,761	721,896	日本プロロジスリート	6.071	2,257,093	371,782
ケネディクス・オフィス投資法人	3.253	2,440,914	750,358	日本ビルファンド	3.054	2,211,448	724,115
野村不動産マスターＦ	13.628	2,359,825	173,160	野村不動産マスターＦ	12.851	2,207,123	171,747
大和ハウスリート投資法人	7.301	2,351,621	322,095	ジャパンリアルエステイト	2.773	1,902,403	686,045
コンフォリア・レジデンシャル	5.826	1,992,181	341,946	東急リアル・エステート	7.983	1,593,198	199,573
ジャパンリアルエステイト	2.895	1,956,384	675,780	産業ファンド	7.288	1,526,373	209,436
日本ロジスティクスファンド投資法人	5.693	1,874,864	329,327	阪急阪神リート投資法人	8.932	1,475,929	165,240
森ヒルズリート	10.558	1,659,960	157,223	スターアジア不動産投	23.942	1,464,421	61,165

(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	評 価 額
	千口	千口	千円
エスコンジャパンリート	4.459	4.288	602,464
サンケイリアルエステート	5.461	5.714	699,965
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投	3.035	－	－
東海道リート投資法	－	2.399	259,331
日本アコモデーションファンド投資法人	4.16	5.768	3,656,912
森ヒルズリート	20.488	27.892	4,339,995
産業ファンド	15.444	12.343	2,557,469
アドバンス・レジデンス	13.944	7.35	2,653,350
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	12.99	14.981	3,240,390
ＡＰＩ投資法人	4.801	5.557	2,528,435
ＧＬＰ投資法人	30.657	43.062	7,936,326
コンフォリア・レジデンシャル	2.751	7.703	2,499,623
日本プロロジスリート	18.842	15.647	5,812,860
Ｏｎｅリート投資法人	－	1.047	312,738
イオンリート投資	14.041	18.084	2,795,786
ヒューリックリート投資法	13.121	11.957	2,044,647
日本リート投資法人	5.334	4.194	1,797,129
積水ハウス・リート投資	25.002	33.656	2,870,856
トーセイ・リート投資法人	－	2.246	297,819
ケネディクス商業リート	5.764	3.708	1,062,712
ヘルスケア&メディカル投資	4.341	0.968	156,235
野村不動産マスターＦ	36.854	37.631	6,273,087
ラサールロジポート投資	14.976	20.297	3,870,637
スターアジア不動産投	15.465	－	－
三井不ロジパーク	3.575	4.65	2,734,200
大江戸温泉リート	0.435	－	－
森トラスト・ホテルリート投	1.62	－	－
三菱地所物流ＲＥＩＴ	5.786	7.682	3,687,360
ＣＲＥロジスティクスファンド	5.3	－	－
ザイマックス・リート	8.296	5.956	695,065
日本ビルファンド	11.867	12.273	8,738,376
ジャパンリアルエステイト	12.386	12.508	8,517,948
日本都市ファンド投資法人	43.65	56.139	5,698,108
オリックス不動産投資	19.856	19.155	3,482,379
日本ブライムリアルティ	3.778	5.567	2,310,305
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	－	3.647	555,073
東急リアル・エステート	9.769	5.646	1,067,094
グローバル・ワン不動産投資法人	5.554	9.398	1,114,602
ユナイテッド・アーバン投資法人	18.66	32.12	4,577,100
森トラスト総合リート	1.565	4.386	641,233
インヴィンシブル投資法人	39.427	52.678	2,288,859
フロンティア不動産投資	2.05	3.46	1,764,600
日本ロジスティクスファンド投資法人	1.674	5.487	1,816,197

銘 柄	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
福岡リート投資法人	2.721	7.305	1,235,275
ケネディクス・オフィス投資法人	2.609	4.475	3,172,775
いちごオフィスリート投資法人	－	13.541	1,167,234
大和証券オフィス投資法人	2.08	2.21	1,617,720
阪急阪神リート投資法人	7.84	－	－
スターツプロシード投資法人	0.667	－	－
大和ハウスリート投資法人	17.953	16.967	5,514,275
ジャパン・ホテル・リート投資法人	19.614	22.126	1,478,016
ジャパンエクセレント投資法人	11.45	10.148	1,417,675
合 計	□ 数、金 額 銘 柄 数<比率>	532.112 47銘柄	604.016 45銘柄 123,560,248 <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	東証ＲＥＩＴ	百万円 2,465	百万円 －

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託証券	123,560,248	96.1
コール・ローン等、その他	4,977,082	3.9
投資信託財産総額	128,537,331	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10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	129,684,931,199円
コール・ローン等	3,044,577,729
投資信託証券(評価額)	123,560,248,200
未収入金	661,791,677
未収配当金	1,170,393,593
差入委託証拠金	1,247,920,000
(B) 負債	1,873,406,744
未払金	681,396,744
未払解約金	44,410,000
差入委託証拠金代用有価証券	1,147,600,000
(C) 純資産総額(A－B)	127,811,524,455
元本	36,265,606,080
次期繰越損益金	91,545,918,375
(D) 受益権総口数	36,265,606,080口
1万口当り基準価額(C／D)	35,243円

* 期首における元本額は33,552,990,780円、当作成期間中における追加設定元本額は3,058,220,855円、同解約元本額は345,605,555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ファンド(ＦＯＦｓ用) (適格機関投資家専用) 33,509,665,629円
安定重視ポートフォリオ (奇数月分配型) 9,630,556円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型) 8,607,298円
成長重視ポートフォリオ (奇数月分配型) 44,228,410円
6資産バランスファンド (分配型) 84,568,014円
6資産バランスファンド (成長型) 224,395,505円
世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型) 24,265,422円
ダイワ資産分散インカムオープン (奇数月決算型) 26,757,433円
ＤＣダイワ・ワールドアセット (六つの羽／安定コース) 302,386,189円
ＤＣダイワ・ワールドアセット (六つの羽／6分散コース) 382,318,755円
ＤＣダイワ・ワールドアセット (六つの羽／成長コース) 560,082,597円
ＤＣダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブファンド 307,184,059円
ライフハーモニー (ダイワ世界資産分散ファンド) (成長型) 64,045,729円
ライフハーモニー (ダイワ世界資産分散ファンド) (安定型) 19,549,156円
ライフハーモニー (ダイワ世界資産分散ファンド) (分配型) 98,365,944円
ダイワ・アクティブＪリート・ファンド (年4回決算型) 599,555,384円
です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は35,243円です。

■損益の状況

当期 自2021年5月11日 至2021年11月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,023,438,057円
受取配当金	2,023,926,041
受取利息	24
その他収益金	5
支払利息	△ 488,013
(B) 有価証券売買損益	801,456,837
売買益	3,915,682,904
売買損	△ 3,114,226,067
(C) 先物取引等損益	45,721,640
取引益	157,573,640
取引損	△ 111,852,000
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	2,870,616,534
(E) 前期繰越損益金	81,615,995,280
(F) 解約差損益金	△ 896,030,584
(G) 追加信託差損益金	7,955,337,145
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	91,545,918,375
次期繰越損益金(H)	91,545,918,375

(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。

ダイワ北米好配当株マザーファンド

運用報告書 第32期（決算日 2021年10月15日）

（作成対象期間 2021年4月16日～2021年10月15日）

ダイワ北米好配当株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。

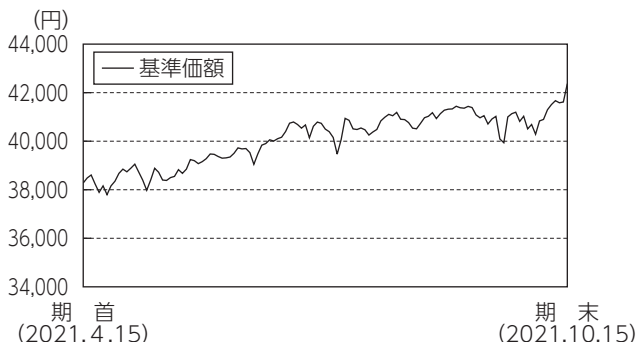
運 用 方 針	北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券
株 式 組 入 制 限	無制限

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



年 月 日	基 準 価 額		MSCIノースアメリカ指数 (配当込み、円換算)		株式組入 比	ハイブリッド 優先証券組入 比率	投資信託 証券組入比率
	円	騰落率	(参考指数)	騰落率	%	%	%
(期首)2021年4月15日	38,280	—	44,930	—	82.2	14.5	0.6
4月末	38,849	1.5	45,886	2.1	82.8	14.4	0.6
5月末	39,198	2.4	46,239	2.9	80.4	13.9	0.6
6月末	40,164	4.9	47,778	6.3	77.6	16.3	0.5
7月末	40,544	5.9	48,671	8.3	77.4	16.6	0.5
8月末	41,278	7.8	50,046	11.4	76.4	18.6	0.4
9月末	41,028	7.2	49,015	9.1	74.6	18.2	0.4
(期末)2021年10月15日	42,371	10.7	51,030	13.6	76.6	16.3	0.4

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) MSCIノースアメリカ指数 (配当込み、円換算) は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIノースアメリカ指数 (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。MSCIノースアメリカ指数 (配当込み、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。

《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：38,280円 期末：42,371円 騰落率：10.7%

【基準価額の主な変動要因】

当作成期は、北米株式市況や米国ハイブリッド優先証券市況が上昇したこと、また米ドルが対円で上昇 (円安) したことが主なプラス要因となり、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

○北米株式市況

北米株式市況は上昇しました。

北米株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種が進み新規感染者数が減少したことなどから上昇し、2021年9月初めにかけて史上最高値を更新しました。その後は、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、9月末にかけて株価は下落しました。

○米国ハイブリッド優先証券市況

米国ハイブリッド優先証券市況は、金利低下やクレジット環境の改善を受けて上昇しました。

米国ハイブリッド優先証券市況は、当作成期首より、各国での金融政策引き締め懸念が和らいだことを背景に金利が低下したことがプラス要因となり、上昇しました。また、一時の株式市場の過熱感には和らいだものの、依然として高い次期四半期の世界経済成長への期待がクレジットスプレッド (債券の債務不履行 (デフォルト) リスクに応じて上乗せされる金利) や投資家のセンチメントを支え、プラス要因となりました。

○為替相場

米ドル円為替相場は対円で上昇しました。

当作成期首より、米国で金融緩和の継続観測が高まったことなどから、米ドルは下落 (円高) しました。その後は、世界的に新型コロナウイルスのワクチン接種が進む中で、世界経済への楽観的な見方が強まったことが円安要因となり、米ドルは上昇しました。2021年7月以降は、新規感染者数の増加を受けた景気への懸念や米国金利の低下などから、米ドルは小幅に下落しました。9月中旬以降は、利上げ観測の高まりなどから米ドルは上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

外貨建資産の運用にあたっては、C&Sに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行ってまいります。普通株式については、今後も企業のファンダメンタルズ、キャッシュフローおよび配当の成長、配当利回り、バリュエーションなどを考慮しながら、ポートフォリオを構築します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築します。

※C&S：コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

◆ポートフォリオについて

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、C&Sに運用の指図にかかる権限を委託しております。

普通株式については、企業のファンダメンタルズやキャッシュフローの成長性、配当利回りやバリュエーション等を考慮し、キャッシュフローを生み出し、魅力的な配当利回りを将来にわたって提供できると考える銘柄を中心としたポートフォリオとしました。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心としたポートフォリオとしました。

◆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。

当ファンドの当作成期の基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。

《今後の運用方針》

外貨建資産の運用にあたっては、C&Sに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行ってまいります。普通株式については、今後も企業のファンダメンタルズ、キャッシュフローおよび配当の成長、配当利回り、バリュエーションなどを考慮しながら、ポートフォリオを構築します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築します。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	7円
(株式)	(4)
(ハイブリッド優先証券)	(3)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	0
(株式)	(0)
(ハイブリッド優先証券)	(0)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	4
(保管費用)	(4)
(その他)	(0)
合 計	11

(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

(2021年4月16日から2021年10月15日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 827.49 (△ 126.6)	千アメリカ・ドル 5,106 (△ 0)	百株 783.07	千アメリカ・ドル 6,793
	カナダ	百株 241.68 ()	千カナダ・ドル 583 ()	百株 －	千カナダ・ドル －

(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) ハイブリッド優先証券

(2021年4月16日から2021年10月15日まで)

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	アメリカ	千証券 115.7 (△6.094)	千アメリカ・ドル 3,021 (△ 156)	千証券 71.001 ()	千アメリカ・ドル 1,874 ()

(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) 投資信託証券

(2021年4月16日から2021年10月15日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 － (－)	千アメリカ・ドル － (－)	千口 2,538 ()	千アメリカ・ドル 69 (－)

(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

(2021年4月16日から2021年10月15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
		千株	千円	円			千株	千円	円
NEXTERA ENERGY INC (アメリカ)		7.509	62,697	8,349	FIRSTENERGY CORP (アメリカ)		29.346	123,183	4,197
DOW INC (アメリカ)		9.163	61,650	6,728	APPLE INC (アメリカ)		3.461	57,738	16,682
PFIZER INC (アメリカ)		9.489	51,585	5,436	FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)		1.418	56,990	40,190
SUNCOR ENERGY INC (カナダ)		24.168	51,044	2,112	EXXON MOBIL CORP (アメリカ)		8.706	55,459	6,370
ESSENTIAL UTILITIES INC (アメリカ)		8.385	44,296	5,282	AMAZON.COM INC (アメリカ)		0.143	52,073	364,148
RENEWABLE ENERGY GROUP INC (アメリカ)		7.066	39,326	5,565	ADOBE INC (アメリカ)		0.474	34,140	72,027
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO (アメリカ)		5.354	37,445	6,993	CONOCOPHILLIPS (アメリカ)		5.115	32,453	6,344
EOG RESOURCES INC (アメリカ)		4.026	35,005	8,694	TYSON FOODS INC-CL A (アメリカ)		3.657	32,160	8,794
CONOCOPHILLIPS (アメリカ)		5.115	30,050	5,874	MICROSOFT CORP (アメリカ)		0.956	31,596	33,050
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)		4.34	29,350	6,762	NEXTERA ENERGY INC (アメリカ)		2.94	27,847	9,472

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

(2021年4月16日から2021年10月15日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘柄	柄	証券数	金 額	平均単価	銘柄	柄	証券数	金 額	平均単価
		千証券	千円	円			千証券	千円	円
JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ (アメリカ)		8.879	25,198	2,838	BANK OF HAWAII CORP 4.375 A (アメリカ)		6.416	18,631	2,903
WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA (アメリカ)		8.422	24,156	2,868	JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ (アメリカ)		6.371	18,581	2,916
JPMORGAN CHASE AND CO DS REPSTG T 4.2 (アメリカ)		7.301	20,414	2,796	AMERICAN INTL GROUP 5.85 A (アメリカ)		5.825	18,271	3,136
BANK OF HAWAII CORP 4.375 A (アメリカ)		6.416	17,947	2,797	JPMORGAN CHASE AND CO DS REPSTG T 4.2 (アメリカ)		6.104	17,393	2,849
FIRST HORIZON CORP 6.1 D (アメリカ)		5.22	15,548	2,978	CULLEN/FROST BANKERS INC 4.45 B (アメリカ)		5.143	15,405	2,995
WASHINGTON FEDERAL INC 4.875 A (アメリカ)		5.275	15,323	2,905	PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P (アメリカ)		4.919	13,974	2,840
ATHENE HOLDING LTD 4.875 D (バミューダ)		5.141	14,567	2,833	AFFILIATED MANAGERS GROUP INC. 4.2 (アメリカ)		4.824	13,377	2,773
WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC (アメリカ)		5.182	14,512	2,800	JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA (アメリカ)		4.2	11,508	2,740
CULLEN/FROST BANKERS INC 4.45 B (アメリカ)		5.143	14,505	2,820	CARLYLE FINANCE LLC 4.625 (アメリカ)		3.219	9,334	2,899
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC. 4.2 (アメリカ)		4.824	13,209	2,738	FIRST REPUBLIC BANK 4.7 J (アメリカ)		3.025	9,046	2,990

(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	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ABBOTT LABORATORIES	24.61	24.61	289	32,952	ヘルスケア
ADOBE INC	12.92	8.18	496	56,596	情報技術
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7.93	12.72	366	41,717	素材
DOLLAR TREE INC	10.99	—	—	—	一般消費・サービス
ALBEMARLE CORP	16.35	6.06	140	15,965	素材
DANAHER CORP	12.2	12.2	366	41,743	ヘルスケア
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	34.34	34.34	442	50,353	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	21.92	75.46	484	55,148	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	9.83	9.83	144	16,446	情報技術
APPLE INC	121.74	91.88	1,320	150,433	情報技術
BOEING CO/THE	11.93	8.96	194	22,188	貴金属・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	121.53	121.53	630	71,862	コミュニケーション・サービス
JPMORGAN CHASE & CO	58.1	55.7	910	103,700	金融
CATERPILLAR INC	12.87	9.63	187	21,313	貴金属・サービス
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	83.85	395	45,007	公益事業
MORGAN STANLEY	46.28	37.67	380	43,335	金融
BROADCOM INC	12.28	12.28	611	69,592	情報技術
DEERE & CO	5.37	4.04	133	15,173	貴金属・サービス
TELEFLEX INC	5.28	5.28	192	21,917	ヘルスケア
COLGATE-PALMOLIVE CO	25.99	17.22	131	15,022	生活必需品
ACTIVISION BLIZZARD INC	29.47	29.47	224	25,545	コミュニケーション・サービス
LABORATORY CORP OF AMER HLDGS	8.59	11.14	307	34,980	ヘルスケア
AMAZON.COM INC	2.98	1.55	511	58,252	一般消費・サービス
EXXON MOBIL CORP	43.66	—	—	—	エネルギー
EOG RESOURCES INC	26.86	40.26	364	41,528	エネルギー
FORD MOTOR CO	—	100.11	154	17,615	一般消費・サービス
NEXTERA ENERGY INC	30.78	76.47	622	70,944	公益事業
GENERAL ELECTRIC CO	160.24	13.25	136	15,503	貴金属・サービス
GENERAL MOTORS CO	51.98	38.78	223	25,479	一般消費・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	11.26	9.2	359	40,989	金融
ALPHABET INC-CL A	1.31	1.31	369	42,118	コミュニケーション・サービス
FIRSTENERGY CORP	293.46	—	—	—	公益事業
HOME DEPOT INC	10.32	8.17	281	32,013	一般消費・サービス
JOHNSON & JOHNSON	29.77	29.77	476	54,285	ヘルスケア
RENEWABLE ENERGY GROUP INC	83.62	134.52	730	83,144	エネルギー
MCDONALD'S CORP	13.55	13.55	331	37,739	一般消費・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	28.82	14.64	480	54,777	コミュニケーション・サービス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	10.84	12.96	317	36,178	情報技術
MERCK & CO. INC.	20.92	20.92	163	18,662	ヘルスケア
NIKE INC -CL B	11.97	11.97	188	21,422	一般消費・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	14.43	16.28	439	50,029	貴金属・サービス
NORTHROP GRUMMAN CORP	7.9	7.9	308	35,084	貴金属・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	22.21	25.92	256	29,180	生活必需品
PFIZER INC	81.64	176.53	735	83,777	ヘルスケア
DOW INC	—	91.63	538	61,299	素材
PROCTER & GAMBLE CO/THE	15.65	10.32	148	16,930	生活必需品

銘柄	期首		当期末		業種等
	株数	株数	評価額	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	
TESLA INC	3.02	3.02	247	28,145	一般消費・サービス
ORGANON & CO	—	2.09	7	800	ヘルスケア
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	22.75	22.75	435	49,596	貴金属・サービス
ANTHEM INC	4.21	4.21	164	18,733	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	18.01	18.01	314	35,774	コミュニケーション・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	16.14	24.25	383	43,625	貴金属・サービス
WALMART INC	8.52	8.52	119	13,572	生活必需品
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	16.42	16.42	839	95,626	情報技術
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13.67	13.67	339	38,633	金融
VISA INC-CLASS A SHARES	34.38	34.38	774	88,170	情報技術
NVIDIA CORP	3.14	13.72	298	33,979	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	24.73	21.51	435	49,607	金融
TYSON FOODS INC-CL A	87.43	50.86	405	46,165	生活必需品
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	7.6	7.6	438	49,973	ヘルスケア
MASTERCARD INC - A	20.1	20.1	692	78,880	情報技術
BANK OF AMERICA CORP	154.77	131.3	591	67,396	金融
EATON CORP PLC	25.44	25.09	400	45,597	貴金属・サービス
ECOLAB INC	10.24	10.24	224	25,581	素材
INTEL CORP	30.89	30.89	166	18,962	情報技術
MICROSOFT CORP	55.55	45.99	1,392	158,574	情報技術
MEDTRONIC PLC	31.78	31.78	396	45,170	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	80.18	107.02	725	82,638	情報技術
COMCAST CORP-CLASS A	42.2	42.2	227	25,948	コミュニケーション・サービス
アメリカ・ドル 通貨計	株数、金額 総柄数<比率>	2,295.86 65総柄	2,213.68 66総柄	-26,509 <74.6%>	3,019,112
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
SUNCOR ENERGY INC	—	241.68	703	64,737	エネルギー
ENBRIDGE INC	36.43	36.43	191	17,665	エネルギー
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 総柄数<比率>	-36.43 1総柄	278.11 2総柄	895 < 2.0%>	82,403
ファンド合計	株数、金額 総柄数<比率>	2,332.29 66総柄	2,491.79 68総柄	-26,509 <76.6%>	3,101,516

(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) ハイブリッド優先証券

銘柄	期首		当期		期末	
	証券数	証券数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額
			千円	千ドル		
(アメリカ)	千証券	千証券	千円	千ドル		
CHS INC 7.5 4	4.575	4.575	131	14,922		
JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA	4.2	—	—	—		
REINSURANCE GRP OF AMER 5.75	2.558	2.558	73	8,346		
WELLS FARGO & COMPANY 5.5 X	4.55	—	—	—		
ENTERGY LOUISIANA LLC 4.875 *	1.2	1.2	30	3,457		
ARCH CAPITAL GROUP LTD 5.25 E	1.2	—	—	—		
MORGAN STANLEY 5.85 K	0.633	0.633	18	2,134		
AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	2.1	4.465	112	12,784		
NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A	2.303	—	—	—		
FIRST REPUBLIC BANK 5.125 H	2.582	2.582	66	7,592		
VALLEY NATIONAL BANCORP 5.5 B	2.076	2.076	53	6,050		
SOUTHERN CO 5.25	1.961	1.961	51	5,858		
ENBRIDGE INC 6.375 B	0.497	0.497	13	1,533		
BANK OF AMERICA CORP 6 GG	2.725	2.725	74	8,434		
UNUM GROUP 6.25	3.35	3.35	91	10,377		
KKR & CO INC 6.5 B	0.75	—	—	—		
KEYCORP 5.65 F	0.952	0.952	25	2,915		
JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	5.088	2.235	62	7,063		
NISOURCE INC 6.5 B	2.81	2.81	78	8,896		
JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	3.975	2.328	65	7,490		
CMS ENERGY CORP 5.875	4.546	4.546	123	14,103		
AMERICAN INTL GROUP 5.85 A	5.825	—	—	—		
DUKE ENERGY CORP 5.75 A	1.818	—	—	—		
REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	3.038	2.272	65	7,485		
ALCONQUIN PWR & UTILITY 6.2 19A	0.909	0.909	25	2,886		
SPIRE INC 5.9 A	3.556	3.556	98	11,202		
ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	1.1	1.1	32	3,723		
SYNOVUS FINANCIAL CORP 5.875 E	2.895	4.851	131	14,939		
TCF FINANCIAL 5.7 C*	0.4	—	—	—		
ALLSTATE CORP 5.1 H	4.375	6.144	167	19,109		
SEMPRA ENERGY 5.75	6.407	6.407	178	20,300		
FIFTH THIRD BANCORP 6 A	1.923	1.923	51	5,892		
AEGON FUNDING CO LLC 5.1	6.414	6.414	173	19,715		
SYNCHRONY FINANCIAL 5.625 A	7.734	9.13	249	28,376		
FIRST REPUBLIC BANK 4.7 J	3.025	—	—	—		
SOUTHERN CO 4.95 2020	8.035	8.035	216	24,620		
WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	11.013	12.614	331	37,739		
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 4.8 J	6.084	9.066	239	27,289		
FIRST HORIZON CORP 6.5	3.936	3.936	109	12,520		
ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	1.95	5.778	166	18,951		
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	3.578	5.735	154	17,556		
UNITED STATES CELLULAR C 6.25	2.438	2.438	65	7,510		
BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	1.675	3.167	82	9,345		
WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA	—	8.422	223	25,427		
BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN 5.375 C	1.7	6.161	166	18,910		
US CELLULAR CORP 5.5	1.667	1.667	44	5,012		
WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC	—	5.182	132	15,132		
WASHINGTON FEDERAL INC 4.875 A	1.228	6.503	173	19,767		
FIRST HORIZON CORP 6.1 D	5.763	10.983	288	32,909		
TELEPHONE & DATA SYS 6.625 UU	3.084	4.979	135	15,429		

銘柄	期首		当期		期末	
	証券数	証券数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額
			千円	千ドル		
TEXAS CAPITAL BANCSHARES 5.75 B	2.5	5.524	147	16,810		
JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ	—	2.508	66	7,540		
CHARLES SCHWAB CORP 4.45 J	4.396	2.64	70	8,009		
FIRST HORIZON CORP 4.7 F	—	4.185	107	12,252		
REGIONS FINANCIAL CORP 4.45 E	—	1.326	34	3,924		
JPMORGAN CHASE & CO 4.625 LL	—	4.467	119	13,588		
HUNTINGTON BANCSHARES 5.7 C	—	0.4	10	1,194		
ATHENE HOLDING LTD 4.875 D	—	5.141	133	15,152		
JPMORGAN CHASE AND CO DS REPGT T 4.2	—	1.197	30	3,444		
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 A	1.444	—	—	—		
MORGAN STANLEY 6.875 F	1.589	1.589	44	5,088		
ALLY FINANCIAL FR 2/15/40	1.963	—	—	—		
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B	—	3.022	85	9,722		
WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R	1.556	—	—	—		
PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P	1.9	1.29	33	3,787		
MORGAN STANLEY 6.375 I	1.593	1.593	45	5,154		
WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	2.892	2.892	78	8,955		
合計	証券数、金額	176,034	214,639	5,780	658,347	
	銘柄数<比率>	57銘柄	55銘柄		<16.3%>	

(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) 外国投資信託証券

銘柄	期首		当期		期末	
	口数	口数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額
			千円	千ドル		
(アメリカ)	千口	千口	千円	千ドル		
UMH PROPERTIES INC 6.75 C	1.2	1.2	31	3,565		
MONMOUTH REIT 6.125 C	2.875	2.875	73	8,323		
SPIRIT REALTY CAPITAL IN 6 A	1.35	1.35	35	4,020		
QTS REALTY TRUST INC 7.125 A	1.175	—	—	—		
AMERICAN HOMES 4 RENT 6.25 H	1.363	—	—	—		
合計	口数、金額	7,963	5,425	139	15,909	
	銘柄数<比率>	5銘柄	3銘柄		<0.4%>	

(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。

■投資信託財産の構成

2021年10月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	3,101,516	76.5
公社債	658,347	16.2
投資信託証券	15,909	0.4
コール・ローン等、その他	277,987	6.9
投資信託財産総額	4,053,760	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、10月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝113.89円、1カナダ・ドル＝92.05円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産（3,884,449千円）の投資信託財産総額（4,053,760千円）に対する比率は、95.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年10月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,053,760,419円
コール・ローン等	262,784,425
株式(評価額)	3,101,516,113
公社債(評価額)	658,347,349
投資信託証券(評価額)	15,909,636
未収入金	10,093,500
未収配当金	3,355,195
未収利息	1,754,201
(B) 負債	6,140,000
未払解約金	6,140,000
(C) 純資産総額(A－B)	4,047,620,419
元本	955,289,209
次期繰越損益金	3,092,331,210
(D) 受益権総口数	955,289,209口
1万口当り基準価額(C／D)	42,371円

* 期首における元本額は928,267,040円、当作成期間中における追加設定元本額は60,215,185円、同解約元本額は33,193,016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、

- 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型） 5,263,409円
- インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型） 4,799,598円
- 成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型） 89,913,140円
- ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド 14,469,451円
- ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型） 15,299,106円
- DＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース） 130,833,466円
- DＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース） 247,261,903円
- DＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース） 447,449,136円

です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は42,371円です。

■損益の状況

当期 自2021年4月16日 至2021年10月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	35,965,644円
受取配当金	20,009,408
受取利息	15,836,829
その他収益金	134,751
支払利息	△ 15,344
(B) 有価証券売買損益	351,065,755
売買益	443,067,081
売買損	△ 92,001,326
(C) その他費用	△ 350,717
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	386,680,682
(E) 前期繰越損益金	2,625,111,697
(F) 解約差損益金	△ 99,842,984
(G) 追加信託差損益金	180,381,815
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	3,092,331,210
次期繰越損益金(H)	3,092,331,210

(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。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

運用報告書 第32期（決算日 2021年10月15日）

（作成対象期間 2021年4月16日～2021年10月15日）

ダイワ欧州好配当株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。

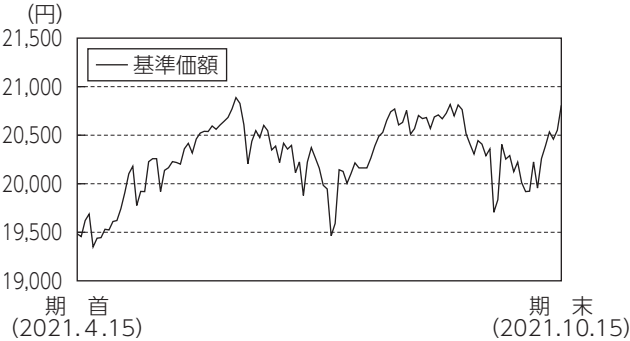
運 用 方 針	欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
株 式 組 入 制 限	無制限

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ヨーロッパ指数 (配当込み、円換算) (参考指数)		株 式 組入比率	株 式 先物比率
	円	%	騰落率	%	%	%
(期首)2021年 4月15日	19,484	—	22,909	—	97.4	—
4 月末	19,621	0.7	23,348	1.9	98.8	—
5 月末	20,416	4.8	24,353	6.3	96.8	—
6 月末	20,388	4.6	24,433	6.7	95.0	—
7 月末	20,215	3.8	24,546	7.1	94.3	—
8 月末	20,709	6.3	24,929	8.8	95.2	—
9 月末	20,223	3.8	24,139	5.4	95.0	—
(期末)2021年10月15日	20,808	6.8	25,166	9.9	95.1	—

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) MSCIヨーロッパ指数 (配当込み、円換算) は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIヨーロッパ指数 (配当込み、ユーロベース) 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。MSCIヨーロッパ指数 (配当込み、ユーロベース) 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：19,484円 期末：20,808円 騰落率：6.8%

【基準価額の主な変動要因】

保有株式が値上がりしたことやユーロが対円で上昇 (円安) 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。

◆ 投資環境について

○ 欧州株式市況

欧州株式市場は上昇しました。

欧州株式市場は、当作成期首より、米国政府による大型インフラ (社会基盤) 計画発表や、欧州における新型コロナウイルスのワクチン接種加速に対する期待を受けて、上昇して始めました。また、経済活動の規制緩和の動きが広がったほか、経済指標がおおむね好調だったことも相場を後押ししました。当作成期末にかけては、世界的にインフレの長期化が懸念されて長期金利が上昇したほか、中国の大手不動産開発会社の債務危機への懸念が高まったことなどから、やや弱含んで推移しました。

○ 為替相場

ユーロは対円で上昇しました。

ユーロ円為替相場は、当作成期首より、市場予想を上回る欧州経済指標や、新型コロナウイルスのワクチン普及に伴う欧州経済の正常化への期待などを受けて、上昇して始めました。2021年6月に入ると、FRB (米国連邦準備制度理事会) による利上げ時期見通しが従来よりも前倒しされたことで米欧の金利差拡大が意識され、ユーロが売られる動きとなりました。またECB (欧州中央銀行) が、インフレ率が一時的に物価目標を上回る期間があっても金融緩和を続ける方針を示したことなども、ユーロの重しとなりました。10月に入るとユーロはやや反発し、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」

外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・アイルランドに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行ってまいります。銘柄選定では、収益基盤が強く安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

※アムンディ・アイルランド：アムンディ・アイルランド・リミテッド

◆ ポートフォリオについて

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、アムンディ・アイルランドに運用の指図にかかる権限を委託しております。

株式組入比率は高位を維持しました。銘柄選定にあたって、アムンディ・アイルランドは、収益基盤が強く安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資しました。

◆ 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。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。参考指数は欧州株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。

《今後の運用方針》

外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・アイルランドに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行ってまいります。銘柄選定では、収益基盤が強く安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	0円 (0)
有価証券取引税 (株式)	0 (0)
その他費用 (保管費用) (その他)	5 (5) (0)
合 計	5

(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
株 式

(2021年 4月16日から2021年10月15日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株 (3.71)	千アメリカ・ドル (11)	百株 3.71	千アメリカ・ドル 9
	イギリス	百株 (-)	千イギリス・ポンド (△ 8)	百株 338.66	千イギリス・ポンド 42
	スイス	百株 (-)	千スイス・フラン (-)	百株 0.13	千スイス・フラン 50
	スウェーデン	百株 (24.86)	千スウェーデン・クローネ (-)	百株 -	千スウェーデン・クローネ -
	ユーロ (オランダ)	百株 (-)	千ユーロ (-)	百株 1.44	千ユーロ 21
	ユーロ (フランス)	百株 (-)	千ユーロ (-)	百株 5.22	千ユーロ 67
	ユーロ (ドイツ)	百株 (-)	千ユーロ (-)	百株 2.02	千ユーロ 48
	ユーロ (スペイン)	百株 (-)	千ユーロ (-)	百株 15.7	千ユーロ 29
国	ユーロ (ユーロ 通貨計)	百株 (-)	千ユーロ (-)	百株 24.38	千ユーロ 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。

■主要な売買銘柄
株 式

(2021年 4月16日から2021年10月15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
		千株	千円	円			千株	千円	円
					SCHNEIDER ELECTRIC SE (フランス)		0.522	9,060	17,356
					VODAFONE GROUP PLC (イギリス)		33.866	6,680	197
					MUENCHENER RUECKVER AG-REG (ドイツ)		0.202	6,437	31,869
					GIVAUDAN-REG (スイス)		0.013	6,108	469,911
					ENAGAS SA (スペイン)		1.57	4,007	2,552
					KONINKLIJKE DSM NV (オランダ)		0.144	2,823	19,610
					JACKSON FINANCIAL INC CLASS A (アメリカ)		0.371	1,112	2,998

(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
外国株式

銘柄	期首		当期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千円	千円	
UNILEVER PLC	44.89	44.89	174	27,130	生活必需品
PRUDENTIAL PLC	148.44	148.44	215	33,562	金融
AVIVA PLC	406.69	406.69	161	25,213	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	159	159	222	34,718	ヘルスケア
M&G PLC	687.65	687.65	137	21,444	金融
TESCO PLC	884.45	884.45	235	36,647	生活必需品
VODAFONE GROUP PLC	1,355.23	1,016.57	112	17,595	コミュニケーション・サービス
NATIONAL GRID PLC	178.73	178.73	161	25,095	公益事業
HSBC HOLDINGS PLC	434.04	434.04	184	28,802	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	117.61	117.61	205	31,964	エネルギー
イギリス・ボンド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,416.73 10銘柄	4,078.07 10銘柄	1,811 <19.3%>	
(スイス)	百株	百株	千円	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	13.13	13.13	468	57,801	ヘルスケア
NESTLE SA-REG	55.78	55.78	638	78,668	生活必需品
ZURICH INSURANCE GROUP AG	9.03	9.03	352	43,452	金融
NOVARTIS AG-REG	43.89	43.89	335	41,363	ヘルスケア
GIVAUDAN-REG	1.08	0.95	401	49,496	素材
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	122.91 5銘柄	122.78 5銘柄	2,196 <18.6%>	
(スウェーデン)	百株	百株	千円	千円	
ELECTROLUX REDEMPTION SHARES CLASS	—	24.86	42	556	一般消費財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	24.86	24.86	461	6,079	一般消費財・サービス
スウェーデン・クロネ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	24.86 1銘柄	49.72 2銘柄	503 < 0.5%>	
ユーロ(オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	77.85	77.85	295	38,964	ヘルスケア
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	65.06	65.06	181	23,958	生活必需品
KONINKLIJKE DSM NV	22.61	21.17	383	50,672	素材
KONINKLIJKE KPN NV	879.29	879.29	240	31,723	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>	1,044.81 4銘柄	1,043.37 4銘柄	1,100 <10.0%>	
ユーロ(フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TOTALENERGIES SE	62.99	62.99	275	36,434	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	21.55	21.55	284	37,537	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	34.17	28.95	417	55,114	資本財・サービス
BNP PARIBAS	39.9	39.9	225	29,839	金融
CAPGEMINI SE	18.83	18.83	352	46,525	情報技術
AXA SA	121.26	121.26	287	37,952	金融
SANOFI	38.93	38.93	327	43,252	ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	337.63 7銘柄	332.41 7銘柄	2,170 <19.7%>	
ユーロ(ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SIEMENS AG-REG	28	28	394	52,159	資本財・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	29.96	29.96	258	34,168	一般消費財・サービス
BASF SE	36.76	36.76	239	31,598	素材
ALLIANZ SE-REG	11.45	11.45	224	29,697	金融

銘 柄	期 首		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12.39	10.37	250	33,113	金融
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	211.45	211.45	349	46,158	コミュニケーション・サービス
DEUTSCHE POST AG-REG	68.23	68.23	360	47,557	資本財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	398.24 7銘柄	396.22 7銘柄	2,078 <18.8%>	
ユーロ(スペイン)		百株	千ユーロ	千円	
ENAGAS SA	101.15	85.45	168	22,292	公益事業
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	101.15 1銘柄	85.45 1銘柄	168 < 1.5%>	
ユーロ(イタリア)		百株	千ユーロ	千円	
INTESA SANPAOLO	1,005.55	1,005.55	253	33,510	金融
ENI SPA	129.35	129.35	154	20,464	エネルギー
ENEL SPA	481.53	481.53	334	44,132	公益事業
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,616.43 3銘柄	1,616.43 3銘柄	742 < 6.7%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,498.26 22銘柄	3,473.88 22銘柄	6,260 <56.7%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	8,062.76 38銘柄	7,724.45 39銘柄	— <95.1%>	

(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。

■投資信託財産の構成

2021年10月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	1,386,422	94.9
コール・ローン等、その他	73,776	5.1
投資信託財産総額	1,460,198	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、10月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝113.89円、1イギリス・ポンド＝155.77円、1スイス・フラン＝123.26円、1デンマーク・クローネ＝17.75円、1ノルウェー・クローネ＝13.47円、1スウェーデン・クローネ＝13.18円、1ユーロ＝132.06円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（1,415,164千円）の投資信託財産総額（1,460,198千円）に対する比率は、96.9%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年10月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,460,198,552円
コール・ローン等	73,335,213
株式(評価額)	1,386,422,473
未収配当金	440,866
(B) 負債	1,831,000
未払解約金	1,831,000
(C) 純資産総額(A－B)	1,458,367,552
元本	700,866,943
次期繰越損益金	757,500,609
(D) 受益権総口数	700,866,943口
1万口当り基準価額(C／D)	20,808円

* 期首における元本額は714,174,440円、当作成期間中における追加設定元本額は37,968,586円、同解約元本額は51,276,083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、
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型） 10,945,122円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型） 9,886,246円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型） 180,632,991円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド 28,728,735円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型） 30,768,966円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース） 69,833,614円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース） 131,582,556円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース） 238,488,713円
です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は20,808円です。

■損益の状況

当期 自2021年4月16日 至2021年10月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	26,853,209円
受取配当金	26,918,689
支払利息	△ 65,480
(B) 有価証券売買損益	66,778,179
売買益	113,483,479
売買損	△ 46,705,300
(C) その他費用	△ 356,681
(D) 当期損益金(A + B + C)	93,274,707
(E) 前期繰越損益金	677,305,405
(F) 解約差損益金	△ 52,423,917
(G) 追加信託差損益金	39,344,414
(H) 合計(D + E + F + G)	757,500,609
次期繰越損益金(H)	757,500,609

(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・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

運用報告書 第32期（決算日 2021年10月15日）

（作成対象期間 2021年4月16日～2021年10月15日）

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株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。

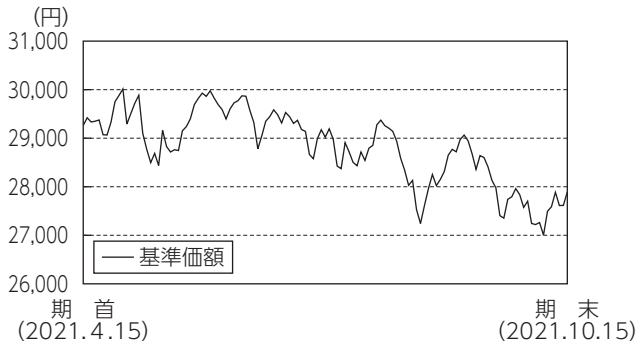
運 用 方 針	アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
株 式 組 入 制 限	無制限

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 パシフィック指数 (除く日本、配当込み、円換算)		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	(参考指数)	騰落率			
(期首)2021年4月15日	29,263	%	31,091	%	95.3	%	%
4月末	30,014	2.6	31,764	2.2	98.1	—	—
5月末	29,692	1.5	32,331	4.0	96.3	—	—
6月末	29,314	0.2	31,884	2.5	95.3	—	—
7月末	28,716	△1.9	31,348	0.8	95.4	—	—
8月末	28,315	△3.2	31,454	1.2	94.5	—	—
9月末	27,575	△5.8	30,348	△2.4	95.1	—	—
(期末)2021年10月15日	27,894	△4.7	31,947	2.8	94.6	—	—

- (注1) 騰落率は期首比。
 (注2) MSCI パシフィック指数 (除く日本、配当込み、円換算) は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCI パシフィック指数 (除く日本、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。MSCI パシフィック指数 (除く日本、配当込み、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：29,263円 期末：27,894円 騰落率：△4.7%

【基準価額の主な変動要因】

新型コロナウイルスの感染再拡大や中国当局の規制リスクからセンチメントが悪化し、保有株式が下落したことなどがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○アジア・オセアニア株式市況

アジア・オセアニア株式市況はまちまちの展開となりました。

アジア・オセアニア株式市況は、当作成期首から2021年8月にかけて、新型コロナウイルスの感染再拡大の動きや中国当局の規制リスクに対する懸念が高まった一方、ワクチンの普及や行動制限の緩和などが下支え要因となり、おおむね横ばい基調で推移しました。9月には中国恒大集団の債務懸念や米国長期金利上昇を受けて軟調

な展開となりましたが、10月以降はやや値を戻して当作成期末を迎えました。

○為替相場

アジア・オセアニア地域の通貨は、円に対してまちまちの展開となりました。

アジア・オセアニア地域の通貨は、当作成期首から2021年8月にかけて、新型コロナウイルスの感染再拡大や中国当局の規制リスクなどが懸念され、市場のリスク回避姿勢が強まったことから対円で軟調に推移しました。9月以降は、円が対米ドルで下落 (円安) したことから、アジア・オセアニア地域の通貨は対円でやや上昇 (円高) 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」

当ファンドでは、主としてオーストラリアや中国 (香港)、台湾、韓国を中心にアジア・オセアニア地域に上場する株式へ投資し、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。

ポートフォリオの構築にあたっては、各国の投資比率の分散に配慮しつつ、企業ファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮して銘柄選択を行います。

◆ポートフォリオについて

オーストラリアや中国 (香港)、台湾、韓国を中心に、高い利益成長が見込まれた銘柄や予想配当利回りが高いと判断された銘柄などを組み入れました。国別では、各国の投資比率の分散に配慮しつつ、オーストラリア、台湾、韓国を高位に組み入れました。セクター別では、情報技術や金融を高位に組み入れました。

◆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。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。

《今後の運用方針》

当ファンドでは、主としてオーストラリアや中国 (香港)、台湾、韓国を中心にアジア・オセアニア地域に上場する株式へ投資し、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。

ポートフォリオの構築にあたっては、各国の投資比率の分散に配慮しつつ、企業ファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮して銘柄選択を行います。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	15円 (15)
有価証券取引税 (株式)	5 (5)
その他費用 (保管費用) (その他)	37 (24) (13)
合 計	57

(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
株 式

(2021年4月16日から2021年10月15日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	オーストラリア	百株 11 (ー)	千オーストラリア・ドル 110 (ー)	百株 332	千オーストラリア・ドル 292
	香港	百株 1,307 (ー)	千香港ドル 2,394 (ー)	百株 458	千香港ドル 886
	シンガポール	百株 ー (ー)	千シンガポール・ドル ー (ー)	百株 173	千シンガポール・ドル 128
国	台湾	百株 60 (ー)	千台湾ドル 2,817 (△ 96)	百株 70	千台湾ドル 5,121
	韓国	百株 9 (ー)	千韓国ウォン 123,658 (ー)	百株 6	千韓国ウォン 55,863

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) (ー)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。

■ 主要な売買銘柄
株 式

(2021年4月16日から2021年10月15日まで)

当					期				
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
CHINA MERCHANTS BANK-H (中国)		13.5	13,221	979	MEDIATEK INC (台湾)		3	11,547	3,849
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL (オーストラリア)		1.1	9,143	8,312	SOUTH32 LTD (オーストラリア)		28.5	7,647	268
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H (中国)		62.2	7,646	122	JB HI-FI LTD (オーストラリア)		1.7	6,847	4,027
SK TELECOM (韓国)		0.2	6,231	31,155	POYA INTERNATIONAL CO LTD (台湾)		3	6,431	2,143
KIA CORP (韓国)		0.7	5,862	8,375	WILMAR INTERNATIONAL LTD (シンガポール)		14.5	6,266	432
NOVATEK MICROELECTRONICS COR (台湾)		3	5,830	1,943	VENTURE CORP LTD (シンガポール)		2.8	4,324	1,544
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD (台湾)		3	5,285	1,761	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR (韓国)		0.3	4,150	13,836
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL (ケイマン諸島)		23	3,526	153	CHINA RESOURCES CEMENT (ケイマン諸島)		30	3,558	118
WEICHA1 POWER CO LTD-H (中国)		12	3,515	292	BHP GROUP LTD (オーストラリア)		0.7	2,937	4,196
SUN HUNG KAI PROPERTIES (香港)		2	3,319	1,659	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD (オーストラリア)		1.3	2,911	2,239

(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
外国株式

銘柄	株数	期首	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額	外貨建金額	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	邦貨換算金額	千円
BHP GROUP LTD	95	88	332	28,094	素材	
SOUTH32 LTD	285	—	—	—	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	17	17	42	3,588	エネルギー	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	42	42	60	5,079	素材	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	117	104	297	25,104	金融	
WESTPAC BANKING CORP	103	96	242	20,489	金融	
RIO TINTO LTD	7	7	70	5,942	素材	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	33.5	41.5	422	35,720	金融	
MACQUARIE GROUP LTD	10	10	182	15,445	金融	
CSL LTD	5	5	148	12,538	ヘルスケア	
WESFARMERS LTD	47	47	255	21,574	一般消費財・サービス	
JB HI-FI LTD	17	—	—	—	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>	778.5 12銘柄	457.5 10銘柄	2,055 173,577 <25.4%>		
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	30	—	—	—	一般消費財・サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	40	60	605	8,863	不動産	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	90	—	—	—	一般消費財・サービス	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	120	120	168	2,466	素材	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	34	31	1,432	20,976	金融	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	—	230	213	3,124	資本財・サービス	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,430	1,430	785	11,493	金融	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	—	622	406	5,946	資本財・サービス	
AIA GROUP LTD	176	176	1,540	22,545	金融	
CHINA RESOURCES CEMENT	300	—	—	—	素材	
CHINA FEIHE LTD	230	200	258	3,788	生活必需品	
SANDS CHINA LTD	208	208	341	5,006	一般消費財・サービス	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	60	55	817	11,965	資本財・サービス	
WEICHAI POWER CO LTD-H	—	120	174	2,554	資本財・サービス	
ZUIJIN MINING GROUP CO LTD-H	—	180	184	2,703	素材	
CHINA MERCHANTS BANK-H	—	135	853	12,490	金融	
香港ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,718 11銘柄	3,567 13銘柄	7,781 113,925 <16.6%>		
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	58	58	176	14,905	金融	
VENTURE CORP LTD	28	—	—	—	情報技術	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	315	170	74	6,304	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>	401 3銘柄	228 2銘柄	251 21,210 <3.1%>		
(台湾)		百株	百株	千台湾ドル	千円	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	—	30	1,116	4,523	一般消費財・サービス	
DELTA ELECTRONICS INC	30	30	706	2,863	情報技術	
NANYA TECHNOLOGY CORP	100	100	623	2,525	情報技術	
MEDIATEK INC	90	60	5,040	20,429	情報技術	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	850	850	2,745	11,128	金融	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	1,410	1,410	3,235	13,116	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	千台湾ドル	千円	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR		—	30	1,116	4,523	情報技術
WIN SEMICONDUCTORS CORP		40	40	1,194	4,839	情報技術
POYA INTERNATIONAL CO LTD		30	—	—	—	一般消費財・サービス
MERIDA INDUSTRY CO LTD		110	110	2,970	12,038	一般消費財・サービス
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC		270	260	14,898	60,387	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY		230	230	2,449	9,928	情報技術
UNITED MICROELECTRONICS CORP		870	870	4,932	19,995	情報技術
台 湾 ド ル 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,030 11銘柄	4,020 12銘柄	41,027	166,300 <24.3%>	
(韓国)		百株	百株	千韓国ウォン	千円	
KIA CORP		—	7	58,870	5,680	一般消費財・サービス
SK HYNIX INC		20	20	187,600	18,103	情報技術
HYUNDAI MOTOR CO		5	5	104,500	10,084	一般消費財・サービス
POSCO		3.3	3.3	108,075	10,429	素材
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR		3	—	—	—	資本財・サービス
HYUNDAI MOBIS CO LTD		2.3	2.3	62,790	6,059	一般消費財・サービス
NAVER CORP		3.9	3.9	154,050	14,865	コミュニケーション・サービス
LG CHEM LTD		0.9	0.9	76,320	7,364	素材
KB FINANCIAL GROUP INC		35	35	191,100	18,441	金融
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD		69	69	478,860	46,209	情報技術
LG ELECTRONICS INC		5	5	61,750	5,958	一般消費財・サービス
SK TELECOM		—	2	60,500	5,838	コミュニケーション・サービス
HANA FINANCIAL GROUP		34	34	149,260	14,403	金融
HANWHA SOLUTIONS CORP		3	—	—	—	素材
韓 国 ウ ォ ン 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	184.4 12銘柄	187.4 12銘柄	1,693,675	163,439 <23.9%>	
(中国)		百株	百株	千オフショア人民元	千円	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A		2.6	2.6	496	8,796	生活必需品
オフショア人民元 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	2.6 1銘柄	2.6 1銘柄	496	8,796 <1.3%>	
ファンダ合計	株数、金額 銘柄数<比率>	8,114.5 50銘柄	8,462.5 50銘柄	—	647,248 <94.6%>	

(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。

■投資信託財産の構成

2021年10月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	647,248	94.6
コール・ローン等、その他	37,139	5.4
投資信託財産総額	684,388	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、10月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝113.89円、1オーストラリア・ドル＝84.46円、1香港ドル＝14.64円、1シンガポール・ドル＝84.48円、1台湾ドル＝4.053円、100韓国ウォン＝9.65円、1オフショア人民元＝17.704円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産（676,717千円）の投資信託財産総額（684,388千円）に対する比率は、98.9%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年10月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	684,388,031円
コール・ローン等	36,875,006
株式(評価額)	647,248,921
未収配当金	264,104
(B) 負債	67,000
未払解約金	67,000
(C) 純資産総額(A－B)	684,321,031
元本	245,331,031
次期繰越損益金	438,990,000
(D) 受益権総口数	245,331,031口
1万口当り基準価額(C／D)	27,894円

* 期首における元本額は250,929,511円、当作成期間中における追加設定元本額は12,878,185円、同解約元本額は18,476,665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、

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	7,882,565円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	7,116,298円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	130,668,778円
ダイワ・株／債券／コモディティ／バランスファンド	20,994,790円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	22,381,007円
D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	8,909,377円
D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	17,038,957円
D Cダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	30,339,259円

です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は27,894円です。

■損益の状況

当期 自2021年4月16日 至2021年10月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	12,821,087円
受取配当金	12,821,906
受取利息	25
支払利息	△ 844
(B) 有価証券売買損益	△ 44,565,398
売買益	34,942,434
売買損	△ 79,507,832
(C) その他費用	△ 891,268
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 32,635,579
(E) 前期繰越損益金	483,367,099
(F) 解約差損益金	△ 36,039,335
(G) 追加信託差損益金	24,297,815
(H) 合計(D + E + F + G)	438,990,000
次期繰越損益金(H)	438,990,000

(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。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

運用報告書 第33期（決算日 2021年10月15日）

（作成対象期間 2021年4月16日～2021年10月15日）

ダイワ好配当日本株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。

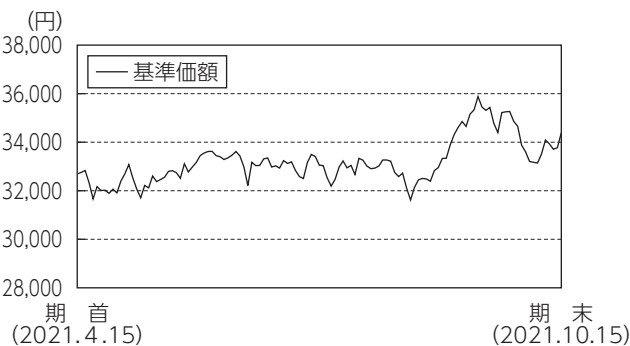
運 用 方 針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）
株 式 組 入 制 限	無制限

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		T O P I X		株 式 先 物 比 率	株 式 先 物 比 率
	円	騰落率	(参考指数)	騰落率	株 式 先 物 比 率	株 式 先 物 比 率
(期首)2021年 4月15日	32,692	%	1,959.13	%	97.8	%
4 月末	31,912	△2.4	1,898.24	△3.1	97.1	—
5 月末	32,774	0.3	1,922.98	△1.8	97.4	—
6 月末	33,026	1.0	1,943.57	△0.8	97.2	—
7 月末	32,671	△0.1	1,901.08	△3.0	98.9	—
8 月末	32,955	0.8	1,960.70	0.1	97.8	—
9 月末	34,658	6.0	2,030.16	3.6	97.3	—
(期末)2021年10月15日	34,388	5.2	2,023.93	3.3	97.1	—

(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。

《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：32,692円 期末：34,388円 騰落率：5.2%

【基準価額の主な変動要因】

世界各国の経済政策や新型コロナウイルスワクチンへの期待から、国内株式市況が上昇したことにより、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

○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、国内で新型コロナウイルスの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。2021年8月下旬以降は、国内のウイルス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月初めには菅首相が自民党総裁選挙に出馬しないことを表明したことで、米たる衆議院議員選挙での自民党大敗リスクが後退したとの見方から、株価は急騰しました。しかしその後は、世界的にインフレ懸念が台頭したことや中国の大手不動産会社の信用不安問題などを受け、株価は反落しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

国内株式市場は、景気回復の継続への期待から底堅く推移すると想定します。2021年度の会社計画は慎重な見通しが提示される可能性があります。2021年度を通して見れば、国内外の経済対策の

効果や新型コロナウイルスワクチンの接種の普及による景気回復が、企業業績を押し上げると考えます。

こうした投資環境を踏まえ、これまで滞っていた工場投資の再開やDX（デジタルトランスフォーメーション）化に向けたIT（情報技術）投資の進展などの設備投資に関わる企業、脱炭素化に向けた技術やサービスを有し、グリーンリカバリー政策に関わるビジネス展開力を持つ企業などに注目しています。個別銘柄の選別にあたりましては、業績の底打ちと回復をもたらす企業の収益力の変化や、資本効率の改善や株主を重視する経営姿勢を背景とした配当などの株主還元政策における経営陣のメッセージなどに注目することで、パフォーマンスの向上に努めてまいります。

◆ポートフォリオについて

配当利回りや企業業績のほか、PER（株価収益率）やPBR（株価純資産倍率）などのバリュエーション指標、株主還元や資本効率の向上に対する経営姿勢などにも注目し、投資しました。

株式等の組入比率は、おおむね高位で推移させました。業種構成は、小売業、鉄鋼、その他金融業などの組入比率を引き上げた一方、機械、銀行業、電気機器などの組入比率を引き下げました。当作成期末では、化学、電気機器、卸売業などを中心としたポートフォリオとなりました。

個別銘柄では、本田技研や三井物産などを売却した一方で、三菱商事やいすゞ自動車などを買い付けました。三菱商事は、市況上昇による業績拡大に加えて、同業他社に比べて遅れていた株主還元政策やESG（環境・社会・企業統治）関連の開示について、今後の取り組みの進展に注目しました。トラック大手のいすゞ自動車は、高いシェアを誇るタイでの業績回復に加え、中期経営計画で掲げた買収や提携戦略による収益拡大への期待が高まったことや、株主還元政策の向上に注目しました。

◆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。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数（TOPIX）の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。

参考指数の騰落率を上回った保険業や卸売業をオーバーウエートとしていたことなどがプラス要因となりました。一方、参考指数の騰落率を上回ったサービス業や精密機器をアンダーウエートとしていたことなどはマイナス要因となりました。

個別銘柄では、日立、富士フィルムホールディングス、AGCなどはプラスに寄与しましたが、第一工業製薬、TDK、アドバンテストなどがマイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

新型コロナウイルスのワクチン接種進展や経口治療薬の開発、新政権による経済対策への期待がある一方、グローバルでの生産やサプライチェーン（供給網）がボトルネックとなって、製造業の業績回復に不透明感が高まりつつあるため、株価は上下に振れやすい状況にあると考えます。

こうした投資環境を踏まえ、価格競争力のある製品・サービスを有し、サプライチェーンの混乱下でも原材料コストを価格転嫁できる素材関連企業やテクノロジー関連企業に注目します。また、2020年来的に厳しいコロナ禍にあって収益構造の改善に取り組み、今後の国内経済活動の正常化によって業績の回復が期待される内需関連企業や、脱炭素化への技術やサービスを有し、グリーンリカバリー政策（新型コロナウイルス感染拡大からの経済復興にあたり、環境に配慮した回復をめざす景気刺激策）に関わるビジネス展開力を持つ企業などに注目しています。個別銘柄の選別にあたりましては、変化する外部環境に対応して取り組んで来た構造改革の成果や企業の収益力の変化、株主還元政策に込められた経営陣のメッセージなどに注目することで、パフォーマンスの向上に努めてまいります。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	15円 (15)
有価証券取引税	—
その他費用	—
合 計	15

(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
株 式

(2021年 4月16日から2021年10月15日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株	千円	千株	千円
	1,177.6 (217.4)	2,501,664 (-)	1,661	3,235,590

(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。

■主要な売買銘柄
株 式

(2021年 4月16日から2021年10月15日まで)

当				期					
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
三菱商事		92.7	309,258	3,336	本田技研		91.1	304,929	3,347
いすゞ自動車		178.6	261,313	1,463	伊藤忠		71.3	232,123	3,255
しまむら		16.6	175,834	10,592	三井物産		77.7	187,214	2,409
伊藤忠		46.9	160,243	3,416	三井住友トラストHD		44.2	163,057	3,689
日本製鉄		72.3	155,634	2,152	ソフトバンク		110.8	156,334	1,410
大日本印刷		53.3	142,541	2,674	タクマ		58.9	108,679	1,845
アサヒグループホールディング		23.7	125,942	5,314	クボタ		46	107,888	2,345
ワコールホールディングス		48.5	121,409	2,503	日本電信電話		32	103,649	3,239
日本ユニシス		33.7	116,508	3,457	マブチモーター		22	97,805	4,445
オリックス		49.4	105,945	2,144	三菱UFJフィナンシャルG		149	86,877	583

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

■組入資産明細表

国内株式

銘柄	期首			銘柄	期首			銘柄	期首		
	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
鉱業 (ー)				日本冶金工	24.6	23.8	61,237	セイコーHD	40.2	38.9	94,799
INPEX	73.6	—	—	三菱製鋼	—	30.1	34,855	その他製品 (3.4%)			
建設業 (2.9%)				非鉄金属 (2.2%)				フジールインターナショナル	51.1	49.4	126,661
ミライト・ホールディングス	14.7	—	—	大紀アルミニウム	52.7	43.1	79,519	大日本印刷	66.6	119.9	338,837
オリエンタル白石	304.5	294.4	81,843	三井金属	38.6	37.3	124,768	リンテック	23.2	22.4	57,052
熊谷組	24.3	—	—	住友鉱山	8.3	—	—	任天堂	1.5	—	—
五洋建設	53.2	—	—	住友電工	94.5	91.4	143,406	陸運業 (1.9%)			
住友林業	22.6	22.6	49,313	アサヒHD	11.1	—	—	山九	—	18.7	99,297
大和ハウス	35	34.4	131,683	金属製品 (2.2%)				丸全昭和運輸	14.3	13.8	45,885
エクシオグループ	27.5	26.6	71,979	川田テクノロジーズ	13.1	12.7	50,228	センコーグループHLDGS	108	140.3	142,404
九電工	30.4	29.3	107,970	信和	46.2	—	—	倉庫・運輸関連業 (0.8%)			
食料品 (1.9%)				三和ホールディングス	94.7	91.6	131,720	三井倉庫HOLD	56.5	54.6	126,071
ブルボン	22.8	22.4	52,662	日東精工	80.1	77.4	50,155	情報・通信業 (6.6%)			
アサヒグループホールディン	—	23.7	125,941	マルゼン	32	30.9	69,679	日鉄ソリューションズ	24.1	12.6	47,250
太陽化学	22.6	22.3	38,958	ファインシンター	19.3	18.9	32,262	SRAホールディングス	7.7	7.5	21,532
日本たばこ産業	35.5	34.4	79,911	機械 (4.0%)				伊藤忠テクノソリューションズ	12.1	29.2	106,142
繊維製品 (2.0%)				タクマ	58.9	—	—	アルゴグラフィックス	28.9	31.1	100,608
富士紡ホールディングス	16.7	16.1	63,675	ソディック	67.4	84.4	72,752	日本ユニシス	16.9	48.9	152,079
帝国繊維	—	15.1	30,517	フリユー	43.7	56.9	96,047	日本電信電話	81.6	49.6	155,892
セーレン	42	40.6	90,659	サトーホールディングス	17.6	17	44,778	KDDI	113.6	108.6	405,403
ワコールホールディングス	3.8	51.3	119,169	技研製作所	20.8	6.5	29,250	ソフトバンク	110.8	—	—
化学 (13.0%)				コボタ	46	—	—	シーイーシー	28.4	27.5	36,905
旭化成	200.5	200.5	244,008	荏原実業	6.4	—	—	卸売業 (10.2%)			
共和レザー	66.6	64.4	44,114	三精テクノロジーズ	29.4	28.5	24,310	エレマテック	22.4	21.7	24,347
昭和電工	—	27.8	76,811	キトー	58.6	56.6	90,277	アルコニック	65	48.5	82,547
日本曹達	32	30.9	109,695	日本トムソン	73.1	—	—	あいホールディングス	23.3	14.5	31,508
大阪ソーダ	21.9	21.2	56,434	IHI	70.8	68.4	187,416	ダイワボウHD	66	96.5	190,684
信越化学	9.1	8.8	173,316	スター精密	41.7	52.5	80,167	レスターホールディングス	11.5	11.1	20,701
エア・ウォーター	58.6	74.3	129,727	電気機器 (12.2%)				TOKAIホールディングス	191	184.6	164,109
四国化成	46	45.2	62,376	日立	88.5	88.5	591,445	三洋貿易	146.4	103.1	116,399
三菱瓦斯化学	30.8	—	—	富士電機	58	57.1	286,642	コメダホールディングス	32.2	31.6	66,676
東京応化工業	11.3	10.9	75,319	マブチモーター	22	—	—	萩原電気HLDGS	17.9	17.3	37,575
旭有機材	57.3	46.9	65,378	愛知電機	19.6	—	—	ダイトロン	56	42.5	90,822
リケンテクノス	51.4	—	—	EIZO	13	6.8	29,206	伊藤忠	71.3	46.9	155,848
第一工業製薬	46.9	45.3	139,750	TDK	11.3	33.9	127,972	三井物産	77.7	—	—
太陽ホールディングス	11	—	—	アドバンテスト	28	23.8	216,580	スターゼン	21.2	20.8	44,595
富士フィルムHLDGS	43.2	43.2	398,692	村田製作所	17.7	17.7	155,494	三菱商事	—	92.7	342,619
デクセリアルズ	131	126.6	270,417	リコー	139.9	137.8	162,052	稲畑産業	42.2	40.8	69,156
藤森工業	10.4	10	47,250	東京エレクトロン	6.7	6.6	327,030	日鉄物産	28.9	28	143,080
信越ポリマー	127.9	123.7	123,823	輸送用機器 (7.3%)				小売業 (2.5%)			
医薬品 (2.1%)				豊田自動織機	13.6	13.2	127,908	パルグループHLDGS	67.3	67.3	110,304
武田薬品	107.9	99.1	320,291	デンソー	24.9	24	189,648	コジマ	79.6	77	45,122
ゴム製品 (0.6%)				いすゞ自動車	—	172.7	273,902	しまむら	—	16.3	156,806
TOYO TIRE	50	48.3	91,770	トヨタ自動車	51.2	243.5	485,417	丸井グループ	—	36.4	80,771
ガラス・土石製品 (3.5%)				プレス工業	—	116	39,092	銀行業 (5.0%)			
AGC	72.6	71.5	413,270	ミクニ	68.4	67.4	21,500	三菱UFJフィナンシャルG	652.1	609.2	400,305
ニチアス	52.5	50.7	133,239	本田技研	91.1	—	—	りそなホールディングス	147.1	—	—
鉄鋼 (1.5%)				精密機器 (0.6%)				三井住友トラストHD	44.2	—	—
日本製鉄	—	72.3	141,816	ナカニシ	15	—	—	三井住友フィナンシャルG	101.9	95.4	368,911

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	
証券、商品先物取引業 (0.7%)	千株	千株	千円	不動産業 (1.2%)	千株	千株	千円	ベルシステム24HLDGS	千株	千株	千円	
SBIホールディングス	52.5	35.6	106,657	ハウスドゥ	48.4	46.8	46,519	日本管財	65.7	72.1	112,043	
保険業 (5.2%)				東京建物	83.4	80.6	137,261		10.2	5.9	16,319	
MS & AD	54	52.2	194,653	サービス業 (2.9%)				合 計	株 数、金 額	7,267	7,001	15,534,419
第一生命HLDGS	114.1	78.9	192,752	日本工営	7.7	7.1	24,708		銘柄数<比率>	128銘柄	116銘柄	<97.1%>
東京海上HD	68.3	67.3	414,096	ディップ	33.1	32	134,560	(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。				
その他金融業 (3.8%)				日本空調サービス	77.2	74.6	59,680	(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。				
プレミアグループ	78.8	60.4	195,394	フルキャストホールディングス	—	38.7	101,858	(注3) 評価額の単位未満は切捨て。				
オリックス	132.4	181.8	399,687	テクノプロ・ホールディング	3.9	—	—					

■投資信託財産の構成

2021年10月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	15,534,419	97.0
コール・ローン等、その他	474,681	3.0
投資信託財産総額	16,009,101	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10月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	16,009,101,832円
コール・ローン等	222,736,598
株式(評価額)	15,534,419,920
未収入金	70,880,114
未収配当金	181,065,200
(B) 負債	9,015,000
未払解約金	9,015,000
(C) 純資産総額(A - B)	16,000,086,832
元本	4,652,755,009
次期繰越損益金	11,347,331,823
(D) 受益権総口数	4,652,755,009口
1万口当り基準価額(C / D)	34,388円

* 期首における元本額は4,902,036,062円、当作成期間中における追加設定元本額は236,145,692円、同解約元本額は485,426,745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、
ダイワ好配当日本株投信 (季節点描) 2,823,708,886円
ダイワ・バランス3資産 (外債・海外リート・好配当日本株) 23,531,017円
安定重視ポートフォリオ (奇数月分配型) 20,128,437円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型) 18,454,508円
成長重視ポートフォリオ (奇数月分配型) 334,670,705円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド 51,204,498円
ダイワ資産分散インカムオープン (奇数月決算型) 56,145,511円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース) 208,697,704円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース) 396,426,383円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース) 719,787,360円
です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は34,388円です。

■損益の状況

当期 自2021年4月16日 至2021年10月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	221,252,461円
受取配当金	221,287,350
受取利息	3
その他収益金	837
支払利息	△ 35,729
(B) 有価証券売買損益	599,477,956
売利益	1,272,635,802
売買損	△ 673,157,846
(C) 当期損益金(A + B)	820,730,417
(D) 前期繰越損益金	11,123,630,353
(E) 解約差損益金	△ 1,132,476,255
(F) 追加信託差損益金	535,447,308
(G) 合計(C + D + E + F)	11,347,331,823
次期繰越損益金(G)	11,347,331,823

(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。