

ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス
ダイワファンドラップ 日経225インデックス
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり）
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）
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）
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）
ダイワファンドラップ J-REITインデックス
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）

運用報告書（全体版）

第6期

（決算日 2022年6月15日）

（作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ」は、このたび、
第6期の決算を行ないました。

ここに、当作成期の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

◇SUZ0464120220615◇

<4641>
<4642>
<2731>
<2732>
<2730>
<4643>
<2734>
<2735>
<2733>
<4640>
<2736>
<2737>

ダイワファンドラップ TOP I Xインデックス

運用報告書(全体版)

第 6 期

(決算日 2022年 6 月15日)

(作成対象期間 2021年 6 月16日～2022年 6 月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数（TOP I X）の動きに連動させることをめざして運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<4641>

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年 9月26日）		
運用方針	投資成果を東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資 対 象	ベビーファンド	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			T O P I X		株 式 組入比率	株 式 先物比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2 期末(2018年 6 月15日)	13,726	0	14.7	1,789.04	12.7	98.7	1.2	8,562
3 期末(2019年 6 月17日)	12,045	0	△ 12.2	1,539.74	△ 13.9	98.5	1.5	8,839
4 期末(2020年 6 月15日)	12,246	0	1.7	1,530.78	△ 0.6	98.2	1.6	11,171
5 期末(2021年 6 月15日)	16,103	0	31.5	1,975.48	29.1	97.4	2.6	13,378
6 期末(2022年 6 月15日)	15,446	0	△ 4.1	1,855.93	△ 6.1	98.2	1.8	14,582

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

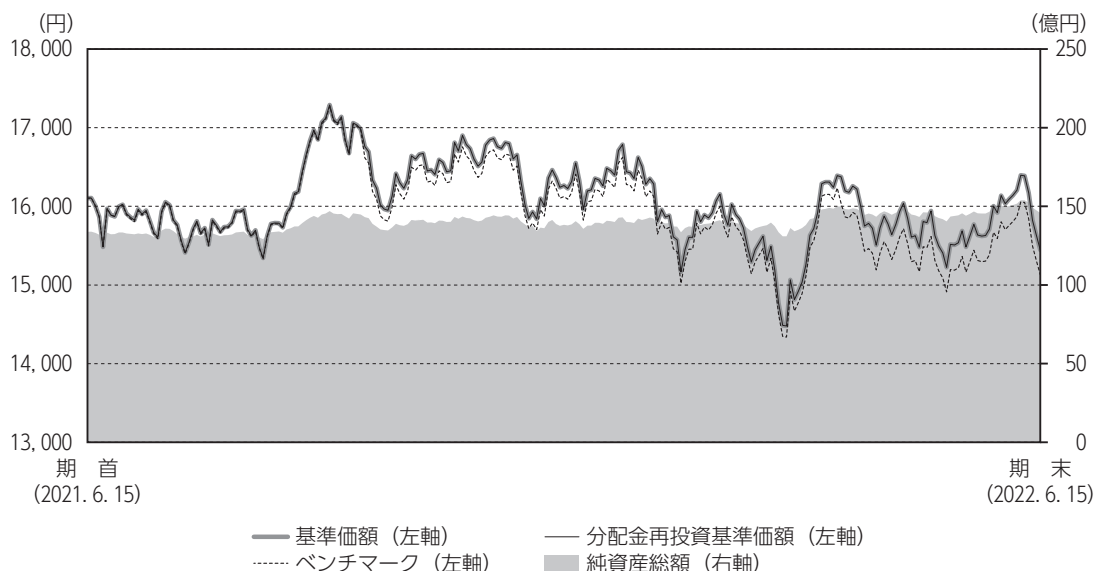
(注3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含まず。

(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

* ベンチマークはTOPIXです。

■基準価額・騰落率

期 首：16,103円

期 末：15,446円（分配金 0 円）

騰落率：△4.1%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の受益証券を通じて、わが国の株式に投資した結果、株式市況が下落したことを反映して、基準価額も下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組入比率	株 式 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2021年 6月15日	円 16,103	% —	1,975.48	% —	% 97.4	% 2.6
6 月末	15,859	△ 1.5	1,943.57	△ 1.6	98.0	2.0
7 月末	15,511	△ 3.7	1,901.08	△ 3.8	97.0	3.0
8 月末	15,996	△ 0.7	1,960.70	△ 0.7	98.3	1.6
9 月末	16,693	3.7	2,030.16	2.8	98.1	1.8
10月末	16,452	2.2	2,001.18	1.3	97.5	2.5
11月末	15,847	△ 1.6	1,928.35	△ 2.4	97.2	3.0
12月末	16,398	1.8	1,992.33	0.9	98.2	1.8
2022年 1 月末	15,607	△ 3.1	1,895.93	△ 4.0	97.7	2.4
2 月末	15,536	△ 3.5	1,886.93	△ 4.5	97.5	2.7
3 月末	16,196	0.6	1,946.40	△ 1.5	97.3	2.6
4 月末	15,805	△ 1.9	1,899.62	△ 3.8	96.8	3.3
5 月末	15,919	△ 1.1	1,912.67	△ 3.2	96.0	4.0
(期末)2022年 6月15日	15,446	△ 4.1	1,855.93	△ 6.1	98.2	1.8

(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. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大による行動制限措置の適用が続いたことや、内閣支持率の低下を受けて政局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。しかし、2021年 8 月下旬からは感染状況の改善により株価が上昇すると、9 月初めには菅首相の自民党総裁選挙への不出馬表明などが好感されて急騰しました。その後は新政権への期待の後退や中国の大手不動産会社の信用不安などで株価は反落しましたが、衆議院議員選挙で自民党が過半数を大きく上回ったことなどが好感されて11月中旬にかけて底堅く推移しました。年末にかけては、新型コロナウイルスの新変異株への警戒感から再び上値の重い展開になり、2022年に入ると、F R B（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め懸念による金利上昇を受けて世界的に株価は下落しました。さらに 2 月下旬からは、ロシアによるウクライナ侵攻という地政学リスクの顕在化を受け、株価下落が加速しました。3 月後半は、F R B の利上げ決定で悪材料出尽くし観測が強まったことや為替市場で円安が進行したことなどから、株価は一時的に反発しましたが、その後は F R B の利上げペースが一層加速するとの懸念などから、当作成期末にかけて株価は下落しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

当作成期中、資金変動への対応、新規上場等によるベンチマーク構成の変化に対応するため、随時、株式の売買を行いました。

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

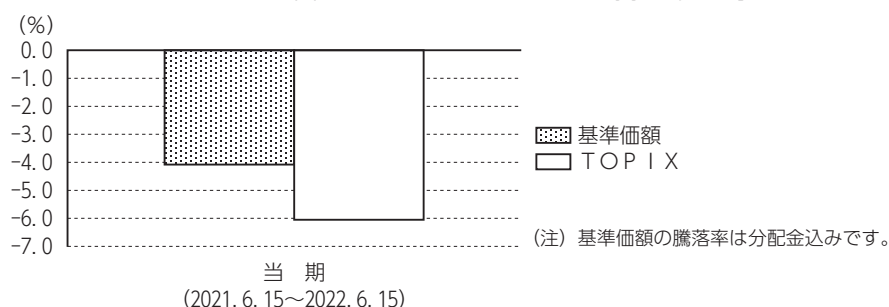
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△6.1%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△4.1%となりました。

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

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークはT O P I Xです。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	5,446

- （注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
 （注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
 （注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	55円	0. 341%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は16, 040円です。
(投 信 会 社)	(34)	(0. 209)	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)	(18)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(4)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0. 004	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)	(1)	(0. 003)	
(先物・オプション)	(0)	(0. 001)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	56	0. 351	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

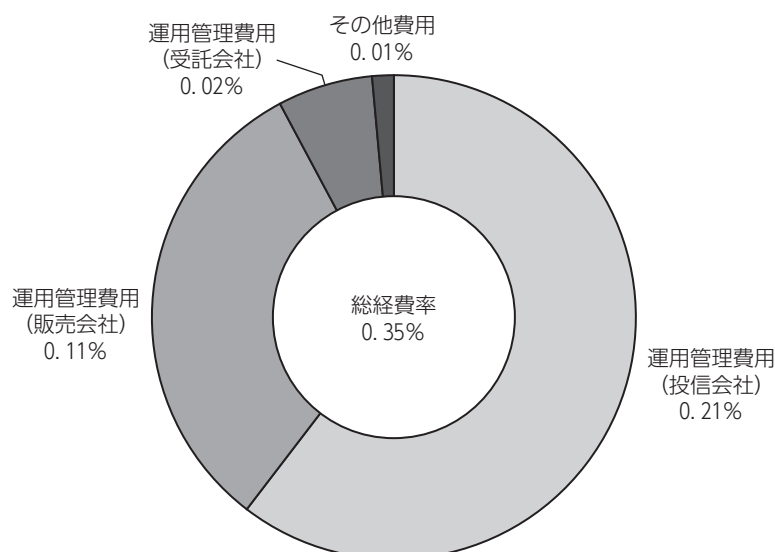
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.35%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6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	2, 676, 911	3, 554, 000	1, 347, 545	1, 791, 900

(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6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	33, 978, 631千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	180, 818, 819千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0. 18

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2021年6月16日から2022年6月15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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	25, 021	7, 696	30. 8	8, 957	25	0. 3
株式先物取引	37, 760	11, 043	29. 2	38, 793	10, 311	26. 6
コール・ローン	2, 560, 168	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合7. 5%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

種 類	当 期		
	トピックス・インデックス・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	33	2	345

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

種 類	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
	買 付 額
	百万円
株式	75

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	610千円
うち利害関係人への支払額 (B)	46千円
(B) / (A)	7. 5%

(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、当作成期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社、株式会社大和証券グループ本社、株式会社マネーパートナーズグループ、サムティ株式会社です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	10, 040, 729	11, 370, 096	14, 581, 011

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	14, 581, 011	99. 8
コール・ローン等、その他	28, 597	0. 2
投資信託財産総額	14, 609, 608	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

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	14, 609, 608, 778円
コール・ローン等	28, 597, 197
トピックス・インデックス・マザーファンド (評価額)	14, 581, 011, 581
(B) 負債	27, 546, 656
未払解約金	2, 915, 623
未払信託報酬	24, 240, 159
その他未払費用	390, 874
(C) 純資産総額 (A - B)	14, 582, 062, 122
元本	9, 440, 492, 072
次期繰越損益金	5, 141, 570, 050
(D) 受益権総口数	9, 440, 492, 072口
1万口当り基準価額 (C / D)	15, 446円

* 期首における元本額は8, 307, 899, 565円、当作成期間中における追加設定元本額は2, 926, 939, 275円、同解約元本額は1, 794, 346, 768円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は15, 446円です。

■損益の状況

当期 自 2021年 6月16日 至 2022年 6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 4,534円
受取利息	475
支払利息	△ 5,009
(B) 有価証券売買損益	△ 551,563,327
売買益	53,891,059
売買損	△ 605,454,386
(C) 信託報酬等	△ 48,475,840
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 600,043,701
(E) 前期繰越損益金	2,093,539,027
(F) 追加信託差損益金	3,648,074,724
(配当等相当額)	(2,075,440,097)
(売買損益相当額)	(1,572,634,627)
(G) 合計 (D + E + F)	5,141,570,050
次期繰越損益金 (G)	5,141,570,050
追加信託差損益金	3,648,074,724
(配当等相当額)	(2,075,440,097)
(売買損益相当額)	(1,572,634,627)
分配準備積立金	2,093,542,475
繰越損益金	△ 600,047,149

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

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

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

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	3,048,035,557
(d) 分配準備積立金	2,093,542,475
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	5,141,578,032
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	5,141,578,032
(h) 受益権総口数	9,440,492,072口

東証株価指数(TOPIX)の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」といいます。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

《お知らせ》

■マザーファンドにおける主要投資対象について

当ファンドの主要投資対象である「トピックス・インデックス・マザーファンド」において、東京証券取引所の市場改革を見据え、主要投資対象を以下の通り変更しました。

変更前：東京証券取引所第一部上場株式

変更後：東京証券取引所上場株式

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ TOP I Xインデックス）が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（2021年9月21日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

トピックス・インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

(2021年6月16日から2022年6月15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
ソフトバンク	526.3	806,304	1,532	ソフトバンクグループ	126.8	774,874	6,111
ソニーグループ	58.6	696,146	11,879	キーエンス	4.9	319,597	65,224
トヨタ自動車	249.4	668,951	2,682	日本電信電話	85.1	265,837	3,123
リクルートホールディングス	82.4	518,902	6,297	三菱UFJフィナンシャルG	398.6	252,598	633
三菱商事	138.2	501,089	3,625	トヨタ自動車	105.6	226,485	2,144
東京エレクトロン	9.1	498,988	54,833	信越化学	10	200,798	20,079
日本電信電話	138.6	493,471	3,560	KDDI	46.8	168,246	3,595
キーエンス	8.4	477,566	56,853	東京海上HD	17.6	124,273	7,060
日本郵政	424.3	379,922	895	新生銀行	54.7	108,089	1,976
日本電産	28.8	338,298	11,746	ダイキン工業	5.3	107,355	20,255

(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6月15日現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンド（144,235,597千円）の内容です。

(1)国内株式

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			大木建設	2.4	3,691	トーエネック	2.3	7,394	亀田製菓	4	17,940
極洋	3.4	11,203	鉄建建設	4.6	8,280	住友電設	5.7	14,147	寿スピリッツ	6.7	47,704
日本水産	96.4	51,188	西松建設	14.2	59,853	日本電設工業	10.9	17,276	カルビー	34	81,294
マルハニチロ	14.2	32,944	三井住友建設	52.5	23,835	エクシオグループ	33.6	70,257	森永乳業	13	56,355
雪国まいたけ	7.4	6,393	大豊建設	3.4	15,113	新日本空調	5.4	9,828	六甲バター	5.2	7,228
カネコ種苗	2.9	4,721	佐田建設	4.7	2,100	九電工	15.9	42,421	ヤクルト	50.1	368,736
サカタのタネ	11.3	51,584	ナカノフード建設	5.1	1,530	三機工業	15.2	22,404	明治ホールディングス	43.5	270,135
ホクト	7.9	15,010	奥村組	12.2	35,538	日揮ホールディングス	68.1	127,551	雪印メグミルク	16.8	28,308
ホクリョウ	1.5	951	東鉄工業	9.8	22,236	中外炉工業	2.1	3,559	プリマハム	9.4	19,740
鉱業 (0.4%)			イチゲン	1.6	2,902	ヤマト	5.7	4,235	日本ハム	27	108,810
住石ホールディングス	17.5	3,255	富士ビー・エス	2.7	1,255	太平電業	4.5	12,244	林兼産業	2.7	1,312
日鉄鉱業	2.1	11,655	浅沼組	2.6	13,728	高砂熱学	19	30,305	丸大食品	7	10,367
三井松島 HLDGS	4.2	11,424	戸田建設	92.2	65,001	三晃金属	0.8	2,056	S Foods	6.7	20,167
INPEX	363.9	604,801	熊谷組	11.6	31,262	朝日工業社	3	4,725	柿安本店	2.4	5,632
石油資源開発	11.9	41,055	北野建設	1.4	2,871	明星工業	12.4	9,039	伊藤ハム米久 HLDGS	47.9	31,709
K&Q エナジーグループ	4.2	6,552	植木組	1.8	2,604	太氣社	10.3	31,672	サッポロホールディングス	23.1	63,848
建設業 (2.2%)			矢作建設	9.4	7,050	ダイダ	4.7	9,635	アサヒグループホールディングス	160.4	677,369
ショーボンドHD	12.7	77,216	ピーエス三菱	7.5	4,447	日比谷総合設備	6.6	12,447	キリンHD	275	559,075
ミライト・ホールディングス	32.7	52,908	日本ハウス HLDGS	15.7	6,123	フィル・カンパニー	1.3	1,450	宝ホールディングス	44.7	42,465
タマホーム	6.2	14,687	大東建託	24	264,480	テスホールディングス	6.5	7,774	オエノホールディングス	20.8	6,052
サンヨーホームズ	0.8	578	新日本建設	9.7	6,984	インフロンIAHD	90.7	82,537	養命酒	2.3	3,979
日本アーク	4.1	2,439	東亜道路	1.2	6,480	東洋エンジニア	9.8	6,076	コカ・コーラボトラーズHD	49.2	70,011
ファーストコーポレーション	2.1	1,518	日本道路	2	13,000	レイズネクスト	10.4	11,648	サントリー食品インター	50	233,000
ベステラ	2	2,556	東亜建設	5.4	12,873	食料品 (3.3%)			ダイドーグループHD	3.8	18,506
キャンディル	1	530	日本国土開発	19.4	9,874	ニッパン	19.4	30,244	伊藤園	22.7	117,132
ダイセキ環境ソリューション	1.9	1,767	若築建設	3.6	7,671	日清製粉G本社	75.1	112,574	キーコーヒー	6.9	14,200
第一カッター興業	2.3	2,973	東洋建設	24.2	19,239	日東富士製粉	1.2	5,058	ユニカフェ	2.4	2,176
安藤・間	47.6	39,127	五洋建設	88.6	55,818	昭和産業	6.4	15,443	ジャパンフーズ	1.1	1,284
東急建設	27.9	17,074	世紀東急	11.1	8,868	鳥越製粉	6.1	3,843	日清オイログループ	8.8	26,215
コムシスホールディングス	32.7	80,343	福田組	2.5	11,050	中部飼料	8.1	8,010	不二製油グループ	16.1	30,058
ビーアールホールディングス	12.8	3,942	住友林業	54.2	105,961	フィード・ワン	9.4	6,110	かどや製油	0.8	2,760
高松コンストラクショング	6.1	12,486	日本基礎技術	5.8	3,300	東洋精糖	1.5	1,425	J-オイルミルズ	7.2	10,821
東建コーポレーション	2.8	21,420	巴コーポレーション	8.7	3,497	日本甜菜糖	4	6,544	キッコーマン	47.9	318,535
ソネック	1	1,016	大和ハウス	195.5	594,515	DM三井製糖ホールディングス	6.3	11,718	味の素	153.3	466,645
ヤマウラ	4.1	3,763	ライト工業	13.3	23,793	塩水港精糖	9.3	1,934	ブルドックソース	2.8	5,056
オリエンタル白石	33.6	8,030	積水ハウス	232.7	542,889	日新製糖	3.8	6,551	キューピー	34.8	74,576
大成建設	63.5	254,000	日特建設	4.6	3,592	森永製菓	15.8	60,593	ハウス食品G本社	24.8	67,034
大林組	223	212,073	北陸電気工事	4.2	3,120	中村屋	1.6	4,880	カゴメ	28.3	91,267
清水建設	207.1	148,283	ユアテック	13.2	9,266	江崎グリコ	18.4	65,596	焼津水産化工	3.4	3,066
飛島建設	5.9	5,894	日本リーテック	4.5	4,639	名糖産業	3	4,824	アリアケジャパン	6.8	35,360
長谷工コーポレーション	65.2	101,646	四電工	2.2	3,700	井村屋グループ	3.9	8,595	ビエトロ	1.1	1,983
松井建設	8.1	5,386	中電工	9.8	20,354	不二家	4.4	9,966	エバラ食品工業	1.7	5,015
銭高組	0.9	2,988	関電工	38	30,970	山崎製パン	49.2	72,914	やまみ	0.7	1,083
鹿島建設	163.3	234,825	きんでん	49.2	74,095	第一屋製パン	1.6	808	ニチレイ	30	66,450
不動テトラ	5	7,780	東京エネシス	7.1	6,766	モロゾフ	2.3	7,785	東洋水産	34.2	165,015

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
イトアンドHLDGS	2.8	6,249	片倉コープアグリ	1.8	2,547	ライオン	79	110,126	ベプチドリーム	39.2	51,665
大冷	0.9	1,706	日本曹達	8.4	36,666	高砂香料	4.5	10,651	あすか製薬HD	7.5	7,237
ヨシムラ・フード・HLDGS	3.9	1,992	東ソー	95.3	170,301	マンダム	14.8	21,193	サワイグループHD	14.9	56,918
日清食品HD	25.7	216,651	トクヤマ	22.3	40,429	ミルボン	9.2	45,356	石油・石炭製品 (0.6%)		
永谷園ホールディングス	3.4	6,630	セントラル硝子	11.2	33,992	ファンケル	30.2	66,832	日本コークス工業	62.7	7,837
一正蒲鉾	3.1	2,480	東亜合成	36.7	37,837	コーセー	14	159,600	ニチレキ	8.5	11,075
フジッコ	7.1	13,575	大阪ソーダ	5.9	18,526	コタ	5.3	7,600	ユシロ化学	3.5	3,377
ロックフィールド	7.6	10,381	関東電化	14.1	12,929	シーボン	1	1,682	ビービー・カストロール	2.6	3,094
日本たばこ産業	401.2	954,856	デンカ	25.3	83,996	ポーラ・オルビスHD	31.8	48,081	富士石油	17.4	5,689
ケンコーマヨネーズ	4	5,584	信越化学	118.9	2,056,970	ノビアホールディングス	5.7	31,236	MORESCO	2.6	3,190
わらべや日洋HD	4.6	7,820	日本カーバイド	2.5	3,495	アジュパンホールディング	1.8	1,717	出光興産	78.2	277,610
なとり	4.4	8,637	堺化学	4.9	9,427	新日本製薬	3	4,044	ENEOSホールディングス	1,122	604,421
イフジ産業	1.5	1,434	第一稀元素化学工	6.4	7,142	エステー	4.9	7,105	コスモエネルギーHLDGS	26.8	101,572
ビックルコーポレーション	3.6	4,672	エア・ウォーター	61.9	105,044	アグロカネショウ	2.5	3,097	ゴム製品 (0.7%)		
ファーマフーズ	9.4	13,940	日本酸素HLDGS	63.4	153,745	コニシ	12.2	18,641	横浜ゴム	37.9	65,263
ユーグレナ	38.3	32,861	日本化学工業	2.1	4,391	長谷川香料	12.7	30,543	TOYO TIRE	36.8	62,928
紀文食品	5.8	5,394	東邦アセチレン	1.6	1,836	星光PMC	4.4	2,446	ブリヂストン	203.8	1,032,247
ミヨシ油脂	2.8	2,900	日本パーカライジング	32.6	29,177	小林製薬	20.9	166,573	住友ゴム	62.9	74,851
理研ビタミン	6.7	10,653	高圧ガス	11	7,128	荒川化学工業	5.6	5,577	藤倉コンポジット	6.5	5,505
繊維製品 (0.5%)			チタン工業	0.9	1,521	メック	5.2	12,838	オカモト	4.3	16,318
片倉工業	7	14,413	四国化成	8.7	10,779	日本高純度化学	1.9	4,377	フコク	2.9	2,746
グンゼ	4.5	16,357	戸田工業	1.5	3,825	タカラバイオ	19.5	36,016	ニッタ	8	22,760
東洋紡	29.6	30,192	ステラケミファ	3.6	9,068	JCU	7.8	26,481	住友理工	16.2	9,282
ユニチカ	21.2	4,876	保土谷化学	2.1	8,085	新田ゼラチン	4.3	2,588	三ツ星ベルト	9.2	25,668
富士紡ホールディングス	3.1	10,292	日本触媒	10.9	58,097	OA T アグリオ	3	5,004	バンドー化学	13.9	12,690
倉敷紡績	5.7	11,331	大日精化	5.4	9,736	デクセリアルズ	19.4	78,667	ガラス・土石製品 (0.8%)		
シキボウ	3.3	2,910	カネカ	16.7	56,696	アース製薬	6.1	30,439	日東紡績	9.8	23,941
日本毛織	19.3	18,277	三菱瓦斯化学	60.9	127,707	北興化学	6.5	6,688	AGC	65	326,950
ダイトウボウ	10	900	三井化学	60	189,000	大成ラミック	2	5,218	日本板硝子	34.5	13,351
トーア紡コーポレーション	2.1	781	J S R	68	250,240	クミアイ化学	27.5	31,570	石塚硝子	1.4	2,312
ダイドーリミテッド	7.7	1,039	東京応化工業	11.2	78,288	日本農薬	13.2	9,688	日本山村硝子	1.9	1,320
帝国繊維	7.7	11,873	大阪有機化学	5.5	13,090	アキレス	5.2	6,983	日本電気硝子	28.4	78,582
帝人	65.9	91,205	三菱ケミカルHLDGS	464.6	372,516	有沢製作所	10.2	11,056	オハラ	2.9	3,445
東レ	477.7	336,396	K H ネオケム	11.4	28,967	日東電工	44.9	422,060	住友大阪セメント	12.6	45,171
住江織物	1.2	1,981	ダイセル	99.2	87,395	レック	9.1	6,124	太平洋セメント	42.4	87,301
日本フエルト	4.4	1,826	住友ベークライト	10.7	48,471	三光合成	9.8	3,273	日本ヒューム	6	3,966
イチカワ	0.7	964	積水化学	145.4	265,936	きもと	10.9	2,430	日本コンクリート	13.3	3,737
日東製網	0.7	929	日本ゼオン	58	79,634	藤森工業	6.1	21,350	三谷セキサン	3.2	13,840
アツギ	5.1	2,529	アイカ工業	18.2	50,960	前澤化成工業	4.3	5,538	アジアパイルHD	9.8	4,380
ダイニツク	2.3	1,522	UBE	34.4	71,827	未来工業	2.7	3,998	東海カーボン	59.1	68,733
セーレン	14	26,698	積水樹脂	10.3	17,252	ウェーブロックHLDGS	3.1	2,011	日本カーボン	3.8	16,093
ソトー	2.5	2,082	タキロンシーアイ	17.2	9,150	ジェイ エス ピー	4.2	5,871	東洋炭素	4.9	13,249
東海染工	0.5	571	旭有機材	4.5	9,468	エフビコ	13.6	35,400	ノリタケ	3.9	16,146
小松マテレ	11.2	14,100	ニチバン	4.1	6,564	天馬	6.3	14,779	TOTO	47.9	204,293
ワコールホールディングス	16.2	33,906	リケンテクノス	16.1	6,858	信越ポリマー	13.2	14,902	日本碍子	76	143,944
ホギメディカル	9.4	26,752	大倉工業	3.2	5,488	東リ	16.5	3,399	日本特殊陶業	53.5	137,548
クラウディアHLDGS	1.6	380	積水化成成品	14.7	5,982	ニフコ	24.7	76,199	ダントホールディングス	4.8	1,238
T S Iホールディングス	22.9	8,015	群栄化学	1.6	4,179	バルカー	6.7	18,317	MA RUWA	2.6	38,740
マツオカコーポレーション	2	1,948	タイガース ポリマー	7.5	3,225	ユニ・チャーム	143.7	600,809	品川リフラクトリーズ	1.7	5,992
ワールド	9.5	12,027	ミライアル	2.3	4,218	ショーエイコーポ	2.7	1,544	黒崎播磨	1.2	5,070
三陽商会	3.2	2,700	ダイキアクシス	2.7	1,979	医薬品 (5.1%)			ヨータイ	4.6	6,380
ナイガイ	2.3	664	ダイキョーニシカワ	17.3	8,598	協和キリン	79.2	223,502	東京薬業	6.7	1,822
オンワードホールディングス	41.4	10,225	竹本容器	2.5	1,995	武田薬品	585.9	2,071,156	ニッカトー	2.8	1,327
ルックホールディングス	2.3	3,514	森六ホールディングス	3.6	6,386	アステラス製薬	637.3	1,271,413	フジマイコーポレート	6	33,960
ゴールドウイン	12.4	96,596	恵和	2	8,010	住友ファーマ	46.1	48,036	クニミネ工業	2	1,826
デサント	13.1	36,287	日本化薬	52.4	58,321	塩野義製薬	88.9	577,227	エーアンドエマテリアル	0.5	431
キング	3.3	1,768	カリットホールディングス	6.2	4,395	わかもと製薬	7.7	1,963	ニチアス	16.3	37,424
ヤマトインターナショナル	5.2	1,461	日本精化	5.1	10,200	日本新薬	17.3	125,252	ニチハ	9.8	24,421
パルプ・紙 (0.2%)			扶桑化学工業	6	21,720	中外製薬	233.2	788,216	鉄鋼 (0.8%)		
特種東海製紙	4	12,320	トリケミカル	7.5	18,262	科研製薬	10.9	40,493	日本製鉄	315.4	635,531
王子ホールディングス	289.8	163,157	A D E K A	30.4	76,273	エーザイ	84.7	430,614	神戸製鋼所	131.7	86,658
日本製紙	31.6	29,893	日油	22.3	111,054	ロート製薬	36.4	125,944	中山製鋼所	10.4	4,357
三菱製紙	8.1	2,405	新日本理化学	10.9	2,703	小野薬品	151.7	490,597	合同製鐵	3.6	4,719
北越コーポレーション	44.9	30,487	ハリマ化成グループ	5	3,775	久光製薬	17.1	56,686	J F Eホールディングス	180.3	272,613
中越パルプ	2.4	2,150	花王	157.6	803,760	持田製薬	8.6	26,359	東京製鐵	22.7	34,708
巴川製紙	2.7	1,638	第一工業製薬	2.6	5,525	参天製薬	133	130,074	共英製鋼	7.5	9,757
大王製紙	32.5	44,720	石原ケミカル	3.6	4,672	扶桑薬品	2.5	5,307	大和工業	12.5	55,125
阿波製紙	1	308	日華化学	2.5	2,170	日本ケミファ	0.9	1,700	東京製鐵	2.9	3,509
レンゴー	61	43,310	ニイタカ	1.4	2,968	ツムラ	21.9	62,020	大阪製鐵	3.8	5,399
トーモク	3.8	5,692	三洋化成	4.3	20,124	日医工	21.8	7,651	淀川製鋼所	8.6	18,997
ザ・パック	5	10,745	有機合成薬品	5.2	1,409	キッセイ薬品工業	11.5	27,600	丸一鋼管	22	63,800
化学 (6.4%)			大日本塗料	8.4	6,174	生化学工業	13	10,270	モリ工業	1.9	4,582
北の達人コーポ	26.7	5,340	日本ペイントHOLD	274.3	251,807	栄研化学	11.7	18,989	大同特殊鋼	10.6	37,259
クラレ	101.1	113,434	関西ペイント	67.3	118,919	日水製薬	2.9	4,959	日本高周波	2	676
旭化成	462.5	488,862	神東塗料	6.8	1,033	鳥居薬品	11	4,416	日本冶金工	5.1	10,883
共和レザー	3.6	2,070	中国塗料	16.2	13,818	J C R ファーマ	21	47,418	山陽特殊製鋼	6.7	13,400
昭和電工	63.9	164,670	日本特殊塗料	4.6	4,443	東和薬品	10.7	23,968	愛知製鋼	4.1	8,355
住友化学	510.8	283,494	藤倉化成	8.7	4,123	富士製薬工業	4.3	3,999	日立金属	71.5	142,285
住友精化	3	8,856	太陽ホールディングス	10.6	31,291	ゼリア新薬工業	11.8	24,319	日本金属	1.8	1,987
日産化学	35.3	236,863	D I C	27.8	69,639	第一三共	555.8	1,712,419	新太平洋金属	4.5	11,871
ラサ工業	2.6	5,023	サカタインクス	14.3	12,769	キョーリン製薬HD	13.9	23,296	新日本電工	42.9	15,315
クレハ	5.4	56,646	東洋インキSCホールディン	14.2	27,590	大幸薬品	11.2	6,384	栗本鉄工所	2.9	4,689
多木化学	2.5	11,325	T & K T O K A	5.9	4,702	ダイト	4.7	12,596	虹技	0.7	679
ティカ	4.6	5,570	富士フィルムHLDGS	131	906,389	大塚ホールディングス	146.3	630,699	日本鋼鉄管	0.8	800
石原産業	12.6	13,973	資生堂	138.9	707,139	大正製薬HD	15.1	73,914	三菱製鋼	4.7	4,469

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
日亜鋼業	7.6	1,945	牧野フライズ	7.7	34,226	油研工業	1.6	2,795	不二電機工業	0.7	781
日本精線	1.2	4,998	オーエスジー	32.7	52,516	タダノ	36.9	35,313	ジーエス・ユアサコーポ	23.1	48,810
エンビプロHD	4.9	4,223	ダイジェット	1.3	1,193	フジテック	24.2	65,001	サクサホールディングス	1.7	2,352
シンメッタン	14.8	3,285	旭ダイヤモンド	19.3	11,560	C K D	20	36,280	メルコホールディングス	1.9	6,403
新家工業	1.5	2,190	DMG 森精機	41.4	76,258	キトー	5.8	15,167	テクノメディア	2	3,050
非鉄金属 (0.8%)			ソディック	17.1	13,816	平和	20.7	39,640	ダイヤモンドエレクトロニクスHD	2.1	2,543
大紀アルミニウム	9.8	12,083	デスコ	10.9	347,165	理想科学工業	6	13,380	日本電気	90.6	462,966
日本軽金属HD	18.7	28,536	日東工器	4.6	6,895	SANKYO	16.1	66,010	富士通	67.1	1,147,410
三井金属	19.9	65,073	日進工具	6.1	7,576	日本金銭機械	7.4	4,861	沖電気	28.9	22,888
東邦亜鉛	3.9	8,927	パンチ工業	6.9	3,180	マースグループHLDGS	4.7	7,971	岩崎通信機	3.2	2,601
三菱マテリアル	44.7	88,371	富士ダイス	5.3	3,439	フクシマガリレイ	4.8	15,576	電気興業	3.9	9,726
住友鉱山	85.3	417,372	豊和工業	4.7	4,582	オーイズミ	2.8	1,136	サンケン電気	6.6	32,637
DOWAホールディングス	18.2	82,901	OKK	2.8	2,844	ダイコク電機	3.4	4,069	ナカヨ	1.4	1,517
古河機金	11.1	13,519	石川製作所	2.2	3,828	竹内製作所	11.4	27,485	アイホン	3.6	6,138
エス・サイエンス	33.3	932	東洋機械金属	5.5	3,168	アマノ	19.5	47,385	ルネサスエレクトロニクス	405.2	542,968
大阪チタニウム	8.5	21,335	津田駒工業	2	1,118	JUKI	10.4	7,332	セイコーエプソン	86.3	187,098
東邦チタニウム	13.2	32,604	エンシュウ	2	1,728	サンデン	10	2,190	ワコム	57.9	48,462
UACJ	10.5	22,407	島精機製作所	10.8	22,507	ジャノメ	6.1	4,196	アルパック	14.7	74,235
CKサンエツ	1.4	5,425	オプトラン	9.2	18,078	マックス	9.8	15,670	アクセル	2.8	2,282
古河電工	22	49,104	NCホールディングス	2	3,736	グローリー	18.1	36,743	EIZO	5.4	20,493
住友電工	263.3	382,706	イウキポンプ	5.2	4,778	新晃工業	6.9	11,122	ジャパンディスプレイ	61.7	3,948
フジクラ	82.3	66,251	フレュー	6.6	7,015	大和冷機工業	10.6	10,939	日本信号	16.6	15,006
昭和電線 HLDGS	6.4	10,937	ヤマシンフィルタ	13.9	4,378	セガミホールディングス	73.9	159,697	京三製作所	14.4	6,076
東京特殊電線	0.9	2,070	日阪製作所	10	8,450	日本ビストロンリング	2.4	3,084	能美防災	8.9	14,969
タツタ電線	12.7	6,019	やまびこ	12.9	15,131	リケン	2.8	6,524	ホーチキ	4.6	5,699
カナレ電気	1.1	1,772	野村マイクロ・サイエンス	2.5	9,500	TPR	8.8	10,824	星和電機	3.2	1,494
平河ヒューテック	3.8	4,107	平田機工	3.3	13,530	ツバキ・ナカシマ	16.4	15,826	エレコム	17	25,789
リョービ	7.7	8,162	ペガサスミシン製造	7.8	4,594	ホシザキ	21.8	168,296	パナソニックホールディング	795.2	879,093
アールステイ	7.4	2,708	マルマエ	3	5,685	大豊工業	5.8	4,048	シャープ	75.6	77,565
アサヒHD	29.5	59,914	タツモ	3.3	3,857	日本精工	130.5	99,571	アンリツ	47.6	69,876
金属製品 (0.6%)			ナプテスコ	39.7	123,864	NTN	146.7	41,076	富士通ゼネラル	20.2	48,379
稲葉製作所	3.8	5,126	三井海洋開発	7.8	9,438	ジェイテクト	66.3	70,145	ソニーグループ	467.5	190,705
宮地エンジニアリングG	2.1	6,919	レオン自動機	8	9,744	不二越	5.9	21,476	TDK	108	473,580
トーカロ	19.3	24,530	SMC	51.7	1,317,841	日本トムソン	19.3	10,151	帝国通信工業	3.2	4,272
アルファCO	2.3	2,194	ホソカワミクロン	2.2	13,462	THK	41.6	110,406	タムラ製作所	27.4	15,316
SUMCO	118.9	240,296	ユニオンツール	3	10,575	ユースン精機	7.3	5,037	アルプスアルパイン	62.6	91,208
川田テクノロジーズ	1.3	4,550	オイレス工業	11.3	17,390	前澤給装工業	5	4,350	池上通信機	2.4	1,428
RS TECHNOLOGIES	2.4	14,424	日精エーエスピー	2.8	9,492	イーグル工業	8.3	7,976	日本電波工業	7.4	8,317
ジェイテックコーポレーション	1	1,967	サトーホールディングス	9.7	18,439	前澤工業	4.9	2,905	鈴木	3.4	2,726
信和	4.5	3,510	技研製作所	6.5	20,540	日本ビラー工業	6.9	18,885	メイコー	8.1	31,387
東洋製罐グループHD	40.7	55,677	日本エアーテック	3.7	3,718	キッツ	24.9	16,832	日本トリム	1.4	3,409
ホッカンホールディングス	5	6,040	カワタ	2.6	2,633	マキタ	85.7	297,121	ローランドディー・ジー	4.3	14,147
コロナ	3.6	2,952	日精樹脂工業	5.4	4,822	三井E&SHD	21.7	7,768	フオスター電機	6.8	5,032
横河ブリッジHLDGS	11.3	22,204	オカダアイヨン	2.2	3,216	SMK	59.9	50,855	SMK	1.5	3,136
駒井ハルテック	1.2	2,024	ワイエイシホールディングス	2.9	4,787	三菱重工業	111.9	584,677	ヨコオ	5.1	11,148
高田機工	0.5	1,238	小松製作所	337.7	1,115,085	IHI	46.4	181,888	ティアック	10.9	1,286
三和ホールディングス	69.7	86,985	住友重機械	40.1	126,315	サノヤホールディングス	6	762	ホシデン	16.9	20,651
文化シャッター	22.1	21,459	日立建機	29.9	99,118	スター精密	10.7	18,318	ヒロセ電機	10.9	192,385
三協立山	9.5	5,500	日工	8.7	5,237	電気機器 (17.7%)			日本航空電子	15.6	33,056
アルインコ	4.7	3,952	巴工業	3.2	7,264	日清紡ホールディングス	42.6	45,326	TOA	7.6	5,776
東洋シャッター	1.6	993	井関農機	6.1	7,423	イビデン	37	151,885	マクセル	13.9	18,250
LIXIL	116.1	294,081	TOWA	6.4	11,289	コニカミノルタ	155	71,300	古野電気	8.8	9,090
日本フィルコン	7.1	3,514	丸山製作所	1.3	1,990	ブラザー工業	86.3	205,221	ユニデンホールディングス	1.6	6,160
ノーリツ	12.6	18,547	北川鉄工所	2.9	4,210	ミネベアミツミ	121.9	282,076	スミダコーポレーション	6.9	5,582
長府製作所	7.3	12,702	ローツェ	3.7	34,817	日立	358.6	2,393,655	アイコム	2.5	6,047
リンナイ	13.2	118,536	タカキタ	2.3	1,225	東芝	130.3	713,392	リオン	2.7	6,752
ダイニチ工業	3.5	2,170	クボタ	361.2	797,710	三菱電機	712.6	1,001,559	本多通信工業	5	2,615
日東精工	9.8	4,733	荏原実業	3.4	7,731	富士電機	42.7	246,806	横河電機	70.2	158,441
三洋工業	0.9	1,532	三菱化工機	2.2	4,501	東洋電機製造	2.1	1,879	新電元工業	2.7	8,910
岡部	11.6	7,203	月島機械	12.4	11,122	安川電機	75.5	323,895	アズビル	43.7	150,765
ジーテクト	8.3	10,624	帝国電機製作所	5.1	7,971	シンファエアテクノロジー	7.7	10,572	東亜ディーケーケー	4.3	3,560
東プレ	12	12,384	東京機械	3.1	2,697	明電舎	11.3	22,419	日本光電工業	29.2	85,176
高周波熱錬	12.1	8,058	新東工業	16.5	11,220	オリジン	1.6	1,944	チノー	2.5	4,025
東京製綱	4.5	4,005	渋谷工業	6.4	14,400	山洋電気	2.9	15,225	共和電業	8.7	2,766
サンコール	6	3,738	アイチコーポレーション	10.1	8,564	デンヨー	5.5	8,497	日本電子材料	3.6	6,681
モリテックスチル	5.8	1,670	小森コーポレーション	18.5	14,707	PHCホールディングス	11.4	14,797	堀場製作所	13.1	83,840
パイオラックス	9.8	19,090	鶴見製作所	5.9	10,743	東芝テック	8	32,160	アドバンテス	55.4	428,242
エイチワン	6.3	3,717	住友精密	1	2,813	芝浦メカトロニクス	1.3	14,365	小野測器	3.6	1,580
日本発条	63.3	59,185	日本ギア工業	8.7	2,340	マブチモーター	17.1	61,303	エスベック	5.9	10,519
中央発條	4.7	3,214	酒井重工業	1.2	3,507	日本電産	174.8	1,440,876	キーエンス	67.5	3,121,875
アドパネクス	1.2	1,560	荏原製作所	29.6	161,616	ユーエムシーエレクトロニクス	2.7	1,225	日置電機	3.5	23,100
立川ブラインド	2.9	3,053	石井鉄工所	0.7	1,971	トックス・セミコンダクター	3.4	9,625	シスメックス	56.6	437,178
三益半導体	5.7	13,195	西島製作所	6.8	9,282	東光高岳	4.1	6,965	日本マイクロニクス	11.8	16,307
機械 (5.4%)			北越工業	6.2	5,046	ダブル・スコープ	21.5	31,024	メガチップス	6.6	20,130
日本ドライケミカル	2.1	3,200	ダイキン工業	86.1	1,710,110	ダイヘン	7.3	30,733	OBARA GROUP	3.4	9,802
日本製鋼所	19.8	61,083	オルガノ	2.1	20,412	ヤーマン	12.1	16,927	澤藤電機	0.8	1,152
三浦工業	29.8	78,463	トーヨーカネツ	2.6	6,952	JVCケンウッド	60.5	10,769	原田工業	3.1	2,821
タクマ	22.1	30,188	栗田工業	38.6	194,158	ミマキエンジニアリング	6.5	3,380	コーセル	7.9	6,406
ツガミ	15.7	17,992	椿本チエイン	10.3	32,445	イーPEX	3.4	4,562	イリソ電子工業	6.3	20,601
オークマ	7.7	41,426	大同工業	3.4	2,760	日新電機	17.5	26,880	オプテックスグループ	12.2	23,655
芝浦機械	8.3	23,513	木村化工機	5.9	3,970	大崎電気	12.4	6,051	千代田インテグレ	2.8	5,404
アマダ	115.5	120,004	アネスト岩田	12.3	10,664	オムロン	61.8	413,998	レーザーテック	31.3	535,230
アイダエンジニア	17.9	16,163	ダイフク	37.1	281,218	日東工業	9.3	21,129	スタンレー電気	49.5	110,385
滝澤鉄工所	2.7	3,221	サムコ	1.9	4,810	IDEC	9.2	24,315	岩崎電気	2.4	6,211
FUJI	30.7	63,180	加藤製作所	3.1	2,507	正興電機製作所	2.1	2,270	ウシオ電機	36.2	59,947

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
岡谷電機	4	1,028	豊田合成	22.1	46,211	リンテック	15.8	37,793	共栄タンカー	1.2	1,201
ヘリオステクノH	9	2,655	愛三工業	11.6	8,178	イトーキ	13.2	5,029	乾汽船	4.4	7,801
エノモト	2	3,142	盟和産業	0.6	605	任天堂	42.1	2,366,441	空運業 (0.4%)		
日本セラミック	6.9	13,938	日本プラス	5.1	2,300	三菱鉛筆	10.7	14,744	日本航空	155.2	351,993
遠藤照明	3.3	2,461	ヨロズ	6	5,226	タカラスタANDARD	13.1	16,427	ANAホールディングス	172	418,390
古河電池	5.3	6,428	エフ・シー・シー	12.1	16,504	コクヨ	33.7	55,065	パスコ	1.4	1,787
双信電機	3.4	1,887	シマノ	28.4	598,530	ナカバヤシ	6.3	3,093	倉庫・運輸関連業 (0.2%)		
山一電機	5	9,345	ティ・エス・テック	31.5	43,879	グローブライド	5.9	12,502	トランコム	2	12,240
図研	4.8	13,473	ジャムコ	4.3	5,276	オカムラ	22.5	24,862	日新	5.2	8,195
日本電子	14.7	84,084	精密機器 (2.6%)			美津濃	6.5	14,384	三菱倉庫	19.8	62,964
カシオ	48.1	60,125	テルモ	210.8	806,731	電気・ガス業 (1.3%)			三井倉庫 HOLD	7.1	21,229
ファナック	65.4	1,310,616	クリエートメディック	3	2,934	東京電力HD	558.1	274,585	住友倉庫	22	44,264
日本シイエムケイ	13.5	6,183	日機装	20.1	17,185	中部電力	216.5	271,707	渋沢倉庫	3.7	8,132
エンプラス	1.8	6,048	日本エム・ディ・エム	4.5	6,777	関西電力	267.9	335,946	東陽倉庫	10.2	3,009
大真空	9.5	9,367	島津製作所	91.2	405,384	中国電力	110.4	91,852	日本トランスシティ	13.5	6,723
ローム	31.8	317,046	JMS	6.3	3,565	北陸電力	64.5	32,185	ケイヒン	1.2	1,588
浜松ホトクス	50.9	292,675	クボテック	2.2	580	東北電力	167	117,067	中央倉庫	3.7	3,552
三井ハイテック	6.7	62,980	長野計器	5.2	5,954	四国電力	63.5	46,926	川西倉庫	1.3	1,418
新光電気工業	21.9	92,527	バイ・テクノロジ	3.3	9,256	九州電力	146.4	121,512	安田倉庫	4.7	4,441
京セラ	104.9	754,860	東京計器	5.1	7,058	北海道電力	64.4	29,559	ファイズホールディングス	1.5	1,060
太陽誘電	34.2	176,472	愛知時計	2.8	3,959	沖縄電力	15.7	19,154	東洋埠頭	1.8	2,287
村田製作所	208.6	1,679,230	インターアクション	3.8	7,212	電源開発	57.8	119,010	上組	36.4	92,856
双葉電子工業	12.3	7,982	オーパル	7.3	2,255	エフオン	4.5	2,457	サンリツ	1.6	1,169
北陸電気工業	2.6	2,893	東京精密	11.9	55,930	イーレックス	10.1	20,563	キムラユニティー	1.8	2,637
ニチコン	21	28,623	マニ	27.7	37,561	レノバ	14.6	29,346	キューソー流通システム	3.4	3,655
日本ケミコン	7	12,656	ニコン	107.9	180,085	東京瓦斯	136.1	355,901	近鉄エクスプレス	12.8	53,376
KOA	10.6	17,490	トプコン	34.9	64,460	大阪瓦斯	128.6	311,212	東海運	3.4	992
市光工業	8.8	3,238	オリンパス	370.7	1,002,743	東邦瓦斯	30.9	94,245	エーアイティー	4.4	6,221
小糸製作所	38.5	174,597	理研計器	5.2	19,500	北海道瓦斯	3.6	5,734	内外トランスライン	2.7	5,100
ミツバ	12.2	4,721	タムロン	5.3	13,006	広島ガス	13	4,069	日本コンセプト	2.2	3,146
SCREENホールディングス	12.2	127,368	HOYA	143.9	1,757,738	西部ガス HLDGS	7.5	13,702	情報・通信業 (8.8%)		
キャノン電子	6.6	10,078	シード	4.3	2,102	静岡ガス	18.2	15,178	NEC ネットエスアイ	24.3	43,958
キャノン	370.3	1,203,845	ノーリツ鋼機	6.7	15,611	メタウォーター	7.8	15,303	クロスキャット	3.8	3,727
リコー	187.2	206,668	A&D ホールディングス	8.4	8,022	陸運業 (3.0%)			システナ	104.6	43,095
象印マホービン	19	26,866	朝日インテック	81.5	145,070	SBS ホールディングス	5.5	14,602	デジタルアーツ	3.9	22,074
MUTOHホールディングス	0.8	1,644	シチズン時計	77.6	43,456	東武鉄道	69.6	206,364	日鉄ソリューションズ	12	42,360
東京エレクトロン	47.3	2,412,300	リズム	2.3	4,020	相鉄ホールディングス	22.5	51,322	キューブシステム	3.6	3,222
輸送用機器 (8.2%)			大研医器	7.2	3,556	東急	178.2	263,736	WOW WORLD	1	1,021
トヨタ紡織	27.6	56,883	メニコン	23.6	63,366	京浜急行	87.2	123,649	コア	3	4,185
芦森工業	1.5	1,534	シンシア	1	416	小田急電鉄	99.6	169,818	手間いらす	1.1	5,478
ユニプレス	11.8	10,773	松風	2.8	4,592	京王電鉄	34.8	154,338	ラクーンホールディングス	6.2	9,758
豊田自動織機	55.3	454,566	セイコーHD	10.5	29,106	京成電鉄	46.5	161,355	ソリトンシステムズ	3.7	4,480
モリタホールディングス	11.7	14,917	ニプロ	52.6	53,441	富士急行	8	31,920	ソフトクリエイトHD	3.2	12,032
三桜工業	10.4	6,708	その他製品 (2.4%)			新京城電鉄	2	5,642	T I S	65.9	209,232
デンソー	152.1	147,296	中本パックス	2.1	3,286	東日本旅客鉄道	119.6	809,692	JNS ホールディングス	3.1	1,326
東海理化電機	19.6	28,263	スノーピーク	9.7	23,377	西日本旅客鉄道	82.9	395,515	グリー	33.2	27,224
川崎重工業	51.8	146,645	パラマウントベッドHD	14.3	28,242	東海旅客鉄道	55.6	856,796	GMOベババ	0.8	1,596
名村造船所	20.1	8,220	トランザクション	4.6	4,972	西武ホールディングス	92.3	127,374	コーエーテクモHD	23.3	98,093
日本車輛	2.3	4,671	粧美堂	2.4	945	鴻池運輸	10.8	12,333	三菱総合研究所	3.4	13,991
三菱ロジスネクスト	9.8	7,840	ニホンフラッシュ	5.9	5,764	西日本鉄道	18.7	52,116	ボルテージ	2	696
近畿車輛	0.8	900	前田工織	7.4	19,291	ハマキョウレックス	4.9	14,126	電算	0.6	1,342
日産自動車	879.6	469,354	永大産業	7.9	2,133	サカイ引越センター	3.4	14,484	AGS	2.8	2,060
いすゞ自動車	222	348,762	アートネイチャー	6.1	4,361	近鉄グループHLDGS	67.7	261,999	ファインデックス	6.1	3,782
トヨタ自動車	3,524.7	330,752	パンダイナムコHLDGS	63.4	590,000	阪急阪神HLDGS	84.3	295,471	ブレインパッド	6.2	6,429
日野自動車	93.3	64,563	アイフォスジャパン	2.1	1,428	南海電鉄	30.1	76,634	K L a b	12.8	6,156
三菱自動車工業	276.1	121,207	共立印刷	10.9	1,667	京阪ホールディングス	28.9	91,902	ポルトクワインホールディン	10.5	9,786
エフテック	4.8	2,601	S H O E I	6.7	33,634	神戸電鉄	2	6,410	ネクソン	166.2	487,298
レシップホールディングス	2.3	1,251	フランスベッドHLDGS	9.3	8,277	名古屋鉄道	71.3	149,230	アイススタイル	18.6	4,259
GMB	1.2	840	パイロットコーポレーション	11.3	56,952	山陽電鉄	5	10,470	エムアップホールディングス	8.4	9,912
ファルテック	1	603	萩原工業	4.8	5,251	アルプス物流	4.8	5,241	エイチーム	4.6	3,293
武蔵精密工業	16.7	22,327	アジアールインターナショナル	16	23,600	ヤマトホールディングス	99	205,821	エニグモ	8.1	4,195
日産車体	10.5	6,111	タカラトミー	30.7	38,774	山丸	17.7	67,879	テクノスジャパン	5.8	2,842
新明和工業	20.4	22,705	広済堂ホールディングス	4.6	5,267	丸連	3.1	737	e n i s h	5.1	1,601
極東開発工業	12.5	17,937	エステールホールディングス	1.4	889	丸全昭和運輸	5.1	14,988	コロブラ	24	15,000
トピー工業	5.6	7,240	タカノ	2.5	1,915	センコーグループHLDGS	33.8	28,290	オルトプラス	5.8	2,111
ティラド	1.9	5,179	プロネクス	5.8	5,979	トナミホールディングス	1.4	4,767	ブロードリーフ	36.4	15,360
タチエス	12.4	13,776	ホクシン	5.1	734	ニッコンホールディングス	22.7	46,194	クロス・マーケティングG	2.8	2,242
NOK	30.7	36,011	ウッドワン	2.2	2,589	日石輸送	0.7	1,764	デジタルハーツHLDGS	3.3	5,204
フタバ産業	17.1	6,549	大建工業	3.9	6,797	福山通運	9.9	30,442	システム情報	5.4	5,211
K Y B	7	20,944	凸版印刷	102.5	239,440	セイノーホールディングス	41.7	43,034	メディアドゥ	2.6	4,482
大同メタル工業	13	6,734	大日本印刷	83.2	239,449	エスライン	1.8	1,526	じげん	20.7	6,913
プレス工業	33.4	14,028	共同印刷	2	5,200	神奈川中央交通	2	6,740	ブイキューブ	7.5	7,155
ミクニ	8.7	3,001	N I S S H A	13.7	20,317	日立物流	13.3	113,715	エンカレッジ・テクノロジ	0.9	465
太平洋工業	14.7	15,096	光村印刷	0.6	753	C&F ロジホールディングス	12.9	18,266	サイバーリンクス	2.5	2,805
河西工業	8.5	2,337	TAKARA & COMPANY	4.3	7,800	九州旅客鉄道	6.3	6,300	ディー・エル・イー	4.3	1,444
アイシン	54.6	232,323	アシックス	60.1	146,463	SG ホールディングス	49.7	130,959	フィックスターズ	7.2	6,847
マツダ	224.4	248,410	ツツミ	1.9	3,585	NIPPON EXPRESS	123.6	273,032	CARTA HOLDINGS	2.9	5,208
今仙電機製作所	4.3	2,511	ローランド	5.2	22,256	海運業 (0.7%)	22.1	168,181	オプティム	5.3	4,001
本田技研	559.1	1,847,825	小松ウオール工業	2.2	4,092	日本郵船	59.1	572,088	セレス	2.7	3,121
スズキ	155.4	627,039	ヤマハ	43.4	230,888	商船三井	111.7	357,998	S H I F T	4.3	74,777
SUBARU	201.8	493,905	河合楽器	1.9	4,978	川崎汽船	21.8	200,560	ティークガイア	6.6	10,599
安永	3	2,094	クリナップ	6.7	3,651	NS ユナイテッド海運	3.5	13,720	セック	1	2,425
ヤマハ発動機	97.4	251,292	ビジョン	45.1	76,715	明治海運	7.2	10,576	テクマトリックス	12.4	19,740
T B K	6	2,040	兼松サステック	0.5	793	飯野海運	29.5	22,361	プロシップ	2.3	3,243
エクセディ	11.2	19,588	キングジム	5.8	5,295				ガンホー・オンライン・エンター	19	44,517

銘柄	2022年6月15日現在			銘柄	2022年6月15日現在			銘柄	2022年6月15日現在			銘柄	2022年6月15日現在		
	株数	評	価 額		株数	評	価 額		株数	評	価 額		株数	評	価 額
	千株		千円		千株		千円		千株		千円		千株		千円
GMOベイメントゲートウェイ	14.2		129,078	ギフトィ	6.2		6,522	S C S K	50.8		108,356	日本ライフライン	22		19,866
ザッパラス	2.6		1,008	ベース	1.2		6,888	日本システムウエア	2.7		6,407	タカショー	5.5		4,125
システムリサーチ	2		4,050	J M D C	9.2		46,092	アイネス	6.1		9,241	I D O M	22.2		15,673
インターネットアジアティ	19.5		86,775	フォーカスシステムズ	4.5		3,982	T K C	11.6		36,482	進和	4.9		10,172
さくらインターネット	7.7		4,173	クレスコ	5.3		10,329	富士ソフト	7.3		52,633	エスケイジャパン	1.8		822
ヴィングス	2		2,228	フジ・メディア・HD	66.6		74,592	N S D	23		52,969	ダイトロン	2.8		5,392
GMOグローバルサインHD	1.6		9,040	オービック	23.1		423,885	コナミホールディングス	26.6		208,544	シークス	9.7		9,680
SRAホールディングス	3.5		9,779	ジャストシステム	10.4		38,636	福井コンピュータHLDGS	3.4		10,659	田中商事	2.2		1,304
システムインテグレータ	1.9		910	T D C ソフト	6		6,024	JBCCホールディングス	4.9		7,693	オーハシテクニカ	3.5		4,483
朝日ネット	6.7		3,785	Zホールディングス	1,054.8		418,228	ミロク情報サービス	6.4		6,963	白銅	2.3		5,602
e B A S E	8.8		4,593	トレンドマイクロ	37		243,090	ソフトバンクグループ	438.7	2,205,783	ダイコー通産	0.6		675	
アパント	7.8		9,757	IDホールディングス	4.2		3,456	卸売業 (5.8%)			伊藤忠	464.7	1,720,319		
アドソル日進	2.6		3,840	日本オラクル	11.9		87,703		高千穂交易	2.6		4,654	丸紅	670.5	
ODKソリューションズ	1.3		746	アルファシステムズ	1.9		7,894	オルパルスケアHLDGS	1.5		2,652	高島	1.1		2,726
フリービット	3.8		2,872	フューチャー	15.5		23,854	伊藤忠食品	1.6		7,528	長瀬産業	35.2		65,014
コムチュア	8.2		21,254	CAC HOLDINGS	3.8		5,289	エレマテック	5.7		7,358	蝶理	4.1		7,794
サイバーコム	0.9		1,025	S B テクノロジー	3.2		7,075	あらた	5.5		20,762	豊田通商	68.3		326,815
アステリア	5.3		5,395	トーセ	2.3		1,708	トーマンデバイス	1.1		6,380	三共生興	9.1		4,895
アイル	3.7		5,379	オービックビジネスC	7		29,715	東京エレクトロニクス	2.2		11,902	兼松	26		34,554
マークライنز	3.7		7,718	伊藤忠テクノソリューションズ	33.4		105,043	フィールズ	6.4		6,374	ツカモトコーポレーション	1.2		1,371
メディカル・データ・ビジ	9.4		9,136	アイティフォー	8.7		6,681	双日	77.2		156,561	三井物産	544.8		1,750,442
g u m i	10.2		5,763	東計電算	0.8		4,768	アルフレッサホールディングス	77.9		129,080	日本紙パルプ	3.5		12,635
ショーケース	1.6		737	エックスネット	0.7		698	横浜冷凍	18.1		15,113	カメイ	8.1		8,480
モバイルファクトリー	1.7		1,936	大塚商会	39.6		152,262	神栄	1.1		977	東都水産	0.4		1,742
テラスカイ	2.7		3,788	サイボウズ	9.9		9,405	ラサ商事	3.2		3,056	OUGホールディングス	1.1		3,011
デジタル・インフォメーション	3.2		4,336	電通国際情報S	9.6		35,664	アルコニックス	9.2		11,822	スターゼン	5.2		10,056
PCIホールディングス	3		2,883	A C C E S S	8.2		5,674	神戸物産	52.7		160,471	山善	27.8		27,605
パイブドHD	1.3		3,543	デジタルガレージ	12.1		45,677	ハイパー	2.2		1,005	椿本興業	1.5		5,302
アイビシー	0.9		408	イーエムシステムズ	12.1		11,567	あいホールディングス	10.4		16,484	住友商事	444.2		821,325
ネオジャパン	2		2,142	ウェザーニューズ	2.3		13,869	ディービーエックス	2.9		2,920	内田洋行	3		15,600
P R T I M E S	1.6		3,177	C I J	5.2		3,946	ダイワボウHD	32.7		54,707	三菱商事	504.4	2,210,785	
ラクス	33.6		47,342	ビジネスエンジニアリング	1.6		3,235	マクニカ・富士エレHLDGS	17.5		48,352	第一実業	3		10,050
ランドコンピュータ	1.3		1,158	日本エンタープライズ	6.7		1,051	ラクト・ジャパン	2.5		4,990	キャノンマーケティングJPN	18.1		52,254
ダブルスタンダード	2.2		3,968	WOWOW	3.5		5,120	グリムス	3.3		4,481	西華産業	3.3		5,329
オーブントピア	4.4		7,629	スカラ	6.1		4,599	パイタルK S K HD	12.1		8,107	佐藤商事	5.1		5,610
マイネット	2.6		1,292	インテリジェントウェイブ	3.3		2,649	ハ洲電機	4.7		4,450	菱洋エレクトロ	4.3		9,769
アカツキ	3.3		9,055	IMAGICA GROUP	5.5		3,905	メディアスホールディングス	4.5		4,360	東京産業	5.6		3,864
ベネフィットジャパン	0.6		1,120	ネットワンシステムズ	27		74,574	レスターホールディングス	6.8		13,239	ユアサ商事	6.2		20,801
UBICOMホールディングス	1.9		4,254	システムソフト	19.6		1,960	ジューテックHD	1.5		1,492	神鋼商事	1.7		6,477
カナミックネットワーク	9.2		4,784	アルゴグラフィックス	5.7		17,584	大光	3.2		2,230	トルク	10.1		1,989
ノムラシステムコーポレーション	3.5		819	マイベラス	11.5		7,682	OCHIホールディングス	1.8		2,192	阪和興業	13.4		38,953
チェンジ	14.7		27,077	エイベックス	12.7		15,887	TOKAIホールディングス	35.6		30,544	正栄食品	4.7		16,614
シンクロ・フード	4		1,328	B I P R O G Y	22.9		64,188	黒谷	1.9		1,111	カナデン	6.2		6,218
オークネット	3.9		6,996	兼松エレクトロニクス	3.9		15,054	C o m i n i x	2.8		2,010	菱電商事	5.8		9,193
キャピタル・アセット・プラン	1.2		823	都築電気	3.4		4,307	三洋貿易	7		6,706	岩谷産業	16.7		87,341
セグエグループ	1.9		1,022	TBSホールディングス	38.3		65,607	ビューティガレージ	1.2		2,920	ナイス	2.5		4,055
エイトロッド	1		1,957	日本テレビHLDGS	60.8		75,574	ウイン・パートナーズ	5.9		5,858	ニチモウ	1		2,292
マクロミル	14.6		13,446	朝日放送グループHD	6.4		4,147	ミタチ産業	1.7		1,545	極東貿易	2.1		5,493
ビーグリー	1.7		2,266	テレビ朝日HD	18		26,550	シブヘルスケアHD	21.7		50,300	アステナホールディングス	9.8		4,076
オロ	2.3		3,804	スカパーJSATHD	61.7		31,713	明治電機工業	3		3,210	三菱オブリ	17		16,150
ユーザーローカル	2.2		3,630	テレビ東京HD	5		9,825	デリカフーズHLDGS	3		1,560	稲畑産業	14.7		33,104
デモナ	1.6		598	日本BS放送	3		3,126	スターティアホールディングス	1.7		1,215	G S I クレオス	3.5		4,438
ニーズウェル	1.8		1,161	ビジョン	12		15,540	コマダホールディングス	16		36,288	明和産業	6.7		4,589
マネーフォワード	14.9		48,648	スマートバリュー	1.7		797	ピーバンドットコム	0.8		416	クワザホールディングス	2.5		1,155
サインポスト	2.3		1,867	USEN-NEXT HLDGS	6		11,262	アセンテック	2.5		1,600	ワキタ	13.8		15,870
電算システムHD	3		6,813	ワイヤレスゲート	3		897	富士興産	1.8		1,974	東邦ホールディングス	21		39,396
ソルクシーズ	6.2		2,225	コネクショ	5.3		6,810	協栄産業	0.5		691	サンゲツ	18		27,378
フェイス	1.9		1,216	日本通信	60.7		11,411	フルサト・マルカHD	6.6		18,664	ミツウロコグループ	9.1		8,108
プロトコーポレーション	7.9		7,441	クロップス	1.4		1,432	ヤマエグループHD	4.4		5,068	シナノンホールディングス	2.5		8,350
ハイマックス	1.9		2,348	日本電信電話	801.6		3,065,318	小野建	6.7		9,306	伊藤忠エネクス	16		16,848
野村総合研究所	132		481,140	K D D I	533.2		2,321,019	南陽	1.7		3,027	サンリオ	21.3		53,186
サイバネットシステム	5.2		3,993	ソフトバンク	1,107.6		1,615,434	佐島電機	4.4		5,214	サンワ テクノス	3.7		5,057
C E ホールディングス	3.4		1,417	光通信	8.4		115,164	エコーレーディング	1.8		1,020	リョーサン	7.6		17,381
日本システム技術	1.3		3,123	エムティーアイ	6.1		2,702	伯東	4.4		12,064	新光商事	9.7		8,448
インテージホールディングス	8.4		11,348	GMOインターネット	25.6		57,497	コンドレーテック	5.4		5,335	トーホー	3		3,936
東邦システムサイエンス	1.6		1,414	ファイバーゲート	3.4		3,080	中山福	3.8		1,212	三信電気	3		4,707
ソースネクスト	31.6		7,900	アйдマーケティングコミュ	1.8		538	ナガイレーベン	9		16,542	東陽テクニカ	7.9		8,650
インフォコム	8		16,616	K A D O K A W A	39.5		106,571	三菱食品	7		21,910	モスフード サービス	9.6		28,896
シンプレックスHD	11.6		21,030	学研ホールディングス	10.3		8,744	松田産業	5.3		10,499	加賀電子	6.2		19,127
H E R O Z	2.1		1,902	ゼンリン	12.1		10,865	第一興商	14		52,150	ソーダニツカ	6.5		3,900
ラクスル	8.5		13,149	昭文社ホールディングス	3		1,155	メディアパル HD	71.6		128,808	立花エレテック	5.1		7,741
I P S	2		4,518	インプレスホールディングス	6.5		1,358	S P K	2.5		3,297	フォーバル	2.8		2,265
F I G	7.6		2,287	アイネット	3.3		3,969	萩原電気 HLDGS	2.3		4,650	P A L T A C	10.3		42,848
システムサポート	2.6		3,010	松竹	4.4		55,440	アズワン	10.5		60,165	三谷産業	11.6		3,549
イソソル	4.5		2,434	東宝	43.2		207,792	スズデン	2.6		5,098	太平洋興発	2.7		1,690
アルテリア・ネットワークス	7.6		9,348	東映	2.2		37,576	尾家産業	1.8		1,542	西本 WISMETTAC HD	1.7		6,579
東海ソフト	1.1		1,048	N T T データ	194.9		362,319	シモジマ	4.6		4,301	ヤマシタヘルスケアHLDGS	0.8		1,473
ウイングアーク1ST	5.6		8,215	ピー・シー・エー	4.3		4,489	ドウシシャ	6.9		10,350	コア商事 HLDGS	4.6		3,574
ヒト・コミュニケーションズHD	1.7		2,522	ビジネスB太田昭和	2.3		3,187	小津産業	1.4		2,567	国際紙パルプ商事	14		6,370
サーバーワークス	1.3		2,628	D T S	13.7		41,374	高速	4.3		6,402	ヤマタネ	3		4,662
東宝	0.7		786	スクウェア・エニックス・HD	34		195,840	たけびし	2.2		3,161	丸紅建材リース	0.7		1,348
ヴィッツ	0.6		649	シーイーシー	7.8		8,642	リックス	2.3		4,215	日鉄物産	4.7		23,970
トビラシステムズ	1.4		1,201	カプコン	69		221,835	丸文	5.7		4,286	泉州電業	1.9		9,861
S a n s a n	24.2		21,731	アイ・エス・ピー	3.4		3,410	ハピネット	5.6		8,607	トラスコ中山	15.3		26,132
L i n k - U	1.4		911	ジャステック	4.1		4,710	橋本総業 HLDGS	1.3		2,490	オートバックスセブン	23.4		31,847

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額 千円		株数	評価額 千円		株数	評価額 千円		株数	評価額 千円
モリト	5.2	3,832	コスモス薬品	7.4	85,692	近鉄百貨店	2.3	5,485	南都銀行	10.5	20,475
加藤産業	8.8	26,488	トーエル	3.3	2,884	丸井グループ	54.8	124,450	百五銀行	64.8	20,865
北恵	1.9	1,634	セブン&アイ・HLDGS	259.9	1,353,039	アクシアル リテイリング	5.1	15,060	京都銀行	24	140,880
イノテック	4.2	5,544	クリエイト・ヒストランツ・ホール	45.7	42,729	井筒屋	3.4	1,196	紀陽銀行	23	30,820
イエローハット	12	19,284	ツルハホールディングス	16	102,080	イオン	255.7	555,380	ほくほくフィナンシャルG	43	35,131
JKホールディングス	5.3	4,791	サマルグホールディングス	6	9,162	イズミ	12.2	35,794	山陰合同銀行	41.9	27,486
日伝	6.2	11,848	フェリシモ	1.7	1,926	平和堂	11.3	21,029	中国銀行	55.5	53,058
北沢産業	4.1	861	トリドールホールディングス	18.2	40,021	フジ	17.4	38,558	鳥取銀行	2	2,340
杉本商事	3.8	7,991	TOKYO BASE	6.9	2,270	ヤオコー	8.3	50,132	伊予銀行	87.9	57,662
因幡電機産業	18.2	48,539	ウィルプラス HLDGS	1.3	1,155	ゼビオホールディングス	10.2	9,078	百十四銀行	7	12,033
東テク	2.3	6,490	JMホールディングス	5.3	7,642	ケーズホールディングス	63.9	78,852	四国銀行	10	8,090
ミスミグループ本社	91.8	253,184	サツドラホールディングス	3.6	2,329	OLYMPIC グループ	3	1,929	阿波銀行	10.2	20,359
アルテック	5.7	1,333	アレンザホールディングス	5.2	5,038	日産東京販売HD	9	2,295	大分銀行	4	7,208
タキヒヨー	1.9	1,896	串カツ田中 HLDGS	2	3,620	シルバーライフ	1.6	2,675	宮崎銀行	4.1	8,405
蔵王産業	1.9	3,634	パロックジャパン	4.8	3,792	GENKY DRUGSTORES	3.2	10,192	佐賀銀行	3.7	5,276
スズケン	27	93,825	クスリのアオキ HLDGS	6.8	34,408	ナルミヤ・インターナショナル	1.6	1,377	琉球銀行	15.7	12,167
ジェコス	5.1	4,131	力の源 HD	4	2,784	ブックオフGHD	4.6	4,443	セブン銀行	219.6	54,900
グローセル	7.4	2,960	FOOD&LIFE COMPAN	39.4	108,822	ギフトホールディングス	1.2	2,444	みずほフィナンシャルG	901.2	1,359,910
小売業 (4.1%)			メディカルシステムネットワーク	6.7	2,713	アインホールディングス	9.3	63,054	高知銀行	2.2	1,601
ローソン	16.3	69,845	一家ホールディングス	1.3	754	元氣寿司	2.2	5,445	山口フィナンシャルG	78	59,124
サンエー	5.1	20,170	藤久ホールディングス	2.4	1,696	ヤマダホールディングス	266.3	122,498	長野銀行	2.1	2,568
カワチ薬品	5.6	11,340	はるやま HLDGS	3.7	1,594	日産東京販売HD	11.4	16,621	名古屋銀行	4.8	14,592
エービーシー・マート	11.4	65,322	ノジマ	11.8	33,417	ニトリホールディングス	29.1	353,710	北洋銀行	99.2	21,526
ハードオフコーポレーション	3.6	3,078	カッパ・クリエイト	10.5	14,595	グレムサキ屋	5.9	5,841	愛知銀行	2.4	13,248
アスクル	16.5	23,677	ライトオン	5.7	4,075	愛媛	7.4	1,369	中京銀行	2.3	4,057
ゲオホールディングス	9.1	10,910	良品計画	84.5	113,314	ケーユーホールディングス	3.7	3,770	大光銀行	2.2	2,851
アダストリア	7.8	15,280	パルミキホールディングス	10	2,680	吉野家ホールディングス	25.4	61,645	愛媛銀行	9.7	8,710
ジーフット	4	1,320	アドヴァングループ	6.6	5,181	松屋フーズ HLDGS	3.7	14,004	トマト銀行	2.1	2,118
シー・ヴィ・エス・バイエリア	0.7	278	アルビス	2.4	5,260	サガミホールディングス	10.8	12,106	京葉銀行	30.7	14,398
くら寿司	7.6	22,085	コナカ	8.2	2,730	関西フードマーケット	6.3	7,452	栃木銀行	33.4	8,550
キャンドゥ	2.7	5,745	ハウス ローゼ	1.1	1,824	王将フードサービス	4.9	32,095	北日本銀行	2	3,014
アイケイ	2.4	1,236	G-7ホールディングス	8.1	11,032	プレナス	8.3	15,969	東和銀行	12.1	6,134
パルグループ HLDGS	6.5	11,329	イオン北海道	10.7	11,213	ミニストップ	5.2	7,238	福島銀行	7.3	1,613
エディオン	33.5	39,429	コジマ	12.8	7,526	アークス	13.3	25,669	大東銀行	2.9	1,856
サラーコーポレーション	14.7	9,099	ヒマラヤ	2.5	2,345	パローホールディングス	15.4	27,566	トモニホールディングス	54.4	16,755
ワッツ	3.1	2,185	コーナン商事	10.3	36,307	ベルク	3.2	16,096	フィデアホール	6.7	8,455
ハロース	3.3	9,705	エコス	2.4	4,764	大庄	3.9	4,430	池田泉州HD	80.6	15,555
フジオフードG本社	5.8	7,801	ワタミ	8.8	8,016	ファーストリテイリング	9.8	657,972	証券・商品先物取引業 (0.7%)		
あみやき亭	1.8	5,162	マルシェ	2.7	1,239	サンドラッグ	27.7	76,645	F P G	24.7	22,477
ひらまつ	15.3	3,044	パンパシフィック HD	146.8	279,213	サックスバーホールディング	7.1	3,841	ジャパンインベストメントA	5.6	7,812
大黒天物産	2.3	9,269	西松屋チェーン	14.9	21,128	ヤマザワ	1.6	2,395	マキセルホールディングス	3.5	2,072
ハニースホールディングス	6.2	7,173	ゼンショーホールディングス	35.6	108,224	やまや	1.8	4,415	SBIホールディングス	90.8	232,448
ファーマライズ HD	1.7	1,190	幸楽苑ホールディングス	4.5	5,746	ペルーナ	15.7	10,770	日本アジア投資	5.9	1,421
アルビス	5.5	10,780	ハークスレイ	3.6	2,055	銀行業 (5.5%)			ジャフコ グループ	28.1	45,297
ハブ	2.5	1,415	サイゼリヤ	10.8	27,853	島根銀行	2	1,024	大和証券G本社	524	322,574
クオールホールディングス	9	11,421	V Tホールディングス	27.4	12,549	じもとホールディングス	4.7	2,679	野村ホールディングス	1,122.3	549,927
ジンスホールディングス	4.2	16,947	魚力	2.3	5,152	めぶきフィナンシャルG	321.2	83,190	岡三証券グループ	54	18,036
ビックカメラ	43.1	47,194	ポプラ	1.8	255	東京きらぼし FG	8.8	17,600	丸三証券	21.9	10,424
DCMホールディングス	43.2	43,804	フジ・コーポレーション	4.1	4,780	九州フィナンシャルG	136.2	52,709	東洋証券	22.8	4,104
ベッパーフードサービス	10	3,920	ユナイテッドアローズ	7.6	14,622	ゆうちょ銀行	173.6	171,169	東海東京HD	75.3	27,936
Monotaro	92.8	165,648	ハイデイ日高	10.6	21,518	富山第一銀行	16.1	6,987	光世証券	1.9	879
東京一番フーズ	2.2	1,295	YU-WA CREATION H	5.2	1,216	コンソルディア・フィナンシャル	383.9	179,281	水戸証券	18.9	4,838
DDホールディングス	3.9	2,414	コロワイド	30	53,760	西日本フィナンシャルHD	41.1	31,071	いちよし証券	13.1	8,253
きちりホールディングス	2.3	952	ピーシーデポコーポ	8.8	2,965	33 F G	6	8,154	松井証券	35.9	29,043
アークランドサービス HD	5.6	11,844	香番屋	5.2	24,986	第4北越フィナンシャルG	10.9	27,173	マネックスG	61.3	26,052
J. フロント リテイリング	83.7	93,158	トップカルチャー	3.7	969	ひろぎん HLDGS	99.2	60,016	極東証券	8.9	6,007
ドトール・日レスHD	12	18,324	P L A N T	1.7	1,105	おきなわ F G	6.4	13,440	岩井コスモホールディング	7	8,596
マツコヨコカラ&カンパニー	43.7	210,415	スギホールディングス	14.7	74,382	十六 F G	9.1	20,848	アイザワ証券グループ	10.8	7,300
ブロンコビルー	4	9,680	葉王堂ホールディングス	3.8	7,672	北國 F HD	6.5	29,022	マネーパートナーズGP	7.5	1,800
ZOZO	50.4	119,347	ヴィア・ホールディングス	9.9	1,475	新生銀行	7.5	14,017	スパークス・グループ	33.8	8,281
トレジャー・ファクトリー	2.3	2,382	スクロール	11.2	9,732	プロレ銀行	48	92,928	小林洋行	3	657
物語コーポレーション	3.6	20,448	ヨンドーホールディングス	6.3	11,018	あおぞら銀行	41.1	108,873	保険業 (2.4%)		
三越伊勢丹 HD	116.5	121,160	木曽路	9.8	20,364	三菱UFJフィナンシャルG	4,406.4	3,261,617	かんぽ生命保険	73.9	164,279
Hamee	2.7	2,754	SRSホールディングス	10.7	8,945	りそなホールディングス	796.5	406,374	SOMPOホールディングス	110	650,540
マーケットエンタープライズ	0.8	820	千趣会	13.7	5,370	三井住友トラストHD	127.4	523,614	アニコムホールディングス	22.5	14,490
ウエルシアHD	38.9	91,220	タカキユー	6.3	573	三井住友フィナンシャルG	487.8	1,959,004	MS & AD	155.7	631,986
クリエイトSDH	10.8	29,041	リテールパートナーズ	10.4	11,440	千葉銀行	220.8	164,716	第一生命HLDGS	350.1	926,014
丸善 CHI HD	10.6	4,070	ケーヨー	13.7	12,699	群馬銀行	125.4	46,774	東京海上HD	215.1	1,599,268
ミサワ	1.6	979	上新電機	7.6	13,870	武蔵野銀行	9.9	17,344	T&Dホールディングス	172.8	277,516
ディーライフ	1	1,357	日本瓦斯	35.7	68,008	千葉興業銀行	15.8	4,060	アドバンスクリエイト	3.5	3,353
エー・ピーホールディングス	1.5	675	ロイヤルホールディングス	12	26,808	筑波銀行	28.3	5,263	その他金融業 (1.2%)		
チムニー	2.3	2,748	東天紅	0.7	639	七十七銀行	20.8	39,894	全国保証	17.5	74,637
シュッピン	6.1	8,540	いなげや	7.7	8,893	秋田銀行	4.3	6,699	あんしん保証	3.5	924
オイシックス・ラ・大地	10.5	16,023	チヨダ	6.7	4,884	山形銀行	7	5,992	ジェイリース	2.5	4,432
ネクステージ	14.9	30,604	ライフコーポレーション	6.1	15,079	岩手銀行	4.5	9,054	イントラスト	3.5	1,862
ジョイフル本田	21.9	34,383	リンガーハット	8.7	19,809	東邦銀行	54.6	10,920	日本モーゲーサービス	4.2	3,960
鳥貴族ホールディングス	2.5	5,885	MrMa x HD	9.4	5,433	東北銀行	3	2,940	C a s a	2.9	2,415
ホットランド	5.7	7,592	テンアライド	7.3	2,241	ぶくおかフィナンシャルG	56.2	138,926	アルビ	10.8	10,692
すかいらーく HD	91	143,143	AOKIホールディングス	14	9,282	静岡銀行	161.2	130,410	プレミアグループ	3.7	14,189
SFPホールディングス	3.7	5,605	オークワ	10.5	8,893	スルガ銀行	63	22,428	ネットプロHD	22.4	11,468
綿半ホールディングス	5.4	6,966	コメリ	11.3	29,809	八十二銀行	150.1	70,396	クレディセゾン	44.4	67,710
ヨシックスホールディングス	1.5	3,552	青山商事	14.3	12,455	山梨中央銀行	7.4	8,273	芙蓉総合リース	6.7	50,317
ユニテッド・スーパーマケ	21.1	21,669	しまむら	8.5	95,625	大垣共立銀行	13.2	22,532	みずほリース	9.8	29,890
ゴルフダイジェスト・オン	3.8	5,396	はせがわ	4.8	1,267	福井銀行	5.9	7,717	東京センチュリー	12.4	50,902
B E N O S	3.7	7,248	高島屋	50.9	65,050	清水銀行	2.5	3,637	日本証券金融	28.7	24,595
あさひ	6.4	8,211	松屋	13.2	11,497	富山銀行	1.1	2,033	アイフル	123.5	42,360
日本調剤	4.5	5,665	Eイチ・ツー・オリテイリング	32.9	32,735	滋賀銀行	12.6	34,108	リコーリース	6.5	22,230

銘柄	2022年 6 月15日現在		銘柄	2022年 6 月15日現在		銘柄	2022年 6 月15日現在		銘柄	2022年 6 月15日現在	
	株数	評価額 千円		株数	評価額 千円		株数	評価額 千円		株数	評価額 千円
イオンフィナンシャルサービス	40.1	48,120	中広	1.1	420	サイバーエージェント	160	200,000	アドバンテッジリスクマネ	3.6	1,641
アコム	144.9	45,498	U T グループ	10.3	23,690	楽天グループ	342.4	222,217	リログループ	39	77,805
ジャックス	7.6	24,966	アイティメディア	3.4	5,280	クリク・アンド・リバー社	3.7	6,941	東祥	5.4	6,841
オリコ	198.6	24,427	E・Jホールディングス	4.1	4,682	モーションングスター	12.5	6,237	ピーウィズ	1.9	2,580
オリックス	436.9	1,011,205	夢真ビーネックスグループ	23.2	31,436	デー・オー・ダブリュー	13.5	4,374	TREホールディングス	12.2	22,887
三菱HCキャピタル	248.5	153,573	コシダホールディングス	19.2	14,668	山田コンサルティングGP	3.7	4,070	人・夢・技術グループ	2.8	6,624
九州リースサービス	3.3	1,864	アルトナー	1.8	1,497	セントラルスポーツ	2.6	6,211	エイチ・アイ・エス	15.2	29,776
日本取引所グループ	175.3	364,010	パソナグループ	7.7	14,383	フルキャストホールディングス	6	12,606	ラックランド	2.1	6,237
イー・ギランティ	10.8	21,081	C D S	1.7	3,080	エン・ジャパン	12.3	20,996	共立メンテナンス	12.7	62,039
アサックス	4.6	2,741	リンクアンドモチベーション	15.7	6,656	リゾルホールディングス	0.7	3,150	イチネンホールディングス	7.6	9,104
NECキャピタルリソリューション	3.2	6,256	エス・エム・エス	24.2	61,855	テクノプロ・ホールディング	42.7	114,009	建設技術研究所	3.8	9,500
不動産業 (2.0%)			サニーサイドアップG	2.5	1,400	アトラグループ	1.9	380	スペース	4.7	4,234
いちご	81.4	23,280	パソルホールディングス	71.3	161,637	ジヤパンワークス	2	740	燦ホールディングス	3.1	5,487
日本駐車場開発	75.4	12,516	リニカル	3.9	2,971	アイ・アールジャパンHD	3.3	6,570	スバル興業	0.4	3,544
スター・マイカ・HLDGS	4	6,224	クックパッド	22.1	4,464	Keepertech	4.6	14,766	東京テアトル	2	2,420
SREホールディングス	1.9	3,456	エスクリ	3.2	1,280	デザインフン・ジャパン	1.3	1,053	タナベ経営	2.9	1,887
ADワークスグループ	12.4	1,897	アイ・ケイ・ケイホールディン	3.2	1,801	三機サービス	1.1	1,127	ナガワ	2.1	16,569
ヒューリック	165.7	174,813	学情	2.9	2,734	Gunosy	3.9	3,572	東京都競馬	5.4	20,250
三栄建築設計	2.9	4,660	スタジオアリス	3.2	7,251	ファーストロジック	2.3	404	常盤興産	2.2	2,816
野村不動産HLDGS	38.2	122,813	シミックホールディングス	3.6	5,061	イー・ガーディアン	2.6	7,306	カナモト	11.9	23,312
三重交通グループHD	14.8	7,133	エプコ	1.6	1,161	リブセンス	4.1	672	西尾レントオール	6.1	16,640
サムティ	10.4	20,789	N J S	1.6	3,092	ジャパンマテリアル	21.9	40,931	アゴラホスピタリティG	34	816
地主	4.6	9,062	総合警備保障	26.8	94,336	ベクトル	10	9,980	トランス・コスモス	9	31,050
プレサンスコーポレーション	8.6	12,814	カカココム	52.3	112,706	ウチヤマホールディングス	2.8	814	乃村工藝社	30.4	26,144
ハウスコム	0.9	875	アイロムグループ	2.6	4,539	チャムケアコーポレーション	5.3	5,125	藤田観光	3.1	8,900
J P M C	3.4	3,386	セントケア・ホールディング	4.6	3,675	キャリアリンク	2.6	4,947	KNT-CTホールディングス	4.4	6,991
サンセイラニディック	1.7	1,485	サイネックス	1.7	999	I B J	6	4,176	日本管財	7.5	18,900
エストラスト	1.1	601	ルネサンス	4.9	4,512	アサンテ	3.1	4,650	トーカイ	5.7	9,336
フージャースHD	9.3	7,374	ディップ	12.5	43,000	パリュールH	6	7,380	白洋舎	0.6	876
オープンハウスグループ	23.4	119,340	デジタルホールディングス	4.9	6,306	M&Aキャピタルパートナー	5.9	18,083	セコム	70.2	569,041
東急不動産HD	206.2	138,566	新日本科学	8.7	16,617	ファーストプラスHD	2.8	3,253	セントラル警備保障	3.5	7,679
飯田GHD	61.4	124,703	キャリアデザインセンター	1.6	1,780	ERIホールディングス	2	2,844	丹青社	13.7	11,261
イーグランド	1	1,411	ベネフィット・ワン	26	43,940	アビスト	1	3,083	メイテツフ	8.4	54,768
ピーロット	4.7	2,279	エムスリー	125.7	448,246	ジグマシス・ホールディン	8.5	8,313	応用地質	7.2	12,297
ファーストブラザーズ	1.7	1,443	ツカダ・グローバルHOLD	4.4	1,421	ウィルグループ	5.2	5,527	船井総研ホールディン	13.7	27,564
ANDDOホールディングス	3.6	3,153	ブラス	0.9	763	エスコローAJ	8.4	1,402	進学会ホールディングス	1.7	613
シーアールイー	2.5	3,957	アウトソーシング	40.8	43,288	メドピア	5.2	9,666	オオバ	4.5	3,312
プロパティエージェント	0.8	1,143	ウェルネット	6.4	3,110	レアジョブ	1.3	700	いであ	1.8	3,114
ケイアイスター不動産	3.3	14,404	ワールドホールディングス	2.8	6,437	リクルートホールディングス	523.4	2,102,497	学究社	2.2	3,392
アグリ都市デザイン	1.2	1,722	ディー・エヌ・エー	27.1	46,828	エラン	9.9	9,820	ベネッセホールディングス	23.8	49,170
ジェイ・エス・ピー	1.5	4,890	博報堂DY HLDGS	93.2	109,603	土木管理総合試験	3.5	1,134	イオンディライト	8.1	22,307
ロードスターキャピタル	1.9	2,886	ぐるなび	10.9	4,381	ネットマーケティング	3.5	2,215	ナック	3.2	2,995
テンポイノベーション	1.9	1,559	タカミヤ	8.6	3,121	日本郵政	852.7	822,684	ダイセキ	13	57,330
グローバルリンクマネジメント	1.2	1,098	ジャパンバスターレキス	4.3	3,285	ベルシステム24HLDGS	10.2	13,923	ステップ	2.5	4,322
フェイスネットワーク	0.7	937	ファンコミュニケーションズ	16.6	6,440	鎌倉新書	8.1	4,033			
パーク24	43.6	81,139	ライク	2.4	4,944	S MN	1.6	960			
パワカ	1.9	3,262	ビジネス・ブレークスルー	2	828	一蔵	0.7	354			
宮越ホールディングス	2.8	2,380	エスプー	20.1	22,270	グローバルキッズCOMP	1	671	株数、金額	78,201.3	181,589,336
三井不動産	303.7	877,085	WDBホールディングス	3.2	6,988	エアトリ	4.3	10,965	銘柄数<比率>	2,160銘柄	<98.2%>
三菱地所	440.4	852,834	ティア	3.1	1,336	アトラエ	5	8,640			
平和不動産	12	46,440	C D G	0.9	1,154	ストライク	3	10,110			
東京建物	66.5	113,515	アドウェイズ	10.6	6,974	ソラスト	17.7	11,487			
京阪神ビルディング	10.2	12,699	パリュールコマース	5.6	16,592	セラク	2.3	2,417			
住友不動産	139.7	486,854	インフォマート	78.3	29,597	インソース	7.6	15,124			
テオオーシー	11.9	7,389	JPホールディングス	18.1	3,963	ペイカントコンサルティング	5	158,250			
東京楽天地	1	3,890	エコナックホールディングス	13.5	1,161	ORCHESTRA HLDGS	1.4	3,507			
スターツコーポレーション	10.1	25,856	CLホールディングス	1.5	1,456	アイモバイル	3	4,053			
フジ住宅	8.2	5,174	プレスステージ・インター	26.5	16,138	キャリアインデックス	2.4	1,106			
空港施設	6.9	3,615	アミューズ	3.9	7,686	MS-Japan	2.9	2,531			
明和地所	3.1	1,884	ドリームインキュベータ	2.1	4,504	船場	0.7	469			
ゴールドクレスト	5.8	9,657	クイック	4.6	6,426	ジャパンエレベーターSHD	22.6	29,380			
エスリード	2.7	4,422	T A C	2.3	517	フルテック	1.1	1,442			
日神グループHLDGS	11.6	5,011	電通グループ	69	290,145	グリーンズ	2.5	1,560			
日本エスコ	13.6	10,363	テイクアンドグヴェニズ	3.3	4,907	ツナグループHLDGS	1.6	500			
タカラレーベン	30.4	10,123	びあ	2.3	7,544	GAMEWITH	1.9	885			
AVANTIA	3.2	2,643	イオンファンタジー	2.7	6,679	MS&CONSULTING	1.1	771			
イオンモール	37.1	59,322	シーティーエス	8	6,280	ウェルビー	4.7	3,473			
毎日コムネット	2.1	1,377	ネクシイズグループ	2.3	1,212	エル・ディー・エス	0.9	3,123			
ファースト住建	2.6	2,808	HUグループHD	18.6	49,978	ミダックホールディングス	3.2	8,384			
ランド	403.8	4,038	アルプス技研	5.9	10,625	日総工産	5.6	3,113			
カチタス	18.3	47,982	サニックス	12.3	2,619	キュービーネットHLDGS	3.3	4,200			
トーセイ	10.2	11,526	ダイオーズ	1.2	1,254	RPAホールディングス	10	3,750			
穴吹興産	1.5	3,363	日本空調サービス	7.6	5,935	スプリックス	2.3	2,214			
サンフロンティア不動産	10.3	10,897	オリエンタルランド	78.6	1,421,481	マゼジャンソリューションズ	3.5	8,802			
インテリックス	1.5	877	ダスキン	15.7	42,013	プロレド・パートナーズ	1.7	827			
ランドビジネス	1.7	396	明光ネットワークジャパン	8.1	4,795	AND FACTORY	1.6	657			
サンネクスタグループ	2.2	2,497	ファルコホールディングス	3.1	6,324	テノ・ホールディングス	0.8	512			
グランディハウス	4.8	2,510	秀英予備校	2.2	946	フロンティア・マネジメント	1.9	2,251			
日本空港ビルデング	25.2	126,000	田谷	1.6	897	ピアラ	1.2	848			
サービス業 (5.1%)			ラウンドワン	19.9	31,342	コプロ・ホールディングス	1.4	1,250			
明豊ファシリティアークス	3.2	1,980	リゾートトラスト	31	63,984	ギーグス	1.2	1,146			
日本工営	4.5	14,715	ビー・エム・エル	9	30,915	カープホールディングス	19.5	12,714			
LIFULL	21.3	3,429	らひらひコミュニケーション	10.5	10,941	フォーラムエンジニアリング	4.5	4,162			
ミクシィ	16.2	35,137	リソー教育	32.7	10,333	FAST FITNESS JAP	1.3	1,766			
ジェイ・シー・リポートメント	5.7	9,450	早稲田アカデミー	3.7	4,166	ダイレクトマーケティングミクス	7.5	12,570			
日本M&Aセンターホールデ	116.9	155,593	ユー・エス・エス	79.7	187,693	ポピンズ	1.7	3,192			
メンバーズ	1.9	4,993	東京個別指導学院	6.2	3,689	LITALICO	5.8	13,032			

合計

銘柄数<比率>

2,160銘柄

<98.2%>

注1

銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

注2

合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

注3

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 6 月15日現在	
		買建額	売建額
国内	TOPIX	百万円	百万円
		3,389	—

注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入状況

区分	2022年 6 月15日現在	
	貸付	借入
株式	株	株
	5,015,900 (26,100)	(—)

注1

()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

注2

当ファンドに係る当作成期中の利害関係人のうち、大和証券株式会社へ26,100株を貸付けています。

15

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用報告書 第33期 (決算日 2021年9月21日)

(作成対象期間 2020年9月24日～2021年9月21日)

トピックス・インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

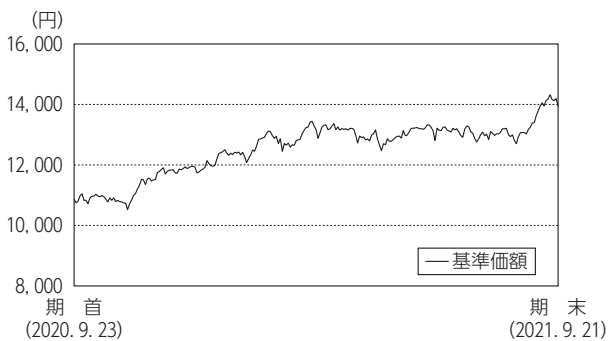
運用方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行います。
主要投資対象	東京証券取引所第1部上場株式（上場予定を含みます。）
株式組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		T O P I X		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首) 2020年9月23日	10,865	—	1,644.25	—	99.4	0.6
9月末	10,829	△ 0.3	1,625.49	△ 1.1	98.5	1.4
10月末	10,523	△ 3.1	1,579.33	△ 3.9	97.9	2.0
11月末	11,698	7.7	1,754.92	6.7	97.9	1.8
12月末	12,046	10.9	1,804.68	9.8	98.8	1.1
2021年1月末	12,074	11.1	1,808.78	10.0	99.1	0.8
2月末	12,452	14.6	1,864.49	13.4	99.3	0.7
3月末	13,165	21.2	1,954.00	18.8	98.1	2.8
4月末	12,793	17.7	1,898.24	15.4	98.2	1.8
5月末	12,969	19.4	1,922.98	17.0	97.2	2.8
6月末	13,123	20.8	1,943.57	18.2	98.0	2.0
7月末	12,839	18.2	1,901.08	15.6	97.0	3.0
8月末	13,244	21.9	1,960.70	19.2	98.3	1.6
(期末) 2021年9月21日	13,951	28.4	2,064.55	25.6	98.7	0.9

(注1) 騰落率は期首比。

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

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注4) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

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

*ベンチマークはT O P I Xです。

《今後の運用方針》

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,865円 期末：13,951円 騰落率：28.4%

【基準価額の主な変動要因】

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

■ 1 万口当りの費用の明細

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

(注 1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。
(注 2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1)株 式

(2020年 9 月24日から2021年 9 月21日まで)

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

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) () 内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
(注 3) 金額の単位未満は切捨て。

(2)先物取引の種類別取引状況

(2020年 9 月24日から2021年 9 月21日まで)

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

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
株 式

(2020年 9 月24日から2021年 9 月21日まで)

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

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)国内株式

銘 柄	期 首			期 首	当 期 末			銘 柄	期 首	当 期 末			銘 柄	期 首	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額			株 数	株 数	評 価 額			株 数	株 数	評 価 額
水産・農林業 (0.1%)	千株	千株	千円	千株	千株	千株	千円	大豊建設	千株	千株	千円	大豊建設	千株	千株	千円	大豊建設	千株
極洋	3.3	3.1	9,455	ダイセキ環境ソリューション	11.1	11.5	9,740	前田建設	4.8	5	19,100	前田建設	4.8	5	19,100	前田建設	4.8
日本水産	92.4	84.3	54,120	第一カッター興業	1.8	1.8	2,982	佐田建設	53.5	53.4	46,618	佐田建設	53.5	53.4	46,618	佐田建設	53.5
マルハニチロ	13.4	14	37,156	安藤・間	1.1	2.3	3,045	ナカノフドー建設	4.5	5.1	2,468	ナカノフドー建設	4.5	5.1	2,468	ナカノフドー建設	4.5
カネコ種苗	2.8	2.7	4,163	東急建設	54.9	58.4	47,420	奥村組	5.7	5	1,790	奥村組	5.7	5	1,790	奥村組	5.7
サカタのタネ	2.8	2.7	4,163	コムシスホールディングス	27.1	29	23,200	東鉄工業	10	11.5	35,937	東鉄工業	10	11.5	35,937	東鉄工業	10
ホクト	11	10.8	39,096	ピーアールホールディングス	32.6	32.6	97,343	イチケン	9	8.5	21,505	イチケン	9	8.5	21,505	イチケン	9
ホクリヨウ	7.1	7.9	15,626	高松コンストラクションGP	9.9	12.5	6,050	富士ピー・エス	1.5	1.5	2,904	富士ピー・エス	1.5	1.5	2,904	富士ピー・エス	1.5
鉱業 (0.2%)	1.6	2.3	1,741	東建コーポレーション	5.7	5.7	11,747	浅沼組	3	2.4	1,420	浅沼組	3	2.4	1,420	浅沼組	3
住石ホールディングス	18.4	21.6	3,002	ソネック	2.8	2.8	29,064	戸田建設	2.4	2.6	12,012	戸田建設	2.4	2.6	12,012	戸田建設	2.4
日鉄鉱業	2.1	2.1	13,818	ヤマウラ	0.9	1	1,130	熊谷組	87.6	86.1	71,032	熊谷組	87.6	86.1	71,032	熊谷組	87.6
三井松島 HLDGS	3.4	3.6	5,058	オリエンタル白石	4	4.1	3,825	北野建設	9.9	9.9	27,383	北野建設	9.9	9.9	27,383	北野建設	9.9
INPEX	339.1	367.2	289,353	大成建設	—	32.3	8,656	植木組	1.3	1.2	2,628	植木組	1.3	1.2	2,628	植木組	1.3
石油資源開発	27.4	31.9	73,497	大林建設	70.8	65.4	235,440	矢作建設	0.9	1.8	2,766	矢作建設	0.9	1.8	2,766	矢作建設	0.9
K&O エナジーグループ	12.1	12.4	24,366	清水建設	212.7	209	195,624	ピーエス三菱	9.3	9.3	7,746	ピーエス三菱	9.3	9.3	7,746	ピーエス三菱	9.3
建設業 (2.3%)	4.5	4.3	5,925	飛鳥建設	215.5	197.8	167,338	日本ハウス HLDGS	7	6.8	4,488	日本ハウス HLDGS	7	6.8	4,488	日本ハウス HLDGS	7
ヒノキヤグループ	5.9	5.7	6,418	長谷工コーポレーション	5.9	5.7	6,418	大東建託	14.2	14.7	6,438	大東建託	14.2	14.7	6,438	大東建託	14.2
ショーボンドHD	2.3	2.3	5,451	松井建設	81.8	68.6	102,900	新日本建設	23.1	23	300,380	新日本建設	23.1	23	300,380	新日本建設	23.1
ミライト・ホールディングス	14.3	13.2	66,792	銭高組	8.3	7.8	6,208	NIPPPO	9	8.4	7,660	NIPPPO	9	8.4	7,660	NIPPPO	9
タマホーム	27.4	31.9	73,497	鹿島建設	0.9	0.9	3,960	東亜道路	17.4	17.7	70,623	東亜道路	17.4	17.7	70,623	東亜道路	17.4
サンヨーホームズ	5	5.9	16,543	不動テトラ	166.7	153.9	225,617	前田道路	1.3	1.3	5,999	前田道路	1.3	1.3	5,999	前田道路	1.3
日本アーク	0.5	1.5	1,113	大末建設	5.5	5.1	9,149	日本道路	18.8	13.2	26,334	日本道路	18.8	13.2	26,334	日本道路	18.8
ファーストコーポレーション	3.8	4.4	2,578	鉄建建設	2.3	2.5	2,462	東亜建設	2	2.1	17,850	東亜建設	2	2.1	17,850	東亜建設	2
ベステラ	3	3.2	2,576	西松建設	4.6	3.9	7,133	日本国土開発	6.7	6	14,622	日本国土開発	6.7	6	14,622	日本国土開発	6.7
キャンディル	1.6	1.9	2,755	三井住友建設	16.4	15.5	55,257	若築建設	20.8	20	12,140	若築建設	20.8	20	12,140	若築建設	20.8
	1.4	1.7	1,057		51.7	51.7	25,126		3.7	3.6	7,660		3.7	3.6	7,660		3.7

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
東洋建設	23.9	24.2	13,866	オエノンホールディングス	18	19.9	7,820	ヤマトインターナショナル	5.7	5.8	1,908
五洋建設	84.8	90.1	68,385	養命酒	2.1	2.3	4,330	パルプ・紙 (0.2%)			
世紀東急	10.2	10.2	8,843	コカ・コーラボトラーズJHD	48	47.2	77,030	特種東海製紙	4.1	3.9	18,271
福田組	2.5	2.4	12,192	サントリー食品インター	45.7	45.2	221,028	王子ホールディングス	277.1	297.6	173,203
住友林業	53.9	54.4	120,332	グッドグループHD	3.5	3.8	22,344	日本製紙	29.3	29.5	36,196
日本基礎技術	7.3	6.3	3,830	伊藤園	20.8	20.5	158,670	三菱製紙	7.3	7.8	2,964
巴コーポレーション	9.2	8.4	4,107	キーコーヒー	6.7	6.9	15,587	北越コーポレーション	39.9	48.7	32,434
大和ハウス	209.9	194.3	738,340	ユニカフェ	1.6	2.5	2,730	中越パルプ	2.8	2.3	2,838
ライト工業	12.2	12.2	23,838	ジャパンフーズ	0.9	1	1,258	巴川製紙	2.1	2.1	1,877
積水ハウス	229.3	227.9	541,376	日清オイリオグループ	8.8	8.5	26,690	大王製紙	29	31.8	69,546
日特建設	5.5	5.3	3,895	不二製油グループ	16.7	16.5	43,840	阿波製紙	2	1.6	668
北陸電気工事	3.6	3.4	4,617	かどや製油	0.8	0.7	2,996	レンゴー	62.5	68.3	61,879
ユアテック	11.9	12.1	8,990	J-オイルミルズ	3.6	6.2	11,482	トーモク	4.1	4.1	7,990
日本リーテック	4.5	4.4	7,862	キッコーマン	49.1	48.5	461,720	ザ・バック	5	4.8	14,856
四電工	1.1	1.2	4,254	味の素	150.4	160.3	555,279	化学 (7.2%)			
中電工	8.2	10.1	23,714	キユーピー	38.1	37.8	105,953	クラレ	104.8	96.3	101,789
関電工	29.8	34.9	33,015	ハウス食品G本社	25.6	25.1	93,497	旭化成	439.2	435.4	541,419
きんでん	50.1	42.2	82,712	カゴメ	26	25.4	76,454	共和レザー	3.6	3.3	2,339
東京エネシス	7	6.7	7,309	焼津水産化工	3.2	3.1	3,199	昭和電工	47.5	47	127,887
トーエネック	2	2	7,500	アリアケジャパン	6.2	6.2	41,664	住友化学	488.4	518.1	306,197
住友電設	6	5.9	14,000	ビエトロ	0.8	0.9	1,640	住友精化	3	3.2	11,808
日本電設工業	11.6	11.1	20,723	エバラ食品工業	1.7	1.7	4,437	日産化学	36.8	36	249,120
協和エクシオ	32.2	32.3	91,441	やまみ	0.6	0.8	1,596	ラサ工業	2.3	2.2	4,303
新日本空調	5.6	5.4	13,748	ニチレイ	32.6	32.1	95,658	クレハ	5.7	5.6	44,576
九電工	14.9	14.8	58,904	東洋水産	35.1	34.7	182,522	多木化学	2.6	2.6	18,200
三機工業	15.3	15.5	23,870	イートアンドHLDGS	2.3	2.3	5,287	テイカ	4.9	4.6	6,412
日揮ホールディングス	65.8	70.1	68,698	大冷	0.8	1.1	2,206	石原産業	11.9	12.1	16,068
中外炉工業	2.3	2.4	4,447	ヨシムラ・フード・HLDGS	3.8	4	3,052	片倉コープアグリ	1.6	1.6	1,964
ヤマト	6.8	6.8	5,331	日清食品HD	29	26.4	243,672	日本曹達	9.9	9.1	32,760
太平洋電業	5.2	4.9	14,283	永谷園ホールディングス	3.4	3.5	7,619	東ソー	102.5	101.6	211,429
高砂熱学	17.7	18.7	40,878	一正蒲鉾	2.6	2.8	2,648	トクヤマ	19.2	19.3	42,730
三晃金属	0.8	0.9	2,079	フジッコ	7.4	7.5	14,617	セントラル硝子	13.5	12	26,532
朝日工業社	1.4	1.4	4,949	ロックフィールド	7.3	7.5	12,795	東亜合成	41.5	39	52,494
明星工業	13.8	13.1	10,087	日本たばこ産業	364.8	360.4	779,905	大阪ソーダ	6.7	6.4	17,984
大気社	10.4	10.1	33,885	ケンコーマヨネーズ	3.8	4	6,712	関東電化	15.8	15	16,275
ダイダ	5.1	4.6	12,521	わらべや日洋HD	4.4	4.6	11,785	デンカ	24.2	24	97,080
日比谷総合設備	6.9	6.7	13,192	なとり	3.9	4.1	8,183	信越化学	113.7	121.6	2,571,840
フィル・カンパニー	1.2	1.3	3,926	イフジ産業	1	1.5	1,432	日本カーバイド	2.1	2.2	3,174
OSJBHD	33.3	—	—	ビックルスコーポレーション	1.5	3.4	7,473	堺化学	4.3	4.4	10,524
東洋エンジニア	8.7	9.1	8,071	北の達人コーポ	23.8	24	11,664	第一稀元素化学工	7.1	7.3	11,877
レイズネクス	11.2	11.1	13,708	ユーグレナ	29.4	35.3	30,816	エア・ウォーター	61.8	67.3	121,678
食料品 (3.4%)				ミヨシ油脂	2.5	2.3	3,079	日本酸素HLDGS	63.7	54.3	156,221
ニッポン	20.1	19.5	32,565	理研ビタミン	6.5	6.4	12,371	日本化学工業	2.1	1.9	6,289
日清製粉G本社	77.3	76.2	146,761	繊維製品 (0.5%)				東邦アセチレン	0.8	1.2	1,634
日東富士製粉	0.5	0.5	3,390	片倉工業	9.2	8.8	13,912	日本パーカライジング	33.6	32	39,200
昭和産業	6.3	5.9	16,726	グンゼ	4.9	4.8	21,048	高圧ガス	10.6	9.8	7,859
鳥越製粉	6	6.4	5,030	東洋紡	26.4	25.6	35,737	チタン工業	0.9	0.9	1,746
中部飼料	8.4	8.4	9,752	ユニチカ	19.8	18.5	7,141	四国化成	9.7	8	11,448
フィード・ワン	45.7	9.3	7,244	富士紡ホールディングス	3.2	3.2	14,464	戸田工業	1.5	1.5	4,972
東洋精糖	1.2	1.5	1,795	倉敷紡績	6.6	5.6	11,407	ステラ ケミファ	3.6	3.5	10,535
日本甜菜糖	3.5	3.5	5,866	シキボウ	4	3.7	3,492	保土谷化学	2.5	1.9	9,842
DM三井製糖ホールディ	6	5.1	10,383	日本毛織	21.4	20.2	21,068	日本触媒	10.2	11.7	69,498
塩水港精糖	6.9	10.3	2,317	ダイトウボウ	12.1	12.1	1,210	大日精化	5.9	5	14,110
日新製糖	3.3	3.1	5,446	トーア紡コーポレーション	2.6	2.3	995	カネカ	17.2	17	81,005
森永製菓	16	15.7	66,332	ダイドーリミテッド	9.7	7.6	1,307	三菱瓦斯化学	61.8	65.8	154,827
中村屋	1.8	1.6	6,312	帝国繊維	7.5	7.6	15,922	三井化学	61.50004	57	224,580
江崎グリコ	19	18.4	80,592	帝人	54.1	61.6	100,038	J S R	61.8	66.3	287,410
名糖産業	3.3	3.2	5,744	東レ	480.7	476.3	346,412	東京応化工業	11.4	11.4	87,666
井村屋グループ	3.8	3.8	9,237	サカイオーベックス	1.7	—	—	大阪有機化学	6.1	6.1	25,345
不二家	3.8	4.1	9,987	住江織物	1.4	1.4	2,641	三菱ケミカルHLDGS	442.5	439.1	453,151
山崎製パン	51.2	50.7	101,349	日本フエルト	3.5	3	1,401	K Hネオケム	11	11.1	35,131
第一屋製パン	1.3	1.8	1,441	イチカフ	0.9	0.8	1,146	ダイセル	86.7	88.5	78,853
モロゾフ	1.1	1.1	6,149	日東製網	0.8	0.9	1,341	住友ベークライト	10.5	10.4	55,744
亀田製菓	3.9	3.8	17,480	アツギ	5.3	5.2	3,354	積水化学	139.9	137.3	276,110
寿スピリッツ	6.6	6.6	47,322	ダイニツ	2.4	2.5	1,955	日本ゼオン	60.2	59.3	93,931
カルビー	31.2	30.6	87,332	セーレン	16.4	16.4	34,440	アイカ工業	19.9	18.2	70,616
森永乳業	12.6	12.6	90,216	ソトー	2.4	1.8	1,477	宇部興産	33.4	33.1	75,732
六甲バター	4.5	4.5	7,663	東海染工	0.9	0.8	908	積水樹脂	11.9	10.2	22,378
ヤクルト	46.8	46.4	270,048	小松マテーレ	10.8	10.5	10,741	タキロンシーアイ	14	13.8	9,259
明治ホールディングス	45	44.2	323,986	ワコールホールディングス	16.7	16.3	37,310	旭有機材	3.8	3.6	5,626
雪印メグミルク	16.5	16	37,552	ホギメディカル	7.5	8.7	28,579	ニチパン	3.5	3.2	5,872
プリマハム	10.7	9.6	29,184	クラウドディアHLDGS	1.7	2.1	594	リケンテクノス	16.6	16.2	9,525
日本ハム	26.1	25.7	112,566	T S Iホールディングス	22.1	19.7	6,638	大倉工業	3.1	3.5	7,910
林兼産業	2.3	2.8	1,705	マツオカコーポレーション	1.9	2	2,900	積水化成品	8.9	7.9	4,858
丸大食品	7.3	6.4	11,526	ワールド	9.5	8.5	12,087	群栄化学	1.4	1.4	4,424
S Foods	5.5	6	18,900	三陽商会	3.5	4	3,788	タイガース ポリマー	3.4	2.2	957
柿安本店	2.3	2.2	5,896	ナイガイ	2.5	3.2	1,126	ミライアル	2.3	1.9	3,106
伊藤ハム米久HLDGS	44.2	42.8	32,613	オンワードホールディングス	40.1	41.8	13,501	ダイキアクシス	2.4	2.6	2,459
サッポロホールディングス	23.3	22.8	57,433	リュックホールディングス	2.1	2.3	3,192	ダイキョーニシカフ	14.1	13.7	9,192
アサヒグループホールディ	143.3	158.6	869,921	ゴールドウイン	12	11	80,630	竹本容器	2.2	2.9	2,711
麒麟HD	288	247.6	507,332	デサント	13	11.4	43,890	森六ホールディングス	3.6	3.5	7,574
宝ホールディングス	50.7	50.2	78,563	キング	3	3.4	1,740	日本化薬	41.4	39.9	51,111

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株 評価額		株数	千株	株数	千株 評価額		株数	千株	株数	千株 評価額
カーリットホールディングス	6.9	6.3	5,859		大日本住友製薬	50.2	50.2	103,261		品川リフラクトリーズ	1.7	1.5	5,985	
日本精化	5.4	4.8	12,201		塩野義製薬	85.1	84.3	621,375		黒崎播磨	1.3	1.1	5,522	
扶桑化学工業	6.7	5.3	27,931		わかもと製薬	8.5	8.5	2,924		ヨータイ	5.3	5	6,855	
トリケミカル	1.5	6.4	23,616		あすか製薬	7.7	—	—		イソライト	3.4	3	2,406	
ADEKA	30.5	30.2	79,818		日本新薬	17.7	19.1	183,933		東京窯業	8.4	7.7	2,671	
日油	24.9	24.9	167,826		ビオフェルミン製薬	1.2	—	—		ニッカトー	3	2.9	2,093	
新日本理化学	10.7	13	4,745		中外製薬	211.4	210.1	867,502		フジミインコーポレーテッド	6.1	5.5	37,125	
ハリマ化成グループ	5.5	4.7	4,488		科研製薬	11.6	11.3	54,409		クニミネ工業	2.8	2.2	2,490	
花王	162	148.3	991,088		エーザイ	81	74.4	623,397		エーアンドエーマテリアル	1.1	0.9	909	
第一工業製薬	2.5	2.3	7,659		ロート製薬	34.7	31.8	111,141		ニチアス	18.6	16.9	48,824	
石原ケミカル	1.8	1.7	5,100		小野薬品	155.3	153.7	409,303		ニチハ	9.5	9.2	31,050	
日華化学	2.2	2.7	2,837		久光製薬	17.9	19.4	84,293		鉄鋼 (0.8%)				
ニイタカ	1.4	1.5	3,633		持田製薬	9.3	9.2	32,660		日本製鉄	299.9	317	651,910	
三洋化成	3.9	3.9	23,478		参天製薬	126.1	117	189,540		神戸製鋼所	123.2	122.5	83,912	
有機合成薬品	5.9	5.7	1,846		扶桑薬品	2.4	2.1	5,571		中山製鋼所	8.7	8.4	3,654	
大日本塗料	7.5	7	6,188		日本ケミファ	0.9	0.8	1,876		合同製鐵	3.6	3.5	5,390	
日本ペイント HOLD	54.7	247.6	323,118		ツムラ	21	22.5	86,062		JFEホールディングス	181.8	192.4	339,008	
関西ペイント	74.5	74	217,486		日医工	19.2	19	17,252		東京製鐵	32.6	26.2	31,518	
神東塗料	6.8	5.8	1,142		キッセイ薬品工業	12	11.5	28,957		共英製鋼	7.6	7.4	10,493	
中国塗料	18.8	16.4	14,727		生化学工業	13.2	11.5	12,937		大和工業	14.2	14.1	53,721	
日本特殊塗料	5	4.9	5,316		栄研化学	11.9	12	26,988		東京鐵鋼	2.7	2.7	4,363	
藤倉化成	8.9	8.2	4,600		日水製薬	2.8	2.5	2,555		大阪製鐵	3.6	3.3	3,719	
太陽ホールディングス	4.9	4.9	29,645		鳥居薬品	4.3	4.2	12,810		淀川製鋼所	8.9	8.4	21,092	
DIC	28.1	27.2	89,488		JCRファーマ	4.8	19.3	56,857		丸一鋼管	21.7	21.4	59,192	
サカタインクス	14.6	13.7	16,686		東和薬品	8.6	9.8	32,634		モリ工業	2	1.9	4,694	
東洋インキSCホールディン	13.9	13.3	28,222		富士製薬工業	4.6	4.5	5,413		大同特殊鋼	11.1	11	54,560	
T&K TOKA	5.1	4.6	4,057		沢井製薬	13.9	—	—		日本高周波	2.4	2.3	945	
富士フイルム HLDGS	129.7	118.1	1,144,861		ゼリア新薬工業	12.3	12.1	26,414		日本冶金工	5.5	5.1	13,948	
資生堂	134.5	125.3	957,041		第一三共	193.5	527.7	1,593,654		山陽特殊製鋼	4.6	7.8	13,540	
ライオン	88	81.1	149,629		キョーリン製薬HD	15	14.8	27,557		愛知製鋼	3.6	3.8	10,374	
高砂香料	4.3	4.2	12,768		大幸薬品	8.3	10.5	9,933		日立金属	72.1	63.1	135,791	
マンダム	15.3	14.5	23,214		ダイト	4.2	4.3	15,028		日本金属	1.6	1.7	1,866	
ミルボン	9.1	8.5	58,310		大塚ホールディングス	140.5	139	675,123		大平洋金属	4.5	4.5	8,523	
ファンケル	27.5	24.7	94,477		大正製薬HD	14.3	16.8	113,232		新日本電工	43.6	44.3	14,530	
コーセー	12.8	12.8	165,120		ペプチドリーム	34.4	35.4	133,989		栗本鉄工所	3.3	2.9	4,903	
コタ	3.9	4.7	7,985		あすか製薬HD	—	7.8	8,564		虹技	1	0.8	919	
シーボン	0.8	0.8	1,518		サウイグループHD	—	14.8	76,664		日本鋳鉄管	0.8	0.7	850	
ポーラ・オルビス HD	29.1	28.9	74,851		石油・石炭製品 (0.4%)					三菱製鋼	4.9	5	6,450	
ノエビアホールディングス	5.8	5.6	33,544		日本コークス工業	56	58.3	7,695		日亜鋼業	9.6	8.8	2,798	
アジュバンホールディング	1.4	1.9	2,029		ニチレキ	8	7.7	10,564		日本精線	1.1	1	5,010	
エステー	4.4	4.2	7,677		ユシロ化学	3.7	3.4	4,158		エンビプロHD	3	3.2	5,705	
アグロカネショウ	2.7	2.5	3,887		ビービー・カストロール	2.4	2.4	3,324		シンニッタン	10.4	8.5	2,116	
コニシ	11.1	10.9	19,652		富士石油	17.7	18.9	4,895		新家工業	1.5	1.6	2,481	
長谷川香料	11.7	11.5	32,959		MORESCO	2.3	2.1	2,564		非鉄金属 (0.7%)				
星光PMC	3.8	3.8	3,332		出光興産	74.9	73.9	213,644		大紀アルミニウム	11	10.1	18,664	
小林製薬	19	18.8	171,080		ENEOSホールディングス	1,014.5	1,004.4	462,124		日本軽金属HD	170.7	17.7	35,683	
荒川化学工業	6.1	5	6,455		コスモエネルギーHLDGS	19.7	21.3	50,523		三井金属	18.2	18	59,040	
メック	4.6	5.2	18,746		ゴム製品 (0.7%)					東邦亜鉛	3.4	3.6	10,328	
日本高純度化学	1.8	2	6,140		横浜ゴム	39.4	39.2	77,772		三菱マテリアル	44.2	43.6	97,620	
タカラバイオ	17.8	17.7	57,436		TOYO TIRE	35.9	35.7	70,614		住友鉱山	85.5	85	351,985	
JCU	8.2	7.5	35,550		ブリヂストン	179.5	193.5	1,026,130		DOWAホールディングス	17	17	77,775	
新田ゼラチン	4	4	2,632		住友ゴム	61.2	60.9	85,625		古河機金	12	10.3	12,833	
OATアグリオ	1.2	1.2	2,274		藤倉コンポジット	6.2	6.2	4,984		エス・サイエンス	37.6	35.4	1,239	
デクセリアルズ	17.6	19.6	44,825		オカモト	4.1	3.9	17,316		大阪チタニウム	6.9	6.7	5,286	
アース製薬	4.8	5.6	39,144		フコク	3	3.1	3,292		東邦チタニウム	12	12.5	14,875	
北興化学	6.6	6.4	7,603		ニッタ	7.7	6.8	19,278		UACJ	10.2	10	28,670	
大成ラミック	2.2	2.4	6,955		住友理工	13.3	13.3	9,948		CKサンエツ	1.4	1.4	4,620	
クミアイ化学	28.1	27.1	25,474		三ツ星ベルト	9	7.7	16,023		古河電工	20.9	20.6	49,543	
日本農薬	12	12.1	6,776		バンドー化学	12	11.1	10,678		住友電工	250.1	230.9	344,618	
アキレス	4.7	4.5	6,228		ガラス・土石製品 (0.8%)					フジクラ	81.2	80.7	55,440	
有沢製作所	10.7	9	8,163		日東紡績	10.1	10	37,250		昭和電線 HLDGS	7.8	6.7	15,470	
日東電工	46.7	40.5	336,555		AGC	62.1	61.7	351,690		東京特殊電線	1	0.7	2,065	
レック	7.2	7.8	8,689		日本板硝子	32.3	34.6	19,895		タツタ電線	13.3	12.5	6,787	
三光合成	7.5	7.2	3,297		石塚硝子	1.2	1	2,262		カナレ電気	1.1	0.9	1,592	
きもと	12.4	12.7	3,225		日本山村硝子	2.8	2.4	2,200		平河ヒューテック	3.3	3.7	4,621	
藤森工業	6.1	6	29,580		日本電気硝子	25.5	26.9	64,775		リョービ	8.3	7.8	10,124	
前澤化成工業	4.3	4.5	5,868		オハラ	2.7	2.8	4,370		アーレスティ	8.6	8.1	3,726	
未来工業	3.5	2.5	4,135		住友大阪セメント	12.8	11.9	37,544		アサヒHD	11.8	25.6	54,528	
ウェーブロック HLDGS	2.3	2.3	1,626		太平洋セメント	43	38	93,100		金属製品 (0.6%)				
ジェイ エス ピー	4	4.3	7,193		日本ヒューム	6.7	5.6	4,211		稲葉製作所	3.7	4.9	6,909	
エフビコ	7.5	12.5	53,500		日本コンクリート	14.6	15	4,665		宮地エンジニアリングG	2	2.3	6,046	
天馬	4.5	5.2	15,600		三谷セキサン	3.1	3.1	21,359		トーカロ	18.7	16.7	24,248	
信越ポリマー	12.2	9.9	10,662		アジアパイルHD	9.6	9.6	4,809		アルファ CO	2.2	2.2	2,851	
東リ	16.8	14.7	3,528		東海カーボン	66.3	56.9	87,284		SUMCO	80.1	84.6	201,771	
ニフコ	25.1	25	90,625		日本カーボン	3.5	3.7	15,743		川田テクノロジーズ	1.4	1.3	4,914	
バルカー	5.5	5.3	12,110		東洋炭素	4	4.6	13,938		RS TECHNOLOGIES	1.9	2.2	13,574	
ユニ・チャーム	143.7	129.4	640,788		ノリタケ	3.8	3.7	17,038		信和	3.6	3.5	2,520	
ショーエイコーポ	0.9	2.2	1,872		OTTO	48.3	47.9	267,282		東洋製罐グループHD	42.9	42.4	57,028	
医薬品 (5.1%)					日本碍子	81.6	73.3	138,097		ホッカンホールディングス	3.7	3.1	4,535	
協和キリン	68	79	326,270		日本特殊陶業	51.6	51.5	92,545		コロナ	3.4	3.7	3,407	
武田薬品	562.5	558.4	2,099,025		ダントーホールディングス	6.3	6.2	1,612		横河ブリッジ HLDGS	12.5	11.6	28,744	
アステラス製薬	586.3	581.9	1,091,644		MARUWA	2.6	2.4	28,368		駒井ハルテック	1.2	1.4	2,490	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
高田機工	0.6	0.6	1,765	千円	オカダアイオン	2	2.1	2,883	千円	キッツ	27.7	22.6	19,187	千円
三和ホールディングス	63.4	62.7	94,739		ワイエイシイホールディングス	2.8	2.8	2,548		マキタ	88.2	87.6	598,308	
文化シャッター	19.8	20.2	23,896		小松製作所	306.9	304	825,208		日立造船	53.6	54.6	50,232	
三協立山	8.7	8.7	6,907		住友重機械	39	38.5	116,462		三菱重工業	113.9	105.7	316,360	
アルインコ	4.9	4.4	4,545		日立建機	27.3	31.6	100,804		I H I	49.1	45.3	116,375	
東洋シャッター	1.7	1.7	1,147		日工	9.2	10.1	6,928		スター精密	10.5	10.4	17,097	
L I X I L	98.8	91.3	287,595		巴工業	2.7	2.6	6,541		電気機器 (18.8%)				
日本フィルコン	5	4.2	2,196		井関農機	6.8	6.3	10,930		日清紡ホールディングス	42.4	40.4	33,814	
ノーリツ	14	13.6	25,513		T O W A	6.8	6.3	17,595		イビデン	41.5	32.6	217,442	
長府製作所	6.8	6.5	14,098		丸山製作所	1.8	1.3	2,141		コニカミノルタ	148.9	137.2	82,457	
リンナイ	13.1	12.9	168,345		北川鉄工所	3	2.7	4,471		ブラザー工業	83.1	81.6	207,753	
ダイニチ工業	3.5	3.8	2,990		ローツェ	3	3.1	27,962		ミネベアミツミ	125.9	115.7	340,505	
日東精工	9.2	8.6	5,882		タカキタ	2.5	2.2	1,546		日立	325	322.9	2,080,444	
三洋工業	0.8	0.7	1,332		クボタ	359	327.4	791,980		東芝	—	133	629,090	
岡部	13.7	12.2	8,564		荏原実業	1.7	3.4	9,832		三菱電機	676.1	670.3	1,056,727	
ジーテクト	8.4	7.9	11,865		三菱化工機	2.3	2.3	5,646		富士電機	41	40.6	208,278	
東プレ	12.6	12.3	16,912		月島機械	12.6	11.8	14,289		東洋電機製造	2.4	2.4	2,865	
高周波熱錬	12.9	11.8	8,047		帝国電機製作所	5.6	4.5	6,507		安川電機	72.9	72.2	423,814	
東京製綱	4.7	2.9	2,871		東京機械	3.1	3.4	6,721		シンフォニアテクノロジー	8.8	8.6	10,569	
サンコール	4.9	5.4	2,565		新東工業	16.2	15.3	12,148		明電舎	12.5	11.3	28,464	
モリテックスチル	5.4	5.4	2,467		渋谷工業	5.9	5.9	19,145		オリジン	1.8	1.6	2,160	
パイオラックス	9.9	9.3	14,703		アイチコーポレーション	11.8	11.2	8,803		山洋電気	3.3	3.3	24,090	
エイチワン	6.4	6.4	4,755		小森コーポレーション	17.3	16.8	15,120		デンヨー	5.8	5.6	12,796	
日本発条	72	66.5	53,931		鶴見製作所	5.1	5	9,225		東芝テック	8.5	7.2	34,020	
中央発條	0.7	4.4	4,950		住友精密	1	0.9	2,277		芝浦メカトロニクス	1.2	1.3	9,646	
アドパネクス	0.9	1.1	1,513		日本ギア工業	2.4	2.4	760		マブチモーター	18.8	15.7	60,288	
立川ブラインド	3	3.1	4,123		酒井重工業	1.2	1.1	2,866		日本電産	162.7	161.6	2,156,552	
三益半導体	5.3	5	12,975		荏原製作所	28.1	28	162,960		ユーエムシーエレクトロニクス	4.2	3.9	3,026	
機械 (5.6%)					石井鉄工所	0.9	0.9	2,799		トレックス・セミコンダクター	3.9	3.8	10,138	
日本ドライケミカル	1.7	1.6	3,721		西島製作所	6.8	6.6	6,263		東光高岳	3.7	3.4	5,113	
日本製鋼所	20.4	20.3	60,027		北越工業	7	6.8	7,051		ダブル・スコープ	10.7	19.3	17,370	
三浦工業	28.9	28.8	144,000		ダイキン工業	86.2	85.5	2,281,140		宮越ホールディングス	2.7	2.7	3,472	
タクマ	22.7	22.9	37,349		オルガノ	2.4	2.3	16,031		ダイヘン	7.5	7.4	37,518	
ツガミ	13.9	14.3	27,770		トーヨーカネツ	3	2.6	7,001		ヤーマン	11.1	11.5	16,514	
オークマ	7.9	7.6	42,864		栗田工業	36.7	36.7	215,796		J V C ケンウッド	55.1	60.1	12,621	
芝浦機械	7.6	6.8	18,938		椿本チエイン	9.8	9.6	34,800		ミマキエンジニアリング	6	6.2	5,611	
アマダ	83.3	97.1	116,617		大同工業	3.2	3.3	3,643		I - P E X	2.8	3.2	6,595	
アイダエンジニア	17.7	16.9	18,995		木村化工機	5.7	6.3	4,731		日新電機	16	15.8	22,467	
滝澤鉄工所	2	1.8	2,068		アネスト岩田	10.6	10.9	10,627		大崎電気	13.3	13.2	7,418	
F U J I	29	26.4	80,652		ダイフク	34.7	37	412,180		オムロン	60.6	55.8	640,584	
牧野フライス	7.9	7.7	34,342		サムコ	1.9	1.7	5,040		日東工業	10	9.8	17,257	
オーエスジー	31.2	30.3	62,024		加藤製作所	3.7	3.4	3,083		I D E C	9.8	9.2	20,884	
ダイジェット	0.7	0.7	884		油研工業	1.1	0.9	1,611		正興電機製作所	1.8	2.5	3,585	
旭ダイヤモンド	17.6	16.3	10,660		タダノ	32.8	32.7	39,141		不二電機工業	1	1	1,276	
D M G 森精機	42.6	39.7	84,402		フジテック	24.8	23.3	66,731		ジーエス・ユアサコーポ	22.7	24.4	63,049	
ソデイツク	15.4	16.1	15,182		C K D	18.7	15.7	39,673		サクサホールディングス	1.5	1.5	2,121	
ディスコ	9.1	9	303,300		キトー	5.2	5.6	10,332		メルコホールディングス	2.3	2.4	11,904	
日東工器	3.7	3.2	6,556		平和	18.7	18.3	37,789		テクノメディカ	1.5	1.4	2,380	
日進工具	2.6	5.1	7,466		理想科学工業	6	5	12,535		ダイヤモンドエレクトリックHD	1.4	2	4,736	
パンチ工業	5.9	5.8	3,642		S A N K Y O	15	16	44,816		日本電気	82	85.5	531,810	
富士ダイス	2.9	2.8	1,920		日本金銭機械	7.3	6.6	4,237		富士通	65.2	60.5	1,272,315	
豊和工業	3.9	3.8	3,195		マースグループ HLDGS	4.2	3.8	6,422		沖電気	27.7	27.1	26,639	
O K K	2.7	2.9	1,209		フクシマガリレイ	4.2	4.7	24,205		岩崎通信機	2.9	2.9	2,636	
石川製作所	1.7	1.8	2,943		オーイズミ	2.8	2.3	883		電気興業	3.3	3.1	8,022	
東洋機械金属	4.6	3.9	2,020		ダイコク電機	3.1	2.6	3,426		サンケン電気	7.4	7.5	51,525	
津田駒工業	1.2	1.3	1,095		竹内製作所	11.4	11.6	30,345		ナカヨ	1.3	1.1	1,580	
エンシュウ	1.5	1.4	1,124		アマノ	17.8	17.6	52,800		アイホン	3.8	4.3	10,109	
島精機製作所	10.6	9.4	22,785		J U K I	9.3	9.2	7,709		ルネサスエレクトロニクス	290.1	362.2	496,938	
オプトラン	7.5	8.3	19,239		サンデンホールディングス	9	9.2	2,723		セイコーエプソン	84.4	83.4	190,068	
NC ホールディングス	2	2.7	3,780		蛇の目マシン	6	6.5	4,927		ワコム	45.8	49.2	36,211	
イワキポンプ	4.2	4	4,124		マックス	10.4	8.8	17,485		アルパック	12.5	12.5	81,500	
フリーユー	6.5	6.8	12,512		グローリー	17.5	16.9	42,976		アクセル	2.7	2.8	2,164	
ヤマシンフィルタ	14.6	13.8	9,480		新晃工業	6.3	6.3	14,351		E I Z O	5.3	5.8	24,766	
日阪製作所	8.4	8.1	7,500		大和冷機工業	9.8	10.9	13,995		ジャパンディスプレイ	61.7	61.7	2,282	
やまびこ	13	12.6	16,430		セガサミーホールディングス	67.1	60.8	96,976		日本信号	17.4	15.5	15,577	
平田機工	3.2	3	21,060		日本ビストンリング	2.4	2.7	3,982		京三製作所	15.8	13.4	7,169	
ペガサスマシン製造	6.6	6.6	2,976		リケン	3.1	2.9	8,418		能美防災	9	8.8	18,585	
マルマエ	2.7	2.9	6,304		T P R	9.1	8.6	13,201		ホーチキ	4.9	4.6	5,543	
タツモ	3.1	3.1	5,006		ツバキ・ナカシマ	13.8	15	22,755		星和電機	3.5	3.4	1,788	
ナプテスコ	39.5	39	181,935		ホシザキ	19.9	19.6	208,152		エレコム	7.6	15.6	29,016	
三井海洋開発	7.1	7.3	12,548		大豊工業	5.4	6	5,106		パナソニック	773.4	715.6	990,748	
レオン自動機	6.6	6.3	9,884		日本精工	128.4	138	104,466		シャープ	78.8	89.6	124,185	
S M C	21.2	19.6	1,515,668		N T N	157.3	154.3	38,575		アンリツ	43.6	40.9	83,108	
ホンカワミクロン	2.4	2.3	16,744		ジェイテクト	65.5	64.7	62,176		富士通ゼネラル	18.5	20.8	60,569	
ユニオンツール	2.5	2.6	10,439		不二越	6.4	6	27,420		ソニーグループ	423.6	420.6	5,190,204	
オイレス工業	8.8	8.9	15,379		日本トムソン	19.9	18.6	10,230		T D K	32.7	32.5	404,950	
日精エーエスピー	2	2.2	9,130		T H K	39.6	39	100,893		帝国通信工業	3	2.7	4,317	
サトーホールディングス	9.6	8.6	24,123		ユーシン精機	5.3	4.3	3,581		タムラ製作所	22.7	25.2	18,849	
技研製作所	5.9	5.9	28,585		前澤給装工業	2.4	4.7	4,991		アルプスアルパイン	60.3	54.7	66,351	
日本エアテック	2.3	3.2	4,099		イーグル工業	8.5	8.1	10,327		池上通信機	2.1	2.4	1,936	
カワタ	1.9	1.8	1,816		前澤工業	4	4.9	3,973		日本電波工業	6.3	7.1	6,397	
日精樹脂工業	5.6	5.5	6,534		日本ピラー工業	6.8	7.3	20,272		鈴木	3.3	3.1	2,690	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
日本トリム	0.9	1.6	6,056	千円	キヤノン	336.3	333.6	896,716	千円	インターアクション	3.6	3.5	9,877	千円
ローランドディー・ジー	3.7	4	12,400		リコー	173.2	171.6	188,931		オーバル	6.4	6.6	1,782	
フオスター電機	7.1	6.6	6,164		象印マホービン	18.4	17.9	33,562		東京精密	12.4	11.4	54,492	
S M K	1.7	1.6	3,825		MUTOH ホールディングス	1	0.9	1,499		マニー	27	26.7	60,261	
ヨコオ	4.4	5.5	14,157		東京エレクトロン	43	39.3	2,124,951		ニコン	104.1	102.7	134,947	
ティアック	4.9	5.2	608		輸送用機器 (7.6%)					トプコン	34.3	34	70,142	
ホシデン	18.6	18	17,154		トヨタ紡織	19.8	19.8	39,857		オリンパス	374.2	352.1	818,984	
ヒロセ電機	10.4	10.4	204,568		芦森工業	1.3	1.2	1,258		理研計器	6	5.9	18,142	
日本航空電子	15.6	15.8	26,322		ユニプレス	13.2	10.6	9,826		タムロン	5.5	5.6	15,573	
T O A	7.3	7.4	6,445		豊田自動織機	54.8	54.3	518,565		H O Y A	134.1	131	2,412,365	
マクセルホールディングス	14.6	13.1	17,344		モリタホールディングス	12	10.2	16,238		シード	2.9	2.4	1,644	
古野電気	8.7	8.5	9,868		三桜工業	8.6	9.5	10,089		ノーリツ鋼機	4.6	6.2	17,050	
ユニデンホールディングス	1.9	1.8	5,094		デンソー	148.8	147.8	1,143,972		エー・アンド・デイ	6.1	5.8	6,153	
スミダコーポレーション	5.2	6.2	7,570		東海理化電機	18	17.5	28,892		朝日インテック	76.6	72.2	233,928	
アイコム	3.8	2.8	6,857		三井 E&SHD	21.7	21.7	10,524		シチズン時計	79.6	85.2	44,730	
リオン	2.8	2.9	8,265		川崎重工業	53	52.7	128,904		リズム	2.1	1.9	2,832	
本多通信工業	5.8	4.4	2,173		名村造船所	22.2	21.9	5,277		大研医器	5.1	4.8	2,976	
船井電機	6.8	—	—		サノヤスホールディングス	9.4	9.8	1,381		メニコン	9.6	10.5	95,550	
横河電機	62.5	66.6	131,068		日本車輦	2.5	2.2	4,620		シンシア	0.9	1.4	942	
新電元工業	2.4	2.7	11,164		三菱ロジスネクスト	9	9.1	10,474		松風	3	3.2	7,033	
アズビル	42.9	45.6	233,472		近畿車輛	1	1	1,154		セイコーHD	9.6	9.7	21,378	
東亜ディーケーケー	3.3	2.8	2,836		日産自動車	799.9	790.6	439,810		ニプロ	46.9	49.8	59,062	
日本光電工業	28	27.8	109,254		いすゞ自動車	196.8	178.9	264,593		その他製品 (2.2%)				
チノー	2.3	1.8	2,685		トヨタ自動車	754.3	680.1	6,752,712		中本パックス	1.6	1.6	3,056	
共和電業	6.9	6.6	2,580		日野自動車	85.1	84.6	85,699		スノーピーク	3.5	4.5	27,225	
日本電子材料	2.7	2.9	5,585		三菱自動車工業	252.4	250.8	69,973		パラマウントベッドHD	7.1	12.5	28,337	
堀場製作所	13.5	12.3	101,106		エフテック	4.8	5.3	3,354		トランザクシオン	4.4	4.5	5,445	
アドバンテスト	50.5	50	555,000		レシップホールディングス	2.6	2.9	1,737		粧美堂	2	2.3	984	
小野測器	2.7	2.5	1,367		GMB	1.5	1.6	1,454		ニホンフラッシュ	6.3	5.7	6,697	
エスベック	6	5.8	13,728		ファルテック	1.4	1.4	1,037		前田工業	7.5	7.6	26,182	
キーエンス	61.3	65.9	4,720,417		武蔵精密工業	15.1	15.4	29,768		永大産業	8.6	8.6	2,648	
日置電機	3.3	3.3	32,241		日産車体	13.3	9.3	7,393		アートネイチャー	7.2	6.3	4,699	
シスメックス	48.3	52.4	769,756		新明和工業	18.3	19.5	18,681		パンダイナムコHLDGS	69.9	55.5	493,006	
日本マイクロニクス	11.8	11.5	17,664		極東開発工業	12.6	11.6	20,172		アイフィスジャパン	1.8	1.8	1,294	
メガチップス	6.3	6.7	23,215		日信工業	13.3	—	—		共立印刷	11.3	8.2	1,459	
OBARA GROUP	4	3.7	15,336		トビー工業	5.6	5.4	6,744		S H O E I	6	6.5	34,125	
淨藤電機	0.9	0.8	1,640		ティラド	2.4	2.2	7,150		フランスベッドHLDGS	9.2	9.8	9,359	
原田工業	3.2	2.7	2,600		タチエス	11.1	10.5	13,734		パイロットコーポレーション	11.1	11.1	49,062	
コーセル	9	8.2	8,167		N O K	36.6	32.4	44,226		萩原工業	3.7	3.8	6,224	
イリソ電子工業	5.7	5.7	27,075		フタバ産業	18.9	16.1	7,711		トッパン・フォームズ	14.6	11.9	12,304	
オプテックスグループ	11.2	11.1	17,438		K Y B	7.6	7.7	23,408		フジールインターナショナル	15.3	13.7	35,784	
千代田インテグレ	2.9	2.7	5,896		大同メタル工業	13.1	13	8,177		タカラトミー	30.5	30.3	35,784	
アイ・オー・データ	2.3	2.4	2,205		プレス工業	33.6	32.6	11,279		廣済堂	4.9	5.2	8,632	
レーザーテック	29.8	29.6	843,896		ミクニ	8.4	7.9	2,607		エスデルホールディングス	2	4	2,640	
スタンレー電気	47.5	46.9	134,696		太平洋工業	14.3	14.1	17,018		タカノ	2.6	2.1	1,745	
岩崎電気	2.6	2.4	4,915		ケービン	15	—	—		プロネクス	5.8	5.3	5,787	
ウシオ電機	37.6	35	75,145		河西工業	9.2	9.4	3,609		ホクシン	5.7	6.9	1,166	
岡谷電機	5.2	4.6	1,669		アイシン	55.7	49.2	205,656		ウッドワン	2.4	2.5	2,870	
ヘリオステクノH	6.3	6.2	2,083		マツダ	200.4	211.9	198,126		大建工業	4.6	4.5	10,651	
エノモト	2	2.1	3,906		今仙電機製作所	6.1	5.6	4,076		凸版印刷	95.9	101.3	201,789	
日本セラミック	6.9	6.7	20,535		本田技研	532.4	528.2	1,763,131		大日本印刷	88.8	79	217,961	
遠藤照明	3.3	3.3	3,356		スズキ	134.2	133.1	676,946		共同印刷	2.1	2	5,564	
古河電池	4.8	4.9	7,604		SUBARU	210.2	192	394,944		N I S S H A	13.9	13.8	25,281	
双信電機	3.3	3.3	2,847		安永	3.3	3.2	3,830		光村印刷	0.6	0.6	1,030	
山一電機	4.9	4.5	7,600		ヤマハ発動機	88.9	87.8	270,863		TAKARA & COMPANY	3.3	3.3	6,039	
図研	4.4	4.6	19,619		ショーワ	15.4	—	—		アシックス	56.2	59.7	152,772	
日本電子	13.4	12.4	112,096		T B K	7.9	7.4	3,100		ツツミ	2.1	2.1	4,953	
カシオ	60.3	54	97,902		エクセディ	9.3	9.1	15,925		小松ウオール工業	1.9	2.2	4,371	
ファナック	63.6	58.9	1,506,367		豊田合成	22	22	50,446		ヤマハ	40.3	39.9	290,073	
日本シイエムケイ	15.9	13.9	6,268		愛三工業	10.6	10.6	8,957		河合楽器	2.1	2	7,820	
エンプラス	3.5	3.1	9,935		盟和産業	1	1.1	1,153		クリナップ	6.3	6	3,588	
大真空	2.5	2.5	10,100		日本プラスト	5	5.1	3,401		ビジョン	41.2	40.8	117,136	
ローム	28.2	27.9	312,759		ヨロズ	6.4	5.5	6,809		オリバー	1.4	—	—	
浜松ホトニクス	48.5	48.3	339,066		エフ・シー・シー	11.2	10.5	16,401		兼松サステック	0.4	0.6	1,086	
三井ハイテック	7.5	6.7	57,151		シマノ	25.3	27.1	929,530		キングジム	5.7	5.6	5,006	
新光電気工業	22.9	22.9	90,111		ティ・エス テック	15.7	30.8	44,752		リンテック	16.1	14	37,450	
京セラ	95	102	713,592		ジャムコ	3.3	4.3	4,235		イトーキ	14.4	12.9	5,108	
太陽誘電	30.2	30	221,700		精密機器 (3.0%)					任天堂	41.5	38.5	2,027,410	
村田製作所	198.6	197.2	1,974,958		テルモ	191.4	205.8	1,094,032		三菱鉛筆	11.3	10.6	15,984	
双葉電子工業	10.8	10.8	8,834		クリエートメディック	2.1	1.8	1,796		タカラスタンダード	13.7	13.2	21,978	
北陸電気工業	2.7	2.2	2,321		日機装	20.4	21.5	20,790		コクヨ	32.3	32.5	65,162	
ニチコン	23.1	21.8	23,805		日本エム・ディ・エム	3.9	4	9,068		ナカバヤシ	6.6	5.8	3,520	
日本ケミコン	5.1	7	15,582		島津製作所	80.9	86.5	462,775		グローブライド	3	3.4	32,164	
K O A	10.2	9.6	17,068		J M S	5.7	5.9	4,967		オカムラ	23.5	23.6	40,049	
市光工業	10.2	9.8	6,154		クボテック	1.9	1.8	545		美津濃	6.2	6.8	18,700	
小糸製作所	40.6	40.1	273,482		長野計器	5	5.1	5,967		電気・ガス業 (1.2%)				
ミツバ	12.4	12.7	8,521		ブイ・テクノロジ	3.2	3.1	14,554		東京電力HD	542	573.4	177,180	
SCREEN ホールディングス	11.8	11.7	119,457		東京計器	4.2	4.1	4,309		中部電力	205.8	204.9	279,483	
キヤノン電子	6.1	6.2	10,180		愛知時計	0.9	0.7	3,360		関西電力	255.9	253.5	291,905	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
中国電力	97.1	97.7	104.343		三菱倉庫	20.4	22	72,380		ザッパラス	2.9	4.1	2,140	
北陸電力	62.2	62.4	38,438		三井倉庫 HOLD	7.4	6.9	18,719		システムリサーチ	1.8	2.1	4,380	
東北電力	168.3	156.4	134,660		住友倉庫	23	22.5	43,897		インターネットインシアティブ	9.9	18	71,460	
四国電力	61.1	55.1	45,567		渋沢倉庫	3.5	3.4	8,255		さくらインターネット	7	7.8	4,898	
九州電力	139.3	148.5	130,531		東陽倉庫	11.3	9.6	3,398		ヴィンクス	1.9	1.9	1,873	
北海道電力	63.7	64.3	35,300		日本トランスシティ	13.8	13.5	9,045		GMOグローバルサインHD	1.2	1.6	7,408	
沖縄電力	13.2	13	19,487		ケイヒン	0.9	1.1	1,577		SRA ホールディングス	3.6	3.6	10,659	
電源開発	54	53.3	88,904		中央倉庫	3.9	3.5	3,661		システムインテグレータ	2.3	1.8	1,137	
エフオン	3.7	4.5	4,090		川西倉庫	1.1	1.1	1,468		朝日ネット	4.7	6	4,530	
イーレックス	9.7	10.2	28,968		安田倉庫	5.1	5	5,005		e B A S E	8	8.6	7,172	
レノバ	11.3	11.7	64,233		ファイズホールディングス	1.4	1.4	1,073		アバント	6.3	7.7	11,958	
東京瓦斯	130.1	128.7	277,798		東洋埠頭	2	1.8	2,818		アドソル日進	2.4	2.7	6,166	
大阪瓦斯	131.5	120.9	257,396		宇徳	5.5	5.4	3,099		フリービット	3.7	4.7	5,480	
東邦瓦斯	33.3	33.1	179,733		上組	35.7	34.9	83,829		コムチュア	7.5	6.2	19,902	
北海道瓦斯	3.6	3.5	5,607		サンリツ	1.5	1.9	1,569		サイバーコム	1.2	1.1	1,465	
広島ガス	13	11.7	4,680		キムラユニティー	1.6	1.4	2,146		アステリア	4.4	5.2	3,666	
西部ガス HLDGS	7.6	7.4	18,973		キューソー流通システム	1.6	1.5	2,802		アイル	3.7	3.9	7,538	
静岡ガス	19.3	19.3	24,993		近鉄エクスプレス	13.7	12	37,680		マークラインズ	3.2	3.6	10,998	
メタウォーター	3.3	7.9	15,215		東海運	3.6	4	1,404		メディカル・データ・ビジ	5	8.9	14,151	
陸運業 (3.1%)					エーアイティー	4.5	4.1	5,079		g u m i	8.6	9.5	7,780	
SBS ホールディングス	5.1	5.4	22,923		内外トランスライン	2.1	2.7	6,642		ショーケース	1.6	1.9	1,238	
東武鉄道	70.4	69.5	206,971		日本コンセプト	2	2.2	4,952		モバイルファクトリー	1.6	2.1	2,188	
相鉄ホールディングス	21.6	22.6	50,488		情報・通信業 (8.5%)					テラスカイ	2.4	2.5	5,400	
東急	170.5	168.3	270,626		NEC ネットズエスアイ	18.9	22.3	49,082		デジタル・インフォメーション	2.9	3.4	6,953	
京浜急行	87.1	86	116,444		クロスキャット	1.8	1.8	2,545		PCI ホールディングス	2.8	3.6	4,060	
小田急電鉄	100.5	107.3	276,297		システナ	23.7	24	57,360		パイブドHD	0.9	1.6	4,038	
京王電鉄	35.1	37.4	224,026		デジタルアーツ	3.3	3.9	36,114		アイビーシー	1.4	1.4	1,239	
京成電鉄	47.1	50.5	179,527		日鉄ソリューションズ	9.9	9.7	38,751		ネオジャパン	1.2	1.7	2,888	
富士急行	9.3	9.2	42,136		キューブシステム	3.5	3.8	4,187		P R T I M E S	1.2	1.8	5,490	
新京成電鉄	1.7	1.9	4,142		WOW WORLD	1.4	1.7	2,981		ラクス	—	20.4	94,758	
東日本旅客鉄道	119	118.2	837,801		コア	2.8	2.6	4,053		ランドコンピュータ	1	1	1,309	
西日本旅客鉄道	60.4	75	389,400		ラクーンホールディングス	3.2	5	7,595		ダブルスタンダード	0.9	1	7,830	
東海旅客鉄道	56.2	55.8	913,167		ソリトンシステムズ	3.1	3.6	5,569		オープンドア	3.4	4.3	10,074	
西武ホールディングス	88.9	81.3	108,372		ソフトクリエイトHD	2.9	2.7	9,396		マイネット	2.1	2.6	1,682	
鴻池運輸	10.9	10.4	14,227		T I S	66.3	66.3	210,171		アカツキ	2.4	2.9	9,367	
西日本鉄道	18.8	18.4	52,826		JNS ホールディングス	2.8	4.3	2,201		ベネフィットジャパン	0.5	0.7	1,640	
ハマキョウレックス	5.2	5	17,275		電算システム	2.5	—	—		UBICOMホールディングス	1.6	2	5,786	
スカイ引越センター	3.6	3.2	15,808		グリー	40.9	42.6	27,349		LINE	20.4	—	—	
近鉄グループHLDGS	64.1	63.4	236,482		コーエーテクモHD	13.6	17.9	105,252		カナミックネットワーク	6	7.5	4,740	
阪急阪神HLDGS	85.4	84	295,680		三菱総合研究所	2.9	2.8	12,418		ノムラシステムコーポレーション	3.6	3.9	1,119	
南海電鉄	30.5	29.8	71,132		ボルテージ	1.9	3.1	1,398		チェンジ	4.6	12.6	28,350	
京阪ホールディングス	28.5	28.3	88,296		電算	0.7	0.8	2,064		シンクロ・フード	2.7	5.2	2,069	
神戸電鉄	1.5	1.5	5,422		A G S	3.7	3.1	3,081		オークネット	3.6	3.9	8,872	
名古屋鉄道	52.4	52.3	106,901		ファインデックス	5.7	6.1	6,423		セグエグループ	1.3	2	1,644	
山陽電鉄	4.7	4.4	9,081		ブレインパッド	1.7	1.9	11,552		エイトレッド	1.1	1.6	4,096	
日本通運	22.2	22	178,640		K L a b	12.6	12	7,296		AOI TYO HOLDINGS	6.7	—	—	
ヤマトホールディングス	112.3	89.1	259,637		ボルトウウィン・ピットクル	8	8.9	9,095		マクロミル	13.5	13.5	10,840	
山九	17.8	16.2	86,670		イーブックイニシアティブ	0.9	1.3	5,297		ビーグリー	1.3	1.7	2,415	
丸連	3.5	4.3	1,186		ネクソン	167.2	148.6	259,752		オロ	1.7	2.3	9,165	
丸全昭和運輸	5.2	5.2	19,136		アイスタイル	18.4	21.6	9,763		ユーザーローカル	0.6	2.7	5,429	
センコーグループHLDGS	34.9	36.2	38,010		エムアップホールディングス	1.9	2	6,730		テモナ	1.3	2	1,618	
トナミホールディングス	1.5	1.5	7,875		エイチーム	4.5	5.1	7,435		ニーズウェル	1	1.8	1,405	
ニッコンホールディングス	22.9	21.3	52,376		エニゴモ	6.3	6.5	8,417		サインポスト	1.3	1.8	2,484	
日石輸送	0.6	0.6	1,602		テクノスジャパン	5.3	5.3	3,296		電算システムHD	—	2.9	8,569	
福山通運	8.2	8.1	40,743		e n i s h	3.5	3.9	1,770		ソルクシーズ	3	3	3,309	
セイノーホールディングス	47.9	47.6	65,640		コロプラ	21.9	21.3	17,657		フェイス	2.3	2.5	1,760	
エスライン	1.7	1.3	1,231		オルトプラス	4.6	5.1	2,142		プロトコーポレーション	6	8.1	12,708	
神奈川中央交通	1.5	1.5	5,415		ブロードリーフ	32.9	33.8	19,435		ハイマックス	0.8	2.2	2,448	
日立物流	11.7	13.4	66,866		クロス・マーケティングG	3.2	3.3	2,930		野村総合研究所	94	114.8	516,026	
丸和運輸機関	6.8	13.8	23,156		デジタルハーツHLDGS	3.7	3.4	7,650		サイバネットシステム	5.1	5.3	3,439	
C&F ロジホールディングス	6.5	6.3	12,196		システム情報	4.9	5.4	5,529		C E ホールディングス	4	3.8	2,382	
九州旅客鉄道	56.3	49.5	123,255		メディアドゥ	2.1	2.8	14,000		日本システム技術	1.2	1.2	2,175	
SG ホールディングス	67.2	120.5	407,892		じげん	16.5	17	6,987		インテージホールディングス	8.4	8.8	14,440	
海運業 (0.6%)					ブイキューブ	3.7	7	11,571		東邦システムサイエンス	1.7	1.4	1,491	
日本郵船	53.7	53.4	537,204		エンカレッジ・テクノロジー	1.3	1.1	674		ソースネクスト	31.6	33.4	8,183	
商船三井	40.7	37.9	348,301		サイバーリンクス	1.2	2.6	3,746		インフォコム	7.3	6.6	16,691	
川崎汽船	19.8	19.8	144,738		ディー・エル・イー	4.3	4.3	1,259		H E R O Z	0.9	2	4,066	
NS ユナイテッド海運	3.6	3.2	16,096		フィックスターズ	7.1	7.1	5,687		ラクスル	5.3	7.4	47,952	
明治海運	6.6	7	6,251		CARTA HOLDINGS	3.1	3	7,605		F I G	7.7	6.8	1,972	
飯野海運	30.2	29.3	16,818		オブティム	3.5	5	9,810		システムサポート	1.4	1.9	2,540	
共栄タンカー	1.2	1.2	1,300		セレス	2.3	2.6	7,033		イーソル	3.1	4	4,068	
乾汽船	3.7	4.5	12,060		S H I F T	2.7	3.4	92,922		アルテリア・ネットワークス	7.4	7.8	13,751	
空運業 (0.5%)					ティーガイア	5.9	6.7	13,567		東海ソフト	0.4	1.3	1,718	
日本航空	113.5	155.4	388,344		セック	1	1	2,442		ヒト・コミュニケーションズHD	1.6	1.9	3,718	
ANA ホールディングス	117.3	172	466,120		日本アジアグループ	7.3	—	—		トビラシステムズ	0.8	1.6	2,140	
パスコ	1.3	1.3	1,913		テクマトリックス	9.4	11.1	22,422		S a n s a n	—	6	75,540	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)					プロシップ	1.9	2.2	3,680		フォーカスシステムズ	4.2	5.6	5,796	
トランコム	1.8	2	17,400		ガンホー・オンライン・エンター	16.1	17.8	37,967		クレスコ	4	4.7	10,133	
日新	5.6	4.9	8,467		GMOペイメントゲートウェイ	14.1	12.9	196,983		フジ・メディア・HD	64.4	68.5	81,583	

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
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
オービック	23	20.8	484,016	ジャステック	4.2	4.1	5,198	高速	4	3.5	5,656
ジャストシステム	10.8	9.5	67,260	S C S K	15.3	15.3	114,444	たけびし	2.4	2.2	3,823
T D Cソフト	5.9	5.9	8,572	日本システムウエア	2.2	2.1	5,212	リックス	1.5	1.3	1,989
Z ホールディングス	912.6	869.7	638,794	アイネス	6.5	6.8	10,778	丸文	5.6	5.6	4,390
トレンドマイクロ	35.5	35.3	219,213	T K C	5.6	11.5	42,492	ハピネット	5.5	6	8,988
ID ホールディングス	2.5	3.6	3,459	富士ソフト	7.1	7.2	43,704	橋本総業 HLDGS	1.3	1.6	3,652
日本オラクル	13.4	13.5	126,495	N S D	21.3	21.6	45,403	日本ライフライン	19.9	21.3	29,394
アルファシステムズ	2.1	1.9	8,103	コナミホールディングス	24.2	24	164,160	タカショー	3.9	5.1	4,758
フューチャー	8	7.9	22,159	福井コンピュータ HLDGS	2.6	3.3	14,520	マルカ	2.3	2.3	6,713
CAC HOLDINGS	4.4	4.1	7,216	JBCC ホールディングス	4.5	4.2	6,997	I D O M	18	22.7	22,858
S Bテクノロジーズ	2.4	2.8	8,540	ミロク情報サービス	5.9	6.6	11,338	進和	4	3.8	9,450
トーセ	1.8	1.7	1,337	ソフトバンクグループ	526.6	522.9	3,309,434	エスケイジャパン	1.6	2.6	1,276
オービックビジネスC	6.8	6.5	37,570	卸売業 (4.8%)				ダイトロン	2.8	2.8	6,801
伊藤忠テクノソリューションズ	30.1	30.5	114,832	ハウスイ	0.5	0.5	471	シークス	8.5	9.4	11,458
アイティフォー	8.1	8.8	7,664	高千穂交易	2.5	2.5	3,092	田中商事	2.1	1.7	1,149
東計電算	1	0.9	4,383	オルパルスケア HLDGS	0.7	1.1	1,755	オーハシテクニカ	3.5	3.4	5,348
エクスネット	1.1	1.6	1,657	伊藤忠食品	1.7	1.6	8,736	白銅	2.3	2.3	7,831
大塚商会	35.9	35.9	212,169	エレマテック	6.3	5.8	6,849	ダイコー通産	0.4	0.9	1,131
サイボウズ	7.8	9.2	23,404	J A L U X	1.8	1.7	3,054	伊藤忠	465.8	462.5	1,597,937
ソフトブレーン	4.1	—	—	あらた	5.3	5.1	23,358	丸紅	693.5	652.2	602,893
電通国際情報S	4.1	9.8	43,806	トーメンデバイス	1	0.9	4,941	高島	1	1	1,901
A C C E S S	6.1	8.4	8,601	東京エレクトロンデバイス	2.4	2.2	18,876	長瀬産業	37.3	35.8	70,311
デジタルガレージ	12	10.9	54,500	フィールズ	4.9	5.9	3,097	蝶理	4.3	4.3	8,406
イーエムシステムズ	9.3	11.7	9,711	双日	368.1	367.4	130,059	豊田通商	74.5	66.2	316,105
ウェザーニューズ	2.3	2.1	13,986	アルフレッサホールディングス	73.9	68.6	119,981	三共生興	10	9.2	5,023
C I J	4.8	4	3,500	横浜冷凍	17.5	17.4	16,077	兼松	25	26.1	37,688
ビジネスエン지니어リング	0.8	0.8	2,916	神栄	1	1.2	1,296	ツカモトコーポレーション	1.3	1.4	1,993
日本エンタープライズ	7.3	8.4	1,806	ラサ商事	3.4	3.3	3,184	三井物産	577	527.9	1,290,715
WOWOW	3.2	3.3	8,157	アルコニックス	7.1	7.2	12,139	日本紙パルプ	3.8	3.3	12,837
スカラ	4.6	6.5	4,933	神戸物産	23	51.6	208,980	カメイ	8.6	8.1	10,116
インテリジェントウェイブ	3.7	3.7	2,345	ハイパー	0.9	1.6	870	東都水産	0.8	0.4	2,832
IMAGICA GROUP	5.7	5.4	2,986	あいホールディングス	9.5	9.3	22,329	OUG ホールディングス	1.1	1	2,935
ネットワンシステムズ	25.3	27.1	105,961	ディーブイエックス	2.3	2.1	2,370	スターゼン	2.5	5	11,205
システムソフト	22.4	18.4	3,128	ダイワボウHD	5.7	30.3	59,812	山善	26.2	25	28,300
アルゴグラフィックス	5.7	5.3	17,967	マクニカ・富士エレ HLDGS	15.9	16	44,624	椿本興業	1.2	1.2	4,698
マーベラス	10	10.4	7,290	ラクト・ジャパン	2.5	3	8,532	住友商事	420.5	416.2	665,920
エイベックス	11.5	11.7	17,585	パイタルK S K HD	11.5	11.3	9,446	内田洋行	2.7	2.9	16,675
日本ユニシス	20.7	23.1	69,762	八洲電機	5.1	4.6	4,968	三菱商事	436.9	402.7	1,422,336
兼松エレクトロニクス	3.6	3.6	14,526	メディアスホールディングス	3.7	3.9	3,662	第一実業	3.3	3.2	16,224
TBS ホールディングス	40.2	43.6	74,556	レスターホールディングス	7	6.5	12,629	キャンマーケティングJPN	16.7	16.3	42,005
日本テレビ HLDGS	55.1	55.1	68,930	ジューテックHD	1.3	1.4	1,569	西華産業	3.7	3.3	5,494
朝日放送グループHD	6.4	5.3	4,049	大光	2.8	3	2,124	佐藤商事	5.6	5.1	6,186
テレビ朝日HD	18.3	20.6	36,008	OCHI ホールディングス	1.9	1.9	2,492	菱洋エレクトロ	6.8	5.1	12,138
スカパー JSATHD	43.9	42.6	18,147	TOKAI ホールディングス	34.9	31.5	29,295	東京産業	6	6.6	4,989
テレビ東京HD	5.5	4.5	9,864	黒谷	1.6	2.4	1,910	ユアサ商事	6.4	6.6	20,559
日本BS放送	2.1	2	2,286	C o m i n i x	1.1	1.3	939	神鋼商事	1.6	1.5	5,085
ビジョン	6.1	11.9	16,671	三洋貿易	6.7	6.9	8,438	トルク	3.9	3.9	897
スマートバリュー	1.8	2.1	1,472	ビューティガレージ	1.1	1.2	4,362	阪和興業	12.5	13.3	47,747
USEN-NEXT HLDGS	2.6	6.8	25,296	ウイン・パートナーズ	4.8	4.6	4,558	正栄食品	4.3	4.2	18,501
ワイヤレスゲート	3.2	3.1	1,236	ミタチ産業	2	1.1	963	カナデン	5.4	5.3	5,618
コネクシオ	3.8	4.2	6,678	シップヘルスケア HD	10.7	23.5	68,385	菱電商事	4.8	4.7	8,629
日本通信	51.7	60.9	14,128	明治電機工業	2	2.1	2,908	フルサト工業	3.4	3.4	7,752
クロップス	1.3	1.2	1,194	デリカフーズ HLDGS	2.2	3.5	2,359	岩谷産業	14.9	16.1	107,065
日本電信電話	886.5	770.5	2,485,633	スターティアホールディングス	1.7	1.6	2,924	ナイス	2.5	2.5	4,925
K D D I	483.8	528.4	2,000,522	コメダホールディングス	14.6	14.6	31,375	昭光通商	2.3	—	—
ソフトバンク	607.9	599.1	932,199	ピーバンドットコム	0.6	1.2	858	ニチモウ	1	1	2,076
光通信	6.8	7.8	152,958	アセンテック	1.4	2	2,500	極東貿易	1.9	2.1	5,707
N T T ドコモ	474.3	—	—	富士興産	2.2	2.1	2,221	アステナホールディングス	8.7	10.8	6,696
エムティーアイ	6.4	7.6	5,449	協栄産業	0.7	0.7	1,027	三菱石油	16.5	16.2	24,478
GMO インターネット	24	23.7	70,815	小野建	5.5	5.5	9,581	稲畑産業	14.8	16	28,080
ファイバーゲート	2.1	2.9	4,341	南陽	1.4	1.2	2,490	G S I クレオス	1.6	3.6	3,790
アйдマーケティングコミュ	2.1	1.7	649	佐島電機	4.5	4	3,668	明和産業	6.3	5.9	6,820
K A D O K A W A	18	17.3	98,437	エコートレーディング	1.5	1.9	1,274	クワザホールディングス	2.1	2.5	1,630
学研ホールディングス	8.9	9.6	11,625	伯東	4.1	4.4	8,676	ヤマエク野	4.9	4.6	5,796
ゼンリン	13.3	11.7	12,647	コンドーテック	5.2	4.8	4,968	ワキタ	14.2	13	14,144
昭文社ホールディングス	3.1	3.4	1,774	中山福	3.7	4.3	1,840	東邦ホールディングス	21.1	20.8	39,520
インプレスホールディングス	5.3	8.9	2,536	ナガイレーベン	8.9	8.4	23,007	サンゲツ	18.3	17.5	28,647
アイネット	3.4	3	4,236	三菱食品	7.4	7	20,517	ミツウロコグループ	9.8	9.9	14,404
松竹	4.4	4.3	55,126	松田産業	4.9	5.2	15,782	シナネンホールディングス	2.8	2.5	9,275
東宝	39.2	38.9	204,614	第一興商	10	12.9	49,213	伊藤忠エネクス	14.1	14.9	15,555
東映	2.5	2.2	48,202	メディアパル HD	71.5	66.2	145,706	サンリオ	18.8	19.1	47,769
N T T データ	176.7	175.8	382,365	S P K	2.8	2.9	4,065	サンワ テクノス	4.7	4.4	6,542
ピー・シー・エー	1.1	1.1	6,798	萩原電気 HLDGS	2.5	2.4	5,551	リョーサン	7.4	6.8	15,925
ビジネスB 太田昭和	2.2	2.6	4,479	アズワン	4.4	4.8	84,720	新光商事	10.3	9.1	8,171
D T S	14.9	14	37,660	スズデン	2.3	2.2	3,568	トーホー	3	3	5,223
スクウェア・エニックス・HD	28.3	28.1	179,278	尾家産業	1.9	2	2,302	三信電気	3.6	4.1	7,047
シーイーシー	7.1	7.2	9,907	シモジマ	4.1	4.2	5,481	東陽テクニカ	7.6	6.9	8,907
カプコン	31.3	56.8	189,996	ドウシシャ	6.3	6.2	11,042	モスフード サービス	8.8	9	29,835
アイ・エス・ピー	1.4	4.1	5,231	小津産業	1.5	1.7	3,394	加賀電子	6.7	6.2	19,902

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ソーダニツカ	6.8	6.3	4,139	千円	ウエルシアHD	39.6	35.2	145,904	千円	P L A N T	1.6	1.6	1,182	千円
立花エレテック	4.9	4.6	7,318		クリエイトSDH	11.2	9.7	37,830		スギホールディングス	13.3	13.3	116,242	
フオーバル	2.9	2.2	2,435		丸善CHI HD	5.6	5.1	1,963		兼王堂ホールディングス	2.9	2.8	7,092	
P A L T A C	10.7	10.7	54,891		ミサワ	1.6	1.9	1,282		ヴィア・ホールディングス	8.1	7.6	1,504	
三谷産業	8.7	9.4	3,647		ティーライフ	0.9	1.4	2,121		スクロール	10.1	9.9	8,751	
太平洋興発	2.6	2.6	1,739		イー・ピーホールディングス	1.5	1.7	761		ヨンドシーホールディングス	6.8	6.2	11,352	
西本 WISMETTAC HD	1.2	1.5	5,700		チムニー	2	2.1	3,173		ファミリーマート	53.2	—	—	
ヤマシタヘルスケアHLDGS	0.7	0.9	1,708		シュッピン	4.6	4.8	6,100		木曽路	8.8	8.3	20,575	
国際紙パルプ商事	15.9	13.6	4,787		オイシックス・ラ・大地	6.6	9	45,630		SRS ホールディングス	8.1	8.2	6,888	
ヤマタネ	3.3	2.9	4,808		ネクステージ	9.6	13.7	32,332		千趣会	12.2	11.8	4,625	
丸紅建材リース	0.7	0.5	949		ジョイフル本田	19.6	18.6	29,332		タカキユー	6.1	7.3	963	
日鉄物産	4.7	4.6	24,150		鳥貴族ホールディングス	2.3	2.6	5,558		リテールパートナーズ	8.9	7.9	10,262	
泉州電業	2	2	10,160		キリン堂ホールディングス	2.6	—	—		ケーヨー	13.7	11.9	10,103	
トラスコ中山	14	13.8	41,096		ホットランド	4.5	4.6	6,242		上新電機	7.9	7.4	19,402	
オートバックスセブン	24.6	23.4	35,357		すかいらーく HD	74.9	92.6	147,048		日本瓦斯	10.6	32.6	55,159	
モリト	4.9	4.5	3,145		SFP ホールディングス	3.8	2.9	4,176		ロイヤルホールディングス	11.7	11.6	24,812	
加藤産業	9.7	9.3	32,550		綿半ホールディングス	2.5	4.9	6,374		東天紅	0.5	0.5	557	
北恵	1.6	1.8	1,886		ヨシックスホールディングス	1.1	1.3	2,973		いなげや	8.2	7.3	10,570	
イノテック	3.9	3.7	5,335		ユナイテッド・スーパーマケ	19.3	19	21,964		島忠	12.5	—	—	
イエローハット	12.6	12	23,952		ゴルフダイジェスト・オン	2.9	3.9	5,460		チヨダ	7.1	6.4	5,254	
JK ホールディングス	6	5.8	4,901		B E E N O S	3	3.6	10,782		ライフコーポレーション	5.1	6.2	29,667	
日伝	6.1	5.3	13,393		あさひ	5	5	7,050		リンガーハット	8.3	7.9	19,054	
北沢産業	5.2	4.3	1,130		日本調剤	4.1	4.2	7,320		MrMaxHD	9.2	8.8	6,036	
杉本商事	3.5	3.2	9,558		コスモス薬品	5.9	6.7	136,747		テンアライド	5.9	5.3	1,738	
因幡電機産業	19.1	17.5	49,577		トーエル	3.2	3.1	2,824		AOKI ホールディングス	13.5	13.3	9,123	
東テク	2.2	2.3	6,433		オンリー	1.1	1.1	840		オークワ	10.5	10	12,170	
ミスミグループ本社	83.6	82.9	398,334		セブン & アイ・HLDGS	260.5	258.8	1,326,091		コメリ	10.3	10	27,250	
アルテック	5.6	6.3	2,003		クリエイト・レストラップ・ホール	36.1	36.2	33,050		青山商事	13.8	15.3	12,163	
タキヒヨー	2	2.1	4,063		ツルハホールディングス	14.5	14.5	203,000		しまむら	7.8	7.7	77,077	
蔵王産業	1	1	1,736		サンマルクホールディングス	5.3	5.1	8,058		はせがわ	3.4	3.3	884	
スズケン	28.1	28	91,700		フェリシモ	1.4	1.7	2,864		高島屋	48.9	49.2	56,973	
ジェコス	4.6	4.5	4,099		トリドールホールディングス	16.6	16.6	43,259		松屋	13.5	14.4	16,156	
グローセル	6.7	6.4	2,668		TOKYO BASE	6	6.9	4,319		エイチ・ツー・オーリテイリング	31.8	32.5	30,712	
小売業 (4.4%)					ウィルブラス HLDGS	1.1	1.2	1,306		近鉄百貨店	2.6	2.5	6,507	
ローソン	16.9	16.6	95,118		JM ホールディングス	5.1	4.9	10,691		丸井グループ	61.2	56.4	118,045	
サンエー	5.5	4.8	19,416		サッドラホールディングス	0.9	0.9	2,000		アクシアルリテイリング	5.5	5.3	21,677	
カワチ薬品	5.2	4.6	10,704		アレンザホールディングス	3.3	4.9	7,154		井筒屋	4	3.7	987	
エーピーシー・マート	10.4	10.3	60,255		串カツ田中 HLDGS	1.3	1.9	4,284		イオン	256.1	254.2	767,175	
ハードオフコーポレーション	2.5	2.5	1,952		パロックスジャパン	4.6	4.9	4,272		イズミ	13.7	13.5	48,465	
アスクル	7	11.2	19,219		クスリのアオキ HLDGS	6	6.6	56,034		平和堂	13.4	12	27,684	
ゲオホールディングス	11.9	8.9	10,920		力の源 HD	3	2.3	1,405		フジ	8.1	7.9	17,917	
アダストリア	9.3	9.4	18,630		FOOD&LIFE COMPAN	36.7	38.9	195,667		ヤオコー	7.6	7.5	54,075	
ジーフット	4.4	3	1,224		メディカルシステムネットワーク	6.4	6.2	4,761		ゼビオホールディングス	8	7.4	8,569	
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	1	1	413		はるやま HLDGS	3.1	2.3	1,382		ケーズホールディングス	64.4	56.6	67,750	
くら寿司	3.5	7.1	28,293		ノジマ	12	11.7	33,590		OLYMPIC グループ	3.4	3.6	2,876	
キャンドゥ	3.2	3.6	6,872		カッパ・クリエイト	9.4	9.1	12,794		日産東京販売HD	9.7	8.9	2,171	
パルグループ HLDGS	6.9	5.9	10,307		ライトオン	4.9	4.6	3,353		シルバライフ	0.9	1.5	2,320	
エディオン	30.8	27.5	29,617		ジーンズメイト	2.7	—	—		一家ダイニングプロジ	0.5	1.3	757	
サーラコーポレーション	13.4	13.6	8,880		良品計画	88.9	76.2	195,605		GENKY DRUGSTORES	2.9	2.9	14,964	
ワッツ	2.8	3.4	3,022		三城ホールディングス	6.9	7.9	2,117		ナルミヤ・インターナショナル	1.4	1.6	1,654	
ハローズ	2.5	2.7	8,140		アドヴァングループ	10.3	6.6	6,448		ブックオフGHD	3.9	3.7	3,637	
フジオフードG 本社	5.7	5.6	7,800		アルビス	2.5	1.9	4,721		アインホールディングス	8.2	9.6	71,328	
あみやき亭	1.4	1.3	3,802		コナカ	7.7	7.8	2,870		元気寿司	1.7	1.8	4,941	
ひらまつ	11.8	12.7	2,705		ハウス ローゼ	0.8	0.6	1,008		ヤマダホールディングス	203.4	221	105,196	
大黒天物産	1.6	2.2	15,158		Gーフホールディングス	3.9	3.9	16,731		アークランドサカモト	10.5	10.3	17,911	
ハニースホールディングス	5.8	5	5,640		イオン北海道	8.5	8.9	11,570		ニトリホールディングス	28.8	26.2	588,976	
ファーマライズHD	1.5	1.5	1,218		コジマ	11.4	12.3	8,142		グルメ軒屋	4.7	4.1	4,169	
アルペン	5.1	5.3	17,543		ヒマラヤ	2.2	2.2	3,080		愛眼	5.4	4.4	976	
ハブ	1.9	2.1	1,520		コーナン商事	9.5	9.6	35,808		ケーユーホールディングス	2.9	3.4	3,478	
クオールホールディングス	9.8	8.8	14,229		エコス	2.4	2.5	4,937		吉野家ホールディングス	22	21.7	48,759	
ジーンズホールディングス	3.6	4.6	37,398		ワタミ	7.9	8.9	8,997		松屋フーズHLDGS	3.2	2.9	10,614	
ビックカメラ	39.8	38.5	40,964		マルシェ	1.5	1.5	741		サガミホールディングス	8.9	8.7	9,291	
DCM ホールディングス	37.3	40.7	46,113		パンパシフィック HD	146.4	132.5	269,372		関西スーパーマーケット	5.5	4.8	9,528	
ベッパーフードサービス	5.7	9.2	3,413		西松屋チェーン	14.7	14.9	21,083		王将フードサービス	4.9	4.1	25,010	
Monotaro	47.5	84.2	212,015		ゼンショーホールディングス	32	35.4	99,898		プレナス	7.2	7.5	16,222	
東京一番フーズ	1.5	1.6	953		幸楽苑ホールディングス	4.2	4.1	6,211		ミニストップ	5	5.4	8,127	
DD ホールディングス	2.7	3.4	1,700		ハークスレイ	1.3	1	1,026		アークス	13.6	12.7	29,959	
きちりホールディングス	1.7	1.4	898		サイゼリヤ	10	10.2	28,345		パローホールディングス	14.7	13.3	33,795	
アークランドサービスHD	4.9	5.5	13,018		V T ホールディングス	27.6	25.2	14,389		藤久	0.6	1.7	1,283	
J. フロントリテイリング	79.8	79.4	80,511		魚力	1.9	1.9	4,216		ベルク	3.3	3.2	19,872	
ドトール・日レスHD	9.7	10.4	17,648		ボブア	1.8	3.1	688		大庄	3.5	3.1	3,205	
マツモトキヨシHLDGS	27.5	27.5	141,900		フジ・コーポレーション	1.8	3.4	4,195		ファーストリテイリング	8.9	8.9	664,207	
ブロンコビリー	3.5	3.6	9,183		ユナイテッドアローズ	7	7.7	15,030		サンドラッグ	25.1	25	91,250	
Z O Z O	45.9	39.2	166,600		ハイデイ日高	9.7	9.5	16,539		サックスパーホールディング	5.5	5	2,845	
トレジャー・ファクトリー	2	2.1	2,064		京都きもの友禅	3.9	4.3	1,105		ヤマザウ	1.4	1.1	1,927	
物語コーポレーション	1.8	3.7	27,713		コロワイド	22.3	22	38,016		やまや	1.3	1.2	3,050	
ココカラファイン	6.9	5.9	51,330		ピーシーデポコーポ	8.8	7.4	3,507		ペルーナ	14.4	14.9	12,650	
三越伊勢丹HD	117.3	116.5	93,083		壺番屋	4.7	4.4	20,636		銀行業 (4.9%)				
Hamee	2.4	1.9	2,513		トップカルチャー	2.4	2.5	855		島根銀行	1.5	3	1,845	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
じもとホールディングス	45	4.3	3,048		トモニホールディングス	51.8	48.2	16,147		エストラスト	1.4	1.1	729	
めぶきフィナンシャルG	346	344.1	86,369		フィデアホール	64.4	66.2	8,473		フージャースHD	13.3	10.4	7,238	
東京きらぼしFG	9	8.8	13,860		池田泉州HD	76.9	74.8	12,641		オープンハウス	19.5	21.2	139,072	
九州フィナンシャルG	146.2	134.9	56,658		証券・商品先物取引業 (0.7%)					東急不動産HD	181.9	180.4	119,785	
ゆうちょ銀行	187.6	187.2	179,337		FPG	20.6	22.7	16,048		飯田GHHD	55.5	55.3	160,093	
富山第一銀行	15.7	14.7	4,410		マーキュリアインベストメント	2.8	—	—		イーグランド	1	1.3	2,139	
コンコルディア・フィナンシャル	380.6	402.8	178,843		マーキュリアホールディングス	—	3.2	2,422		ピーロット	3.4	4.7	2,547	
西日本フィナンシャルHD	44.6	43.3	30,959		SBIホールディングス	74.6	81.8	227,240		ファーストブラザーズ	1.5	1.2	1,238	
関西みらいFG	39.5	—	—		日本アジア投資	6.3	6.1	1,518		ハウスドゥ	3.5	3.3	3,286	
33FG	6.2	5.6	8,366		ジャフコグループ	10.3	8.7	63,423		シーアールイー	1.8	1.9	4,582	
第四北越フィナンシャルG	11.7	10.7	27,841		大和証券G本社	534.4	495.5	330,845		プロパティエージェント	1.1	1.4	4,494	
ひろぎんHLDGS	—	98.7	64,352		野村ホールディングス	1,174.1	1,013	558,264		ケイアイスター不動産	2.2	2.3	12,788	
新生銀行	49.1	54.7	103,164		岡三証券グループ	57.3	53.9	22,476		アグレ都市デザイン	1.7	1.7	2,007	
あおぞら銀行	40	39.5	107,993		丸三証券	19.7	19.6	12,759		ジェイ・エス・ビー	1.3	1.4	4,298	
三菱UFJフィナンシャルG	4,562.2	4,527.4	2,863,580		東洋証券	24.3	21.5	3,612		テンポイノベーション	1.7	2.2	2,010	
りそなホールディングス	725.8	768.7	341,225		東海東京HD	76.9	68.8	29,240		グローバルリンクマネジメント	1.4	1.3	1,223	
三井住友トラストHD	126	125.2	479,516		光世証券	1.8	1.8	1,089		パーク24	36	35.8	64,547	
三井住友フィナンシャルG	461	457.6	1,797,910		水戸証券	19.1	17.8	5,571		パワカ	1.7	1.6	2,944	
千葉銀行	222.5	221.2	157,715		いちよし証券	12.2	13.3	9,522		三井不動産	329	301.5	760,533	
群馬銀行	128	136.6	49,449		松井証券	37.7	32.2	26,822		三菱地所	467.2	433.9	750,863	
武蔵野銀行	10	9.7	18,284		マネックスG	50	60.4	34,428		平和不動産	12.2	11.5	47,092	
千葉興業銀行	18	16.6	4,648		極東証券	8.7	8.5	7,403		東京建物	66.1	65.4	111,114	
筑波銀行	28.1	29.1	5,267		岩井コスモホールディング	6.3	7.7	11,118		ダイビル	17	16.9	26,296	
七十七銀行	22.7	20.5	26,076		藍澤證券	12	11.9	13,768		京阪神ビルディング	10.5	10.5	15,456	
青森銀行	5.2	5.1	11,123		マネーパートナーズGP	6.6	9.1	1,992		住友不動産	149.9	148.9	578,923	
秋田銀行	4.3	4	5,980		スパークス・グループ	30.8	31.6	9,290		テオオーシー	12.9	12.1	8,022	
山形銀行	7.5	7	6,244		小林洋行	2.8	4.1	1,123		東京楽天地	1.2	1	4,125	
岩手銀行	4.4	4.2	7,413		保険業 (2.0%)					スターツコーポレーション	9	7.7	21,937	
東邦銀行	59.7	56.7	12,247		かんぽ生命保険	23.5	82.4	171,227		フジ住宅	7.7	7.7	5,528	
東北銀行	3.1	3.3	3,418		SOMPOホールディングス	125.4	116.6	592,094		空港施設	6.8	7.2	4,305	
みちのく銀行	4.4	4.5	3,996		アニコムホールディングス	5.5	19.5	17,667		明和地所	4.2	3.4	2,077	
ふくおかフィナンシャルG	56.3	60.1	121,161		MS&AD	174.3	160.3	615,071		ゴールドクレスト	5	5.8	9,987	
静岡銀行	162.2	161.8	150,150		第一生命HLDGS	377.8	326.2	769,342		エスリード	2.7	2.5	4,175	
十六銀行	8.4	8.3	18,284		東京海上HD	235.9	218.1	1,308,600		日神グループHLDGS	10.3	9.3	4,752	
スルガ銀行	63	63	24,129		T&Dホールディングス	199.7	198.3	305,382		日本エスコン	12.2	13.1	10,427	
八十二銀行	161	148.5	58,954		アドバンスクリエイト	1.6	3.4	3,787		タカラレーベン	30.2	29.3	9,434	
山梨中央銀行	7.8	7.4	6,349		その他金融業 (1.1%)					AVANTIA	3.8	3.6	3,178	
大垣共立銀行	13.2	12.9	25,038		全国保証	18.9	17.2	94,944		イオンモール	33.4	33.1	55,674	
福井銀行	5.7	5.9	9,971		ジェイリース	2.5	2.5	5,120		毎日コムネット	2	2.7	2,073	
北國銀行	6.7	6.2	13,106		イントラスト	2.5	2.7	1,917		ファースト住建	2.9	2.9	3,862	
清水銀行	2.7	2.5	4,232		日本モーゲージサービス	2.8	3.7	3,870		ランド	378.1	371.2	4,454	
富山銀行	1.3	1.3	2,996		Casa	2.3	2.1	2,034		カチタス	16.6	16.4	66,502	
滋賀銀行	13.4	13.2	24,987		アルヒ	10.7	10.1	13,180		トーセイ	9.4	9.3	10,648	
南都銀行	11.2	9.3	18,972		プレミアムグループ	3.6	3.4	11,798		穴吹興産	1.5	1.8	3,668	
百五銀行	59.5	59.3	19,924		クレディセゾン	47	38.9	52,787		サンフロンティア不動産	9.5	8.1	9,185	
京都銀行	23.9	23.9	119,978		芙蓉総合リース	7	6.8	53,924		インテリックス	2.8	2	1,542	
紀陽銀行	23.7	23	36,593		みずほリース	10.2	10.5	38,377		ランドビジネス	2.6	2.9	783	
はくほくフィナンシャルG	44.5	44.2	37,083		東京センチュリー	13.4	15.3	99,450		サンネクスタググループ	1.9	2.3	2,339	
広島銀行	99	—	—		日本証券金融	29.5	29	27,318		グランディハウス	5.3	5.2	2,527	
山陰合同銀行	39.9	41	23,124		アイフル	102	113.8	40,968		日本空港ビルデング	21.4	23.1	115,962	
中国銀行	57.5	56	49,840		リコーリース	5.2	5.2	19,578		サービス業 (6.0%)				
鳥取銀行	2.2	2.2	2,530		イオンフィナンシャルサービス	41.1	40.4	52,802		明豊ファシリティアークス	2.7	3.3	3,012	
伊予銀行	95.1	88.2	51,597		アコム	133.9	129.8	54,645		日本工営	4.4	3.8	13,148	
百十四銀行	7.1	6.5	10,400		ジャックス	7.4	7.7	23,485		LIFULL	22.6	22.5	8,212	
四国銀行	10.2	9.3	6,937		オリコ	181.6	179.6	27,478		ミクシィ	12.4	16.5	43,560	
阿波銀行	10.9	9.9	21,968		日立キャピタル	15.8	—	—		ジェイエイシールクートメント	4.3	5.5	11,698	
大分銀行	3.9	3.7	6,889		アプラスフィナンシャル	34.1	—	—		日本M&Aセンター	49.2	105.5	378,745	
宮崎銀行	4.5	4.1	8,745		オリックス	413.9	401.5	850,577		メンバーズ	1.9	2.4	8,280	
佐賀銀行	4	3.8	5,719		三菱HCキャピタル	168.4	227	134,838		中広	0.6	1.1	442	
沖縄銀行	6.1	5.8	16,634		九州リースサービス	2.9	3	1,842		UTグループ	10.2	9.4	29,046	
琉球銀行	15.5	13.6	10,812		日本取引所グループ	191.3	178.7	519,659		アイティメディア	2.6	2.5	5,910	
セブン銀行	223	221.9	56,806		イー・ギャランティ	7.2	8	20,144		タケエイ	6.2	7.5	14,175	
みずほフィナンシャルG	9,059.1	898.7	1,439,717		アサックス	3.5	3.9	2,780		E・Jホールディングス	1.2	3.5	4,753	
高知銀行	2.5	2.5	2,102		NECキャピタルソリューション	2.7	2.8	6,014		夢真ピーネックスグループ	8.1	17.6	23,496	
山口フィナンシャルG	83.5	82.6	54,929		不動産業 (1.9%)					コシダカホールディングス	15.5	18.6	10,843	
長野銀行	2.1	2.4	2,812		いちご	85.5	74.3	26,153		アルトナー	1.8	1.6	1,385	
名古屋銀行	5.1	5.2	14,414		日本駐車場開発	69.7	73.5	11,907		パソナグループ	7	7.3	24,345	
北洋銀行	101.3	101.2	26,716		スター・マイカ・HLDGS	3.3	3.5	5,281		CDS	1.6	1.5	2,446	
愛知銀行	2.4	2.3	8,418		ADワークスグループ	14.9	13.1	2,096		リンクアンドモチベーション	13.7	14.5	16,037	
中京銀行	2.7	2.6	3,653		ヒューリック	141.5	139.7	186,359		GCA	7.8	8.2	11,439	
大光銀行	2.2	2.2	3,498		三栄建築設計	2.7	3	5,907		エス・エム・エス	20.2	22.2	94,128	
愛媛銀行	9	8.9	7,120		野村不動産HLDGS	40.5	38.3	110,074		サニーサイドアップG	2.1	2	1,566	
トマト銀行	2.5	2.3	2,566		三重交通グループHD	13.3	12.8	6,758		パーソルホールディングス	65.1	64.2	175,009	
京葉銀行	28.5	25.7	11,693		サムティ	9.5	9.7	22,765		リニカル	3.2	3.7	2,963	
栃木銀行	31.6	31.6	5,846		日本商業開発	4.5	4.6	8,050		クックパッド	22.4	21.7	5,099	
北日本銀行	2	1.9	3,060		プレサンスコーポレーション	11.1	11	20,614		エスクリ	2	3	1,671	
東和銀行	11.7	12.2	6,771		ハウスコム	0.9	1.2	1,536		アイ・ケイ・ケイ	3.1	3.1	2,135	
福島銀行	7.3	7.7	1,940		日本管理センター	3.9	3.7	4,643		学情	2.4	2.8	3,533	
大東銀行	3.3	3	2,055		サンセイランディック	2.5	2	1,656		スタジオアリス	3.2	3.4	8,027	

銘柄	柄	期 首		当 期 末		銘柄	柄	期 首		当 期 末		銘柄	柄	期 首		当 期 末	
		株 数	千 株	株 数	千 株			株 数	千 株	株 数	千 株			株 数	千 株	株 数	千 株
シミックホールディングス		3.6	3.6	5,403		エン・ジャパン		11.5	11.5	46,920		建設技術研究所		4.4	4.1	10,783	
エプコ		1.3	1.5	1,336		リソルホールディングス		0.7	0.7	2,891		スペース		4.1	3.9	3,802	
N J S		1.4	1.6	3,152		テクノプロ・ホールディング		13	38.6	128,924		長大		2.5	2.6	5,842	
総合警備保障		25.9	25.4	129,032		アトラグループ		1.7	1.9	590		燦ホールディングス		2.8	2.7	3,923	
カカコム		48	47.8	177,099		インターワークス		1.6	1.6	651		スバル興業		0.4	0.4	3,324	
アイロムグループ		2.4	2.4	5,232		アイ・アールジャパンHD		2.6	2.7	37,125		東京テアトル		3.1	2.3	2,980	
セントケア・ホールディング		4	5.2	5,215		K e e P e r 技研		2.4	4.4	16,786		タナベ経営		1.1	1	1,613	
サイネックス		1.1	1.8	1,213		ファーストロジック		1.4	2.2	1,683		ナガワ		2	2	23,980	
ルネサンス		3.5	4.2	4,897		三機サービス		1.3	1.5	1,699		よみうりランド		1.4	—	—	
ディップ		9.1	10.4	42,484		G u n o s y		4	4.8	3,494		東京都競馬		4.2	5	20,400	
デジタルホールディングス		3.5	4.9	8,619		デザインワン・ジャパン		1.5	3.5	836		常磐興産		2.6	2.6	3,868	
新日本科学		7.1	8.1	7,452		イー・ガーディアン		3.2	3.2	10,304		カナモト		10.7	11	28,644	
ツクイホールディングス		15.2	—	—		リブセンス		4.5	6.6	1,346		東京ドーム		26.4	—	—	
キャリアデザインセンター		1.7	1.6	1,936		ジャパンマテリアル		20	19.1	25,594		西尾レントオール		6	5.8	17,162	
ベネフィット・ワン		23.7	23.5	129,485		ベクトル		8.2	8.3	9,154		アゴーラホスピタリティーG		47.5	52.2	1,305	
エムスリー		142.6	113.6	975,596		ウチヤマホールディングス		3.2	3	1,029		トランス・コスモス		6.2	6.4	23,616	
ツカダ・グローバルHOLD		4	4.9	1,734		チャームケアコーポレーション		5.5	5.4	8,920		乃村工藝社		27.8	27.7	27,118	
プラス		0.7	1.4	1,143		キャリアアリンク		2.4	2.5	4,650		藤田観光		2.9	2.7	6,480	
アウトソーシング		37.1	37.4	74,987		I B J		4.5	5.9	6,407		KNT-CTホールディングス		3.9	3.8	5,354	
ウェルネット		6.6	6.3	3,320		アサンテ		2.7	2.6	4,693		日本管財		7.2	6.7	18,029	
ワールドホールディングス		2.3	2.6	7,264		N・フィールド		4.3	—	—		トーカイ		6.3	6.1	14,347	
ディー・エヌ・エー		27.5	27.8	55,155		パリュールH R		2.6	2.7	4,819		白洋舎		0.8	0.7	1,464	
博報堂D Y HLDGS		90.5	89.1	169,913		M&Aキャピタルパートナー		5.3	5.5	31,735		セコム		68.7	63.1	530,040	
ぐるなび		11.3	11.1	5,805		ライドオンエクスプレスHD		2.5	2.6	4,248		セントラル警備保障		3.1	3	8,412	
タカミヤ		6.7	7.5	3,720		ERIホールディングス		1.8	1.8	2,039		丹青社		12.2	11.9	10,186	
ジャパンベストレスキューS		5	5	6,340		アピスト		0.9	1.1	3,349		メイテック		8	7.8	51,246	
ファンコミュニケーションズ		18	16.4	7,183		シグマクシス		4.4	3.8	10,978		応用地質		6.9	7.1	10,302	
ライク		2.3	1.9	3,465		ウィルグループ		4.3	4.7	6,138		船井総研ホールディン		13.4	13.1	39,496	
ビジネス・ブレークスルー		3.2	3	1,317		エスコローA J		9	10.3	2,451		進学会ホールディングス		2.5	2.6	1,089	
エスプール		16.6	19.1	20,131		リクルートホールディングス		463.1	459.6	3,209,386		オオバ		4.8	4.2	3,704	
WDBホールディングス		3	3	10,920		エラン		3.8	9.7	11,950		いであ		1.5	1.5	2,872	
手間いらず		0.4	1	5,850		土木管理総合試験		2.9	3.4	1,244		学究社		1.8	1.9	2,660	
ティア		3.6	3.6	1,828		ネットマーケティング		2.3	4.6	2,125		ベネッセホールディングス		21.7	23.6	58,221	
C D G		0.7	0.5	785		日本郵政		527	484.9	468,801		イオンディライト		8	7.8	28,236	
パリュールコマース		3.6	5.3	25,705		ベルシステム24HLDGS		10.9	10.9	18,257		ナック		3.9	2.7	2,629	
インフォマート		65.6	71.5	76,648		鎌倉新書		4.9	6.9	5,865		ニチイ学館		6.2	—	—	
JPホールディングス		20.2	18.8	5,264		S M N		1.3	2.1	1,421		ダイセキ		10.9	12.9	63,081	
エコナックホールディングス		13.5	13.5	1,201		一蔵		0.7	0.9	369		ステッパ		2.4	2.3	4,372	
EPSホールディングス		9	—	—		LITALICO		2.2	—	—							
レックス		1.7	1.7	3,610		グローバルキッズCOMP		1	1.7	1,283		合計		千株	千株	千円	
プレステージ・インター		24.3	23.6	18,360		エアトリ		3.3	4.6	15,226		株 数、金 額		79,781,50004	70,983.9	189,973,468	
アミューズ		3.5	3.5	8,319		アトラエ		1.9	4.9	12,475		銘柄数<比率>		2,151銘柄	2,126銘柄	<98.7%>	
ドリームインキュベータ		1.9	2.1	1,782		ストライク		2.4	2.6	10,881							
クイック		3.9	3.9	5,440		ソラスト		18	16.2	25,077							
T A C		4.4	4	972		セラク		2.2	2.6	6,117							
ケネディクス		56.8	—	—		インソース		2.8	6.7	13,929							
電通グループ		67.1	66.2	278,040		バイカレントコンサルティング		3.9	4.2	258,720							
ティクアンドギヴニーズ		2.4	3.4	3,437		ORCHESTRA HLDGS		1.6	1.6	6,192							
ぴあ		1.8	1.9	6,688		アイモバイル		2.2	2.6	3,601							
イオンファンタジー		2.5	2.5	5,097		キャリアインデックス		2.8	3.2	3,244							
シーティーエス		7.3	7.3	5,847		M S - J a p a n		2.2	3	3,189							
ネクシイズグループ		2.4	2.3	2,047		船場		1.1	0.9	743							
H U グループHD		18.2	18.1	58,372		グレイステクノロジー		3	7.2	7,689							
アルプス技研		5.7	5.5	11,423		ジャパンエレベーターSHD		6.8	19.1	50,443							
サニックス		11.4	10.8	3,574		フルテック		0.9	0.9	1,320							
ダイオーズ		1.2	0.8	900		グリーンズ		1.8	2.8	1,540							
日本空調サービス		6.8	6.3	5,216		ツナググループHLDGS		0.9	2.1	632							
オリエンタルランド		68.7	68.1	1,175,065		GAMEWITH		1.7	2.4	1,308							
ダスキン		16.2	14.5	38,976		ソウルドアウト		1.3	1.6	2,585							
明光ネットワークジャパン		8.1	8.1	5,038		MS&CONSULTING		1	1.3	783							
ファルコホールディングス		3.5	2.9	5,251		ミダックホールディングス		0.8	2.9	17,081							
秀英予備校		1.4	2	862		日総工産		4.5	5.3	3,821							
田谷		1.2	1.5	862		キュービーネットHLDGS		2.9	3	5,613							
ラウンドワン		18.1	22.7	31,439		RPAホールディングス		4.8	8.8	5,306							
リゾートトラスト		29.8	29.8	61,477		スプリックス		2.2	2.1	2,009							
ビー・エム・エル		8.3	8.4	37,212		マネジメントソリューションズ		2.8	3.4	10,608							
ワタベウェディング		1	—	—		プロレド・パートナーズ		0.9	1.7	3,173							
りらいあコミュニケーション		11.7	9.9	12,315		AND FACTORY		0.5	1.9	957							
リンソー教育		29.6	34.2	14,671		ギークス		0.6	1.5	2,296							
早稲田アカデミー		2.8	2.8	2,738		カープスホールディングス		17.8	18.2	16,289							
ユー・エス・エス		72.9	71.5	143,071		フォーラムエンジニアリング		3.3	4.7	4,399							
東京個別指導学院		2.3	5.7	3,762		LITALICO		—	2.8	20,104							
サイバーエージェント		39.9	159.1	348,906		アドバンテッジリスクマネ		3.3	3.6	4,032							
楽天グループ		301.7	330.2	366,522		リログループ		35.4	35.2	75,856							
クリーク・アンド・リバー社		3.4	3.5	6,436		東祥		4	4.3	7,675							
テー・オー・ダブリュー		10.4	10.8	3,704		エイチ・アイ・エス		10.1	14.5	35,728							
山田コンサルティングGP		4.1	3.6	4,132		ラックランド		1.5	1.9	5,468							
セントラルスポーツ		2.4	2.4	6,211		共立メンテナンス		10.8	10.7	42,158							
フルキャストホールディングス		6.2	5.7	12,722		イチネンホールディングス		7.2	6.2	8,320							

(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
T O P I X	1,788	—

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

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

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

■投資信託財産の構成

2021年9月21日現在

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

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年9月21日現在

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

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

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、トピックス・インデックスファンド2,989,191,828円、ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A5,882,696,138円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A2 925,539円、ダイワ国内重視バランスファンド30 V A（一般投資家私募）25,469,299円、ダイワ国内重視バランスファンド50 V A（一般投資家私募）429,078,400円、ダイワ国際分散バランスファンド30 V A（一般投資家私募）23,164,900円、ダイワ国際分散バランスファンド50 V A（一般投資家私募）721,398,709円、日本株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）212,609,568円、D－I's T O P I Xインデックス50,045,732円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 112,275,070円、iFree T O P I Xインデックス4,271,085,355円、iFree 8資産バランス3,194,833,049円、iFree 年金バランス442,601,861円、D Cダイワ日本株式インデックス65,726,059,110円、ダイワ・ライフ・バランス30 2,904,866,842円、ダイワ・ライフ・バランス50 3,951,974,309円、ダイワ・ライフ・バランス70 3,760,977,295円、年金ダイワ日本株式インデックス5,858,241,088円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 50,696,932円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 51,725,840円、ダイワつみたてインデックス日本株式1,353,026,496円、ダイワつみたてインデックスバランス30 9,628,593円、ダイワつみたてインデックスバランス50 8,568,294円、ダイワつみたてインデックスバランス70 17,409,216円、ダイワ世界バランスファンド40 V A113,101,715円、ダイワ世界バランスファンド60 V A130,262,046円、ダイワ・バランスファンド35 V A 6,161,189,519円、ダイワ・バランスファンド25 V A（適格機関投資家専用）559,246,637円、ダイワ国内バランスファンド25 V A（適格機関投資家専用）80,610,399円、ダイワ国内バランスファンド30 V A（適格機関投資家専用）146,638,577円、ダイワ・ノーロード T O P I Xファンド178,771,082円、ダイワファンドラップ T O P I Xインデックス10,294,148,277円、ダイワT O P I Xインデックス（ダイワSMA専用）2,512,120,167円、ダイワファンドラップオンライン T O P I Xインデックス2,644,643,973円、ダイワ・インデックスセレクト T O P I X1,211,577,472円、ダイワライフスタイル25 153,686,797円、ダイワライフスタイル50 617,422,037円、ダイワライフスタイル75 487,367,793円、D C・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）10,633,113,617円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,951円です。

■損益の状況

当期 自 2020年9月24日 至 2021年9月21日

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

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

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

ダイワファンドラップ 日経２２５インデックス

運用報告書(全体版)

第６期

(決算日 2022年６月15日)

(作成対象期間 2021年６月16日～2022年６月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の株式に投資し、投資成果を日経平均株価（日経２２５）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年 9月26日）		
運用方針	投資成果を日経平均株価（日経225）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主 要 投資対象	ベビーファンド	ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券	
	ストックインデックス225・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

<4642>

最近5期の運用実績

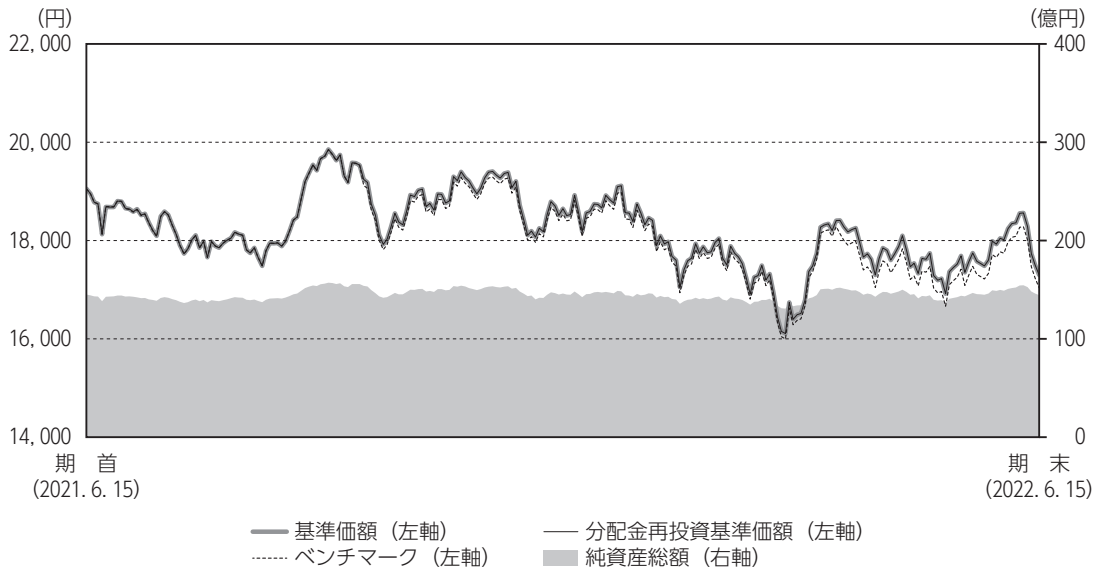
決 算 期	基 準 価 額			日経平均株価		株 式 組入比率	株 式 先物比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率			
	円	円	%	円	%	%	%	百万円
2 期末 (2018年 6 月15日)	14,057	0	17.1	22,851.75	15.2	98.3	1.7	6,623
3 期末 (2019年 6 月17日)	13,227	0	△ 5.9	21,124.00	△ 7.6	97.7	2.3	8,152
4 期末 (2020年 6 月15日)	13,749	0	3.9	21,530.95	1.9	98.1	1.9	11,210
5 期末 (2021年 6 月15日)	19,054	0	38.6	29,441.30	36.7	97.9	2.1	14,516
6 期末 (2022年 6 月15日)	17,300	0	△ 9.2	26,326.16	△ 10.6	97.6	2.4	14,452

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注 2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注 3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
(注 4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期 首：19,054円
期 末：17,300円（分配金 0 円）
騰落率：△9.2%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券を通して、ベンチマークへの連動をめざした運用を行った結果、国内株式市況が下落したことを受け、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 組入比率	株 式 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2021年 6月15日	円 19,054	% —	円 29,441.30	% —	% 97.9	% 2.1
6 月末	18,644	△ 2.2	28,791.53	△ 2.2	98.3	1.7
7 月末	17,662	△ 7.3	27,283.59	△ 7.3	98.2	1.8
8 月末	18,185	△ 4.6	28,089.54	△ 4.6	98.4	1.6
9 月末	19,181	0.7	29,452.66	0.0	96.4	3.6
10月末	18,808	△ 1.3	28,892.69	△ 1.9	97.6	2.4
11月末	18,107	△ 5.0	27,821.76	△ 5.5	97.1	2.9
12月末	18,764	△ 1.5	28,791.71	△ 2.2	98.6	1.4
2022年 1 月末	17,590	△ 7.7	27,001.98	△ 8.3	97.7	2.3
2 月末	17,286	△ 9.3	26,526.82	△ 9.9	97.6	2.4
3 月末	18,278	△ 4.1	27,821.43	△ 5.5	98.1	1.9
4 月末	17,636	△ 7.4	26,847.90	△ 8.8	96.6	3.4
5 月末	17,927	△ 5.9	27,279.80	△ 7.3	98.3	1.6
(期末)2022年 6月15日	17,300	△ 9.2	26,326.16	△ 10.6	97.6	2.4

(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. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大による行動制限措置の適用が続いたことや、内閣支持率の低下を受けて政局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。しかし、2021年8月下旬からは感染状況の改善により株価が上昇すると、9月初めには菅首相の自民党総裁選挙への不出馬表明などが好感されて急騰しました。その後は新政権への期待の後退や中国の大手不動産会社の信用不安などで株価は反落しましたが、衆議院議員選挙で自民党が過半数を大きく上回ったことなどが好感されて11月中旬にかけて底堅く推移しました。年末にかけては、新型コロナウイルスの新変異株への警戒感から再び上値の重い展開になり、2022年に入ると、F R B（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め懸念による金利上昇を受けて世界的に株価は下落しました。さらに2月下旬からは、ロシアによるウクライナ侵攻という地政学リスクの顕在化を受け、株価下落が加速しました。3月後半は、F R Bの利上げ決定で悪材料出尽くし観測が強まったことや為替市場で円安が進行したことなどから、株価は一時的に反発しましたが、その後はF R Bの利上げペースが一層加速するとの懸念などから、当作成期末にかけて株価は下落しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークに連動する投資成果をめざして「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券を高位に組み入れて運用を行ってまいります。

■ストックインデックス225・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れて運用を行いました。

■ストックインデックス225・マザーファンド

株式の組み入れを中心に、日経平均先物取引も一部利用し、当作成期を通じて、実質株式組入比率をおおむね99%程度以上の水準に維持しました。

株式ポートフォリオにつきましては、ベンチマーク採用銘柄のうち当社独自の基準で財務リスクが高いと判断される銘柄を除いた残りすべての銘柄に投資を行い、ベンチマークの動きに連動するように、ポートフォリオを構築し運用しております。当作成期につきましては、採用銘柄すべてを組み入れて運用を行いました。

また、ベンチマーク採用銘柄の入替え時には、その都度、組入銘柄の入替えを行い、連動性の維持に努めました。

*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
ストックインデックス225・マザーファンド	日経平均株価

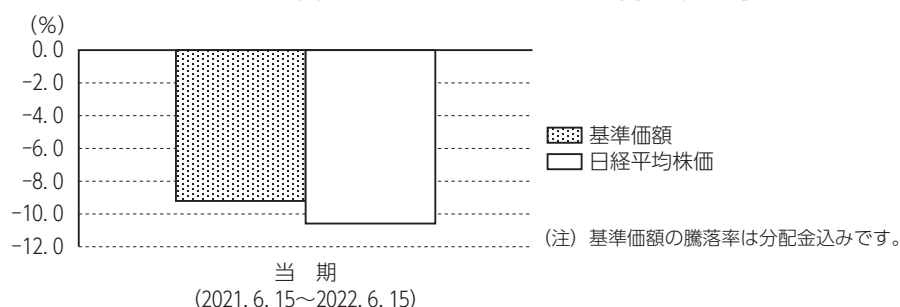
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△10.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△9.2%となりました。

ほぼ100%組み入れているマザーファンドに組入銘柄の配当金が計上されたのに対し、ベンチマークである日経平均株価には配当金の影響が考慮されていないことが、プラスのかい離要因となりました。

また、ファンドから運用管理費用が控除されたことがマイナス要因となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



*ベンチマークは日経平均株価です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	7,300

- （注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
 （注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
 （注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

■当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークに連動する投資成果をめざして「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券を高位に組み入れて運用を行ってまいります。

■ストックインデックス225・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

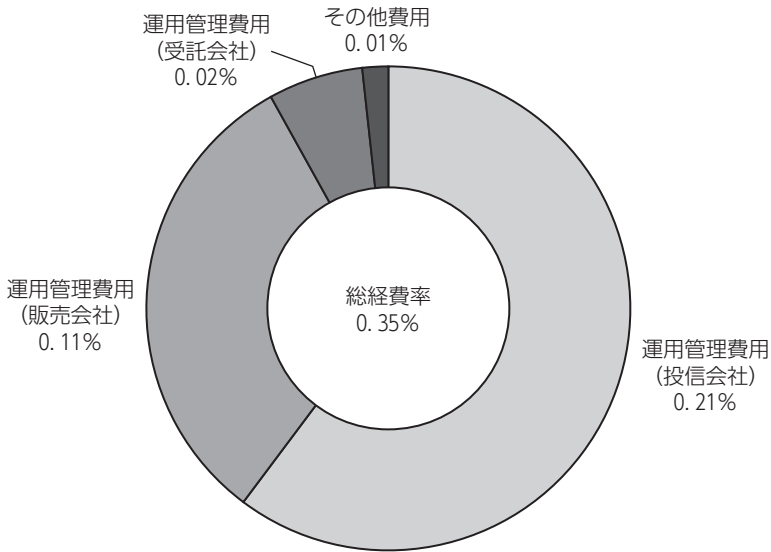
項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	62円	0. 341%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は18, 222円です。
(投 信 会 社)	(38)	(0. 209)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(20)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(4)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0. 002	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0. 000)	
(先物・オプション)	(0)	(0. 002)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	63	0. 348	

- (注 1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。
- (注 2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。
- (注 3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。
- (注 4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.35%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6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ストックインデックス225・マザーファンド	885,734	3,235,300	533,857	1,961,400

(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6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期
	ストックインデックス225・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	69,849,839千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	197,138,675千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.35

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	53,465	32,765	61.3	16,383	5,768	35.2
株式先物取引	93,074	37,737	40.5	91,973	33,075	36.0
コール・ローン	2,439,492	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合7.2%

※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。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

種 類	当 期		
	ストックインデックス225・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	39	12	168

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

種 類	当 期
	ストックインデックス225・マザーファンド
	買 付 額
	百万円
株式	1

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	267千円
うち利害関係人への支払額 (B)	99千円
(B) / (A)	37.1%

(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、大和証券株式会社、株式会社大和証券グループ本社です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ストックインデックス225・マザーファンド	3,793,099	4,144,976	14,450,216

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ストックインデックス225・マザーファンド	14,450,216	99.7
コール・ローン等、その他	47,390	0.3
投資信託財産総額	14,497,607	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

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	14,497,607,368円
コール・ローン等	42,390,413
ストックインデックス225・マザーファンド (評価額)	14,450,216,955
未収入金	5,000,000
(B) 負債	44,929,768
未払解約金	20,047,989
未払信託報酬	24,486,912
その他未払費用	394,867
(C) 純資産総額 (A - B)	14,452,677,600
元本	8,353,925,182
次期繰越損益金	6,098,752,418
(D) 受益権総口数	8,353,925,182口
1万口当り基準価額 (C / D)	17,300円

※期首における元本額は7,618,451,322円、当作成期間中における追加設定元本額は2,488,303,056円、同解約元本額は1,752,829,196円です。

※当期末の計算口数当りの純資産額は17,300円です。

■損益の状況

当期 自 2021年 6月16日 至 2022年 6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 7,601円
受取利息	1,196
支払利息	△ 8,797
(B) 有価証券売買損益	△ 1,218,952,995
売買益	125,508,264
売買損	△ 1,344,461,259
(C) 信託報酬等	△ 50,249,432
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 1,269,210,028
(E) 前期繰越損益金	3,054,593,116
(F) 追加信託差損益金	4,313,369,330
(配当等相当額)	(2,434,641,027)
(売買損益相当額)	(1,878,728,303)
(G) 合計 (D + E + F)	6,098,752,418
次期繰越損益金 (G)	6,098,752,418
追加信託差損益金	4,313,369,330
(配当等相当額)	(2,434,641,027)
(売買損益相当額)	(1,878,728,303)
分配準備積立金	3,054,599,616
繰越損益金	△ 1,269,216,528

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	3,044,166,903
(d) 分配準備積立金	3,054,599,616
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	6,098,766,519
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	6,098,766,519
(h) 受益権総口数	8,353,925,182口

「日経平均株価」に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延または中断に関して責任を負いません。また、「ダイワファンドラップ 日経225インデックス」について、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 日経 225インデックス）が投資対象としている「ストックインデックス 225・マザーファンド」の決算日（2021年9月21日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在におけるストックインデックス 225・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。

■ストックインデックス 2 2 5 ・マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2021年6月16日から2022年6月15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
ファーストリテイリング	62	4,286,740	69,140	ファーストリテイリング	19	1,431,372	75,335
東京エレクトロン	62	3,257,220	52,535	東京エレクトロン	19	1,025,214	53,958
ソフトバンクグループ	372	2,193,636	5,896	ソフトバンクグループ	114	746,984	6,552
村田製作所	220.8	2,138,543	9,685	ダイキン工業	19	511,862	26,940
キーエンス	27.6	1,816,904	65,829	ファナック	19	480,387	25,283
任天堂	27.6	1,501,634	54,407	KDDI	114	440,283	3,862
ファナック	62	1,418,750	22,883	アドバンテスト	38	396,197	10,426
ダイキン工業	62	1,409,300	22,730	テルモ	76	384,017	5,052
KDDI	372	1,368,144	3,677	信越化学	19	379,782	19,988
アドバンテスト	124	1,153,600	9,303	リクルートホールディングス	57	370,866	6,506

(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6月15日現在におけるストックインデックス 2 2 5 ・マザーファンド（60,104,604千口）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			旭化成	273	288,561	太平洋セメント	27.3	56,210
日本水産	273	144,963	昭和電工	27.3	70,352	東海カーボン	273	317,499
マルハニチロ	27.3	63,336	住友化学	273	151,515	TOTO	136.5	582,172
鉱業 (0.1%)			日産化学	273	1,831,830	日本碍子	273	517,062
I N P E X	109.2	181,490	東ソー	136.5	243,925	鉄鋼 (0.1%)		
建設業 (1.8%)			トクヤマ	54.6	98,989	日本製鉄	27.3	55,009
コムシスホールディングス	273	670,761	デンカ	54.6	181,272	神戸製鋼所	27.3	17,963
大成建設	54.6	218,400	信越化学	273	4,722,900	J F E ホールディングス	27.3	41,277
大林組	273	259,623	三井化学	54.6	171,990	大平洋金属	27.3	72,017
清水建設	273	195,468	三菱ケミカル HLDGS	136.5	109,445	非鉄金属 (0.9%)		
長谷工コーポレーション	54.6	85,121	U B E	27.3	57,002	日本軽金属HD	27.3	41,659
鹿島建設	136.5	196,287	花王	273	1,392,300	三井金属	27.3	89,271
大和ハウス	273	830,193	D I C	27.3	68,386	東邦亜鉛	27.3	62,489
積水ハウス	273	636,909	富士フイルム HLDGS	273	1,888,887	三菱マテリアル	27.3	53,972
日揮ホールディングス	273	511,329	資生堂	273	1,389,843	住友鉱山	136.5	667,894
食料品 (3.4%)			日東電工	273	2,566,200	DOWA ホールディングス	54.6	248,703
日清製粉G本社	273	409,227	医薬品 (7.0%)			古河電工	27.3	60,933
明治ホールディングス	54.6	339,066	協和キリン	273	770,406	住友電工	273	396,805
日本ハム	136.5	550,095	武田薬品	273	965,055	フジクラ	273	219,765
サッポロホールディングス	54.6	150,914	アステラス製薬	1,365	2,723,175	金属製品 (0.0%)		
アサヒグループホールディン	273	1,152,879	住友ファーマ	273	284,466	S U M C O	27.3	55,173
キリンHD	273	555,009	塩野義製薬	273	1,772,589	機械 (4.9%)		
宝ホールディングス	273	259,350	中外製薬	819	2,768,220	日本製鋼所	54.6	168,441
キッコーマン	273	1,815,450	エーザイ	273	1,387,932	オークマ	54.6	293,748
味の素	273	831,012	第一三共	819	2,523,339	アマダ	273	283,647
ニチレイ	136.5	302,347	大塚ホールディングス	273	1,176,903	小松製作所	273	901,446
日本たばこ産業	273	649,740	石油・石炭製品 (0.3%)			住友重機械	54.6	171,990
繊維製品 (0.1%)			出光興産	109.2	387,660	日立建機	273	904,995
東洋紡	27.3	27,846	ENEOS ホールディングス	273	147,065	クボタ	273	602,920
ユニチカ	27.3	6,279	ゴム製品 (0.8%)			荏原製作所	54.6	298,116
帝人	54.6	75,566	横浜ゴム	136.5	235,053	ダイキン工業	273	5,428,605
東レ	273	192,246	ブリヂストン	273	1,382,745	日本精工	273	208,299
パルプ・紙 (0.1%)			ガラス・土石製品 (1.0%)			N T N	273	76,440
王子ホールディングス	273	153,699	A G C	54.6	274,638	ジェイテクト	273	288,834
日本製紙	27.3	25,825	日本板硝子	27.3	10,565	三井 E&SHD	27.3	9,773
化学 (7.6%)			日本電気硝子	81.9	226,617	日立造船	54.6	46,355
クラレ	273	306,306	住友大阪セメント	27.3	97,870	三菱重工業	27.3	142,642

銘柄	2022年 6 月15日現在		銘柄	2022年 6 月15日現在		銘柄	2022年 6 月15日現在	
	株 数	評 価 額		株 数	評 価 額		株 数	評 価 額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
I H I	27. 3	107, 016	東日本旅客鉄道	27. 3	184, 821	三井不動産	273	788, 424
電気機器 (24. 2%)			西日本旅客鉄道	27. 3	130, 248	三菱地所	273	528, 664
コニカミノルタ	273	125, 580	東海旅客鉄道	27. 3	420, 693	東京建物	136. 5	233, 005
ミネベアミツミ	273	631, 722	ヤマトホールディングス	273	567, 567	住友不動産	273	951, 405
日立	54. 6	364, 455	NIPPON EXPRESS	27. 3	207, 753	サービス業 (4. 8%)		
三菱電機	273	383, 701	海運業 (0. 4%)			エムスリー	655. 2	2, 336, 443
富士電機	54. 6	315, 588	日本郵船	27. 3	264, 264	ディー・エヌ・エー	81. 9	141, 523
安川電機	273	1, 171, 170	商船三井	81. 9	262, 489	電通グループ	273	1, 147, 965
オムロン	273	1, 828, 827	川崎汽船	27. 3	251, 160	サイバーエージェント	218. 4	273, 000
ジーエス・ユアサ コーポ	54. 6	115, 369	空運業 (0. 0%)			楽天グループ	273	177, 177
日本電気	27. 3	139, 503	ANA ホールディングス	27. 3	66, 407	リクルートホールディングス	819	3, 289, 923
富士通	27. 3	466, 830	倉庫・運輸関連業 (0. 2%)			日本郵政	273	263, 390
沖電気	27. 3	21, 621	三菱倉庫	136. 5	434, 070	セコム	273	2, 212, 938
セイコーエプソン	546	1, 183, 728	情報・通信業 (11. 9%)					
パナソニック ホールディング	273	301, 801	ネクソン	546	1, 600, 872	株 数、金 額	51, 324	204, 507, 294
シャープ	273	280, 098	Z ホールディングス	109. 2	43, 297	銘柄数<比率>	225銘柄	<97. 6%>
ソニーグループ	273	3, 034, 395	トレンドマイクロ	273	1, 793, 610			
T D K	819	3, 591, 315	日本電信電話	109. 2	417, 580	(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。		
アルプスアルパイン	273	397, 761	K D D I	1, 638	7, 130, 214	(注 2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。		
横河電機	273	616, 161	ソフトバンク	273	398, 170	(注 3) 評価額の単位未満は切捨て。		
アドバンテスト	546	4, 220, 580	東宝	27. 3	131, 313			
キーエンス	27. 3	1, 262, 625	N T T データ	1, 365	2, 537, 535			
カシオ	273	341, 250	コナミホールディングス	273	2, 140, 320			
ファナック	273	5, 470, 920	ソフトバンクグループ	1, 638	8, 235, 864			
京セラ	546	3, 929, 016	卸売業 (2. 6%)					
太陽誘電	273	1, 408, 680	双日	27. 3	55, 364			
村田製作所	218. 4	1, 758, 120	伊藤忠	273	1, 010, 646			
SCREEN ホールディングス	54. 6	570, 024	丸紅	273	363, 909			
キヤノン	409. 5	1, 331, 284	豊田通商	273	1, 306, 305			
リコー	273	301, 392	三井物産	273	877, 149			
東京エレクトロン	273	13, 923, 000	住友商事	273	504, 777			
輸送用機器 (4. 8%)			三菱商事	273	1, 196, 559			
デンソー	273	2, 060, 604	小売業 (10. 5%)					
川崎重工業	27. 3	77, 286	J. フロント リテイリング	136. 5	151, 924			
日産自動車	273	145, 672	三越伊勢丹 H D	273	283, 920			
いすゞ自動車	136. 5	214, 441	セブン & アイ・HLDGS	273	1, 421, 238			
トヨタ自動車	1, 365	2, 839, 200	高島屋	136. 5	174, 447			
日野自動車	273	188, 916	丸井グループ	273	619, 983			
三菱自動車工業	27. 3	11, 984	イオン	273	592, 956			
マツダ	54. 6	60, 442	ファーストリテイリング	273	18, 329, 220			
本田技研	546	1, 804, 530	銀行業 (0. 6%)					
スズキ	273	1, 101, 555	コンコルディア・フィナンシャル	273	127, 491			
SUBARU	273	668, 167	あおぞら銀行	27. 3	72, 317			
ヤマハ発動機	273	704, 340	三菱 U F J フィナンシャル G	273	202, 074			
精密機器 (3. 8%)			りそなホールディングス	27. 3	13, 928			
テルモ	1, 092	4, 179, 084	三井住友トラスト H D	27. 3	112, 203			
ニコン	273	455, 637	三井住友フィナンシャル G	27. 3	109, 636			
オリンパス	1, 092	2, 953, 860	千葉銀行	273	203, 658			
シチズン時計	273	152, 880	ふくおかフィナンシャル G	54. 6	134, 971			
その他製品 (3. 1%)			静岡銀行	273	220, 857			
バンダイナムコ HLDGS	273	2, 540, 538	みずほフィナンシャル G	27. 3	41, 195			
凸版印刷	136. 5	318, 864	証券、商品先物取引業 (0. 3%)					
大日本印刷	136. 5	392, 847	大和証券 G 本社	273	168, 058			
ヤマハ	273	1, 452, 360	野村ホールディングス	273	133, 770			
任天堂	27. 3	1, 534, 533	松井証券	273	220, 857			
電気・ガス業 (0. 2%)			保険業 (0. 9%)					
東京電力 H D	27. 3	13, 431	SOMPO ホールディングス	54. 6	322, 904			
中部電力	27. 3	34, 261	M S & A D	81. 9	332, 432			
関西電力	27. 3	34, 234	第一生命 HLDGS	27. 3	72, 208			
東京瓦斯	54. 6	142, 779	東京海上 H D	136. 5	1, 014, 877			
大阪瓦斯	54. 6	132, 132	T & D ホールディングス	54. 6	87, 687			
陸運業 (1. 4%)			その他金融業 (0. 8%)					
東武鉄道	54. 6	161, 889	クレディセゾン	273	416, 325			
東急	136. 5	202, 020	オリックス	273	631, 858			
小田急電鉄	136. 5	232, 732	日本取引所グループ	273	566, 884			
京王電鉄	54. 6	242, 151	不動産業 (1. 3%)					
京成電鉄	136. 5	473, 655	東急不動産 H D	273	183, 456			

ストックインデックス225・マザーファンド

運用報告書 第20期 (決算日 2021年9月21日)

(作成対象期間 2020年9月24日～2021年9月21日)

ストックインデックス225・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、日経平均株価をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄
株式組入制限	無制限

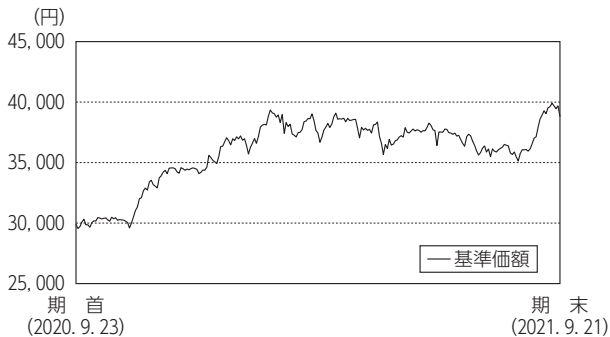
大和アセットマネジメント

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		日経平均株価		株式組入比率	株式先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) 2020年9月23日	29,884	—	23,346.49	—	98.4	0.6
9月末	29,859	△ 0.1	23,185.12	△ 0.7	98.0	2.0
10月末	29,594	△ 1.0	22,977.13	△ 1.6	98.1	1.9
11月末	34,080	14.0	26,433.62	13.2	98.5	1.4
12月末	35,428	18.6	27,444.17	17.6	98.7	1.3
2021年1月末	35,709	19.5	27,663.39	18.5	97.9	2.1
2月末	37,413	25.2	28,966.01	24.1	99.0	1.0
3月末	37,903	26.8	29,178.80	25.0	96.8	3.2
4月末	37,435	25.3	28,812.63	23.4	97.4	2.5
5月末	37,511	25.5	28,860.08	23.6	98.2	1.8
6月末	37,446	25.3	28,791.53	23.3	98.3	1.7
7月末	35,482	18.7	27,283.59	16.9	98.2	1.8
8月末	36,545	22.3	28,089.54	20.3	98.4	1.6
(期末) 2021年9月21日	38,825	29.9	29,839.71	27.8	97.8	1.5

(注1) 基準価額の騰落率は期首比。
(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：29,884円 期末：38,825円 騰落率：29.9%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークへの連動をめざした運用を行った結果、ベンチマークの動きを反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、国内外の新型コロナウイルスの感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、横ばい圏で推移しました。2020年11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が当選確実となって選挙結果に対する不確実性が後退したことや、それによって大型経済対策への期待が高まったこと、欧米において複数のワクチンの接種が始まったことなどが好感され、株価は上昇しました。2021年に入っても、1月に行われた米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利し、大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、3月には実際に米国で追加経済対策が発表されたことや、国内のウイルスの感染状況が改善したことなどが好感され、株価は上昇しました。その後は、国内で感染が再拡大して再び行動制限措置がとられたことや、内閣支持率の低下で政局の行方に不透明感が増したこと、また世界的にインフレ懸念が台頭して米国の金融緩和縮小の早期化観測が高まったことなどから、上値の重い展開となりました。9月に入ると、菅首相が自民党総裁選挙への不出馬を表明したことを受けて、来たる衆議院選挙での自民党大敗リスクが後退したことや新たな経済対策による景気回復期待などを背景に上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

株式の組み入れを中心に、日経平均先物取引も一部利用し、当作成期を通じて、実質株式組入比率をおおむね99%程度以上の水準に維持しました。

株式ポートフォリオにつきましては、ベンチマーク採用銘柄のうち当社独自の基準で財務リスクが高いと判断される銘柄を除いた残りすべての銘柄に投資を行い、ベンチマークの動きに連動するように、ポートフォリオを構築し運用しております。当作成期につきましては、原則として、ベンチマークに採用されている全銘柄を組み入れて運用を行いました。

また、ベンチマーク採用銘柄の入替え時には、その都度、組入銘柄の入替えを行い、連動性の維持に努めました。

◆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27.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は29.9%となりました。

- ・ファンドには保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークである日経平均株価では配当金の影響が考慮されないことが、プラス要因となりました。
- ・資金の流出に伴う現物株式および株式先物の売買等によるコスト負担等が、マイナス要因となりました。

*ベンチマークは日経平均株価です。

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入しております。

■売買および取引の状況

(1)株 式				
(2020年9月24日から2021年9月21日まで)				
	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 (5,707.3182)	千円 (22,448,831—)	千株 8,877.1	千円 33,973,327

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2)先物取引の種類別取引状況
 (2020年9月24日から2021年9月21日まで)

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株式先物取引	百万円 70,102	百万円 69,189	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
 株 式

当 期				期			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ファーストリテイリング	26	2,113,040	81,270	ファーストリテイリング	42	3,369,114	80,217
ネクソン	548	1,589,333	2,900	ファミリーマート	1,000	2,284,914	2,284
ソフトバンクグループ	156	1,215,576	7,792	ソフトバンクグループ	252	1,742,913	6,916
東京エレクトロン	26	1,203,820	46,300	東京エレクトロン	42	1,615,012	38,452
ファナック	26	663,190	25,507	ファナック	42	1,038,393	24,723
ダイキン工業	26	581,080	22,349	ダイキン工業	42	1,035,004	24,642
KDDI	156	545,064	3,494	エムスリー	100.8	834,106	8,274
アドバンテスト	52	493,560	9,491	KDDI	252	818,323	3,247
信越化学	26	471,800	18,146	テルモ	168	757,926	4,511
エムスリー	62.4	460,982	7,387	信越化学	42	723,096	17,216

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
 (1)国内株式

銘 柄	期 首	当 期 末		銘 柄	期 首	当 期 末		銘 柄	期 首	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				味の素	250	234	810,576	日本化薬	250	—	—
日本水産	250	234	150,228	ニチレイ	125	117	348,660	花王	250	234	1,563,822
マルハニチロ	25	23.4	62,103	日本たばこ産業	250	234	506,376	D I C	25	23.4	76,986
鉱業 (0.0%)				繊維製品 (0.1%)				富士フィルム HLDGS	250	234	2,268,396
I N P E X	100	93.6	73,756	東洋紡	25	23.4	32,666	資生堂	250	234	1,787,292
建設業 (1.7%)				ユニチカ	25	23.4	9,032	日東電工	250	234	1,944,540
コムシスホールディングス	250	234	698,724	帝人	50	46.8	76,003	医薬品 (7.4%)			
大成建設	50	46.8	168,480	東レ	250	234	170,188	協和キリン	250	234	966,420
大林組	250	234	219,024	パルプ・紙 (0.1%)				武田薬品	250	234	879,606
清水建設	250	234	197,964	王子ホールディングス	250	234	136,188	アステラス製薬	1,250	1,170	2,194,920
長谷工コーポレーション	50	46.8	70,200	日本製紙	25	23.4	28,711	大日本住友製薬	250	234	481,338
鹿島建設	125	117	171,522	化学 (8.2%)				塩野義製薬	250	234	1,724,814
大和ハウス	250	234	889,200	クラレ	250	234	247,338	中外製薬	750	702	2,898,558
積水ハウス	250	234	555,867	旭化成	250	234	290,979	エーザイ	250	234	1,960,686
日揮ホールディングス	250	234	229,320	昭和電工	25	23.4	63,671	第一三共	250	702	2,120,040
食料品 (3.8%)				住友化学	250	234	138,294	大塚ホールディングス	250	234	1,136,538
日清製粉G本社	250	234	450,684	日産化学	250	234	1,619,280	石油・石炭製品 (0.2%)			
明治ホールディングス	50	46.8	343,044	東ソー	125	117	243,477	出光興産	100	93.6	270,597
日本ハム	125	117	512,460	トクヤマ	50	46.8	103,615	ENEOSホールディングス	250	234	107,663
サッポロホールディングス	50	46.8	117,889	デンカ	50	46.8	189,306	ゴム製品 (0.8%)			
アサヒグループホールディン	250	234	1,283,490	信越化学	250	234	4,949,100	横浜ゴム	125	117	232,128
キリンHD	250	234	479,466	三井化学	50	46.8	184,392	ブリヂストン	250	234	1,240,902
宝ホールディングス	250	234	366,210	三菱ケミカル HLDGS	125	117	120,744	ガラス・土石製品 (1.0%)			
キッコーマン	250	234	2,227,680	宇部興産	25	23.4	53,539	A G C	50	46.8	266,760

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
日本板硝子	25	23.4	13,455		日産自動車	250	234	130,174		ファーストリテイリング	250	234	17,463,420	
日本電気硝子	75	70.2	169,041		いすゞ自動車	125	117	173,043		銀行業 (0.6%)				
住友大阪セメント	25	23.4	73,827		トヨタ自動車	250	234	2,323,386		コンコルディア・フィナンシャル	250	234	103,896	
太平洋セメント	25	23.4	57,330		日野自動車	250	234	237,042		新生銀行	25	23.4	44,132	
東海カーボン	250	234	358,956		三菱自動車工業	25	23.4	6,528		あおぞら銀行	25	23.4	63,975	
TOTO	125	117	652,860		マツダ	50	46.8	43,758		三菱UFJフィナンシャルG	250	234	148,005	
日本碍子	250	234	440,856		本田技研	500	468	1,562,184		りそなホールディングス	25	23.4	10,387	
鉄鋼 (0.1%)					スズキ	250	234	1,190,124		三井住友トラストHD	25	23.4	89,622	
日本製鉄	25	23.4	48,122		SUBARU	250	234	481,338		三井住友フィナンシャルG	25	23.4	91,938	
神戸製鋼所	25	23.4	16,029		ヤマハ発動機	250	234	721,890		千葉銀行	250	234	166,842	
JFEホールディングス	25	23.4	41,230		精密機器 (3.9%)					ふくおかフィナンシャルG	50	46.8	94,348	
大平洋金属	25	23.4	44,319		テルモ	1,000	936	4,975,776		静岡銀行	250	234	217,152	
非鉄金属 (0.8%)					ニコン	250	234	307,476		みずほフィナンシャルG	250	23.4	37,486	
日本軽金属HD	250	23.4	47,174		オリンパス	1,000	936	2,177,136		証券・商品先物取引業 (0.2%)				
三井金属	25	23.4	76,752		シチズン時計	250	234	122,850		大和証券G本社	250	234	156,241	
東邦亜鉛	25	23.4	67,134		その他製品 (2.2%)					野村ホールディングス	250	234	128,957	
三菱マテリアル	25	23.4	52,392		バンダイナムコHLDGS	250	234	2,078,622		松井証券	250	234	194,922	
住友鉱山	125	117	484,497		凸版印刷	125	117	233,064		保険業 (0.7%)				
DOWAホールディングス	50	46.8	214,110		大日本印刷	125	117	322,803		SOMPOホールディングス	62.5	58.5	297,063	
古河電工	25	23.4	56,277		ヤマハ	250	234	1,701,180		MS&AD	75	70.2	269,357	
住友電工	250	234	349,245		電気・ガス業 (0.1%)					第一生命HLDGS	25	23.4	55,188	
フジクラ	250	234	160,758		東京電力HD	25	23.4	7,230		東京海上HD	125	117	702,000	
金属製品 (0.2%)					中部電力	25	23.4	31,917		T&Dホールディングス	50	46.8	72,072	
SUMCO	25	23.4	55,809		関西電力	25	23.4	26,945		その他金融業 (0.5%)				
東洋製罐グループHD	250	234	314,730		東京瓦斯	50	46.8	101,017		クレディセゾン	250	234	317,538	
機械 (5.1%)					大阪瓦斯	50	46.8	99,637		日本取引所グループ	250	234	680,472	
日本製鋼所	50	46.8	138,387		陸運業 (1.5%)					不動産業 (1.2%)				
オークマ	50	46.8	263,952		東武鉄道	50	46.8	139,370		東急不動産HD	250	234	155,376	
アマダ	250	234	281,034		東急	125	117	188,136		三井不動産	250	234	590,265	
小松製作所	250	234	635,193		小田急電鉄	125	117	301,275		三菱地所	250	234	404,937	
住友重機械	50	46.8	141,570		京王電鉄	50	46.8	280,332		東京建物	125	117	198,783	
日立建機	250	234	746,460		京成電鉄	125	117	415,935		住友不動産	250	234	909,792	
クボタ	250	234	566,046		東日本旅客鉄道	25	23.4	165,859		サービス業 (7.1%)				
荏原製作所	50	46.8	272,376		西日本旅客鉄道	25	23.4	121,492		エムスリー	600	561.6	4,823,020	
ダイキン工業	250	234	6,243,120		東海旅客鉄道	25	23.4	382,941		ディー・エヌ・エー	75	70.2	139,276	
日本精工	250	234	177,138		日本通運	25	23.4	190,008		電通グループ	250	234	982,800	
NTN	250	234	58,500		ヤマトホールディングス	250	234	681,876		サイバーエージェント	50	187.2	410,529	
ジェイテクト	250	234	224,874		海運業 (0.3%)					楽天グループ	250	234	259,740	
日立造船	50	46.8	43,056		日本郵船	25	23.4	235,404		リクルートホールディングス	750	702	4,902,066	
三菱重工業	25	23.4	70,036		商船三井	25	23.4	215,046		日本郵政	250	234	226,231	
IHI	25	23.4	60,114		川崎汽船	25	23.4	171,054		セコム	250	234	1,965,600	
電気機器 (23.7%)					空運業 (0.0%)									
日清紡ホールディングス	250	234	195,858		ANAホールディングス	25	23.4	63,414		合計	株数	千株	千株	千円
コニカミノルタ	250	234	140,634		倉庫・運輸関連業 (0.2%)					株数、金額	45,587.5	42,599.7	193,896,831	
ミネベアミツミ	250	234	688,662		三菱倉庫	125	117	384,930		銘柄数<比率>	225銘柄	225銘柄	<97.8%>	
日立	50	46.8	301,532		情報・通信業 (11.1%)									
三菱電機	250	234	368,901		ネクソン	—	468	818,064		(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する				
富士電機	50	46.8	240,084		Zホールディングス	100	93.6	68,749		各業種の比率。				
安川電機	250	234	1,373,580		トレンドマイクロ	250	234	1,453,140		(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価				
オムロン	250	234	2,686,320		スカパーJSATHD	25	23.4	9,968		額の比率。				
ジーエス・ユアサコーポ	50	46.8	120,931		日本電信電話	100	93.6	301,953		(注3) 評価額の単位未満は切捨て。				
日本電気	25	23.4	145,548		KDDI	1,500	1,404	5,315,544						
富士通	25	23.4	492,102		ソフトバンク	—	234	364,104		(2)先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)				
沖電気	25	23.4	23,002		NTTドコモ	25	—	—		銘柄別	当期末			
セイコーエプソン	500	468	1,066,572		東宝	25	23.4	123,084		買建額	売建額			
パナソニック	250	234	323,973		NTTデータ	1,250	1,170	2,544,750		百万円	百万円			
シャープ	—	234	324,324		コナミホールディングス	250	234	1,600,560		国内	日経平均	2,886	—	
ソニーグループ	250	234	2,887,560		ソフトバンクグループ	1,500	1,404	8,885,916		(注) 単位未満は切捨て。				
TDK	250	234	2,915,640		卸売業 (2.0%)									
アルプスアルパイン	250	234	283,842		双日	25	23.4	8,283						
横河電機	250	234	460,512		伊藤忠	250	234	808,470						
アドバンテスト	500	468	5,194,800		丸紅	250	234	216,309						
カシオ	250	234	424,242		豊田通商	250	234	1,117,350						
ファナック	250	234	5,984,550		三井物産	250	234	572,130						
京セラ	500	468	3,274,128		住友商事	250	234	374,400						
太陽誘電	250	234	1,729,260		三菱商事	250	234	826,488						
SCREENホールディングス	50	46.8	477,828		小売業 (10.5%)									
キャノン	375	351	943,488		J.フロントリテイリング	125	117	118,638						
リコー	250	234	257,634		三越伊勢丹HD	250	234	186,966						
東京エレクトロン	250	234	12,652,380		セブン&アイHLDGS	250	234	1,199,016						
輸送用機器 (4.5%)					ファミリーマート	1,000	—	—						
デンソー	250	234	1,811,160		高島屋	125	117	135,486						
三井E&SHD	25	23.4	11,349		丸井グループ	250	234	489,762						
川崎重工業	25	23.4	57,236		イオン	250	234	706,212						

■有価証券の貸付及び借入の状況

区 分	当 期 末	
	貸 付	借 入
株式	1,461,700 (株)	— (株)

(注) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

■投資信託財産の構成

2021年9月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	193,896,831 千円	93.6 %
コール・ローン等、その他	13,352,544	6.4
投資信託財産総額	207,249,376	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年9月21日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	209,030,267,077円
コール・ローン等	11,594,808,498
株式（評価額）	193,896,831,960
未収入金	1,657,155,991
未収配当金	96,876,500
未収利息	515,646
その他未収収益	360,722
差入委託証拠金	1,783,717,760
(B) 負債	10,801,260,975
未払金	30,879,510
未払解約金	589,590,000
差入委託証拠金代用有価証券	1,810,860,000
受入担保金	8,369,931,465
(C) 純資産総額（A－B）	198,229,006,102
元本	51,056,738,772
次期繰越損益金	147,172,267,330
(D) 受益権総口数	51,056,738,772口
1万口当り基準価額（C／D）	38,825円

＊期首における元本額は55,323,152,743円、当作成期間中における追加設定元本額は12,733,160,542円、同解約元本額は16,999,574,513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、ストックインデックス ファンド225 20,583,545,296円、適格機関投資家専用・ダイワ・ストックインデックスファンド225 V A333,474,643円、大和 スtock インデックス 225 ファンド7,295,860,497円、D－I's 日経225インデックス113,106,768円、iFree 日経225インデックス6,285,660,509円、DC・ダイワ・ストックインデックス225（確定拠出年金専用ファンド）5,483,055,624円、ダイワ・ノーロード 日経225ファンド307,165,744円、ダイワファンドラップ 日経225インデックス3,954,737,892円、ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）169,533,410円、ダイワ・インデックスセレクト 日経225 6,530,598,389円です。

＊当期末の計算口数当りの純資産額は38,825円です。

■損益の状況

当期 自 2020年9月24日 至 2021年9月21日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,842,355,761円
受取配当金	2,804,132,530
受取利息	5,995,539
その他収益金	36,011,662
支払利息	△ 3,783,970
(B) 有価証券売買損益	42,818,862,667
売買益	46,108,931,694
売買損	△ 3,290,069,027
(C) 先物取引等損益	999,915,770
取引益	1,395,396,780
取引損	△ 395,481,010
(D) その他費用	△ 38,717
(E) 当期損益金（A＋B＋C＋D）	46,661,095,481
(F) 前期繰越損益金	110,002,206,988
(G) 解約差損益金	△ 42,547,538,597
(H) 追加信託差損益金	33,056,503,458
(I) 合計（E＋F＋G＋H）	147,172,267,330
次期繰越損益金（I）	147,172,267,330

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

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

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)

運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2022年6月15日)
(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年 9月26日）		
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの受益証券	
	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、外国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざしております。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/>

<2731>

最近5期の運用実績

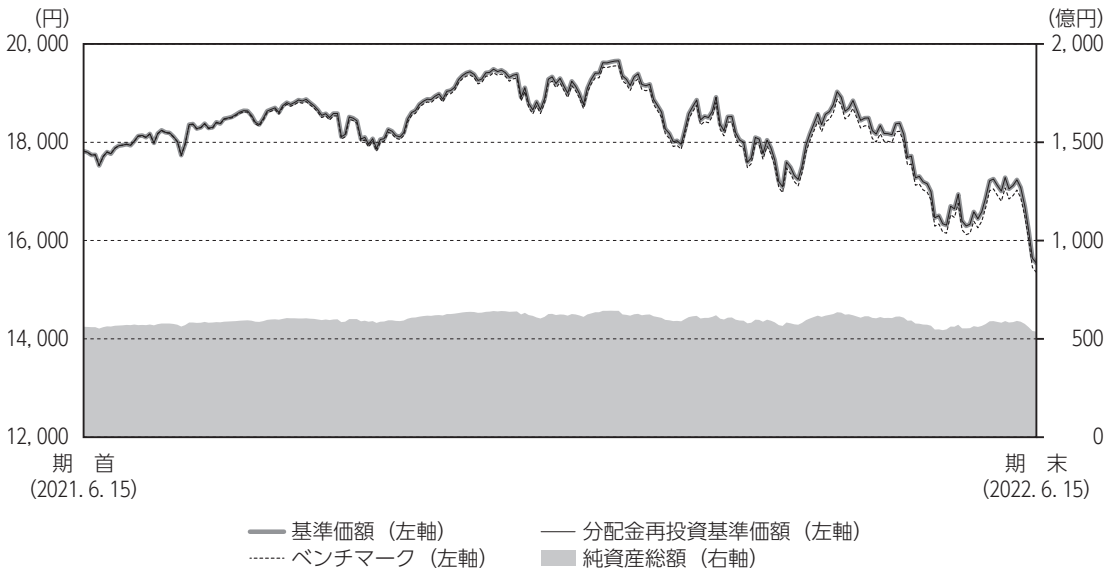
決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
2 期末 (2018年 6 月15日)	12,400	0	10.8	12,054	8.9	95.8	3.4	—	2.3	31,820
3 期末 (2019年 6 月17日)	12,648	0	2.0	12,074	0.2	91.6	6.0	—	2.8	36,065
4 期末 (2020年 6 月15日)	12,825	0	1.4	12,067	△ 0.1	95.0	1.9	—	2.7	42,369
5 期末 (2021年 6 月15日)	17,819	0	38.9	16,570	37.3	94.2	3.7	—	2.4	56,165
6 期末 (2022年 6 月15日)	15,540	0	△ 12.8	14,276	△ 13.8	95.9	6.0	—	2.5	53,716

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注2) MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) は、MSCI Inc. (「MSCI」) の承諾を得て、MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCI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。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>]
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
(注6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。
(注7) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



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

■基準価額・騰落率

期 首：17,819円
期 末：15,540円 (分配金 0 円)
騰落率：△12.8% (分配金込み)

■基準価額の主な変動要因

「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の受益証券を通じて、ベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行った結果、海外株式市況が下落したことを受け、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首) 2021年 6 月 15 日	17,819	—	16,570	—	94.2	3.7	—	2.4
6 月 末	17,960	0.8	16,699	0.8	93.7	4.3	—	2.3
7 月 末	18,382	3.2	17,086	3.1	92.0	4.4	—	2.3
8 月 末	18,807	5.5	17,457	5.4	91.2	6.5	—	2.2
9 月 末	18,101	1.6	16,784	1.3	94.3	4.9	—	2.3
10 月 末	19,037	6.8	17,646	6.5	94.0	5.8	—	2.3
11 月 末	19,109	7.2	17,696	6.8	93.0	3.7	—	2.3
12 月 末	19,636	10.2	18,170	9.7	93.4	5.7	—	2.4
2022年 1 月 末	18,263	2.5	16,891	1.9	93.0	4.4	—	2.3
2 月 末	18,099	1.6	16,717	0.9	92.5	5.4	—	2.3
3 月 末	18,915	6.2	17,442	5.3	96.8	6.6	—	2.5
4 月 末	17,307	△ 2.9	15,950	△ 3.7	95.8	6.9	—	2.7
5 月 末	17,253	△ 3.2	15,856	△ 4.3	88.8	8.1	—	2.3
(期末) 2022年 6 月 15 日	15,540	△ 12.8	14,276	△ 13.8	95.9	6.0	—	2.5

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■海外株式市況

海外株式市況は下落しました。

海外株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展により経済活動の正常化が順次進んだことや、好調な経済指標の発表などから上昇しました。2021年9月には、中国の大手不動産会社の資金繰り問題や米国の債務上限問題、米国金利上昇に対する警戒感など複数のリスク要因が嫌気され、軟調な推移となりました。2022年に入ると、2021年12月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）議事録を受け、米国の金融引き締めに対する懸念が高まり下落しました。2月以降は、欧米中央銀行高官の金融政策に対する発言やロシアのウクライナへの侵攻、ロシアとウクライナの散発的な停戦協定による状況改善期待などから、一進一退の展開となりました。その後は、FRB（米国連邦準備制度理事会）の利上げペースが一層加速するとの懸念などから下落し、当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。また、保有実質外貨建資産については、為替ヘッジを行います。

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

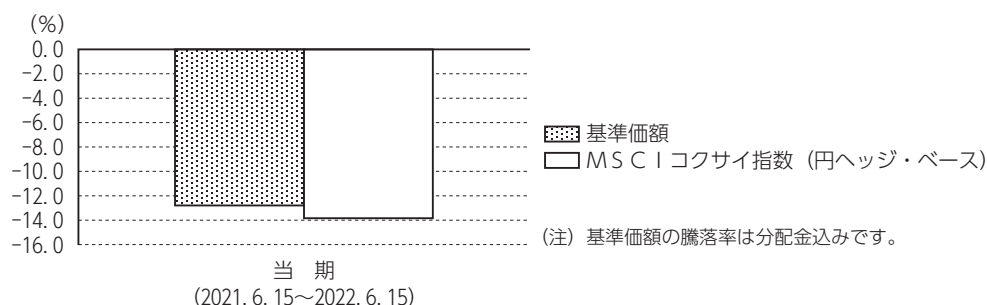
組入ファンド	ベンチマーク
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	M S C I コクサイ指数（円ヘッジ・ベース）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△13.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△12.8%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークはM S C I コクサイ指数（円ヘッジ・ベース）です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	6,426

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
 （注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
 （注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。また、保有実質外貨建資産については、為替ヘッジを行います。

1万口当りの費用の明細

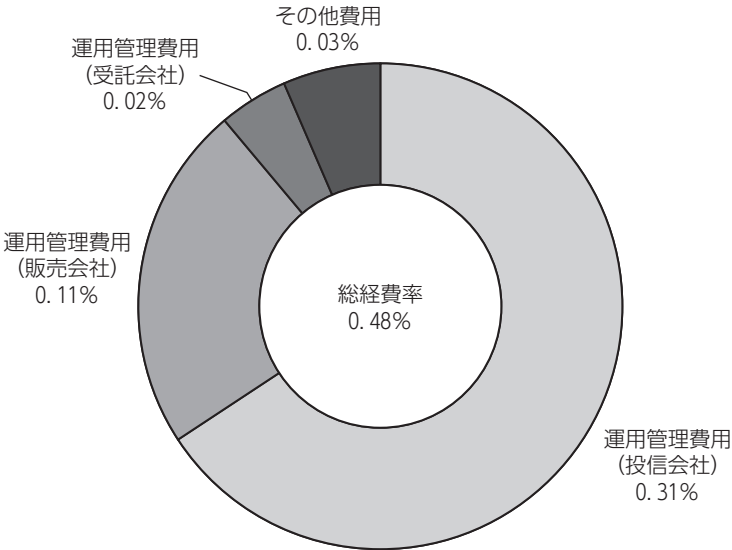
項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	82円	0. 445%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は18, 299円です。
(投 信 会 社)	(57)	(0. 313)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(20)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(4)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0. 006	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)	(1)	(0. 003)	
(先物・オプション)	(0)	(0. 002)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 000)	
有価証券取引税	1	0. 003	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)	(1)	(0. 003)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	6	0. 031	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)	(1)	(0. 004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(2)	(0. 013)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	89	0. 485	

- (注 1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。
- (注 2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。
- (注 3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。
- (注 4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.48％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6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	4, 278, 294	12, 023, 869	2, 410, 717	6, 952, 646

(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6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期
	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	17, 819, 330千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	74, 812, 154千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0. 23

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	20, 363, 112	22, 230, 689	53, 707, 123

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	53, 707, 123	99. 7
コール・ローン等、その他	158, 781	0. 3
投資信託財産総額	53, 865, 905	100. 0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝135. 01円、1カナダ・ドル＝104. 20円、1オーストラリア・ドル＝93. 10円、1香港・ドル＝17. 20円、1シンガポール・ドル＝96. 95円、1ニュージーランド・ドル＝83. 95円、1イギリス・ポンド＝162. 21円、1イスラエル・シェケル＝38. 942円、1スイス・フラン＝135. 01円、1デンマーク・クローネ＝18. 93円、1ノルウェー・クローネ＝13. 49円、1スウェーデン・クローネ＝13. 25円、1ユーロ＝140. 80円です。

(注3) 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（72, 926, 239千円）の投資信託財産総額（76, 386, 708千円）に対する比率は、95. 5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	53, 865, 905, 713円
コール・ローン等	150, 841, 916
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（評価額）	53, 707, 123, 797
未収入金	7, 940, 000
(B) 負債	149, 795, 757
未払解約金	15, 602, 369
未払信託報酬	133, 096, 197
その他未払費用	1, 097, 191
(C) 純資産総額 (A - B)	53, 716, 109, 956
元本	34, 566, 355, 532
次期繰越損益金	19, 149, 754, 424
(D) 受益権総口数	34, 566, 355, 532口
1万口当り基準価額 (C / D)	15, 540円

* 期首における元本額は31, 520, 778, 793円、当作成期間中における追加設定元本額は10, 317, 685, 523円、同解約元本額は7, 272, 108, 784円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は15, 540円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 27, 894円
受取利息	3, 513
支払利息	△ 31, 407
(B) 有価証券売買損益	△ 7, 906, 147, 741
売買益	393, 355, 650
売買損	△ 8, 299, 503, 391
(C) 信託報酬等	△ 268, 994, 813
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 8, 175, 170, 448
(E) 前期繰越損益金	12, 812, 293, 209
(F) 追加信託差損益金	14, 512, 631, 663
(配当等相当額)	(9, 401, 109, 949)
(売買損益相当額)	(5, 111, 521, 714)
(G) 合計 (D + E + F)	19, 149, 754, 424
次期繰越損益金 (G)	19, 149, 754, 424
追加信託差損益金	14, 512, 631, 663
(配当等相当額)	(9, 401, 109, 949)
(売買損益相当額)	(5, 111, 521, 714)
分配準備積立金	12, 812, 314, 874
繰越損益金	△ 8, 175, 192, 113

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	9, 401, 109, 949
(d) 分配準備積立金	12, 812, 314, 874
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	22, 213, 424, 823
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	22, 213, 424, 823
(h) 受益権総口数	34, 566, 355, 532口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の決算日（2022年1月11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6月15日）現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2021年6月16日から2022年6月15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
AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.832	315,115	378,744	APPLE INC (アメリカ)	27.233	560,521	20,582
APPLE INC (アメリカ)	14.364	281,276	19,582	MICROSOFT CORP (アメリカ)	10.8	412,091	38,156
MICROSOFT CORP (アメリカ)	7.1	254,077	35,785	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.677	255,389	377,236
TESLA INC (アメリカ)	2.37	239,795	101,179	TESLA INC (アメリカ)	1.335	169,258	126,785
SEA LTD-ADR (ケイマン諸島)	6.1	124,734	20,448	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.452	151,433	335,029
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.336	107,964	321,321	ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.436	147,070	337,316
SNOWFLAKE INC-CLASS A (アメリカ)	2.409	80,014	33,214	NVIDIA CORP (アメリカ)	3.556	111,656	31,399
NVIDIA CORP (アメリカ)	2.667	69,792	26,168	META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)	3.674	110,658	30,119
AIRBNB INC-CLASS A (アメリカ)	3.796	69,074	18,196	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	2.4	100,169	41,737
ASTRAZENECA PLC (イギリス)	4.872	68,765	14,114	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	5.19	90,457	17,429

(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6月15日現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（30,012,407千円）の内容です。

(1) 外国株式

銘 柄	2022年 6 月15日現在			業 種 等
	株 数	価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	12. 95	174	23, 501	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	11. 66	561	75, 818	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	20. 63	278	37, 648	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	15. 94	130	17, 651	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7. 46	106	14, 408	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	63. 3	186	25, 219	金融
ABBOTT LABORATORIES	204. 45	2, 104	284, 143	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	39. 5	127	17, 171	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	21. 4	338	45, 716	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	38. 8	125	16, 904	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	69. 05	452	61, 089	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5	203	27, 485	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	69. 34	660	89, 169	情報技術
QORVO INC	12. 83	124	16, 743	情報技術
AFLAC INC	73. 4	394	53, 225	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	15. 06	171	23, 185	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	18. 35	155	21, 043	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	55. 15	2, 045	276, 105	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	24. 29	226	30, 580	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	14. 07	394	53, 283	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	17. 24	166	22, 512	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24. 66	589	79, 644	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	81. 05	1, 485	200, 555	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	26. 56	177	23, 932	金融
AUTOZONE INC	2. 32	471	63, 696	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	25. 66	400	54, 050	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	123. 65	97	13, 104	ヘルスケア
CELANESE CORP	12. 11	164	22, 269	素材
DR HORTON INC	37. 92	249	33, 645	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	24. 5	87	11, 772	ヘルスケア
AUTODESK INC	25. 07	430	58, 078	情報技術
MOODY'S CORP	18. 84	485	65, 543	金融
DEVON ENERGY CORP	72. 76	513	69, 342	エネルギー
ALBEMARLE CORP	13. 24	295	39, 920	素材
ATMOS ENERGY CORP	19. 85	209	28, 284	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	28. 7	159	21, 547	公益事業
CITIGROUP INC	235. 48	1, 082	146, 116	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	50. 58	1, 032	139, 396	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	56. 49	510	68, 976	公益事業
ALLEGHANY CORP	1. 46	121	16, 399	金融
DOMINO'S PIZZA INC	4. 07	153	20, 722	一般消費財・サービス

銘柄	柄	2022年6月15日現在			業 種 等
		株 数	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
HESS CORP		32.31	387	52,376	エネルギー
DAVITA INC		7.09	63	8,612	ヘルスケア
DANAHER CORP		78.26	1,897	256,138	ヘルスケア
FORTIVE CORP		37.94	212	28,720	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN		63.76	599	80,960	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO		63.03	521	70,349	生活必需品
BUNGE LTD		16.93	176	23,851	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD		37.5	443	59,939	情報技術
APPLE INC		1,882.24	24,988	3,373,713	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		33.87	311	41,996	金融
BOEING CO/THE		62.67	765	103,360	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP		17.41	202	27,364	金融
BECTON DICKINSON AND CO		34.52	815	110,138	ヘルスケア
LEIDOS HOLDINGS INC		14	137	18,506	資本財・サービス
NISOURCE INC		62.99	173	23,471	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC		14.04	149	20,159	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		89.05	361	48,811	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC		478.95	2,354	317,883	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		148.59	4,125	556,977	金融
ANSYS INC		9.93	228	30,802	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP		149.34	690	93,230	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE		88.22	841	113,650	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		247.85	1,806	243,839	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO		336.97	3,843	518,908	金融
T ROWE PRICE GROUP INC		29.88	321	43,439	金融
LKQ CORP		33	160	21,617	一般消費財・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B		36.65	238	32,241	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC		31.49	451	60,961	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC		12.69	308	41,644	金融
DOLLAR GENERAL CORP		26.46	608	82,171	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC		24.12	1,072	144,830	情報技術
CATERPILLAR INC		60.68	1,254	169,328	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC		27.52	150	20,308	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC		27.67	115	15,630	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES		5.74	120	16,235	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP		33.84	211	28,563	公益事業
MOSAIC CO/THE		42.85	225	30,505	素材
DELTA AIR LINES INC		13.58	42	5,753	資本財・サービス
CORNING INC		91.15	292	39,502	情報技術
CISCO SYSTEMS INC		473.34	2,031	274,219	情報技術
MORGAN STANLEY		150.47	1,127	152,280	金融
MSCI INC		9.38	366	49,515	金融
FAIR ISAAC CORP		3.25	123	16,647	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC		3.22	62	8,498	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		27.8	158	21,416	情報技術
BROADCOM INC		47.46	2,468	333,302	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC		14.16	189	25,525	ヘルスケア
ARAMARK		31.73	96	12,992	一般消費財・サービス
DTE ENERGY COMPANY		21.62	257	34,767	公益事業
CENTENE CORP		65.39	498	67,298	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC		12.31	132	17,869	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP		66.82	238	32,170	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO		23.34	357	48,284	金融
GARTNER INC		9.35	219	29,614	情報技術
SPLUNK INC		19.21	166	22,426	情報技術
DOMINION ENERGY INC		91.9	685	92,559	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP		43.42	382	51,621	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP		14	77	10,516	資本財・サービス
DEERE & CO		33.11	1,081	145,987	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC		16.57	204	27,639	資本財・サービス
POOL CORP		4.38	153	20,663	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC		32.97	369	49,921	情報技術
VMWARE INC-CLASS A		24.85	301	40,702	情報技術
CABLE ONE INC		0.6	73	9,913	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC		7.66	121	16,384	一般消費財・サービス
NASDAQ INC		13.28	193	26,153	金融
VAIL RESORTS INC		4.92	113	15,334	一般消費財・サービス
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A		63.6	75	10,235	コミュニケーション・サービス
TARGA RESOURCES CORP		28.16	186	25,206	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC		8.74	115	15,577	金融
WESTLAKE CORP		5.72	65	8,832	素材
CONSOLIDATED EDISON INC		39.99	355	47,932	公益事業
COGNEX CORP		19.94	85	11,581	情報技術
WEBSTER FINANCIAL CORP		22	99	13,383	金融
TELEFLEX INC		5.63	142	19,193	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		9.79	158	21,335	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES		8.52	239	32,278	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A		2.41	113	15,291	ヘルスケア

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘	柄	2022年6月15日現在			業 種 等
		株 数	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
CATALENT INC		18.63	194	26,231	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A		16.6	297	40,188	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC		6.9	180	24,378	ヘルスケア
IDEX CORP		8.69	155	21,049	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO		88.91	660	89,151	生活必需品
ROLLINS INC		26.85	88	11,882	資本財・サービス
AMETEK INC		25.97	289	39,038	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC		27.07	221	29,968	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION		16.44	74	10,025	資本財・サービス
HEICO CORP		5.35	71	9,634	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC		7.16	171	23,214	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC		3.99	139	18,892	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A		30.45	296	40,074	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC		4.67	145	19,581	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP		51.11	2,324	313,828	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC		11.28	80	10,847	情報技術
EPAM SYSTEMS INC		6.24	173	23,450	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC		15.87	123	16,656	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC		3.18	382	51,691	一般消費財・サービス
UGI CORP		20.85	82	11,178	公益事業
CUMMINS INC		16.04	315	42,577	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC		88.74	662	89,424	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE		15.67	254	34,378	情報技術
SIGNATURE BANK		6.92	123	16,635	金融
COSTAR GROUP INC		46.91	258	34,940	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP		6.77	275	37,144	金融
AMERCO		1.19	55	7,460	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE		10.77	257	34,820	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC		5.36	330	44,606	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC		8.37	148	20,014	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN		31.86	379	51,247	一般消費財・サービス
DEXCOM INC		44.16	306	41,322	ヘルスケア
NORDSON CORP		5.95	119	16,132	資本財・サービス
COPART INC		23.84	246	33,341	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC		19.52	292	39,433	エネルギー
SEAGEN INC		15.45	223	30,170	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC		8.31	197	26,710	ヘルスケア
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC		9.71	183	24,715	金融
TRANSDIGM GROUP INC		5.87	309	41,816	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP		4.3	139	18,820	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC		12.03	109	14,815	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC		25.6	208	28,088	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC		231.08	413	55,813	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC		28.39	508	68,716	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC		4.2	112	15,223	金融
COTERRA ENERGY INC		105.27	327	44,215	エネルギー
T-MOBILE US INC		75.5	942	127,313	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C		17.86	53	7,279	不動産
COCA-COLA CO/THE		472.06	2,796	377,489	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE		25.75	130	17,618	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC		19.25	189	25,625	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC		38.51	88	11,999	金融
CSX CORP		252.87	741	100,166	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS		10.44	223	30,143	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC		15.63	159	21,509	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC		1,057.4	10,818	1,460,573	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP		70.32	608	82,122	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP		486.82	4,678	631,622	エネルギー
AES CORP		74.55	140	19,032	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD		4.33	118	15,940	金融
EOG RESOURCES INC		65.93	865	116,837	エネルギー
EQT CORP		45.84	187	25,269	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC		19.14	170	23,075	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A		1.57	97	13,200	金融
ABIOMED INC		5.12	117	15,875	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP		17.73	250	33,801	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC		34.22	396	53,597	ヘルスケア
FORD MOTOR CO		446.66	544	73,570	一般消費財・サービス
EXACT SCIENCES CORP		22.19	82	11,126	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A		24.16	51	6,996	コミュニケーション・サービス
ENTEGRIS INC		17	167	22,667	情報技術
AERCAP HOLDINGS NV		17	67	9,095	資本財・サービス
FORTINET INC		15.95	429	57,976	情報技術
MARKEL CORP		1.59	206	27,834	金融
NEXTERA ENERGY INC		229.73	1,642	221,701	公益事業
MASIMO CORP		6.93	85	11,513	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC		165.2	608	82,122	素材
INSULET CORP		7.69	158	21,340	ヘルスケア

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		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	
US BANCORP	159.18	727	98,256	金融
UNITED RENTALS INC	8.26	214	29,008	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	6.59	99	13,416	情報技術
FASTENAL CO	65.3	320	43,313	資本財・サービス
FISERV INC	74.14	666	89,976	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	132.41	901	121,650	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	167.52	556	75,088	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	13.05	74	10,044	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	27.38	591	79,809	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	39.92	1,127	152,277	金融
ALPHABET INC-CL A	34.84	7,435	1,003,925	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	32.64	6,997	944,749	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	11.93	98	13,313	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	69.11	459	62,001	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	58.4	224	30,268	公益事業
GENUINE PARTS CO	16.26	215	29,074	一般消費財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	81	280	37,816	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21.91	497	67,124	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	102.3	375	50,646	エネルギー
HOME DEPOT INC	119.83	3,339	450,839	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	5.93	104	14,091	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	169.2	207	27,960	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5	102	13,825	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	16.16	334	45,116	生活必需品
HUMANA INC	14.51	615	83,047	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	29.85	502	67,821	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9.17	44	6,028	情報技術
HENRY SCHEIN INC	14.91	111	15,097	ヘルスケア
HP INC	132.53	447	60,388	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	141.15	192	26,050	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6.81	24	3,330	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22.62	131	17,749	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20.28	73	9,933	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	42.74	190	25,706	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	93.36	337	45,552	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	13.86	248	33,592	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	105.97	1,438	194,174	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	176	23,833	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	91	12,418	資本財・サービス
ZOETIS INC	53.61	845	114,213	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	26.87	340	45,955	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	28.36	370	49,974	エネルギー
ALLEGION PLC	11.1	112	15,176	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	33.41	75	10,153	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	28.95	339	45,870	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	40	113	15,293	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	12.25	153	20,732	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	299.74	5,041	680,629	ヘルスケア
PLUG POWER INC	62.51	88	11,984	資本財・サービス
ABBVIE INC	203.59	2,801	378,271	ヘルスケア
HOLOGIC INC	28.01	190	25,665	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	37.65	464	62,680	生活必需品
KROGER CO	80.9	407	55,037	生活必需品
KLA CORP	17.19	544	73,447	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	28.02	1,166	157,436	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8.4	190	25,748	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	28.72	94	12,718	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	79.29	1,410	190,483	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	93.67	2,723	367,744	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	16	719	97,157	情報技術
LOEWS CORP	23.65	138	18,691	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	19.81	95	12,923	金融
MCDONALD'S CORP	86.68	2,069	279,412	一般消費財・サービス
3M CO	64.77	876	118,270	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	265.49	4,346	586,870	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	41.71	1,324	178,753	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6.82	215	29,139	素材
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	5.75	152	20,543	情報技術
ALCOA CORP	24.04	117	15,877	素材
PHILLIPS 66	54.02	562	75,944	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	45.19	132	17,937	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	28.21	236	31,916	生活必需品
METLIFE INC	81.54	504	68,099	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	110.88	537	72,633	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	25.99	238	32,257	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	19.04	387	52,262	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.6	300	40,635	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	116.87	384	51,958	エネルギー

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘	柄	2022年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
ROCKWELL AUTOMATION INC		13. 4	268	36, 258	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.		291. 04	2, 459	332, 028	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC		59. 74	360	48, 691	素材
MASCO CORP		27. 31	139	18, 881	資本財・サービス
M & T BANK CORP		18. 48	304	41, 142	金融
MARSH & MCLENNAN COS		61. 19	901	121, 655	金融
BLACK KNIGHT INC		16. 44	105	14, 298	情報技術
HEICO CORP-CLASS A		7. 54	81	11, 000	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A		31. 57	480	64, 880	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A		22. 75	317	42, 810	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A		8. 8	41	5, 600	一般消費財・サービス
BLOCK INC CLASS A		59. 91	361	48, 773	情報技術
TRANSUNION		22. 93	177	23, 939	資本財・サービス
VISTRA CORP		42. 85	98	13, 282	公益事業
NOVOCURE LTD		10. 54	63	8, 519	ヘルスケア
NETAPP INC		27. 03	173	23, 472	情報技術
NIKE INC -CL B		149. 92	1, 659	224, 105	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP		27. 46	611	82, 604	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC		62. 14	378	51, 134	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		21. 46	186	25, 142	金融
ALLY FINANCIAL INC		43. 51	148	20, 019	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP		16. 91	768	103, 754	資本財・サービス
APTIV PLC		30. 63	290	39, 252	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP		99. 13	625	84, 436	素材
MCKESSON CORP		17. 02	521	70, 434	ヘルスケア
XYLEM INC		19. 72	150	20, 367	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		181. 38	1, 795	242, 358	生活必需品
NUCOR CORP		32. 07	364	49, 238	素材
WESTERN UNION CO		43. 5	71	9, 666	情報技術
GODADDY INC - CLASS A		19. 3	128	17, 291	情報技術
NEWELL BRANDS INC		40. 58	74	10, 119	一般消費財・サービス
EVERGY INC		26. 54	162	21, 971	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP		104. 88	651	87, 918	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A		2. 69	46	6, 284	金融
OKTA INC		16. 34	133	17, 972	情報技術
COUPA SOFTWARE INC		8. 8	47	6, 345	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C		16. 14	183	24, 751	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC		48. 77	101	13, 761	ヘルスケア
LINDE PLC		52. 88	1, 563	211, 052	素材
WIX. COM LTD		7. 85	43	5, 891	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC		42. 93	112	15, 191	金融
KKR & CO INC		75. 84	357	48, 226	金融
PAYCHEX INC		36. 57	429	57, 998	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC		7. 56	451	60, 902	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC		206. 46	955	129, 029	生活必需品
P G & E CORP		173. 68	172	23, 354	公益事業
PFIZER INC		649. 11	3, 110	419, 953	ヘルスケア
CIGNA CORP		37. 11	911	123, 106	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C		32. 76	155	20, 942	情報技術
XCEL ENERGY INC		69. 88	460	62, 154	公益事業
STERIS PLC		11. 73	238	32, 254	ヘルスケア
SEA LTD-ADR		51	361	48, 852	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B		15. 3	45	6, 124	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A		38. 31	122	16, 566	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP		38. 15	765	103, 311	ヘルスケア
LYFT INC-A		31. 91	45	6, 100	資本財・サービス
DOW INC		82. 99	485	65, 613	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A		11. 3	73	9, 876	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A		25. 74	275	37, 135	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP		14. 23	359	48, 535	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC		172. 53	363	49, 125	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO		25. 89	684	92, 471	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE		275. 98	3, 693	498, 688	生活必需品
EXELON CORP		111. 5	471	63, 691	公益事業
TELADOC HEALTH INC		16. 18	47	6, 393	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC		58. 97	258	34, 847	資本財・サービス
NVR INC		0. 37	144	19, 507	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS		148. 09	1, 651	222, 908	エネルギー
TWILIO INC - A		20. 53	168	22, 689	情報技術
DOCUSIGN INC		23. 33	133	18, 041	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC		6. 01	162	21, 944	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC		14. 7	66	8, 962	情報技術
PEPSICO INC		158. 88	2, 480	334, 883	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL		4. 09	48	6, 597	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A		37. 43	76	10, 384	情報技術
MONGODB INC		7. 12	171	23, 166	情報技術
SNAP INC - A		129. 1	153	20, 758	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC		81. 98	462	62, 413	素材

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		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	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42.85	403	54,461	金融
AMCOR PLC	174.57	211	28,494	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	23.36	372	50,227	情報技術
ROKU INC	14.17	105	14,212	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20.92	279	37,697	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	73.42	2,019	272,710	情報技術
KORNIT DIGITAL LTD	6	20	2,750	資本財・サービス
PENTAIR PLC	15.75	72	9,751	資本財・サービス
QUALCOMM INC	130.95	1,705	230,293	情報技術
INVESCO LTD	37	60	8,112	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	6.64	113	15,372	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31.93	204	27,563	金融
DATADOG INC - CLASS A	25.87	225	30,424	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	67.63	116	15,695	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	10.47	73	9,860	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	12.77	700	94,539	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	24.68	303	41,004	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	4.61	899	121,461	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	41.1	304	41,061	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	9.98	146	19,837	素材
RESMED INC	16.6	335	45,273	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	13.27	168	22,765	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	12.09	98	13,291	資本財・サービス
MODERNA INC	39.1	475	64,170	ヘルスケア
HUBSPOT INC	5.64	166	22,527	情報技術
PERKINELMER INC	17.6	243	32,824	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	111.61	401	54,156	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	45.2	312	42,235	資本財・サービス
BILL. COM HOLDINGS INC	9	95	12,876	情報技術
AVANTOR INC	66.86	198	26,827	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	18.36	60	8,227	金融
DYNATRACE INC	23.39	90	12,258	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	51.91	235	31,817	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	108.25	209	28,279	金融
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	33.64	104	14,111	コミュニケーション・サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	41.76	159	21,537	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	10.21	80	10,867	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	31.62	231	31,193	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	224.04	3,753	506,799	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A	31.74	30	4,105	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	9.85	139	18,898	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	43.65	266	35,936	公益事業
ETSY INC	14.09	100	13,622	一般消費財・サービス
TESLA INC	101.52	6,727	908,269	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	25.02	284	38,464	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	67.67	148	20,090	情報技術
UNITY SOFTWARE INC	29.86	100	13,610	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	18.95	202	27,316	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	17.16	506	68,381	情報技術
CARVANA CO	9.64	20	2,722	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	8.56	23	3,126	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	31.13	126	17,143	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	14.27	644	87,076	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	137.45	141	19,150	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	26.83	156	21,176	一般消費財・サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	49.45	129	17,438	コミュニケーション・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	43.29	428	57,785	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	38.49	271	36,677	不動産
TWITTER INC	90.07	335	45,260	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	118.75	793	107,064	公益事業
SYSCO CORP	57.47	460	62,180	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	27.8	462	62,420	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6	26	3,550	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	9.56	50	6,822	金融
STEEL DYNAMICS INC	23	163	22,053	素材
SCHLUMBERGER LTD	157.94	682	92,160	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	88	11,909	資本財・サービス
AFFIRM HOLDINGS INC	20.35	36	4,862	情報技術
AT&T INC	836.15	1,626	219,568	コミュニケーション・サービス
APA CORP	43.54	200	27,040	エネルギー
SOUTHWEST AIRLINES CO	10.08	37	5,065	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	51.37	291	39,289	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	23.88	94	12,699	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	28.3	649	87,679	素材
SEMPRA ENERGY	36.02	521	70,426	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	22.64	69	9,423	情報技術
CLARIVATE PLC	47.21	62	8,419	資本財・サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	197.7	154	20,872	情報技術

銘	柄	2022年 6月15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	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS		22. 4	169	22, 872	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A		16. 57	85	11, 539	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC		107. 78	1, 660	224, 207	情報技術
SALESFORCE.COM INC		115. 1	1, 892	255, 549	情報技術
WESTROCK CO		29. 71	127	17, 155	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS		55. 49	273	36, 979	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATION		79. 32	393	53, 116	資本財・サービス
TERADYNE INC		18. 27	166	22, 424	情報技術
UNION PACIFIC CORP		72. 2	1, 505	203, 230	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP		93. 23	268	36, 237	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP		68. 55	703	95, 020	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP		175. 23	1, 600	216, 043	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		85. 8	1, 494	201, 744	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC		21. 41	430	58, 065	ヘルスケア
AMEREN CORPORATION		28. 61	238	32, 175	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC		107. 72	4, 973	671, 535	ヘルスケア
APPROVIN CORP CLASS A		21. 44	69	9, 364	情報技術
VERISIGN INC		12. 1	195	26, 330	情報技術
LUCID GROUP INC		51	84	11, 429	一般消費財・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO		22	60	8, 108	一般消費財・サービス
VALERO ENERGY CORP		45. 84	613	82, 775	エネルギー
UPSTART HOLDINGS INC		2	6	925	金融
ULTA BEAUTY INC		5. 5	215	29, 157	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL		30. 08	112	15, 180	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B		7. 67	80	10, 859	ヘルスケア
ANTHEM INC		27. 19	1, 251	169, 009	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE		211. 9	1, 996	269, 550	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO		447. 85	1, 676	226, 317	金融
WASTE MANAGEMENT INC		46. 7	680	91, 812	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC		136. 22	440	59, 476	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY		12. 49	240	32, 405	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP		6. 86	106	14, 388	一般消費財・サービス
WALMART INC		178. 41	2, 131	287, 744	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC		23. 48	247	33, 370	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD		11. 45	66	8, 967	一般消費財・サービス
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A		139	34	4, 597	資本財・サービス
WABTEC CORP		18. 98	163	22, 119	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC		135. 04	774	104, 522	一般消費財・サービス
WATERS CORP		6. 99	224	30, 339	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A		5. 71	171	23, 184	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		79. 88	321	43, 354	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC		14	272	36, 833	金融
WESTERN DIGITAL CORP		35. 31	173	23, 473	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC		36. 5	335	45, 360	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP		58. 55	356	48, 195	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES		190. 79	3, 692	498, 479	情報技術
PPL CORP		83. 6	217	29, 379	公益事業
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS		36. 96	201	27, 165	公益事業
PULTEGROUP INC		27. 95	111	15, 048	一般消費財・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES		250. 13	349	47, 210	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC		26. 8	298	40, 347	素材
NORTHERN TRUST CORP		22. 6	211	28, 559	金融
NVIDIA CORP		288. 63	4, 570	617, 096	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP		48. 69	757	102, 325	金融
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L		11. 77	58	7, 937	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A		33. 22	278	37, 638	生活必需品
NETFLIX INC		49. 77	833	112, 577	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		45. 47	2, 307	311, 518	ヘルスケア
NRG ENERGY INC		30	118	15, 966	公益事業
GLOBE LIFE INC		12. 15	108	14, 673	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA		20. 67	283	38, 220	金融
TEXTRON INC		23. 88	143	19, 405	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A		37. 49	58	7, 870	コミュニケーション・サービス
OMNICOM GROUP		25. 46	165	22, 325	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP		184. 58	1, 305	176, 235	情報技術
MASTERCARD INC - A		100. 48	3, 236	437, 008	情報技術
ONEOK INC		50. 33	303	41, 035	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC		110. 62	117	15, 815	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC		11. 95	454	61, 414	情報技術
YUM! BRANDS INC		32. 75	361	48, 739	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE		20. 69	251	33, 914	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B		22. 06	113	15, 296	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP		847. 45	2, 666	359, 947	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC		5. 23	190	25, 760	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		22. 63	161	21, 839	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO		74. 47	1, 076	145, 383	金融
ANALOG DEVICES INC		60. 05	883	119, 315	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES		190. 8	1, 659	224, 085	情報技術

銘柄	柄	2022年 6月15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	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP		92.09	479	64,676	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC		19.4	179	24,295	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		26.09	103	13,910	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP		9.29	149	20,204	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A		59.54	404	54,557	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO		67.86	574	77,600	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A		25	627	84,762	金融
AMGEN INC		66.17	1,559	210,565	ヘルスケア
EATON CORP PLC		50.05	653	88,195	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A		18.59	430	58,102	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC		101.47	980	132,364	情報技術
CME GROUP INC		40.78	799	107,972	金融
ECOLAB INC		29.18	438	59,204	素材
EQUIFAX INC		13.57	233	31,515	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC		143.13	827	111,673	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC		99.75	343	46,327	生活必需品
HORMEL FOODS CORP		33.15	149	20,193	生活必需品
STATE STREET CORP		41.52	258	34,855	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP		173.13	1,057	142,840	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC		56.65	382	51,610	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO		21.66	98	13,288	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC		15.97	150	20,271	素材
CARDINAL HEALTH INC		33.19	169	22,902	ヘルスケア
FEDEX CORP		28.31	650	87,889	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP		48.73	519	70,119	金融
FMC CORP		13.6	146	19,815	素材
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		27.48	321	43,470	素材
CITRIX SYSTEMS INC		14.12	130	17,616	情報技術
INTEL CORP		472.82	1,793	242,127	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC		43.18	119	16,194	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP		39.7	264	35,696	金融
ILLINOIS TOOL WORKS		35.67	663	89,540	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC		102.27	60	8,187	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC		16.89	319	43,191	ヘルスケア
SEALED AIR CORP		14.5	84	11,467	素材
INTUITIVE SURGICAL INC		43.34	828	111,818	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH		13.3	161	21,807	情報技術
SNAP-ON INC		6.23	128	17,290	資本財・サービス
CARMAX INC		18.34	164	22,232	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP		86.25	870	117,540	公益事業
TARGET CORP		53.73	766	103,515	一般消費財・サービス
DOVER CORP		17.13	210	28,446	資本財・サービス
WW GRAINGER INC		4.75	223	30,134	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC		14.62	181	24,538	資本財・サービス
CINTAS CORP		10.4	366	49,486	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC		55.67	177	23,900	生活必需品
CLOROX COMPANY		13.84	172	23,289	生活必需品
ENTERGY CORP		22.43	240	32,490	公益事業
MICROSOFT CORP		821.66	20,088	2,712,184	情報技術
INCYTE CORP		20.06	132	17,923	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP		155.28	1,407	190,020	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC		157.69	1,395	188,371	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC		124.93	733	99,008	情報技術
BLACKROCK INC		17.18	1,015	137,134	金融
CENTERPOINT ENERGY INC		69.14	190	25,763	公益事業
HASBRO INC		14.49	117	15,797	一般消費財・サービス
KELLOGG CO		29.14	199	26,886	生活必需品
KEYCORP		103.89	182	24,601	金融
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A		166.95	976	131,790	生活必需品
COOPER COS INC/THE		5.47	172	23,256	ヘルスケア
CHUBB LTD		48.39	957	129,316	金融
ARROW ELECTRONICS INC		7.37	84	11,347	情報技術
ALLSTATE CORP		32.42	395	53,395	金融
EBAY INC		70.68	300	40,631	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC		124.99	905	122,275	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO		14.92	143	19,386	素材
DISH NETWORK CORP-A		29.84	52	7,102	コミュニケーション・サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A		26.15	629	85,007	生活必需品
TRIMBLE INC		29.38	173	23,466	情報技術
LENNAR CORP-A		29.92	206	27,929	一般消費財・サービス
LEAR CORP		6	75	10,234	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP		66.01	742	100,179	金融
PACCAR INC		39.19	329	44,529	資本財・サービス
BIOGEN INC		16.99	329	44,541	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC		9.62	316	42,729	ヘルスケア
STARBUCKS CORP		131.72	952	128,592	一般消費財・サービス
PTC INC		12	119	16,183	情報技術
EVERSOURCE ENERGY		39.06	315	42,578	公益事業

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2022年 6 月15日現在			業 種 等
		株 数	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
INTUIT INC		32.06	1,169	157,892	情報技術
BORGWARNER INC		27.41	96	12,974	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC		25.7	181	24,493	一般消費財・サービス
BALL CORP		36.3	241	32,590	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP		161.99	570	77,070	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC		32.21	410	55,389	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO		14.25	215	29,058	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		28.56	711	96,042	ヘルスケア
VF CORP		36.36	165	22,296	一般消費財・サービス
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B		67.79	172	23,256	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC		6.28	77	10,480	一般消費財・サービス
CARNIVAL CORP		99.86	95	12,834	一般消費財・サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC		63.61	112	15,149	素材
COMCAST CORP-CLASS A		528.64	2,106	284,344	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		28	150	20,292	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		131	63	8,595	不動産
アメリカ・ドル 通貨計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	38,087.49 603銘柄	374,164 <69.7%>	
(カナダ)		百株	千カナダ・ドル	千円	
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT		96.62	525	54,718	生活必需品
IMPERIAL OIL LTD		23	158	16,536	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		2.29	425	44,370	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN		31.36	194	20,266	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		52.7	265	27,676	素材
INTACT FINANCIAL CORP		19.97	350	36,542	金融
BCE INC		9	57	5,950	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP		22	394	41,134	素材
SUNCOR ENERGY INC		163.65	834	86,966	エネルギー
METRO INC/CN		27.76	188	19,640	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA		39.41	351	36,589	金融
BANK OF NOVA SCOTIA		149.98	1,209	126,054	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		102.3	664	69,266	金融
TORONTO-DOMINION BANK		214.88	1,919	200,059	金融
GREAT-WEST LIFECO INC		39	124	12,943	金融
ROYAL BANK OF CANADA		167.46	2,110	219,879	金融
TOURMALINE OIL CORP		36.56	257	26,804	エネルギー
TC ENERGY CORP		123.64	867	90,427	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		63.75	317	33,094	エネルギー
BARRICK GOLD CORP		203.69	513	53,506	素材
CAE INC		37.52	115	12,033	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP		19.68	247	25,791	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'		18	71	7,459	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD		10.34	109	11,389	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B		15.6	90	9,379	素材
HYDRO ONE LTD		39.86	134	14,038	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD		20.86	234	24,457	生活必需品
NORTHLAND POWER INC		30.03	111	11,621	公益事業
WSP GLOBAL INC		14.44	200	20,890	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD		9.74	102	10,651	資本財・サービス
PARKLAND CORP		16.21	60	6,286	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B		23	63	6,585	コミュニケーション・サービス
EMERA INC		27.31	162	16,897	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC		11	107	11,202	資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A		10	38	4,005	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B		43.06	255	26,647	コミュニケーション・サービス
BRP INC/CA- SUB VOTING		10.17	82	8,603	一般消費財・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A		88.5	81	8,474	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD		52.12	327	34,154	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES		118.88	203	21,182	公益事業
AIR CANADA		17	30	3,183	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP		147.57	77	8,088	素材
BANK OF MONTREAL		80.79	1,037	108,091	金融
POWER CORP OF CANADA		63	213	22,267	金融
SHOPIFY INC - CLASS A		13.05	512	53,447	情報技術
NUTRIEN LTD		65.33	738	76,923	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A		15.32	68	7,172	公益事業
CAMECO CORP		50.21	144	15,099	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP		4.22	64	6,727	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT		18.65	63	6,634	資本財・サービス
LIGHTSPEED COMMERCE INC		15.6	41	4,276	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG		10	52	5,493	情報技術
TELUS CORP		6	17	1,831	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B		53.74	274	28,648	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A		7.43	121	12,663	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES		132.69	1,041	108,508	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		3	197	20,606	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC		31.67	234	24,469	一般消費財・サービス

銘柄		2022年6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千カナダ・ドル	千円	
WESTON (GEORGE) LTD		9.01	131	13,726	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP		26.15	70	7,370	素材
BLACKBERRY LTD		64	42	4,454	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC		66.71	395	41,234	金融
ENBRIDGE INC		244.33	1,359	141,654	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		173.41	1,009	105,199	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP		221.84	486	50,646	金融
BAUSCH HEALTH COS INC		35.14	33	3,511	ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		106.07	941	98,079	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC		11	68	7,125	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC		23.64	86	8,991	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO		69.45	975	101,689	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A		23.84	231	24,155	情報技術
ONEX CORPORATION		11.04	75	7,904	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		51.72	176	18,361	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC		27.84	98	10,277	金融
TMX GROUP LTD		7.94	105	11,025	金融
OPEN TEXT CORP		32.1	154	16,148	情報技術
SAPUTO INC		29	78	8,213	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		63	201	20,954	素材
FORTIS INC		54.74	324	33,846	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS		13.55	106	11,087	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP		66	65	6,856	素材
CENOVUS ENERGY INC		173.9	499	52,059	エネルギー
DOLLARAMA INC		35.29	255	26,578	一般消費財・サービス
ALTAGAS LTD		32.01	88	9,235	公益事業
KEYERA CORP		22	73	7,672	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		92.53	182	18,994	エネルギー
カナダ・ドル通貨計		株 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	4,727.86 86銘柄	27,786 2,895,374 <4.0%>	
(オーストラリア)		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
THE LOTTERY CORPORATION LTD		265.51	121	11,346	一般消費財・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD		539.23	165	15,412	金融
BHP GROUP LTD		605.7	2,680	249,585	素材
SOUTH32 LTD		563.87	253	23,570	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD		211.41	697	64,931	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD		196.91	386	35,986	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		376.85	1,011	94,167	金融
WESTPAC BANKING CORP		424.01	850	79,226	金融
SANTOS LTD		370.03	299	27,904	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP		328.92	723	67,369	金融
RIO TINTO LTD		41.69	462	43,102	素材
ORIGIN ENERGY LTD		209.68	124	11,556	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD		234.38	94	8,771	資本財・サービス
XERO LTD		14.26	116	10,873	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		27.48	65	6,096	エネルギー
COLES GROUP LTD		155.7	266	24,845	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD		16.45	60	5,611	情報技術
IDP EDUCATION LTD		26.19	58	5,400	一般消費財・サービス
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		107.16	86	8,041	素材
EVOLUTION MINING LTD		170.17	56	5,275	素材
REECE LTD		37.62	52	4,861	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI		139.06	99	9,256	生活必需品
SEEK LTD		26	56	5,255	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		86.16	93	8,703	生活必需品
NEWCREST MINING LTD		103.31	239	22,333	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		206.53	1,883	175,358	金融
AMPOL LTD		20	68	6,412	エネルギー
ORICA LTD		47.83	74	6,977	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		153.48	176	16,432	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD		138.36	468	43,577	生活必需品
CROWN RESORTS LTD		30	39	3,644	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD		63.73	30	2,871	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD		507.1	190	17,704	コミュニケーション・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		47.96	155	14,498	素材
MACQUARIE GROUP LTD		45.02	735	68,465	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD		64.62	221	20,605	一般消費財・サービス
CSL LTD		59.05	1,559	145,162	ヘルスケア
WESFARMERS LTD		129.17	542	50,508	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD		8.05	165	15,411	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD		50.24	82	7,703	素材
SUNCORP GROUP LTD		145.04	152	14,151	金融
ASX LTD		22.6	175	16,310	金融
COMPUTERSHARE LTD		60.54	142	13,262	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		270.97	112	10,519	金融
SONIC HEALTHCARE LTD		52.23	174	16,202	ヘルスケア
BRAMBLES LTD		183.37	192	17,925	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2022年6月15日現在			業種等
		株数	価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
MINERAL RESOURCES LTD		18.81	104	9,729	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD		20.64	154	14,369	ヘルスケア
REA GROUP LTD		6.08	62	5,855	コミュニケーション・サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		7.6	48	4,505	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>	7,636.77 50銘柄	16,838 1,567,652 <2.2%>	
		百株	千香港・ドル	千円	
(香港)					
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		175	895	15,396	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		290	1,196	20,575	一般消費財・サービス
MTR CORP		165	684	11,777	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES		190	1,772	30,490	不動産
SINO LAND CO		340	380	6,549	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		325.52	1,725	29,674	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		80	382	6,577	不動産
CLP HOLDINGS LTD		190	1,434	24,673	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		205.65	604	10,399	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		1,450.27	1,237	21,277	公益事業
HANG SENG BANK LTD		100	1,370	23,564	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT		175	511	8,789	不動産
WH GROUP LTD		1,135	634	10,912	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		154	5,260	90,483	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD		200	287	4,946	不動産
XINYI GLASS HOLDINGS LTD		260	455	7,834	資本財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		80	152	2,625	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD		235.52	1,223	21,044	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		55	282	4,857	公益事業
AIA GROUP LTD		1,530	12,025	206,843	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS		120	310	5,335	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		200	692	11,902	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		192	395	6,802	生活必需品
ESR CAYMAN LTD		280	590	10,161	不動産
SANDS CHINA LTD		290	436	7,501	一般消費財・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU		260	352	6,064	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		160	1,491	25,648	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		450	1,374	23,645	金融
香港・ドル通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	9,287.96 28銘柄	38,160 656,356 <0.9%>	
		百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)					
CAPITALAND INVESTMENT LTD		334	121	11,819	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD		149	403	39,132	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD		223	664	64,470	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD		177.5	91	8,828	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD		173	115	11,220	資本財・サービス
UOL GROUP LTD		30	21	2,094	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		52	41	3,992	不動産
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		407	465	45,101	金融
GENTING SINGAPORE LTD		450	33	3,272	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD		32	54	5,286	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		1,034	260	25,262	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING		141	56	5,440	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD		118	113	11,028	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD		158	64	6,219	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	3,478.5 14銘柄	2,508 243,168 <0.3%>	
		百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
(ニュージーランド)					
MERIDIAN ENERGY LTD		150	66	5,578	公益事業
MERCURY NZ LTD		32.94	17	1,482	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD		275.03	124	10,459	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		132.89	96	8,110	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		72.38	141	11,848	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	663.24 5銘柄	446 37,479 <0.1%>	
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)					
SHELL PLC		892.51	2,059	334,138	エネルギー
BP PLC		2,230.25	970	157,351	エネルギー
UNILEVER PLC		305.42	1,102	178,822	生活必需品
BARCLAYS PLC		1,838.69	288	46,754	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		912.45	80	13,012	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC		314.21	305	49,622	金融
NATWEST GROUP PLC		662.75	146	23,801	金融
JOHNSON MATTHEY PLC		17.58	34	5,670	素材
BAE SYSTEMS PLC		364.45	282	45,804	資本財・サービス
AVIVA PLC		340.02	137	22,287	金融
AVEVA GROUP PLC		11.4	26	4,373	情報技術

銘柄		2022年6月15日現在			業種等
		株数	価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
GSK		601.83	1,030	167,149	ヘルスケア
INFORMA PLC		162	81	13,186	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC		494.22	74	12,109	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC		105.87	54	8,816	コミュニケーション・サービス
DCC PLC		9.38	48	7,914	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC		51.49	40	6,553	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		7.4	68	11,144	資本財・サービス
HALMA PLC		39.78	77	12,495	情報技術
ENTAIN PLC		58.23	78	12,671	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC		320.55	35	5,810	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC		68.57	41	6,751	金融
M&G PLC		259.64	52	8,499	金融
RELX PLC		220.83	459	74,543	資本財・サービス
DIAGEO PLC		278.48	960	155,753	生活必需品
RIO TINTO PLC		138	766	124,348	素材
STANDARD CHARTERED PLC		295.93	177	28,782	金融
TESCO PLC		847.03	208	33,895	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC		92.37	107	17,440	ヘルスケア
GLENCORE PLC		1,209.36	584	94,809	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC		32	24	4,006	金融
SMITHS GROUP PLC		40.8	60	9,758	資本財・サービス
PEARSON PLC		82.71	61	9,906	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC		176.31	35	5,814	生活必需品
NEXT PLC		16.85	100	16,229	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC		322.36	40	6,520	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC		17.85	45	7,429	一般消費財・サービス
BUNZL PLC		39.54	103	16,823	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC		3,150.36	395	64,163	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		14.09	84	13,635	素材
KINGFISHER PLC		247.03	58	9,408	一般消費財・サービス
WPP PLC		130.21	106	17,277	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC		82.44	84	13,747	公益事業
SEVERN TRENT PLC		29.71	83	13,527	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC		222.42	100	16,322	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		89.64	536	87,068	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC		48.83	53	8,740	金融
SCHRODERS PLC		12.27	32	5,226	金融
SSE PLC		119.27	195	31,757	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		123.68	60	9,774	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC		182.85	1,782	289,185	ヘルスケア
FERGUSON PLC		24.79	227	36,938	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		682.32	164	26,729	金融
3i GROUP PLC		111.52	123	19,980	金融
ASHTREAD GROUP PLC		51.39	187	30,434	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE		115.48	69	11,209	情報技術
NATIONAL GRID PLC		414.25	435	70,588	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC		8,100.12	351	56,984	金融
IMPERIAL BRANDS PLC		108.06	194	31,568	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC		11.55	46	7,540	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		246.58	864	140,172	生活必需品
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		34.83	54	8,861	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC		2,398.77	1,248	202,489	金融
ANGLO AMERICAN PLC		144.24	498	80,837	素材
MONDI PLC		59.21	84	13,671	素材
COMPASS GROUP PLC		201.76	336	54,654	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC		39.69	85	13,841	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC		1,027.57	184	29,944	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI		25.74	43	6,989	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC		45.08	71	11,648	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		20.78	90	14,666	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC		18.97	80	13,025	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		36.24	244	39,609	金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		20.39	30	4,992	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC		15.7	33	5,424	金融
ANTOFAGASTA PLC		34.6	48	7,818	素材
ABRDN PLC		277.75	47	7,632	金融
EXPERIAN PLC		104.96	243	39,550	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	32,704.25 78銘柄	20,519 <4.6%>	
(イスラエル)		百株	千イスラエル・シェケル	千円	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		120	216	8,425	金融
AZRIELI GROUP LTD		5.3	122	4,778	不動産
TOWER SEMICONDUCTOR LTD		18.59	299	11,669	情報技術
ICL GROUP LTD		82.94	295	11,491	素材
ELBIT SYSTEMS LTD		3	203	7,920	資本財・サービス
BANK HAPOLAIM BM		151.6	456	17,764	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		株数	2022年6月15日現在		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
BANK LEUMI LE-ISRAEL		190.43	592	23,063	金融
NICE LTD		8	525	20,468	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		18.83	208	8,102	金融
イスラエル・シェケル通貨計		598.69	2,919	113,684	
銘柄数 < 比率 >		9銘柄		<0.2%>	
(スイス)		百株	千スイス・フラン	千円	
UBS GROUP AG-REG		389.06	622	83,990	金融
ROCHE HOLDING AG-BR		4.28	149	20,224	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		0.89	63	8,615	素材
ADECCO GROUP AG-REG		17.54	58	7,933	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		80.79	2,470	333,495	ヘルスケア
SIKA AG-REG		18.12	411	55,581	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.01	96	13,055	生活必需品
ABB LTD-REG		181.74	499	67,402	資本財・サービス
SWISS RE AG		33.1	251	33,963	金融
NESTLE SA-REG		325.98	3,540	478,042	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG		2.43	207	27,951	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		2.61	45	6,184	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		301.22	177	24,010	金融
JULIUS BAER GROUP LTD		26.84	123	16,690	金融
SGS SA-REG		0.94	199	26,942	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		4.67	79	10,781	資本財・サービス
TEMENOS AG - REG		7.93	57	7,714	情報技術
VAT GROUP AG		3.39	81	11,030	資本財・サービス
ALCON INC		55.13	365	49,362	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR		3.77	86	11,655	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		16.79	703	95,002	金融
BALOISE HOLDING AG - REG		6.11	93	12,687	金融
CLARIANT AG-REG		25.52	47	6,415	素材
NOVARTIS AG-REG		242.42	1,956	264,189	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.41	85	11,491	生活必需品
BACHEM HOLDING AG-REG B		3.9	26	3,609	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG		58.09	574	77,517	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG		2.76	146	19,756	コミュニケーション・サービス
GEBERIT AG-REG		3.89	183	24,788	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG		1.04	324	43,864	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG		17.09	174	23,603	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG		6.37	200	27,038	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		17.3	89	12,108	情報技術
LONZA GROUP AG-REG		8.29	416	56,207	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG		4.5	19	2,627	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD		58.05	264	35,761	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		3.49	179	24,171	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		6.4	149	20,193	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG		9.46	83	11,309	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.14	130	17,672	生活必需品
スイス・フラン通貨計		1,952.46	15,440	2,084,647	
銘柄数 < 比率 >		40銘柄		<2.9%>	
(デンマーク)		百株	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B		211.87	16,004	302,968	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S		92.36	1,012	19,162	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A		0.39	715	13,539	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		120.49	1,931	36,557	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S		21.59	511	9,690	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B		12.32	1,044	19,767	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES		24.64	987	18,694	素材
COLOPLAST-B		15.19	1,138	21,554	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S		24.04	2,391	45,261	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS		0.98	176	3,339	資本財・サービス
DEMANT A/S		13.14	359	6,798	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		0.66	1,224	23,182	資本財・サービス
TRYG A/S		40.74	633	11,988	金融
PANDORA A/S		13.25	639	12,102	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S		12.62	600	11,369	素材
GENMAB A/S		7.78	1,531	28,991	ヘルスケア
ORSTED A/S		22.46	1,558	29,493	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計		634.52	32,459	614,461	
銘柄数 < 比率 >		17銘柄		<0.8%>	
(ノルウェー)		百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
DNB BANK		116.96	2,142	28,897	金融
NORSK HYDRO ASA		166.15	1,064	14,353	素材
ORKLA ASA		74.83	547	7,383	生活必需品
TELENOR ASA		87.46	1,115	15,054	コミュニケーション・サービス

銘	柄	2022年6月15日現在			業 種 等
		株 数	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
EQUINOR ASA		117.89	4,169	56,250	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		21.12	996	13,447	素材
MOWI ASA		46.77	1,119	15,098	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		20	388	5,234	金融
AKER BP ASA		13.55	561	7,576	エネルギー
KONGSBERG GRUPPEN ASA		19.73	653	8,815	資本財・サービス
SALMAR ASA		9.43	641	8,656	生活必需品
ADEVINTA ASA		45.82	301	4,070	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計	株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	739.71 12 銘柄	13,701	184,837 <0.3%>	
		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)					
SAGAX CLASS B		20.2	413	5,476	不動産
INVESTOR CLASS A		62.56	1,183	15,674	金融
VOLVO CAR CLASS B		85.56	634	8,408	一般消費財・サービス
ERICSSON LM-B SHS		348.35	2,621	34,732	情報技術
VOLVO AB-B SHS		193.33	3,181	42,148	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES		40	667	8,837	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B		26	348	4,617	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB		205.45	2,075	27,494	生活必需品
TELE2 AB-B SHS		70.26	808	10,715	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS		28.69	717	9,503	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		196.1	2,129	28,217	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		174.28	1,650	21,868	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		108.21	1,616	21,420	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		88.36	1,177	15,599	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B		73.2	1,181	15,654	素材
SKANSKA AB-B SHS		37.09	601	7,968	資本財・サービス
SANDVIK AB		135.38	2,560	33,920	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS		234.46	4,006	53,085	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		317.12	3,182	42,169	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS		39.23	671	8,898	資本財・サービス
HOLMEN AB-B SHARES		13.42	604	8,008	素材
SECURITAS AB-B SHS		39.3	345	4,574	資本財・サービス
TELIA CO AB		332.69	1,299	17,213	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB		38.03	927	12,295	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS		192.52	1,688	22,371	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		119.97	2,646	35,066	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		16.38	387	5,139	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		64.2	351	4,658	不動産
INDUTRADE AB		36	741	9,826	資本財・サービス
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB		32.95	715	9,473	ヘルスケア
LUNDBERGS AB-B SHS		9.48	405	5,377	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		20.48	428	5,674	資本財・サービス
LIFCO AB-B SHS		29.24	505	6,692	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		167.16	1,200	15,911	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB		29	1,393	18,459	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B		72.6	1,828	24,231	生活必需品
EMBRACER GROUP AB		70.9	572	7,585	コミュニケーション・サービス
BOLIDEN AB		31.71	1,132	15,003	素材
EPIROC AB-A		86.6	1,534	20,332	資本財・サービス
EPIROC AB-B		40.15	608	8,056	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		54	419	5,558	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP		426.56	4,186	55,467	金融
EQT AB		33.65	735	9,742	金融
EVOLUTION AB		20.64	1,868	24,763	一般消費財・サービス
SINCH AB		64	240	3,182	情報技術
KINNEVIK AB - B		30.03	504	6,684	金融
HEXAGON AB-B SHS		235.58	2,571	34,070	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		13	305	4,044	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	4,804.07 48 銘柄	61,575	815,880 <1.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (アイルランド)					
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		30.55	98	13,897	素材
KINGSPAN GROUP PLC		17.44	122	17,188	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		18.22	166	23,457	生活必需品
CRH PLC		83.4	283	39,925	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		17.85	166	23,494	一般消費財・サービス
国 小 計	株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	167.46 5 銘柄	837	117,964 <0.2%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オランダ)					
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV		89.3	176	24,802	コミュニケーション・サービス
QIAGEN N. V.		25.21	102	14,492	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		103.01	215	30,327	ヘルスケア
NN GROUP NV		31	138	19,458	金融
HEINEKEN NV		31.23	277	39,134	生活必需品

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2022年6月15日現在			業種等
		株数	価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
AEGON NV		179.67	78	11,022	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		110.69	278	39,274	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.		23.19	164	23,097	素材
KONINKLIJKE DSM NV		21.12	299	42,181	素材
WOLTERS KLUWER		31.58	268	37,777	資本財・サービス
ING GROEP NV		426.86	410	57,842	金融
KONINKLIJKE KPN NV		376.07	124	17,558	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		44.67	2,104	296,362	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA		40.3	41	5,776	金融
IMCD NV		7.15	94	13,313	資本財・サービス
ADYEN NV		2.56	295	41,646	情報技術
JUST EAT TAKEAWAY		23.81	40	5,735	一般消費財・サービス
PROSUS NV		100.88	480	67,674	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV		14.76	38	5,432	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV		6.02	154	21,703	情報技術
RANDSTAD NV		14.9	70	9,902	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		12.85	89	12,646	生活必需品
OCI NV		18.79	62	8,809	素材
EURONEXT NV		10.95	80	11,375	金融
STMICROELECTRONICS NV		81.18	263	37,147	情報技術
AIRBUS SE		63.5	611	86,153	資本財・サービス
ARGENX SE		5.16	161	22,805	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		55.46	50	7,048	生活必需品
EXOR NV		10.88	65	9,252	金融
CNH INDUSTRIAL NV		116.91	145	20,518	資本財・サービス
STELLANTIS NV		264.95	330	46,549	一般消費財・サービス
FERRARI NV		14.99	243	34,328	一般消費財・サービス
国小計		株数、金額 銘柄数<比率>	2,359.6 32銘柄	7,962 <1.5%>	1,121,153
			百株	千ユーロ	千円
ユーロ（ベルギー）					
UCB SA		15.5	122	17,245	ヘルスケア
KBC GROUP NV		30.11	162	22,901	金融
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		11.39	90	12,787	金融
SOLVAY SA		8.73	75	10,661	素材
UMICORE		22.7	87	12,250	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		93.95	458	64,579	生活必需品
AGEAS		21.72	87	12,388	金融
D'IETEREN GROUP		4.42	62	8,737	一般消費財・サービス
PROXIMUS		22.69	34	4,838	コミュニケーション・サービス
ELIA GROUP SA/NV		4.32	61	8,698	公益事業
SOFINA		1.46	28	4,080	金融
国小計		株数、金額 銘柄数<比率>	236.99 11銘柄	1,272 <0.2%>	179,171
			百株	千ユーロ	千円
ユーロ（ルクセンブルグ）					
AROUNDTOWN SA		104.12	37	5,289	不動産
ARCELORMITTAL		74.77	193	27,303	素材
EUROFINS SCIENTIFIC		14.8	115	16,220	ヘルスケア
TENARIS SA		47	67	9,559	エネルギー
国小計		株数、金額 銘柄数<比率>	240.69 4銘柄	414 <0.1%>	58,372
			百株	千ユーロ	千円
ユーロ（フランス）					
TOTALENERGIES SE		281.13	1,520	214,065	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		21.46	233	32,814	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		60.69	819	115,342	素材
KERING		8.26	405	57,138	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		58.24	681	95,925	資本財・サービス
BOUYGUES SA		27.21	82	11,600	資本財・サービス
BNP PARIBAS		122.39	579	81,570	金融
THALES SA		13.06	148	20,870	資本財・サービス
DANONE		69.56	359	50,674	生活必需品
CARREFOUR SA		72.48	136	19,150	生活必需品
VIVENDI		89.3	97	13,717	コミュニケーション・サービス
L'OREAL		27.26	822	115,779	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		60.93	293	41,384	資本財・サービス
LEGRAND SA		39.4	284	40,053	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA		23.02	389	54,873	生活必需品
EURAZEO SE		4	25	3,624	金融
SOCIETE GENERALE SA		97.9	219	30,897	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		31.39	1,707	240,432	一般消費財・サービス
ACCOR SA		18.5	50	7,095	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		19.19	318	44,784	情報技術
VALEO SA		28.67	54	7,621	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		29.18	134	18,936	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA		32.27	80	11,381	資本財・サービス
EIFFAGE		9.45	82	11,676	資本財・サービス

銘柄		2022年6月15日現在			業種等
		株数	価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
SODEXO SA		10.85	71	10,049	一般消費財・サービス
IPSEN		2.76	23	3,283	ヘルスケア
AMUNDI SA		10.05	47	6,732	金融
TELEPERFORMANCE		7.01	195	27,567	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		9.77	43	6,060	コミュニケーション・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		3.14	93	13,099	ヘルスケア
SEB SA		2.16	19	2,724	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA		30.3	407	57,380	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA		2.2	34	4,804	資本財・サービス
WORLDLINE SA		31.35	102	14,363	情報技術
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		8.78	28	3,968	一般消費財・サービス
AXA SA		216.72	485	68,321	金融
EDENRED		30.07	128	18,087	情報技術
RENAULT SA		20.44	49	6,979	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL		3.39	332	46,814	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU		2.53	38	5,439	生活必需品
DASSAULT SYSTEMES SE		81.65	273	38,506	情報技術
WENDEL		3.31	28	4,008	金融
ORANGE		241.19	261	36,886	コミュニケーション・サービス
ALSTOM		36.68	91	12,916	資本財・サービス
SANOFI		130.43	1,227	172,902	ヘルスケア
VINCI SA		58.02	485	68,368	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		78.49	184	25,970	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		146.09	129	18,169	金融
BIOMERIEUX		4.57	39	5,506	ヘルスケア
ENGIE		217.58	260	36,633	公益事業
EDF		67.6	55	7,766	公益事業
SAFRAN SA		36.41	322	45,472	資本財・サービス
ARKEMA		7.31	71	10,018	素材
ADP		3.5	42	6,031	資本財・サービス
GETLINK SE		49.73	84	11,847	資本財・サービス
BOLLORE		73	34	4,882	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>	2,872.02 56銘柄	15,220 2,142,977	<3.0%>
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ(ドイツ)					
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		50.55	138	19,473	資本財・サービス
BAYER AG-REG		106.07	674	94,999	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		44.31	109	15,428	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		243.43	225	31,724	金融
COMMERZBANK AG		96.89	72	10,261	金融
VOLKSWAGEN AG		4.2	80	11,321	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		19.7	283	39,986	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG		88.86	970	136,650	資本財・サービス
E.ON SE		271.11	246	34,698	公益事業
UNIPER SE		11.92	24	3,460	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		35.27	273	38,541	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		19.08	66	9,332	資本財・サービス
CONTINENTAL AG		14.74	104	14,656	一般消費財・サービス
BASF SE		99.78	482	67,983	素材
ALLIANZ SE-REG		44.59	811	114,302	金融
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		21.41	125	17,719	生活必需品
RHEINMETALL AG		6.25	129	18,189	資本財・サービス
RWE AG		75.26	287	40,447	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		66.13	37	5,318	資本財・サービス
BRENNTAG SE		18.93	133	18,865	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		48.35	143	20,171	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		9.59	27	3,860	コミュニケーション・サービス
SAP SE		119.87	1,042	146,852	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		15.44	338	47,696	金融
ZALANDO SE		28.56	79	11,126	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG		17.72	88	12,395	素材
KION GROUP AG		6	23	3,320	資本財・サービス
COVESTRO AG		19.45	77	10,844	素材
RATIONAL AG		0.74	42	6,043	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG		3.1	97	13,744	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		17.4	119	16,772	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE		21.48	68	9,626	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		5.6	63	8,890	ヘルスケア
BECHTLE AG		8.19	29	4,215	情報技術
NEMETSCHEK SE		7.89	45	6,383	情報技術
SCOUT24 AG		10.83	57	8,026	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		34.61	172	24,248	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG		9.26	53	7,585	資本財・サービス
HELLOFRESH SE		18.14	52	7,386	生活必需品
SIEMENS ENERGY AG		47.32	73	10,397	資本財・サービス
BEIERSDORF AG		12.75	118	16,702	生活必需品
MERCK KGAA		15.64	255	35,993	ヘルスケア

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2022年6月15日現在			業種等
		株数	価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG		20.45	336	47,376	一般消費財・サービス
PUMA SE		12.95	85	12,052	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		13.11	76	10,789	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		349.87	623	87,774	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		25.61	129	18,195	ヘルスケア
MERCEDES-BENZ GROUP N AG		93.01	579	81,573	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		140.76	341	48,100	情報技術
HANNOVER RUECK SE		6.44	89	12,626	金融
DEUTSCHE POST AG-REG		108.78	376	52,963	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		20.99	318	44,877	金融
MTU AERO ENGINES AG		6.66	112	15,824	資本財・サービス
SYMRISE AG		16.56	158	22,318	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		62.4	17	2,442	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		7.33	52	7,420	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		80.41	254	35,799	不動産
LEG IMMOBILIEN SE		8.69	72	10,175	不動産
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,790.43	11,974	1,685,957	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ポルトガル）					
JERONIMO MARTINS		29	54	7,684	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		359.64	161	22,726	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		61.35	77	10,901	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	449.99	293	41,311	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（スペイン）					
TELEFONICA SA		644.91	284	40,035	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA		37.6	71	10,103	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		722.68	303	42,675	金融
IBERDROLA SA		638.68	630	88,775	公益事業
REPSOL SA		172.83	265	37,341	エネルギー
GRIFOLS SA		27.95	49	6,932	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		1,859.13	487	68,661	金融
AMADEUS IT GROUP SA		54	273	38,533	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA		27.21	73	10,370	公益事業
CAIXABANK SA		670.15	215	30,354	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		29.53	70	9,987	資本財・サービス
AENA SME SA		8.66	113	15,991	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA		74.19	263	37,062	コミュニケーション・サービス
ACCIONA SA		3.53	62	8,807	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		118.36	266	37,513	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		32.93	58	8,306	資本財・サービス
ENAGAS SA		32.18	67	9,478	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		51.47	92	13,019	公益事業
FERROVIAL SA		60.55	140	19,838	資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA		30.29	65	9,229	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,296.83	3,856	543,015	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（イタリア）					
PRYSMIAN SPA		29.49	81	11,493	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		129.44	200	28,276	金融
MEDIOBANCA SPA		83.45	74	10,525	金融
UNICREDIT SPA		255.29	248	34,920	金融
TELECOM ITALIA SPA		1,085.03	26	3,790	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO		1,761.98	311	43,911	金融
ATLANTIA SPA		60.27	133	18,864	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		77.27	70	9,920	金融
MONCLER SPA		24.35	93	13,158	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		12.85	48	6,799	ヘルスケア
ENI SPA		272.08	358	50,452	エネルギー
DIASORIN SPA		2.77	30	4,348	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		24.14	22	3,141	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA		65.11	47	6,701	情報技術
AMPLIFON SPA		14.4	37	5,346	ヘルスケア
ENEL SPA		887.93	473	66,673	公益事業
SNAM SPA		243	123	17,394	公益事業
TERNA SPA		158.15	114	16,094	公益事業
FINECOBANK SPA		80.77	83	11,753	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,267.77	2,582	363,566	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フィンランド）					
UPM-KYMMENE OYJ		65.25	199	28,122	素材
NOKIA OYJ		627.53	283	39,937	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		41.16	29	4,186	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		69.84	108	15,325	素材
ELISA OYJ		17.34	91	12,822	コミュニケーション・サービス

銘柄		2022年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
SAMPO OYJ-A SHS		58.26	236	33,304	金融
FORTUM OYJ		44	72	10,268	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		34.7	75	10,699	生活必需品
KONE OYJ-B		37.96	169	23,912	資本財・サービス
NESTE OYJ		49.41	207	29,170	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		17.63	64	9,067	ヘルスケア
国小計		株数、金額 銘柄数<比率>	1,063.08 11銘柄	216,816 <0.3%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オーストリア）					
VERBUND AG		8.76	82	11,624	公益事業
OMV AG		20.56	100	14,095	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		34.89	92	12,983	金融
VOESTALPINE AG		13.23	33	4,761	素材
国小計		株数、金額 銘柄数<比率>	77.44 4銘柄	43,464 <0.1%>	
ユーロ通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	20,822.3 223銘柄	6,513,771 <9.0%>	
ファンド合計		株数、金額 銘柄数<比率>	126,137.82 1,213銘柄	69,571,750 <95.9%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2)外国投資信託証券

銘 柄		2022年6月15日現在		
		口 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
		千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
AVALONBAY COMMUNITIES INC		1.606	297	40,154
SIMON PROPERTY GROUP INC		3.755	362	48,926
BOSTON PROPERTIES INC		1.658	150	20,289
VORNADO REALTY TRUST		2.128	61	8,320
SBA COMMUNICATIONS CORP		1.216	361	48,768
EQUITY RESIDENTIAL		4.032	277	37,441
EQUINIX INC		1.021	631	85,258
AMERICAN TOWER CORP		5.381	1,261	170,354
HOST HOTELS & RESORTS INC		10.529	180	24,421
AMERICAN HOMES 4 RENT- A		4.335	142	19,278
KIMCO REALTY CORP		7.054	135	18,285
INVITATION HOMES INC		6.976	234	31,673
VICI PROPERTIES INC		12.524	352	47,564
VENTAS INC		4.401	213	28,776
WEYERHAEUSER CO		8.683	298	40,350
CROWN CASTLE INTL CORP		4.914	776	104,770
IRON MOUNTAIN INC		3.474	164	22,175
SUN COMMUNITIES INC		1.35	203	27,529
PROLOGIS INC		8.288	917	123,824
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		2.091	283	38,215
CAMDEN PROPERTY TRUST		1.177	148	20,022
DUKE REALTY CORP		4.262	218	29,461
ESSEX PROPERTY TRUST INC		0.771	197	26,669
WELLTOWER INC		4.901	379	51,247
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		6.434	150	20,361
MID-AMERICA APARTMENT COMM		1.326	212	28,649
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		1.95	133	18,078
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		15.632	92	12,494
REALTY INCOME CORP		7.325	459	62,096
PUBLIC STORAGE		1.784	531	71,737
REGENCY CENTERS CORP		1.939	109	14,816
UDR INC		3.7	156	21,140
WVP CAREY INC		2.131	172	23,295
DIGITAL REALTY TRUST INC		3.174	395	53,380
EXTRA SPACE STORAGE INC		1.575	250	33,754
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		6.944	103	14,006
ア メ リ カ ・ ド ル 通 貨 計		口 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	160.441 36 銘柄	1,487,590 <2.1%>
		千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)				
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		0.831	36	3,825
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		1.4	28	2,933
カ ナ ダ ・ ド ル 通 貨 計		口 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2.231 2 銘柄	6,759 <0.0%>

銘柄		2022年6月15日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)				
DEXUS/AU		13.949	126	11,778
LENDLEASE GROUP		8.477	81	7,607
TRANSURBAN GROUP		40.411	564	52,558
APA GROUP		14.243	163	15,249
SCENTRE GROUP		64.017	163	15,197
GPT GROUP		21.774	90	8,432
MIRVAC GROUP		43.513	89	8,304
STOCKLAND		18.729	67	6,277
GOODMAN GROUP		20.198	361	33,678
VICINITY CENTRES		50.371	87	8,183
オーストラリア・ドル通貨計		295.682	1,796	167,269
		銘柄数 < 比率 >	10 銘柄	<0.2%>
		千口	千香港・ドル	千円
(香港)				
LINK REIT		26	1,778	30,588
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		33	252	4,336
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		54	578	9,956
香港・ドル通貨計		113	2,609	44,881
		銘柄数 < 比率 >	3 銘柄	<0.1%>
		千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)				
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		30.5	83	8,131
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		56.826	120	11,679
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		46	74	7,224
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		37.6	66	6,415
シンガポール・ドル通貨計		170.926	345	33,451
		銘柄数 < 比率 >	4 銘柄	<0.0%>
		千口	千イギリス・ポンド	千円
(イギリス)				
LAND SECURITIES GROUP PLC		8.969	65	10,643
SEGRO PLC		11.371	108	17,611
BRITISH LAND CO PLC		9.799	49	8,052
イギリス・ポンド通貨計		30.139	223	36,307
		銘柄数 < 比率 >	3 銘柄	<0.1%>
		千口	千ユーロ	千円
(ユーロ (ベルギー))				
WAREHOUSES DE PAUW SCA		2.198	67	9,519
国小計		2.198	67	9,519
		銘柄数 < 比率 >	1 銘柄	<0.0%>
		千口	千ユーロ	千円
(ユーロ (フランス))				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		1.507	80	11,351
GECINA SA		0.578	55	7,788
KLEPIERRE		2.394	45	6,343
COVIVIO		0.353	20	2,818
国小計		4.832	201	28,302
		銘柄数 < 比率 >	4 銘柄	<0.0%>
ユーロ通貨計		7.03	268	37,821
		銘柄数 < 比率 >	5 銘柄	<0.1%>
合計		779.449	—	1,814,081
		銘柄数 < 比率 >	63 銘柄	<2.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別		2022年6月15日現在	
		買建額	売建額
外	S&P500 EMINI FUT（アメリカ）	百万円 3,307	百万円 —
	S&P/TSX 60 IX FUT（カナダ）	122	—
	SPI 200 FUTURES（オーストラリア）	91	—
	FTSE 100 IDX FUT（イギリス）	196	—
国	SWISS MKT IX FUTR（ドイツ）	158	—
	EURO STOXX 50（ドイツ）	477	—

(注1) 外貨建の評価額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

運用報告書 第14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）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

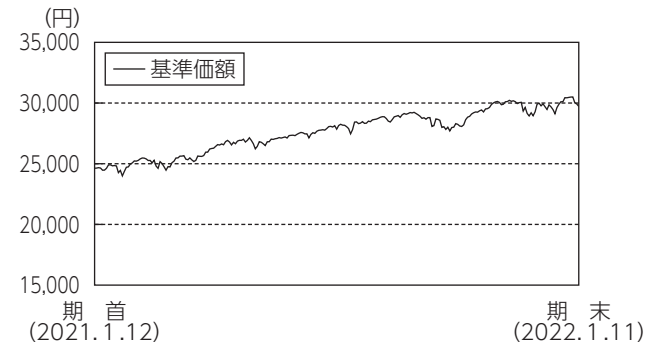
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ 指数(円ヘッジ・ベース)		株 組 比	株 式 入 率	株 先 比	式 物 率	投資信託 証券 組入比率
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率					
(期首)2021年1月12日	24,628	—	18,522	—	91.1	7.9	2.0		
2021年1月末	24,448	△ 0.7	18,380	△ 0.8	91.1	6.3	2.2		
2月末	24,805	0.7	18,622	0.5	94.5	4.9	2.2		
3月末	25,602	4.0	19,179	3.5	97.5	3.3	2.3		
4月末	27,019	9.7	20,212	9.1	94.2	2.9	2.3		
5月末	27,153	10.3	20,267	9.4	94.8	3.7	2.3		
6月末	27,802	12.9	20,733	11.9	93.7	4.3	2.3		
7月末	28,466	15.6	21,213	14.5	92.1	4.4	2.3		
8月末	29,136	18.3	21,674	17.0	91.2	6.5	2.2		
9月末	28,052	13.9	20,838	12.5	94.3	4.9	2.3		
10月末	29,513	19.8	21,908	18.3	94.0	5.8	2.3		
11月末	29,636	20.3	21,970	18.6	93.0	3.7	2.3		
12月末	30,465	23.7	22,559	21.8	93.4	5.7	2.4		
(期末)2022年1月11日	29,723	20.7	21,997	18.8	94.4	3.3	2.4		

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) をもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

(注5) 株式先物比率は買建比率・売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：24,628円 期末：29,723円 騰落率：20.7%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行った結果、新型コロナウイルスのワクチン接種の進捗などを好感して海外株式市況が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○先進国株式市況

先進国株式市況は上昇しました。

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は18.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は20.7%となりました。

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

*ベンチマークはMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）です。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	1円 (1)
(先物・オプション)	(0)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税 (株式)	0 (0)
(投資信託証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	8 (4)
(その他)	(4)
合 計	9

(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1月13日から2022年1月11日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 2,529.02 (△ 260.83)	千アメリカ・ドル 27,716 (△ 702)	百株 3,244.57	千アメリカ・ドル 36,904
	カナダ	百株 483.49 (99.36)	千カナダ・ドル 2,316 (212)	百株 702.42	千カナダ・ドル 2,409
	オーストラリア	百株 320.69 (58.3)	千オーストラリア・ドル 841 (△ 48)	百株 617.54	千オーストラリア・ドル 663
	香港	百株 1,090 (81.91)	千香港ドル 2,190 (△ 22)	百株 1,388	千香港ドル 2,829
	シンガポール	百株 50 (370.97)	千シンガポール・ドル 128 (△ 34)	百株 510.97	千シンガポール・ドル 295
	ニュージーランド	百株 — (—)	千ニュージーランド・ドル (—)	百株 70	千ニュージーランド・ドル 42
	イギリス	百株 1,632.56 (△ 595.44)	千イギリス・ポンド 977 (△ 206)	百株 2,255.52	千イギリス・ポンド 1,419
	イスラエル	百株 — (—)	千イスラエル・シェケル (—)	百株 20	千イスラエル・シェケル 196
	スイス	百株 32.88 (—)	千スイス・フラン 807 (△ 30)	百株 121.39	千スイス・フラン 1,104
	デンマーク	百株 45.94 (102.28)	千デンマーク・クローネ 716 (—)	百株 56.48	千デンマーク・クローネ 2,648
	ノルウェー	百株 30.67 (—)	千ノルウェー・クローネ 1,182 (—)	百株 27.83	千ノルウェー・クローネ 775
	スウェーデン	百株 338.93 (1,035.13)	千スウェーデン・クローネ 8,970 (—)	百株 679.14	千スウェーデン・クローネ 8,392
	ユーロ (アイルランド)	百株 8.28 (—)	千ユーロ 80 (—)	百株 20.76	千ユーロ 162
	ユーロ (オランダ)	百株 240.31 (112.9)	千ユーロ 1,378 (△ 62)	百株 481.66	千ユーロ 1,036
	ユーロ (ベルギー)	百株 — (—)	千ユーロ (—)	百株 15.07	千ユーロ 85
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 57.91 (—)	千ユーロ 87 (—)	百株 70.11	千ユーロ 66
	ユーロ (フランス)	百株 49.15 (1.91)	千ユーロ 582 (△ 58)	百株 221.3	千ユーロ 1,414
	ユーロ (ドイツ)	百株 108.81 (153.04)	千ユーロ 616 (△ 32)	百株 328.33	千ユーロ 1,307
	ユーロ (ポルトガル)	百株 169.85 (—)	千ユーロ 79 (—)	百株 85.97	千ユーロ 41
国	ユーロ (スペイン)	百株 269.49 (3,614.69)	千ユーロ 342 (61)	百株 3,168.18	千ユーロ 304
	ユーロ (イタリア)	百株 45.25 (—)	千ユーロ 79 (△ 0)	百株 817.2	千ユーロ 207
	ユーロ (フィンランド)	百株 22.35 (—)	千ユーロ 78 (—)	百株 38.62	千ユーロ 133
	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 971.4 (3,882.54)	千ユーロ 3,325 (△ 92)	百株 5,247.2	千ユーロ 4,758

(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、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) 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	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 6.081 (△ 0.155)	千アメリカ・ドル 382 (—)	千口 15.238 (—)	千アメリカ・ドル 876 (—)
	オーストラリア	千口 27.011 (3.711)	千オーストラリア・ドル 256 (—)	千口 10.674 (—)	千オーストラリア・ドル 61 (—)
	香港	千口 (—)	千香港ドル (—)	千口 6 (—)	千香港ドル 421 (—)
	シンガポール	千口 (5.166)	千シンガポール・ドル (6)	千口 26 (—)	千シンガポール・ドル 36 (—)

(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、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、上段の数字には含まれておりません。
(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	株式先物取引	百万円 25,850	百万円 29,410	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

当 期				当 期			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘柄	株 数	金 額	平均単価	銘柄	株 数	金 額	平均単価
AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.523	203,757	389,593	APPLE INC (アメリカ)	21.313	315,537	14,804
TESLA INC (アメリカ)	1.477	135,224	91,553	MICROSOFT CORP (アメリカ)	7.183	214,856	29,911
APPLE INC (アメリカ)	5.422	92,141	16,993	ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.55	141,838	257,888
MICROSOFT CORP (アメリカ)	2.5	84,468	33,787	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.37	135,438	366,050
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.281	75,780	269,679	META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)	2.255	77,877	34,535
SNOWFLAKE INC-CLASS A (アメリカ)	2.091	71,227	34,063	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.287	74,208	258,565
SEA LTD-ADR (ケイマン諸島)	1.7	59,641	35,082	TESLA INC (アメリカ)	0.668	60,233	90,170
AIRBNB INC-CLASS A (アメリカ)	2.931	57,800	19,720	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	3.155	55,500	17,591
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A (アメリカ)	19.77	55,009	2,782	ALEXION PHARMACEUTICALS INC (アメリカ)	2.652	52,988	19,980
PROSUS NV (オランダ)	5.3	49,511	9,341	ORACLE CORP (アメリカ)	5.72	52,828	9,235

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	株数	期首 株数	当期 株数	期末 評価額		業種等
				外貨建金額	邦貨換算金額	
				千円	千円	
(アメリカ)	百株	百株	千円	千円		
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	12.95	12.95	217	25,130	情報技術	
PALO ALTO NETWORKS INC	12.2	12.2	637	73,538	情報技術	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22.71	22.71	424	48,924	情報技術	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS INC	15.94	15.94	137	15,906	資本財・サービス	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7.46	7.46	109	12,604	ヘルスケア	
SYNCHRONY FINANCIAL	62	72.38	349	40,322	金融	
ABBOTT LABORATORIES	223.7	212.42	2,873	331,394	ヘルスケア	
HOWMET AEROSPACE INC	39.5	39.5	134	15,481	資本財・サービス	
VERISK ANALYTICS INC	19.43	19.43	401	46,318	資本財・サービス	
LAS VEGAS SANDS CORP	47.29	47.29	172	19,870	一般消費財・サービス	
AMPHENOL CORP-CL A	41.67	69.05	565	65,242	情報技術	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1.87	4.43	199	22,958	情報技術	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	77.66	74.82	870	100,424	情報技術	
QORVO INC	12.83	12.83	194	22,428	情報技術	
AFLAC INC	84.71	84.71	532	61,465	金融	
DARDEN RESTAURANTS INC	12.48	18.7	274	31,701	一般消費財・サービス	
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	18.35	18.35	211	24,407	コミュニケーション・サービス	
ADOBE INC	60.97	57.19	3,007	346,852	情報技術	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	28.72	28.72	193	22,349	素材	
LULULEMON ATHLETICA INC	16.07	14.07	490	56,544	一般消費財・サービス	
GARMIN LTD	15.27	20.68	268	31,019	一般消費財・サービス	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	28.19	26.02	767	88,563	素材	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	88.26	83.91	1,791	206,590	資本財・サービス	
WR BERKLEY CORP	17.71	17.71	149	17,238	金融	
AUTOZONE INC	2.91	2.61	525	60,588	一般消費財・サービス	
DOLLAR TREE INC	33.98	25.66	348	40,173	一般消費財・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	123.65	123.65	112	13,006	ヘルスケア	
PINNACLE WEST CAPITAL	15.08	—	—	—	公益事業	
CELANESE CORP	12.97	12.97	220	25,474	素材	
DR HORTON INC	43.97	43.97	420	48,544	一般消費財・サービス	
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	24.5	135	15,669	ヘルスケア	
AUTODESK INC	26.84	26.84	704	81,228	情報技術	
MOODY'S CORP	21.43	20.35	736	84,918	金融	
DEVON ENERGY CORP	77.48	77.48	375	43,342	エネルギー	
ALBEMARLE CORP	16.68	14.27	323	37,357	素材	
ATMOS ENERGY CORP	16.54	16.54	173	20,059	公益事業	
ALLIANT ENERGY CORP	36.14	36.14	219	25,272	公益事業	
CITIGROUP INC	261.68	248.66	1,641	189,376	金融	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	53.55	51.05	1,188	137,128	情報技術	
AMERICAN ELECTRIC POWER	59.18	59.18	535	61,773	公益事業	
ALLEGHANY CORP	1.46	1.46	98	11,417	金融	
DOMINO'S PIZZA INC	5.26	5.26	264	30,495	一般消費財・サービス	
HESS CORP	34.26	38.07	324	37,389	エネルギー	
DAVITA INC	10	10	113	13,117	ヘルスケア	
DANAHER CORP	80.31	76.75	2,325	268,252	ヘルスケア	
FORTIVE CORP	43.35	43.35	312	36,044	資本財・サービス	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	71.72	66.22	870	100,437	金融	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	65.8	65.8	460	53,072	生活必需品	
BUNGE LTD	18.38	18.38	176	20,374	生活必需品	
TE CONNECTIVITY LTD	42.21	40.02	633	73,055	情報技術	
APPLE INC	2,156.06	1,997.15	34,388	3,966,418	情報技術	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33.59	37.57	479	55,258	金融	
BOEING CO/THE	67.41	66.98	1,401	161,701	資本財・サービス	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20.63	20.63	243	28,137	金融	
BECTON DICKINSON AND CO	36.79	34.85	903	104,175	ヘルスケア	
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT INC	20	20	18	2,094	一般消費財・サービス	
LEIDOS HOLDINGS INC	14	14	125	14,486	資本財・サービス	
NISOURCE INC	40.26	40.26	111	12,895	公益事業	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17.08	17.08	184	21,244	資本財・サービス	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	99.78	99.78	626	72,274	金融	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	519.78	493.71	2,659	306,760	コミュニケーション・サービス	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	173.71	159.59	5,089	587,057	金融	
ANSYS INC	10.38	10.38	376	43,480	情報技術	
TRUIST FINANCIAL CORP	171.23	160.8	1,049	121,091	金融	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	81.93	86.15	988	113,991	金融	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	286.15	272.84	1,776	204,865	ヘルスケア	
JPMORGAN CHASE & CO	382.84	359.51	6,015	693,807	金融	
T. ROWE PRICE GROUP INC	30.13	26.58	502	58,006	金融	
LKQ CORP	33	33	190	21,954	一般消費財・サービス	
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	5.47	—	—	—	金融	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	36.65	36.65	241	27,815	生活必需品	
CADENCE DESIGN SYS INC	36.14	33.59	557	64,266	情報技術	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16.11	13.48	429	49,543	金融	
DOLLAR GENERAL CORP	30.52	28.25	667	76,998	一般消費財・サービス	
SERVENOW INC	24.19	24.19	1,383	159,592	情報技術	
CATERPILLAR INC	68.56	65.72	1,456	168,006	資本財・サービス	
BROWN & BROWN INC	28.86	28.86	196	22,661	金融	
ESSENTIAL UTILITIES INC	24.78	24.78	128	14,779	公益事業	
CHARLES RIVER LABORATORIES	—	6.4	213	24,663	ヘルスケア	
CMS ENERGY CORP	33.84	33.84	219	25,284	公益事業	
MOSAIC CO/THE	52.09	52.09	208	24,056	素材	
DELTA AIR LINES INC	16.5	16.5	67	7,732	資本財・サービス	
CORNING INC	99.83	99.83	375	43,294	情報技術	
CISCO SYSTEMS INC	534.5	505.01	3,121	360,088	情報技術	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12.97	—	—	—	ヘルスケア	
MORGAN STANLEY	189.09	170.09	1,771	204,284	金融	
ZILLOW GROUP INC - A	5.87	10.16	56	6,475	不動産	
MSCI INC	10.06	10.06	545	62,873	金融	
FAIR ISAAC CORP	3.98	3.98	175	20,207	情報技術	

銘柄	株数	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	千円	千円		
LENNOX INTERNATIONAL INC	4.5	4.5	137	15,871	資本財・サービス	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	27.8	27.8	229	26,488	情報技術	
BROADCOM INC	50.58	48.79	3,030	349,553	情報技術	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14.16	14.16	212	24,524	ヘルスケア	
ARAMARK	31.73	31.73	115	13,303	一般消費財・サービス	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	16.12	—	—	—	素材	
DTE ENERGY COMPANY	27.39	22.81	274	31,610	公益事業	
CENTENE CORP	77.79	68.44	532	61,445	ヘルスケア	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	13.58	13.58	166	19,214	金融	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	55.32	55.32	298	34,404	金融	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	22.32	24.75	402	46,368	金融	
GARTNER INC	11.74	10.48	307	35,500	情報技術	
SPLUNK INC	20.29	20.29	240	27,689	情報技術	
DOMINION ENERGY INC	109.95	97.4	777	89,681	公益事業	
MONSTER BEVERAGE CORP	47.68	47.68	442	50,996	生活必需品	
SMITH (A.O.) CORP	14	14	116	13,384	資本財・サービス	
DEERE & CO	36.23	36.23	1,376	158,734	資本財・サービス	
POOL CORP	1.74	4.38	217	25,073	一般消費財・サービス	
GLOBAL PAYMENTS INC	38.66	35.67	524	60,482	情報技術	
VMWARE INC-CLASS A	8.92	23.35	286	33,002	情報技術	
CABLE ONE INC	0.6	0.6	97	11,294	コミュニケーション・サービス	
BURLINGTON STORES INC	7.66	7.66	189	21,822	一般消費財・サービス	
NASDAQ INC	14.27	14.27	269	31,127	金融	
VAIL RESORTS INC	5.53	5.53	164	18,933	一般消費財・サービス	
AMC ENTERTAINMENT HLD-CL A	—	63.6	144	16,710	コミュニケーション・サービス	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	8.94	—	—	—	金融	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	8.74	119	13,755	金融	
CONSOLIDATED EDISON INC	46.02	37.8	320	36,962	公益事業	
COGNEX CORP	24.39	24.39	175	20,229	情報技術	
TELEFLEX INC	5.63	5.63	182	21,008	ヘルスケア	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	9.79	9.79	193	22,355	資本財・サービス	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8.52	8.52	334	38,577	ヘルスケア	
BIO-RAD LABORATORIES-A	3	3	199	22,992	ヘルスケア	
CATALENT INC	20	20	236	27,291	ヘルスケア	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17.57	17.57	421	48,608	ヘルスケア	
MOLINA HEALTHCARE INC	8	8	231	26,731	ヘルスケア	
IDEX CORP	11.56	9.53	214	24,714	資本財・サービス	
COLGATE-PALMOLIVE CO	104.86	97.15	813	93,799	生活必需品	
ROLLINS INC	26.85	26.85	90	10,461	資本財・サービス	
AMETEK INC	25.97	25.97	364	42,004	資本財・サービス	
CHURCH & DWIGHT CO INC	30.47	30.47	313	36,128	生活必需品	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	16.44	16.44	95	10,988	資本財・サービス	
HEICO CORP	5.35	5.35	79	9,150	資本財・サービス	
XPO LOGISTICS INC	10.6	—	—	—	資本財・サービス	
GENERAC HOLDINGS INC	2.64	7.16	231	26,734	資本財・サービス	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4.8	4.8	212	24,520	金融	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	34.22	34.22	334	38,601	素材	
TYLER TECHNOLOGIES INC	5.09	5.09	247	28,556	情報技術	
COSTCO WHOLESALE CORP	55.33	52.6	2,728	314,749	生活必需品	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	11.28	11.28	120	13,910	情報技術	
EPAM SYSTEMS INC	7.49	7.49	408	47,155	情報技術	
RPM INTERNATIONAL INC	17.5	17.5	160	18,557	素材	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3.53	3.53	544	62,842	一般消費財・サービス	
UGI CORP	20.85	20.85	94	10,857	公益事業	
CUMMINS INC	17.63	17.63	407	47,049	資本財・サービス	
ACTIVISION BLIZZARD INC	99.82	93.22	588	67,855	コミュニケーション・サービス	
CDW CORP/DE	17.92	17.92	358	41,381	情報技術	
SIGNATURE BANK	—	8	282	32,594	金融	
COSTAR GROUP INC	4.92	49.2	351	40,579	資本財・サービス	
SVB FINANCIAL GROUP	6.9	6.9	490	56,601	金融	
AMERCO	0.7	0.7	48	5,605	資本財・サービス	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	12.39	12.39	409	47,183	資本財・サービス	
MERCADOLIBRE INC	6.03	5.56	585	67,547	一般消費財・サービス	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	8.37	141	16,369	情報技術	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	38.01	34.77	516	59,598	一般消費財・サービス	
IPG PHOTONICS CORP	2.5	2.5	41	4,738	情報技術	
DEXCOM INC	11.88	11.88	549	63,351	ヘルスケア	
NORDSON CORP	7.5	7.5	178	20,616	資本財・サービス	
COPART INC	24.95	24.95	339	39,163	資本財・サービス	
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	22	266	30,792	エネルギー	
SEAGEN INC	15.45	15.45	224	25,853	ヘルスケア	
ALIGN TECHNOLOGY INC	9.63	9.09	498	57,549	ヘルスケア	
TRANSIDGM GROUP INC	6.98	6.37	410	47,315	資本財・サービス	
BIO-TECHNE CORP	—	5.07	216	25,014	ヘルスケア	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	12.03	12.03	91	10,606	ヘルスケア	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	14.47	24.57	233	26,893	ヘルスケア	
KINDER MORGAN INC	278.51	278.51	485	55,990	エネルギー	
HCA HEALTHCARE INC	32.61	32.61	813	93,831	ヘルスケア	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	5.44	4.2	159	18,447	金融	
COTERRA ENERGY INC	46.08	95	202	23,404	エネルギー	
T-MOBILE US INC	72.44	76.24	806	92,982	コミュニケーション・サービス	
ZILLOW GROUP INC - C	17.86	17.86	100	11,647	不動産	
COCA-COLA CO/THE	514.9	488.85	2,954	340,728	生活必需品	
COCA-COLA EUROPAFIC PARTNE	25.75	25.75	148	17,178	生活必需品	
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.46	19.46	242	28,004	資本財・サービス	
FRANKLIN RESOURCES INC	38.51	38.51	134	15,510	金融	
CSX CORP	94.51	272.23	994	114,731	資本財・サービス	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11.66	11.66	340	39,218	ヘルスケア	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	当 株数	期末 評価価額		業種等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円	
EXPEDIA GROUP INC	15,638	15,638	282	32,552	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	8	—	—	—	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	53,521	55,051	17,779	2,050,700	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	81.09	73.71	885	102,122	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	529.46	515.19	3,527	406,862	エネルギー
AES CORP	83.41	83.41	191	22,088	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	5.71	5.71	159	18,453	金融
EOG RESOURCES INC	76.55	72.38	709	81,863	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	19.14	19.14	215	24,868	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	—	1	90	10,449	金融
ABIOMED INC	5.55	5.55	170	19,639	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	19.89	19.89	267	30,887	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	36.83	36.83	534	61,663	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	475.97	475.97	1,135	130,932	一般消費財・サービス
NOVAVAX INC	—	9.75	131	15,180	ヘルスケア
DISCOVERY INC - A	15.21	15.21	43	5,015	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	17.21	22.19	165	19,047	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	24.16	65	7,604	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	5.95	3.24	47	5,492	コミュニケーション・サービス
ENTEGRIS INC	—	17	227	26,256	情報技術
DISCOVERY INC-C	45.54	45.54	126	14,633	コミュニケーション・サービス
FORTINET INC	15.95	15.95	517	59,736	情報技術
MARKEL CORP	1.77	1.77	222	25,642	金融
NEXTERA ENERGY INC	243.24	233.99	1,972	227,485	公益事業
MASIMO CORP	6.93	6.93	176	20,332	ヘルスケア
FREEMONT-MCMORAN INC	197.64	182.97	761	87,833	素材
INSULET CORP	7.69	7.69	185	21,349	ヘルスケア
US BANCORP	180.05	171.43	1,051	121,325	金融
UNITED RENTALS INC	10.55	9.18	295	34,116	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	11.11	6.59	156	18,039	情報技術
FASTENAL CO	79.24	67.16	404	46,609	資本財・サービス
FISERV INC	73.39	72.06	776	89,555	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	1,169.58	132.27	1,315	151,675	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	165.43	154.98	946	109,165	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	4.65	13.05	130	15,050	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	32.11	28.75	605	69,838	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	41.76	40.78	1,627	187,752	金融
ALPHABET INC-CL A	36.37	36.31	10,070	1,161,494	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	39.68	34.69	9,614	1,108,909	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	17.63	17.63	161	18,660	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	78.49	78.49	539	62,257	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	76.12	58.4	242	27,967	公益事業
GENUINE PARTS CO	17.7	17.7	244	28,181	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	44.17	44.17	542	62,535	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	81	81	395	45,591	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	27.79	24.78	553	63,861	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	102.3	102.3	264	30,501	エネルギー
HOME DEPOT INC	135.34	128.45	4,976	574,038	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	8.4	8.4	131	15,148	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	166.84	190.88	325	37,493	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5	5	98	11,314	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	17.25	17.25	335	38,725	生活必需品
HUMANA INC	17.33	15.69	604	69,705	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	36.71	33.62	745	86,019	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9.17	9.17	159	18,448	情報技術
HENRY SCHEIN INC	18.7	18.7	148	17,071	ヘルスケア
HP INC	174.43	153.38	597	68,923	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	200.5	141.15	239	27,676	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	13.95	13.95	68	7,859	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	27.62	27.62	173	19,971	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20.28	20.28	99	11,484	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	50.11	50.11	230	26,598	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	83.9	83.9	313	36,153	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	15.58	15.58	229	26,439	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	110.82	107.57	1,452	167,533	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	40.47	196	22,671	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	15	150	17,365	資本財・サービス
ZOETIS INC	60.03	56.48	1,200	138,496	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	32.74	29.08	552	63,774	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	24.84	29.38	317	36,580	エネルギー
ALLEGION PLC	11.1	11.1	138	16,014	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	51.08	51.08	140	16,207	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	34.31	34.31	438	50,618	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	49.12	49.12	169	19,551	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC	8.64	—	—	—	ヘルスケア
JM SMUCKER CO/THE	13.93	13.93	199	23,020	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	332.56	317.89	5,502	634,641	ヘルスケア
PLUG POWER INC	—	62.51	154	17,844	資本財・サービス
ABBVIE INC	223.87	211.65	2,886	332,951	ヘルスケア
HOLOGIC INC	30.42	30.42	223	25,770	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	44.29	39.87	576	66,491	生活必需品
KROGER CO	100.13	86.74	425	49,122	生活必需品
KLA CORP	19.19	18.3	766	88,382	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	31.47	29.82	1,083	124,937	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	9.76	9.76	232	26,794	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	—	28.72	167	19,352	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	94.68	84.7	2,097	241,975	一般消費財・サービス

銘 柄	期 首		当		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額				
			外貨建金額	千円換算金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
ELI LILLY & CO	109.21	97.69	2,541	293,080	ヘルスケア		
LAM RESEARCH CORP	17.56	17.56	1,166	134,543	情報技術		
LOEWS CORP	35.91	28.73	174	20,124	金融		
LINCOLN NATIONAL CORP	26.43	26.43	190	22,024	金融		
MCDONALD'S CORP	94.58	90.35	2,388	275,540	一般消費財・サービス		
3M CO	72.16	69.54	1,233	142,296	資本財・サービス		
META PLATFORMS INC CLASS A	303.64	287.43	9,429	1,087,623	コミュニケーション・サービス		
S&P GLOBAL INC	29.23	29.23	1,272	146,786	金融		
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7.67	7.67	319	36,823	素材		
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	5.75	5.75	146	16,942	情報技術		
CONCHCO RESOURCES INC	25.52	—	—	—	その他		
PHILLIPS 66	51.07	51.07	428	49,397	エネルギー		
MGM RESORTS INTERNATIONAL	56.59	56.59	246	28,471	一般消費財・サービス		
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	29.92	29.92	283	32,653	生活必需品		
METLIFE INC	90.65	90.65	611	70,575	金融		
MARVELL TECHNOLOGY INC	86.17	104.85	861	99,419	情報技術		
ARISTA NETWORKS INC	5.93	23.72	312	35,987	情報技術		
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	24.19	—	—	—	金融		
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22.32	20.48	524	60,478	情報技術		
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.84	2.84	444	51,296	ヘルスケア		
BAKER HUGHES CO	84.46	84.46	220	25,396	エネルギー		
ROCKWELL AUTOMATION INC	14.6	14.6	482	55,596	資本財・サービス		
MERCK & CO. INC.	318.87	303.2	2,497	288,056	ヘルスケア		
DUPONT DE NEMOURS INC	91.81	66.57	545	62,938	素材		
MASCO CORP	35.43	35.43	235	27,220	資本財・サービス		
M & T BANK CORP	19.84	13.71	243	28,066	金融		
MARSH & MCLENNAN COS	64.53	60.48	999	115,225	金融		
BLACK KNIGHT INC	16.44	16.44	129	14,978	情報技術		
HEICO CORP-CLASS A	10.18	10.18	131	15,183	資本財・サービス		
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	33.61	33.61	544	62,819	一般消費財・サービス		
WORKDAY INC-CLASS A	21.23	23.03	581	67,020	情報技術		
WAYFAIR INC- CLASS A	8.8	8.8	155	17,913	一般消費財・サービス		
BLOCK INC CLASS A	48.01	46.73	675	77,872	情報技術		
TRANSUNION	22.93	22.93	250	28,928	資本財・サービス		
VISTRA CORP	42.85	42.85	96	11,100	公益事業		
NOVOCURE LTD	6.16	10.54	69	7,978	ヘルスケア		
NETAPP INC	27.03	27.03	251	29,056	情報技術		
NIKE INC -CL B	155.47	152.54	2,294	264,683	一般消費財・サービス		
NORFOLK SOUTHERN CORP	33.43	29.93	861	99,410	資本財・サービス		
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	34.92	66.46	551	63,569	情報技術		
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17.49	26.23	282	32,580	金融		
ALLY FINANCIAL INC	50.94	50.94	255	29,471	金融		
NORTHROP GRUMMAN CORP	20.25	18.35	738	85,131	資本財・サービス		
APTIV PLC	32.32	32.32	533	61,534	一般消費財・サービス		
NEWMONT CORP	104.13	92.52	559	64,486	素材		
MCKESSON CORP	21.61	18.5	463	53,498	ヘルスケア		
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	32.57	—	—	—	情報技術		
XYLEM INC	19.72	19.72	225	25,988	資本財・サービス		
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	196.39	187.91	1,884	217,342	生活必需品		
NUCOR CORP	36.92	36.92	412	47,633	素材		
SUNRUN INC	15	15	47	5,453	資本財・サービス		
WESTERN UNION CO	68.11	43.5	81	9,382	情報技術		
GODADDY INC - CLASS A	19.3	19.3	147	17,051	情報技術		
NEWELL BRANDS INC	40.58	40.58	94	10,886	一般消費財・サービス		
EVERGY INC	32.43	26.54	177	20,454	公益事業		
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	102.38	102.38	331	38,235	エネルギー		
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	2.69	51	5,979	金融		
OKTA INC	13.76	16.34	328	37,926	情報技術		
COUPA SOFTWARE INC	8.8	8.8	129	14,987	情報技術		
LIBERTY BROADBAND-C	8.84	18.78	283	32,649	コミュニケーション・サービス		
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	48.77	48.77	140	16,161	ヘルスケア		
LINDE PLC	61.08	57.29	1,921	221,646	素材		
WIX.COM LTD	7.85	7.85	115	13,303	情報技術		
EQUITABLE HOLDINGS INC	61.84	61.84	217	25,085	金融		
KKR & CO INC	64.89	64.89	449	51,874	金融		
PAYCHEX INC	46	36.57	462	53,391	情報技術		
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9.16	8.38	565	65,249	一般消費財・サービス		
ALTRIA GROUP INC	232.79	220.86	1,116	128,745	生活必需品		
P G & E CORP	155.15	155.15	189	21,885	公益事業		
PFIZER INC	702.37	669.99	3,768	434,603	ヘルスケア		
CIGNA CORP	46.3	40.86	954	110,133	ヘルスケア		
DELL TECHNOLOGIES -C	32.76	32.76	196	22,625	情報技術		
ALTICE USA INC- A	41.47	—	—	—	コミュニケーション・サービス		
XCEL ENERGY INC	65.28	65.28	456	52,600	公益事業		
STERIS PLC	8.97	13.29	307	35,488	ヘルスケア		
SEA LTD-ADR	—	17	318	36,686	コミュニケーション・サービス		
FOX CORP - CLASS B	15.3	15.3	55	6,347	コミュニケーション・サービス		
FOX CORP - CLASS A	52.67	41.92	163	18,871	コミュニケーション・サービス		
STRYKER CORP	44.82	40.86	1,078	124,347	ヘルスケア		
LYFT INC-A	—	36.49	161	18,573	資本財・サービス		
DOW INC	96.64	87.18	509	58,723	素材		
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	15.08	15.08	138	15,984	金融		
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	23.26	27.23	469	54,196	情報技術		
PARKER HANNIFIN CORP	18.39	15.38	488	56,313	資本財・サービス		
UBER TECHNOLOGIES INC	116.86	151.86	646	74,616	資本財・サービス		
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	22.03	30.37	604	69,749	エネルギー		
PROCTER & GAMBLE CO/THE	310.59	291.25	4,675	539,231	生活必需品		
EXELON CORP	118.82	118.82	675	77,870	公益事業		
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	26.52	—	—	—	その他		
TELADOC HEALTH INC	13.4	19.85	163	18,815	ヘルスケア		
INGERSOLL-RAND INC	53.97	49.86	294	33,924	資本財・サービス		
NVR INC	0.45	0.45	248	28,626	一般消費財・サービス		

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等
			価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
CONOCOPHILLIPS	141.85	167.66	1,358	156,695	エネルギー
TWILIO INC - A	17.46	20.53	467	53,875	情報技術
DOCUSIGN INC	22.52	25.65	349	40,303	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	6.01	6.01	218	25,233	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6.12	14.7	131	15,208	情報技術
PEPSICO INC	174.34	167.68	2,920	336,848	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4.09	4.09	64	7,440	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	23.92	54.14	128	14,824	情報技術
MONGODB INC	6.1	7.12	309	35,723	情報技術
SNAP INC - A	116.75	116.75	486	56,166	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	85.3	85.3	404	46,624	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	53.88	49.01	560	64,702	金融
AMCOR PLC	174.57	174.57	212	24,463	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	19.1	23.36	449	51,866	情報技術
ROKU INC	14.88	15.56	284	32,835	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20.92	20.92	355	41,026	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	79.88	75.59	2,819	325,201	情報技術
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	58.76	—	—	—	情報技術
10X GENOMICS INC-CLASS A	4.21	8.18	104	12,050	ヘルスケア
KORUNIT DIGITAL LTD	—	6	74	8,611	資本財・サービス
PENTAIR PLC	15.75	15.75	109	12,627	資本財・サービス
QUALCOMM INC	142.14	135.24	2,429	280,275	情報技術
INVESCO LTD	37	37	89	10,310	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	8.19	8.19	191	22,116	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31.93	31.93	242	27,919	金融
DATADOG INC - CLASS A	18.25	25.36	371	42,801	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	60.8	77.35	252	29,173	コミュニケーション・サービス
INMODE LTD	—	6	32	3,780	ヘルスケア
AVALARA INC	12.57	12.57	143	16,501	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	13.27	12.61	783	90,359	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	26.67	26.67	351	40,490	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	5.01	5.01	1,215	140,210	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	48.88	41.1	423	48,883	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	9.98	9.98	135	15,651	素材
RESMED INC	19.83	16.6	394	45,444	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	18.12	15.58	248	28,680	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	14.99	14.99	165	19,078	資本財・サービス
MODERNA INC	33.62	42.39	990	114,262	ヘルスケア
HUBSPOT INC	3.54	5.64	296	34,210	情報技術
PERKINELMER INC	11.63	11.63	213	24,648	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	97.33	97.33	509	58,734	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	48.66	48.66	411	47,514	資本財・サービス
BILL.COM HOLDINGS INC	—	9	180	20,863	情報技術
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	23	—	—	—	金融
AVANTOR INC	56	66.86	255	29,520	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	31.23	14.76	74	8,535	金融
DYNATRACE INC	23.39	23.39	127	14,713	情報技術
TRADE DESK INC/THE-CLASS A	5.4	54	437	50,449	情報技術
FIVERR INTERNATIONAL LTD	—	4	38	4,408	一般消費財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	153.5	108.25	269	31,039	金融
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	—	28	149	17,193	コミュニケーション・サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	—	41.76	177	20,441	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	10.21	10.21	133	15,366	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	31.62	31.62	400	46,157	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	234.68	231.9	2,901	334,636	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A	25.9	31.74	109	12,582	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	12.94	10.89	300	34,623	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	49.85	49.85	327	37,741	公益事業
ETSY INC	13.29	16.62	305	35,216	一般消費財・サービス
TESLA INC	93.77	101.86	10,778	1,243,135	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3.63	24.54	742	85,686	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	79.44	79.44	213	24,601	情報技術
DRAFTKINGS INC - CL A	12.2	41.34	108	12,459	一般消費財・サービス
UNITY SOFTWARE INC	—	7.52	94	10,928	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	22	18.95	356	41,110	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	20.31	17.76	585	67,522	情報技術
CARVANA CO	6.88	9.64	176	20,396	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	8.56	8.56	42	4,927	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20.3	29.34	324	37,478	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	18.26	15.9	962	111,030	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	137.45	137.45	206	23,796	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	—	9.49	126	14,607	一般消費財・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	—	29.31	471	54,329	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	38.49	38.49	397	45,903	不動産
TWITTER INC	105.16	95.99	383	44,252	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	139.16	125.64	861	99,308	公益事業
SYSCO CORP	61.6	61.6	488	56,349	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	29.58	29.58	485	55,973	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	—	6	25	2,944	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	19.25	19.25	121	14,007	金融
STEEL DYNAMICS INC	23	23	139	16,073	素材
SCHLUMBERGER LTD	178.99	178.99	628	72,504	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	20.26	126	14,623	資本財・サービス
AFFIRM HOLDINGS INC	—	11	86	9,926	情報技術
AT&T INC	897.21	855.56	2,263	261,108	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	17.58	17.58	79	9,173	資本財・サービス

銘柄	期 首		当 期		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千円	千円			
ON SEMICONDUCTOR CORP	44.52	55.54	361	41,715	情報技術		
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	25.95	229	26,428	一般消費財・サービス		
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10.19	30.57	988	113,993	素材		
SEMPRA ENERGY	39.15	38.07	524	60,463	公益事業		
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	—	22.64	97	11,215	情報技術		
CLARIVATE PLC	—	47.21	97	11,249	資本財・サービス		
OAK STREET HEALTH INC	—	16.54	40	4,712	ヘルスケア		
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	—	197.7	326	37,624	情報技術		
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	26.06	26.06	298	34,391	情報技術		
COINBASE GLOBAL INC-CLASS A	—	5	112	12,976	金融		
TEXAS INSTRUMENTS INC	114.44	109.81	2,009	231,727	情報技術		
SALESFORCE.COM INC	114.15	116.24	2,669	307,867	情報技術		
ASANA INC CLASS A	—	8	49	5,681	情報技術		
WESTROCK CO	26.18	26.18	119	13,763	素材		
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	—	36.82	251	29,027	金融		
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	99.06	83.22	652	75,262	資本財・サービス		
TERADYNE INC	20.96	20.96	328	37,860	情報技術		
UNION PACIFIC CORP	85.02	80.74	2,020	233,074	資本財・サービス		
MARATHON PETROLEUM CORP	81.28	81.28	572	66,045	エネルギー		
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	190.09	182.23	1,635	188,598	資本財・サービス		
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	87.73	87.73	1,857	214,244	資本財・サービス		
IQVIA HOLDINGS INC	24.35	24.35	626	72,243	ヘルスケア		
VOYA FINANCIAL INC	18	—	—	—	金融		
AMEREN CORPORATION	28.61	28.61	250	28,877	公益事業		
UNITEDHEALTH GROUP INC	119.3	114.28	5,314	612,919	ヘルスケア		
VERISIGN INC	13.65	13.65	322	37,250	情報技術		
LUCID GROUP INC	—	51	212	24,541	一般消費財・サービス		
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	—	22	179	20,665	一般消費財・サービス		
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	—	23	35	4,141	金融		
VALERO ENERGY CORP	58.84	45.84	371	42,842	エネルギー		
SOFI TECHNOLOGIES INC	—	65	86	10,023	金融		
UPSTART HOLDINGS INC	—	2	22	2,639	金融		
ULTA BEAUTY INC	6.35	6.35	241	27,907	一般消費財・サービス		
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	30.08	161	18,585	金融		
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9.92	9.92	131	15,201	ヘルスケア		
ANTHEM INC	32.54	29.98	1,312	151,396	ヘルスケア		
WALT DISNEY CO/THE	228.95	217.61	3,407	393,052	コミュニケーション・サービス		
WELLS FARGO & CO	483.84	496.46	2,747	316,943	金融		
WASTE MANAGEMENT INC	55.07	50.34	802	92,556	資本財・サービス		
WILLIAMS COS INC	171.23	145.42	406	46,879	エネルギー		
TRACTOR SUPPLY COMPANY	15.91	13.93	316	36,534	一般消費財・サービス		
WHIRLPOOL CORP	8.7	8.7	193	22,321	一般消費財・サービス		
WALMART INC	178.52	184.85	2,673	308,317	生活必需品		
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	24.92	24.92	316	36,474	ヘルスケア		
WYNN RESORTS LTD	11.45	11.45	94	10,851	一般消費財・サービス		
WABTEC CORP	18.98	18.98	179	20,669	資本財・サービス		
TXJ COMPANIES INC	149.98	145.67	1,055	121,794	一般消費財・サービス		
WATERS CORP	7.6	7.6	262	30,244	ヘルスケア		
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5.55	6.5	348	40,140	情報技術		
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	86.95	86.95	467	53,884	生活必需品		
WILLIS TOWERS WATSON PLC	18.68	14.52	337	38,957	金融		
WESTERN DIGITAL CORP	35.31	35.31	231	26,692	情報技術		
WEC ENERGY GROUP INC	41.89	41.89	405	46,818	公益事業		
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	68.77	58.55	387	44,746	公益事業		
VISA INC-CLASS A SHARES	212.64	202.64	4,295	495,426	情報技術		
PPL CORP	101.94	101.94	308	35,543	公益事業		
PULTEGROUP INC	35.56	35.56	188	21,737	一般消費財・サービス		
PPG INDUSTRIES INC	32.34	28.34	470	54,323	素材		
NORTHERN TRUST CORP	22.6	22.6	292	33,691	金融		
NVIDIA CORP	77.62	300.67	8,238	950,212	情報技術		
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	51.6	51.6	1,147	132,392	金融		
TYSON FOODS INC-CL A	33.22	33.22	301	34,779	生活必需品		
NETFLIX INC	55.58	53.01	2,861	330,073	コミュニケーション・サービス		
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	49.85	46.9	2,931	338,112	ヘルスケア		
NRG ENERGY INC	30	30	121	13,972	公益事業		
GLOBE LIFE INC	12.15	12.15	122	14,155	金融		
FIRST REPUBLIC BANK/CA	19.53	21.06	426	49,181	金融		
TEXTRON INC	28.31	28.31	217	25,060	資本財・サービス		
NEWS CORP - CLASS A	37.49	37.49	83	9,612	コミュニケーション・サービス		
OGE ENERGY CORP	24.52	—	—	—	公益事業		
OMNICOM GROUP	25.46	25.46	197	22,834	コミュニケーション・サービス		
ORACLE CORP	257.94	200.74	1,792	206,713	情報技術		
MASTERCARD INC - A	112.66	106.04	3,858	445,085	情報技術		
ONEOK INC	45.66	55.26	335	38,739	エネルギー		
LUMEN TECHNOLOGIES INC	110.62	110.62	150	17,415	コミュニケーション・サービス		
ROPER TECHNOLOGIES INC	12.69	12.69	575	66,396	資本財・サービス		
YUM! BRANDS INC	41.58	36.01	480	55,431	一般消費財・サービス		
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	14.13	14.13	202	23,303	コミュニケーション・サービス		
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	33.74	22.06	108	12,541	生活必需品		
BANK OF AMERICA CORP	980.93	926.34	4,532	522,787	金融		
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4.18	6.22	262	30,223	情報技術		
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	29.08	28.38	239	27,623	ヘルスケア		
AMERICAN EXPRESS CO	88.35	81.72	1,419	163,760	金融		
ANALOG DEVICES INC	48.3	64.8	1,104	127,357	情報技術		
ADVANCED MICRO DEVICES	146.31	146.31	1,931	222,755	情報技術		
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	100.84	100.84	619	71,425	金融		
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22.83	19.4	298	34,479	情報技術		
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	21.47	32.66	261	30,105	一般消費財・サービス		
AVERY DENNISON CORP	11.31	11.31	234	27,063	素材		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等
			評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	65.6	65.6	568	65,584	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	78.46	71.75	683	78,866	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	30.57	27.11	764	88,177	金融
AMGEN INC	73.75	69.99	1,612	185,969	ヘルスケア
EATON CORP PLC	50.56	50.56	841	97,049	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	21.81	20.19	498	57,537	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	119.64	109.56	1,638	189,031	情報技術
CME GROUP INC	45.88	42.9	955	110,243	金融
ECOLAB INC	33.15	31.06	701	80,906	素材
EQUIFAX INC	17.75	14.41	375	43,342	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	158.31	148.98	1,073	123,874	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	45.94	92.36	344	39,745	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	33.15	33.15	165	19,060	生活必需品
STATE STREET CORP	41.52	41.52	420	48,463	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	187.78	173.79	1,592	183,711	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	65.68	60.96	526	60,685	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	21.66	21.66	99	11,452	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	15.97	15.97	173	20,049	素材
CARDINAL HEALTH INC	33.19	33.19	169	19,534	ヘルスケア
FEDEX CORP	31.93	29.79	764	88,150	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	54.87	54.87	862	99,455	金融
FMC CORP	13.6	13.6	146	16,847	素材
CERNER CORP	41.33	41.33	381	43,999	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11.63	30.05	422	48,728	素材
CITRIX SYSTEMS INC	14.12	14.12	137	15,833	情報技術
INTEL CORP	534.49	483.45	2,669	307,857	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	52.31	52.31	195	22,522	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	48.66	48.66	349	40,319	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	40.4	37.68	918	105,973	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	153	153	95	11,047	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	17.87	17.87	647	74,670	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	14.5	14.5	94	10,941	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	15.22	42.55	1,385	159,760	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	13.3	13.3	161	18,578	情報技術
SNAP-ON INC	5	5	108	12,554	資本財・サービス
CARMAX INC	19.9	19.9	236	27,237	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP	89.87	91.33	954	110,143	公益事業
TARGET CORP	64.74	60	1,364	157,383	一般消費財・サービス
DOVER CORP	17.13	17.13	307	35,435	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	5.88	5.88	294	33,916	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17.5	17.5	233	26,956	資本財・サービス
CINTAS CORP	11.62	11.62	463	53,506	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	55.67	55.67	190	21,940	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	15	—	—	—	生活必需品
CLOROX COMPANY	16.28	16.28	292	33,742	生活必需品
ENTERGY CORP	22.43	22.43	250	28,897	公益事業
MICROSOFT CORP	908.49	861.66	27,079	3,123,336	情報技術
INCYTE CORP	26.89	26.89	200	23,155	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	160.17	160.17	1,682	194,087	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	169.39	161.74	1,708	197,035	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	146.66	135.86	1,275	147,126	情報技術
BLACKROCK INC	19.59	18.34	1,601	184,740	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	56.36	56.36	156	18,000	公益事業
HASBRO INC	14.49	14.49	146	16,946	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	36.9	36.9	247	28,506	生活必需品
KEYCORP	117.82	117.82	310	35,780	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	11.76	—	—	—	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	183.59	173.19	1,160	133,897	生活必需品
COOPER COS INC/THE CHUBB LTD	6.47	6.47	269	31,050	ヘルスケア
ARROW ELECTRONICS INC	58.31	54.52	1,083	125,024	金融
ALLSTATE CORP	10	10	131	15,175	情報技術
EBAY INC	39.99	34.77	429	49,544	金融
PAYPAL HOLDINGS INC	93.21	83.08	536	61,873	一般消費財・サービス
EASTMAN CHEMICAL CO	141.1	133.7	2,446	282,126	情報技術
XILINX INC	14.92	14.92	178	20,588	素材
DISH NETWORK CORP-A	28.92	28.92	559	64,544	情報技術
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	29.84	29.84	101	11,684	コミュニケーション・サービス
TRIMBLE INC	27.83	27.83	934	107,817	生活必需品
LENNAR CORP-A	29.38	29.38	231	26,692	情報技術
LEAR CORP	33.94	33.94	353	40,723	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	6	6	111	12,882	一般消費財・サービス
PACCAR INC	73.91	69.8	767	88,558	金融
BIOGEN INC	48.25	41.7	385	44,422	資本財・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	19.48	19.48	458	52,869	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	10.24	10.24	572	65,981	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	148.28	142.74	1,513	174,563	一般消費財・サービス
PTC INC	12	12	137	15,853	情報技術
PERRIGO CO PLC	19.29	—	—	—	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	42.9	42.9	381	44,033	公益事業
INTUIT INC	34.01	32.63	1,860	214,593	情報技術
BORGWARNER INC	30.81	30.81	148	17,075	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	29.87	29.87	306	35,399	一般消費財・サービス
BALL CORP	38.6	38.6	347	40,042	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	184.24	171.49	727	83,885	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	36.77	36.77	473	54,667	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	16.06	16.06	321	37,062	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	32.07	32.07	718	82,841	ヘルスケア
VF CORP	42.16	42.16	299	34,544	一般消費財・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B	72.02	72.02	251	28,998	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	9.42	6.28	108	12,491	一般消費財・サービス

銘柄	期 首		当 期		末 期		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	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			
NUANCE COMMUNICATIONS INC	—	37	203	23,522			情報技術
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10.03	—	—	—			その他
CARNIVAL CORP	49.92	99.86	213	24,648			一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	574.77	548.2	2,769	319,434			コミュニケーション・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	21	—	—	—			その他
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	36	16	92	10,614			資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	231	231	125	14,467			不動産
アメリカ・ドル 株数、金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	39,340.65 591銘柄	38,364.27 606銘柄	496,046	57,213,958	<69.2%>	<69.2%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円			
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	—	100.13	508	46,328			生活必需品
IMPERIAL OIL LTD	23	23	112	10,216			エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2.5	2.5	541	49,283			情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	37.21	37.21	274	25,004			一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	63	63	314	28,604			素材
INTACT FINANCIAL CORP	17	23.79	391	35,632			金融
BCE INC	9	9	59	5,387			コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	22	22	366	33,398			素材
SUNCOR ENERGY INC	218.12	173.48	584	53,263			エネルギー
METRO INC/CN	30	30	201	18,328			生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	39.41	39.41	389	35,456			金融
BANK OF NOVA SCOTIA	150.75	150.75	1,370	124,849			金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	57	57	895	81,538			金融
TORONTO-DOMINION BANK	230.3	217.6	2,170	197,654			金融
GREAT-WEST LIFE CO INC	39	39	148	13,544			金融
ROYAL BANK OF CANADA	182.32	170.86	2,435	221,804			金融
TOURMALINE OIL CORP	—	39	168	15,355			エネルギー
TC ENERGY CORP	113.04	121.44	757	69,008			エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	63.75	63.75	250	22,807			エネルギー
BARRICK GOLD CORP	218.48	218.48	515	46,942			素材
CAE INC	23	23	73	6,711			資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	22.84	22.84	321	29,279			資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	18	18	69	6,302			生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	10.34	120	11,007			素材
BALLARD POWER SYSTEMS INC	—	32.06	45	4,120			資本財・サービス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	15.6	15.6	102	9,292			素材
HYDRO ONE LTD	48	48	151	13,797			公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	24.89	24.89	252	23,030			生活必需品
NORTHLAND POWER INC	—	30.03	107	9,753			公益事業
WSP GLOBAL INC	12	12	207	18,873			資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	—	9.74	106	9,745			資本財・サービス
PARKLAND CORP	28	28	98	8,953			エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	23	23	67	6,163			コミュニケーション・サービス
EMERA INC	27.31	27.31	165	15,091			公益事業
TFI INTERNATIONAL INC	—	11	137	12,545			資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	10	35	3,226			公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	56	43.06	266	24,229			コミュニケーション・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	—	142.61	158	14,469			素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	29	29	189	17,266			素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	70	70	124	11,316			公益事業
B2GOLD CORP	164	—	—	—			素材
AIR CANADA	17	17	38	3,480			資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	147.57	147.57	103	9,462			素材
BANK OF MONTREAL	82	78.55	1,123	102,342			金融
POWER CORP OF CANADA	63	63	265	24,185			金融
SHOPIFY INC - CLASS A	14.44	13.56	1,944	177,091			情報技術
NUTRIEN LTD	80.27	69.06	600	54,685			素材
CANOPY GROWTH CORP	20	20	22	2,021			ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	31.93	31.93	164	14,971			素材
TOPICUS.COM INC-SUB VOTING	4.64	—	—	—			情報技術
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	—	15.32	66	6,073			公益事業
CAMECO CORP	28	28	82	7,510			エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	4.22	4.22	92	8,401			不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	—	24.05	105	9,589			資本財・サービス
LIGHTSPEED COMMERCE INC	—	15.6	71	6,494			情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	—	10	79	7,236			情報技術
TELUS CORP	6	6	17	1,611			コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	44	44	173	15,837			素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	7.43	7.43	135	12,304			一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	152	152	906	82,580			エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3	3	189	17,243			金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	31	36.93	399	36,387			一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	9.01	9.01	128	11,741			生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	43.08	12.18	35	3,233			素材
BLACKBERRY LTD	64	64	71	6,522			情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	72.66	72.66	515	46,920			金融
ENBRIDGE INC	267	246.95	1,275	116,127			エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	180	172.13	1,236	112,612			金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	266	221.84	568	51,785			金融
BAUSCH HEALTH COS INC	43	43	143	13,100			ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	18	114.36	1,098	100,086			資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	11	11	85	7,742			金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	28	28	147	13,434			一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	87.93	87.93	1,366	124,422			資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	28	28	295	26,912			情報技術
ONEX CORPORATION	16	16	153	13,998			金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	68	68	259	23,627			コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	3	3	13	1,274			金融
TMX GROUP LTD	7.94	7.94	98	8,961			金融

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
OPEN TEXT CORP	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	情報技術
CI FINANCIAL CORP	45	32.1	187	17,071	金融
SAPUTO INC	20	—	—	—	金融
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	29	29	86	7,879	生活必需品
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	63	63	195	17,787	素材
YAMANA GOLD INC	100.13	—	—	—	生活必需品
FORTIS INC	119	—	—	—	素材
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	62	62	366	33,418	公益事業
LUNDIN MINING CORP	13.55	13.55	103	9,441	資本財・サービス
CENOVUS ENERGY INC	66	66	65	5,993	素材
DOLLARAMA INC	141	141	242	22,114	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	35.29	35.29	218	19,863	一般消費財・サービス
ALTAGAS LTD	8	—	—	—	公益事業
KEYERA CORP	47	47	125	11,459	公益事業
INTER PIPELINE LTD	22	22	63	5,790	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	48	—	—	—	エネルギー
カナダ・ドル 株数、金額	4,855.61	4,736.04	30,988	2,822,425	
通貨計 銘柄数<比率>	82銘柄	87銘柄	<3.4%>	<3.4%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
MEDIBANK PRIVATE LTD	228.24	228.24	81	6,719	金融
BHP GROUP LTD	365.48	365.48	1,636	135,724	素材
SOUTH32 LTD	563.87	563.87	228	18,985	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	156.53	105.76	245	20,374	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	205.54	205.54	424	35,181	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	421.03	419.83	1,233	102,325	金融
WESTPAC BANKING CORP	442.7	442.7	966	80,144	金融
SANTOS LTD	182.7	291.53	199	16,536	エネルギー
AUSNET SERVICES	285	285	72	6,050	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	351.9	351.9	998	82,792	金融
RIO TINTO LTD	41.69	41.69	441	36,644	素材
ORIGIN ENERGY LTD	209.68	209.68	115	9,581	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD	290.47	290.47	105	8,768	資本財・サービス
XERO LTD	6.32	14.26	181	15,045	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	9.53	9.53	28	2,376	エネルギー
COLES GROUP LTD	166.96	166.96	285	23,635	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	25.09	25.09	136	11,325	情報技術
IDP EDUCATION LTD	—	26.19	85	7,121	一般消費財・サービス
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	81.83	148.32	132	10,971	素材
EVOLUTION MINING LTD	170.17	170.17	63	5,306	素材
AFTERPAY LTD	30	30	216	17,985	情報技術
TPG TELECOM LTD	50	—	—	—	コミュニケーション・サービス
REECE LTD	—	63.58	169	14,035	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	—	139.06	91	7,622	生活必需品
OIL SEARCH LTD	173.45	—	—	—	エネルギー
SEEK LTD	26	26	79	6,587	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	101.73	101.73	126	10,461	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	119.81	119.81	287	23,855	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	218.56	218.56	2,258	187,269	金融
AMPOL LTD	20	20	60	4,977	エネルギー
ORICA LTD	58.45	58.45	78	6,514	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	153.48	153.48	186	15,502	金融
CIMIC GROUP LTD	10	—	—	—	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	169.8	157.79	585	48,547	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	26	—	—	—	その他
TABCORP HOLDINGS LTD	173.52	173.52	88	7,338	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	30	30	35	2,910	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	63.73	63.73	32	2,700	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	351.14	351.14	145	12,055	コミュニケーション・サービス
AMP LTD	249.35	—	—	—	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	67.33	58.26	296	24,587	素材
MACQUARIE GROUP LTD	42.77	42.77	889	73,768	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	61.63	64.62	283	23,536	一般消費財・サービス
CSL LTD	55.5	55.5	1,554	128,873	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	137.98	137.98	788	65,360	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	8.05	8.05	167	13,852	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	70.92	70.92	153	12,697	素材
SUNCORP GROUP LTD	145.04	145.04	167	13,904	金融
ASX LTD	22.6	22.6	204	16,956	金融
COMPUTERSHARE LTD	60.54	60.54	126	10,493	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	270.97	120	9,977	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	52.23	52.23	231	19,209	ヘルスケア
AGL ENERGY LTD	84.66	—	—	—	公益事業
BRAMBLES LTD	183.37	183.37	193	16,043	資本財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20.64	20.64	138	11,511	ヘルスケア
REA GROUP LTD	6.08	6.08	96	7,999	コミュニケーション・サービス
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15.51	15.51	31	2,648	金融
DOMINOS PIZZA ENTERPRISES LTD	—	12.88	145	12,061	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル 株数、金額	7,535.57	7,297.02	17,695	1,467,459	
通貨計 銘柄数<比率>	54銘柄	52銘柄	<1.8%>	<1.8%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	235	235	1,144	16,926	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	230	230	932	13,793	一般消費財・サービス
MTR CORP	165	165	705	10,432	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	190	160	1,520	22,480	不動産
SINO LAND CO	340	340	331	4,902	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	375.52	375.52	2,029	30,019	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	80	80	367	5,430	不動産
CLP HOLDINGS LTD	170	170	1,323	19,573	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	205.65	205.65	678	10,037	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,638.36	1,720.27	2,081	30,785	公益事業
HANG SENG BANK LTD	80	80	1,236	18,292	金融

銘柄	期 首		当		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
NEW WORLD DEVELOPMENT	百株	百株	千香港ドル	千円			不動産
WH GROUP LTD	175	175	529	7,829			生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,695	1,695	889	13,161			金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	149	149	6,827	100,973			金融
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	370	370	596	8,821			不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	30	—	—	—			情報技術
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	86	—	—	—			金融
SJM HOLDINGS LTD	—	260	494	7,306			資本財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	100	—	—	—			一般消費財・サービス
CK ASSET HOLDINGS LTD	80	80	162	2,407			不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	285.52	285.52	1,413	20,903			不動産
PCCW LTD	55	55	268	3,973			公益事業
AIA GROUP LTD	600	—	—	—			コミュニケーション・サービス
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1,594	1,500	12,000	177,480			金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	—	220	642	9,501			資本財・サービス
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	200	200	775	11,462			不動産
ESR CAYMAN LTD	192	192	403	5,963			生活必需品
SANDS CHINA LTD	180	180	481	7,121			不動産
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	290	290	500	7,402			一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	—	350	446	6,605			一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	190	170	2,363	34,948			資本財・サービス
WYNN MACAU LTD	450	450	1,291	19,101			金融
香港・ドル 株数、金額	10,599.05	10,382.96	42,436	627,638			一般消費財・サービス
通 貨 計 銘柄数<比率>	30銘柄	28銘柄	<0.8%>	<0.8%>			
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円			
CAPITALAND INVESTMENT LTD	—	334	118	10,121			不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD	179	159	463	39,465			金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	233	213	746	63,583			金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	177.5	177.5	88	7,569			資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	173	173	88	7,495			資本財・サービス
UOL GROUP LTD	30	30	21	1,792			不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	52	35	3,023			不動産
CAPITALAND LTD	334	—	—	—			不動産
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	447	447	540	46,038			金融
GENTING SINGAPORE LTD	450	450	34	2,949			一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	32	32	57	4,902			情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,284	1,284	299	25,465			コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	141	52	4,488			資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	168	118	113	9,692			金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	158	67	5,783			生活必需品
シンガポール・ドル 株数、金額	3,858.5	3,768.5	2,729	232,372			
通 貨 計 銘柄数<比率>	14銘柄	14銘柄	<0.3%>	<0.3%>			
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円			
MERIDIAN ENERGY LTD	150	150	69	5,411			公益事業
MERCURY NZ LTD	32.94	32.94	20	1,584			公益事業
A2 MILK CO LTD	70	—	—	—			生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	168.6	168.6	75	5,885			コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	132.89	132.89	101	7,938			資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORP	92	92	295	23,075			ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	44.19	44.19	52	4,127			ヘルスケア
ニュージーランド・ドル 株数、金額	690.62	620.62	614	48,023			
通 貨 計 銘柄数<比率>	7銘柄	6銘柄	<0.1%>	<0.1%>			
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円			
BP PLC	2,510.81	2,510.81	911	142,776			エネルギー
UNILEVER PLC	337.93	314.26	1,246	195,241			生活必需品
BARCLAYS PLC	2,413.6	2,037.15	423	66,336			金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	768.95	1,031.03	131	20,615			資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	314.21	314.21	407	63,782			金融
NATWEST GROUP PLC	508.36	823.39	203	31,854			金融
EVRAZ PLC	74.41	74.41	44	6,929			素材
JOHNSON MATTHEY PLC	17.58	17.58	36	5,653			素材
BAE SYSTEMS PLC	377.96	377.96	216	33,862			資本財・サービス
AVIVA PLC	510.81	510.81	221	34,715			金融
AVEVA GROUP PLC	11.4	11.4	34	5,387			情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC	629.03	605.42	975	152,804			ヘルスケア
INFORMA PLC	162	162	87	13,661			コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	643.35	579.01	98	15,381			資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	144.99	144.99	100	15,787			コミュニケーション・サービス
DCC PLC	9.38	9.38	57	9,041			資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	62.34	62.34	96	15,110			生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7.4	7.4	105	16,476			資本財・サービス
HALMA PLC	39.78	39.78	112	17,589			情報技術
ENTAIN PLC	88.05	73.37	122	19,151			一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	64.11	320.55	68	10,684			一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	108.88	72	11,419			金融
M&G PLC	259.64	259.64	53	8,430			金融
RELX PLC	242.03	242.03	529	82,945			資本財・サービス
DIAGEO PLC	293.51	279.1	1,074	168,238			生活必需品
RIO TINTO PLC	145.2	136.27	708	111,031			素材
STANDARD CHARTERED PLC	319.51	319.51	157	24,647			金融
TESCO PLC	1,344.91	867.91	253	39,755			生活必需品
FRESNILLIO PLC	39.07	—	—	—			素材
SMITH & NEPHEW PLC	112.97	112.97	149	23,365			ヘルスケア
GLENCORE PLC	1,292.26	1,292.26	502	78,726			素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	32	44	6,971			金融
SMITHS GROUP PLC	40.8	40.8	64	10,180			資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	168.79	—	—	—			金融
PEARSON PLC	82.71	82.71	49	7,744			コミュニケーション・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期 首		当		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千円	千円			
SAINSBURY (J) PLC	176.31	176.31	49	7,707	生活必需品		
NEXT PLC	16.85	16.85	128	20,200	一般消費財・サービス		
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	322.36	53	8,429	一般消費財・サービス		
WHITBREAD PLC	17.85	17.85	56	8,840	一般消費財・サービス		
BUNZL PLC	31.59	31.59	85	13,339	資本財・サービス		
VODAFONE GROUP PLC	3,591.29	3,635.21	426	66,879	コミュニケーション・サービス		
CRODA INTERNATIONAL PLC	17.49	17.49	158	24,748	素材		
KINGFISHER PLC	172.29	172.29	58	9,164	一般消費財・サービス		
WPP PLC	130.21	130.21	150	23,555	コミュニケーション・サービス		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	82.44	86	13,622	公益事業		
SEVERN TRENT PLC	43	33.27	95	14,914	公益事業		
RENTOKIL INITIAL PLC	222.42	222.42	118	18,533	資本財・サービス		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	91.11	86.77	548	85,907	生活必需品		
ST JAMES'S PLACE PLC	48.83	48.83	80	12,623	金融		
SCHRODERS PLC	12.27	12.27	43	6,759	金融		
SSE PLC	124.6	124.6	204	31,977	公益事業		
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	123.68	86	13,552	一般消費財・サービス		
ASTRAZENECA PLC	166.08	186.18	1,551	243,030	ヘルスケア		
FERGUSON PLC	27.24	27.24	336	52,713	資本財・サービス		
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	682.32	682.32	208	32,638	金融		
3I GROUP PLC	132.93	132.93	187	29,440	金融		
ASHTED GROUP PLC	59.21	59.21	337	52,862	資本財・サービス		
SAGE GROUP PLC/THE	115.48	115.48	93	14,600	情報技術		
NATIONAL GRID PLC	451.05	451.05	475	74,420	公益事業		
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,652.13	8,652.13	456	71,567	金融		
RSA INSURANCE GROUP LTD	125.86	—	—	—	その他		
IMPERIAL BRANDS PLC	137.85	108.06	179	28,163	生活必需品		
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	19.63	18.12	83	13,027	一般消費財・サービス		
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	286.95	258.15	740	116,005	生活必需品		
BHP GROUP PLC	269.34	269.34	608	95,384	素材		
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	49.64	49.64	103	16,180	生活必需品		
HSBC HOLDINGS PLC	2,560.05	2,448.46	1,204	188,683	金融		
ANGLO AMERICAN PLC	146.45	168.85	547	85,741	素材		
MONDI PLC	59.21	59.21	110	17,333	素材		
WM MORRISON SUPERMARKETS	391.67	—	—	—	生活必需品		
COMPASS GROUP PLC	219.92	219.92	373	58,523	一般消費財・サービス		
PERSIMMON PLC	49.69	26.88	71	11,157	一般消費財・サービス		
BT GROUP PLC	1,317.54	1,027.57	182	28,616	コミュニケーション・サービス		
COCA-COLA HBC AG-DI	25.74	25.74	68	10,768	生活必需品		
BURBERRY GROUP PLC	51.36	51.36	89	14,037	一般消費財・サービス		
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	21.82	22.68	111	17,527	一般消費財・サービス		
INTERTEK GROUP PLC	18.97	18.97	104	16,330	資本財・サービス		
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	37.5	37.5	268	42,125	金融		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	495.26	518.12	896	140,443	エネルギー		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	482.46	446.23	772	120,970	エネルギー		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	20.39	20.39	42	6,716	ヘルスケア		
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	15.7	48	7,571	金融		
ANTOFAGASTA PLC	34.6	34.6	46	7,291	素材		
ABRDN PLC	330.46	330.46	79	12,494	金融		
EXPERIAN PLC	121.19	113.47	366	57,388	資本財・サービス		
イギリス・債券	株数・金額	株数・金額	株数・金額	株数・金額	株数・金額	株数・金額	
通 貨 計	84銘柄	81銘柄	22,542	3,530,810	< 4.3% >		
(イスラエル)	百株	百株	千円	千円			
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	120	120	261	9,621	金融		
AZRIELI GROUP LTD	5.3	5.3	154	5,678	不動産		
ICL GROUP LTD	110.96	110.96	361	13,280	素材		
ELBIT SYSTEMS LTD	3	3	163	6,007	資本財・サービス		
BANK HAPOLIM BM	151.6	151.6	507	18,679	金融		
BANK LEUMI LE-ISRAEL	190.43	190.43	648	23,856	金融		
NICE LTD	8	8	679	24,981	情報技術		
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	38.83	18.83	234	8,608	金融		
イスラエル・シケル	株数・金額	株数・金額	株数・金額	株数・金額	株数・金額	株数・金額	
通 貨 計	8銘柄	8銘柄	3,010	110,715	< 0.1% >		
(スイス)	百株	百株	千円	千円			
UBS GROUP AG-REG	464.78	425.54	756	94,160	金融		
ROCHE HOLDING AG-BR	—	2.8	112	13,973	ヘルスケア		
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1.3	1.3	125	15,571	素材		
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	17.54	83	10,414	資本財・サービス		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	88.76	83.88	3,113	387,490	ヘルスケア		
SIKA AG-REG	16.9	16.9	575	71,572	素材		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	0.01	113	14,137	生活必需品		
ABB LTD-REG	221.39	210.74	712	88,645	資本財・サービス		
SWISS RE AG	36.66	36.66	348	43,342	金融		
NESTLE SA-REG	360.55	342.92	4,180	520,225	生活必需品		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2.34	2.87	380	47,343	金融		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5.31	4.89	114	14,228	資本財・サービス		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	301.22	301.22	283	35,245	金融		
JULIUS BAER GROUP LTD	26.84	26.84	166	20,776	金融		
SGS SA-REG	0.65	0.65	189	23,580	資本財・サービス		
SCHINDLER HOLDING AG-REG	4.67	4.67	108	13,448	資本財・サービス		
VIFOR PHARMA AG	6.65	6.65	109	13,572	ヘルスケア		
TEMENOS AG - REG	7.93	7.93	92	11,566	情報技術		
VAT GROUP AG	—	3.39	134	16,731	資本財・サービス		
ALCON INC	58.53	58.53	417	51,979	ヘルスケア		
SWATCH GROUP AG/THE-BR	5	5	147	18,399	一般消費財・サービス		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	17.92	17.92	758	94,424	金融		
BALOISE HOLDING AG - REG	6.11	6.11	97	12,074	金融		
CLARIANT AG-REG	15.68	15.68	29	3,722	素材		
NOVARTIS AG-REG	278.51	269.42	2,219	276,248	ヘルスケア		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.56	0.56	122	15,262	生活必需品		

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
株数		株数	千円	千円	
BACHEM HOLDING AG-REG B	—	0.78	43	5,426	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	67.1	60.87	807	100,523	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	2.76	2.76	143	17,847	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	7.84	—	—	—	金融
GEBERIT AG-REG	4.56	4.56	312	38,873	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	1.13	1.13	497	61,946	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1.11	1.11	186	23,221	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	6.72	6.72	216	26,970	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	21.65	21.65	160	20,024	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	9.13	9.13	618	76,968	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	4.5	25	3,183	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD	65.87	65.87	320	39,930	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3.81	3.81	226	28,136	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	6.4	6.4	174	21,704	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	9.46	82	10,254	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.17	0.14	162	20,210	生活必需品
スイス・フラン 通 貨 計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,158.02 39銘柄	2,069.51 41銘柄	19,472 2,423,357 < 2.9%>	
(デンマーク)	株数	株数	千デンマーク・ クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	236.71	213.44	13,986	245,746	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	72.36	72.36	870	15,294	金融
AP MOLLER-MÆRSK A/S-A	0.39	0.39	841	14,787	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	5	—	—	—	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	25.57	127.85	2,305	40,501	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S	11.59	11.59	436	7,662	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B	12.32	12.32	1,402	24,644	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	29.81	29.81	1,449	25,475	素材
COLOPLAST-B	15.19	15.19	1,557	27,369	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	27.98	25.8	3,560	62,556	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	1.43	1.43	369	6,499	資本財・サービス
DEMAND A/S	13.14	13.14	424	7,459	ヘルスケア
AP MOLLER-MÆRSK A/S-B	0.66	0.66	1,537	27,019	資本財・サービス
TRYG A/S	17	45.94	751	13,197	金融
PANDORA A/S	16.37	13.25	1,023	17,977	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	12.62	12.62	642	11,281	素材
GENMAB A/S	9.19	9.19	2,170	38,138	ヘルスケア
ORSTED A/S	28.37	22.46	1,657	29,123	公益事業
AMBU A/S-B	20.91	20.91	318	5,593	ヘルスケア
デンマーク・クローネ 通 貨 計	株数・金額 銘柄数<比率>	556.61 19銘柄	648.35 18銘柄	35,306 620,328 < 0.8%>	
(ノルウェー)	株数	株数	千ノルウェー・ クローネ	千円	
DNB BANK	—	128.38	2,688	34,974	金融
NORSK HYDRO ASA	130.5	130.5	910	11,850	素材
DNB	128.38	—	—	—	金融
ORKLA ASA	74.83	74.83	648	8,432	生活必需品
TELENOR ASA	87.46	87.46	1,232	16,038	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	142.48	122.6	2,987	38,870	エネルギー
SCHIBSTED ASA-CL A	—	9.17	285	3,710	コミュニケーション・サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	27.56	27.56	1,242	16,170	素材
MOWI ASA	46.77	46.77	939	12,224	生活必需品
GEJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	20	435	5,669	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	17	17	475	6,188	コミュニケーション・サービス
AKER BP ASA	—	13.55	378	4,927	エネルギー
ADEVINTA ASA	45.82	45.82	509	6,631	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ 通 貨 計	株数・金額 銘柄数<比率>	720.8 10銘柄	723.64 12銘柄	12,735 165,689 < 0.2%>	
(スウェーデン)	株数	株数	千スウェーデン・ クローネ	千円	
SAGAX CLASS B	—	20.2	537	6,812	不動産
INVESTOR CLASS A	—	62.56	1,415	17,929	金融
ICA GRUPPEN AB	26	12.97	696	8,827	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	445.95	384.64	3,896	49,367	情報技術
VOLVO AB-B SHS	188.73	188.73	4,030	51,064	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES	40	40	885	11,220	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	26	26	553	7,013	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	21.88	21.88	1,619	20,514	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	70.26	70.26	890	11,278	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS	—	28.69	996	12,628	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	217.79	217.79	2,757	34,933	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	241.45	154.82	1,563	19,811	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	108.21	108.21	1,985	25,158	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	103.52	103.52	1,831	23,210	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	82.01	82.01	1,324	16,780	素材
SKANSKA AB-B SHS	37.09	37.09	864	10,949	資本財・サービス
SANDVIK AB	146.57	146.57	3,664	46,426	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	62.9	219.28	4,797	60,788	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	85.75	85.75	5,036	63,818	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS	—	39.23	845	10,706	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	25	25	306	3,878	資本財・サービス
TELIA CO AB	364.21	364.21	1,302	16,508	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	48.4	48.4	1,637	20,751	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	48.13	48.13	2,414	30,587	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	144.49	126.35	3,352	42,470	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	29	16.38	476	6,030	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	19	13.19	772	9,789	不動産
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	9.48	458	5,814	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	9.24	9.24	300	3,804	資本財・サービス

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等
			評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ・ クロネ	千円	
LIFCO AB-B SHS	—	29.24	652	8,268	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	41.79	167.16	1,834	23,244	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB	19	19	647	8,208	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	72.6	72.6	2,090	26,482	生活必需品
EMBRACER GROUP AB	—	70.9	619	7,847	コミュニケーション・サービス
BOLIDEN AB	31.71	31.71	1,156	14,652	素材
EPIROC AB-A	121.82	86.6	1,909	24,193	資本財・サービス
EPIROC AB-B	40.15	40.15	739	9,372	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS	114	54	742	9,407	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP	435.48	406.44	4,582	58,056	金融
EQT AB	38.45	29.6	1,267	16,062	金融
EVOLUTION AB	20.64	20.64	2,384	30,209	一般消費財・サービス
SINCH AB	—	64	638	8,089	情報技術
KINNEVIK AB - B	36.41	36.41	1,040	13,179	金融
HEXAGON AB-B SHS	38.68	270.76	3,542	44,888	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13	13	371	4,707	金融
スウェーデン・クロネ 通 貨 計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,624.79 38銘柄	4,319.71 45銘柄	75,434 955,749	< 1.2%>
ユーロ (アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	30.55	30.55	149	19,597	素材
KINGSPAN GROUP PLC	16	20.88	200	26,204	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A	18.22	18.22	211	27,635	生活必需品
CRH PLC	105.17	92	425	55,612	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	22.04	17.85	238	31,215	一般消費財・サービス
国 小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	191.98 5銘柄	179.5 5銘柄	1,226 160,265	< 0.2%>
ユーロ (オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	—	89.3	205	26,896	コミュニケーション・サービス
QIAGEN N.V.	25.21	25.21	110	14,418	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	114.2	114.2	380	49,718	ヘルスケア
NN GROUP NV	31	31	155	20,339	金融
HEINEKEN NV	37.11	31.23	315	41,205	生活必需品
AEGON NV	380.61	179.67	87	11,433	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	138.93	121.3	370	48,401	生活必需品
AKZO NOBEL N.V.	25.04	25.04	240	31,385	素材
KONINKLIJKE DSM NV	22.3	22.3	404	52,871	素材
WOLTERS KLUWER	33	33	314	41,069	資本財・サービス
ING GROEP NV	456.01	456.01	596	77,993	金融
KONINKLIJKE KPN NV	376.07	376.07	103	13,566	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV	53.27	49.16	3,059	399,840	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA	90.53	40.3	56	7,394	金融
IMCD NV	—	7.15	115	15,106	資本財・サービス
ADYEN NV	2.15	2.25	442	57,803	情報技術
JUST EAT TAKEAWAY	14	23.81	100	13,179	一般消費財・サービス
PROSUS NV	59.99	112.99	797	104,290	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV	—	14.76	40	5,330	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV	—	6.02	204	26,783	情報技術
VOPAK	6.3	—	—	—	エネルギー
RANDSTAD NV	20.2	20.2	121	15,935	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	12.85	12.85	106	13,872	生活必需品
ALTICE EUROPE NV	112.95	—	—	—	その他
EURONEXT NV	—	15	127	16,683	金融
STMICROELECTRONICS NV	85.75	85.75	363	47,553	情報技術
AIRBUS SE	74.02	69.81	823	107,592	資本財・サービス
ARGENX SE	5.16	5.16	137	17,939	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	85	85	102	13,448	生活必需品
EXOR NV	10.88	10.88	81	10,702	金融
CNH INDUSTRIAL NV	116.91	116.91	163	21,361	資本財・サービス
STELLANTIS NV	169.37	248.03	443	57,910	一般消費財・サービス
FERRARI NV	17.22	17.22	380	49,739	一般消費財・サービス
国 小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,576.03 28銘柄	2,447.58 31銘柄	10,954 1,431,766	< 1.7%>
ユーロ (ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
GALAPAGOS NV	5.57	—	—	—	ヘルスケア
UCB SA	19.21	19.21	178	23,395	ヘルスケア
KBC GROUP NV	30.11	30.11	240	31,467	金融
COLRUYT SA	3.5	3.5	13	1,722	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11.39	11.39	111	14,541	金融
SOLVAY SA	8.73	8.73	92	12,077	素材
UMICORE	22.7	22.7	80	10,562	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	98.76	89.26	506	66,182	生活必需品
AGEAS	16.54	16.54	81	10,631	金融
PROXIMUS	22.69	22.69	39	5,149	コミュニケーション・サービス
ELIA GROUP SA/NV	7	7	77	10,109	公益事業
SOFINA	2.39	2.39	95	12,519	金融
国 小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	248.59 12銘柄	233.52 11銘柄	1,517 198,359	< 0.2%>
ユーロ (ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AROUNDTOWN SA	160.64	160.64	87	11,413	不動産
ARCELORMITTAL	80.31	80.31	242	31,688	素材
INPOST SA	—	31.82	26	3,433	資本財・サービス
EUROFINS SCIENTIFIC	14.8	14.8	139	18,213	ヘルスケア
SES	44.02	—	—	—	コミュニケーション・サービス
TENARIS SA	47	47	45	5,988	エネルギー
国 小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	346.77 5銘柄	334.57 5銘柄	541 70,737	< 0.1%>
ユーロ (フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TOTALENERGIES SE	307.62	299.62	1,400	183,035	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	21.46	21.46	327	42,773	一般消費財・サービス

銘柄	期 首		当		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円			
AIR LIQUIDE SA	61.19	57.59	898	117,481	素材		
KERING	9.77	8.88	616	80,558	一般消費財・サービス		
SCHNEIDER ELECTRIC SE	67.45	63.38	1,018	133,120	資本財・サービス		
BOUYGUES SA	27.21	27.21	87	11,487	資本財・サービス		
BNP PARIBAS	134	134	857	112,088	金融		
PEUGEOT SA	64.97	—	—	—	その他		
NATIXIS	76.74	—	—	—	金融		
THALES SA	14.04	14.04	110	14,456	資本財・サービス		
DANONE	75.51	75.51	429	56,155	生活必需品		
CARREFOUR SA	80.22	80.22	141	18,526	生活必需品		
SUEZ	29.5	29.5	58	7,665	公益事業		
VIVENDI	104.3	89.3	105	13,760	コミュニケーション・サービス		
L'OREAL	32.05	29.56	1,166	152,472	生活必需品		
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	69.75	69.75	443	57,979	資本財・サービス		
LEGRAND SA	41.19	34.59	340	44,449	資本財・サービス		
PERNOD RICARD SA	27.44	25.44	519	67,963	生活必需品		
EURAZEO SE	5.6	5.6	43	5,665	金融		
SOCIETE GENERALE SA	110.65	110.65	365	47,746	金融		
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	34.42	33.37	2,344	306,479	一般消費財・サービス		
ACCOR SA	18.5	18.5	56	7,437	一般消費財・サービス		
CAPGEMINI SE	19.81	19.81	385	50,346	情報技術		
VALEO SA	37.03	37.03	99	12,990	一般消費財・サービス		
PUBLICIS GROUPE	29.18	29.18	173	22,684	コミュニケーション・サービス		
BUREAU VERITAS SA	32.27	32.27	88	11,569	資本財・サービス		
EIFAGE	9.45	9.45	86	11,321	資本財・サービス		
SODEXO SA	12.48	12.48	100	13,156	一般消費財・サービス		
IPSEN	2.76	2.76	22	2,958	ヘルスケア		
ORPEA	5.24	5.24	45	5,969	ヘルスケア		
AMUNDI SA	4.37	4.37	31	4,120	金融		
TELEPERFORMANCE	8.7	7.01	254	33,322	資本財・サービス		
UBISOFT ENTERTAINMENT	9.77	9.77	41	5,460	コミュニケーション・サービス		
FAURECIA	5.6	10.41	45	5,974	一般消費財・サービス		
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3.99	3.99	157	20,567	ヘルスケア		
SEB SA	1.97	2.16	29	3,856	一般消費財・サービス		
ESSILORLUXOTTICA	38.09	35.06	611	79,897	一般消費財・サービス		
DASSAULT AVIATION SA	0.22	2.2	22	2,990	資本財・サービス		
WORLDLINE SA	31.35	31.35	152	19,958	情報技術		
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	22.16	8.78	33	4,414	一般消費財・サービス		
AXA SA	243.18	243.18	666	87,103	金融		
EDENRED	30.07	30.07	129	16,946	情報技術		
RENAULT SA	25.54	25.54	86	11,357	一般消費財・サービス		
HERMES INTERNATIONAL	4.51	4.05	556	72,730	一般消費財・サービス		
REMY COINTREAU	2.53	2.53	50	6,613	生活必需品		
ATOS SE	9.46	—	—	—	情報技術		
DASSAULT SYSTEMES SE	16.33	81.65	380	49,708	情報技術		
WENDEL	2.01	5.55	57	7,580	金融		
ORANGE	257.92	257.92	248	32,459	コミュニケーション・サービス		
ALSTOM	29.61	51.06	168	22,069	資本財・サービス		
CNP ASSURANCES	13.49	13.49	29	3,840	金融		
SANOFI	142.91	133.26	1,184	154,750	ヘルスケア		
VINCI SA	69.25	64.38	607	79,398	資本財・サービス		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	73.51	73.51	237	31,100	公益事業		
CREDIT AGRICOLE SA	146.09	146.09	197	25,830	金融		
BIOMERIEUX	4.57	4.57	48	6,382	ヘルスケア		
ENGIE	210.99	210.99	281	36,770	公益事業		
EDF	67.6	67.6	68	8,985	公益事業		
SAFRAN SA	43.81	39.31	442	57,872	資本財・サービス		
ILIAD SA	2.19	—	—	—	コミュニケーション・サービス		
ARKEMA	8.38	8.38	107	14,112	素材		
ADP	3.5	3.5	42	5,610	資本財・サービス		
SCOR SE	32.89	—	—	—	金融		
GETLINK SE	49.73	49.73	71	9,346	資本財・サービス		
BOLLORE	73	73	35	4,594	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>	3,251.09 65銘柄	3,080.85 60銘柄	19,418	2,538,026 < 3.1%>		
ユーロ (ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	—	50.55	169	22,126	資本財・サービス		
BAYER AG-REG	125.53	115.83	579	75,755	ヘルスケア		
EVONIK INDUSTRIES AG	18	18	51	6,770	素材		
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	255.58	255.58	316	41,334	金融		
COMMERZBANK AG	96.89	96.89	74	9,747	金融		
VOLKSWAGEN AG	4.2	4.2	113	14,854	一般消費財・サービス		
VOLKSWAGEN AG-PREF	22.72	22.72	426	55,755	一般消費財・サービス		
SIEMENS AG-REG	94.65	90.95	1,344	175,787	資本財・サービス		
E.ON SE	300.06	300.06	354	46,363	公益事業		
UNIPER SE	20.66	20.66	84	10,984	公益事業		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	37.29	37.29	362	47,373	一般消費財・サービス		
GEA GROUP AG	13	13	58	7,594	資本財・サービス		
CONTINENTAL AG	14.74	14.74	141	18,523	一般消費財・サービス		
BASF SE	112.83	112.83	745	97,462	素材		
ALLIANZ SE-REG	53.92	50.14	1,120	146,400	金融		
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	26.83	21.41	161	21,138	生活必需品		
RWE AG	75.26	75.26	260	34,063	公益事業		
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	17	17	12	1,614	資本財・サービス		
BRENNTAG SE	21.21	21.21	160	20,935	資本財・サービス		
FRESenius SE & CO KGAA	48.35	48.35	176	23,100	ヘルスケア		
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9.59	9.59	33	4,353	コミュニケーション・サービス		
HOCHTIEF AG	1.66	—	—	—	資本財・サービス		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等
			評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円	
SAP SE	130.66	122.83	1,483	193,834	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	17.04	17.04	464	60,655	金融
ZALANDO SE	20.25	28.56	184	24,076	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	21.28	21.28	132	17,316	素材
KION GROUP AG	6	6	55	7,289	資本財・サービス
COVESTRO AG	19.45	19.45	109	14,301	素材
RATIONAL AG	—	0.74	59	7,791	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	5.13	3.88	191	25,092	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HDG-PRF	21.02	21.02	187	24,456	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	19.79	21.48	176	23,004	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	5.6	5.6	89	11,674	ヘルスケア
BECHTLE AG	2.73	8.19	46	6,092	情報技術
NEMETSCHEK SE	11.39	11.39	101	13,243	情報技術
SCOUT24 AG	14.6	14.6	87	11,449	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	40.38	28.94	176	23,065	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	5.49	13.57	119	15,565	資本財・サービス
HELLOFRESH SE	18.14	18.14	102	13,433	生活必需品
TEAMVIEWER AG	14.61	—	—	—	情報技術
SIEMENS ENERGY AG	47.32	47.32	104	13,637	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	12.75	12.75	113	14,801	生活必需品
FUCHS PETROLUB PREF	7	7	27	3,615	素材
MERCK KGAA	16.92	16.92	335	43,819	ヘルスケア
ADIDAS AG	23.85	21.88	534	69,848	一般消費財・サービス
PUMA SE	12.95	12.95	125	16,444	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	13.11	13.11	93	12,268	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	418.6	411.35	638	83,483	コミュニケーション・サービス
FRESNIUS MEDICAL CARE AG & DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	25.61	25.61	147	19,300	ヘルスケア
INFINEON TECHNOLOGIES AG	110.27	101.1	738	96,526	一般消費財・サービス
HANNOVER RUECK SE	164.97	155.1	597	78,126	情報技術
DEUTSCHE POST AG-REG	6.44	6.44	112	14,675	金融
DEUTSCHE BOERSE AG	131.16	116.91	625	81,764	資本財・サービス
LANXESS AG	24.04	24.04	352	46,124	金融
MTU AERO ENGINES AG	15.29	15.29	87	11,470	素材
DEUTSCHE WOHNEN SE	6.66	6.66	128	16,756	資本財・サービス
SYMRISE AG	47.96	—	—	—	不動産
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16.56	16.56	199	26,113	素材
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	62.4	62.4	15	2,012	コミュニケーション・サービス
VONOVIA SE	9	9	73	9,586	一般消費財・サービス
LEG IMMOBILIEN SE	71.86	80.41	375	49,121	不動産
	10.73	10.73	125	16,338	不動産
国 小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,998.98 60銘柄	2,932.5 59銘柄	16,069 2,100,220	< 2.5%>
ユーロ (ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	29	29	59	7,732	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	275.76	359.64	161	21,091	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	71.83	71.83	67	8,856	エネルギー
国 小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	376.59 3銘柄	460.47 3銘柄	288 37,680	< 0.0%>
ユーロ (スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA RIGHTS SA	—	720.39	11	1,562	公益事業
TELEFONICA SA	570.39	644.91	259	33,918	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA	37.6	37.6	72	9,496	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	951.66	835.83	466	60,924	金融
IBERDROLA SA	720.39	720.39	721	94,343	公益事業
REPSOL SA	176.85	176.85	190	24,917	エネルギー
GRIFOLS SA	51.14	27.95	46	6,045	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	2,073.7	2,073.7	646	84,440	金融
AMADEUS IT GROUP SA	54	54	335	43,814	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA	39.78	39.78	114	14,932	公益事業
CAIXABANK SA	468.59	468.59	126	16,487	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	35.83	35.83	86	11,323	資本財・サービス
AENA SME SA	8.66	8.66	126	16,479	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA	45.46	65.12	273	35,746	コミュニケーション・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	142.55	124.17	343	44,921	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	17.93	32.93	64	8,373	資本財・サービス
ENAGAS SA	36.75	36.75	73	9,544	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	51.47	51.47	91	12,011	公益事業
FERROVIAL SA	60.55	60.55	162	21,240	資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA	—	43.83	84	11,084	公益事業
国 小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,543.3 18銘柄	6,259.3 20銘柄	4,296 561,610	< 0.7%>
ユーロ (イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA	41.45	41.45	136	17,796	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	159.85	129.44	238	31,230	金融
MEDIOBANCA SPA	99.71	99.71	103	13,520	金融
UNICREDIT SPA	294.71	294.71	419	54,781	金融
TELECOM ITALIA SPA	1,085.03	1,085.03	48	6,374	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP	483.81	—	—	—	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO	2,135.25	1,910.98	470	61,517	金融
ATLANTIA SPA	60.27	60.27	99	13,009	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	77.27	77.27	90	11,780	金融
MONCLER SPA	24.35	24.35	147	19,292	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	12.85	12.85	69	9,082	ヘルスケア
ENI SPA	360.61	281.9	357	46,733	エネルギー
DIASORIN SPA	2.77	2.77	41	5,361	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	24.14	24.14	23	3,103	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA	35.53	80.78	108	14,115	情報技術

銘 柄	期 首		当		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
		百株	百株	千ユーロ	千円		
AMPLIFON SPA		17.5	17.5	72	9,528	ヘルスケア	
ENEL SPA		983.37	983.37	681	89,068	公益事業	
SNAM SPA		243	243	125	16,400	公益事業	
TERNA SPA		199	199	136	17,837	公益事業	
FINECOBANK SPA		59.72	59.72	90	11,864	金融	
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	6,400.19 20銘柄	5,628.24 19銘柄	3,461 452,400	< 0.5%>		
ユーロ (フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円		
UPM-KYMMENE OYJ		65.25	65.25	221	29,004	素材	
NOKIA OYJ		652.61	652.61	355	46,486	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP		41.16	41.16	51	6,708	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS		88.53	88.53	146	19,149	素材	
ELISA OYJ		17.34	17.34	91	11,979	コミュニケーション・サービス	
SAMPO OYJ-A SHS		68.09	68.09	300	39,290	金融	
FORTUM OYJ		44	44	111	14,509	公益事業	
KESKO OYJ-B SHS		51.25	42.45	118	15,435	生活必需品	
KONE OYJ-B		45.43	37.96	233	30,581	資本財・サービス	
NESTE OYJ		57.78	57.78	254	33,296	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B		17.63	17.63	62	8,106	ヘルスケア	
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,149.07 11銘柄	1,132.8 11銘柄	1,947 254,548	< 0.3%>		
ユーロ (オーストリア)		百株	百株	千ユーロ	千円		
VERBUND AG		12.16	12.16	112	14,701	公益事業	
OMV AG		12.09	12.09	65	8,542	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG		34.89	34.89	148	19,407	金融	
VOESTALPINE AG		18	18	61	7,975	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL		11	11	28	3,694	金融	
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	88.14 5銘柄	88.14 5銘柄	415 54,321	< 0.1%>		
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	23,170.73 232銘柄	22,777.47 229銘柄	60,137 7,859,935	< 9.5%>		
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	134,609.2 1,208銘柄	131,967.94 1,227銘柄	78,078.463 94.4%>			

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期 首		期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	評 価 額
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.679	1.679	417	48,150
SIMON PROPERTY GROUP INC	4.233	4.012	645	74,446
BOSTON PROPERTIES INC	2.356	1.915	239	27,633
VORNADO REALTY TRUST	2.128	2.128	97	11,194
SBA COMMUNICATIONS CORP	1.501	1.28	438	50,576
EQUITY RESIDENTIAL	5.245	4.406	395	45,574
EQUINIX INC	1.081	1.081	826	95,298
AMERICAN TOWER CORP	5.555	5.453	1,441	166,300
HOTEL RESORTS INC	12.228	6.701	118	13,718
INVITATION HOMES INC	6.976	6.976	297	34,308
VICI PROPERTIES INC	5.464	8.607	247	28,501
VENTAS INC	4.401	4.401	233	26,964
WEYERHAEUSER CO	8.683	8.683	348	40,210
AGNC INVESTMENT CORP	7.559	7.559	115	13,374
CROWN CASTLE INTL CORP	5.102	5.102	972	112,202
IRON MOUNTAIN INC	3.474	3.474	162	18,704
VEREIT INC	2.726	—	—	—
SUN COMMUNITIES INC	1.214	1.214	236	27,304
PROLOGIS INC	9.436	8.863	1,356	156,425
ALEXANDRIA REAL ESTATE	1.648	1.648	342	39,502
CAMDEN PROPERTY TRUST	1.177	1.177	194	22,466
DUKE REALTY CORP	4.971	4.971	299	34,487
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.771	0.771	266	30,681
WELLTOWER INC	4.901	4.901	429	49,484
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6.434	6.434	230	26,589
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.714	1.452	311	35,956
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1.95	1.95	156	18,083
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15.632	15.632	124	14,369
REALTY INCOME CORP	4.587	6.508	466	53,767
PUBLIC STORAGE	2.105	1.857	668	77,068
REGENCY CENTERS CORP	1.939	1.939	147	17,059
UDR INC	4.752	3.7	214	24,756
WP CAREY INC	2.702	2.702	216	24,978
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2.164	—	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	3.415	3.415	543	62,722
EXTRA SPACE STORAGE INC	1.797	1.797	374	43,217
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8.597	8.597	202	23,311
アメリカ・ドル 口数、金額	162,297	152,985	13,780	1,589,393
通 貨 計 銘柄数<比率>	37銘柄	35銘柄		<1.9%>
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
CAN APARTMENT PROP REAL ESTATE	1.6	1.6	91	8,310
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1.4	1.4	31	2,883
カナダ・ドル 口数、金額	3	3	122	11,193
通 貨 計 銘柄数<比率>	2銘柄	2銘柄		<0.0%>
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU	—	13.949	156	12,990
LENDLEASE GROUP	4.303	14.733	156	12,987
TRANSURBAN GROUP	33.406	33.406	449	37,289
SYDNEY AIRPORT	9.129	18.747	162	13,510
APA GROUP	14.243	14.243	142	11,847
SCENTRE GROUP	64.017	64.017	202	16,829
DEXUS	13.949	—	—	—
GPT GROUP	30.647	30.647	167	13,851
MIRVAC GROUP	61.117	61.117	176	14,597
STOCKLAND	18.729	18.729	80	6,647
GOODMAN GROUP	20.198	20.198	490	40,635
VICINITY CENTRES	50.371	50.371	88	7,310
オーストラリア・ドル 口数、金額	320,109	340,157	2,272	188,496
通 貨 計 銘柄数<比率>	11銘柄	11銘柄		<0.2%>
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT	32	26	1,765	26,110
HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	52	52	400	5,929
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34	34	361	5,340
香港・ドル 口数、金額	118	112	2,527	37,380
通 貨 計 銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		<0.0%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30.5	30.5	87	7,476
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	51.66	56.826	112	9,577
SUNTEC REIT	26	—	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	46	46	81	6,969
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	37.6	37.6	68	5,856
シンガポール・ドル 口数、金額	191.76	170.926	351	29,880
通 貨 計 銘柄数<比率>	5銘柄	4銘柄		<0.0%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	10.295	10.295	79	12,480
SEGRO PLC	13.286	13.286	174	27,302
BRITISH LAND CO PLC	14.58	14.58	80	12,564
イギリス・ポンド 口数、金額	38,161	38,161	334	52,348
通 貨 計 銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		<0.1%>
ユーロ (フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1.751	1.751	117	15,312
GECINA SA	0.578	0.578	70	9,235
KLEPIERRE	2.394	2.394	54	7,177
COVIVIO	0.353	0.353	26	3,431
ユーロ通貨計 口数、金額	5,076	5,076	268	35,157
銘柄数<比率>	4銘柄	4銘柄		<0.0%>
合 計 口数、金額	838,403	822,305	—	1,943,851
銘柄数<比率>	65銘柄	62銘柄		<2.4%>

(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。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外	S&P500 EMINI FUT(アメリカ)	百万円 2,124	百万円 —
	S&P/TSX 60 IX FUT(カナダ)	93	—
	SPI 200 FUTURES(オーストラリア)	60	—
	FTSE 100 IDX FUT(イギリス)	127	—
国	SWISS MKT IX FUTR(スイス)	77	—
	EURO STOXX 50(ドイツ)	260	—

(注1) 外貨建の評価額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年1月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 78,078,463	% 94.3
投資信託証券	1,943,851	2.3
コール・ローン等、その他	2,734,299	3.4
投資信託財産総額	82,756,614	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ユーロ=130.70円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産 (80,971,863円) の投資信託財産総額 (82,756,614円) に対する比率は、97.8%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	165,654,019,939円
コール・ローン等	1,955,672,980
株式(評価額)	78,078,463,848
投資信託証券(評価額)	1,943,851,071
未収入金	82,999,580,622
未収配当金	65,682,838
差入委託証拠金	610,768,580
(B) 負債	82,967,774,276
未払金	82,959,674,276
未払解約金	8,100,000
(C) 純資産総額(A-B)	82,686,245,663
元本	27,819,075,015
次期繰越損益金	54,867,170,648
(D) 受益権総口数	27,819,075,015口
1万口当り基準価額(C/D)	29,723円

* 期首における元本額は27,480,973,178円、当作成期間中における追加設定元本額は5,991,910,031円、同解約元本額は5,653,808,194円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 20,806,492,720円
ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 1,138,436,766円
iFree 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 1,640,820,976円
ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジあり) (ダイワSMA専用) 4,233,324,553円
* 当期末の計算口数当りの純資産額は29,723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	1,194,345,220円
受取配当金	1,194,533,790
受取利息	1,226
その他収益金	674,785
支払利息	△ 864,581
(B) 有価証券売買損益	12,065,620,947
売買益	24,744,271,123
売買損	△12,678,650,176
(C) 先物取引等損益	637,837,134
取引益	737,569,138
取引損	△ 99,732,004
(D) その他費用	△ 20,508,168
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	13,877,295,133
(F) 前期繰越損益金	40,198,140,352
(G) 解約差損益金	△ 9,957,048,806
(H) 追加信託差損益金	10,748,783,969
(I) 合計(E+F+G+H)	54,867,170,648
次期繰越損益金(I)	54,867,170,648

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。
(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)

運用報告書(全体版) 第 6 期

(決算日 2022年 6 月15日)
(作成対象期間 2021年 6 月16日～2022年 6 月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、外国の株式（D R（預託証券）を含みます。）に投資し、投資成果を M S C I コクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないました。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。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年 9月26日）		
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券	
	外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式（預託証券を含みます。）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質上限組入比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

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/>

<2732>

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			MSCIコクサイ指数 (円ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2 期末(2018年 6 月15日)	13,931	0	13.9	13,533	12.0	96.1	1.5	2.4	3,307
3 期末(2019年 6 月17日)	14,011	0	0.6	13,342	△ 1.4	95.8	1.3	2.9	4,523
4 期末(2020年 6 月15日)	14,231	0	1.6	13,353	0.1	96.5	0.6	2.7	5,717
5 期末(2021年 6 月15日)	20,848	0	46.5	19,329	44.8	91.8	5.9	2.3	9,292
6 期末(2022年 6 月15日)	21,770	0	4.4	19,916	3.0	94.1	3.4	2.4	10,844

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) MSCIコクサイ指数（円ベース）は、MSCI Inc.（「MSCI」）の承諾を得て、MSCIコクサイ指数（米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIコクサイ指数（米ドルベース）は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCI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。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>]

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

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

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

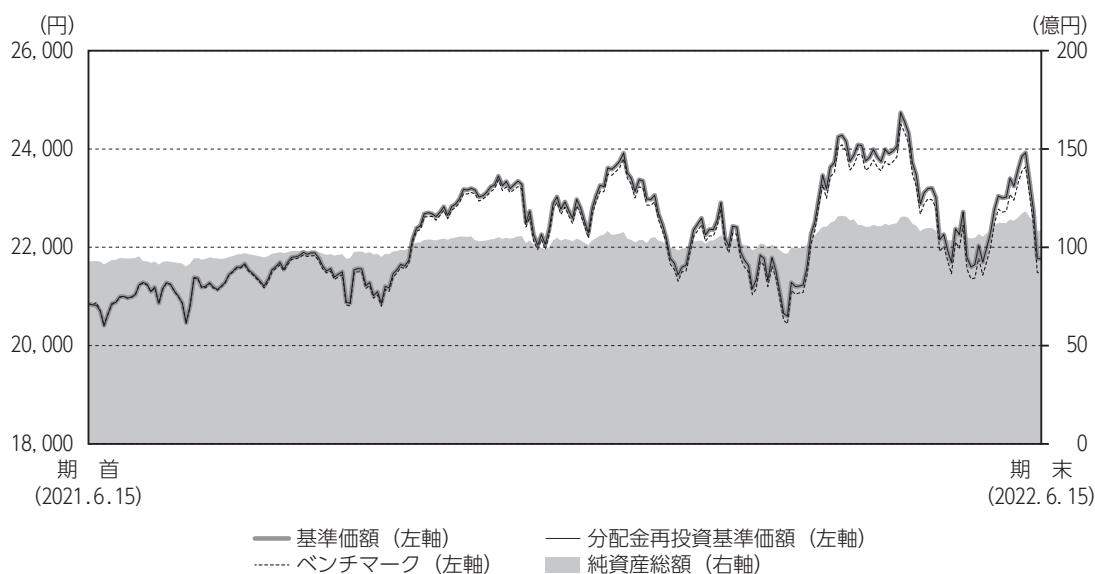
(注6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注7) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

* ベンチマークはMSCIコクサイ指数（円ベース）です。

基準価額・騰落率

期 首：20,848円

期 末：21,770円（分配金 0 円）

騰落率：4.4%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

「外国株式インデックスマザーファンド」の受益証券を通じて、ベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行った結果、海外株式市況は下落した一方、為替相場が円安となったことにより、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		M S C I コクサイ指数 (円ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証 券 組入比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
	円	%		%	%	%	%
(期首) 2021年 6月15日	20,848	—	19,329	—	91.8	5.9	2.3
6 月末	20,990	0.7	19,456	0.7	91.0	6.7	2.2
7 月末	21,278	2.1	19,719	2.0	92.0	5.7	2.2
8 月末	21,797	4.6	20,171	4.4	91.2	6.8	2.2
9 月末	21,283	2.1	19,677	1.8	92.2	5.6	2.2
10月末	22,832	9.5	21,100	9.2	92.0	5.8	2.3
11月末	22,737	9.1	20,978	8.5	91.4	6.5	2.2
12月末	23,658	13.5	21,823	12.9	92.8	4.8	2.4
2022年 1 月末	21,995	5.5	20,280	4.9	92.1	5.7	2.3
2 月末	21,839	4.8	20,129	4.1	91.1	6.4	2.2
3 月末	24,156	15.9	22,214	14.9	93.0	4.5	2.4
4 月末	23,115	10.9	21,216	9.8	92.3	5.2	2.6
5 月末	23,044	10.5	21,115	9.2	90.6	7.1	2.4
(期末) 2022年 6月15日	21,770	4.4	19,916	3.0	94.1	3.4	2.4

(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. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■海外株式市況

海外株式市況は下落しました。

海外株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展により経済活動の正常化が順次進んだことや、好調な経済指標の発表などから上昇しました。2021年9月には、中国の大手不動産会社の資金繰り問題や米国の債務上限問題、米国金利上昇に対する警戒感など複数のリスク要因が嫌気され、軟調な推移となりました。2022年に入ると、2021年12月のF O M C（米国連邦公開市場委員会）議事録を受け、米国の金融引き締めに対する懸念が高まり下落しました。2月以降は、欧米中央銀行高官の金融政策に対する発言やロシアのウクライナへの侵攻、ロシアとウクライナの断片的な停戦協定による状況改善期待などから、一進一退の展開となりました。その後は、F R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げペースが一層加速するとの懸念などから下落し、当作成期末を迎えました。

■為替相場

為替相場は円安となりました。

当作成期首より、米ドル円は比較的狭いレンジでの推移となりましたが、2021年9月以降は米国金利が上がったことにより上昇（円安）しました。その後2022年に入ってから、期待インフレ率の上昇などにより米国金利がさらに上がったため、米ドル円も上げ幅を拡大しました。また、世界的に利上げ観測が高まっている一方で、日本の金融政策が相対的に緩和的であることなどから、その他の通貨も対円で上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに円安が進みました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「外国株式インデックスマザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れることで、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

「外国株式インデックスマザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れました。

■外国株式インデックスマザーファンド

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

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

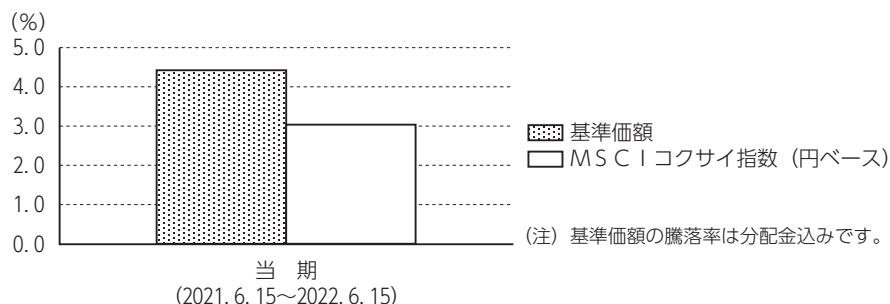
組入ファンド	ベンチマーク
外国株式インデックスマザーファンド	M S C I コクサイ指数（円ベース）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は3.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.4%となりました。

マザーファンドにおいて保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークには配当分が含まれていないことが、かい離要因となりました。その他、マザーファンドで組み入れているポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、運用管理費用、売買コスト等がかい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークはM S C I コクサイ指数（円ベース）です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	11,769

- （注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

■当ファンド

「外国株式インデックスマザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れることで、ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

1万口当りの費用の明細

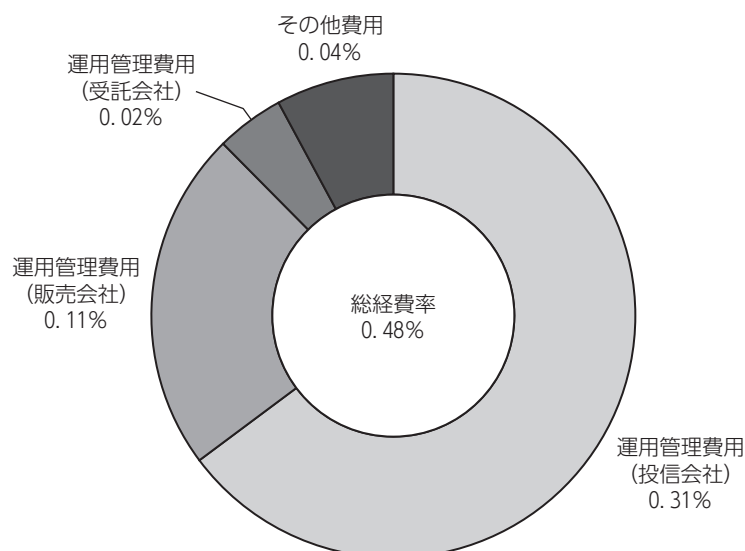
項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	99円	0. 445%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は22, 270円です。
（投 信 会 社）	(70)	(0. 313)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(24)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(5)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0. 004	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）	(1)	(0. 002)	
（先物・オプション）	(0)	(0. 002)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
有価証券取引税	1	0. 005	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）	(1)	(0. 005)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	8	0. 038	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）	(4)	(0. 019)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(3)	(0. 013)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	110	0. 492	

- (注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。
- (注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。
- (注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。
- (注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.48%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

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式 インデックス マザーファンド	805, 143	3, 266, 507	526, 709	2, 157, 905

(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 6月16日から2022年 6月15日まで)

項 目	当 期
	外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	39, 447, 732千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	229, 720, 983千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0. 17

(注 1) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。
(注 2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等
当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国株式インデックス マザーファンド	2, 470, 931	2, 749, 365	10, 844, 049

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

項 目	2022年 6月15日現在	
	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス マザーファンド	10, 844, 049	99. 8
コール・ローン等、その他	24, 676	0. 2
投資信託財産総額	10, 868, 725	100. 0

(注 1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注 2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1 アメリカ・ドル＝135. 01円、1 カナダ・ドル＝104. 20円、1 オーストラリア・ドル＝93. 10円、1 香港・ドル＝17. 20円、1 シンガポール・ドル＝96. 95円、1 ニュージーランド・ドル＝83. 95円、1 イギリス・ポンド＝162. 21円、1 イスラエル・シェケル＝38. 942円、1 スイス・フラン＝135. 01円、1 デンマーク・クローネ＝18. 93円、1 ノルウェー・クローネ＝13. 49円、1 スウェーデン・クローネ＝13. 25円、1 ユーロ＝140. 80円です。
(注 3) 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (254, 328, 525千円) の投資信託財産総額 (257, 632, 004千円) に対する比率は、98. 7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況
2022年 6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	10, 868, 725, 245円
コール・ローン等	24, 571, 481
外国株式インデックス マザーファンド (評価額)	10, 844, 049, 164
未収入金	104, 600
(B) 負債	23, 943, 803
未払信託報酬	23, 651, 883
その他未払費用	291, 920
(C) 純資産総額 (A - B)	10, 844, 781, 442
元本	4, 981, 572, 692
次期繰越損益金	5, 863, 208, 750
(D) 受益権総口数	4, 981, 572, 692口
1 万口当り基準価額 (C / D)	21, 770円

* 期首における元本額は4, 456, 971, 386円、当作成期間中における追加設定元本額は1, 798, 628, 403円、同解約元本額は1, 274, 027, 097円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は21, 770円です。

■損益の状況
当期 自 2021年 6月16日 至 2022年 6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3, 562円
受取利息	499
支払利息	△ 4, 061
(B) 有価証券売買損益	246, 323, 933
売買益	434, 311, 455
売買損	△ 187, 987, 522
(C) 信託報酬等	△ 46, 116, 734
(D) 当期損益金 (A + B + C)	200, 203, 637
(E) 前期繰越損益金	1, 995, 014, 885
(F) 追加信託差損益金	3, 667, 990, 228
(配当等相当額)	(1, 667, 270, 995)
(売買損益相当額)	(2, 000, 719, 233)
(G) 合計 (D + E + F)	5, 863, 208, 750
次期繰越損益金 (G)	5, 863, 208, 750
追加信託差損益金	3, 667, 990, 228
(配当等相当額)	(1, 667, 270, 995)
(売買損益相当額)	(2, 000, 719, 233)
分配準備積立金	2, 195, 222, 084
繰越損益金	△ 3, 562

(注 1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
(注 2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
(注 3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程 (総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	200, 204, 820
(c) 収益調整金	3, 667, 990, 228
(d) 分配準備積立金	1, 995, 017, 264
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	5, 863, 212, 312
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	5, 863, 212, 312
(h) 受益権総口数	4, 981, 572, 692口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「外国株式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6月15日）現在における外国株式インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を併せて掲載いたしました。

■外国株式インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

（2021年6月16日から2022年6月15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
APPLE INC（アメリカ）	76.4	1,445,332	18,917	ALEXION PHARMACEUTICALS INC（アメリカ）	7.98	159,446	19,980
MICROSOFT CORP（アメリカ）	39.1	1,394,438	35,663	DEUTSCHE WOHNEN SE（ドイツ）	12.05	73,268	6,080
AMAZON.COM INC（アメリカ）	3.66	1,374,537	375,556	ORACLE CORP（アメリカ）	6	62,614	10,435
TESLA INC（アメリカ）	8.88	902,720	101,657	XPO LOGISTICS INC（アメリカ）	3.1	47,864	15,440
ALPHABET INC-CL A（アメリカ）	1.74	547,466	314,635	VIFOR PHARMA AG（スイス）	1.75	41,510	23,720
NVIDIA CORP（アメリカ）	13.85	437,993	31,624	AUTOLIV INC（アメリカ）	2.95	32,702	11,085
ALPHABET INC-CL C（アメリカ）	1.27	398,057	313,430	LAMB WESTON HOLDINGS INC（アメリカ）	5.45	32,540	5,970
META PLATFORMS INC CLASS A（アメリカ）	10	328,517	32,851	RENAISSANCE HOLDINGS LTD（バミューダ）	1.83	32,435	17,724
SEA LTD-ADR（ケイマン諸島）	14.3	325,630	22,771	SUEZ（フランス）	12.625	32,200	2,550
JOHNSON & JOHNSON（アメリカ）	15.4	316,356	20,542	REINSURANCE GROUP OF AMERICA（アメリカ）	2.45	31,755	12,961

（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6月15日現在における外国株式インデックスマザーファンド（65,283,819千円）の内容です。

(1) 外国株式

銘 柄	2022年 6月15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	
(アメリカ)				
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	47	631	85,295	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	40	1,926	260,099	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	74	1,000	135,044	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	54	442	59,797	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	24	343	46,354	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	211	622	84,065	金融
ABBOTT LABORATORIES	714.66	7,356	993,229	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	149.83	482	65,135	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	65	1,028	138,857	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	139	448	60,559	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	243	1,592	214,987	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	18	732	98,947	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	247	2,352	317,634	情報技術
QORVO INC	44.2	427	57,681	情報技術
AFLAC INC	250	1,342	181,284	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	51	581	78,515	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	68	577	77,980	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	191.2	7,090	957,231	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	84	783	105,753	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	48	1,346	181,777	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	63	609	82,266	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	90	2,152	290,673	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	278	5,095	687,900	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	86.42	576	77,869	金融
AUTOZONE INC	8.2	1,667	225,133	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	90.71	1,415	191,073	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	459	360	48,646	ヘルスケア
CELANESE CORP	44.5	606	81,834	素材
DR HORTON INC	136.16	894	120,812	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	89	316	42,764	ヘルスケア
AUTODESK INC	89	1,527	206,180	情報技術
MOODY'S CORP	68	1,752	236,567	金融
DEVON ENERGY CORP	256	1,807	243,977	エネルギー
ALBEMARLE CORP	47	1,049	141,713	素材
ATMOS ENERGY CORP	55	580	78,369	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	102	567	76,580	公益事業
CITIGROUP INC	804.73	3,698	499,339	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	170	3,470	468,513	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	204	1,844	249,090	公益事業
ALLEGHANY CORP	5.2	432	58,410	金融
DOMINO'S PIZZA INC	15.3	577	77,901	一般消費財・サービス
HESS CORP	113	1,356	183,180	エネルギー
DAVITA INC	27.5	247	33,403	ヘルスケア
DANAHER CORP	276.5	6,702	904,960	ヘルスケア

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	2022年6月15日現在			業 種 等
		株 数	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
FORTIVE CORP		138	773	104,466	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN		228	2,144	289,507	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO		228	1,884	254,477	生活必需品
BUNGE LTD		57	594	80,303	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD		131.95	1,562	210,906	情報技術
APPLE INC		6,611	87,767	11,849,508	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		114	1,046	141,352	金融
BOEING CO/THE		225	2,748	371,088	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP		62.15	723	97,686	金融
BECTON DICKINSON AND CO		114.99	2,717	366,882	ヘルスケア
LEIDOS HOLDINGS INC		54	528	71,381	資本財・サービス
NISOURCE INC		165	455	61,483	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC		51	542	73,227	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		307.71	1,249	168,668	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC		1,703.04	8,372	1,130,323	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		523.5	14,534	1,962,296	金融
ANSYS INC		35	804	108,569	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP		538.17	2,488	335,972	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE		284	2,709	365,867	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		883	6,434	868,711	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO		1,196.7	13,649	1,842,827	金融
T ROWE PRICE GROUP INC		93	1,001	135,202	金融
LKQ CORP		108	524	70,747	一般消費財・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B		126.12	821	110,950	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC		112	1,605	216,821	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC		45	1,093	147,675	金融
DOLLAR GENERAL CORP		94	2,162	291,917	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC		81	3,602	486,370	情報技術
CATERPILLAR INC		217	4,485	605,543	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC		97	530	71,582	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC		94	393	53,098	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES		20	419	56,569	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP		117	731	98,757	公益事業
MOSAIC CO/THE		149	785	106,074	素材
DELTA AIR LINES INC		62	194	26,267	資本財・サービス
CORNING INC		326	1,046	141,282	情報技術
CISCO SYSTEMS INC		1,684.5	7,228	975,877	情報技術
MORGAN STANLEY		541.52	4,059	548,037	金融
MSCI INC		33	1,290	174,203	金融
FAIR ISAAC CORP		11	417	56,346	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC		13	254	34,311	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		94	536	72,414	情報技術
BROADCOM INC		166.12	8,641	1,166,630	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC		49	654	88,330	ヘルスケア
ARAMARK		90	272	36,853	一般消費財・サービス
DTE ENERGY COMPANY		79	940	127,040	公益事業
CENTENE CORP		236.07	1,799	242,958	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC		42	451	60,968	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP		202	720	97,252	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO		85	1,302	175,844	金融
GARTNER INC		33.5	785	106,105	情報技術
SPLUNK INC		63	544	73,548	情報技術
DOMINION ENERGY INC		329.41	2,457	331,773	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP		161	1,417	191,412	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP		53	294	39,813	資本財・サービス
DEERE & CO		118	3,853	520,280	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC		60	741	100,082	資本財・サービス
POOL CORP		16	559	75,484	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC		112.84	1,265	170,855	情報技術
VMWARE INC-CLASS A		85	1,031	139,225	情報技術
CABLE ONE INC		2	244	33,046	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC		27	427	57,752	一般消費財・サービス
NASDAQ INC		46	671	90,591	金融
VAIL RESORTS INC		16	369	49,869	一般消費財・サービス
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A		209	249	33,634	コミュニケーション・サービス
TARGA RESOURCES CORP		90	596	80,560	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC		28	369	49,903	金融
WESTLAKE CORP		16	182	24,705	素材
CONSOLIDATED EDISON INC		144	1,278	172,601	公益事業
COGNEX CORP		69	296	40,076	情報技術
WEBSTER FINANCIAL CORP		73	328	44,409	金融
TELEFLEX INC		19	479	64,773	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		34	548	74,097	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES		30	841	113,655	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A		9	422	57,104	ヘルスケア
CATALENT INC		69	719	97,153	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A		56	1,004	135,575	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC		24	628	84,793	ヘルスケア
IDEX CORP		31	556	75,088	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO		324	2,406	324,881	生活必需品
ROLLINS INC		86.07	282	38,091	資本財・サービス

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		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	
AMETEK INC	94	1,046	141,300	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	98	803	108,494	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	64.5	291	39,334	資本財・サービス
HEICO CORP	18	240	32,416	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	26	624	84,298	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	15	526	71,026	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	106	1,033	139,504	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	17	527	71,283	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	179.6	8,168	1,102,789	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	32.5	231	31,254	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	23	640	86,437	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	53	412	55,627	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	11	1,324	178,808	一般消費財・サービス
UGI CORP	85	337	45,570	公益事業
CUMMINS INC	58	1,140	153,957	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	316	2,358	318,437	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	55	893	120,665	情報技術
SIGNATURE BANK	25.5	454	61,301	金融
COSTAR GROUP INC	160	882	119,176	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	24	975	131,680	金融
AMERCO	4	185	25,078	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	40	957	129,323	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	17.9	1,103	148,964	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	30	531	71,734	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	113.16	1,348	182,018	一般消費財・サービス
DEXCOM INC	156	1,081	145,977	ヘルスケア
NORDSON CORP	20.9	419	56,665	資本財・サービス
COPART INC	87	901	121,675	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	68	1,017	137,370	エネルギー
SEAGEN INC	56	809	109,355	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	30	714	96,429	ヘルスケア
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	33	622	83,996	金融
TRANSDIGM GROUP INC	20.9	1,102	148,887	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	15.8	512	69,152	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	39	355	48,030	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	87	707	95,458	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	826.81	1,479	199,701	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	98	1,756	237,205	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	15	402	54,371	金融
COTERRA ENERGY INC	330	1,026	138,605	エネルギー
T-MOBILE US INC	253.27	3,163	427,082	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	67.5	203	27,512	不動産
COCA-COLA CO/THE	1,670.5	9,894	1,335,839	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	85	430	58,159	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	69.5	685	92,518	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	117	270	36,457	金融
CSX CORP	889	2,608	352,150	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	38	812	109,718	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	61.25	624	84,289	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	3,712	37,977	5,127,338	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	253	2,188	295,462	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,717.05	16,500	2,227,779	エネルギー
AES CORP	271	512	69,187	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	16	436	58,901	金融
EOG RESOURCES INC	237	3,110	419,997	エネルギー
EQT CORP	141	575	77,725	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	65	580	78,366	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	5	311	42,038	金融
ABIOMED INC	18	413	55,811	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	64	903	122,014	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	122	1,415	191,082	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1,595.23	1,946	262,753	一般消費財・サービス
EXACT SCIENCES CORP	71	263	35,601	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	62.37	133	18,062	コミュニケーション・サービス
ENTEGRIS INC	55	543	73,334	情報技術
AERCAP HOLDINGS NV	56	221	29,962	資本財・サービス
FORTINET INC	55	1,480	199,918	情報技術
MARKEL CORP	5.5	713	96,283	金融
NEXTERA ENERGY INC	795.8	5,688	767,987	公益事業
MASIMO CORP	20	246	33,228	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	590.08	2,172	293,332	素材
INSULET CORP	28	575	77,703	ヘルスケア
US BANCORP	572	2,615	353,075	金融
UNITED RENTALS INC	29	754	101,844	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	25	376	50,895	情報技術
FASTENAL CO	233	1,144	154,549	資本財・サービス
FISERV INC	251.33	2,259	305,015	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	446.06	3,035	409,814	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	560	1,859	251,010	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	49	279	37,714	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	96	2,072	279,827	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	2022年 6月15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	
GOLDMAN SACHS GROUP INC		137. 5	3, 884	524, 503	金融
ALPHABET INC-CL A		121. 9	26, 017	3, 512, 587	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C		115. 07	24, 669	3, 330, 646	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING		39	322	43, 523	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC		245	1, 628	219, 799	生活必需品
FIRSTENERGY CORP		220. 18	845	114, 120	公益事業
GENUINE PARTS CO		58. 5	774	104, 602	一般消費財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP		277	957	129, 321	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC		78. 5	1, 781	240, 496	資本財・サービス
HALLIBURTON CO		364	1, 334	180, 209	エネルギー
HOME DEPOT INC		423. 5	11, 801	1, 593, 344	一般消費財・サービス
ASSURANT INC		22. 5	396	53, 466	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC		583	713	96, 342	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE		16. 1	329	44, 518	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE		59	1, 220	164, 720	生活必需品
HUMANA INC		51	2, 162	291, 897	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV		109	1, 834	247, 657	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A		33. 2	161	21, 824	情報技術
HENRY SCHEIN INC		56	420	56, 704	ヘルスケア
HP INC		473	1, 596	215, 526	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE		527	720	97, 262	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C		68. 28	247	33, 389	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C		79	459	61, 989	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A		29. 5	107	14, 449	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD		154	686	92, 626	金融
KRAFT HEINZ CO/THE		298. 03	1, 077	145, 416	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC		54	969	130, 879	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP		365	4, 953	668, 809	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO		143	623	84, 214	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI		52	318	43, 049	資本財・サービス
ZOETIS INC		191	3, 013	406, 917	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC		94. 99	1, 203	162, 462	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC		94	1, 226	165, 642	エネルギー
ALLEGION PLC		36. 5	369	49, 904	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C		129. 73	292	39, 425	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC		104. 37	1, 224	165, 371	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC		127	359	48, 558	情報技術
JM SMUCKER CO/THE		44	551	74, 469	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON		1, 066	17, 929	2, 420, 601	ヘルスケア
PLUG POWER INC		211	299	40, 451	資本財・サービス
ABBVIE INC		716. 72	9, 863	1, 331, 671	ヘルスケア
HOLOGIC INC		101	685	92, 547	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP		137	1, 689	228, 078	生活必需品
KROGER CO		283	1, 426	192, 529	生活必需品
KLA CORP		61	1, 930	260, 632	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP		99	4, 120	556, 252	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		31	703	95, 023	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE		105	344	46, 497	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC		272	4, 839	653, 444	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO		327. 85	9, 533	1, 287, 124	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP		56. 8	2, 554	344, 909	情報技術
LOEWS CORP		86	503	67, 969	金融
LINCOLN NATIONAL CORP		66. 49	321	43, 375	金融
MCDONALD'S CORP		301. 5	7, 198	971, 884	一般消費財・サービス
3M CO		231. 9	3, 136	423, 451	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A		936	15, 325	2, 069, 045	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC		144. 39	4, 583	618, 801	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS		25	791	106, 816	素材
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC		21. 2	561	75, 742	情報技術
ALCOA CORP		77	376	50, 856	素材
PHILLIPS 66		195	2, 030	274, 142	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL		160. 5	471	63, 707	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS		101	846	114, 269	生活必需品
METLIFE INC		284	1, 756	237, 188	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC		342	1, 659	224, 033	情報技術
ARISTA NETWORKS INC		100	919	124, 114	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC		67. 98	1, 382	186, 597	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL		9	1, 041	140, 662	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO		388. 23	1, 278	172, 602	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC		47	941	127, 175	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.		1, 025. 21	8, 663	1, 169, 594	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC		207. 51	1, 252	169, 132	素材
MASCO CORP		95	486	65, 681	資本財・サービス
M & T BANK CORP		72. 99	1, 203	162, 498	金融
MARSH & MCLENNAN COS		203. 7	2, 999	404, 987	金融
BLACK KNIGHT INC		63. 5	409	55, 228	情報技術
HEICO CORP-CLASS A		30. 2	326	44, 059	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A		112. 02	1, 705	230, 214	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A		80	1, 115	150, 541	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A		29	136	18, 456	一般消費財・サービス
BLOCK INC CLASS A		210. 12	1, 267	171, 060	情報技術

銘	柄	2022年6月15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	
TRANSUNION		78	603	81,434	資本財・サービス
VISTRA CORP		176	404	54,557	公益事業
NOVOCURE LTD		38.5	230	31,119	ヘルスケア
NETAPP INC		90	578	78,154	情報技術
NIKE INC -CL B		517	5,724	772,827	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP		97	2,161	291,791	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC		225	1,371	185,149	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		76.05	659	89,101	金融
ALLY FINANCIAL INC		142	483	65,336	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP		60	2,726	368,139	資本財・サービス
APTIV PLC		110	1,044	140,966	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP		323.11	2,038	275,218	素材
MCKESSON CORP		61	1,869	252,437	ヘルスケア
XYLEM INC		73	558	75,396	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		628	6,215	839,129	生活必需品
NUCOR CORP		111	1,262	170,422	素材
WESTERN UNION CO		152.46	250	33,880	情報技術
GODADDY INC - CLASS A		68	451	60,922	情報技術
NEWELL BRANDS INC		164.42	303	41,000	一般消費財・サービス
EVERGY INC		93.5	573	77,406	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP		379.24	2,354	317,908	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A		10.5	181	24,530	金融
OKTA INC		60	488	65,995	情報技術
COUPA SOFTWARE INC		29	154	20,911	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C		56	636	85,880	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC		173.05	361	48,829	ヘルスケア
LINDE PLC		208.46	6,162	831,998	素材
WIX. COM LTD		23.1	128	17,337	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC		158	414	55,910	金融
KKR & CO INC		226	1,064	143,712	金融
PAYCHEX INC		132	1,550	209,347	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC		27	1,611	217,509	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC		737	3,411	460,596	生活必需品
P G & E CORP		604	601	81,219	公益事業
PFIZER INC		2,280.13	10,926	1,475,170	ヘルスケア
CIGNA CORP		130	3,194	431,252	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C		118.01	558	75,440	情報技術
XCEL ENERGY INC		221	1,455	196,567	公益事業
STERIS PLC		41	835	112,739	ヘルスケア
SEA LTD-ADR		149	1,057	142,726	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B		60.33	178	24,150	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A		127.99	409	55,347	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP		137.8	2,763	373,166	ヘルスケア
LYFT INC-A		125	177	23,896	資本財・サービス
DOW INC		298.18	1,746	235,746	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A		41	265	35,836	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A		88	940	126,959	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP		52	1,313	177,359	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC		594	1,252	169,133	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO		94	2,486	335,738	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE		971.67	13,004	1,755,782	生活必需品
EXELON CORP		397.22	1,680	226,902	公益事業
TELADOC HEALTH INC		65	190	25,686	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC		165.08	722	97,552	資本財・サービス
NVR INC		1.3	507	68,539	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS		527.02	5,875	793,284	エネルギー
TWILIO INC - A		70	573	77,363	情報技術
DOCUSIGN INC		80	458	61,866	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC		21	567	76,678	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC		53	239	32,314	情報技術
PEPSICO INC		561	8,758	1,182,462	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL		16.2	193	26,130	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A		114	234	31,628	情報技術
MONGODB INC		27	650	87,851	情報技術
SNAP INC - A		444	528	71,393	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC		294.68	1,661	224,346	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		152	1,430	193,189	金融
AMCOR PLC		614	742	100,221	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A		80	1,274	172,013	情報技術
ROKU INC		48	356	48,143	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC		74	987	133,346	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A		256	7,043	950,885	情報技術
KORNIT DIGITAL LTD		19	64	8,708	資本財・サービス
PENTAIR PLC		66.75	306	41,328	資本財・サービス
QUALCOMM INC		457	5,952	803,698	情報技術
INVESCO LTD		141	228	30,915	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC		25.5	437	59,036	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP		106	677	91,504	金融
DATADOG INC - CLASS A		91	792	107,022	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A		231	397	53,610	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC		36.5	254	34,376	情報技術

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	2022年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
REGENERON PHARMACEUTICALS		43	2,357	318,340	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC		90	1,107	149,528	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC		17	3,317	447,904	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC		143	1,058	142,867	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA		38.3	563	76,130	素材
RESMED INC		59	1,191	160,912	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC		47.3	601	81,146	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC		45	366	49,472	資本財・サービス
MODERNA INC		139	1,689	228,124	ヘルスケア
HUBSPOT INC		17.8	526	71,098	情報技術
PERKINELMER INC		51	704	95,116	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP		346.87	1,246	168,310	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP		173.38	1,199	162,007	資本財・サービス
BILL. COM HOLDINGS INC		38	402	54,366	情報技術
AVANTOR INC		248	737	99,509	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE		80	265	35,847	金融
DYNATRACE INC		81	314	42,452	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A		179	812	109,717	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP		379.85	735	99,233	金融
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A		110	341	46,142	コミュニケーション・サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A		140	534	72,203	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP		32.3	254	34,380	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC		116	847	114,436	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP		790.18	13,239	1,787,460	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A		117	112	15,132	一般消費財・サービス
ZSCALER INC		34	483	65,233	情報技術
EDISON INTERNATIONAL		154	939	126,786	公益事業
ETSY INC		52	372	50,273	一般消費財・サービス
TESLA INC		355.5	23,557	3,180,554	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A		87	990	133,750	情報技術
NORTONLIFELOCK INC		236	518	70,065	情報技術
UNITY SOFTWARE INC		79	266	36,007	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC		66.02	704	95,167	資本財・サービス
SYNOPSIS INC		62	1,829	247,067	情報技術
CARVANA CO		39	81	11,015	一般消費財・サービス
CHEVY INC - CLASS A		32.5	87	11,869	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A		101	411	55,621	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		49.05	2,216	299,305	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC		490.21	505	68,301	ヘルスケア
DOORDASH INC - A		78.5	458	61,957	一般消費財・サービス
ROBLOX CORP -CLASS A		146	381	51,486	コミュニケーション・サービス
AIRBNB INC-CLASS A		136	1,344	181,538	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A		136	959	129,594	不動産
TWITTER INC		325	1,209	163,314	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE		430	2,871	387,686	公益事業
SYSCO CORP		206	1,650	222,885	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE		98.03	1,630	220,111	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR		25	109	14,793	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY		46	243	32,828	金融
STEEL DYNAMICS INC		78.5	557	75,269	素材
SCHLUMBERGER LTD		572.52	2,474	334,072	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		62	269	36,445	資本財・サービス
AFFIRM HOLDINGS INC		77	136	18,400	情報技術
AT&T INC		2,895.91	5,632	760,449	コミュニケーション・サービス
APA CORP		144	662	89,430	エネルギー
SOUTHWEST AIRLINES CO		60.5	225	30,401	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP		175	991	133,845	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC		87	342	46,266	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE		100	2,294	309,820	素材
SEMPRA ENERGY		128	1,853	250,267	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B		78	240	32,466	情報技術
CLARIVATE PLC		134	177	23,898	資本財・サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A		665	520	70,209	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS		84.5	639	86,281	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A		49	252	34,122	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC		374	5,762	778,007	情報技術
SALESFORCE. COM INC		398.66	6,555	885,120	情報技術
WESTROCK CO		107	457	61,785	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS		162.09	800	108,018	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATION		285.34	1,415	191,077	資本財・サービス
TERADYNE INC		66	600	81,006	情報技術
UNION PACIFIC CORP		257.8	5,374	725,661	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP		299	860	116,219	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP		239.88	2,462	332,509	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP		604.79	5,522	745,652	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		297	5,172	698,346	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC		77.04	1,547	208,938	ヘルスケア
AMEREN CORPORATION		105	874	118,086	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC		380.66	17,576	2,373,067	ヘルスケア
APPROVIN CORP CLASS A		49	158	21,401	情報技術
VERISIGN INC		40	644	87,043	情報技術

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		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	
LUCID GROUP INC	168	278	37,651	一般消費財・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	70	191	25,800	一般消費財・サービス
VALERO ENERGY CORP	166.42	2,225	300,514	エネルギー
UPSTART HOLDINGS INC	28	95	12,955	金融
ULTA BEAUTY INC	22	863	116,631	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	108.88	406	54,948	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	28.3	296	40,068	ヘルスケア
ANTHEM INC	98	4,511	609,154	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	737.62	6,949	938,300	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,550.22	5,802	783,391	金融
WASTE MANAGEMENT INC	168	2,446	330,290	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	493	1,594	215,254	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	46	883	119,346	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	24	372	50,340	一般消費財・サービス
WALMART INC	619	7,394	998,341	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	85	894	120,806	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	45	261	35,243	一般消費財・サービス
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	455	111	15,050	資本財・サービス
WABTEC CORP	71.11	613	82,872	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	484	2,774	374,621	一般消費財・サービス
WATERS CORP	25	803	108,510	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	22	661	89,326	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	297	1,193	161,193	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	48.63	947	127,942	金融
WESTERN DIGITAL CORP	127	625	84,428	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	128	1,178	159,074	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	204	1,243	167,923	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	672.5	13,014	1,757,049	情報技術
PPL CORP	298	775	104,726	公益事業
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	132.24	719	97,195	公益事業
PULTEGROUP INC	98.5	392	53,034	一般消費財・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	902.53	1,261	170,347	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC	96	1,070	144,527	素材
NORTHERN TRUST CORP	80	748	101,095	金融
NVIDIA CORP	1,013.8	16,054	2,167,523	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	170.13	2,648	357,539	金融
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	35	174	23,603	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	119	998	134,827	生活必需品
NETFLIX INC	179.9	3,014	406,926	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	159	8,068	1,089,322	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	98.5	388	52,422	公益事業
GLOBE LIFE INC	36.55	326	44,140	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	72	986	133,134	金融
TEXTRON INC	86	517	69,885	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	152.87	237	32,093	コミュニケーション・サービス
OMNICOM GROUP	83	539	72,781	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	649.33	4,592	619,974	情報技術
MASTERCARD INC - A	354	11,403	1,539,621	情報技術
ONEOK INC	181	1,093	147,573	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	373.52	395	53,404	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	43	1,636	220,989	情報技術
YUM! BRANDS INC	117	1,289	174,121	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	66	801	108,184	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	74	380	51,312	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	2,944.01	9,261	1,250,443	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	19	693	93,585	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	75	536	72,378	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	262	3,788	511,488	金融
ANALOG DEVICES INC	211.91	3,118	421,052	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	663.27	5,769	778,978	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	329.72	1,715	231,569	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	66	612	82,655	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	93	367	49,583	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	33.3	536	72,423	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	213	1,445	195,174	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	241	2,041	275,591	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	87	2,184	294,974	金融
AMGEN INC	226	5,326	719,173	ヘルスケア
EATON CORP PLC	162.36	2,119	286,102	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	67	1,551	209,407	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	358	3,458	466,999	情報技術
CME GROUP INC	146	2,863	386,561	金融
ECOLAB INC	105	1,577	213,037	素材
EQUIFAX INC	49	842	113,799	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	508	2,935	396,353	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	317	1,090	147,225	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	121	545	73,708	生活必需品
STATE STREET CORP	148.13	921	124,353	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	588.4	3,595	485,457	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	204	1,376	185,853	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	86	390	52,759	生活必需品

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2022年6月15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	
CROWN HOLDINGS INC		49.8	468	63,214	素材
CARDINAL HEALTH INC		110	562	75,903	ヘルスケア
FEDEX CORP		102	2,345	316,664	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP		167.54	1,785	241,079	金融
FMC CORP		51.5	555	75,036	素材
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		103.13	1,208	163,142	素材
CITRIX SYSTEMS INC		51	471	63,628	情報技術
INTEL CORP		1,651	6,262	845,465	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC		160	444	60,009	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP		134.5	895	120,937	金融
ILLINOIS TOOL WORKS		127	2,361	318,800	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC		386	228	30,903	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC		64	1,212	163,662	ヘルスケア
SEALED AIR CORP		58	339	45,871	素材
INTUITIVE SURGICAL INC		145	2,770	374,105	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH		43.5	528	71,326	情報技術
SNAP-ON INC		22	452	61,058	資本財・サービス
CARMAX INC		66	592	80,008	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP		312.28	3,152	425,572	公益事業
TARGET CORP		194	2,768	373,758	一般消費財・サービス
DOVER CORP		58	713	96,316	資本財・サービス
WW GRAINGER INC		19	892	120,538	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC		52.2	648	87,614	資本財・サービス
CINTAS CORP		38	1,339	180,815	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC		194	616	83,290	生活必需品
CLOROX COMPANY		50	623	84,138	生活必需品
ENTERGY CORP		82	879	118,778	公益事業
MICROSOFT CORP		2,886	70,559	9,526,280	情報技術
INCYTE CORP		76	502	67,905	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP		531.69	4,819	650,645	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC		543.98	4,813	649,821	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC		454	2,664	359,798	情報技術
BLACKROCK INC		62	3,665	494,896	金融
CENTERPOINT ENERGY INC		255	703	95,020	公益事業
HASBRO INC		54	436	58,871	一般消費財・サービス
KELLOGG CO		104	710	95,956	生活必需品
KEYCORP		376	659	89,039	金融
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A		563.11	3,292	444,520	生活必需品
COOPER COS INC/THE		20	629	85,034	ヘルスケア
CHUBB LTD		172.99	3,424	462,296	金融
ARROW ELECTRONICS INC		27	307	41,570	情報技術
ALLSTATE CORP		112	1,366	184,462	金融
EBAY INC		249	1,060	143,143	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC		449.5	3,257	439,737	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO		52	500	67,565	素材
DISH NETWORK CORP-A		96	169	22,850	コミュニケーション・サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A		94	2,263	305,572	生活必需品
TRIMBLE INC		102	603	81,469	情報技術
LENNAR CORP-A		106	732	98,946	一般消費財・サービス
LEAR CORP		23	290	39,231	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP		237	2,664	359,682	金融
PACCAR INC		141.37	1,189	160,630	資本財・サービス
BIOGEN INC		60	1,165	157,297	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC		34	1,118	151,017	ヘルスケア
STARBUCKS CORP		466	3,369	454,935	一般消費財・サービス
PTC INC		44	439	59,339	情報技術
EVERSOURCE ENERGY		140	1,130	152,609	公益事業
INTUIT INC		108.8	3,968	535,828	情報技術
BORGWARNER INC		97	340	45,914	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC		88.5	624	84,343	一般消費財・サービス
BALL CORP		130.04	864	116,752	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP		578.97	2,040	275,459	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC		114	1,452	196,036	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO		54	815	110,116	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		103	2,565	346,371	ヘルスケア
VF CORP		134	608	82,170	一般消費財・サービス
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B		246.25	625	84,478	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC		22	271	36,714	一般消費財・サービス
CARNIVAL CORP		340	323	43,700	一般消費財・サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC		218	384	51,918	素材
COMCAST CORP-CLASS A		1,833.9	7,306	986,417	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		87	467	63,051	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		448	217	29,395	不動産
アメリカ・ドル通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	133,369.57 603銘柄	1,314,532 177,475,066 <68.9%>	
(カナダ)		百株	千カナダ・ドル	千円	
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT		335	1,820	189,719	生活必需品
IMPERIAL OIL LTD		91	627	65,427	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		8	1,487	155,005	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN		116.87	724	75,527	一般消費財・サービス

銘柄	柄	2022年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千カナダ・ドル	千円	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		179	902	94,005	素材
INTACT FINANCIAL CORP		70.5	1,238	129,004	金融
BCE INC		49.3	312	32,594	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP		76	1,363	142,102	素材
SUNCOR ENERGY INC		567.3	2,893	301,474	エネルギー
METRO INC/CN		96	651	67,921	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA		134	1,193	124,408	金融
BANK OF NOVA SCOTIA		482	3,887	405,110	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		357	2,319	241,721	金融
TORONTO-DOMINION BANK		722	6,451	672,201	金融
GREAT-WEST LIFECO INC		107	340	35,510	金融
ROYAL BANK OF CANADA		561.5	7,075	737,263	金融
TOURMALINE OIL CORP		125	879	91,643	エネルギー
TC ENERGY CORP		389.5	2,733	284,872	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		218.29	1,087	113,319	エネルギー
BARRICK GOLD CORP		705	1,777	185,195	素材
CAE INC		126	387	40,411	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP		68.12	856	89,272	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'		65	258	26,936	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD		35	369	38,552	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B		58.5	337	35,172	素材
HYDRO ONE LTD		131	442	46,137	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD		65.6	738	76,913	生活必需品
NORTHLAND POWER INC		87	323	33,668	公益事業
WSP GLOBAL INC		47	652	67,995	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD		33	346	36,088	資本財・サービス
PARKLAND CORP		58	215	22,494	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B		60	164	17,180	コミュニケーション・サービス
EMERA INC		104	617	64,348	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC		33	322	33,608	資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A		48	184	19,226	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B		140	831	86,638	コミュニケーション・サービス
BRP INC/CA- SUB VOTING		16	129	13,535	一般消費財・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A		225	206	21,545	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD		181.17	1,139	118,723	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES		267	456	47,574	公益事業
AIR CANADA		65	116	12,171	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP		465	244	25,486	素材
BANK OF MONTREAL		257	3,299	343,847	金融
POWER CORP OF CANADA		222	753	78,465	金融
SHOPIFY INC - CLASS A		45	1,768	184,301	情報技術
NUTRIEN LTD		220.19	2,488	259,264	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A		47	211	22,004	公益事業
CAMECO CORP		158	455	47,513	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP		15	229	23,913	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT		71	242	25,257	資本財・サービス
LIGHTSPEED COMMERCE INC		53	139	14,529	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG		26	137	14,282	情報技術
TELUS CORP		108	316	32,973	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B		188	961	100,220	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A		22	359	37,496	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES		466	3,657	381,076	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		10	659	68,689	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC		113	837	87,308	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD		29.37	429	44,745	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP		78	210	21,985	素材
BLACKBERRY LTD		194	129	13,503	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC		232	1,376	143,402	金融
ENBRIDGE INC		803	4,467	465,554	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		559.25	3,255	339,270	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP		770	1,687	175,792	金融
BAUSCH HEALTH COS INC		113	108	11,291	ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		368.2	3,267	340,463	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC		41	254	26,560	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC		75	273	28,524	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO		271.5	3,815	397,535	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A		87	845	88,151	情報技術
ONEX CORPORATION		29	199	20,762	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		190	647	67,451	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC		31	109	11,444	金融
TMX GROUP LTD		21	279	29,159	金融
OPEN TEXT CORP		104	502	52,320	情報技術
SAPUTO INC		95	258	26,905	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		233	743	77,497	素材
FORTIS INC		187	1,109	115,626	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS		44	345	36,004	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP		246	245	25,556	素材
CENOVUS ENERGY INC		555	1,594	166,148	エネルギー
DOLLARAMA INC		112	809	84,353	一般消費財・サービス
ALTAGAS LTD		111	307	32,026	公益事業
KEYERA CORP		88	294	30,690	エネルギー

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2022年6月15日現在			業種等
		株数	価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ARC RESOURCES LTD		百株 286	千カナダ・ドル 563	千円 58,708	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数＜比率＞	15,743.16 86銘柄	93,764	9,770,297 ＜3.8%＞	
(オーストラリア)		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
THE LOTTERY CORPORATION LTD		849.5	389	36,301	一般消費財・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD		1,050.94	322	30,037	金融
BHP GROUP LTD		1,924.1	8,516	792,845	素材
SOUTH32 LTD		1,770.77	795	74,021	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD		717.02	2,365	220,223	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD		643.7	1,263	117,639	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		1,227.82	3,295	306,808	金融
WESTPAC BANKING CORP		1,348.48	2,706	251,965	金融
SANTOS LTD		1,223.04	990	92,230	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP		1,065.11	2,343	218,155	金融
RIO TINTO LTD		141.34	1,569	146,127	素材
ORIGIN ENERGY LTD		647	383	35,659	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD		676	271	25,300	資本財・サービス
XERO LTD		51.35	420	39,153	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		79	188	17,526	エネルギー
COLES GROUP LTD		507.94	870	81,053	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD		54	197	18,420	情報技術
IDP EDUCATION LTD		79	174	16,291	一般消費財・サービス
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		445.84	359	33,455	素材
EVOLUTION MINING LTD		656	218	20,337	素材
REECE LTD		105	145	13,568	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI		512.6	366	34,121	生活必需品
SEEK LTD		128.45	278	25,962	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		275.29	298	27,808	生活必需品
NEWCREST MINING LTD		340.97	791	73,710	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		647.87	5,908	550,088	金融
AMPOL LTD		88	303	28,216	エネルギー
ORICA LTD		149	233	21,737	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		562.69	647	60,244	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD		459.92	1,555	144,855	生活必需品
CROWN RESORTS LTD		134	174	16,280	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD		354.69	171	15,982	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD		1,563.94	586	54,601	コミュニケーション・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		164	532	49,576	素材
MACQUARIE GROUP LTD		139.28	2,275	211,815	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD		229.09	784	73,049	一般消費財・サービス
CSL LTD		183.15	4,836	450,238	ヘルスケア
WESFARMERS LTD		431.07	1,810	168,556	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD		25.1	516	48,054	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD		178	293	27,293	素材
SUNCORP GROUP LTD		480.15	503	46,847	金融
ASX LTD		73.65	570	53,154	金融
COMPUTERSHARE LTD		206.89	486	45,322	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		906.36	377	35,187	金融
SONIC HEALTHCARE LTD		173.28	577	53,753	ヘルスケア
BRAMBLES LTD		527	553	51,516	資本財・サービス
MINERAL RESOURCES LTD		62	344	32,070	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD		69.73	521	48,546	ヘルスケア
REA GROUP LTD		20.23	209	19,482	コミュニケーション・サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		22	140	13,042	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＞	24,371.35 50銘柄	54,438	5,068,239 ＜2.0%＞	
(香港)		百株	千香港・ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		580	2,966	51,027	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		880	3,630	62,436	一般消費財・サービス
MTR CORP		620	2,573	44,255	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES		605	5,644	97,087	不動産
SINO LAND CO		1,420	1,590	27,354	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		1,116.69	5,918	101,797	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		185	884	15,209	不動産
CLP HOLDINGS LTD		670	5,058	87,006	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		595.07	1,749	30,091	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		4,534.75	3,868	66,532	公益事業
HANG SENG BANK LTD		310	4,247	73,048	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT		635	1,854	31,892	不動産
WH GROUP LTD		3,610	2,017	34,709	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		501	17,114	294,363	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD		780	1,121	19,292	不動産
XINYI GLASS HOLDINGS LTD		690	1,208	20,792	資本財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		450	858	14,767	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD		911.69	4,736	81,463	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		265	1,360	23,405	公益事業
AIA GROUP LTD		5,036	39,582	680,826	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS		540	1,395	24,009	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		670	2,318	39,873	不動産

銘		柄	2022年 6月15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	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT			679	1,398	24,058	生活必需品
ESR CAYMAN LTD			800	1,688	29,033	不動産
SANDS CHINA LTD			928	1,395	24,006	一般消費財・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU			820	1,111	19,125	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD			575	5,359	92,174	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD			1,540	4,704	80,920	金融
香 港 ・ ド ル 通 貨 計		株 数 、 金 額	30,947.2	127,358	2,190,562	
		銘 柄 数 < 比 率 >	28 銘柄		<0.9%>	
(シンガポール)			百株	千シンガポール・ドル	千円	
CAPITALAND INVESTMENT LTD			1,074	392	38,005	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD			491	1,330	128,955	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD			754	2,248	217,985	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD			539.75	276	26,844	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD			593	396	38,461	資本財・サービス
UOL GROUP LTD			171	123	11,936	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD			161	127	12,362	不動産
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP			1,410	1,611	156,247	金融
GENTING SINGAPORE LTD			2,380	178	17,305	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD			112	190	18,502	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS			3,438.5	866	84,007	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING			627	249	24,193	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD			357	344	33,365	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD			800	324	31,489	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計		株 数 、 金 額	12,908.25	8,660	839,661	
		銘 柄 数 < 比 率 >	14 銘柄		<0.3%>	
(ニュージーランド)			百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD			525	232	19,524	公益事業
MERCURY NZ LTD			300	160	13,499	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD			727.89	329	27,681	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD			521.13	378	31,805	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C			242	471	39,616	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計		株 数 、 金 額	2,316.02	1,573	132,126	
		銘 柄 数 < 比 率 >	5 銘柄		<0.1%>	
(イギリス)			百株	千イギリス・ポンド	千円	
SHELL PLC			3,052.97	7,046	1,142,972	エネルギー
BP PLC			7,812.94	3,398	551,228	エネルギー
UNILEVER PLC			1,027.96	3,710	601,867	生活必需品
BARCLAYS PLC			6,726.97	1,054	171,053	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC			3,363.9	295	47,974	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC			1,102.58	1,073	174,127	金融
NATWEST GROUP PLC			2,255.36	499	80,997	金融
JOHNSON MATTHEY PLC			70.64	140	22,785	素材
BAE SYSTEMS PLC			1,262.79	978	158,707	資本財・サービス
AVIVA PLC			1,156.48	467	75,806	金融
AVEVA GROUP PLC			44	104	16,879	情報技術
GSK			2,041.62	3,495	567,031	ヘルスケア
INFORMA PLC			600.95	301	48,915	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC			1,691	255	41,432	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC			380.02	195	31,647	コミュニケーション・サービス
DCC PLC			39.64	206	33,448	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC			183	143	23,290	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC			29	269	43,672	資本財・サービス
HALMA PLC			152.6	295	47,934	情報技術
ENTAIN PLC			227	304	49,396	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC			997	111	18,072	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC			301.68	183	29,703	金融
M&G PLC			1,045.04	210	34,208	金融
RELX PLC			776.24	1,615	262,026	資本財・サービス
DIAGEO PLC			929.3	3,204	519,757	生活必需品
RIO TINTO PLC			451.02	2,505	406,403	素材
STANDARD CHARTERED PLC			1,046.59	627	101,792	金融
TESCO PLC			3,063.36	755	122,587	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC			353.11	411	66,671	ヘルスケア
GLENCORE PLC			3,969.5	1,918	311,193	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC			132.5	102	16,588	金融
SMITHS GROUP PLC			153.83	226	36,792	資本財・サービス
PEARSON PLC			283.63	209	33,972	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC			653.25	132	21,542	生活必需品
NEXT PLC			53.11	315	51,155	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC			1,466.73	182	29,668	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC			81.27	208	33,827	一般消費財・サービス
BUNZL PLC			135.62	355	57,703	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC			10,810.03	1,357	220,168	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC			56.01	334	54,203	素材
KINGFISHER PLC			787.11	184	29,978	一般消費財・サービス
WPP PLC			458.47	375	60,833	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC			264	271	44,022	公益事業
SEVERN TRENT PLC			97.33	273	44,316	公益事業

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2022年6月15日現在			業種等
		株数	価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
RENTOKIL INITIAL PLC		747.06	337	54,822	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		286.99	1,718	278,757	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC		217.32	239	38,900	金融
SCHRODERS PLC		46.5	122	19,807	金融
SSE PLC		427.91	702	113,938	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		395	192	31,216	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC		622.04	6,064	983,785	ヘルスケア
FERGUSON PLC		87.77	806	130,782	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		2,396.89	578	93,895	金融
3I GROUP PLC		390.73	431	70,003	金融
ASSTEAD GROUP PLC		178.54	651	105,736	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE		401.14	240	38,937	情報技術
NATIONAL GRID PLC		1,463.68	1,537	249,413	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC		28,500.13	1,236	200,499	金融
IMPERIAL BRANDS PLC		381.61	687	111,483	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC		42.32	170	27,630	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		873.95	3,062	496,809	生活必需品
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		138	216	35,110	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC		8,128.75	4,230	686,180	金融
ANGLO AMERICAN PLC		510.15	1,762	285,906	素材
MONDI PLC		188	267	43,410	素材
COMPASS GROUP PLC		716.29	1,196	194,036	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC		128.32	275	44,751	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC		3,453	620	100,623	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI		78	130	21,180	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC		160.61	255	41,501	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		71.36	310	50,364	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC		64.81	274	44,500	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		132.11	890	144,392	金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		66	99	16,160	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC		75	159	25,913	金融
ANTOFAGASTA PLC		153	213	34,571	素材
ABRDN PLC		843.62	142	23,181	金融
EXPERIAN PLC		370.16	859	139,481	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	114,323.91 78銘柄	70,994	11,516,048 <4.5%>	
		百株	千イスラエル・シェケル	千円	
(イスラエル)					
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		514.98	928	36,158	金融
AZRIELI GROUP LTD		16.5	381	14,874	不動産
TOWER SEMICONDUCTOR LTD		45.41	732	28,506	情報技術
ICL GROUP LTD		281	999	38,934	素材
ELBIT SYSTEMS LTD		11	745	29,043	資本財・サービス
BANK HAPOLIM BM		528.58	1,590	61,937	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL		604.86	1,881	73,254	金融
NICE LTD		26.28	1,726	67,237	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		64.07	707	27,570	金融
イスラエル・シェケル通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,092.68 9銘柄	9,694	377,517 <0.1%>	
		百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)					
VIFOR N. LINIE AG		18	312	42,212	ヘルスケア
UBS GROUP AG-REG		1,380.62	2,207	298,049	金融
ROCHE HOLDING AG-BR		11.8	413	55,759	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		2.8	200	27,104	素材
ADECCO GROUP AG-REG		63.6	213	28,765	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		275.8	8,432	1,138,483	ヘルスケア
SIKA AG-REG		57.17	1,298	175,364	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.04	386	52,221	生活必需品
ABB LTD-REG		644.47	1,770	239,016	資本財・サービス
SWISS RE AG		118.42	899	121,507	金融
NESTLE SA-REG		1,104.93	12,001	1,620,356	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG		9	766	103,525	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		16.01	280	37,934	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		1,040.49	614	82,937	金融
JULIUS BAER GROUP LTD		87.08	401	54,151	金融
SGS SA-REG		2.52	534	72,229	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		9.34	159	21,562	資本財・サービス
TEMENOS AG - REG		25	180	24,322	情報技術
VAT GROUP AG		10.5	253	34,164	資本財・サービス
ALCON INC		196.11	1,300	175,594	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR		10.9	249	33,699	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		59.05	2,474	334,120	金融
BALOISE HOLDING AG - REG		18	276	37,376	金融
CLARIANT AG-REG		77	143	19,356	素材
NOVARTIS AG-REG		860.01	6,942	937,239	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG		1.41	292	39,519	生活必需品
BACHEM HOLDING AG-REG B		12.5	85	11,568	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG		204.9	2,025	273,426	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG		10	530	71,582	コミュニケーション・サービス
GEBERIT AG-REG		14	660	89,214	資本財・サービス

銘柄		柄	2022年6月15日現在			業種等
			株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
			百株	千スイス・フラン	千円	
GIVAUDAN-REG			3.6	1,124	151,837	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG			43.89	448	60,618	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG			21.1	663	89,563	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG			66	342	46,192	情報技術
LONZA GROUP AG-REG			29.25	1,468	198,320	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG			19	82	11,091	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD			218.29	996	134,477	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG			12.37	634	85,674	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG			21.35	498	67,363	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG			30.25	267	36,164	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC			0.42	392	53,018	生活必需品
ス イ ス ・ フ ラ ン 通 貨 計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,806.99 41銘柄	53,230 <2.8%>	7,186,692	
			百株	千デンマーク・クローネ	千円	
(デンマーク)						
NOVO NORDISK A/S-B			701.05	52,957	1,002,482	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S			279	3,057	57,884	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A			1.31	2,402	45,480	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S			420.42	6,738	127,559	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S			54.65	1,295	24,528	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B			41.8	3,542	67,068	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES			83	3,326	62,973	素材
COLOPLAST-B			48.5	3,635	68,821	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S			82.8	8,235	155,894	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS			3.7	666	12,607	資本財・サービス
DEMANT A/S			42.75	1,168	22,117	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B			2.3	4,267	80,786	資本財・サービス
TRYG A/S			149.9	2,330	44,110	金融
PANDORA A/S			40	1,930	36,534	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S			43	2,046	38,737	素材
GENMAB A/S			27.37	5,387	101,990	ヘルスケア
ORSTED A/S			78.75	5,462	103,412	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,100.3 17銘柄	108,451 <0.8%>	2,052,989	
			百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
(ノルウェー)						
DNB BANK			380.5	6,968	94,009	金融
NORSK HYDRO ASA			542	3,470	46,823	素材
ORKLA ASA			303.5	2,219	29,945	生活必需品
TELENOR ASA			291.31	3,717	50,143	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA			406.87	14,390	194,134	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA			66.6	3,143	42,406	素材
MOWI ASA			178	4,259	57,461	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA			80.5	1,561	21,067	金融
AKER BP ASA			49	2,031	27,398	エネルギー
KONGSBERG GRUPPEN ASA			37.23	1,233	16,633	資本財・サービス
SALMAR ASA			24.52	1,668	22,509	生活必需品
ADEVINTA ASA			120	790	10,659	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,480.03 12銘柄	45,455 <0.2%>	613,193	
			百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)						
SAGAX CLASS B			79.24	1,621	21,481	不動産
INVESTOR CLASS A			200	3,782	50,111	金融
VOLVO CAR CLASS B			248.08	1,840	24,380	一般消費財・サービス
ERICSSON LM-B SHS			1,215.13	9,143	121,156	情報技術
VOLVO AB-B SHS			628.23	10,336	136,963	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES			154	2,567	34,025	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B			86	1,152	15,273	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB			657.78	6,643	88,027	生活必需品
TELE2 AB-B SHS			202	2,325	30,806	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS			92	2,300	30,475	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A			677.56	7,358	97,497	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS			607.23	5,750	76,193	金融
SWEDBANK AB - A SHARES			377.02	5,632	74,632	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS			293	3,903	51,727	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B			244	3,938	52,180	素材
SKANSKA AB-B SHS			136.5	2,213	29,326	資本財・サービス
SANDVIK AB			457	8,641	114,504	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS			758.5	12,961	171,736	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS			1,118.24	11,222	148,700	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS			80	1,369	18,147	資本財・サービス
HOLMEN AB-B SHARES			39.06	1,759	23,310	素材
SECURITAS AB-B SHS			119.5	1,049	13,908	資本財・サービス
TELIA CO AB			1,106.67	4,321	57,260	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB			127	3,098	41,059	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS			649.81	5,698	75,509	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B			417.27	9,204	121,965	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS			52.43	1,241	16,450	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS			262.68	1,438	19,059	不動産
INDUTRADE AB			113.71	2,342	31,037	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2022年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB		70.32	1,525	20,218	ヘルスケア
LUNDBERGS AB-B SHS		30	1,284	17,016	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		57	1,191	15,792	資本財・サービス
LIFCO AB-B SHS		95	1,641	21,744	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		630.92	4,532	60,056	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB		80.5	3,867	51,240	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B		253.54	6,386	84,623	生活必需品
EMBRACER GROUP AB		265.94	2,147	28,453	コミュニケーション・サービス
BOLIDEN AB		113.87	4,066	53,878	素材
EPIROC AB-A		274.36	4,861	64,416	資本財・サービス
EPIROC AB-B		157	2,377	31,505	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		170.5	1,324	17,548	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP		1,377.6	13,519	179,136	金融
EQT AB		123.18	2,691	35,662	金融
EVOLUTION AB		76.12	6,892	91,327	一般消費財・サービス
SINCH AB		213	799	10,590	情報技術
KINNEVIK AB - B		93	1,562	20,701	金融
HEXAGON AB-B SHS		810.32	8,844	117,191	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		62	1,455	19,288	金融
スウェーデン・クローネ通貨計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	16,153.81 48 銘柄	205,834 <1.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (アイルランド)					
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		94	303	42,762	素材
KINGSPAN GROUP PLC		60.76	425	59,885	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		62.72	573	80,750	生活必需品
CRH PLC		301.26	1,024	144,219	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		65.69	614	86,461	一般消費財・サービス
国 小 計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	584.43 5 銘柄	2,940 <0.2%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オランダ)					
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV		278.91	550	77,465	コミュニケーション・サービス
QIAGEN N. V.		91.05	371	52,343	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		349	729	102,750	ヘルスケア
NN GROUP NV		112.92	503	70,878	金融
HEINEKEN NV		101.96	907	127,768	生活必需品
AEGON NV		679.94	296	41,711	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		411.49	1,036	146,003	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.		71	502	70,717	素材
KONINKLIJKE DSM NV		68.8	975	137,410	素材
WOLTERS KLUWER		103.28	877	123,547	資本財・サービス
ING GROEP NV		1,536.19	1,478	208,162	金融
KONINKLIJKE KPN NV		1,278	423	59,668	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		159.79	7,529	1,060,126	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA		167	170	23,936	金融
IMCD NV		22.46	297	41,822	資本財・サービス
ADYEN NV		8.57	990	139,417	情報技術
JUST EAT TAKEAWAY		72.2	123	17,391	一般消費財・サービス
PROSUS NV		354.8	1,690	238,014	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV		37	96	13,617	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV		18	460	64,893	情報技術
RANDSTAD NV		47.2	222	31,367	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		42.5	297	41,828	生活必需品
OCI NV		43.86	146	20,564	素材
EURONEXT NV		33	243	34,281	金融
STMICROELECTRONICS NV		268.92	873	123,057	情報技術
AIRBUS SE		231.99	2,235	314,752	資本財・サービス
ARGENX SE		19.12	600	84,504	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		195	176	24,781	生活必需品
EXOR NV		42.73	258	36,338	金融
CNH INDUSTRIAL NV		402.65	501	70,667	資本財・サービス
STELLANTIS NV		866.43	1,081	152,223	一般消費財・サービス
FERRARI NV		49.6	806	113,589	一般消費財・サービス
国 小 計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	8,165.36 32 銘柄	27,454 <1.5%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ベルギー)					
UCB SA		49.76	393	55,363	ヘルスケア
KBC GROUP NV		98.43	531	74,866	金融
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		42	334	47,155	金融
SOLVAY SA		28	242	34,196	素材
UMICORE		82.69	316	44,626	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		341.79	1,668	234,941	生活必需品
AGEAS		62.9	254	35,876	金融
D'IETEREN GROUP		10.36	145	20,479	一般消費財・サービス
PROXIMUS		60.35	91	12,869	コミュニケーション・サービス
ELIA GROUP SA/NV		12	171	24,161	公益事業
SOFINA		6	119	16,769	金融
国 小 計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	794.28 11 銘柄	4,270 <0.2%>	

銘柄		2022年6月15日現在			業種等	
		株数	価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
		百株	千ユーロ	千円		
ユーロ (ルクセンブルグ)						
AROUNDTOWN SA		380	137	19,304	不動産	
ARCELORMITTAL		257	666	93,847	素材	
EUROFINS SCIENTIFIC		52.96	412	58,043	ヘルスケア	
TENARIS SA		186.08	268	37,845	エネルギー	
国小計		株数、金額 銘柄数<比率>	876.04	1,484	209,041	
			4銘柄	<0.1%>		
		百株	千ユーロ	千円		
ユーロ (フランス)						
TOTALENERGIES SE		974.92	5,272	742,349	エネルギー	
MICHELIN (CGDE)		66.85	725	102,219	一般消費財・サービス	
AIR LIQUIDE SA		205.76	2,777	391,050	素材	
KERING		29.42	1,445	203,512	一般消費財・サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE		212.74	2,488	350,399	資本財・サービス	
BOUYGUES SA		90.62	274	38,635	資本財・サービス	
BNP PARIBAS		436.84	2,067	291,143	金融	
THALES SA		41	465	65,521	資本財・サービス	
DANONE		257.08	1,330	187,282	生活必需品	
CARREFOUR SA		244.54	458	64,610	生活必需品	
VIVENDI		295.91	322	45,455	コミュニケーション・サービス	
L'OREAL		95	2,865	403,487	生活必需品	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		195.72	944	132,936	資本財・サービス	
LEGRAND SA		105.24	759	106,984	資本財・サービス	
PERNOD RICARD SA		82.41	1,395	196,444	生活必需品	
EURAZEO SE		17.24	110	15,620	金融	
SOCIETE GENERALE SA		308	690	97,205	金融	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		109.21	5,941	836,496	一般消費財・サービス	
ACCOR SA		67.17	182	25,762	一般消費財・サービス	
CAPGEMINI SE		64.52	1,069	150,574	情報技術	
VALEO SA		84	158	22,329	一般消費財・サービス	
PUBLICIS GROUPE		87	400	56,458	コミュニケーション・サービス	
BUREAU VERITAS SA		116.05	290	40,931	資本財・サービス	
EIFFAGE		32.85	288	40,591	資本財・サービス	
SODEXO SA		34.91	229	32,333	一般消費財・サービス	
IPSEN		14	118	16,656	ヘルスケア	
AMUNDI SA		22.5	107	15,073	金融	
TELEPERFORMANCE		23.15	646	91,038	資本財・サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT		36	158	22,333	コミュニケーション・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		11	325	45,890	ヘルスケア	
SEB SA		9.97	89	12,577	一般消費財・サービス	
ESSILORLUXOTTICA		113.17	1,522	214,316	一般消費財・サービス	
DASSAULT AVIATION SA		10	155	21,838	資本財・サービス	
WORLDLINE SA		91.14	296	41,756	情報技術	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		41.63	133	18,815	一般消費財・サービス	
AXA SA		762.06	1,706	240,240	金融	
EDENRED		95	405	57,142	情報技術	
RENAULT SA		70.5	170	24,071	一般消費財・サービス	
HERMES INTERNATIONAL		12.46	1,222	172,068	一般消費財・サービス	
REMY COINTREAU		9	137	19,350	生活必需品	
DASSAULT SYSTEMES SE		262.47	879	123,783	情報技術	
WENDEL		9.3	79	11,261	金融	
ORANGE		785.04	852	120,061	コミュニケーション・サービス	
ALSTOM		125.25	313	44,105	資本財・サービス	
SANOFI		447.47	4,212	593,180	ヘルスケア	
VINCI SA		209.83	1,756	247,254	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT		261.79	615	86,621	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA		491.28	433	61,099	金融	
BIOMERIEUX		15.2	130	18,315	ヘルスケア	
ENGIE		718.69	859	121,004	公益事業	
EDF		221.2	180	25,414	公益事業	
SAFRAN SA		134.49	1,192	167,964	資本財・サービス	
ARKEMA		22.2	216	30,426	素材	
ADP		11.1	135	19,129	資本財・サービス	
GETLINK SE		173.45	293	41,321	資本財・サービス	
BOLLORE		324	153	21,669	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>	9,789.34	52,458	7,386,118	
			56銘柄	<2.9%>		
		百株	千ユーロ	千円		
ユーロ (ドイツ)						
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		179.02	489	68,963	資本財・サービス	
BAYER AG-REG		386.59	2,459	346,241	ヘルスケア	
EVONIK INDUSTRIES AG		80	197	27,855	素材	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		813.28	752	105,990	金融	
COMMERZBANK AG		420.31	316	44,514	金融	
VOLKSWAGEN AG		12	229	32,347	一般消費財・サービス	
VOLKSWAGEN AG-PREF		73	1,052	148,173	一般消費財・サービス	
SIEMENS AG-REG		297	3,243	456,731	資本財・サービス	
E. ON SE		883.44	803	113,069	公益事業	
UNIPER SE		66.5	137	19,306	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		130.27	1,011	142,352	一般消費財・サービス	
GEA GROUP AG		58	201	28,370	資本財・サービス	

銘柄		2022年6月15日現在			業種等
		株数	価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
CONTINENTAL AG		43.42	306	43,173	一般消費財・サービス
BASF SE		361.41	1,748	246,239	素材
ALLIANZ SE-REG		159	2,894	407,581	金融
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		68	399	56,278	生活必需品
RHEINMETALL AG		18.13	374	52,764	資本財・サービス
RWE AG		252.79	964	135,857	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		219.5	125	17,653	資本財・サービス
BRENNTAG SE		60.9	431	60,691	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		164.83	488	68,765	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		38.39	109	15,453	コミュニケーション・サービス
SAP SE		405.92	3,531	497,292	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		55.14	1,209	170,335	金融
ZALANDO SE		87.83	243	34,218	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG		57.08	283	39,927	素材
KION GROUP AG		27	106	14,944	資本財・サービス
COVESTRO AG		73	289	40,702	素材
RATIONAL AG		1.9	110	15,516	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG		12.1	381	53,648	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		60.35	413	58,172	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE		64.43	205	28,875	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		15.92	179	25,273	ヘルスケア
BECHTLE AG		32.38	118	16,668	情報技術
NEMETSCHEK SE		22.84	131	18,478	情報技術
SCOUT24 AG		36	189	26,682	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		110.97	552	77,747	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG		28	162	22,936	資本財・サービス
HELLOFRESH SE		65.16	188	26,532	生活必需品
SIEMENS ENERGY AG		172.9	269	37,989	資本財・サービス
BEIERSDORF AG		39.8	370	52,138	生活必需品
MERCK KGAA		50.86	831	117,047	ヘルスケア
ADIDAS AG		72	1,184	166,804	一般消費財・サービス
PUMA SE		41.63	275	38,744	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		41.01	239	33,750	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		1,275.96	2,273	320,109	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		80.7	407	57,335	ヘルスケア
MERCEDES-BENZ GROUP N AG		325	2,024	285,039	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		513.88	1,247	175,603	情報技術
HANNOVER RUECK SE		23.78	331	46,624	金融
DEUTSCHE POST AG-REG		390.03	1,348	189,900	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		74.78	1,135	159,883	金融
MTU AERO ENGINES AG		21.04	355	49,991	資本財・サービス
SYMRISE AG		52.28	500	70,459	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		413.12	114	16,170	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		22	158	22,271	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		280	885	124,658	不動産
LEG IMMOBILIEN SE		28	232	32,784	不動産
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,860.57 58銘柄	41,219	5,803,636 <2.3%>	
ユーロ（ポルトガル）		百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS		105	197	27,823	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		1,094	490	69,130	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		187.5	236	33,316	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,386.5 3銘柄	925	130,271 <0.1%>	
ユーロ（スペイン）		百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA		2,044.87	901	126,942	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA		121	230	32,514	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		2,623.74	1,100	154,935	金融
IBERDROLA SA		2,279.05	2,249	316,782	公益事業
REPSOL SA		572.01	877	123,587	エネルギー
GRIFOLS SA		118.3	208	29,340	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		6,823.35	1,789	251,998	金融
AMADEUS IT GROUP SA		177.28	898	126,502	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA		103	278	39,257	公益事業
CAIXABANK SA		1,749.27	562	79,233	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		88.76	213	30,018	資本財・サービス
AENA SME SA		29	380	53,551	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA		214.6	761	107,205	コミュニケーション・サービス
ACCIONA SA		10.28	182	25,648	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		429.2	966	136,030	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		94.14	168	23,746	資本財・サービス
ENAGAS SA		98.84	206	29,113	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		157	282	39,712	公益事業
FERROVIAL SA		190.18	442	62,310	資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA		110	238	33,516	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	18,033.87 20銘柄	12,939	1,821,951 <0.7%>	

銘柄		2022年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（イタリア）					
PRYSMIAN SPA		100.4	277	39,129	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		435.47	675	95,128	金融
MEDIOBANCA SPA		223.65	200	28,208	金融
UNICREDIT SPA		832.17	808	113,830	金融
TELECOM ITALIA SPA		3,787.82	93	13,231	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO		6,498.77	1,150	161,959	金融
ATLANTIA SPA		195.31	434	61,131	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		192	175	24,649	金融
MONCLER SPA		78	299	42,150	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		38.5	144	20,371	ヘルスケア
ENI SPA		993.14	1,307	184,161	エネルギー
DIASORIN SPA		10	111	15,699	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		128	118	16,656	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA		199	145	20,482	情報技術
AMPLIFON SPA		47	123	17,450	ヘルスケア
ENEL SPA		3,200.36	1,706	240,310	公益事業
SNAM SPA		793.5	403	56,800	公益事業
TERNA SPA		554.64	400	56,445	公益事業
FINECOBANK SPA		232	239	33,759	金融
国小計		株数、金額 銘柄数＜比率＞	18,539.73 19銘柄	8,817 ＜0.5%＞	
ユーロ（フィンランド）					
UPM-KYMMENE OYJ		210.01	642	90,511	素材
NOKIA OYJ		2,129.8	962	135,543	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		170	122	17,291	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		214	333	46,959	素材
ELISA OYJ		54	283	39,932	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		196.22	796	112,168	金融
FORTUM OYJ		169	280	39,440	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		104	227	32,068	生活必需品
KONE OYJ-B		133.75	598	84,254	資本財・サービス
NESTE OYJ		166.46	697	98,273	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		40	146	20,573	ヘルスケア
国小計		株数、金額 銘柄数＜比率＞	3,587.24 11銘柄	5,092 ＜0.3%＞	
ユーロ（オーストリア）					
VERBUND AG		26	245	34,503	公益事業
OMV AG		56.5	275	38,733	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		135.46	358	50,409	金融
VOESTALPINE AG		42.5	108	15,295	素材
国小計		株数、金額 銘柄数＜比率＞	260.46 4銘柄	986 ＜0.1%＞	
ユーロ通貨計		株数、金額 銘柄数＜比率＞	71,877.82 223銘柄	158,590 ＜8.7%＞	
ファンド合計		株数、金額 銘柄数＜比率＞	435,491.09 1,214銘柄	— ＜94.1%＞	

（注1）邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

（注2）< >内は純資産総額に対する評価額の比率。

（注3）評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	数	2022年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)			
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5.737	1,062	143,439
SIMON PROPERTY GROUP INC	13.307	1,284	173,387
BOSTON PROPERTIES INC	6	543	73,423
VORNADO REALTY TRUST	6.297	182	24,620
SBA COMMUNICATIONS CORP	4.4	1,307	176,466
EQUITY RESIDENTIAL	14.5	997	134,646
EQUINIX INC	3.708	2,293	309,636
AMERICAN TOWER CORP	18.5	4,338	585,682
HOST HOTELS & RESORTS INC	29.043	498	67,364
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	13	428	57,813
KIMCO REALTY CORP	25	480	64,804
INVITATION HOMES INC	24.7	830	112,147
VICI PROPERTIES INC	39	1,097	148,115
VENTAS INC	16.2	784	105,924
WEYERHAEUSER CO	30.314	1,043	140,870
CROWN CASTLE INTL CORP	17.5	2,763	373,113
IRON MOUNTAIN INC	11.8	557	75,322
SUN COMMUNITIES INC	4.7	709	95,841
PROLOGIS INC	30.002	3,320	448,236
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6.2	839	113,313
CAMDEN PROPERTY TRUST	4	504	68,045
DUKE REALTY CORP	15.5	793	107,143
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2.6	666	89,936
WELLTOWER INC	18.1	1,401	189,263
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	21.9	513	69,305
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4.7	752	101,546
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7.2	494	66,752
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	63.4	375	50,673
REALTY INCOME CORP	23.995	1,506	203,412
PUBLIC STORAGE	6.4	1,906	257,352
REGENCY CENTERS CORP	6.3	356	48,141
UDR INC	12.9	545	73,705
WP CAREY INC	7.7	623	84,174
DIGITAL REALTY TRUST INC	11.5	1,432	193,409
EXTRA SPACE STORAGE INC	5.4	857	115,730
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	24.2	361	48,812
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	555.703 36銘柄	5,191,577 <2.0%>
(カナダ)			
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3.4	150	15,652
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5.8	116	12,153
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	9.2 2銘柄	27,805 <0.0%>
(オーストラリア)			
DEXUS/AU	40.978	371	34,602
LENLEASE GROUP	25.3	243	22,706
TRANSURBAN GROUP	116.72	1,630	151,806
APA GROUP	45.041	517	48,223
SCENTRE GROUP	190.722	486	45,278
GPT GROUP	73.031	303	28,284
MIRVAC GROUP	144.9	297	27,654
STOCKLAND	91.123	328	30,540
GOODMAN GROUP	63.909	1,144	106,563
VICINITY CENTRES	137.273	239	22,301
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	928.997 10銘柄	517,962 <0.2%>
(香港)			
LINK REIT	87.9	6,012	103,412
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	107	817	14,060
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	152	1,629	28,026
香港・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	346.9 3銘柄	145,499 <0.1%>
(シンガポール)			
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	134.5	369	35,859
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	220.07	466	45,231
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	125.3	202	19,679
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	87.5	154	14,930
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	567.37 4銘柄	115,701 <0.0%>

銘 柄		2022年 6 月15日現在		
		口 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
		千口	千イギリス・ポンド	千円
(イギリス)				
LAND SECURITIES GROUP PLC		28.317	207	33,604
SEGRO PLC		48.274	460	74,765
BRITISH LAND CO PLC		35.395	179	29,086
イギリス・ポンド通貨計	口 数 、 金 額	111.986	847	137,456
	銘 柄 数 < 比 率 >	3 銘柄		<0.1%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ (ベルギー)				
WAREHOUSES DE PAUW SCA		6.192	190	26,817
国 小 計	口 数 、 金 額	6.192	190	26,817
	銘 柄 数 < 比 率 >	1 銘柄		<0.0%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ (フランス)				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		4.6	246	34,650
GECINA SA		1.817	173	24,483
KLEPIERRE		8.527	160	22,595
COVIVIO		2	113	15,966
国 小 計	口 数 、 金 額	16.944	693	97,696
	銘 柄 数 < 比 率 >	4 銘柄		<0.0%>
ユ ー ロ 通 貨 計	口 数 、 金 額	23.136	884	124,513
	銘 柄 数 < 比 率 >	5 銘柄		<0.0%>
フ ァ ン ド 合 計	口 数 、 金 額	2,543.292	—	6,260,515
	銘 柄 数 < 比 率 >	63 銘柄		<2.4%>

(注1) 邦貨換算金額は、2022年 6 月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘 柄 別		2022年 6 月15日現在	
		買 建 額	売 建 額
外	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	百万円 5,352	百万円 —
	S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	516	—
	SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	550	—
	FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	463	—
国	SWISS MKT IX FUTR (ドイツ)	447	—
	EURO STOXX 50 (ドイツ)	1,344	—

(注1) 外貨建の評価額は、2022年 6 月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第22期 (決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日)

外国株式インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数(円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の株式(預託証券を含みます。)
株式組入制限	無制限

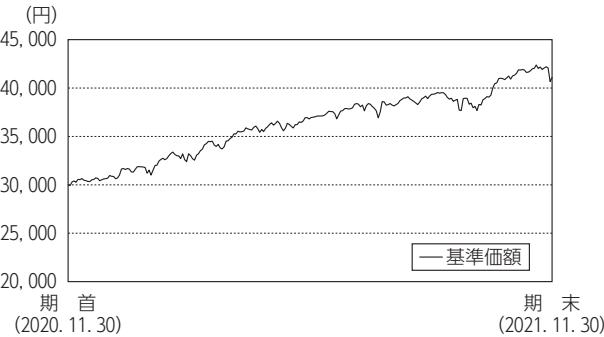
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



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

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) MSCIコクサイ指数(円ベース)は、MSCI Inc. の承諾を得て、MSCIコクサイ指数(米ドルベース)をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIコクサイ指数(米ドルベース)は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。またMSCI Inc. は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。
(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：30,015円 期末：41,095円 騰落率：36.9%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。

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

○為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると円安が進みました。

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

外国株式を中心に組み入れ、S&P500先物取引等の株価指数先物も一部利用し、株式組入比率(投資信託証券、株価指数先物を含む。)につきましては、当作成期を通じておおむね100%程度の水準を維持しました。

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

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

*ベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ベース)です。

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

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

(注 1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。
(注 2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2020年12月 1 日から2021年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 15,282.5 (△ 828.54)	千アメリカ・ドル 166,102 (△ 1,904)	百株 1,904.86	千アメリカ・ドル 9,623
	カナダ	百株 1,880 (214.08)	千カナダ・ドル 10,122 (△ 32)	百株 356.08	千カナダ・ドル 732
	オーストラリア	百株 1,960.2 (301.86)	千オーストラリア・ドル 5,090 (△ 238)	百株 1,186.06	千オーストラリア・ドル 243
	香港	百株 5,643 (201.17)	千香港・ドル 21,457 (△ 19)	百株 2,647.4	千香港・ドル 5,196
	シンガポール	百株 1,052 (1,013.12)	千シンガポール・ドル 801 (△ 98)	百株 1,953.12	千シンガポール・ドル 132
	ニュージーランド	百株 344 (292 —)	千ニュージーランド・ドル — (292 —)	百株 —	千ニュージーランド・ドル —
	イギリス	百株 11,569.5 (△ 1,546.66)	千イギリス・ポンド 7,107 (1,666)	百株 107.38	千イギリス・ポンド 63
	イスラエル	百株 294.5 (944 —)	千イスラエル・シェケル — (944 —)	百株 —	千イスラエル・シェケル —
	スイス	百株 548.91 (548.91 —)	千スイス・フラン 4,917 (△ 90)	百株 36	千スイス・フラン 364
	デンマーク	百株 290.45 (650.6)	千デンマーク・クローネ 11,548 (11,548 —)	百株 411	千デンマーク・クローネ 1,511
	ノルウェー	百株 333.5 (333.5 —)	千ノルウェー・クローネ 5,172 (5,172 —)	百株 —	千ノルウェー・クローネ —
	スウェーデン	百株 1,523 (2,840.43)	千スウェーデン・クローネ 32,328 (32,328 —)	百株 663.5	千スウェーデン・クローネ 2,486
	ユーロ (アイルランド)	百株 57.2 (57.2 —)	千ユーロ 414 (414 —)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (オランダ)	百株 1,074.8 (△ 72)	千ユーロ 4,391 (△ 98)	百株 335.09	千ユーロ 482
	ユーロ (ベルギー)	百株 51 (51 —)	千ユーロ 327 (327 —)	百株 28.4	千ユーロ 138
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 143.5 (143.5 —)	千ユーロ 242 (242 —)	百株 177	千ユーロ 111
	ユーロ (フランス)	百株 748 (△ 93.56)	千ユーロ 4,645 (△ 164)	百株 230	千ユーロ 137
	ユーロ (ドイツ)	百株 804.1 (354.42)	千ユーロ 4,935 (△ 88)	百株 663.32	千ユーロ 919
	ユーロ (ポルトガル)	百株 134 (134 —)	千ユーロ 78 (78 —)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (スペイン)	百株 2,106.38 (8,378.69)	千ユーロ 1,626 (1,626 156)	百株 8,900.19	千ユーロ 346

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ユーロ (イタリア)	百株 2,231 (2,231 —)	千ユーロ 972 (△ 1)	百株 241.75	千ユーロ 129
	ユーロ (フィンランド)	百株 269.5 (269.5 —)	千ユーロ 642 (642 —)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (オーストリア)	百株 26.8 (26.8 —)	千ユーロ 104 (104 —)	百株 21	千ユーロ 74
	ユーロ (その他)	百株 — (1 —)	千ユーロ — (△ 2,409)	百株 —	千ユーロ —
ユーロ (ユーロ通貨計)		百株 7,646.28 (8,567.55)	千ユーロ 18,379 (△ 2,606)	百株 10,596.75	千ユーロ 2,340

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
(注 3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 新株予約権証券

(2020年12月 1 日から2021年11月30日まで)

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

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) ()内は、割当、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
(注 3) 単位未満は切捨て。

(3) 投資信託証券

(2020年12月 1 日から2021年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 56.01 (△ 27.261)	千アメリカ・ドル 4,314 (4,314 —)	千口 9.654 (9.654 —)	千アメリカ・ドル 441 (441 —)
	カナダ	千口 1.6 (1.6 —)	千カナダ・ドル 50 (50 —)	千口 6.9 (6.9 —)	千カナダ・ドル 125 (125 —)
	オーストラリア	千口 79.6 (10.6)	千オーストラリア・ドル 461 (461 —)	千口 10.6 (10.6 —)	千オーストラリア・ドル 9 (9 —)
	香港	千口 27 (27 —)	千香港・ドル 985 (985 —)	千口 — (0 —)	千香港・ドル — (0 —)
	シンガポール	千口 75 (12.101)	千シンガポール・ドル 173 (173 19)	千口 63 (63 —)	千シンガポール・ドル 89 (89 —)
	イギリス	千口 6.55 (6.55 —)	千イギリス・ポンド 63 (63 —)	千口 — (0 —)	千イギリス・ポンド — (0 —)
	ユーロ (フランス)	千口 1.75 (1.75 —)	千ユーロ 87 (87 —)	千口 0.95 (0.95 —)	千ユーロ 58 (58 —)

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2020年12月 1 日から2021年11月30日まで)

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

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
株 式

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

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

銘柄	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TE CONNECTIVITY LTD		106.75	119.25	1,900	216,245	情報技術
APPLE INC		5,678	6,056	97,041	11,040,393	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		102	110.5	1,252	142,461	金融
BOEING CO/THE		175.6	201.3	3,995	454,602	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP		51.65	55.65	659	75,000	金融
BECTON DICKINSON AND CO		94.19	106.19	2,586	294,310	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR		67	76	76	8,750	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC		43.5	49	443	50,479	資本財・サービス
CDK GLOBAL INC		40	—	—	—	情報技術
NISOURCE INC		126	139	350	39,930	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC		44.5	49	468	53,305	資本財・サービス
BOSTON BEER COMPANY INC-A		—	3.2	141	16,105	生活必需品
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		260.21	300.71	1,714	195,041	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC		1,355.04	1,502.04	7,759	882,802	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		455.5	488.5	13,781	1,567,928	金融
ANSYS INC		27.8	32	1,272	144,795	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP		444.17	490.67	2,996	340,858	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE		222	249.5	3,714	422,605	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		740	810	4,425	503,527	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO		997.7	1,097.7	17,698	2,013,526	金融
T ROWE PRICE GROUP INC		77	83	1,718	195,487	金融
LKQ CORP		91.5	102.5	590	67,169	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD		16.6	18.3	283	32,291	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B		100.62	114.12	846	96,324	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC		93	100.5	1,876	213,459	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC		40.1	42.2	1,239	141,012	金融
DOLLAR GENERAL CORP		83.5	88.5	1,991	226,614	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC		62.6	71.5	4,810	547,309	情報技術
CATERPILLAR INC		176.5	198.5	3,889	442,452	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC		79.5	85.5	559	63,626	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC		73	83	402	45,741	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES		—	18	675	76,858	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP		93	106.5	651	74,068	公益事業
MOSAIC CO/THE		120.5	128	461	52,468	素材
DELTA AIR LINES INC		51.5	57.5	208	23,707	資本財・サービス
CORNING INC		246	294	1,130	128,642	情報技術
CISCO SYSTEMS INC		1,382.5	1,529.5	8,528	970,286	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC		42	—	—	—	ヘルスケア
MORGAN STANLEY		459.02	506.52	4,924	560,305	金融
ZILLOW GROUP INC - A		—	21	113	12,939	不動産
MSCI INC		28.2	30	1,936	220,312	金融
FAIR ISAAC CORP		10	10	350	39,894	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC		11	12	386	43,977	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		75	85	667	75,893	情報技術
BROADCOM INC		130.52	148.12	8,359	951,003	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC		37.8	43.5	786	89,448	ヘルスケア
ARAMARK		72	85	292	33,247	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD		72.5	—	—	—	素材
DTE ENERGY COMPANY		62.5	71.7	799	90,945	公益事業
CENTENE CORP		189.87	213.87	1,577	179,497	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC		35	39.5	512	58,286	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP		143	157	765	87,130	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO		61.5	75	1,236	140,628	金融
GARTNER INC		29.2	31.5	1,023	116,472	情報技術
SPLUNK INC		51.8	60.1	751	85,469	情報技術
DOMINION ENERGY INC		276.41	294.41	2,190	249,269	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP		128.5	143	1,241	141,297	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP		42.5	50	404	45,997	資本財・サービス
DEERE & CO		96.5	108	3,759	427,703	資本財・サービス
POOL CORP		—	14.8	828	94,309	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC		98.84	106.84	1,284	146,178	情報技術
VMWARE INC-CLASS A		28.3	74.8	900	102,443	情報技術
CABLE ONE INC		1.7	2	365	41,548	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC		21.9	24	704	80,104	一般消費財・サービス
NASDAQ INC		37	42	878	99,905	金融
VAIL RESORTS INC		13.6	14.9	496	56,525	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC		46	—	—	—	金融
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A		—	184	677	77,119	コミュニケーション・サービス
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		22.5	—	—	—	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC		24.3	26.3	363	41,333	金融
CONSOLIDATED EDISON INC		109	126	1,012	115,181	公益事業
COGNEX CORP		55	65	511	58,169	情報技術
TELEFLEX INC		15	17.2	531	60,456	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		28	30.5	597	67,966	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES		24	27.1	1,212	137,934	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A		7.1	7.9	592	67,369	ヘルスケア
CATALENT INC		51.5	62	830	94,491	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A		44.8	50.5	1,485	168,966	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC		20	21.2	630	71,761	ヘルスケア
IDEX CORP		25.2	27.6	646	73,609	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO		268	293.5	2,280	259,485	生活必需品

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ROLLINS INC		49.25	80.87	285	32,505	資本財・サービス
AMETEK INC		74.25	84.45	1,182	134,519	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC		82	89	834	94,926	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION		43.5	55.5	320	36,515	資本財・サービス
HEICO CORP		14	16	224	25,517	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC		31	—	—	—	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC		—	23.2	985	112,066	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC		12.4	14	657	74,769	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A		88.5	97	864	98,405	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC		13	15	781	88,959	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP		144.4	160.6	8,911	1,013,846	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC		26	28	331	37,739	情報技術
EPAM SYSTEMS INC		18	20	1,268	144,299	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC		43.5	46	427	48,681	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC		8.8	10	1,678	190,917	一般消費財・サービス
UGI CORP		70.5	76.5	332	37,772	公益事業
CUMMINS INC		48.5	53.5	1,162	132,245	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC		253	283.5	1,709	194,522	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE		46.5	51	993	113,028	情報技術
SIGNATURE BANK		16.5	—	—	—	金融
COSTAR GROUP INC		13.1	145	1,159	131,956	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP		17.1	20.2	1,463	166,501	金融
AMERCO		2.9	3.7	265	30,191	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE		31.5	36.4	1,300	147,932	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC		14.8	16.1	1,986	226,049	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC		25	27.6	420	47,826	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN		90.16	100.16	1,382	157,333	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP		11.7	14.2	231	26,362	情報技術
DEXCOM INC		30	35.4	2,021	229,971	ヘルスケア
NORDSON CORP		17.3	19.1	500	56,965	資本財・サービス
COPART INC		68.5	78.3	1,158	131,850	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC		51.5	—	—	—	エネルギー
SEAGEN INC		39.5	49.5	818	93,096	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC		25.1	27.1	1,719	195,617	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC		17.1	18.9	1,104	125,622	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP		—	14	671	76,404	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC		28	33.5	283	32,296	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC		—	77.5	791	90,005	ヘルスケア
NIELSEN HOLDINGS PLC		111	—	—	—	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC		673.81	733.81	1,174	133,660	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC		90	98	2,253	256,348	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC		12.2	14	494	56,218	金融
COTERRA ENERGY INC		124	290	604	68,758	エネルギー
T-MOBILE US INC		183.27	226.77	2,571	292,567	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C		45.5	59.5	322	36,730	不動産
COCA-COLA CO/THE		1,336	1,486.5	8,113	923,052	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE		65	73.5	380	43,332	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC		55.5	61.5	779	88,692	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC		95	111.5	376	42,813	金融
CSX CORP		252.5	821	2,924	332,709	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS		31.3	34.6	1,010	114,912	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC		43.75	51.75	861	98,028	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC		27.5	29.5	282	32,196	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC		138.8	164.7	58,659	6,673,641	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP		202.4	226.9	2,512	285,791	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP		1,384.05	1,536.05	9,460	1,076,324	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC		42	—	—	—	その他
AES CORP		219	246	581	66,106	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD		13.5	15	396	45,116	金融
EOG RESOURCES INC		193	210	1,856	211,178	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC		52	60	685	77,996	情報技術
ABIOMED INC		15.2	16.1	513	58,453	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP		49.5	56.8	682	77,694	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC		101.4	111.7	1,713	194,967	ヘルスケア
FORD MOTOR CO		1,263.23	1,433.23	2,819	320,736	一般消費財・サービス
NOVAVAX INC		—	26	504	57,373	ヘルスケア
DISCOVERY INC - A		46.9	62.9	154	17,596	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP		48.5	62.5	541	61,556	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A		48.87	56.37	155	17,726	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A		8.5	8.5	132	15,118	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C		103.89	113.89	273	31,162	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV		40	—	—	—	資本財・サービス
FORTINET INC		48	50.5	1,733	197,239	情報技術
MARKEL CORP		4.6	5.1	634	72,165	金融
NEXTERA ENERGY INC		640.8	711.8	6,310	717,981	公益事業
MASIMO CORP		17	19.2	553	62,973	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC		472.08	536.08	2,036	231,639	素材
INSULET CORP		22.2	24.4	721	82,133	ヘルスケア
US BANCORP		441.5	512	2,938	334,356	金融
UNITED RENTALS INC		23.5	25.7	917	104,388	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC		19	22.5	519	59,149	情報技術

銘	柄	期	首	当	期		末	業 種 等
		株	数	株	数	評 価 額		
						外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株		百株		千アメリカ・ドル	千円	
FASTENAL CO		186		210.5		1,282	145,942	資本財・サービス
FISERV INC		185.83		219.33		2,137	243,218	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO		2,880.5		398.56		3,921	446,186	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO		426		476.5		2,852	324,509	一般消費財・サービス
ZENDESK INC		—		43.7		415	47,286	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP		79.5		87.5		1,701	193,562	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC		107.6		123.5		4,773	543,111	金融
ALPHABET INC-CL A		98.2		109		31,725	3,609,427	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C		98.87		105.57		30,850	3,509,862	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING		33.5		39		339	38,659	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC		200.5		220.5		1,400	159,348	生活必需品
FIRSTENERGY CORP		180.68		197.68		771	87,823	公益事業
GENUINE PARTS CO		48.5		51		677	77,117	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD		125.84		138.84		1,806	205,551	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP		230		259		1,113	126,676	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC		71.6		75.5		1,620	184,402	資本財・サービス
HALLIBURTON CO		276		326		725	82,523	エネルギー
HOME DEPOT INC		352		385.5		15,682	1,784,244	一般消費財・サービス
ASSURANT INC		19		22.5		351	39,943	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC		318		529		813	92,503	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE		12.9		15.1		274	31,218	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE		47.4		53.9		965	109,864	生活必需品
HUMANA INC		43.5		47.2		2,020	229,871	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV		93		101		2,261	257,324	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A		23.6		28.2		626	71,250	情報技術
HENRY SCHEIN INC		45		51		376	42,803	ヘルスケア
HP INC		473		473		1,699	193,350	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE		419		476		695	79,119	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C		59.78		59.78		297	33,822	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C		65		70		420	47,823	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A		29.5		29.5		147	16,744	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD		132		144		600	68,365	金融
KRAFT HEINZ CO/THE		217.53		243.03		845	96,165	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC		—		46.9		1,203	136,975	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP		291.5		324		3,839	436,808	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO		122		137.5		649	73,868	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI		43.5		49		504	57,397	資本財・サービス
ZOETIS INC		156		173		3,867	439,995	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC		79.79		87.79		1,693	192,695	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC		76.5		88.5		943	107,331	エネルギー
ALLEGION PLC		29		33		424	48,311	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C		129.73		129.73		362	41,208	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC		85.07		94.87		1,301	148,074	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC		105		122		388	44,193	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC		24		—		—	—	ヘルスケア
JM SMUCKER CO/THE		36.7		40.5		523	59,609	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON		862		955		15,256	1,735,689	ヘルスケア
PLUG POWER INC		—		186		774	88,072	資本財・サービス
ABBVIE INC		577.72		640.72		7,489	852,066	ヘルスケア
HOLOGIC INC		83.5		91.5		695	79,084	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP		112.5		122		1,647	187,434	生活必需品
KROGER CO		255		264		1,118	127,199	生活必需品
KLA CORP		50.3		55.6		2,300	261,779	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP		82.6		90.3		3,081	350,560	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		27.8		29.3		624	70,996	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE		—		97		735	83,727	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC		244.5		260		6,463	735,304	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO		281.85		295.35		7,526	856,278	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP		48.2		52		3,538	402,610	情報技術
JONES LANG LASALLE INC		16.5		—		—	—	不動産
LOEWS CORP		83		83		457	52,039	金融
LINCOLN NATIONAL CORP		62.49		66.49		454	51,696	金融
MCDONALD'S CORP		243		270.5		6,770	770,292	一般消費財・サービス
3M CO		188.5		210.4		3,707	421,845	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A		787.5		869		29,374	3,341,971	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC		79		87.7		4,077	463,889	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS		21.1		23.1		966	109,943	素材
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC		—		19.2		666	75,843	情報技術
CONCHO RESOURCES INC		62		—		—	—	その他
PHILLIPS 66		141.5		157.5		1,100	125,180	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL		152.5		160.5		660	75,103	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS		40.5		92		800	91,051	生活必需品
METLIFE INC		255.5		270		1,617	183,969	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC		217		299.5		2,246	255,624	情報技術
ARISTA NETWORKS INC		18.7		84.8		1,073	122,139	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A		48		48		404	46,008	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC		56.58		62.28		1,616	183,871	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL		8		8.5		1,305	148,559	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO		213.73		265.23		624	71,002	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC		37.6		41.9		1,427	162,353	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.		826.21		918.21		6,876	782,336	ヘルスケア

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DUPONT DE NEMOURS INC		242.18	207.51	1,598	181,879	素材
MASCO CORP		87	91	612	69,717	資本財・サービス
M & T BANK CORP		42.89	46.89	713	81,172	金融
MARSH & MCLENNAN COS		168.5	185.2	3,093	351,935	金融
BLACK KNIGHT INC		50	56	409	46,598	情報技術
HEICO CORP-CLASS A		25	27.2	345	39,300	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A		91.22	101.72	1,533	174,481	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A		56.8	69	1,942	221,051	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A		21	27.1	724	82,477	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A		118	142	3,022	343,898	情報技術
TRANSUNION		61.5	69	787	89,593	資本財・サービス
VISTRA CORP		142.5	156.5	314	35,770	公益事業
BEIGENE LTD-ADR		14.5	—	—	—	ヘルスケア
NOVOCURE LTD		—	34.5	322	36,640	ヘルスケア
NETAPP INC		74.5	82	750	85,380	情報技術
NIKE INC -CL B		406	462	7,847	892,866	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP		84.5	90.5	2,432	276,699	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC		80	201	1,696	193,003	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		41.5	68.55	689	78,433	金融
ALLY FINANCIAL INC		125.5	136.5	651	74,091	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP		52.2	57.1	2,034	231,520	資本財・サービス
APTIV PLC		87	97.5	1,613	183,571	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP		264.61	293.11	1,623	184,743	素材
MCKESSON CORP		52.5	57.5	1,283	146,058	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS		87	—	—	—	情報技術
XYLEM INC		58.7	66.7	825	93,945	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		510	565	4,935	561,486	生活必需品
NUCOR CORP		99	109.5	1,227	139,614	素材
SUNRUN INC		39	61	291	33,214	資本財・サービス
WESTERN UNION CO		129.46	152.46	246	28,030	情報技術
GODADDY INC - CLASS A		57	60	414	47,162	情報技術
NEWELL BRANDS INC		125.42	134.42	300	34,179	一般消費財・サービス
EVERGY INC		74	82.5	538	61,253	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP		302.24	343.24	1,031	117,385	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A		8.2	9	183	20,907	金融
OKTA INC		38.6	45.1	1,008	114,734	情報技術
COUPA SOFTWARE INC		21.8	25.5	516	58,794	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C		36	56	895	101,899	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC		133.55	157.55	475	54,113	ヘルスケア
LINDE PLC		171.96	188.46	6,044	687,701	素材
WIX. COM LTD		17.8	21.3	339	38,620	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC		133	143	461	52,451	金融
KKR & CO INC		163	188	1,434	163,217	金融
PAYCHEX INC		107	117	1,447	164,698	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC		24.1	24.8	1,597	181,746	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC		611.5	667	2,900	329,946	生活必需品
P G & E CORP		355	551	682	77,606	公益事業
PFIZER INC		1,819.13	2,031.13	10,643	1,210,867	ヘルスケア
CIGNA CORP		121.6	126.2	2,519	286,595	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C		78.51	101.01	581	66,158	情報技術
ALTICE USA INC- A		109	109	174	19,829	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC		174.5	197	1,292	147,004	公益事業
STERIS PLC		28.5	36	816	92,845	ヘルスケア
SEA LTD-ADR		—	27	804	91,527	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B		54.33	54.33	187	21,318	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A		108.49	121.99	450	51,240	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP		111.2	123.3	3,002	341,577	ヘルスケア
LYFT INC-A		—	92	384	43,772	資本財・サービス
DOW INC		240.68	273.68	1,556	177,042	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A		28	38.5	374	42,618	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A		51.8	77.4	1,694	192,829	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP		41.7	46.6	1,440	163,896	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC		315	445	1,766	200,991	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO		53.5	84.5	1,549	176,274	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE		809.17	886.67	13,213	1,503,260	生活必需品
EXELON CORP		322.72	357.72	1,937	220,460	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC		73.5	—	—	—	その他
TELADOC HEALTH INC		23	51	542	61,741	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC		113.58	147.08	879	100,065	資本財・サービス
NVR INC		1.1	1.2	633	72,108	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS		355	492.02	3,549	403,874	エネルギー
TWILIO INC - A		40.5	59.5	1,744	198,496	情報技術
DOCUSIGN INC		57.5	71	1,785	203,153	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC		16.1	18.9	845	96,208	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC		—	50	564	64,262	情報技術
PEPSICO INC		454	501	8,223	935,577	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL		13	15	265	30,199	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A		80	114	284	32,359	情報技術
MONGODB INC		16.2	20.2	1,062	120,878	情報技術
SNAP INC - A		295	347.5	1,697	193,128	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC		248.18	269.18	1,254	142,680	素材

銘柄	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		128	143	1,501	170,874	金融
AMCOR PLC		522	564	653	74,304	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A		46.5	69	1,549	176,290	情報技術
ROKU INC		33.5	42.2	976	111,039	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC		60	65.5	1,135	129,156	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A		208.5	230.5	8,432	959,325	情報技術
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A		126	—	—	—	情報技術
10X GENOMICS INC-CLASS A		—	27.5	397	45,193	ヘルスケア
PENTAIR PLC		55.05	59.25	455	51,769	資本財・サービス
QUALCOMM INC		364.5	408.5	7,505	853,932	情報技術
INVESCO LTD		120	141	327	37,280	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC		23.5	23.5	534	60,762	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP		92	100	709	80,685	金融
DATADOG INC - CLASS A		43.5	68	1,244	141,567	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A		131	199	806	91,783	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC		25	30.5	435	49,516	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS		33.2	38	2,486	282,914	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC		74	82.5	1,140	129,743	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC		13.5	15	3,273	372,370	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC		118	131	1,462	166,416	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA		31	34.5	461	52,478	素材
RESMED INC		48.5	53.3	1,369	155,794	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC		43.5	47.3	741	84,325	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC		36	41.5	476	54,183	資本財・サービス
MODERNA INC		88	123.7	4,558	518,616	ヘルスケア
RALPH LAUREN CORP		14.5	—	—	—	一般消費財・サービス
HUBSPOT INC		—	15.9	1,354	154,105	情報技術
PERKINELMER INC		37.3	41.3	764	87,029	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP		266.37	302.37	1,692	192,574	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP		137.18	149.38	1,248	142,043	資本財・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC		58	63	462	52,573	金融
AVANTOR INC		155	193.5	769	87,573	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE		47	57	323	36,834	金融
DYNATRACE INC		61	67	431	49,142	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A		13.3	158.2	1,693	192,691	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP		321.35	351.85	828	94,230	金融
ROYALTY PHARMA PLC- CL A		—	65.5	270	30,806	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP		25.3	28.8	376	42,860	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC		81.7	93.7	1,256	142,932	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP		610.18	701.18	8,053	916,195	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A		65	94	417	47,472	一般消費財・サービス
ZSCALER INC		24	30	1,067	121,479	情報技術
EDISON INTERNATIONAL		123.5	140	924	105,234	公益事業
ETSY INC		—	46.5	1,308	148,911	一般消費財・サービス
TESLA INC		242.7	296.2	33,677	3,831,505	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A		10	70	2,553	290,507	情報技術
NORTONLIFELOCK INC		178.5	214	541	61,621	情報技術
DRAFTKINGS INC - CL A		—	117	411	46,855	一般消費財・サービス
UNITY SOFTWARE INC		—	21	357	40,694	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC		50.22	58.52	1,077	122,603	資本財・サービス
SYNOPSYS INC		50.4	55.8	1,985	225,919	情報技術
CARVANA CO		—	26.2	764	87,029	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A		—	32.5	223	25,387	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A		—	85	1,624	184,792	情報技術
PPD INC		—	44	207	23,627	ヘルスケア
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		46.85	47.85	3,197	363,755	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC		386.21	433.21	542	61,706	ヘルスケア
DOORDASH INC - A		—	27	494	56,216	一般消費財・サービス
AIRBNB INC-CLASS A		—	46	828	94,243	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A		108.5	121.5	1,190	135,410	不動産
TWITTER INC		259.5	292	1,336	152,085	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE		347.5	386.5	2,427	276,232	公益事業
SYSCO CORP		160	187.5	1,372	156,149	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE		84.03	91.03	1,387	157,832	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR		—	20	100	11,488	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY		43	43	264	30,096	金融
STEEL DYNAMICS INC		66	76.5	469	53,438	素材
SCHLUMBERGER LTD		460.02	503.52	1,492	169,851	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		50.5	58.5	338	38,535	資本財・サービス
AT&T INC		2,332.91	2,589.91	6,187	703,928	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO		47	55.5	247	28,123	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP		129	155	976	111,131	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC		—	75	701	79,764	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE		26.9	91.7	3,065	348,744	素材
SEMPRA ENERGY		96.7	114	1,415	161,084	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B		—	65	325	37,019	情報技術
CLARIVATE PLC		—	125	285	32,467	資本財・サービス
OAK STREET HEALTH INC		—	36	110	12,561	ヘルスケア
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A		—	560	1,179	134,239	情報技術
TIFFANY & CO		36.5	—	—	—	その他
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS		76.5	79.5	827	94,119	情報技術

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TEXAS INSTRUMENTS INC		297. 5	335	6, 511	740, 839	情報技術
SALESFORCE. COM INC		294. 21	352. 16	10, 449	1, 188, 896	情報技術
WESTROCK CO		85. 3	98. 8	455	51, 841	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION		244. 84	259. 34	2, 032	231, 202	資本財・サービス
TERADYNE INC		55	60. 5	934	106, 309	情報技術
UNION PACIFIC CORP		219. 8	240. 8	5, 766	656, 020	資本財・サービス
MARATHON PETROLEUM CORP		215. 88	234. 88	1, 451	165, 090	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP		494. 79	549. 29	4, 555	518, 314	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		230. 5	262	5, 361	609, 985	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC		62. 44	70. 44	1, 878	213, 724	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC		43. 5	43. 5	270	30, 807	金融
AMEREN CORPORATION		80. 5	92	782	89, 062	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC		310. 16	342. 16	15, 465	1, 759, 524	ヘルスケア
VERISIGN INC		33. 7	37	904	102, 905	情報技術
VALERO ENERGY CORP		131. 42	147. 92	1, 008	114, 722	エネルギー
ULTA BEAUTY INC		17. 6	18. 9	758	86, 315	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL		86. 88	98. 88	493	56, 191	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B		25	28. 3	343	39, 045	ヘルスケア
ANTHEM INC		83	89. 2	3, 712	422, 391	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE		591. 62	658. 62	9, 735	1, 107, 558	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1, 274. 22		1, 499. 22	7, 370	838, 503	金融
WASTE MANAGEMENT INC	140		152	2, 535	288, 499	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	402		438	1, 226	139, 577	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	37		42. 5	963	109, 614	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	19. 5		23. 2	516	58, 801	一般消費財・サービス
WALMART INC	464		561	8, 001	910, 335	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	67. 5		76. 5	944	107, 487	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	30. 5		37	307	34, 938	一般消費財・サービス
WABTEC CORP	58. 61		65. 11	602	68, 497	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	394		438	3, 095	352, 157	一般消費財・サービス
WATERS CORP	20. 5		22. 3	760	86, 569	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	17. 6		18. 9	1, 147	130, 563	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	247		265	1, 221	138, 926	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	41. 73		47. 43	1, 092	124, 321	金融
WESTERN DIGITAL CORP	97. 5		112. 5	663	75, 502	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	104. 8		114. 3	1, 034	117, 672	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	168		182. 5	1, 172	133, 402	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	552		612. 5	12, 022	1, 367, 829	情報技術
PPL CORP	248		279	793	90, 273	公益事業
PULTEGROUP INC	89		94. 5	486	55, 379	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	78. 5		85. 3	1, 342	152, 711	素材
NORTHERN TRUST CORP	64		73	875	99, 612	金融
NVIDIA CORP	201		903. 8	30, 165	3, 431, 898	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	138. 43		154. 63	3, 106	353, 393	金融
HD SUPPLY HOLDINGS INC	53		—	—	—	その他
TYSON FOODS INC-CL A	98		108. 5	888	101, 073	生活必需品
NETFLIX INC	144		160. 7	10, 667	1, 213, 687	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	129. 2		142. 4	9, 238	1, 051, 062	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	79. 5		86. 5	316	36, 047	公益事業
GLOBE LIFE INC	32. 25		36. 55	323	36, 788	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	57		64. 5	1, 383	157, 366	金融
TEXTRON INC	71. 5		83	604	68, 734	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	131. 37		141. 37	308	35, 094	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	67. 5		—	—	—	公益事業
OMNICOM GROUP	71. 5		79. 5	536	61, 024	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	720. 33		681. 33	6, 332	720, 423	情報技術
MASTERCARD INC - A	292		320. 5	10, 352	1, 177, 800	情報技術
ONEOK INC	144		164	1, 024	116, 539	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	311. 52		347. 52	450	51, 200	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	34. 2		38	1, 829	208, 156	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	98		108. 5	1, 358	154, 609	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	37		42. 5	720	82, 005	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	60. 5		69. 5	315	35, 842	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	2, 556. 01		2, 794. 01	12, 737	1, 449, 189	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	12. 1		17. 2	742	84, 512	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	58. 5		67. 5	589	67, 118	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	226		247. 5	3, 907	444, 503	金融
ANALOG DEVICES INC	121. 99		193. 91	3, 552	404, 160	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	383		441. 5	7, 148	813, 265	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	283. 22		311. 72	1, 712	194, 876	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	55		59. 5	921	104, 870	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	59		84. 5	590	67, 189	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	27. 5		30. 3	653	74, 298	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	179		191. 5	1, 526	173, 663	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	197		215. 5	1, 958	222, 765	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	76. 2		82. 4	2, 444	278, 136	金融
AMGEN INC	192. 5		208. 5	4, 242	482, 652	ヘルスケア
EATON CORP PLC	130. 86		145. 86	2, 441	277, 758	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	55. 8		62. 5	1, 418	161, 389	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	302		332. 5	5, 028	572, 042	情報技術
CME GROUP INC	118		131. 2	2, 956	336, 341	金融

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
NOV INC		116.94	—	—	—	エネルギー
ECOLAB INC		84.5	94	2,135	242,922	素材
EQUIFAX INC		40.5	44.3	1,258	143,166	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC		411.5	456.5	3,225	366,927	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC		115	255	896	102,032	生活必需品
HORMEL FOODS CORP		96	105.5	448	50,999	生活必需品
STATE STREET CORP		117.43	124.63	1,161	132,135	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP		502.9	525.4	4,208	478,795	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC		169	182	1,383	157,428	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO		60	70	288	32,811	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC		45.5	49.8	539	61,416	素材
CARDINAL HEALTH INC		94.5	104	493	56,166	ヘルスケア
FEDEX CORP		82	92	2,213	251,800	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP		151.04	165.04	2,426	276,053	金融
FMC CORP		42	46.5	481	54,775	素材
CERNER CORP		100.5	108.5	790	89,938	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		28.24	90.13	1,326	150,929	素材
CITRIX SYSTEMS INC		38	46	378	43,107	情報技術
INTEL CORP		1,386	1,465	7,325	833,365	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC		124	142	483	54,960	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP		116.5	131.5	902	102,645	金融
ILLINOIS TOOL WORKS		103	115.5	2,750	312,886	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC		346	386	242	27,534	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC		48.5	53.3	1,976	224,856	ヘルスケア
SEALED AIR CORP		50	54	346	39,441	素材
INTUITIVE SURGICAL INC		38.2	128.7	4,308	490,132	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH		40.5	43.5	483	54,988	情報技術
SNAP-ON INC		16.3	20.2	429	48,909	資本財・サービス
CARMAX INC		53.5	58	849	96,657	一般消費財・サービス
COMERICA INC		45	—	—	—	金融
INGREDION INC		21.5	—	—	—	生活必需品
DUKE ENERGY CORP		241.78	280.28	2,808	319,576	公益事業
TARGET CORP		162.8	179.5	4,472	508,827	一般消費財・サービス
DOVER CORP		48	52	893	101,637	資本財・サービス
WW GRAINGER INC		14.9	15.8	783	89,083	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC		42.5	47.2	689	78,449	資本財・サービス
CINTAS CORP		29.4	34.2	1,486	169,150	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC		158	173	545	62,018	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC		47.5	54.5	290	33,042	生活必需品
CLOROX COMPANY		40.5	44.3	749	85,256	生活必需品
ENTERGY CORP		66.5	74.2	779	88,697	公益事業
MICROSOFT CORP		2,359	2,596	87,389	9,942,263	情報技術
INCYTE CORP		60	69.3	487	55,481	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP		429.69	477.69	4,395	500,099	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC		438.98	488.98	5,392	613,501	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC		366.5	408.5	3,518	400,336	情報技術
BLACKROCK INC		50	55.1	5,113	581,737	金融
CENTERPOINT ENERGY INC		158	211	561	63,830	公益事業
HASBRO INC		44	47	465	53,006	一般消費財・サービス
KELLOGG CO		84	93	593	67,578	生活必需品
KEYCORP		326	354	808	91,946	金融
KANSAS CITY SOUTHERN		31.5	33.5	992	112,886	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A		468.11	510.61	3,096	352,270	生活必需品
COOPER COS INC/THE		17.7	17.7	674	76,761	ヘルスケア
CHUBB LTD		148.69	162.19	3,001	341,442	金融
ARROW ELECTRONICS INC		27	27	335	38,219	情報技術
ALLSTATE CORP		102.5	109.5	1,238	140,947	金融
EBAY INC		256.5	249	1,756	199,859	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC		365	405	7,583	862,742	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO		45.5	50.5	556	63,302	素材
XILINX INC		80	88.5	2,062	234,679	情報技術
DISH NETWORK CORP-A		82	89	294	33,545	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA		52	—	—	—	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A		74.5	84.7	2,880	327,683	生活必需品
TRIMBLE INC		82.5	90.5	783	89,092	情報技術
LENNAR CORP-A		90	100.5	1,077	122,628	一般消費財・サービス
LEAR CORP		18	21.5	363	41,338	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP		193	213.9	2,031	231,113	金融
PACCAR INC		114.87	125.37	1,079	122,835	資本財・サービス
BIOGEN INC		56.2	55.2	1,303	148,279	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC		27.7	30.9	1,950	221,933	ヘルスケア
STARBUCKS CORP		383.5	427.5	4,733	538,553	一般消費財・サービス
PTC INC		37	40.2	443	50,455	情報技術
PERRIGO CO PLC		42	—	—	—	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY		109.8	124.1	1,058	120,391	公益事業
INTUIT INC		85.7	98.8	6,863	780,830	情報技術
BORGWARNER INC		82	87.5	392	44,607	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC		76	82.5	915	104,137	一般消費財・サービス
BALL CORP		105.84	119.84	1,136	129,265	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP		470.97	517.97	1,998	227,408	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC		95.7	105.7	1,319	150,174	コミュニケーション・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期 首		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
VULCAN MATERIALS CO		43.5	49	976	111,132	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		85.5	93.5	1,777	202,229	ヘルスケア
VF CORP		109	122.5	903	102,756	一般消費財・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B		183.75	220.25	710	80,886	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC		19	22	383	43,646	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		30.7	—	—	—	その他
CARNIVAL CORP		153	300	544	61,981	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A		1,490.9	1,660.9	8,558	973,713	コミュニケーション・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD		72	—	—	—	その他
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		75	83	484	55,118	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD		90	—	—	—	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		403	448	249	28,338	不動産
アメリカ・ドル通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	102,065.16 591 銘柄	114,614.26 598 銘柄	1,496,632	170,271,878 <67.9%>
		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)						
IMPERIAL OIL LTD		83	91	389	34,805	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		7	7	1,543	137,792	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN		92.87	96.87	706	63,085	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		149	161	868	77,530	素材
INTACT FINANCIAL CORP		46.5	64.5	1,040	92,899	金融
BCE INC		49.3	49.3	319	28,541	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP		62	69	1,241	110,836	素材
SUNCOR ENERGY INC		501.3	542.3	1,732	154,656	エネルギー
METRO INC/CN		82	86	534	47,708	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA		110	120	1,222	109,114	金融
BANK OF NOVA SCOTIA		399	435	3,542	316,177	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		146.5	159.5	2,322	207,276	金融
TORONTO-DOMINION BANK		594	652	6,102	544,670	金融
GREAT-WEST LIFECO INC		91	98	367	32,759	金融
ROYAL BANK OF CANADA		467.5	510.5	6,622	591,143	金融
TC ENERGY CORP		310.5	352.5	2,150	191,994	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		178.29	197.29	760	67,886	エネルギー
BARRICK GOLD CORP		586	633	1,546	138,033	素材
CAE INC		79	109	343	30,686	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP		57.12	62.12	969	86,499	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'		53	59	218	19,543	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD		—	35	373	33,343	素材
BALLARD POWER SYSTEMS INC		—	78	152	13,625	資本財・サービス
CCL INDUSTRIES INC - CL B		46.5	54.5	345	30,871	素材
HYDRO ONE LTD		105	113	351	31,388	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD		59.6	59.6	577	51,528	生活必需品
NORTHLAND POWER INC		—	79	306	27,388	公益事業
WSP GLOBAL INC		37	43	781	69,793	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD		—	28	310	27,727	資本財・サービス
PARKLAND CORP		44	51	174	15,555	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B		53	60	174	15,531	コミュニケーション・サービス
EMERA INC		77	90	534	47,678	公益事業
SSR MINING INC		72	—	—	—	素材
CANADIAN UTILITIES LTD-A		40	48	169	15,124	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B		116	127	733	65,431	コミュニケーション・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A		—	225	232	20,746	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD		78	87	562	50,165	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES		189	215	377	33,660	公益事業
B2GOLD CORP		347	347	177	15,858	素材
AIR CANADA		41	65	138	12,358	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP		403	432	332	29,691	素材
BANK OF MONTREAL		211	231	3,164	282,501	金融
POWER CORP OF CANADA		181	201	840	75,048	金融
SHOPIFY INC - CLASS A		35	41	8,200	731,932	情報技術
NUTRIEN LTD		188.19	203.19	1,773	158,261	素材
CANOPY GROWTH CORP		74	84	118	10,564	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC		55	—	—	—	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD		88	96	488	43,633	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A		—	47	224	20,019	公益事業
CAMECO CORP		128	140	445	39,776	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP		—	14	354	31,625	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT		—	65	332	29,694	資本財・サービス
LIGHTSPEED COMMERCE INC		—	39	265	23,727	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG		—	19	233	20,831	情報技術
TELUS CORP		108	108	318	28,428	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B		151	170	576	51,425	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A		18	22	382	34,178	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES		389	420	2,244	200,304	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		9	10	566	50,587	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC		92	102	1,023	91,382	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD		25.37	27.37	373	33,342	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP		70	70	228	20,381	素材
BLACKBERRY LTD		160	194	243	21,749	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC		192.5	208.5	1,431	127,799	金融
ENBRIDGE INC		665	727	3,543	316,283	エネルギー

銘柄		期首	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		434.25	461.25	3,407	304,131	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP		638	691	1,652	147,535	金融
BAUSCH HEALTH COS INC		105	105	333	29,794	ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		45	240	2,194	195,886	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC		33	37	258	23,078	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC		63	70	372	33,290	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO		233.5	255.5	4,184	373,469	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A		79	79	848	75,754	情報技術
ONEX CORPORATION		26	26	248	22,188	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		151	160	595	53,184	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC		24	31	151	13,522	金融
TMX GROUP LTD		19	19	244	21,811	金融
OPEN TEXT CORP		87	99	614	54,823	情報技術
CI FINANCIAL CORP		70	—	—	—	金融
SAPUTO INC		80	87	252	22,504	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		193	204	572	51,112	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		283	302	1,434	128,070	生活必需品
YAMANA GOLD INC		323	323	166	14,876	素材
FORTIS INC		150	166	928	82,916	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS		38	38	336	30,072	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP		194	221	230	20,554	素材
CENOVUS ENERGY INC		314	467	740	66,111	エネルギー
DOLLARAMA INC		97	107	603	53,876	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I		22	29	123	11,011	公益事業
ALTAGAS LTD		91	103	256	22,929	公益事業
KEYERA CORP		74	74	213	19,016	エネルギー
INTER PIPELINE LTD		128	—	—	—	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	12,687.79 82銘柄	14,425.79 88銘柄	89,694	8,006,114 <3.2%>	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
MEDIBANK PRIVATE LTD		888	970	325	26,494	金融
BHP GROUP LTD		957.5	1,034	3,988	324,195	素材
SOUTH32 LTD		1,516	1,601	571	46,461	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		305.5	335.5	712	57,927	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD		565	591	1,040	84,554	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		1,024.5	1,159.5	3,153	256,375	金融
WESTPAC BANKING CORP		1,173.48	1,289.48	2,697	219,287	金融
SANTOS LTD		531	629	401	32,672	エネルギー
AUSNET SERVICES		650	650	163	13,315	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP		924.5	1,008.5	2,684	218,233	金融
RIO TINTO LTD		122.5	130	1,240	100,805	素材
ORIGIN ENERGY LTD		535	590	290	23,596	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD		600	600	204	16,631	資本財・サービス
XERO LTD		—	47.5	670	54,525	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		34	34	105	8,598	エネルギー
COLES GROUP LTD		430.45	468.45	844	68,658	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD		45	54	279	22,742	情報技術
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		250	370	357	29,054	素材
EVOLUTION MINING LTD		530	595	245	19,927	素材
AFTERPAY LTD		70	76	840	68,298	情報技術
TPG TELECOM LTD		120	—	—	—	コミュニケーション・サービス
REECE LTD		—	105	246	20,024	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI		—	473	324	26,338	生活必需品
OIL SEARCH LTD		642	642	251	20,405	エネルギー
SEEK LTD		107	117	401	32,622	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		235	256	305	24,805	生活必需品
NEWCREST MINING LTD		260	285	689	56,019	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		574.5	623.5	5,847	475,317	金融
AMPOL LTD		79.5	79.5	229	18,696	エネルギー
ORICA LTD		131	131	188	15,313	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		464.5	519.5	602	48,986	金融
CIMIC GROUP LTD		28	—	—	—	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD		413	441	1,768	143,754	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD		157	—	—	—	その他
TABCORP HOLDINGS LTD		727.63	782.63	390	31,746	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD		116	134	148	12,091	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD		305	305	149	12,148	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD		1,345	1,435	574	46,660	コミュニケーション・サービス
AMP LTD		1,020	—	—	—	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		142.5	156.5	859	69,881	素材
MACQUARIE GROUP LTD		110.84	119.84	2,325	189,000	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD		184.5	211.3	942	76,590	一般消費財・サービス
CSL LTD		147.5	160	4,912	399,296	ヘルスケア
WESFARMERS LTD		370	403	2,345	190,695	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD		20.5	23.2	525	42,748	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD		163	178	361	29,416	素材
SUNCORP GROUP LTD		412.57	436.57	464	37,795	金融
ASX LTD		62.5	67	609	49,573	金融
COMPUTERSHARE LTD		159	182	348	28,317	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		709.36	861.36	376	30,598	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
SONIC HEALTHCARE LTD		143.5	159.5	681	55,363	ヘルスケア
AGL ENERGY LTD		190	215	114	9,315	公益事業
BRAMBLES LTD		504	504	509	41,379	資本財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD		57.5	61.5	407	33,095	ヘルスケア
REA GROUP LTD		16	18	289	23,557	コミュニケーション・サービス
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD		38	44	143	11,670	金融
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		—	22	286	23,279	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル通貨計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	21,308.83 53 銘柄	22,384.83 53 銘柄	49,438 4,018,864	<1.6%>
		百株	百株	千香港・ドル	千円	
(香港)						
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		475	525	2,509	36,613	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		770	830	3,622	52,858	一般消費財・サービス
MTR CORP		525	585	2,457	35,847	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES		445	510	4,934	71,990	不動産
SINO LAND CO		1,040	1,260	1,215	17,739	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		956.69	1,046.69	5,285	77,119	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		155	185	814	11,889	不動産
CLP HOLDINGS LTD		560	620	4,761	69,471	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		485.07	555.07	1,834	26,765	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		3,773.58	4,224.75	5,002	72,980	公益事業
HANG SENG BANK LTD		261	288	4,057	59,205	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT		525	585	1,848	26,971	不動産
WH GROUP LTD		3,210	3,610	1,841	26,861	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		419	461	20,514	299,306	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD		660	780	1,248	18,208	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		108	—	—	—	情報技術
KERRY PROPERTIES LTD		225	—	—	—	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD		452.4	—	—	—	金融
MICROPORT SCIENTIFIC CORP		260	—	—	—	ヘルスケア
XINYI GLASS HOLDINGS LTD		—	690	1,337	19,510	資本財・サービス
SJM HOLDINGS LTD		580	710	396	5,780	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		382	450	873	12,737	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD		911.69	911.69	4,129	60,256	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		200	235	1,092	15,943	公益事業
PCCW LTD		1,470	—	—	—	コミュニケーション・サービス
AIA GROUP LTD		4,194	4,614	38,711	564,800	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS		—	540	1,555	22,690	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		570	630	2,535	36,996	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		609	679	1,371	20,011	生活必需品
ESR CAYMAN LTD		—	750	1,938	28,286	不動産
SANDS CHINA LTD		824	928	1,733	25,291	一般消費財・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU		—	820	1,193	17,419	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		470	530	8,729	127,357	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		1,255	1,415	3,396	49,547	金融
WYNN MACAU LTD		540	540	388	5,664	一般消費財・サービス
香 港 ・ ド ル 通 貨 計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	27,311.43 31 銘柄	30,508.2 30 銘柄	131,331 1,916,123	<0.8%>
		百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)						
CAPITALAND INVESTMENT LTD		—	1,024	345	28,714	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD		420	452	1,199	99,781	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD		629	699	2,152	179,086	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD		436.75	484.75	238	19,804	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD		513	563	293	24,407	資本財・サービス
UOL GROUP LTD		140	171	117	9,775	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		161	161	112	9,377	不動産
CAPITALAND LTD		829	—	—	—	不動産
YANGZIJIANG SHIPBUILDING		913	—	—	—	資本財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		27	—	—	—	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		1,164	1,293	1,466	122,007	金融
GENTING SINGAPORE LTD		2,090	2,090	165	13,738	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD		86	99	186	15,495	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		2,909.5	3,201.5	771	64,201	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING		500	565	216	18,053	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD		273	315	290	24,192	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD		659	744	311	25,939	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	11,750.25 16 銘柄	11,862.25 14 銘柄	7,866 654,577	<0.3%>
		百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
(ニュージーランド)						
MERIDIAN ENERGY LTD		415	475	213	16,535	公益事業
MERCURY NZ LTD		230	260	152	11,792	公益事業
A2 MILK CO LTD		262	262	162	12,593	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD		620.89	727.89	316	24,576	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		389	483	376	29,152	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		204	232	765	59,356	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD		140	165	199	15,478	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,260.89 7 銘柄	2,604.89 7 銘柄	2,186 169,486	<0.1%>

銘	柄	期	当	期		業 種 等
		首		末		
		株 数	株 数	評 価 額		
		株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)						
BP PLC		6,665	7,330	2,402	364,053	エネルギー
UNILEVER PLC		384.1	948.6	3,719	563,721	生活必需品
BARCLAYS PLC		5,688	6,223	1,140	172,861	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		2,795	3,005	368	55,791	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC		849	951	1,231	186,580	金融
NATWEST GROUP PLC		1,597.91	2,102.91	442	67,058	金融
EVRAZ PLC		150	174	99	15,084	素材
JOHNSON MATTHEY PLC		60.64	70.64	150	22,836	素材
BAE SYSTEMS PLC		1,065	1,170	643	97,493	資本財・サービス
AVIVA PLC		1,289.66	1,423.66	538	81,604	金融
AVEVA GROUP PLC		20	44	141	21,473	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC		1,651	1,823	2,780	421,348	ヘルスケア
INFORMA PLC		499	527	249	37,859	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC		1,565	1,595.4	233	35,314	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC		319	350	256	38,850	コミュニケーション・サービス
DCC PLC		31.5	34	191	29,032	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC		152	175	320	48,643	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		24.5	27.5	435	66,019	資本財・サービス
HALMA PLC		122.5	137	414	62,893	情報技術
ENTAIN PLC		191	212	370	56,100	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC		146	172	196	29,756	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC		—	235	151	22,937	金融
M&G PLC		837	917	174	26,454	金融
RELX PLC		631.46	703.96	1,649	249,979	資本財・サービス
DIAGEO PLC		769	847	3,238	490,827	生活必需品
RIO TINTO PLC		370	407	1,880	285,076	素材
STANDARD CHARTERED PLC		868	970	401	60,892	金融
TESCO PLC		3,207	2,806.84	783	118,687	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC		290.5	319.5	396	60,045	ヘルスケア
GLENCORE PLC		3,307.25	3,645.25	1,301	197,316	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC		102.5	124.5	167	25,313	金融
SMITHS GROUP PLC		123.83	143.83	209	31,739	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		419.83	465.83	124	18,864	金融
PEARSON PLC		235.63	257.63	158	23,997	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC		542.25	595.25	172	26,135	生活必需品
NEXT PLC		44.5	48.5	386	58,525	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC		1,177	1,277	198	30,095	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC		68.61	73.61	211	32,074	一般消費財・サービス
BUNZL PLC		112.05	119.05	341	51,729	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC		8,701.83	10,141.83	1,116	169,264	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		42.61	50.11	504	76,440	素材
KINGFISHER PLC		682.11	737.11	240	36,419	一般消費財・サービス
WPP PLC		409	429	454	68,952	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC		228.27	248.27	270	40,957	公益事業
SEVERN TRENT PLC		78.33	90.83	264	40,018	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC		612	673	416	63,097	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		234.5	260	1,602	242,896	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC		165.5	194.5	303	46,060	金融
SCHRODERS PLC		41.5	41.5	145	22,121	金融
SSE PLC		339	376	585	88,785	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		340	367	254	38,535	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC		431.5	561	4,693	711,405	ヘルスケア
FERGUSON PLC		74.87	80.87	934	141,625	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		1,955	2,152	613	92,922	金融
3I GROUP PLC		313.91	350.91	487	73,819	金融
ASHTREAD GROUP PLC		146.5	161.5	989	150,043	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE		351.14	401.14	311	47,239	情報技術
NATIONAL GRID PLC		1,144.34	1,296.34	1,297	196,709	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC		22,964.65	25,754.65	1,205	182,677	金融
RSA INSURANCE GROUP LTD		317.6	—	—	—	その他
IMPERIAL BRANDS PLC		304	341	532	80,778	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC		41.5	38.32	165	25,118	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		753.6	790.6	2,020	306,268	生活必需品
BHP GROUP PLC		687.27	768.27	1,551	235,090	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		115	128.5	245	37,139	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC		6,696.5	7,416.5	3,088	468,108	金融
ANGLO AMERICAN PLC		403.83	465.83	1,250	189,458	素材
MONDI PLC		156.5	176	307	46,627	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS		734	—	—	—	生活必需品
COMPASS GROUP PLC		589.39	647.39	985	149,336	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC		106	112	309	46,833	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC		2,901	3,206	523	79,396	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI		65.5	71.5	168	25,498	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC		132.89	142.89	256	38,873	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		56.36	64.36	296	44,870	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC		52	58.5	320	48,587	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		104.99	120.49	827	125,456	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		1,350	1,489	2,374	359,903	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		1,223.18	1,346.18	2,145	325,219	エネルギー
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		57	57	127	19,264	ヘルスケア

外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄	株 数	株 数	期 末 評 価 額		業 種 等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ADMIRAL GROUP PLC	百株 61.5	百株 70.5	千イギリス・ポンド 212	千円 32,193	金融
ANTOFAGASTA PLC	128	141	197	29,875	素材
ABRDN PLC	708.62	778.62	183	27,826	金融
EXPERIAN PLC	296.54	336.54	1,138	172,553	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	95,671.55 83 銘柄	105,587.01 82 銘柄	64,194 <3.9%>	
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	345	443	874	31,507	金融
AZRIELI GROUP LTD	14	16.5	479	17,284	不動産
ICL GROUP LTD	236	281	801	28,859	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	9.5	9.5	447	16,113	資本財・サービス
BANK HAPOLIM BM	357	441	1,355	48,818	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	512	562	1,744	62,819	金融
NICE LTD	22	24	2,123	76,461	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	41	54	632	22,771	金融
イスラエル・シェケル通貨計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,536.5 8 銘柄	1,831 8 銘柄	8,459 <0.1%>	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
UBS GROUP AG-REG	1,200	1,306	2,057	253,599	金融
ROCHE HOLDING AG-BR	—	11	421	51,925	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2.8	2.8	249	30,713	素材
ADECCO GROUP AG-REG	51.5	51.5	225	27,763	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	229.8	250	8,937	1,101,546	ヘルスケア
SIKA AG-REG	47.1	51	1,854	228,612	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.03	0.04	449	55,363	生活必需品
ABB LTD-REG	601	627	2,002	246,825	資本財・サービス
SWISS RE AG	97.5	107	927	114,285	金融
NESTLE SA-REG	972	1,027	12,334	1,520,198	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	5.9	8	1,260	155,295	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	12.6	15	360	44,425	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	799.7	909.2	806	99,351	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	74	80	457	56,379	金融
SGS SA-REG	2	2.1	597	73,661	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	6.9	6.9	161	19,899	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	14.5	17.5	184	22,690	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG	21.2	23	278	34,385	情報技術
ALCON INC	161.3	178	1,300	160,326	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	9.7	9.7	265	32,661	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	48.62	53.42	2,039	251,377	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	15.7	17	235	28,977	金融
CLARIANT AG-REG	57	77	139	17,186	素材
NOVARTIS AG-REG	726	791	5,872	723,771	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1.2	265	32,685	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	171.6	186	2,583	318,421	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	8.3	9	462	56,948	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	10.1	10.1	71	8,813	金融
GEBERIT AG-REG	11.9	13	907	111,837	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	3	3.3	1,492	184,002	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	3.4	3.6	700	86,299	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	18.22	19.92	685	84,505	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	55	62	467	57,647	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	24	26.9	1,964	242,158	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	15.2	19	100	12,422	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD	172.9	185.4	843	103,924	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	10.4	11.1	582	71,769	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	18	19.2	510	62,969	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	25.1	27	239	29,483	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.34	0.34	385	47,478	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	5,705.31 39 銘柄	6,218.22 40 銘柄	55,680 <2.7%>	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	595	648	46,377	800,937	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	227	260	2,852	49,257	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1.05	1.2	2,222	38,380	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	23	—	—	—	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	68	386.5	8,560	147,848	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S	43	48.5	1,870	32,297	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B	36.5	39	4,145	71,596	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	72.5	78.5	3,835	66,239	素材
COLOPLAST-B	40.5	45	4,835	83,504	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	71.6	79.1	11,291	195,004	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	—	3	822	14,211	資本財・サービス
DEMANT A/S	34.25	38.75	1,219	21,053	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2.2	2.3	4,521	78,091	資本財・サービス
TRYG A/S	40	132	2,088	36,075	金融
PANDORA A/S	35	38	3,203	55,322	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	34.5	40.5	1,993	34,419	素材
GENMAB A/S	22.9	25.2	6,426	110,977	ヘルスケア

銘柄		期首	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
ORSTED A/S		百株 66	百株 70.5	千デンマーク・クローネ 5,965	千円 103,027	公益事業
AMBU A/S-B		56	63	1,203	20,780	ヘルスケア
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,469 18銘柄	1,999.05 18銘柄	113,435	1,959,025 <0.8%>	
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
DNB BANK		—	367.5	7,416	93,517	金融
NORSK HYDRO ASA		417	507	3,067	38,679	素材
DNB		331	—	—	—	金融
ORKLA ASA		244.5	290.5	2,443	30,807	生活必需品
TELENOR ASA		254	278	3,833	48,341	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA		338.23	382.23	8,682	109,484	エネルギー
SCHIBSTED ASA-CL A		—	28	1,149	14,490	コミュニケーション・サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		57.1	66.6	2,966	37,405	素材
MOWI ASA		141	166	3,492	44,042	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		73.5	73.5	1,523	19,213	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS		31	36.5	1,306	16,477	コミュニケーション・サービス
ADEVINTA ASA		81	106	1,398	17,637	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,968.33 10銘柄	2,301.83 11銘柄	37,279	470,097 <0.2%>	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB		35.2	38.7	2,067	25,903	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS		996.3	1,128.3	10,585	132,638	情報技術
VOLVO AB-B SHS		508.5	556.5	11,036	138,287	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES		133	144	3,028	37,944	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B		76	86	1,751	21,950	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB		56.5	613	4,105	51,446	生活必需品
TELE2 AB-B SHS		168	188	2,465	30,894	コミュニケーション・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		574	620	8,153	102,157	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		528.5	548.5	5,284	66,211	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		318	341	6,259	78,430	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		282	282	4,585	57,461	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B		207	229	3,451	43,241	素材
SKANSKA AB-B SHS		115.5	128.5	2,702	33,860	資本財・サービス
SANDVIK AB		384.5	431	9,887	123,885	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS		156	700	14,829	185,813	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		229.5	254.5	14,190	177,812	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS		—	80	1,616	20,248	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS		109.5	119.5	1,588	19,907	資本財・サービス
TELIA CO AB		862	1,002	3,544	44,413	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB		110	119	4,303	53,917	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS		132.5	149	7,081	88,737	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		341.5	387.5	10,036	125,754	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		—	47.43	1,304	16,343	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		—	40	2,739	34,322	不動産
LUNDBERGS AB-B SHS		26	30	1,523	19,088	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		52	57	1,948	24,418	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		104	543	6,901	86,476	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB		63.5	75.5	2,557	32,041	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B		212	230	6,725	84,266	生活必需品
EMBRACER GROUP AB		—	200	1,901	23,827	コミュニケーション・サービス
BOLIDEN AB		93	104	3,186	39,927	素材
EPIROC AB-A		222.5	249.5	5,444	68,214	資本財・サービス
EPIROC AB-B		135	148	2,671	33,472	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		141.5	158.5	2,083	26,106	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP		1,111	1,250	13,405	167,964	金融
EQT AB		81	91	4,835	60,591	金融
EVOLUTION AB		44	65.5	6,572	82,350	一般消費財・サービス
SINCH AB		—	194	2,396	30,032	情報技術
KINNEVIK AB - B		83	93	3,055	38,285	金融
HEXAGON AB-B SHS		99	764	10,199	127,798	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		57	62	1,683	21,091	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	8,848.5 36銘柄	12,548.43 41銘柄	213,690	2,677,537 <1.1%>	
(ユーロ (アイルランド))		百株	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		75.5	86	394	50,655	素材
KINGSPAN GROUP PLC		50	54	539	69,327	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		51.5	56	606	77,914	生活必需品
CRH PLC		253.5	281	1,219	156,601	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		49.6	60.3	735	94,504	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	480.1 5銘柄	537.3 5銘柄	3,496	449,002 <0.2%>	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オランダ)						
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV		—	278.91	697	89,572	コミュニケーション・サービス
QIAGEN N. V.		72.98	76.98	378	48,663	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		302.1	322.6	1,024	131,503	ヘルスケア
NN GROUP NV		90.5	99	434	55,795	金融
HEINEKEN NV		85.5	92	859	110,387	生活必需品
AEGON NV		582.44	642.44	253	32,495	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		362.33	373.83	1,131	145,234	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.		65.38	67.68	639	82,093	素材
KONINKLIJKE DSM NV		57	62	1,189	152,700	素材
WOLTERS KLUWER		89	96	962	123,643	資本財・サービス
ING GROEP NV		1,262.5	1,396	1,697	217,944	金融
KONINKLIJKE KPN NV		1,146.5	1,211.5	317	40,743	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		139.3	150.1	10,579	1,358,455	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA		130.5	151.5	191	24,652	金融
ADYEN NV		6	7	1,722	221,166	情報技術
UNILEVER NV		479.5	—	—	—	その他
JUST EAT TAKEAWAY		40	64.5	375	48,162	一般消費財・サービス
PROSUS NV		161	333.8	2,359	302,957	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV		—	26	65	8,363	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV		—	17	673	86,532	情報技術
VOPAK		23	23	76	9,799	エネルギー
RANDSTAD NV		37	43	241	30,976	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		37.5	39.5	305	39,208	生活必需品
ALTICE EUROPE NV		205	—	—	—	その他
STMICROELECTRONICS NV		210.5	244	1,049	134,806	情報技術
AIRBUS SE		194	211	2,103	270,105	資本財・サービス
ARGENX SE		14.5	16.4	411	52,837	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		195	195	255	32,764	生活必需品
EXOR NV		35.3	37.8	298	38,287	金融
CNH INDUSTRIAL NV		328	366	546	70,238	資本財・サービス
STELLANTIS NV		360	732	1,139	146,333	一般消費財・サービス
FERRARI NV		41.45	44.95	1,059	136,104	一般消費財・サービス
国小計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,753.78 29銘柄	7,421.49 30銘柄	33,038 <1.7%>	
			百株	百株	千ユーロ	千円
ユーロ (ベルギー)						
GALAPAGOS NV		13.9	—	—	—	ヘルスケア
UCB SA		41.3	45.3	439	56,447	ヘルスケア
KBC GROUP NV		82.5	89	645	82,947	金融
COLRUYT SA		16	16	66	8,495	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		36	40	387	49,730	金融
SOLVAY SA		24.5	26	257	33,126	素材
UMICORE		63.5	70	301	38,714	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		249	272	1,382	177,571	生活必需品
AGEAS		57.9	62.9	291	37,404	金融
PROXIMUS		49.5	49.5	79	10,189	コミュニケーション・サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		14.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス
ELIA GROUP SA/NV		10.5	10.5	114	14,710	公益事業
SOFINA		5.5	6	244	31,342	金融
国小計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	664.6 13銘柄	687.2 11銘柄	4,210 <0.2%>	
			百株	百株	千ユーロ	千円
ユーロ (ルクセンブルグ)						
AROUNDTOWN SA		370	325	179	23,036	不動産
ARCELORMITTAL		233	257	628	80,655	素材
INPOST SA		—	70	72	9,269	資本財・サービス
EUROFINS SCIENTIFIC		44	47.5	536	68,911	ヘルスケア
SES		110	—	—	—	コミュニケーション・サービス
TENARIS SA		133	157	140	17,987	エネルギー
国小計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	890 5銘柄	856.5 5銘柄	1,556 <0.1%>	
			百株	百株	千ユーロ	千円
ユーロ (フランス)						
JCDECAUX SA		27	—	—	—	コミュニケーション・サービス
TOTALENERGIES SE		810.5	893.5	3,681	472,705	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		57	60.5	776	99,712	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		155.77	169.77	2,501	321,247	素材
KERING		25	27	1,846	237,078	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		182	193.5	2,926	375,791	資本財・サービス
BOUYGUES SA		74	82	245	31,494	資本財・サービス
BNP PARIBAS		364.5	403	2,231	286,587	金融
PEUGEOT SA		191.5	—	—	—	その他
NATIXIS		295.5	—	—	—	金融
THALES SA		35	38.5	284	36,524	資本財・サービス
DANONE		200	234	1,271	163,250	生活必需品

銘柄		期首	当	期末		業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		百株	百株	千ユーロ	千円		
CARREFOUR SA		198	212	321	41,297	生活必需品	
SUEZ		112.25	126.25	249	32,050	公益事業	
VIVENDI		268.91	278.91	312	40,112	コミュニケーション・サービス	
L'OREAL		82.3	90.4	3,632	466,420	生活必需品	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		168.5	179	1,024	131,568	資本財・サービス	
LEGRAND SA		88.17	94.67	906	116,435	資本財・サービス	
PERNOD RICARD SA		69.37	74.87	1,546	198,626	生活必需品	
EURAZEO SE		12.54	12.54	92	11,827	金融	
SOCIETE GENERALE SA		269.5	290	797	102,351	金融	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		91	99.1	6,909	887,217	一般消費財・サービス	
ACCOR SA		61.5	61.5	164	21,061	一般消費財・サービス	
CAPGEMINI SE		53.2	57.2	1,154	148,296	情報技術	
VALEO SA		77	77	189	24,293	一般消費財・サービス	
PUBLICIS GROUPE		70.5	80	463	59,541	コミュニケーション・サービス	
BUREAU VERITAS SA		97	106	300	38,534	資本財・サービス	
EIFFAGE		27.4	30.4	250	32,134	資本財・サービス	
SODEXO SA		27	29.5	221	28,463	一般消費財・サービス	
IPSEN		11.5	11.5	99	12,814	ヘルスケア	
ORPEA		18	18	150	19,323	ヘルスケア	
AMUNDI SA		19.5	22.5	168	21,683	金融	
TELEPERFORMANCE		19.2	21	750	96,376	資本財・サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT		30	30	134	17,292	コミュニケーション・サービス	
FAURECIA		22.5	38.57	143	18,394	一般消費財・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		9	10	513	65,900	ヘルスケア	
SEB SA		6.5	9.97	132	17,065	一般消費財・サービス	
ESSILORLUXOTTICA		92.5	101.5	1,830	235,100	一般消費財・サービス	
DASSAULT AVIATION SA		1	10	84	10,844	資本財・サービス	
WORLDLINE SA		78.14	85.14	404	51,898	情報技術	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		30	35	146	18,799	一般消費財・サービス	
AXA SA		638.5	694	1,681	215,973	金融	
EDENRED		79.5	88.5	358	46,025	情報技術	
RENAULT SA		58	64	186	23,952	一般消費財・サービス	
HERMES INTERNATIONAL		10.2	11.3	1,853	237,969	一般消費財・サービス	
REMY COINTREAU		7.5	7.5	160	20,552	生活必需品	
ATOS SE		32	32	119	15,351	情報技術	
DASSAULT SYSTEMES SE		43.6	234.5	1,252	160,889	情報技術	
WENDEL		7.8	9.3	96	12,360	金融	
ORANGE		659	714	685	88,054	コミュニケーション・サービス	
ALSTOM		63	114	369	47,385	資本財・サービス	
CNP ASSURANCES		48.5	58.5	126	16,210	金融	
SANOFI		370.75	407.25	3,486	447,697	ヘルスケア	
VINCI SA		170	188.5	1,586	203,711	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT		175	197	556	71,438	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA		376	416	504	64,807	金融	
BIOMERIEUX		13.4	13.4	170	21,913	ヘルスケア	
ENGIE		602.23	646.23	833	106,997	公益事業	
EDF		202.5	202.5	249	32,100	公益事業	
SAFRAN SA		104.2	122	1,239	159,166	資本財・サービス	
ILIAD SA		4.9	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
ARKEMA		22.2	22.2	257	33,068	素材	
ADP		9.1	9.1	95	12,199	資本財・サービス	
SCOR SE		49.5	55.5	148	19,028	金融	
GETLINK SE		142	142	183	23,513	資本財・サービス	
BOLLORE		286	286	136	17,503	コミュニケーション・サービス	
国	小計	株数、金額	8,705.13	9,129.57	55,198	7,087,987	
		銘柄数 < 比率 >	66銘柄	62銘柄		<2.8%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円		
ユーロ（ドイツ）							
BAYER AG-REG		322.7	352.2	1,596	204,964	ヘルスケア	
EVONIK INDUSTRIES AG		65	70	186	23,999	素材	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		639.5	739	789	101,328	金融	
COMMERZBANK AG		329.35	329.35	205	26,368	金融	
VOLKSWAGEN AG		10.1	11.1	283	36,403	一般消費財・サービス	
VOLKSWAGEN AG-PREF		61.2	65.5	1,077	138,375	一般消費財・サービス	
SIEMENS AG-REG		250.5	273.5	3,953	507,696	資本財・サービス	
E.ON SE		742	793	871	111,930	公益事業	
UNIPER SE		66.5	66.5	257	33,029	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		110	117.5	1,007	129,426	一般消費財・サービス	
GEA GROUP AG		50.5	50.5	225	28,902	資本財・サービス	
CONTINENTAL AG		35.9	39.6	369	47,417	一般消費財・サービス	
BASF SE		301.2	328.7	1,905	244,724	素材	
ALLIANZ SE-REG		134.7	147.4	2,831	363,561	金融	
THYSSENKRUPP AG		114.5	—	—	—	素材	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		58	64	455	58,431	生活必需品
RWE AG		212	227	794	102,080	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		96.5	96.5	53	6,816	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		11.8	—	—	—	資本財・サービス
BRENNTAG SE		50	53.5	408	52,445	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		135.5	148	499	64,197	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		33.2	33.2	109	14,077	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG		7.1	—	—	—	資本財・サービス
SAP SE		341.92	373.92	4,367	560,815	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		46.1	50.4	1,205	154,742	金融
ZALANDO SE		49.5	76.5	623	80,060	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG		49	53.5	318	40,958	素材
KION GROUP AG		21	24	225	28,938	資本財・サービス
COVESTRO AG		56	67	339	43,602	素材
RATIONAL AG		—	1.9	154	19,801	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG		12.1	12.1	701	90,118	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		50	53	397	51,042	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE		41.5	58	691	88,852	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		12.5	14	248	31,909	ヘルスケア
METRO AG		50	—	—	—	生活必需品
BECHTLE AG		—	28.5	180	23,143	情報技術
NEMETSCHEK SE		20	20	215	27,620	情報技術
SCOUT24 AG		36	36	215	27,625	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		86	101	651	83,600	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG		23	25	226	29,033	資本財・サービス
HELLOFRESH SE		—	57	538	69,168	生活必需品
TEAMVIEWER AG		44.5	53.5	66	8,484	情報技術
SIEMENS ENERGY AG		131.25	143.25	345	44,312	資本財・サービス
KION GROUP AG-RTS		21	—	—	—	資本財・サービス
BEIERSDORF AG		32.9	36.1	322	41,377	生活必需品
FUCHS PETROLUB PREF		23.5	23.5	93	12,010	素材
MERCK KGAA		42.5	46	1,010	129,714	ヘルスケア
ADIDAS AG		61.7	68.1	1,731	222,378	一般消費財・サービス
PUMA SE		27.1	38.6	410	52,713	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		34	37.5	250	32,166	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		1,092.5	1,192	1,911	245,515	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		69.2	72.2	386	49,619	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		281	306.5	2,537	325,881	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		413	467	1,878	241,189	情報技術
HANNOVER RUECK SE		20	22	342	43,929	金融
DEUTSCHE POST AG-REG		324	354.5	1,899	243,903	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		62.6	67.1	954	122,523	金融
LANXESS AG		25	28	143	18,423	素材
MTU AERO ENGINES AG		17.1	17.9	300	38,535	資本財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE		110	—	—	—	不動産
SYMRISE AG		42.2	44	553	71,134	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		338	338	79	10,229	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		19.5	19.5	137	17,653	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		170.5	195	958	123,121	不動産
LEG IMMOBILIEN SE		23	25.5	316	40,652	不動産
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,158.42 62銘柄	8,653.62 59銘柄	45,811	5,882,683 <2.3%>	
ユーロ（ポルトガル）		百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS		77	85	165	21,283	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		883	992	482	61,984	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		150.5	167.5	140	18,045	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,110.5 3銘柄	1,244.5 3銘柄	788	101,314 <0.0%>	
ユーロ（スペイン）		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA		1,572.27	1,867.27	739	94,987	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA		103.5	103.5	208	26,780	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		2,205.12	2,367	1,136	145,970	金融
IBERDROLA SA		1,944.34	2,119.34	2,101	269,858	公益事業
BANKINTER SA		215	—	—	—	金融
REPSOL SA		494	534	529	67,967	エネルギー
GRIFOLS SA		98	98	163	21,053	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		5,477.5	6,199.5	1,725	221,588	金融
AMADEUS IT GROUP SA		146	160.5	932	119,701	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA		94	103	253	32,576	公益事業
MAPFRE SA		306.5	—	—	—	金融
CAIXABANK SA		1,175	1,605	367	47,134	金融

銘柄		期首	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		88.76	88.76	191	24,550	資本財・サービス
AENA SME SA		22.5	26	336	43,185	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA		104.55	180.05	958	123,092	コミュニケーション・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		360	390	1,157	148,587	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		77	85	199	25,628	資本財・サービス
ENAGAS SA		79.5	79.5	159	20,539	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		139	157	290	37,337	公益事業
FERROVIAL SA		162.7	176.7	443	56,952	資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA		—	110	247	31,724	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	14,865.24	16,450.12	12,142	1,559,214	
		20銘柄	19銘柄		<0.6%>	
ユーロ（イタリア）		百株	百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA		78.5	88.5	294	37,831	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		372.43	394.43	702	90,154	金融
MEDIOBANCA SPA		188.65	223.65	217	27,926	金融
UNICREDIT SPA		696.56	763.56	807	103,637	金融
TELECOM ITALIA SPA		2,629.82	3,439.82	162	20,808	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP		1,719.5	2,039.5	90	11,667	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO		5,507.37	5,945.37	1,274	163,606	金融
ATLANTIA SPA		172.57	172.57	278	35,810	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		160	177	198	25,444	金融
MONCLER SPA		63	74	478	61,385	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		34.5	38.5	211	27,171	ヘルスケア
ENI SPA		841	904	1,066	136,977	エネルギー
PIRELLI & C SPA		110	—	—	—	一般消費財・サービス
DIASORIN SPA		8.5	8.5	157	20,203	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		83	112	115	14,777	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA		120.5	158.5	218	28,076	情報技術
AMPLIFON SPA		—	43	183	23,610	ヘルスケア
LEONARDO SPA		131.75	—	—	—	資本財・サービス
ENEL SPA		2,671.34	2,911.34	1,976	253,803	公益事業
SNAM SPA		666	701	350	44,980	公益事業
TERNA SPA		463	490	318	40,873	公益事業
FINCOBANK SPA		197	219	340	43,743	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	16,914.99	18,904.24	9,442	1,212,490	
		21銘柄	20銘柄		<0.5%>	
ユーロ（フィンランド）		百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ		175.5	191.5	626	80,410	素材
NOKIA OYJ		1,864	1,913	960	123,290	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		147	170	209	26,926	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		188.5	197	304	39,058	素材
ELISA OYJ		46	51	271	34,892	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		153	178	766	98,422	金融
FORTUM OYJ		138.5	159	406	52,186	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		—	98	274	35,197	生活必需品
KONE OYJ-B		112.5	121	715	91,920	資本財・サービス
NESTE OYJ		139	151	648	83,337	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		32	36	132	17,071	ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,996	3,265.5	5,316	682,716	
		10銘柄	11銘柄		<0.3%>	
ユーロ（オーストリア）		百株	百株	千ユーロ	千円	
VERBUND AG		20	24.3	218	28,005	公益事業
OMV AG		44.5	53	250	32,157	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		94.5	100	387	49,771	金融
VOESTALPINE AG		42.5	42.5	125	16,088	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		44	52.5	134	17,217	金融
ANDRITZ AG		21	—	—	—	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	266.5	272.3	1,115	143,240	
		6銘柄	5銘柄		<0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	61,805.26	67,422.34	172,118	22,101,720	
		240銘柄	230銘柄		<8.8%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	354,388.8	394,308.1	—	229,141,995	
		1,214銘柄	1,220銘柄		<91.4%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘	柄	期 首	当	期 末	
		□ 数	□ 数	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)					
AVALONBAY COMMUNITIES INC		4.587	5.087	1,224	139,350
SIMON PROPERTY GROUP INC		10.137	11.857	1,896	215,754
BOSTON PROPERTIES INC		4.95	5.47	603	68,666
VORNADO REALTY TRUST		5.397	5.897	245	27,896
SBA COMMUNICATIONS CORP		3.65	4.04	1,436	163,430
EQUITY RESIDENTIAL		12.35	13.05	1,125	128,010
EQUINIX INC		2.918	3.288	2,696	306,742
AMERICAN TOWER CORP		14.5	16.45	4,391	499,582
HOST HOTELS & RESORTS INC		22.243	24.943	409	46,596
INVITATION HOMES INC		17.7	20.85	860	97,896
VICI PROPERTIES INC		15.4	19.8	556	63,366
VENTAS INC		12.2	13.8	677	77,119
WEYERHAEUSER CO		24.114	27.564	1,068	121,518
AGNC INVESTMENT CORP		18.1	19.6	310	35,299
CROWN CASTLE INTL CORP		13.75	15.75	2,926	332,984
IRON MOUNTAIN INC		9.71	10.26	480	54,698
VEREIT INC		33.5	—	—	—
SUN COMMUNITIES INC		3.25	4.1	806	91,775
PROLOGIS INC		24.402	26.952	4,131	470,006
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		4.12	5.1	1,046	119,097
CAMDEN PROPERTY TRUST		3.2	3.45	582	66,274
DUKE REALTY CORP		12.15	13.8	820	93,338
ESSEX PROPERTY TRUST INC		2.17	2.4	831	94,611
FEDERAL REALTY INVS TRUST		2.36	—	—	—
WELLTOWER INC		13.85	15.3	1,255	142,805
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		17.65	19.8	674	76,725
MID-AMERICA APARTMENT COMM		3.75	4.25	892	101,539
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		5.8	6.15	521	59,347
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		45.1	50.8	424	48,258
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		5.35	—	—	—
REALTY INCOME CORP		11.2	19.445	1,357	154,415
PUBLIC STORAGE		5.22	5.67	1,881	214,094
REGENCY CENTERS CORP		5.3	5.7	403	45,887
UDR INC		9.75	10.55	606	68,979
WP CAREY INC		5.8	6.4	504	57,340
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		7.6	8.3	230	26,213
DIGITAL REALTY TRUST INC		8.9	10.3	1,738	197,793
EXTRA SPACE STORAGE INC		4.25	4.9	994	113,194
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		17.25	21.65	465	52,932
ア メ リ カ ・ ド ル 通 貨 計		□ 数、金 額	443.628	462.723	41,078
		銘 柄 数 < 比 率 >	39 銘柄	36 銘柄	<1.9%>
(カナダ)					
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		4.8	—	—	—
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		2.1	—	—	—
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		2.4	2.9	169	15,132
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		4.7	5.8	128	11,451
カ ナ ダ ・ ド ル 通 貨 計		□ 数、金 額	14	8.7	297
		銘 柄 数 < 比 率 >	4 銘柄	2 銘柄	<0.0%>
(オーストラリア)					
DEXUS/AU		—	36.15	392	31,884
LENDLEASE GROUP		21.5	23.5	249	20,249
TRANSURBAN GROUP		89.5	95.4	1,306	106,166
SYDNEY AIRPORT		42.5	45.8	377	30,678
APA GROUP		38.1	41.4	401	32,644
SCENTRE GROUP		159.922	181.922	553	44,956
DEXUS		33.15	—	—	—
GPT GROUP		63.16	68.16	353	28,756
MIRVAC GROUP		126.1	136.1	394	32,084
STOCKLAND		78	83.8	364	29,632
GOODMAN GROUP		52.9	58.2	1,428	116,147
VICINITY CENTRES		123.273	137.273	232	18,914
オーストラリア・ドル通貨計		□ 数、金 額	828.105	907.705	6,053
		銘 柄 数 < 比 率 >	11 銘柄	11 銘柄	<0.2%>

銘 柄	期 首 □ 数	当 期 □ 数	期 末 評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円
LINK REIT	70.5	81.5	5,599	81,690
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	92	92	703	10,268
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	122	138	1,465	21,382
香 港 ・ ド ル 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	284.5 3 銘柄	311.5 3 銘柄	7,768 113,341 <0.0%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	101	124.5	372	30,975
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	158.032	190.87	408	33,988
SUNTEC REIT	63	—	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	91.8	114.3	218	18,165
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	65.5	77.5	161	13,477
(非上場)				
ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS	3.737	—	—	—
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	483.069 6 銘柄	507.17 4 銘柄	1,161 96,607 <0.0%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	21.662	23.562	176	26,818
SEGRO PLC	38.45	43.1	610	92,594
BRITISH LAND CO PLC	29.55	29.55	154	23,351
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	89.662 3 銘柄	96.212 3 銘柄	941 142,764 <0.1%>
(ユーロ (フランス))	千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4.2	4.6	276	35,441
ICADE	0.95	—	—	—
GECINA SA	1.4	1.6	190	24,521
KLEPIERRE	6.25	7.15	136	17,494
COVIVIO	1.5	1.75	128	16,485
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	14.3 5 銘柄	15.1 4 銘柄	731 93,942 <0.0%>
合 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,157.264 71 銘柄	2,309.11 63 銘柄	— 5,638,901 <2.2%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

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

(注1) 外貨建の評価額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

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

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1香港・ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.21円、1ニュージーランド・ドル=77.53円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シケル=36.011円、1スイス・フラン=123.25円、1デンマーク・クローネ=17.27円、1ノルウェー・クローネ=12.61円、1スウェーデン・クローネ=12.53円、1ユーロ=128.41円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産 (241,345,626千円) の投資信託財産総額 (250,978,162千円) に対する比率は、96.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在	
項 目	当 期 末
(A) 資産	260,709,876,829円
コール・ローン等	10,822,639,735
株式（評価額）	229,141,995,652
投資信託証券（評価額）	5,638,901,532
未収入金	10,204,922,167
未収配当金	248,294,417
差入委託証拠金	4,653,123,326
(B) 負債	9,932,665,466
未払金	9,867,283,466
未払解約金	65,382,000
(C) 純資産総額（A－B）	250,777,211,363
元本	61,024,141,090
次期繰越損益金	189,753,070,273
(D) 受益権総口数	61,024,141,090口
1万口当り基準価額（C／D）	41,095円

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

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

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

* 当期末の計算口数当りの純資産額は41,095円です。

■損益の状況

当期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日	
項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,297,226,954円
受取配当金	3,289,764,908
受取利息	1,845
その他収益金	10,303,967
支払利息	△ 2,843,766
(B) 有価証券売買損益	57,314,244,756
売買益	62,568,866,991
売買損	△ 5,254,622,235
(C) 先物取引等損益	2,472,470,870
取引益	2,561,237,007
取引損	△ 88,766,137
(D) その他費用	△ 66,438,634
(E) 当期損益金（A＋B＋C＋D）	63,017,503,946
(F) 前期繰越損益金	108,215,788,993
(G) 解約差損益金	△ 17,149,000,589
(H) 追加信託差損益金	35,668,777,923
(I) 合計（E＋F＋G＋H）	189,753,070,273
次期繰越損益金（I）	189,753,070,273

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

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

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式		
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）		
運用方針	海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめ ざして運用を行ないます。		
主要投資 対 象	ベビーファンド	イ. 外国株式インデックスマ ザーファンドの受益証券 ロ. ダイワ新興国株式ファン ダメンタル・インデック ス・マザーファンドの受益 証券	
	外 国 株 式 インデックス マザーファンド	外国の株式（預託証券を含み ます。）	
	ダイワ新興国株式 ファンダメンタル・ インデックス・ マザーファンド	1. 新興国の金融商品取引所 上場株式および店頭登録株 式（上場予定および店頭登 録予定を含みます。） 2. 新興国の企業のD R（預 託証券） 3. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめ ざすE T F（上場投資信託 証券）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	外国株式インデックスマザーファンドの株式組入上限比率		
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデッ クス・マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買 益（評価益を含みます。）等とし、原則とし て、信託財産の成長に資することを目的に、配 当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して 分配金額を決定します。ただし、配当等収益が 少額の場合には、分配を行なわないことがあり ます。		

運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2022年6月15日)
(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2730>

最近5期の運用実績

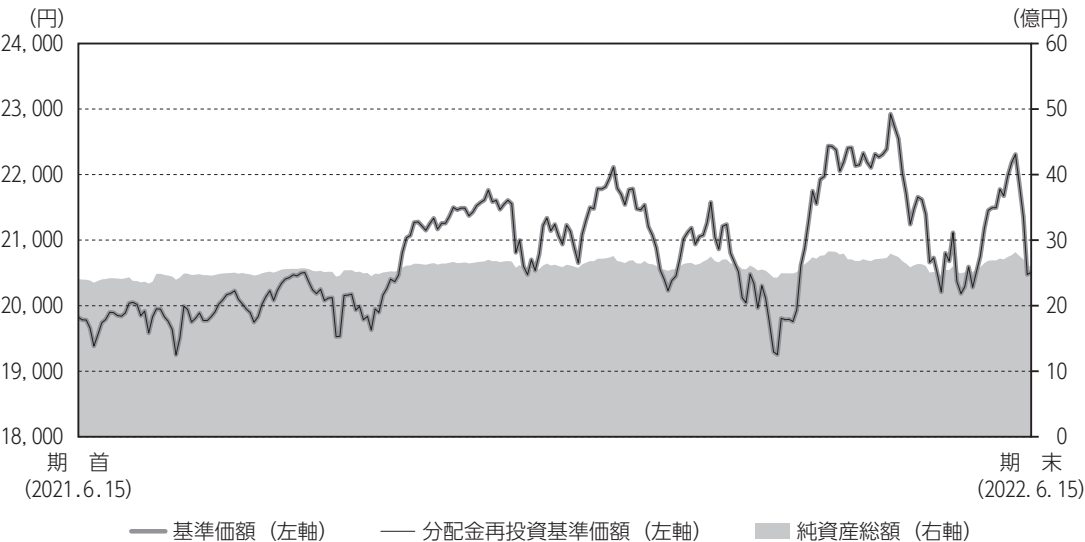
決 算 期	基 準 価 額			株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
2 期末 (2018年 6 月15日)	13,778	0	13.3	93.2	1.3	4.3	1,697
3 期末 (2019年 6 月17日)	13,793	0	0.1	93.8	1.3	4.0	1,747
4 期末 (2020年 6 月15日)	13,573	0	△ 1.6	93.5	0.7	4.8	1,800
5 期末 (2021年 6 月15日)	19,822	0	46.0	90.7	5.1	3.4	2,402
6 期末 (2022年 6 月15日)	20,510	0	3.5	91.2	3.9	3.9	2,605

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注2) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
(注3) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。
(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。
(注5) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■ 基準価額・騰落率

期 首：19,822円
期 末：20,510円（分配金 0 円）
騰落率：3.5%（分配金込み）

■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国株式インデックスマザーファンド	4.9%	78.7%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	△0.4%	20.5%

■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて、主に海外の株式に投資した結果、海外の株式市場は下落した一方、為替相場が円安となったことにより、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証 券 組入比率
		騰 落 率			
(期首)2021年 6月15日	円	%	%	%	%
	19,822	—	90.7	5.1	3.4
6 月末	19,841	0.1	89.8	6.4	3.0
7 月末	19,889	0.3	91.5	5.5	2.2
8 月末	20,341	2.6	90.3	6.3	2.9
9 月末	19,989	0.8	90.6	5.6	3.0
10月末	21,257	7.2	90.2	5.9	3.2
11月末	20,997	5.9	89.2	6.8	3.3
12月末	21,814	10.0	90.8	4.9	3.6
2022年 1 月末	20,705	4.5	89.7	5.7	3.8
2 月末	20,481	3.3	89.3	5.8	4.0
3 月末	22,376	12.9	91.8	4.7	2.7
4 月末	21,477	8.3	90.7	5.2	3.3
5 月末	21,455	8.2	88.7	6.8	3.7
(期末)2022年 6月15日	20,510	3.5	91.2	3.9	3.9

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■先進国株式市況

先進国株式市況は下落しました。

先進国株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展により経済活動の正常化が順次進んだことや、好調な経済指標の発表などから上昇しました。2021年9月には、中国の大手不動産会社の資金繰り問題や米国の債務上限問題、米国金利上昇に対する警戒感など複数のリスク要因が嫌気され、軟調な推移となりました。2022年に入ると、2021年12月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）議事録を受け、米国の金融引き締めに対する懸念が高まり下落しました。2月以降は、欧米中央銀行高官の金融政策に対する発言やロシアのウクライナへの侵攻、ロシアとウクライナの散発的な停戦協定による状況改善期待などから、一進一退の展開となりました。その後は、FRB（米国連邦準備制度理事会）の利上げペースが一層加速するとの懸念などから下落し、当作成期末を迎えました。

■先進国為替相場

為替相場は円安となりました。

当作成期首より、米ドル円は比較的狭いレンジでの推移となりましたが、2021年9月以降は米国金利が上がったことにより上昇（円安）しました。その後2022年に入ってから、期待インフレ率の上昇などにより米国金利がさらに上がったため、米ドル円も上げ幅を拡大しました。また、世界的に利上げ観測が高まっている一方で、日本の金融政策が相対的に緩和的であることなどから、その他の通貨も対円で上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに円安が進みました。

■新興国株式市況

新興国株式市況は下落しました。

新興国株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの影響が続く中で緩やかな下落基調で推移しました。中国のテクノロジー業界における規制強化や、米国と中国の対立も下落の要因となりました。その後、2022年2月末にはロシアのウクライナ侵攻の影響で株価は大きく下落しました。3月半ばから反発する局面もありましたが、ウクライナ情勢の混乱長期化や世界的なインフレ懸念と米国の金利引き上げが織り込まれていく形で、株価は下落して当作成期末を迎えました。

■新興国為替相場

新興国為替相場は対円で上昇しました。

新興国為替相場は、当作成期首より対円で横ばい推移しました。2021年10月以降は、市場のリスク回避的な姿勢が後退したことなどを背景に、対円で上昇して推移しました。2022年2月末のロシアによるウクライナ侵攻でリスク回避傾向が高まり、新興国通貨は対米ドルで下落しましたが、相対的に円の下落幅が大きく、対円では上昇推移が続きました。その後は、世界的なインフレ懸念と米国の金利引き上げ観測から、米ドルが相対的に強く推移しました。この局面でも新興国為替は対米ドルでは下落しましたが、日米の金融政策の相違がより明確となり、円安米ドル高が大きく進行したため、対円では上昇して当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

（2021. 6. 16 ～ 2022. 6. 15）

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

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

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

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	10,510

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	95円	0. 456%	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, 801円です。
(投 信 会 社)	(67)	(0. 324)	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)	(23)	(0. 110)	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)	(5)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	4	0. 018	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. 012)	
(新株予約権証券)	(0)	(0. 000)	
(先物・オプション)	(1)	(0. 003)	
(投資信託証券)	(1)	(0. 003)	
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)	(3)	(0. 012)	
(新株予約権証券)	(0)	(0. 000)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	13	0. 064	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)	(8)	(0. 036)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(5)	(0. 022)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	115	0. 551	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

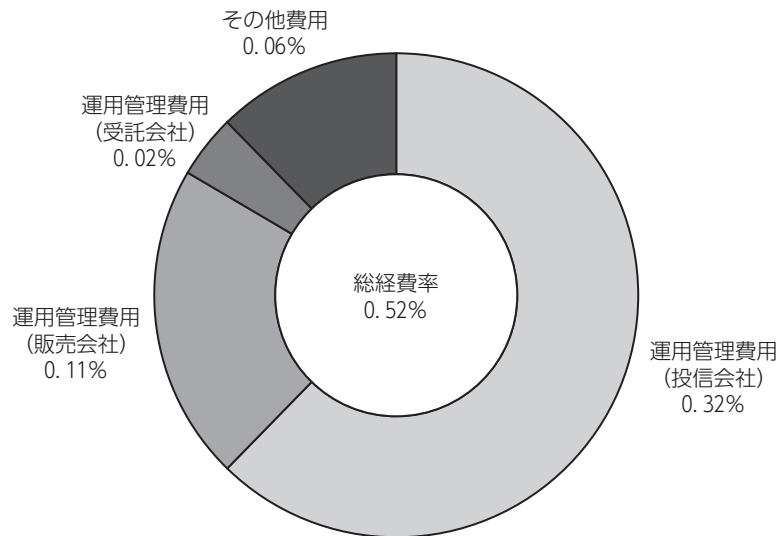
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.52%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6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	79,928	150,806	50,941	98,360
外国株式インデックスマザーファンド	101,730	406,490	88,229	359,331

(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6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	8,347,123千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,032,951千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.55
項 目	外 国 株 式
	インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	39,447,732千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	229,720,983千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.17

- (注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期	期 末
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	245,435	274,421	533,311
外国株式インデックスマザーファンド	506,476	519,977	2,050,895

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期	期 末
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	533,311	20.4
外国株式インデックスマザーファンド	2,050,895	78.5
コール・ローン等、その他	27,920	1.1
投資信託財産総額	2,612,127	100.0

- (注1) 評価額の単位未満は切捨て。
 (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.01円、1カナダ・ドル=104.20円、1オーストラリア・ドル=93.10円、1香港・ドル=17.20円、1シンガポール・ドル=96.95円、1ニュージーランド・ドル=83.95円、1台湾・ドル=4.548円、1イギリス・ポンド=162.21円、1イスラエル・シェケル=38.942円、1スイス・フラン=135.01円、1トルコ・リラ=7.825円、1デンマーク・クローネ=18.93円、1ノルウェー・クローネ=13.49円、1スウェーデン・クローネ=13.25円、1メキシコ・ペソ=6.565円、100チリ・ペソ=15.542円、1サウジアラビア・リアル=36.04円、1インド・ルピー=1.74円、100インドネシア・ルピア=0.92円、1ブラジル・レアル=26.374円、1オフショア・人民元=20.014円、1マレーシア・リンギット=30.536円、1南アフリカ・ランド=8.42円、1タイ・バーツ=3.85円、1ユーロ=140.80円です。
 (注3) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(19,984,797千円)の投資信託財産総額(20,300,596千円)に対する比率は、98.4%です。
 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(254,328,525千円)の投資信託財産総額(257,632,004千円)に対する比率は、98.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,612,127,648円
コール・ローン等	27,920,770
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド (評価額)	533,311,296
外国株式インデックスマザーファンド (評価額)	2,050,895,582
(B) 負債	6,251,510
未払解約金	164,756
未払信託報酬	6,014,386
その他未払費用	72,368
(C) 純資産総額 (A - B)	2,605,876,138
元本	1,270,536,081
次期繰越損益金	1,335,340,057
(D) 受益権総口数	1,270,536,081口
1万口当り基準価額 (C / D)	20,510円

* 期首における元本額は1,212,032,415円、当作成期間中における追加設定元本額は295,982,191円、同解約元本額は237,478,525円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は20,510円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 5,214円
受取利息	598
支払利息	△ 5,812
(B) 有価証券売買損益	75,360,540
売買益	102,236,016
売買損	△ 26,875,476
(C) 信託報酬等	△ 11,939,360
(D) 当期損益金 (A + B + C)	63,415,966
(E) 前期繰越損益金	623,844,481
(F) 追加信託差損益金	648,079,610
(配当等相当額)	(305,170,100)
(売買損益相当額)	(342,909,510)
(G) 合計 (D + E + F)	1,335,340,057
次期繰越損益金 (G)	1,335,340,057
追加信託差損益金	648,079,610
(配当等相当額)	(305,170,100)
(売買損益相当額)	(342,909,510)
分配準備積立金	687,265,661
繰越損益金	△ 5,214

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

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

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

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	63,417,139
(c) 収益調整金	648,079,610
(d) 分配準備積立金	623,848,522
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,335,345,271
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,335,345,271
(h) 受益権総口数	1,270,536,081口

★「外国株式インデックスマザーファンド」の第22期にかかる運用状況については105～127ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「外国株式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6月15日）現在における外国株式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。86～104ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の決算日（2021年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

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

(1) 株式

(2021年6月16日から2022年6月15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
ALIBABA GROUP HOLDING LTD (ケイマン諸島)	238.1	435,256	1,828	HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	742	333,987	450
TENCENT HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)	39.9	240,168	6,019	PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	165.7	139,442	841
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	89	224,340	2,520	IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	1,703	123,088	72
VALE SA (ブラジル)	83.7	193,702	2,314	CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	1,159	103,490	89
PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)	210	186,286	887	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	133.5	89,376	669
BAIDU INC-CLASS A (ケイマン諸島)	64.65	151,346	2,341	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル)	116.2	89,278	768
JD. COM INC - CL A (ケイマン諸島)	27.5	112,812	4,102	JD. COM INC-ADR (ケイマン諸島)	7.8	67,812	8,693
XIAOMI CORP-CLASS B (ケイマン諸島)	332.8	70,503	211	AL RAJHI BANK (サウジアラビア)	11.509	59,544	5,173
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H (中国)	1,116	64,568	57	BAIDU INC - SPON ADR (ケイマン諸島)	3.1	56,543	18,239
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)	642	61,269	95	XP INC BDR (ケイマン諸島)	12.405	42,103	3,394

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2021年6月16日から2022年6月15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
INVESTOR FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	1,263	3,224,876	2,553	INVESTOR FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	978.6	2,436,704	2,489

(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6月15日現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド（10,444,109千口）の内容です。

(1) 外国株式

銘	柄	2022年 6月15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	
JOYY INC-ADR		34	105	14, 266	コミュニケーション・サービス
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR		137	291	39, 341	一般消費財・サービス
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF		290	—	—	エネルギー
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR		309	333	45, 055	一般消費財・サービス
TAL EDUCATION GROUP- ADR		469	208	28, 113	一般消費財・サービス
CANADIAN SOLAR INC		44	129	17, 447	情報技術
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR		353. 5	—	—	コミュニケーション・サービス
LUFAX HOLDING LTD-ADR		293	179	24, 169	金融
JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD		30	172	23, 301	情報技術
TRIP. COM GROUP LTD-ADR		167	370	50, 008	一般消費財・サービス
VTB BANK JSC -GDR-REG S		1, 912. 17	—	—	金融
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR		72. 9	—	—	素材
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR		96. 08	—	—	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR		360. 75	—	—	エネルギー
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR		182. 93	—	—	素材
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS		233. 94	—	—	生活必需品
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR		1, 746. 77	—	—	金融
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S		26. 98	—	—	エネルギー
LUKOIL PJSC-SPON ADR		230. 88	—	—	エネルギー
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR		974. 99	—	—	エネルギー
GAZPROM PJSC-SPON ADR		4, 267. 39	—	—	エネルギー
SEVERSTAL - GDR REG S		134. 6	—	—	素材
TATNEFT PJSC - PREF		210. 09	—	—	エネルギー
SISTEMA PJSC		3, 192	—	—	コミュニケーション・サービス
INTER RAO UES PJSC		27, 261	—	—	公益事業
ALROSA PJSC		1, 803. 1	—	—	素材

銘柄		2022年6月15日現在			業種等
		株数	価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ AEROFLOT PJSC		百株 566.19 1,649.1	千アメリカ・ドル — —	千円 — —	金融 資本財・サービス
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	47,048.36 28銘柄	1,790	241,704 <1.2%>	
(香港)		百株	千香港・ドル	千円	
CHINA CONCH ENVIRONMENT PROTECTION		290	157	2,703	資本財・サービス
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H		5,690	2,827	48,640	資本財・サービス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT		1,930	2,821	48,532	一般消費財・サービス
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT		2,170	969	16,683	資本財・サービス
JIANGXI COPPER CO LTD-H		1,060	1,291	22,206	素材
CHINA GAS HOLDINGS LTD		1,368	1,644	28,282	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H		31,958	11,600	199,532	エネルギー
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS		385	656	11,297	資本財・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD		614	23,086	397,086	コミュニケーション・サービス
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD		5,440	2,404	41,357	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN		1,760	2,569	44,197	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H		22,280	9,624	165,549	エネルギー
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS		200	1,172	20,158	一般消費財・サービス
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD		2,280	745	12,823	不動産
HUANENG POWER INTL INC-H		4,280	1,506	25,912	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H		695	2,276	39,149	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H		620	985	16,955	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H		41,470	22,974	395,159	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H		5,920	2,255	38,794	金融
GREENTOWN CHINA HOLDINGS		755	1,001	17,219	不動産
GF SECURITIES CO LTD-H		500	508	8,737	金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H		666	771	13,265	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD		255	935	16,096	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H		6,060	3,514	60,454	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H		2,355	6,299	108,353	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT		1,431.2	1,023	17,600	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H		520	954	16,421	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD		1,660	5,378	92,508	不動産
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD		960	2,745	47,224	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL		1,885	774	13,325	ヘルスケア
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT		320	1,124	19,346	公益事業
BYD CO LTD-H		60	1,822	31,352	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H		34,450	10,024	172,429	金融
CHINA RESOURCES CEMENT		1,420	728	12,529	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H		670	1,403	24,142	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H		7,110	1,791	30,817	金融
CITIC LTD		1,600	1,361	23,419	資本財・サービス
CHINA HONGQIAO GROUP LTD		1,450	1,345	23,144	素材
IND & COMM BK OF CHINA-H		44,780	20,240	348,137	金融
CHINA TOWER CORP LTD-H		15,700	1,491	25,653	コミュニケーション・サービス
XIAOMI CORP-CLASS B		3,328	3,840	66,056	情報技術
MEITUAN-CLASS B		177	3,440	59,183	一般消費財・サービス
ALIBABA GROUP HOLDING LTD		3,332	33,719	579,981	一般消費財・サービス
JD.COM INC - CL A		285.95	6,897	118,630	一般消費財・サービス
NETEASE INC		256	4,175	71,816	コミュニケーション・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H		2,870	548	9,428	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-H		672	1,696	29,184	一般消費財・サービス
BAIDU INC-CLASS A		646.5	8,805	151,451	コミュニケーション・サービス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST		3,000	6,465	111,198	不動産
CRRC CORP LTD - H		2,860	875	15,052	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-H		5,570	1,069	18,394	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H		4,040	18,907	325,203	金融
CHINA COAL ENERGY CO-H		1,520	1,190	20,470	エネルギー
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD		7,460	3,416	58,766	不動産
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H		655.5	819	14,093	資本財・サービス
CHINA MINSHENG BANKING COR-H		11,165.8	3,494	60,112	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO		4,290	1,797	30,917	不動産
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD		100	872	14,998	一般消費財・サービス
CHINA VANKE CO LTD-H		1,874	3,122	53,699	不動産
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H		1,140	878	15,117	一般消費財・サービス
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP		104	1,020	17,548	一般消費財・サービス
CHINA MENGNIU DAIRY CO		480	1,761	30,299	生活必需品
PICC PROPERTY & CASUALTY-H		2,420	1,967	33,840	金融
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H		570	930	16,000	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H		980	1,266	21,777	資本財・サービス
CHINA POWER INTERNATIONAL		3,970	1,846	31,752	公益事業
SUNNY OPTICAL TECH		60	688	11,837	情報技術
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H		2,640	852	14,666	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H		1,902	3,225	55,483	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H		845	1,046	17,993	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-H		3,330	3,996	68,731	金融
ENN ENERGY HOLDINGS LTD		199	2,421	41,655	公益事業
KUNLUN ENERGY CO LTD		1,780	1,142	19,655	公益事業
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H		1,040	1,083	18,639	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H		2,560	2,109	36,282	素材

銘		柄	2022年 6月15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	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H			9,681	5,024	86,420	金融
CHINA EVERGRANDE GROUP			1,420	234	4,029	不動産
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H			3,040	857	14,745	金融
CHINA MERCHANTS BANK-H			1,330	6,244	107,402	金融
BANK OF CHINA LTD-H			45,220	13,837	238,001	金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H			700	1,202	20,684	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H			4,240	1,081	18,596	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-H			1,720	983	16,922	金融
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE			940	514	8,851	一般消費財・サービス
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD			835	2,709	46,604	不動産
香 港 ・ ド ル 通 貨 計	株 数、金 額	402,265.95	320,894	5,519,384		
	銘柄 数 < 比 率 >	85 銘柄		<27.2%>		
(シンガポール)			百株	千シンガポール・ドル	千円	
YANGZIJANG FINANCIAL HOLDING			1,260	61	5,924	金融
YANGZIJANG SHIPBUILDING			1,260	121	11,788	資本財・サービス
シンガポール・ドル通貨計	株 数、金 額	2,520	182	17,712		
	銘柄 数 < 比 率 >	2 銘柄		<0.1%>		
(台湾)			百株	千台湾・ドル	千円	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO			260	3,367	15,316	情報技術
SINO-AMERICAN SILICON PRODUC			180	2,889	13,141	情報技術
TAIWAN CEMENT			1,471.45	5,900	26,840	素材
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT			1,630	16,626	75,630	情報技術
WALSIN TECHNOLOGY CORP			250	2,687	12,225	情報技術
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO			651.12	4,167	18,956	生活必需品
FORMOSA PLASTICS CORP			1,136	12,098	55,034	素材
NAN YA PLASTICS CORP			921.4	7,638	34,746	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE			413.9	3,369	15,325	素材
CHINA STEEL CORP			4,666.86	15,867	72,178	素材
LITE-ON TECHNOLOGY CORP			546.16	3,326	15,130	情報技術
DELTA ELECTRONICS INC			520	11,882	54,050	情報技術
YAGEO CORPORATION			140	5,278	24,009	情報技術
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP			570	3,306	15,038	情報技術
ACER INC			1,770	4,840	22,020	情報技術
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD			630	3,553	16,163	情報技術
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP			80	3,428	15,593	情報技術
QUANTA COMPUTER INC			1,060	8,469	38,526	情報技術
AU OPTRONICS CORP			6,670	11,339	51,579	情報技術
CHUNGHWA TELECOM CO LTD			974	12,126	55,161	コミュニケーション・サービス
MEDIATEK INC			210.03	18,482	84,075	情報技術
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD			290	4,872	22,162	情報技術
EVERGREEN MARINE CORP LTD			270	3,550	16,150	資本財・サービス
FUBON FINANCIAL HOLDING CO			2,194.34	13,604	61,887	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO			2,718.38	14,516	66,032	金融
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL			5,820	9,050	41,167	金融
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO			2,001.24	5,893	26,809	金融
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO			2,133.81	4,929	22,421	金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT			2,039.93	7,527	34,241	金融
TAISHIN FINANCIAL HOLDING			2,340	3,954	17,989	金融
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING			10,402.31	9,590	43,628	金融
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS			2,180	3,716	16,907	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT			4,230.28	10,998	50,032	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO			1,722.14	4,563	20,759	金融
LARGAN PRECISION CO LTD			40	6,920	31,478	情報技術
NOVATEK MICROELECTRONICS COR			110	4,169	18,964	情報技術
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP			140	2,821	12,832	情報技術
WISTRON CORP			1,381.1	3,977	18,093	情報技術
INNOLUX CORP			7,230	9,832	44,728	情報技術
PEGATRON CORP			640	4,390	19,971	情報技術
CHAILEASE HOLDING CO LTD			247.94	5,392	24,530	金融
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL			1,520	4,104	18,668	金融
POWERTECH TECHNOLOGY INC			484	4,772	21,708	情報技術
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP			360	3,488	15,868	エネルギー
COMPAL ELECTRONICS			1,740	3,967	18,046	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC			3,030	155,439	707,076	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY			2,889.02	32,212	146,531	情報技術
PRESIDENT CHAIN STORE CORP			140	3,689	16,780	生活必需品
ASUSTEK COMPUTER INC			277.6	9,022	41,040	情報技術
UNITED MICROELECTRONICS CORP			3,100	15,376	69,943	情報技術
台 湾 ・ ド ル 通 貨 計	株 数、金 額	86,423.01	526,984	2,397,199		
	銘柄 数 < 比 率 >	50 銘柄		<11.8%>		
(トルコ)			百株	千トルコ・リラ	千円	
TURKIYE GARANTI BANKASI			4,268.52	6,407	50,137	金融
AKBANK T. A. S.			5,781.32	4,873	38,137	金融
TURKIYE IS BANKASI-C			8,102.36	3,889	30,433	金融
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS			1,956.33	3,482	27,249	コミュニケーション・サービス
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE			204.07	5,518	43,180	エネルギー
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK			1,162.93	3,537	27,683	素材
HACI OMER SABANCI HOLDING			2,082.02	4,084	31,965	金融

銘柄		2022年6月15日現在			業種等
		株数	価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千トルコ・リラ	千円	
TURKIYE HALK BANKASI		3,356.45	1,923	15,049	金融
YAPI VE KREDI BANKASI		4,210.52	1,945	15,222	金融
KOC HOLDING AS		1,226.98	4,851	37,964	資本財・サービス
TURK HAVA YOLLARI AO		1,219.46	5,714	44,716	資本財・サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		356.99	2,986	23,368	生活必需品
トルコ・リラ通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	33,927.95 12銘柄	49,213 <1.9%>	
		百株	千メキシコ・ペソ	千円	
(メキシコ)					
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L		10,736	21,407	140,551	コミュニケーション・サービス
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO		1,113	3,689	24,224	コミュニケーション・サービス
CEMEX SAB-CPO		11,105.19	8,317	54,610	素材
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD		881	12,483	81,962	生活必需品
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV		197	2,520	16,545	生活必需品
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B		688	6,217	40,820	素材
WALMART DE MEXICO SAB DE CV		1,603	10,682	70,135	生活必需品
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O		820	9,739	63,947	金融
メキシコ・ペソ通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	27,143.19 8銘柄	75,058 <2.4%>	
		百株	千チリ・ペソ	千円	
(チリ)					
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE		2.41	17,050	2,650	素材
CENCOSUD SA		671.12	87,581	13,612	生活必需品
BANCO SANTANDER CHILE		42,682.55	165,608	25,739	金融
ENEL AMERICAS SA		13,632.94	123,105	19,133	公益事業
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		18.72	151,401	23,531	素材
FALABELLA SA		558.41	117,266	18,225	一般消費財・サービス
BANCO DE CHILE		20,598.72	173,235	26,924	金融
チリ・ペソ通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	78,164.87 7銘柄	835,248 <0.6%>	
		百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
(サウジアラビア)					
SAUDI ARABIAN MINING		128.08	742	26,772	素材
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP		233.24	2,509	90,448	素材
SAUDI TELECOM CO		164.45	1,677	60,453	コミュニケーション・サービス
AL RAJHI BANK		254.22	2,290	82,550	金融
RIYAD BANK		231.11	821	29,610	金融
ETIHAD ETISALAT CO		144.62	498	17,981	コミュニケーション・サービス
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL		72.59	390	14,074	素材
ALINMA BANK		188.42	673	24,276	金融
THE SAUDI NATIONAL BANK		270.87	1,812	65,308	金融
SAUDI ARABIAN OIL CO		561.61	2,193	79,038	エネルギー
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO		275.76	443	16,000	素材
SAUDI ELECTRICITY CO		365.17	848	30,585	公益事業
サウジアラビア・リアル通貨計		株数、金額 銘柄数<比率>	2,890.14 12銘柄	14,902 <2.6%>	
		百株	千インド・ルピー	千円	
(インド)					
TATA STEEL LTD		425.77	42,413	73,798	素材
AXIS BANK LTD		526.55	34,265	59,621	金融
MARUTI SUZUKI INDIA LTD		23.5	18,357	31,941	一般消費財・サービス
TATA POWER CO LTD		556.46	12,264	21,340	公益事業
BANK OF BARODA		873.29	8,780	15,278	金融
HINDUSTAN UNILEVER LTD		91.66	19,899	34,624	生活必需品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP		524.85	11,231	19,543	エネルギー
STATE BANK OF INDIA		751.56	33,677	58,598	金融
NTPC LTD		1,829.05	27,691	48,183	公益事業
JSW STEEL LTD		300.41	16,880	29,371	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD		1,332.5	29,841	51,923	公益事業
INDIAN OIL CORP LTD		1,457.95	16,073	27,968	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD		715.4	22,485	39,123	エネルギー
JINDAL STEEL & POWER LTD		260.88	9,085	15,808	素材
ULTRATECH CEMENT LTD		15.97	8,669	15,084	素材
PIRAMAL ENTERPRISES LTD		46.17	7,380	12,842	金融
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE		90.2	10,277	17,883	金融
TECH MAHINDRA LTD		117.02	12,054	20,975	情報技術
YES BANK LTD		176.4	224	389	金融
TATA MOTORS LTD-A-DVR		281.75	5,567	9,687	一般消費財・サービス
REC LTD		725.16	8,230	14,321	金融
COAL INDIA LTD		1,657.98	31,866	55,447	エネルギー
INDUS TOWERS LTD		411.72	8,292	14,428	コミュニケーション・サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE L		787.03	8,008	13,933	金融
GAIL INDIA LTD		1,294.03	19,015	33,087	公益事業
HINDALCO INDUSTRIES LTD		659.18	23,618	41,096	素材
GRASIM INDUSTRIES LTD		137.11	17,952	31,237	素材
WIPRO LTD		155.83	6,948	12,090	情報技術
TATA CONSULTANCY SVCS LTD		135.39	43,467	75,633	情報技術
INFOSYS LTD		502.75	72,423	126,017	情報技術
LARSEN & TOUBRO LTD		189.47	29,266	50,923	資本財・サービス
TATA MOTORS LTD		1,289.11	52,228	90,877	一般消費財・サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE		350.93	74,028	128,809	金融

銘柄		2022年 6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千インド・ルピー	千円	
ICICI BANK LTD		267.64	18,346	31,923	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD		700.02	183,972	320,111	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD		2,316.58	36,127	62,861	エネルギー
ITC LTD		909.71	24,148	42,017	生活必需品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD		363.7	37,070	64,502	一般消費財・サービス
HERO MOTOCORP LTD		58.06	14,849	25,838	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD		413.67	28,214	49,092	コミュニケーション・サービス
UPL LTD		171.76	12,292	21,389	素材
SUN PHARMACEUTICAL INDUS		154.16	12,718	22,131	ヘルスケア
HCL TECHNOLOGIES LTD		180.04	17,948	31,229	情報技術
VEDANTA LTD		794.58	23,134	40,253	素材
インド・ルピー通貨計		株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	25,022.95 44銘柄	1,151,290 <9.9%>	
(インドネシア)		百株	千インドネシア・ルピア	千円	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT		4,829	3,368,227	30,987	一般消費財・サービス
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK		12,563	5,163,393	47,503	コミュニケーション・サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER		3,155	2,610,762	24,019	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT		7,016	5,191,840	47,764	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT		4,441	3,641,620	33,502	金融
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER		15,072	6,571,392	60,456	金融
ADARO ENERGY TBK PT		8,504	2,772,304	25,505	エネルギー
インドネシア・ルピア通貨計		株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	55,580 7銘柄	29,319,539 <1.3%>	
(ブラジル)		百株	千ブラジル・リアル	千円	
CIA PARANAENSE DE ENERGIA		265	166	4,403	公益事業
ENERGISA SA-UNITS		147	619	16,333	公益事業
RUMO SA		509	868	22,902	資本財・サービス
VIBRA ENERGIA SA		1,134	1,930	50,904	一般消費財・サービス
VIA SA		2,265	518	13,680	一般消費財・サービス
NATURA &CO HOLDING SA		412	576	15,201	生活必需品
TIM SA		526.26	655	17,294	コミュニケーション・サービス
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE		555	316	8,343	ヘルスケア
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR		3,763	11,138	293,770	エネルギー
USINAS SIDER MINAS GER-PF A		312	292	7,710	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF		4,701.59	8,763	231,139	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF		4,159.36	9,836	259,441	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA		307	556	14,679	素材
VALE SA		1,785.9	14,594	384,917	素材
GERDAU SA-PREF		634	1,610	42,489	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS		2,491	8,145	214,834	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF		991.73	1,075	28,353	公益事業
ITAUSA SA		1,323.2	1,153	30,431	金融
BRASKEM SA-PREF A		166	687	18,121	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B		245	987	26,047	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.		1,277	4,280	112,895	金融
COSAN SA		392	720	18,992	エネルギー
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER		559	2,317	61,110	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB		1,084	747	19,726	公益事業
EMBRAER SA		489	552	14,560	資本財・サービス
METALURGICA GERDAU SA-PREF		1,192	1,290	34,047	素材
CCR SA		786	967	25,518	資本財・サービス
BRF SA		797	1,048	27,662	生活必需品
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP		266	1,119	29,528	公益事業
LOJAS RENNER S. A.		277.75	636	16,797	一般消費財・サービス
JBS SA		801	2,643	69,715	生活必需品
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS		115	106	2,817	素材
SUZANO SA		158.45	803	21,187	素材
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO		1,380	1,585	41,819	金融
CIELO SA		2,931.28	1,108	29,223	情報技術
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD		411	962	25,376	公益事業
SUL AMERICA SA - UNITS		343.18	821	21,677	金融
CIA ENERGETICA DE MINAS GER		276.3	419	11,054	公益事業
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT		407	1,227	32,374	金融
TELEFONICA BRASIL S. A.		340	1,575	41,563	コミュニケーション・サービス
KLABIN SA - UNIT		325	679	17,931	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA		1,106	1,350	35,616	エネルギー
ITAU UNIBANCO HOLDING SA		393	797	21,020	金融
COGNA EDUCACAO		4,014	903	23,820	一般消費財・サービス
BANCO BRADESCO S. A.		1,381.21	2,146	56,610	金融
AMBEV SA		1,910	2,511	66,243	生活必需品
ブラジル・リアル通貨計		株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	50,105.21 46銘柄	2,579,895 <12.7%>	
(中国)		百株	千オフショア・人民元	千円	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A		1,044	2,112	42,270	金融
BANK OF BEIJING CO LTD -A		1,860	837	16,752	金融
PING AN INSURANCE GROUP CO-A		518	2,342	46,881	金融
IND & COMM BK OF CHINA-A		3,012	1,421	28,453	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A		130	233	4,675	ヘルスケア

銘	柄	2022年6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千オフショア・人民元	千円	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A		29	119	2,393	一般消費財・サービス
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A		6	1,122	22,468	生活必需品
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A		159	575	11,513	素材
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A		564	853	17,090	不動産
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A		2,719	2,139	42,827	金融
CITIC SECURITIES CO-A		215	453	9,083	金融
CHINA MERCHANTS BANK-A		512	2,009	40,210	金融
PING AN BANK CO LTD-A		786	1,109	22,212	金融
GF SECURITIES CO LTD-A		148	284	5,687	金融
CHINA STATE CONSTRUCTION -A		4,804	2,584	51,728	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-A		101	243	4,871	一般消費財・サービス
SAIC MOTOR CORP LTD-A		871	1,592	31,866	一般消費財・サービス
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A		439	173	3,470	金融
CHINA COAL ENERGY CO-A		262	298	5,977	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A		171.6	251	5,024	資本財・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A		1,079	378	7,580	資本財・サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A		704	349	7,002	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-A		135	253	5,082	素材
YANKUANG ENERGY GROUP LTD A		41	177	3,557	エネルギー
CHINA CONSTRUCTION BANK-A		306	183	3,680	金融
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A		10,813	3,265	65,357	金融
BANK OF CHINA LTD-A		3,144	1,015	20,324	金融
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A		2,849	1,207	24,176	エネルギー
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A		3,699	1,842	36,868	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A		344	1,187	23,759	エネルギー
CHINA VANKE CO LTD -A		674	1,196	23,944	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A		333	726	14,535	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A		487	230	4,610	金融
CHINA MINSHENG BANKING-A		4,294	1,670	33,431	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A		3,928	1,253	25,078	金融
CRRC CORP LTD-A		1,187	607	12,163	資本財・サービス
CHINA UNITED NETWORK-A		2,495	865	17,327	コミュニケーション・サービス
CGN POWER CO LTD-A		189	53	1,062	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-A		213	306	6,143	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A		335	328	6,577	金融
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A		2,064	1,281	25,653	資本財・サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A		1,231	816	16,334	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A		102	304	6,089	金融
HUAXIA BANK CO LTD-A		1,583	813	16,284	金融
BYD CO LTD -A		10	343	6,876	一般消費財・サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A		71	121	2,441	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-A		237	304	6,090	資本財・サービス
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A		269	269	5,389	素材
HUANENG POWER INTL INC-A		456	280	5,612	公益事業
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A		953	495	9,918	金融
オフショア・人民元通貨計		株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	62,575.6 50 銘柄	42,890 <4.2%>	
(マレーシア)		百株	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYAN BANKING BHD		763	662	20,224	金融
PUBLIC BANK BERHAD		1,686	760	23,219	金融
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD		807	779	23,805	素材
CIMB GROUP HOLDINGS BHD		1,104	550	16,822	金融
マレーシア・リンギット通貨計		株 数 、 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	4,360 4 銘柄	2,753 <0.4%>	
(南アフリカ)		百株	千南アフリカ・ランド	千円	
GOLD FIELDS LTD		237.82	3,572	30,082	素材
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD		11.13	2,282	19,219	金融
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV		9,718.7	2,458	20,703	一般消費財・サービス
OLD MUTUAL LTD		1,535.77	1,758	14,806	金融
VODACOM GROUP LTD		153.79	2,059	17,337	コミュニケーション・サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD		154.54	3,232	27,221	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD		162.94	3,474	29,252	金融
BIDVEST GROUP LTD		89.12	1,880	15,832	資本財・サービス
BID CORP LTD		86.49	2,733	23,012	生活必需品
STANDARD BANK GROUP LTD		308.84	4,919	41,422	金融
SASOL LTD		306.1	12,345	103,950	素材
REMGRO LTD		135.67	1,790	15,073	金融
DISCOVERY LTD		130.47	1,697	14,292	金融
EXXARO RESOURCES LTD		101.92	2,033	17,122	エネルギー
KUMBA IRON ORE LTD		26.67	1,434	12,082	素材
SANLAM LTD		452.73	2,469	20,794	金融
FIRSTRAND LTD		1,179.95	7,653	64,439	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD		454.23	2,384	20,079	一般消費財・サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD		143.47	1,797	15,138	一般消費財・サービス
ABSA GROUP LTD		237	3,849	32,413	金融
NASPERS LTD-N SHS		35.59	6,192	52,142	一般消費財・サービス
MTN GROUP LTD		511.77	7,167	60,348	コミュニケーション・サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD		112.5	1,909	16,080	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT		137.42	1,909	16,079	ヘルスケア

銘 柄	株 数	2022年 6 月15日現在		業 種 等
		評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	139.52	千南アフリカ・ランド	千円	素材 一般消費財・サービス 素材
MR PRICE GROUP LTD	81.72	3,542	29,825	
SIBANYE STILLWATER LTD	798.07	1,543	12,992	
南アフリカ・ランド通貨計	17,443.94	3,293	27,732	
株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	27 銘柄	91,387	769,480	
(タイ)	百株	千タイ・パート	千円	
SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	1,653	17,769	68,413	金融
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	271	3,644	14,033	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR	503	18,057	69,522	素材
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	385	5,678	21,863	金融
KASIKORNBANK PCL-NVDR	675	9,956	38,331	金融
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	31,683	3,928	15,125	金融
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	983	5,037	19,395	素材
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	389	8,130	31,300	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	6,963	10,931	42,087	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	4,964	6,651	25,609	エネルギー
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	2,061	5,070	19,519	ヘルスケア
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	772	13,394	51,567	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	11,202	3,831	14,749	エネルギー
PTT PCL-NVDR	9,340	34,091	131,250	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	1,242	6,768	26,060	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	1,718	10,694	41,174	生活必需品
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	474	6,375	24,544	金融
LAND & HOUSES PUB - NVDR	4,672	3,901	15,019	不動産
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	3,746	9,833	37,858	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,966	9,092	35,007	素材
株 数、金 額	85,662	192,839	742,433	
銘 柄 数 < 比 率 >	20 銘柄	—	<3.7%>	
株 数、金 額	981,133.17	—	17,028,113	
銘 柄 数 < 比 率 >	402 銘柄		<83.9%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15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) 新株予約権証券

銘柄		2022年6月15日現在		
		証券数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(タイ) TMBTHANACHA-CW25		証券	千タイ・パーツ	千円
		31,683	18	71
ファンド合計		31,683	18	71
証券数、金額 銘柄数 < 比率 >		1銘柄		<0.0%>

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15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		2022年6月15日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千アメリカ・ドル	千円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M		771.6	14,452	1,951,173
合計		771.6	14,452	1,951,173
口数、金額 銘柄数 < 比率 >		1銘柄		<9.6%>

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15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。

(4) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2022年6月15日現在	
	買建額	売建額
外国	百万円	百万円
MSCI EMGMKT (アメリカ)	1,230	—

(注1) 外貨建の評価額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

運用報告書 第11期 (決算日 2021年7月5日)

(作成対象期間 2020年7月7日～2021年7月5日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

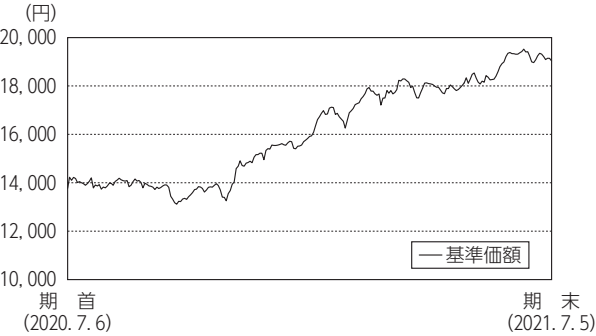
運用方針	投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	1. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式 (上場予定および店頭登録予定を含みます) 2. 新興国の企業のD R (預託証券) 3. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすE T F (上場投資信託証券)
株式組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



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

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) は、FTSE International Limited の承諾を得て、FTSE RAFI エマージング インデックス (配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE International Limited と Research Affiliates LLC に帰属します。また、FTSE International Limited は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。
(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：13,774円 期末：19,034円 騰落率：38.2%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

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

○為替相場

新興国通貨の為替相場は、対円で上昇 (円安) しました。

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

ポートフォリオ構築にあたっては、FTSE RAFI エマージング インデックスの組入比率上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、D R (預託証券) 等の組み入れを行いました。また、効率性の観点からE T F (上場投資信託証券) および株価指数先物を利用し、基準価額

とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について
当作成期のベンチマークの騰落率は38.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は38.2%となりました。
配当金に対する課税分や売買手数料・保管費用等のコスト負担が、マイナス要因となりました。
なお、組み入れている株式ポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、株価指数先物とベンチマークとの騰落率の差異、ファンドとベンチマークの為替評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。
*ベンチマークは FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) です。

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

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

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。
(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式 (2020年7月7日から2021年7月5日まで)

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

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	マレーシア	百株 2,639 (1,796)	千マレーシア・リンギット 1,586 (1)	百株 991	千マレーシア・リンギット 744
	南アフリカ	百株 3,281.3 (3.21)	千南アフリカ・ランド 28,767 (△ 63)	百株 5,065.75	千南アフリカ・ランド 33,160
国	タイ	百株 57,946 (1)	千タイ・バーツ 80,478 (△ 128)	百株 4,250	千タイ・バーツ 8,166

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 新株予約権証券

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	タイ	証券 1 (7,487)	千タイ・バーツ 1 (34)	証券 7,487 (1)	千タイ・バーツ 40 (1)

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) ()内は、割当、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 単位未満は切捨て。

(3) 投資信託証券

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

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

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	百万円 8,120	百万円 7,077	百万円 1	百万円 1

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1)株 式

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2)投資信託証券

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国株式

銘	柄	期 首		当 期		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		百株	百株	千アメリカ・ドル		千円		
(アメリカ)								
		—	10	64		7,137	コミュニケーション・サービス	
		—	52	39		4,375	一般消費財・サービス	
		337	290	181		20,212	エネルギー	
		64	—	—		—	一般消費財・サービス	
		44	28	550		61,222	コミュニケーション・サービス	
		80	56	106		11,808	一般消費財・サービス	
		28	23	99		11,014	情報技術	
		25	34	99		11,073	資本財・サービス	
		199.5	353.5	340		37,841	コミュニケーション・サービス	
		82	78	594		66,095	一般消費財・サービス	
		5	30	339		37,786	コミュニケーション・サービス	
		56	93	330		36,689	一般消費財・サービス	
		1,642.98	1,912.17	249		27,759	金融	
		45.6	72.9	227		25,331	素材	
		60.5	96.08	424		47,131	エネルギー	
		296	360.75	179		19,914	エネルギー	
		92.1	169.93	580		64,564	素材	
		249.7	206.94	295		32,894	生活必需品	
		604.95	—	—		—	公益事業	
		811	1,569.77	2,626		291,931	金融	
		12.2	24.98	561		62,449	エネルギー	
		168.3	202.88	1,890		210,185	エネルギー	
		487	912.99	698		77,699	エネルギー	
		3,272.9	3,923.39	3,041		338,083	エネルギー	
		102.7	134.6	288		32,108	素材	
		35.1	155.09	106		11,849	エネルギー	
		147	3,192	137		15,283	コミュニケーション・サービス	
		29,890	—	—		—	公益事業	
		10,160	27,261	173		19,320	公益事業	
		791.6	1,803.1	309		34,354	素材	
		362.29	566.19	131		14,644	金融	
		402.5	1,649.1	153		17,112	資本財・サービス	
アメリカ・ドル通貨計		株 数、金 額	50,554.92	45,261.36	14,824	1,647,876		
		銘 柄 数 < 比 率 >	30 銘柄	29 銘柄		<10.2%>		
(香港)								
		百株	百株	千香港・ドル		千円		
		1,410	—	—		—	資本財・サービス	
		2,770	4,600	1,849		26,462	資本財・サービス	
		400	620	706		10,114	資本財・サービス	
		760	780	1,817		26,006	一般消費財・サービス	

銘柄	柄	期 首	当	期 末	業 種 等	
		株 数	株 数	評 価		額
				外貨建金額		邦貨換算金額
		百株	百株	千香港・ドル	千円	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT		1,100	—	—	—	資本財・サービス
JIANGXI COPPER CO LTD-H		750	510	801	11,472	素材
BEIJING ENTERPRISES WATER GR		1,400	—	—	—	公益事業
CHINA GAS HOLDINGS LTD		196	492	1,163	16,650	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H		17,438	20,798	8,132	116,369	エネルギー
BEIJING ENTERPRISES HLDGS		155	—	—	—	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H		1,060	2,460	1,699	24,324	一般消費財・サービス
GOME RETAIL HOLDINGS LTD		—	3,540	350	5,015	一般消費財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H		980	—	—	—	資本財・サービス
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS		135	290	932	13,341	資本財・サービス
FOSUN INTERNATIONAL LTD		930	715	795	11,377	資本財・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD		182	215	12,351	176,753	コミュニケーション・サービス
CHINA TELECOM CORP LTD-H		6,920	—	—	—	コミュニケーション・サービス
AIR CHINA LTD-H		600	1,100	621	8,893	資本財・サービス
CHINA UNICOM HONG KONG LTD		3,320	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD		470	605	1,161	16,622	不動産
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP		1,500	2,580	670	9,599	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN		580	—	—	—	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H		12,580	20,520	7,777	111,290	エネルギー
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS		—	155	1,079	15,448	一般消費財・サービス
CNOOC LTD		5,930	—	—	—	エネルギー
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD		880	—	—	—	不動産
HUANENG POWER INTL INC-H		3,380	6,120	1,817	26,010	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H		195	355	1,444	20,675	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H		1,150	1,050	1,377	19,713	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H		38,110	47,080	28,577	408,944	金融
CHINA MOBILE LTD		2,150	—	—	—	コミュニケーション・サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD		656	1,242	1,602	22,927	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H		5,380	7,040	2,583	36,972	金融
GF SECURITIES CO LTD-H		306	500	501	7,169	金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H		284	484	541	7,743	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD		140	275	1,454	20,817	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H		2,660	4,750	2,484	35,549	金融
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H		700	760	364	5,209	資本財・サービス
HUADIAN POWER INTL CORP-H		1,420	—	—	—	公益事業
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H		1,705	2,450	3,660	52,378	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT		312	1,091.2	1,204	17,239	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H		512	1,028	2,343	33,540	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD		700	1,100	3,465	49,584	不動産
HAIER ELECTRONICS GROUP CO		260	—	—	—	その他
YANZHOU COAL MINING CO-H		1,000	1,820	1,856	26,565	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL		430	1,285	959	13,736	ヘルスケア
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT		—	220	1,016	14,544	公益事業
BYD CO LTD-H		80	50	1,106	15,826	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H		14,670	25,230	6,812	97,481	金融
CHINA RESOURCES CEMENT		—	820	594	8,507	素材
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H		—	254	276	3,961	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H		210	358	930	13,319	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H		2,120	3,900	1,014	14,510	金融
CITIC LTD		880	2,150	1,806	25,843	資本財・サービス
CHINA HONGQIAO GROUP LTD		—	1,165	1,211	17,337	素材
IND & COMM BK OF CHINA-H		30,830	54,900	24,979	357,456	金融
CHINA TOWER CORP LTD-H		5,820	16,760	1,776	25,422	コミュニケーション・サービス
XIAOMI CORP-CLASS B		916	—	—	—	情報技術
MEITUAN-CLASS B		106	52	1,580	22,621	一般消費財・サービス
SEAZEN GROUP LTD		—	1,240	908	13,006	不動産
ALIBABA GROUP HOLDING LTD		—	951	20,161	288,506	一般消費財・サービス
GUANGDONG INVESTMENT LTD		420	860	949	13,586	公益事業
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H		2,150	2,150	380	5,445	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-H		—	250	673	9,641	一般消費財・サービス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST		1,220	3,180	5,673	81,182	不動産
CRRC CORP LTD - H		1,240	—	—	—	資本財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H		3,110	—	—	—	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-H		—	4,570	776	11,117	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H		915	1,940	14,530	207,932	金融
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD		290	1,040	2,766	39,587	不動産
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H		—	585	1,172	16,784	資本財・サービス
CHINA MINSHENG BANKING COR-H		3,845.8	7,335.8	2,721	38,945	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO		2,200	2,440	2,110	30,202	不動産
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD		70	60	1,055	15,102	一般消費財・サービス
CHINA VANKE CO LTD-H		409	899	2,198	31,454	不動産
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H		1,940	2,900	522	7,469	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H		560	960	655	9,382	一般消費財・サービス
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP		55	64	1,223	17,510	一般消費財・サービス
CHINA MENGNIU DAIRY CO		—	330	1,504	21,533	生活必需品
PICC PROPERTY & CASUALTY-H		2,020	3,600	2,480	35,494	金融
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H		1,075	415	1,016	14,549	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H		440	560	937	13,414	資本財・サービス
SUNNY OPTICAL TECH		—	37	875	12,527	情報技術
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H		2,680	2,920	1,316	18,845	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H		646	882	2,125	30,417	金融

銘柄		期首		当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		百株	百株	千香港・ドル	千円			
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H		349	606	993	14,221	ヘルスケア		
CHINA LIFE INSURANCE CO-H		1,210	1,950	2,987	42,749	金融		
ENN ENERGY HOLDINGS LTD		100	132	1,958	28,031	公益事業		
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS		620	660	728	10,426	素材		
KUNLUN ENERGY CO LTD		1,400	2,020	1,442	20,639	公益事業		
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H		804	—	—	—	不動産		
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H		1,140	620	648	9,280	素材		
CHINA STATE CONSTRUCTION INT		—	1,280	670	9,598	資本財・サービス		
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H		2,300	2,680	2,420	34,630	素材		
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H		4,381	8,521	4,447	63,650	金融		
CHINA EVERGRANDE GROUP		800	1,420	1,428	20,442	不動産		
AGILE GROUP HOLDINGS LTD		520	—	—	—	不動産		
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H		—	1,980	605	8,670	金融		
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD		12,260	3,800	752	10,766	情報技術		
CHINA MERCHANTS BANK-H		915	1,010	6,534	93,511	金融		
BANK OF CHINA LTD-H		33,860	33,500	9,313	133,269	金融		
CITIC SECURITIES CO LTD-H		335	440	837	11,988	金融		
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H		1,600	2,400	698	9,994	金融		
HAITONG SECURITIES CO LTD-H		680	1,272	859	12,304	金融		
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE		—	940	686	9,819	一般消費財・サービス		
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD		300	580	2,479	35,481	不動産		
香港・ドル通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	268,387.8 90 銘柄	350,249 88 銘柄	250,487 3,584,473 <22.2%>			
(シンガポール)			百株	百株	千シンガポール・ドル	千円		
YANGZIJIANG SHIPBUILDING		887	1,427	205	16,950	資本財・サービス		
シンガポール・ドル通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	887 1 銘柄	1,427 1 銘柄	205 <0.1%>			
(台湾)			百株	百株	千台湾・ドル	千円		
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO		200	220	3,388	13,450	情報技術		
TAIWAN CEMENT		1,272.32	1,481.45	7,481	29,701	素材		
ASIA CEMENT CORP		630	—	—	—	素材		
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT		940	1,160	12,992	51,579	情報技術		
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA		420	—	—	—	金融		
WALSIN TECHNOLOGY CORP		—	90	1,899	7,539	情報技術		
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO		821.12	881.12	6,467	25,676	生活必需品		
FORMOSA PLASTICS CORP		496	806	8,463	33,598	素材		
NAN YA PLASTICS CORP		441.4	621.4	5,250	20,846	素材		
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE		433.9	593.9	5,054	20,065	素材		
CHINA STEEL CORP		976.86	3,206.86	12,490	49,589	素材		
HOTAI MOTOR COMPANY LTD		30	—	—	—	一般消費財・サービス		
LITE-ON TECHNOLOGY CORP		586.16	676.16	3,847	15,274	情報技術		
DELTA ELECTRONICS INC		470	340	10,166	40,360	情報技術		
YAGEO CORPORATION		60	80	4,448	17,659	情報技術		
WINBOND ELECTRONICS CORP		—	750	2,610	10,361	情報技術		
ACER INC		—	1,730	4,956	19,677	情報技術		
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD		300	670	4,355	17,289	情報技術		
QUANTA COMPUTER INC		850	720	6,400	25,411	情報技術		
AU OPTRONICS CORP		7,450	6,680	15,096	59,935	情報技術		
CHUNGHWA TELECOM CO LTD		884	834	9,507	37,746	コミュニケーション・サービス		
MEDIATEK INC		280.03	160.03	15,314	60,801	情報技術		
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD		230	360	6,516	25,869	情報技術		
EVA AIRWAYS CORP		—	1,690	3,405	13,519	資本財・サービス		
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD		—	1,180	3,068	12,180	金融		
FUBON FINANCIAL HOLDING CO		1,234.11	1,884.11	13,735	54,529	金融		
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO		1,548.38	1,968.38	10,609	42,121	金融		
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL		2,240	4,120	5,417	21,509	金融		
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO		1,440.27	2,065.05	5,369	21,315	金融		
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO		1,388.28	2,553.81	6,767	26,868	金融		
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT		1,589.93	1,769.93	5,761	22,872	金融		
TAISHIN FINANCIAL HOLDING		1,287.68	—	—	—	金融		
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING		4,193.34	4,243.34	4,001	15,886	金融		
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS		1,670	—	—	—	金融		
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT		2,720.28	2,470.28	5,533	21,968	金融		
FIRST FINANCIAL HOLDING CO		1,191.72	1,467.47	3,294	13,079	金融		
LARGAN PRECISION CO LTD		10	20	6,210	24,654	情報技術		
NOVATEK MICROELECTRONICS COR		110	80	3,948	15,673	情報技術		
TAIWAN MOBILE CO LTD		310	340	3,468	13,768	コミュニケーション・サービス		
WISTRON CORP		1,291.1	1,331.1	4,306	17,095	情報技術		
INNOLUX CORP		9,660	6,600	14,025	55,680	情報技術		
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD		310	—	—	—	コミュニケーション・サービス		
PEGATRON CORP		630	1,680	11,424	45,354	情報技術		
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING		150	240	2,496	9,909	情報技術		
CHALEASE HOLDING CO LTD		214.71	264.71	5,333	21,176	金融		
POWERTECH TECHNOLOGY INC		194	324	3,483	13,827	情報技術		
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP		320	360	3,960	15,721	エネルギー		
COMPAL ELECTRONICS		1,070	1,850	4,079	16,195	情報技術		
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC		2,660	2,140	125,832	499,565	情報技術		
HON HAI PRECISION INDUSTRY		3,679.02	9,169.02	102,234	405,881	情報技術		
PRESIDENT CHAIN STORE CORP		80	130	3,386	13,444	生活必需品		

銘柄	株数	当株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ASUSTEK COMPUTER INC	137.6	317.6	11,782	46,779	情報技術
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	690	—	—	—	資本財・サービス
UNITED MICROELECTRONICS CORP	4,580	2,060	10,835	43,018	情報技術
台湾・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	64,372.21 49銘柄	74,379.72 47銘柄	530,473 <13.1%>	
(トルコ)	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	百株 —	百株 —	千トルコ・リラ —	千円
IS YATIRIM MENKUL DEGERLER A	—	324.96	475	6,094	金融
TURKIYE GARANTI BANKASI	1,060.2	2,418.41	2,031	26,041	金融
AKBANK T. A. S.	1,492.72	3,342.74	1,781	22,839	金融
TURKIYE IS BANKASI-C	1,271	2,498.56	1,286	16,495	金融
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	696.6	877.6	1,408	18,056	コミュニケーション・サービス
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	90.9	199.9	1,912	24,511	エネルギー
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	868.81	842.22	1,530	19,617	素材
HACI OMER SABANCI HOLDING	803.9	1,279.23	1,169	14,988	金融
TURKIYE HALK BANKASI	1,108.3	1,108.22	549	7,046	金融
YAPI VE KREDI BANKASI	—	2,377.87	520	6,675	金融
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	961.2	—	—	—	金融
KOC HOLDING AS	399.15	807.81	1,571	20,141	資本財・サービス
TURK HAVA YOLLARI AO	567.8	1,294.89	1,779	22,807	資本財・サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	94.4	123.96	774	9,923	生活必需品
トルコ・リラ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,414.98 12銘柄	17,496.37 13銘柄	16,790 <1.3%>	
(メキシコ)	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	百株 —	百株 —	千メキシコ・ペソ —	千円
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	134	—	—	—	生活必需品
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	—	88	1,866	10,477	資本財・サービス
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	7,766	8,965	13,268	74,474	コミュニケーション・サービス
GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO	719	758	4,358	24,464	コミュニケーション・サービス
CEMEX SAB-CPO	10,067.19	8,967.19	14,768	82,898	素材
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	430	756	12,675	71,149	生活必需品
ORBITA ADVANCE CORP SAB DE CV	296.23	—	—	—	素材
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	648	574	5,441	30,543	素材
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	956	1,593	10,163	57,046	生活必需品
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	648	653	8,513	47,788	金融
メキシコ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	21,664.42 9銘柄	22,354.19 8銘柄	71,056 <2.5%>	
(チリ)	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	百株 —	百株 —	千チリ・ペソ —	千円
ENEL CHILE SA	6,997.67	—	—	—	公益事業
CENCOSUD SA	—	461.15	65,944	9,965	生活必需品
BANCO SANTANDER CHILE	21,058.8	28,986.96	102,816	15,537	金融
ENEL AMERICAS SA	8,533.63	12,217.63	133,172	20,125	公益事業
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	—	14.72	51,888	7,841	素材
FALABELLA SA	218	215.93	67,478	10,197	一般消費財・サービス
BANCO DE CHILE	12,197.92	10,345.39	73,969	11,178	金融
チリ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	49,006.02 5銘柄	52,241.78 6銘柄	495,269 <0.5%>	
(サウジアラビア)	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	百株 —	百株 —	千サウジアラビア・リアル —	千円
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	214.6	131.73	1,604	47,620	素材
SAUDI TELECOM CO	75	54.52	717	21,294	コミュニケーション・サービス
AL RAJHI BANK	174	241.62	2,725	80,892	金融
SAMBA FINANCIAL GROUP	126.2	—	—	—	金融
RIYAD BANK	163.6	—	—	—	金融
ETIHAD ETISALAT CO	120.7	176.9	574	17,063	コミュニケーション・サービス
SAVOLA	71.2	—	—	—	生活必需品
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	62.1	—	—	—	素材
ALINMA BANK	174.26	329.25	723	21,459	金融
THE SAUDI NATIONAL BANK	130.5	118.42	688	20,420	金融
SAUDI ARABIAN OIL CO	98.8	280.37	982	29,166	エネルギー
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	309.9	285.25	552	16,407	素材
SAUDI ELECTRICITY CO	—	366.17	884	26,256	公益事業
サウジアラビア・リアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,720.86 12銘柄	1,984.23 9銘柄	9,453 <1.7%>	
(インド)	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	百株 —	百株 —	千インド・ルピー —	千円
RELIANCE INDUSTRIES-PARTLY P	—	25.19	3,791	5,686	エネルギー
TATA STEEL LTD	185.4	348.72	39,614	59,421	素材
AXIS BANK LTD	233.9	431.9	32,420	48,630	金融
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	13.5	19.5	14,769	22,153	一般消費財・サービス
TATA POWER CO LTD	—	794.37	9,607	14,411	公益事業
BANK OF BARODA	—	736.29	6,273	9,409	金融
HINDUSTAN UNILEVER LTD	27.3	52.23	12,991	19,486	生活必需品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	469.4	664.96	19,812	29,718	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	554.7	782.7	33,217	49,826	金融
NTPC LTD	916	2,405.22	28,261	42,392	公益事業
POWER FINANCE CORPORATION	359.4	—	—	—	金融
JSW STEEL LTD	335.2	317.64	21,323	31,984	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	—	650.99	14,839	22,258	公益事業
INDIAN OIL CORP LTD	1,020.7	2,304.71	24,994	37,491	エネルギー

銘柄		期首	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額	価額	
		株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千インド・ルピー	千円	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD		422.05	686.05	31,746	47,620	エネルギー
VODAFONE IDEA LTD		11,058.9	—	—	—	コミュニケーション・サービス
JINDAL STEEL & POWER LTD		276.9	220.88	8,573	12,860	素材
ULTRATECH CEMENT LTD		—	10.97	7,371	11,057	素材
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE		30.5	53.46	7,282	10,923	金融
TECH MAHINDRA LTD		58.2	92.74	10,103	15,154	情報技術
YES BANK LTD		176.4	176.4	239	358	金融
TATA MOTORS LTD-A-DVR		318.2	282.02	4,399	6,599	一般消費財・サービス
REC LTD		383.6	530.6	7,664	11,496	金融
COAL INDIA LTD		725.1	1,440.5	21,268	31,903	エネルギー
INDUS TOWERS LTD		206.8	—	—	—	コミュニケーション・サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE L		217.4	622.66	16,189	24,283	金融
GAIL INDIA LTD		378.66	691.94	10,469	15,703	公益事業
HINDALCO INDUSTRIES LTD		528	640.18	24,073	36,110	素材
GRASIM INDUSTRIES LTD		106.8	136.2	20,290	30,435	素材
WIPRO LTD		204.23	160.49	8,643	12,965	情報技術
TATA CONSULTANCY SVCS LTD		84.16	108.98	36,240	54,361	情報技術
INFOSYS LTD		472.4	487.24	76,389	114,584	情報技術
LARSEN & TOUBRO LTD		55.72	135.49	20,129	30,193	資本財・サービス
TATA MOTORS LTD		1,066.8	1,103.73	38,067	57,101	一般消費財・サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE		147.9	218.9	54,193	81,289	金融
ICICI BANK LTD		—	222.99	14,276	21,415	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD		400.4	526.81	112,160	168,240	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD		1,211.25	2,380.25	28,194	42,291	エネルギー
ITC LTD		432.9	804.34	16,279	24,419	生活必需品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD		169.5	234.85	18,379	27,569	一般消費財・サービス
HERO MOTOCORP LTD		25.1	29.67	8,663	12,994	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD		211.42	290.16	15,233	22,850	コミュニケーション・サービス
UPL LTD		—	137.76	11,011	16,517	素材
SUN PHARMACEUTICAL INDUS		152.4	147.6	10,055	15,082	ヘルスケア
HCL TECHNOLOGIES LTD		151.4	162.74	16,024	24,036	情報技術
VEDANTA LTD		1,334.6	1,329.16	34,830	52,245	素材
インド・ルピー通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	25,123.19 39銘柄	23,600.18 43銘柄	950,361 <8.8%>	
(インドネシア)		百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT		2,563	4,933	2,466,500	18,992	一般消費財・サービス
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK		—	1,013	780,010	6,006	素材
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK		9,272	18,061	5,544,727	42,694	コミュニケーション・サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER		1,727	4,250	2,052,750	15,806	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT		615	1,194	3,641,700	28,041	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT		3,370	5,474	3,257,030	25,079	金融
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT		—	8,570	886,995	6,829	公益事業
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER		7,761	13,452	5,367,348	41,328	金融
ADARO ENERGY TBK PT		—	12,895	1,624,770	12,510	エネルギー
インドネシア・ルピア通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	25,308 6銘柄	69,842 9銘柄	25,621,830 <1.2%>	
(ブラジル)		百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
ULTRAPAR PARTICIPACOES RIGHTS SA		—	902.93	0	19	エネルギー
CIA PARANAENSE DE ENERGIA		6	164	92	2,025	公益事業
ENERGISA SA-UNITS		—	106	483	10,633	公益事業
RUMO SA		—	285	562	12,367	資本財・サービス
IRB BRASIL RESSEGUROS SA		146	1,765	1,009	22,181	金融
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT		36	184	578	12,718	金融
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA		268	755	2,218	48,752	一般消費財・サービス
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC		66	108	423	9,304	生活必需品
TIM SA		—	485.26	557	12,239	コミュニケーション・サービス
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR		1,300	4,438	12,950	284,528	エネルギー
BANCO BRADESCO SA-PREF		1,437.26	4,212.18	10,951	240,621	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF		1,833.36	4,857.36	14,576	320,272	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA		246	185	833	18,319	素材
VALE SA		1,035.9	948.9	10,777	236,796	素材
GERDAU SA-PREF		367	570	1,696	37,270	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS		821	3,673	11,030	242,342	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF		413.97	1,074.87	1,301	28,599	公益事業
ITAUSA SA		—	1,361	1,528	33,580	金融
BRASKEM SA-PREF A		125	261	1,566	34,406	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B		48	222	960	21,095	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.		453	1,543	4,959	108,959	金融
COSAN SA		—	644	1,573	34,567	エネルギー
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER		123	372	1,620	35,602	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB		33	792	472	10,388	公益事業
EMBRAER SA		282	712	1,349	29,644	資本財・サービス
METALURGICA GERDAU SA-PREF		753	949	1,327	29,170	素材
CCR SA		252	886	1,189	26,124	資本財・サービス
BRF SA		197	571	1,533	33,697	生活必需品
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP		68	260	949	20,867	公益事業
TIM PARTICIPACOES SA		194.26	—	—	—	その他
TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF		153	—	—	—	その他
LOJAS RENNER S. A.		50.05	197.05	854	18,785	一般消費財・サービス

銘柄	株数	当株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ブラジル・リアル	千円	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	85.84	147.84	315	6,941	一般消費財・サービス
JBS SA	429	965	2,849	62,610	生活必需品
SUZANO SA	89.45	122.45	724	15,927	素材
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	197	379	729	16,037	生活必需品
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	141	906	1,487	32,685	金融
CIELO SA	752.28	2,442.28	886	19,478	情報技術
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	90	370	905	19,884	公益事業
SUL AMERICA SA - UNITS	—	188.18	641	14,102	金融
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	32	186.54	270	5,938	公益事業
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	146	332	1,356	29,812	金融
RAIA DROGASIL SA	—	235	582	12,804	生活必需品
TELEFONICA BRASIL S. A.	10	369	1,548	34,018	コミュニケーション・サービス
KLABIN SA - UNIT	144	—	—	—	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	565	732	1,387	30,477	エネルギー
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	199	516	1,376	30,236	金融
LOJAS AMERICANAS SA	22.93	46.93	95	2,104	一般消費財・サービス
COGNA EDUCACAO	475	2,643	1,147	25,202	一般消費財・サービス
BANCO BRADESCO S. A.	382.41	1,267.65	2,786	61,218	金融
AMBEV SA	878	1,872	3,262	71,689	生活必需品
ブラジル・リアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	15,346.71 43 銘柄	47,205.42 48 銘柄	112,285 <15.3%>	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	650	737	1,532	26,315	金融
BANK OF BEIJING CO LTD -A	—	1,495	729	12,530	金融
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	682	—	—	—	資本財・サービス
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	—	175	291	5,001	金融
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	131	249	1,551	26,642	金融
IND & COMM BK OF CHINA-A	2,318	3,796	1,992	34,227	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	55	93	193	3,319	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	60	94	300	5,164	金融
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	84	29	121	2,085	一般消費財・サービス
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	4	3	603	10,371	生活必需品
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	46	80	322	5,541	素材
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	—	500	604	10,382	不動産
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	996	1,733	1,720	29,555	金融
HUADIAN POWER INTL CORP-A	404	—	—	—	公益事業
CITIC SECURITIES CO-A	110	148	350	6,011	金融
CHINA MERCHANTS BANK-A	359	388	2,058	35,351	金融
PING AN BANK CO LTD-A	378	464	1,011	17,380	金融
GF SECURITIES CO LTD-A	98	134	197	3,390	金融
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	2,175	3,940	1,824	31,330	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-A	—	101	259	4,458	一般消費財・サービス
SAIC MOTOR CORP LTD-A	379	630	1,325	22,765	一般消費財・サービス
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	238	337	124	2,135	素材
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	291	421	250	4,302	資本財・サービス
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	—	289	114	1,965	金融
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	—	132	404	6,950	資本財・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHINA-A	845	903	267	4,590	資本財・サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	621	704	361	6,214	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-A	96	68	150	2,576	素材
YANZHOU COAL MINING CO-A	49	81	119	2,049	エネルギー
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	303	306	204	3,510	金融
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	4,834	8,046	2,437	41,871	金融
BANK OF CHINA LTD-A	2,442	2,581	794	13,653	金融
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	1,704	2,089	900	15,463	エネルギー
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	1,733	3,315	1,624	27,898	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	263	398	767	13,179	エネルギー
CHINA VANKE CO LTD -A	191	344	827	14,209	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	122	153	431	7,407	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	412	487	247	4,257	金融
CHINA MINSHENG BANKING-A	1,525	3,033	1,331	22,868	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	1,551	2,530	951	16,338	金融
CRRC CORP LTD-A	552	—	—	—	資本財・サービス
CHINA UNITED NETWORK-A	913	—	—	—	コミュニケーション・サービス
CGN POWER CO LTD-A	—	189	50	866	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	90	154	239	4,112	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	123	229	261	4,491	金融
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	—	1,850	965	16,585	資本財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	268	—	—	—	資本財・サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	815	915	698	11,990	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	35	52	231	3,978	金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	603	1,174	725	12,460	金融
AIR CHINA LTD-A	148	207	157	2,709	資本財・サービス
BYD CO LTD -A	18	7	167	2,873	一般消費財・サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	44	71	93	1,599	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-A	98	98	167	2,884	資本財・サービス
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	259	130	127	2,197	素材
HUANENG POWER INTL INC-A	386	665	280	4,819	公益事業
オフショア・人民元通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	30,501 48 銘柄	46,747 51 銘柄	33,469 <3.6%>	

銘	柄	期 首	当	期 末	業 種 等	
		株 数	株 数	評 価		額
				外貨建金額		邦貨換算金額
		百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
(マレーシア)						
MISC BHD		429	—	—	—	資本財・サービス
MALAYAN BANKING BHD		675	583	472	12,649	金融
GENTING BHD		—	878	434	11,627	一般消費財・サービス
PUBLIC BANK BERHAD		349	2,617	1,075	28,775	金融
CIMB GROUP HOLDINGS BHD		691	1,360	631	16,882	金融
TENAGA NASIONAL BHD		347	497	483	12,937	公益事業
マレーシア・リンギット通貨計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,491 5 銘柄	5,935 5 銘柄	3,097	82,871 <0.5%>	
		百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
(南アフリカ)						
GOLD FIELDS LTD		154.2	241.42	3,195	24,894	素材
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD		—	15.03	2,510	19,552	金融
NEPI ROCKCASTLE PLC		75	151.07	1,540	12,001	不動産
MULTICHOICE GROUP LTD		127.3	118.08	1,395	10,870	コミュニケーション・サービス
OLD MUTUAL LTD		1,695.4	1,295.77	1,709	13,314	金融
VODACOM GROUP LTD		171.2	141.5	1,807	14,083	コミュニケーション・サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD		227.2	157.17	2,444	19,046	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD		119	139.46	2,347	18,287	金融
BIDVEST GROUP LTD		88.7	90.87	1,701	13,252	資本財・サービス
BID CORP LTD		73.1	68.49	2,139	16,670	生活必需品
NETCARE LTD		566.9	—	—	—	ヘルスケア
STANDARD BANK GROUP LTD		364.2	320.36	4,040	31,477	金融
SASOL LTD		236.4	273.1	5,977	46,563	素材
REMGRO LTD		124.1	—	—	—	金融
DISCOVERY LTD		89.4	130.47	1,603	12,491	金融
EXXARO RESOURCES LTD		80.3	—	—	—	エネルギー
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD		210.2	—	—	—	一般消費財・サービス
SANLAM LTD		427.2	530.72	3,234	25,194	金融
TIGER BRANDS LTD		66.8	—	—	—	生活必需品
FIRSTRAND LTD		889.3	1,215.28	6,445	50,213	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD		399.6	278.95	1,506	11,734	一般消費財・サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD		78.4	—	—	—	一般消費財・サービス
ABSA GROUP LTD		254.6	255.81	3,396	26,461	金融
NASPERS LTD-N SHS		17.29	26.73	7,910	61,626	一般消費財・サービス
MTN GROUP LTD		385.9	433.66	4,531	35,298	コミュニケーション・サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD		64.3	64.45	1,554	12,105	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT		132.8	119.7	1,936	15,084	ヘルスケア
ANGLOGOLD ASHANTI LTD		54.5	122.25	3,309	25,783	素材
SAPPI LIMITED		470.8	—	—	—	素材
TELKOM SA SOC LTD		350	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SPAR GROUP LIMITED/THE		77.7	—	—	—	生活必需品
MR PRICE GROUP LTD		59	79.44	1,659	12,924	一般消費財・サービス
SIBANYE STILLWATER LTD		265	344.77	2,064	16,082	素材
南アフリカ・ランド通貨計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	8,395.79 32 銘柄	6,614.55 24 銘柄	69,963	545,014 <3.4%>	
		百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
(タイ)						
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG		208	271	3,035	10,501	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR		309	458	19,602	67,824	素材
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN		227	385	4,620	15,985	金融
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR		—	1,139	3,388	11,724	一般消費財・サービス
KASIKORNBANK PCL-NVDR		116	169	2,002	6,929	金融
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR		1,068	1,641	15,876	54,933	金融
THANACHART CAPITAL PCL-NVDR		372	—	—	—	金融
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR		—	31,683	3,548	12,277	金融
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR		685	917	3,828	13,246	素材
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR		221	412	7,065	24,447	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR		2,994	6,418	6,803	23,538	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR		3,163	3,723	5,026	17,390	エネルギー
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR		—	1,520	3,556	12,306	ヘルスケア
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR		384	670	7,906	27,354	エネルギー
IRPC PCL - NVDR		8,853	11,202	4,323	14,960	エネルギー
BANGCHAK CORP PCL-NVDR		—	1,048	2,588	8,956	エネルギー
PTT PCL-NVDR		5,902	10,368	40,176	139,008	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR		706	961	5,189	17,955	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR		693	1,447	8,645	29,914	生活必需品
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR		—	539	3,355	11,609	資本財・サービス
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR		—	187	2,094	7,246	金融
LAND & HOUSES PUB - NVDR		—	3,271	2,616	9,054	不動産
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR		1,316	2,294	6,079	21,033	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR		1,214	1,404	8,424	29,147	素材
タイ・パーツ通貨計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	28,431 17 銘柄	82,127 23 銘柄	169,753	587,347 <3.6%>	
ファ ン ド 合 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	601,604.9 398 銘柄	847,464.8 404 銘柄	—	14,204,803 <88.1%>	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘 柄		期 首		当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M		651	178.6	4,156	461,983
ア メ リ カ ・ ド ル 通 貨 計	口 数、金 額	651	178.6	4,156	461,983
	銘 柄 数 < 比 率 >	1 銘柄	1 銘柄		<2.9%>
(メキシコ)		千口	千口	千メキシコ・ペソ	千円
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		80.2	—	—	—
メ キ シ コ ・ ペ ソ 通 貨 計	口 数、金 額	80.2	—	—	—
	銘 柄 数 < 比 率 >	1 銘柄			<—>
(南アフリカ)		千口	千口	千南アフリカ・ランド	千円
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		76.93	—	—	—
南 ア フ リ カ ・ ラ ン ド 通 貨 計	口 数、金 額	76.93	—	—	—
	銘 柄 数 < 比 率 >	1 銘柄			<—>
合 計		口 数、金 額	808.13	178.6	—
		銘 柄 数 < 比 率 >	3 銘柄	1 銘柄	<2.9%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

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

(注1) 外貨建の評価額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年7月5日現在

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

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝111.16円、1香港・ドル＝14.31円、1シンガポール・ドル＝82.49円、1台湾・ドル＝3.97円、1トルコ・リラ＝12.819円、1メキシコ・ペソ＝5.613円、100チリ・ペソ＝15.112円、1サウジアラビア・リアル＝29.68円、1インド・ルピー＝1.50円、100インドネシア・ルピア＝0.77円、1ブラジル・リアル＝21.971円、1オフショア・人民元＝17.174円、1マレーシア・リンギット＝26.753円、1南アフリカ・ランド＝7.79円、1タイ・バーツ＝3.46円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産 (16,010,106千円) の投資信託財産総額 (16,144,512千円) に対する比率は、99.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年7月5日現在

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

* 期首における元本額は6,697,704,657円、当作成期間中における追加設定元本額は2,563,269,417円、同解約元本額は788,417,853円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用) 30,073,026円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし) 244,455,917円、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし) 247,588,516円、D－I’s 新興国株式インデックス135,184,864円、i F r e e 新興国株式インデックス 3,368,872,878円、i F r e e 8 資産バランス2,090,080,781円、新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド (為替ヘッジなし/適格機関投資家専用) 717,072,972円、D Cダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド1,170,193,060円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式 372,572,544円、ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド96,461,663円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は19,034円です。

■損益の状況

当期 自 2020年7月7日 至 2021年7月5日

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

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

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

【注記】

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

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

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

運用報告書(全体版)

第 6 期

(決算日 2022年 6 月15日)

(作成対象期間 2021年 6 月16日～2022年 6 月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年 9 月26日）		
運用方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	日本債券インデックスマザーファンドの受益証券	
	日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		純資産総額の30%以下
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（D B I）総合指数の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<4643>

最近5期の運用実績

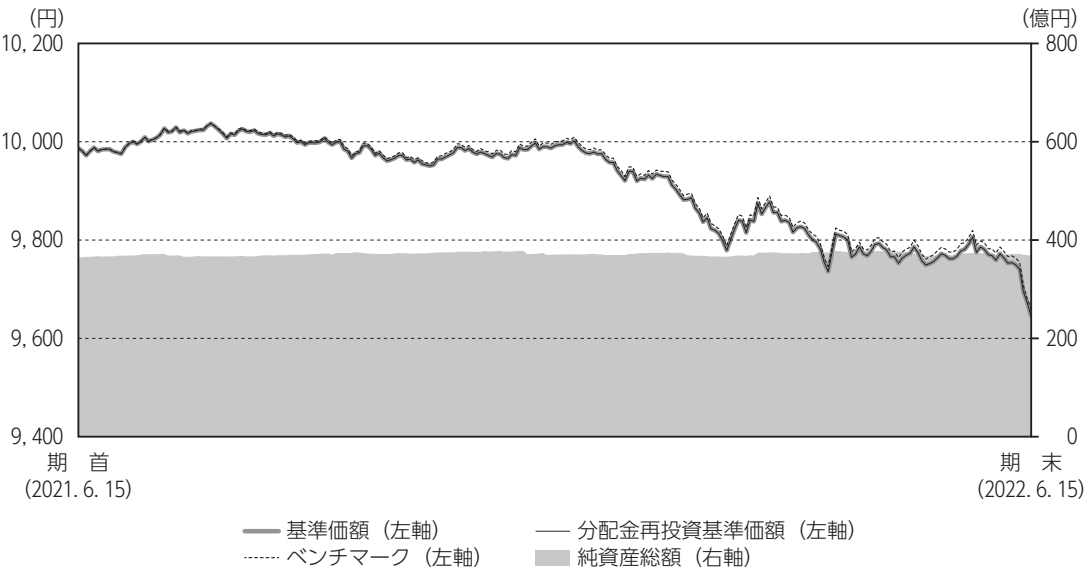
決 算 期	基 準 価 額			ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率	純資産 総 額
	（分配落）	税込み 分配金	期 中 騰落率	（ベンチマーク）	期 中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2 期末 (2018年 6 月15日)	9,915	0	0.6	525.468	0.7	99.4	—	25,120
3 期末 (2019年 6 月17日)	10,149	0	2.4	538.684	2.5	99.4	—	27,372
4 期末 (2020年 6 月15日)	10,024	0	△ 1.2	532.954	△ 1.1	99.4	—	33,339
5 期末 (2021年 6 月15日)	9,987	0	△ 0.4	532.014	△ 0.2	99.3	—	36,597
6 期末 (2022年 6 月15日)	9,645	0	△ 3.4	514.574	△ 3.3	99.4	—	36,841

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注 2) ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。
(注 3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注 4) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
(注 5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。
(注 6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

* ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数です。

■ 基準価額・騰落率

期 首：9,987円
期 末：9,645円（分配金 0 円）
騰落率：△3.4%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

「日本債券インデックスマザーファンド」の受益証券を通じて、わが国の公社債に投資した結果、投資している債券の価格が下落したことにより、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2021年 6月15日	円	%		%	%	%
	9,987	—	532.014	—	99.3	—
6月末	9,975	△ 0.1	531.421	△ 0.1	99.5	—
7月末	10,024	0.4	534.087	0.4	99.1	—
8月末	10,014	0.3	533.627	0.3	99.0	—
9月末	9,978	△ 0.1	531.730	△ 0.1	99.3	—
10月末	9,965	△ 0.2	531.186	△ 0.2	99.4	—
11月末	9,988	0.0	532.469	0.1	99.1	—
12月末	9,964	△ 0.2	531.310	△ 0.1	99.6	—
2022年 1月末	9,892	△ 1.0	527.510	△ 0.8	99.4	—
2月末	9,841	△ 1.5	524.780	△ 1.4	99.3	—
3月末	9,812	△ 1.8	523.357	△ 1.6	99.5	—
4月末	9,786	△ 2.0	522.056	△ 1.9	99.5	—
5月末	9,770	△ 2.2	521.104	△ 2.1	99.4	—
(期末) 2022年 6月15日	9,645	△ 3.4	514.574	△ 3.3	99.4	—

(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. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇（債券価格は下落）しました。

国内長期金利は、当作成期首より2021年 8月にかけて、米国金利の低下や国内での新型コロナウイルスの感染急拡大により、一時ゼロ%程度まで低下しました。その後、世界的にインフレ懸念が高まったことで0.1%程度まで上昇しましたが、11月から先進各国で金融引き締めが始まると、将来のインフレ鈍化や景気減速を織り込んで長期金利は低下しました。2022年に入ると、世界的なインフレ圧力のさらなる高まりや各国での金融引き締め加速観測を受けて長期金利は上昇し、2月には0.2%台となりました。その後は、日銀が金利上昇に歯止めをかける姿勢を示したことや、ロシアによるウクライナ侵攻などで一時0.1%台半ばまで低下しましたが、ロシアに対する経済制裁が追加的なインフレ要因となったこともあり、3月下旬には0.2%台半ばまで上昇しました。4月以降も世界的なインフレ率の上振れが金利上昇要因になる一方、日銀が長期金利を0.25%にとどめる方針を改めて示したことで、当作成期末にかけて0.2%台前半から半ばでの推移が続きました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

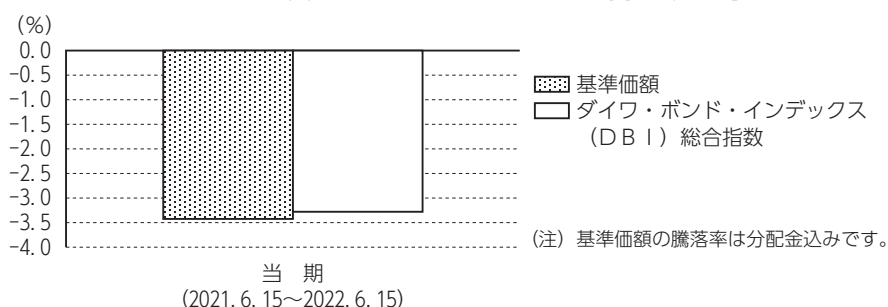
組入ファンド	ベンチマーク
日本債券インデックスマザーファンド	ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△3.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△3.4%となりました。

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差異は0.1%でした。差異の内訳は、運用管理费用等の要因によるベンチマークとの差異が0.2%程度、「日本債券インデックスマザーファンド」におけるベンチマークとの差異が0.0%程度となっており、信託報酬要因を除くと、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	267

- （注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
 （注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
 （注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

今後も、ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行います。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。

なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

1万口当りの費用の明細

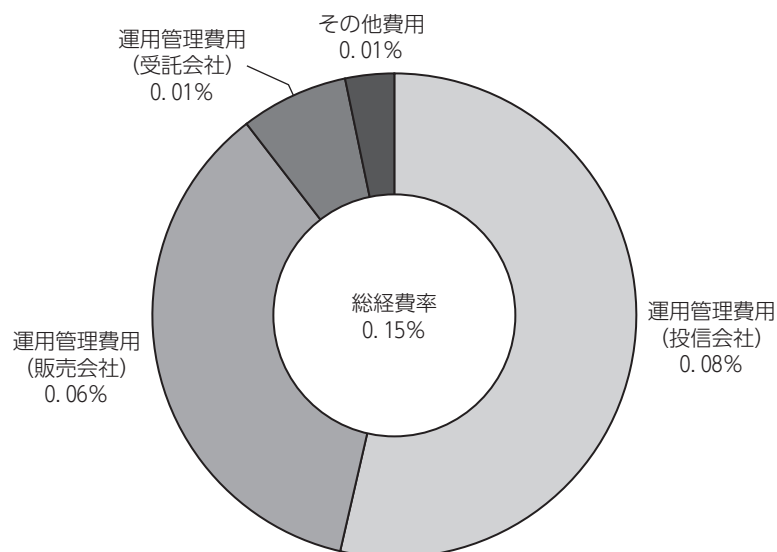
項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	15円	0. 148%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,914円です。
(投 信 会 社)	(8)	(0. 082)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(5)	(0. 055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(1)	(0. 011)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	15	0. 154	

- (注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。
- (注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。
- (注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。
- (注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.15%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。

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

(注) 単位未満は切捨て。

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

※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。

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

(注2) 単位未満は切捨て。

(注) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 日本債券インデックス）が投資対象としている「日本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 6 月15日）現在における日本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。

■日本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 6 月16日から2022年 6 月15日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
365 10年国債 0.1% 2031/12/20	1,357,117	135 5年国債 0.1% 2023/3/20	1,552,681
150 5年国債 0.005% 2026/12/20	1,248,921	134 5年国債 0.1% 2022/12/20	952,223
151 5年国債 0.005% 2027/3/20	1,139,936	136 5年国債 0.1% 2023/6/20	951,833
148 5年国債 0.005% 2026/6/20	1,105,606	415 2年国債 0.1% 2022/8/1	751,784
364 10年国債 0.1% 2031/9/20	1,093,029	421 2年国債 0.1% 2023/2/1	601,220
149 5年国債 0.005% 2026/9/20	1,044,515	133 5年国債 0.1% 2022/9/20	551,287
431 2年国債 0.005% 2023/12/1	901,055	329 10年国債 0.8% 2023/6/20	504,650
433 2年国債 0.005% 2024/2/1	900,721	424 2年国債 0.005% 2023/5/1	500,456
363 10年国債 0.1% 2031/6/20	814,552	327 10年国債 0.8% 2022/12/20	454,338
366 10年国債 0.2% 2032/3/20	797,033	425 2年国債 0.005% 2023/6/1	380,364

(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 6 月15日現在における日本債券インデックスマザーファンド（73,960,042千円）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）

区 分	2022年 6 月15日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	う ち B B 格 以 下 組 入 比	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	90,875,000	92,613,356	91.2	—	58.4	23.5	9.4
地方債証券	3,100,000	3,235,573	3.2	—	1.6	1.2	0.4
特殊債券（除く金融債券）	2,000,000	2,040,068	2.0	—	1.2	0.7	0.1
金融債券	100,000	99,471	0.1	—	—	0.1	—
普通社債券	3,000,000	3,011,147	3.0	—	1.3	1.5	0.2
合 計	99,075,000	100,999,617	99.5	—	62.5	26.9	10.1

(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 6 月15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		%	千円	千円	
	426 2年国債	0.0050	390,000	390,425	2023/07/01
	427 2年国債	0.0050	166,000	166,185	2023/08/01
	428 2年国債	0.0050	450,000	450,517	2023/09/01
	137 5年国債	0.1000	800,000	801,864	2023/09/20
	330 10年国債	0.8000	612,000	618,842	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	365,000	368,160	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	92,258	2023/09/20
	429 2年国債	0.0050	40,000	40,046	2023/10/01
	430 2年国債	0.0050	303,000	303,354	2023/11/01
	431 2年国債	0.0050	900,000	901,116	2023/12/01
	138 5年国債	0.1000	1,200,000	1,203,168	2023/12/20
	332 10年国債	0.6000	250,000	252,552	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	180,232	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	185,000	190,250	2023/12/20
	433 2年国債	0.0050	900,000	901,098	2024/02/01
	434 2年国債	0.0050	100,000	100,128	2024/03/01
	139 5年国債	0.1000	950,000	952,840	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	700,000	708,253	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	56,907	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	124,796	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	114,203	2024/03/20
	435 2年国債	0.0050	100,000	100,134	2024/04/01

2022年6月15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	
	436 2年国債	0.0050	500,000	500,700	2024/05/01
	140 5年国債	0.1000	1,120,000	1,123,606	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	900,000	911,952	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	87,110	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	130,687	2024/06/20
	141 5年国債	0.1000	1,210,000	1,214,101	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	690,000	698,597	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	105,000	110,113	2024/09/20
	142 5年国債	0.1000	1,040,000	1,043,785	2024/12/20
	336 10年国債	0.5000	275,000	278,767	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	400,000	403,468	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	126,171	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	76,938	2024/12/20
	143 5年国債	0.1000	800,000	802,976	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	580,000	586,965	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	84,716	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	53,724	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	137,304	2025/03/20
	144 5年国債	0.1000	1,090,000	1,094,098	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	590,000	597,552	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	64,538	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	53,050	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	56,393	2025/06/20
	145 5年国債	0.1000	1,250,000	1,254,687	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	760,000	770,290	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	93,006	2025/09/20
	146 5年国債	0.1000	780,000	782,870	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	500,000	505,355	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	99,876	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	1,120,000	1,119,787	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	880,000	882,974	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	62,554	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	86,883	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	59,525	2026/03/20
	148 5年国債	0.0050	1,100,000	1,099,109	2026/06/20
	343 10年国債	0.1000	780,000	782,340	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	109,115	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	84,797	2026/06/20
	149 5年国債	0.0050	780,000	778,837	2026/09/20
	344 10年国債	0.1000	780,000	781,989	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	20,000	21,838	2026/09/20
	150 5年国債	0.0050	1,250,000	1,247,175	2026/12/20
	345 10年国債	0.1000	950,000	951,919	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	310,000	338,532	2026/12/20
	151 5年国債	0.0050	1,140,000	1,136,477	2027/03/20
	346 10年国債	0.1000	780,000	781,107	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	109,154	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	142,516	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	600,000	600,294	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	55,526	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	55,000	60,529	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	550,000	549,708	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	44,386	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	320,000	353,414	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	1,300,000	1,297,855	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	100,000	110,812	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	550,000	548,427	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	155,000	173,240	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	350,000	395,188	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	97,368	2028/04/20
	351 10年国債	0.1000	1,000,000	995,530	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	170,000	191,601	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	10,000	11,151	2028/06/20
	11 フィリピン共和国	0.9900	100,000	99,872	2028/08/15
	352 10年国債	0.1000	700,000	695,884	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	140,938	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	168,712	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	930,000	923,127	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	90,000	100,960	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	300,000	332,676	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	600,000	594,408	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	55,000	61,133	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	260,000	292,455	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	690,000	682,161	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	200,000	226,870	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	150,000	169,119	2029/06/20

2022年 6月15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	
	356 10年国債	0.1000	710,000	702,147	2029/09/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	18,930	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	310,000	351,158	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	940,000	925,166	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	70,000	79,285	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	205,200	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	27,794	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	800,000	786,672	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	200,000	228,812	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	200,000	227,296	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	34,671	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	880,000	865,216	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	107,717	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	103,993	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	317,000	349,511	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	900,000	883,701	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	200,000	225,710	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	200,000	224,098	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	43,695	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	1,070,000	1,049,616	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	200,000	229,690	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	300,000	342,045	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	760,000	745,430	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	130,000	151,015	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	125,906	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	250,000	284,015	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	32,624	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	770,000	755,493	2031/06/20
	128 20年国債	1.9000	250,000	284,970	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	200,000	226,222	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	910,000	898,042	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	159,500	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	169,537	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	28,727	2031/11/20
	365 10年国債	0.1000	1,130,000	1,114,767	2031/12/20
	132 20年国債	1.7000	100,000	113,262	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	430,000	491,012	2031/12/20
	366 10年国債	0.2000	800,000	796,184	2032/03/20
	134 20年国債	1.8000	30,000	34,299	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	104,310	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	550,000	618,376	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	65,666	2032/05/20
	138 20年国債	1.5000	100,000	111,500	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	370,000	416,139	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	300,000	340,461	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	30,925	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	47,505	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	400,000	454,288	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	160,000	183,336	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	48,298	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	236,359	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	290,000	323,405	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	45,460	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	450,000	511,425	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	70,840	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	350,000	397,964	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	87,819	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	400,000	450,592	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	99,857	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	450,000	501,925	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	50,000	61,609	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	502,000	560,146	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	250,000	308,662	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	180,000	198,718	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	130,000	159,272	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	480,000	518,342	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	97,154	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	460,000	496,533	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	69,321	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	530,000	578,261	2035/06/20
	154 20年国債	1.2000	550,000	593,087	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	73,206	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	440,000	462,862	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	170,000	212,129	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	370,000	359,451	2036/03/20
	157 20年国債	0.2000	460,000	433,416	2036/06/20

2022年6月15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	
	24 30年国債	2.5000	92,000	115,193	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	350,000	342,923	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	183,796	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	240,000	237,777	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	180,000	223,322	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	360,000	360,964	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	420,000	414,292	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	188,793	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	450,000	442,876	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	340,000	333,608	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	170,000	214,342	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	500,000	482,040	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	300,000	288,453	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	249,642	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	400,000	395,664	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	400,000	382,496	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	271,777	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	320,000	300,195	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	320,000	294,278	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	300,000	366,483	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	220,000	201,632	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	500,000	456,685	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	285,000	353,397	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	100,000	92,699	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	410,000	378,811	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	280,000	333,275	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	550,000	506,467	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	400,000	373,720	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	270,000	330,577	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	380,000	353,897	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	380,000	346,620	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	250,000	297,835	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	390,000	361,717	2041/09/20
	179 20年国債	0.5000	550,000	509,256	2041/12/20
	36 30年国債	2.0000	350,000	418,092	2042/03/20
	180 20年国債	0.8000	100,000	97,830	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	450,000	528,930	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	250,000	289,352	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	230,000	270,399	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	180,000	208,170	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	210,000	238,772	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	205,000	233,142	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	260,000	295,497	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	200,000	227,354	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	250,000	274,227	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	180,000	197,416	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	370,000	413,071	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	260,000	279,362	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	120,000	128,892	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	310,000	293,864	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	270,000	226,816	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	280,000	246,173	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	250,000	224,350	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	310,000	290,770	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	260,000	243,269	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	240,000	223,994	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	230,000	214,120	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	89,980	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	400,000	371,440	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	300,000	271,338	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	210,000	198,607	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	179,704	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	136,567	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	230,000	195,801	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	300,000	247,755	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	220,000	181,238	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	200,000	164,690	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	187,479	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	200,000	164,626	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	260,000	224,702	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	290,000	250,107	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	350,000	309,858	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	180,000	224,730	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	235,000	207,657	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	260,000	229,309	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	320,000	281,987	2051/09/20

2022年 6月15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	
		73 30年国債	0.7000	363,000	319,610	2051/12/20
		5 40年国債	2.0000	185,000	221,583	2052/03/20
		74 30年国債	1.0000	259,000	245,754	2052/03/20
		6 40年国債	1.9000	105,000	123,453	2053/03/20
		7 40年国債	1.7000	121,000	136,322	2054/03/20
		8 40年国債	1.4000	230,000	241,099	2055/03/20
		9 40年国債	0.4000	220,000	170,150	2056/03/20
		10 40年国債	0.9000	275,000	249,559	2057/03/20
		11 40年国債	0.8000	320,000	280,598	2058/03/20
		12 40年国債	0.5000	380,000	298,444	2059/03/20
		13 40年国債	0.5000	360,000	281,358	2060/03/20
		14 40年国債	0.7000	430,000	358,878	2061/03/20
		15 40年国債	1.0000	500,000	457,085	2062/03/20
種 別 小 計	銘 柄 数	263銘柄				
	金 額			90,875,000	92,613,356	
地方債証券		126 共同発行地方	0.8100	100,000	100,987	2023/09/25
		25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	201,842	2023/11/22
		131 共同発行地方	0.6600	100,000	101,014	2024/02/23
		26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	101,057	2024/11/25
		26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	100,988	2025/02/26
		3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	202,595	2025/04/16
		22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	105,332	2025/11/21
		27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	101,234	2025/11/27
		751 東京都公債	0.3700	100,000	100,884	2025/12/19
		222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,621	2026/06/19
		28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,010	2027/01/29
		168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,138	2027/03/25
		420 大阪府公債	0.1700	200,000	199,693	2027/05/28
		29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,009	2027/06/23
		29-5 広島県公債	0.2450	100,000	99,955	2028/01/25
		20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	112,308	2028/05/26
		16 東京都20年	2.0100	100,000	110,806	2028/12/20
		21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	113,072	2029/06/20
		11 名古屋市20年	2.1300	100,000	112,452	2029/12/14
		9 埼玉県20年	2.1500	100,000	113,253	2030/05/24
		2-2 岡山県公債	0.1200	100,000	97,311	2031/01/29
		3-5 北海道公債	0.1400	100,000	97,498	2031/06/30
		23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	113,747	2031/08/19
		19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	111,006	2033/12/09
		16 千葉県20年	1.5550	100,000	110,876	2034/04/14
		31 神奈川県20年	1.0020	100,000	103,921	2035/12/20
		4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	119,781	2041/09/20
		4 埼玉県30年	1.3270	100,000	104,170	2045/12/20
種 別 小 計	銘 柄 数	28銘柄				
	金 額			3,100,000	3,235,573	
特殊債券（除く金融債券）		51 地方公共団体	0.8410	100,000	100,977	2023/08/28
		65 地方公共団体	0.5350	100,000	101,090	2024/10/28
		236 政保道路機構	0.3200	100,000	100,825	2025/01/31
		71 地方公共団体	0.4650	100,000	101,058	2025/04/28
		261 政保道路機構	0.3810	200,000	202,373	2025/11/28
		127 都市再生	0.0750	100,000	99,551	2026/09/18
		80 住宅支援機構	1.5890	100,000	106,000	2026/09/18
		F143地方公共団体	1.3510	100,000	105,792	2027/08/25
		1 地方公共団15年	1.3340	100,000	105,927	2028/01/28
		86 政保道路機構	2.0000	100,000	111,941	2029/07/31
		47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	104,353	2029/09/20
		123 住宅支援機構	1.8010	100,000	113,370	2032/09/17
		31 地方公共団20	1.7440	100,000	112,677	2033/09/28
		223 政保道路機構	1.4270	100,000	109,994	2034/07/31
		284 政保道路機構	0.1490	200,000	185,435	2036/07/31
		298 政保道路機構	0.5470	100,000	97,749	2036/12/26
		247 道路機構	0.3420	200,000	180,947	2040/03/19
種 別 小 計	銘 柄 数	17銘柄				
	金 額			2,000,000	2,040,068	
金融債券		19 利付商工債	0.1000	100,000	99,471	2026/09/18
種 別 小 計	銘 柄 数	1銘柄				
	金 額			100,000	99,471	
普通社債券		175 オリックス	1.0640	100,000	101,319	2023/11/24
		21 西日本高速道	0.7540	100,000	101,045	2023/12/20
		1 三菱 UFJFG 劣後	0.9400	100,000	100,901	2024/06/26
		482 九州電力	0.1700	100,000	99,920	2024/08/23

2022年6月15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	
	5 野村不動産 HD	0.9240	100,000	101,879	2025/05/30
	11日本たばこ産業	0.5990	100,000	101,389	2025/07/15
	63 中日本高速道	0.5760	100,000	101,495	2025/11/13
	4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	101,785	2025/12/18
	14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	99,846	2025/12/19
	16 NTT ファイナンス	0.1800	100,000	99,707	2025/12/19
	1 日生2021基金	0.2800	100,000	99,363	2026/08/03
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,644	2026/08/21
	17 パナソニック	0.4700	100,000	100,540	2026/09/18
	7 三井住友海上	0.1900	100,000	99,291	2026/11/13
	6 楽天カード	0.6200	100,000	98,264	2026/12/17
	509 関西電力	0.4700	100,000	99,804	2027/05/25
	12 アサヒグループ HD	0.3300	100,000	99,909	2027/06/11
	15 デンソー	0.2450	100,000	99,580	2027/06/18
	78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	99,623	2027/07/23
	11 東京電力パワー	0.7900	100,000	100,016	2028/01/25
	20 ZHD	0.4600	100,000	98,102	2028/07/28
	15 ソフトバンク	0.4100	100,000	97,689	2028/10/12
	41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	110,908	2029/01/29
	13 NTT ファイナンス	1.0900	100,000	103,896	2029/09/20
	7 凸版印刷	1.1040	100,000	103,826	2029/12/12
	65 東京瓦斯	0.2250	100,000	96,986	2030/09/10
	18 楽天グループ	1.0500	100,000	96,399	2031/12/02
	332 北海道電力	0.9070	100,000	97,937	2036/04/25
	23 森ビル	0.9700	100,000	95,962	2038/05/17
	107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	104,109	2045/01/27
種 別 小 計	銘 柄 数	30銘柄			
	金 額		3,000,000	3,011,147	
合 計	銘 柄 数	339銘柄			
	金 額		99,075,000	100,999,617	

(注) 単位未満は切捨て。

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第22期（決算日 2021年11月30日）

（作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日）

日本債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	わが国の公社債
株式組入制限	純資産総額の30%以下

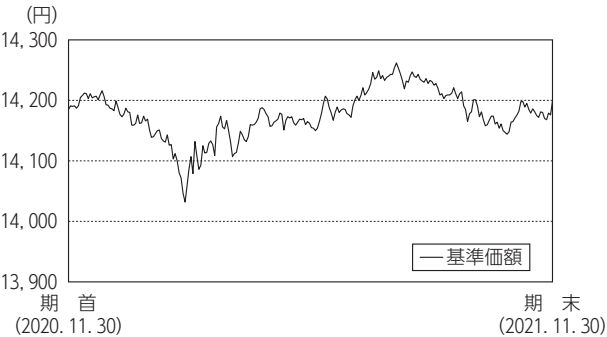
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



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

（注1）騰落率は期首比。
（注2）ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。
（注3）指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
（注4）公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。
（注5）債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：14,185円 期末：14,199円 騰落率：0.1%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内債券市場

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

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

*ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数です。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債券(転換社債券)は含まれておりません。

(注4) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

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

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

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

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

区 分	当 期		末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
国債証券	134 5年国債	0.1000	950,000	952,251	2022/12/20
	326 10年国債	0.7000	30,000	30,258	2022/12/20
	327 10年国債	0.8000	450,000	454,360	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	45,862	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,160	2022/12/20
	421 2年国債	0.1000	600,000	601,614	2023/02/01
	135 5年国債	0.1000	1,550,000	1,554,526	2023/03/20
	328 10年国債	0.6000	350,000	353,300	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	101,463	2023/03/20
	423 2年国債	0.0050	100,000	100,180	2023/04/01
	424 2年国債	0.0050	500,000	500,955	2023/05/01
	425 2年国債	0.0050	380,000	380,767	2023/06/01
	136 5年国債	0.1000	950,000	953,391	2023/06/20
	329 10年国債	0.8000	500,000	507,185	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	96,365	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	133,887	2023/06/20
	426 2年国債	0.0050	390,000	390,830	2023/07/01
	427 2年国債	0.0050	166,000	166,373	2023/08/01
	137 5年国債	0.1000	800,000	803,392	2023/09/20
	330 10年国債	0.8000	612,000	622,281	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	365,000	369,814	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	93,301	2023/09/20
	429 2年国債	0.0050	40,000	40,099	2023/10/01
	138 5年国債	0.1000	1,200,000	1,205,676	2023/12/20
	332 10年国債	0.6000	250,000	253,727	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	182,290	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	185,000	192,326	2023/12/20
	139 5年国債	0.1000	900,000	904,770	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	700,000	711,697	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	57,560	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	126,416	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	115,628	2024/03/20
	140 5年国債	0.1000	700,000	704,025	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	900,000	916,695	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	88,362	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	132,436	2024/06/20
	141 5年国債	0.1000	1,120,000	1,127,078	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	690,000	702,123	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	105,000	111,555	2024/09/20
	142 5年国債	0.1000	850,000	855,856	2024/12/20
	336 10年国債	0.5000	275,000	280,263	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	400,000	405,208	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	127,792	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	77,964	2024/12/20
	143 5年国債	0.1000	700,000	705,215	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	580,000	589,987	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	85,881	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	54,411	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	139,126	2025/03/20
	144 5年国債	0.1000	890,000	896,977	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	590,000	600,938	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	65,381	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	53,770	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	57,185	2025/06/20
	145 5年国債	0.1000	1,100,000	1,109,031	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	760,000	775,093	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	94,341	2025/09/20
	146 5年国債	0.1000	480,000	484,099	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	500,000	508,445	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	101,365	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	840,000	843,981	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	880,000	887,981	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	63,536	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	88,326	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	60,487	2026/03/20
	148 5年国債	0.0050	1,000,000	1,005,020	2026/06/20
	343 10年国債	0.1000	780,000	787,488	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	110,996	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	86,220	2026/06/20
	149 5年国債	0.0050	220,000	221,060	2026/09/20
	344 10年国債	0.1000	780,000	787,527	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	20,000	22,219	2026/09/20
	345 10年国債	0.1000	900,000	909,135	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	310,000	344,627	2026/12/20

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率 %	額 面 金 額 千円	末	
				評 価 額 千円	償還年月日
	346 10年国債	0.1000	780,000	788,307	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	111,186	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	145,234	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	600,000	606,528	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	56,682	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	55,000	61,736	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	550,000	556,253	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	45,343	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	320,000	360,876	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	1,050,000	1,062,453	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	100,000	113,326	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	500,000	506,015	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	155,000	177,426	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	350,000	405,076	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	99,550	2028/04/20
	351 10年国債	0.1000	800,000	809,744	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	170,000	196,642	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	10,000	11,435	2028/06/20
	11 フィリピン共和国	0.9900	100,000	101,955	2028/08/15
	352 10年国債	0.1000	700,000	708,855	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	144,787	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	173,392	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	580,000	587,609	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	90,000	103,914	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	300,000	342,126	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	600,000	607,926	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	55,000	62,971	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	260,000	301,498	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	690,000	699,163	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	200,000	234,462	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	150,000	174,708	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	510,000	516,599	2029/09/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	19,579	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	310,000	362,634	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	620,000	627,768	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	70,000	82,200	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	212,828	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	28,854	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	660,000	667,966	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	200,000	237,400	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	200,000	235,734	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	35,947	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	930,000	940,360	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	111,531	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	107,588	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	317,000	361,294	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	900,000	909,117	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	200,000	233,758	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	200,000	231,996	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	45,364	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	633,000	638,437	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	200,000	237,910	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	300,000	354,150	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	710,000	715,268	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	130,000	156,302	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	130,214	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	250,000	293,620	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	33,734	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	700,000	703,990	2031/06/20
	128 20年国債	1.9000	250,000	294,380	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	200,000	233,600	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	520,000	522,277	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	163,899	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	174,142	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	29,580	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	40,000	46,531	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	430,000	504,506	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	30,000	35,288	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	107,278	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	300,000	346,755	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	67,672	2032/05/20
	138 20年国債	1.5000	100,000	114,796	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	370,000	428,615	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	300,000	351,486	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	31,965	2032/11/22

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	末	
				評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	9 30年国債	1.4000	43,000	49,056	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	200,000	234,850	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	240,000	284,443	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	49,915	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	244,782	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	240,000	277,072	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	47,173	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	420,000	495,318	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	73,740	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	350,000	413,633	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	91,533	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	320,000	375,148	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	104,279	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	530,000	616,029	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	50,000	64,395	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	402,000	467,988	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	250,000	323,187	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	180,000	207,610	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	130,000	166,909	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	400,000	451,740	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	102,026	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	460,000	520,260	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	72,888	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	430,000	492,401	2035/06/20
	154 20年国債	1.2000	550,000	623,034	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	77,168	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	350,000	387,208	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	170,000	223,884	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	270,000	275,969	2036/03/20
	157 20年国債	0.2000	360,000	357,220	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	121,895	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	350,000	362,229	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	194,889	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	170,000	178,243	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	180,000	237,198	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	360,000	382,741	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	320,000	335,008	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	200,848	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	350,000	366,117	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	340,000	355,347	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	170,000	228,825	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	500,000	514,340	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	300,000	308,244	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	267,398	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	350,000	370,615	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	300,000	307,488	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	291,638	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	320,000	322,083	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	320,000	316,044	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	300,000	394,329	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	220,000	216,882	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	300,000	295,197	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	285,000	380,899	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	100,000	100,000	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	410,000	409,290	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	280,000	360,231	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	420,000	418,534	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	400,000	405,284	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	270,000	358,030	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	340,000	343,933	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	365,000	362,043	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	250,000	323,395	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	150,000	151,363	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	310,000	402,364	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	350,000	448,668	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	250,000	316,517	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	230,000	296,389	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	180,000	228,472	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	170,000	212,629	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	205,000	256,668	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	200,000	250,668	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	200,000	250,922	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	200,000	242,592	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	140,000	169,923	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	400,000	494,788	2045/06/20

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	
	48 30年国債	1.4000	160,000	190,832	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	120,000	143,187	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	260,000	274,814	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	240,000	226,044	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	260,000	256,321	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	250,000	251,920	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	310,000	326,485	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	260,000	273,639	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	170,000	178,593	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	230,000	241,451	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	100,678	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	350,000	367,150	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	300,000	306,870	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	210,000	224,544	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	203,706	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	153,078	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	230,000	222,258	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	230,000	216,057	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	220,000	206,078	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	200,000	187,026	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	209,835	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	200,000	186,930	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	230,000	226,412	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	290,000	285,441	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	259,000	261,843	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	180,000	253,659	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	235,000	237,307	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	240,000	242,373	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	140,000	141,218	2051/09/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	141,153	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	156,797	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	279,128	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	200,910	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	275,000	293,053	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	330,697	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	380,000	354,897	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	430,000	400,394	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	300,000	298,161	2061/03/20
種 別 小 計	銘 柄 数	262銘柄			
	金 額		79,992,000	85,097,080	
地方債証券	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	100,888	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	100,639	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	101,485	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	202,723	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	101,460	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	101,504	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	101,447	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	203,686	2025/04/16
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	106,623	2025/11/21
	27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	101,874	2025/11/27
	751 東京都公債	0.3700	100,000	101,482	2025/12/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	100,259	2026/06/19
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,916	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	101,119	2027/03/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	201,625	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	101,039	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	101,351	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	115,199	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	113,930	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	116,763	2029/06/20
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	116,484	2029/12/14
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	117,498	2030/05/24
	2-2 岡山県公債	0.1200	100,000	100,154	2031/01/29
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	100,139	2031/06/30
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	117,121	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	115,382	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	115,827	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	109,600	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	130,694	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	115,929	2045/12/20
種 別 小 計	銘 柄 数	30銘柄			
	金 額		3,300,000	3,514,853	

当		期	末		
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
特殊債券（除く金融債券）	25 政保日本政策	0.8150	100,000	101,061	2023/02/24
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	100,916	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	100,927	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	101,190	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	100,960	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	101,467	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	101,524	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,108	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	101,547	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	203,284	2025/11/28
	127 都市再生	0.0750	100,000	100,191	2026/09/18
	80 住宅支援機構	1.5890	100,000	107,467	2026/09/18
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	107,540	2027/08/25
	1 地方公共団15年	1.3340	100,000	107,919	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	115,190	2029/07/31
	47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	107,254	2029/09/20
	123 住宅支援機構	1.8010	100,000	116,970	2032/09/17
	31 地方公共団20	1.7440	100,000	117,162	2033/09/28
	223 政保道路機構	1.4270	100,000	114,844	2034/07/31
	284 政保道路機構	0.1490	200,000	195,373	2036/07/31
	298 政保道路機構	0.5470	100,000	103,238	2036/12/26
	247 道路機構	0.3420	200,000	195,749	2040/03/19
種 別 小 計	銘 柄 数	22銘柄			
	金 額		2,500,000	2,602,888	
金融債券	19 利付商工債	0.1000	100,000	100,201	2026/09/18
種 別 小 計	銘 柄 数	1銘柄			
	金 額		100,000	100,201	
普通社債券	175 オリックス	1.0640	100,000	101,961	2023/11/24
	21 西日本高速道	0.7540	100,000	101,538	2023/12/20
	1 三菱 UFJFG 劣後	0.9400	100,000	101,659	2024/06/26
	482 九州電力	0.1700	100,000	100,233	2024/08/23
	5 野村不動産 HD	0.9240	100,000	102,551	2025/05/30
	11日本たばこ産業	0.5990	100,000	101,889	2025/07/15
	63 中日本高速道	0.5760	100,000	102,163	2025/11/13
	4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	102,699	2025/12/18
	14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	100,443	2025/12/19
	16 NTT ファイナンス	0.1800	100,000	100,241	2025/12/19
	1 日生2021基金	0.2800	100,000	100,018	2026/08/03
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	100,249	2026/08/21
	17 パナソニック	0.4700	100,000	101,500	2026/09/18
	7 三井住友海上	0.1900	100,000	100,049	2026/11/13
	509 関西電力	0.4700	100,000	101,460	2027/05/25
	12 アサヒグループ HD	0.3300	100,000	101,050	2027/06/11
	15 デンソー	0.2450	100,000	100,656	2027/06/18
	78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	100,754	2027/07/23
	11 東京電力パワー	0.7900	100,000	102,792	2028/01/25
	20 ZHD	0.4600	100,000	99,967	2028/07/28
	15 ソフトバンク	0.4100	100,000	99,989	2028/10/12
	41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	114,360	2029/01/29
	13 NTT ファイナンス	1.0900	100,000	106,692	2029/09/20
	7 凸版印刷	1.1040	100,000	106,876	2029/12/12
	65 東京瓦斯	0.2250	100,000	100,444	2030/09/10
	18 楽天グループ	1.0500	100,000	100,138	2031/12/02
	332 北海道電力	0.9070	100,000	104,791	2036/04/25
	23 森ビル	0.9700	100,000	102,592	2038/05/17
	107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	116,343	2045/01/27
種 別 小 計	銘 柄 数	29銘柄			
	金 額		2,900,000	2,976,109	
合 計	銘 柄 数	344銘柄			
	金 額		88,792,000	94,291,133	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	94,291,133	99.0
コール・ローン等、その他	905,947	1.0
投資信託財産総額	95,197,080	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

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

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

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

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

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,199円です。

■損益の状況

当期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日

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

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

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

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)

運用報告書(全体版) 第 6 期

(決算日 2022年 6 月15日)
(作成対象期間 2021年 6 月16日～2022年 6 月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年 9月26日）		
運用方針	投資成果をFTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの受益証券	
	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	外国の公社債	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		純資産総額の10%以下
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、外国の公社債に投資し、投資成果を FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざしております。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/>

<2734>

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2 期末 (2018年 6 月15日)	9,475	0	△ 2.4	9,567	△ 1.9	95.4	2.1	61,154
3 期末 (2019年 6 月17日)	9,905	0	4.5	10,050	5.1	97.3	1.4	72,847
4 期末 (2020年 6 月15日)	10,451	0	5.5	10,666	6.1	97.5	—	87,728
5 期末 (2021年 6 月15日)	10,198	0	△ 2.4	10,462	△ 1.9	98.5	—	98,409
6 期末 (2022年 6 月15日)	8,787	0	△ 13.8	9,048	△ 13.5	101.6	0.2	97,518

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注 2) FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営されている債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。

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

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

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

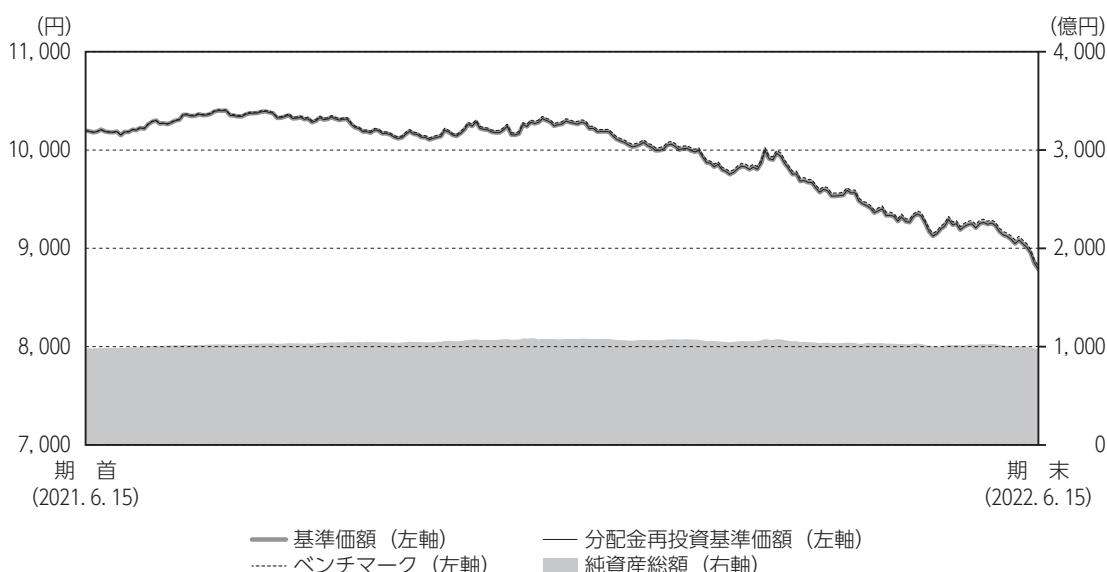
(注 6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注 7) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

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

■ 基準価額・騰落率

期 首：10,198円

期 末：8,787円（分配金 0円）

騰落率：△13.8%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」を通じて日本を除く先進国国債に投資した結果、各国の金利が上昇（債券価格の下落）したため、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%		%	%	%
(期首) 2021年 6 月15日	10,198	—	10,462	—	98.5	—
6 月末	10,183	△ 0.1	10,450	△ 0.1	97.5	—
7 月末	10,357	1.6	10,632	1.6	96.3	—
8 月末	10,355	1.5	10,635	1.7	97.7	—
9 月末	10,188	△ 0.1	10,468	0.1	98.4	—
10 月末	10,181	△ 0.2	10,461	△ 0.0	98.8	2.2
11 月末	10,240	0.4	10,528	0.6	96.8	—
12 月末	10,145	△ 0.5	10,433	△ 0.3	99.6	—
2022年 1 月末	10,017	△ 1.8	10,305	△ 1.5	97.0	0.4
2 月末	9,804	△ 3.9	10,087	△ 3.6	97.7	0.4
3 月末	9,541	△ 6.4	9,819	△ 6.1	102.9	1.4
4 月末	9,329	△ 8.5	9,605	△ 8.2	101.0	—
5 月末	9,233	△ 9.5	9,504	△ 9.2	97.3	0.5
(期末) 2022年 6 月15日	8,787	△ 13.8	9,048	△ 13.5	101.6	0.2

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■海外債券市況

主要国の国債金利は、上昇しました。

当作成期首より、主要国の国債金利は、米国など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低下しましたが、2021年9月に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、上昇に転じました。2022年に入ってから、ロシアがウクライナに侵攻したことで原油価格が高騰し、インフレ期待が上昇したことで、金利上昇が加速しました。その後も、インフレ率の上振れなどから各国で金融政策正常化が意識され、主要国の金利は上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに金利は上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

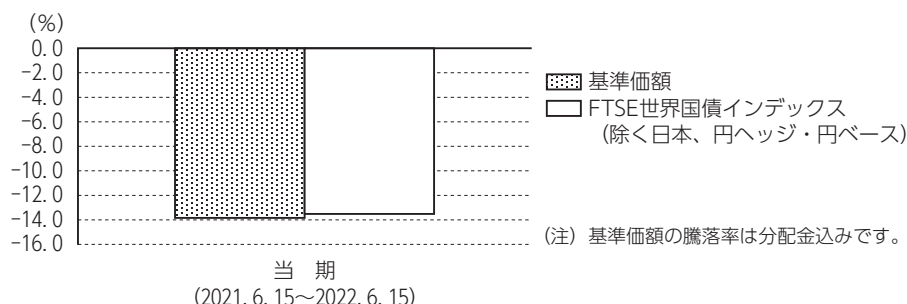
組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△13.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△13.8%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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 6 月16日 ～2022年 6 月15日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	858

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	42円	0.418%	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9,954円です。
(投 信 会 社)	(28)	(0.286)	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)	(11)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0.000	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.011	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.008)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	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)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	43	0.429	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

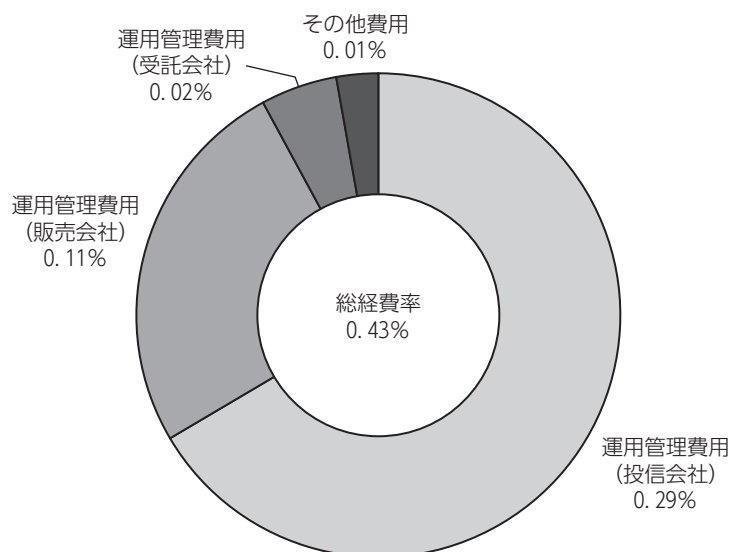
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.43%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6月16日から2022年6月15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 (為替ヘッジあり) マザーファンド	20,868,494	21,287,035	7,123,848	7,184,274

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	94,364,692	108,109,338	97,222,728

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	97,222,728	99.4
コール・ローン等、その他	571,868	0.6
投資信託財産総額	97,794,596	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝135.01円、1カナダ・ドル＝104.20円、1オーストラリア・ドル＝93.10円、1シンガポール・ドル＝96.95円、1イギリス・ポンド＝162.21円、1イスラエル・シェケル＝38.942円、1デンマーク・クローネ＝18.93円、1ノルウェー・クローネ＝13.49円、1スウェーデン・クローネ＝13.25円、1メキシコ・ペソ＝6.565円、1オフショア・人民元＝20.014円、1マレーシア・リンギット＝30.536円、1南アフリカ・ランド＝8.42円、1ポーランド・ズロチ＝30.093円、1ユーロ＝140.80円です。

(注3) 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（123,970,109千円）の投資信託財産総額（124,495,550千円）に対する比率は、99.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	97,794,596,870円
コール・ローン等	552,806,888
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド（評価額）	97,222,728,050
未収入金	19,061,932
(B) 負債	276,593,585
未払解約金	57,641,186
未払信託報酬	217,840,098
その他未払費用	1,112,301
(C) 純資産総額（A－B）	97,518,003,285
元本	110,985,788,072
次期繰越損益金	△ 13,467,784,787
(D) 受益権総口数	110,985,788,072口
1万口当り基準価額（C／D）	8,787円

* 期首における元本額は96,502,550,747円、当作成期間中における追加設定元本額は32,610,525,682円、同解約元本額は18,127,288,357円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は8,787円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は13,467,784,787円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 110,261円
受取利息	11,701
支払利息	△ 121,962
(B) 有価証券売買損益	△ 14,516,838,164
売買益	542,156,108
売買損	△ 15,058,994,272
(C) 信託報酬等	△ 437,355,074
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 14,954,303,499
(E) 前期繰越損益金	1,984,050,744
(F) 追加信託差損益金	△ 497,532,032
（配当等相当額）	(5,674,879,117)
（売買損益相当額）	(△ 6,172,411,149)
(G) 合計（D＋E＋F）	△ 13,467,784,787
次期繰越損益金（G）	△ 13,467,784,787
追加信託差損益金	△ 497,532,032
（配当等相当額）	(5,674,879,117)
（売買損益相当額）	(△ 6,172,411,149)
分配準備積立金	3,855,821,932
繰越損益金	△ 16,826,074,687

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	5,674,879,117
(d) 分配準備積立金	3,855,821,932
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	9,530,701,049
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	9,530,701,049
(h) 受益権総口数	110,985,788,072口

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

運用報告書 第6期（決算日 2022年6月15日）

（作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	外国の公社債
株式組入制限	純資産総額の10%以下

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		FTSE 世界 国 債 インデックス (除く日本、円 ヘッジ・円ベース)		公 社 債 入 金 率	
	円	騰落率 (ベンチマーク)	円	騰落率	比 率	先 比 率
(期首)2021年6月15日	10,398	—	10,462	—	98.8	—
6月末	10,385	△ 0.1	10,450	△ 0.1	97.8	—
7月末	10,566	1.6	10,632	1.6	96.6	—
8月末	10,568	1.6	10,635	1.7	98.0	—
9月末	10,401	0.0	10,468	0.1	98.7	—
10月末	10,397	△ 0.0	10,461	△ 0.0	99.1	2.2
11月末	10,462	0.6	10,528	0.6	97.1	—
12月末	10,368	△ 0.3	10,433	△ 0.3	99.9	—
2022年1月末	10,240	△ 1.5	10,305	△ 1.5	97.2	0.4
2月末	10,025	△ 3.6	10,087	△ 3.6	98.0	0.4
3月末	9,759	△ 6.1	9,819	△ 6.1	103.2	1.4
4月末	9,545	△ 8.2	9,605	△ 8.2	101.3	—
5月末	9,450	△ 9.1	9,504	△ 9.2	97.6	0.5
(期末)2022年6月15日	8,993	△13.5	9,048	△13.5	101.9	0.2

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。
(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

- ◆基準価額等の推移について
【基準価額・騰落率】
期首：10,398円 期末：8,993円 騰落率：△13.5%
【基準価額の主な変動要因】
日本を除く先進国国債に投資した結果、各国の金利が上昇（債券価格の下落）したため、基準価額は下落しました。
- ◆投資環境について
○海外債券市況
主要国の国債金利は、上昇しました。
当作成期首より、主要国の国債金利は、米国など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低下しましたが、2021年9月にFRB（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、上昇に転じました。2022年に入ってから、ロシアがウクライナに侵攻したことで原油価格が高騰し、インフレ期待が上昇したことで、金利上昇が加速しました。その後も、インフレ率の上振れなどから各国で金融政策正常化が意識され、主要国の金利は上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに金利は上昇しました。
- ◆前作成期末における「今後の運用方針」
外貨建資産については為替ヘッジを行い、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。
- ◆ポートフォリオについて
外貨建資産については為替ヘッジを行い、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。
- ◆ベンチマークとの差異について
当作成期のベンチマークの騰落率は△13.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△13.5%となりました。
当作成期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.1%程度でした。
※ベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）です。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。
(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

181

■売買および取引の状況
(1) 公 社 債

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 211, 180	千アメリカ・ドル 148, 074 (—)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 7, 549	千カナダ・ドル 5, 916 (—)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 1, 269	千オーストラリア・ドル 5, 764 (—)
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1, 237	千シンガポール・ドル 1, 024 (—)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 11, 119	千イギリス・ポンド 13, 115 (—)
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 2, 574	千イスラエル・シケル 3, 603 (—)
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 4, 851	千デンマーク・クローネ 5, 617 (—)
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 7, 237	千ノルウェー・クローネ 1, 612 (—)
国	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローネ 2, 569	千スウェーデン・クローネ 7, 192 (—)
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 27, 964	千メキシコ・ペソ 16, 065 (—)
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 133, 144	千オフショア・人民元 5, 531 (—)
国	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 4, 569	千マレーシア・リンギット 1, 120 (—)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 3, 346	千ポーランド・ズロチ 4, 236 (—)

			買 付 額	売 付 額
外 国	ユーロ (アイルランド)	国債証券	千ユーロ 782	千ユーロ 1, 047 (—)
	ユーロ (オランダ)	国債証券	千ユーロ 4, 038	千ユーロ 2, 589 (—)
	ユーロ (ベルギー)	国債証券	千ユーロ 3, 985	千ユーロ 3, 165 (—)
	ユーロ (フランス)	国債証券	千ユーロ 21, 144	千ユーロ 16, 945 (—)
	ユーロ (ドイツ)	国債証券	千ユーロ 16, 619	千ユーロ 14, 217 (—)
	ユーロ (スペイン)	国債証券	千ユーロ 13, 500	千ユーロ 10, 554 (—)
	ユーロ (イタリア)	国債証券	千ユーロ 20, 956	千ユーロ 17, 688 (—)
	ユーロ (フィンランド)	国債証券	千ユーロ 1, 172	千ユーロ 1, 480 (—)
国	ユーロ (オーストリア)	国債証券	千ユーロ 3, 269	千ユーロ 2, 832 (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	国債証券	千ユーロ 85, 469	千ユーロ 70, 521 (—)

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。
(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	債券先物取引	百万円 9, 290	百万円 9, 089	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
公 社 債

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

当 期			期		
買 付		金 額	売 付		金 額
銘 柄			銘 柄		
千円			千円		
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2023/5/15		4, 104, 317	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2023/5/15		6, 491, 804
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2023/11/15		1, 704, 658	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2022/11/15		3, 962, 372
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.875% 2028/8/15		1, 480, 220	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/9/30		2, 893, 065
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2029/2/15		1, 130, 062	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2023/2/15		1, 291, 607
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2026/11/15		1, 070, 131	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 1.75% 2023/5/25		661, 054
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2024/5/15		944, 969	SPANISH GOVERNMENT BOND (スペイン) 5.4% 2023/1/31		549, 284
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.25% 2031/8/15		855, 174	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2026/5/15		487, 393
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.375% 2023/9/30		793, 513	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (イタリア) 5.5% 2022/11/1		436, 393
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.375% 2031/11/15		753, 902	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (イタリア) 4.75% 2023/8/1		434, 658
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2025/11/15		719, 534	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.375% 2049/11/15		362, 153

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

■組入資産明細表

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	当 期		未		残存期間別組入比率		
		評 価 額		組入比率	うちB B 格 以下組入 比 率	5 年以上	2 年以上	2 年未満
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額					
アメリカ	千アメリカ・ドル 500, 462	千アメリカ・ドル 460, 256	千円 62, 139, 230	% 51.7	% —	% 24.0	% 18.0	% 9.8
カナダ	千カナダ・ドル 26, 257	千カナダ・ドル 24, 111	2, 512, 414	2.1	—	1.1	0.5	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 22, 874	千オーストラリア・ドル 20, 474	1, 906, 160	1.6	—	1.1	0.4	0.1

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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
シンガポール	千シンガポール・ドル 6, 122	千シンガポール・ドル 5, 875	千円 569, 604	% 0. 5	% —	% 0. 3	% 0. 1	% 0. 1
イギリス	千イギリス・ポンド 37, 977	千イギリス・ポンド 38, 197	6, 195, 990	5. 2	—	4. 0	0. 7	0. 4
イスラエル	千イスラエル・シケル 11, 250	千イスラエル・シケル 11, 897	424, 355	0. 4	—	0. 2	0. 1	0. 1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 25, 540	千デンマーク・クローネ 25, 680	486, 130	0. 4	—	0. 3	0. 1	0. 0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 21, 380	千ノルウェー・クローネ 20, 125	271, 486	0. 2	—	0. 1	0. 0	0. 1
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 25, 320	千スウェーデン・クローネ 24, 686	327, 093	0. 3	—	0. 1	0. 1	0. 0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 158, 730	千メキシコ・ペソ 146, 498	961, 839	0. 8	—	0. 4	0. 4	0. 0
中国	千オフショア・人民元 124, 500	千オフショア・人民元 127, 855	2, 558, 941	2. 1	—	1. 0	0. 8	0. 3
マレーシア	千マレーシア・リンギット 23, 280	千マレーシア・リンギット 22, 570	689, 224	0. 6	—	0. 3	0. 2	0. 0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 22, 395	千ポーランド・ズロチ 18, 173	546, 920	0. 5	—	0. 2	0. 2	0. 1
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 6, 218	千ユーロ 5, 885	828, 708	0. 7	—	0. 5	0. 1	0. 0
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 15, 320	千ユーロ 15, 155	2, 133, 921	1. 8	—	1. 3	0. 4	0. 1
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 18, 354	千ユーロ 17, 576	2, 474, 729	2. 1	—	1. 5	0. 4	0. 1
ユーロ (フランス)	千ユーロ 78, 471	千ユーロ 76, 884	10, 825, 331	9. 0	—	5. 5	2. 7	0. 8
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 56, 163	千ユーロ 58, 046	8, 173, 016	6. 8	—	4. 2	1. 6	1. 0
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 46, 538	千ユーロ 45, 613	6, 422, 322	5. 3	—	3. 1	1. 6	0. 7
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 71, 847	千ユーロ 69, 510	9, 787, 137	8. 1	—	4. 6	2. 6	1. 0
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 5, 020	千ユーロ 4, 553	641, 137	0. 5	—	0. 3	0. 2	0. 0
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 11, 100	千ユーロ 10, 649	1, 499, 450	1. 2	—	0. 7	0. 5	0. 0
ユーロ (小計)	309, 031	303, 876	42, 785, 754	35. 6	—	21. 7	10. 0	3. 9
合計	—	—	122, 375, 149	101. 9	—	54. 8	31. 7	15. 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) 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	2. 5000	13, 310	13, 205	1, 782, 930	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 7500	27, 905	27, 704	3, 740, 366	2023/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 7500	15, 000	14, 848	2, 004, 736	2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 5000	16, 580	16, 300	2, 200, 680	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6. 2500	3, 300	3, 421	461, 924	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6. 1250	8, 950	10, 032	1, 354, 463	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5. 2500	3, 700	4, 050	546, 873	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6. 2500	1, 400	1, 661	224, 378	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5. 3750	630	716	96, 784	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5. 0000	300	354	47, 837	2037/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 5000	430	428	57, 790	2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4. 3750	1, 410	1, 555	209, 994	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4. 6250	1, 390	1, 581	213, 569	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4. 7500	2, 270	2, 611	352, 609	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 7500	600	602	81, 391	2041/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 1250	670	614	82, 922	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 7500	1, 500	1, 287	173, 877	2042/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 8750	4, 500	3, 921	529, 463	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 6250	1, 100	1, 080	145, 912	2043/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 7500	2, 532	2, 536	342, 405	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 6250	1, 000	982	132, 614	2044/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 3750	2, 200	2, 076	280, 359	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 1250	2, 940	2, 662	359, 435	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 2500	12, 810	12, 432	1, 678, 527	2024/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 5000	1, 100	889	120, 072	2045/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 1250	15, 300	14, 681	1, 982, 200	2025/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3. 0000	370	327	44, 247	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 0000	14, 820	14, 107	1, 904, 627	2025/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 2500	19, 800	18, 930	2, 555, 817	2025/11/15	

			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
								%	千		ア		メ		リ		カ		・		ド		ル	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分		当 期			末		
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額
				%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円
オーストラリア		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 7500	889	931	86,751
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	1,156	1,149	107,002
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 2500	320	308	28,736
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 2500	1,800	1,790	166,686
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 5000	359	375	34,958
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 2500	2,398	2,453	228,388
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 7500	725	697	64,958
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	800	695	64,749
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 2500	684	611	56,895
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	1,300	1,238	115,266
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	658	605	56,329
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 0000	575	470	43,829
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	1,250	1,174	109,362
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 5000	2,100	1,901	177,024
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	510	416	38,743
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	1,800	1,468	136,676
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2500	2,350	1,832	170,564
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 0000	2,300	1,816	169,130
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 7500	900	538	50,104
通貨小計		銘柄数	19銘柄				
	金 額				22,874	20,474	1,906,160
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3. 5000	203	206	20,027
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3. 0000	150	150	14,605
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 8750	600	588	57,064
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 7500	239	223	21,715
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 7500	700	701	68,035
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3. 3750	420	427	41,411
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 8750	500	494	47,893
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 3750	400	394	38,237
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 7500	330	308	29,865
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 1250	200	193	18,790
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 2500	260	231	22,448
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 6250	800	782	75,892
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 0000	500	494	47,982
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 3750	300	268	26,001
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1. 8750	350	274	26,569
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1. 8750	170	134	13,064
通貨小計		銘柄数	16銘柄				
	金 額				6,122	5,875	569,604
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2. 0000	1,350	1,342	217,779
		United Kingdom Gilt	国債証券	2. 5000	810	806	130,860
		United Kingdom Gilt	国債証券	1. 5000	1,875	1,825	296,068
		United Kingdom Gilt	国債証券	1. 5000	1,150	893	144,862
		United Kingdom Gilt	国債証券	1. 7500	820	717	116,452
		United Kingdom Gilt	国債証券	1. 7500	900	721	117,103
		United Kingdom Gilt	国債証券	1. 2500	650	620	100,576
		United Kingdom Gilt	国債証券	1. 6250	800	770	124,965
		United Kingdom Gilt	国債証券	1. 6250	517	394	63,913
		United Kingdom Gilt	国債証券	1. 0000	1,500	1,470	238,514
		United Kingdom Gilt	国債証券	1. 7500	800	654	106,134
		United Kingdom Gilt	国債証券	1. 6250	850	660	107,150
		United Kingdom Gilt	国債証券	0. 8750	800	720	116,862
		United Kingdom Gilt	国債証券	1. 2500	1,200	929	150,814
		United Kingdom Gilt	国債証券	0. 3750	400	338	54,939
		United Kingdom Gilt	国債証券	0. 5000	850	422	68,493
		United Kingdom Gilt	国債証券	0. 6250	370	220	35,699
		United Kingdom Gilt	国債証券	0. 6250	1,450	1,114	180,836
		United Kingdom Gilt	国債証券	0. 2500	1,200	979	158,830
		United Kingdom Gilt	国債証券	0. 8750	500	338	54,895
		United Kingdom Gilt	国債証券	1. 2500	200	142	23,036
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1. 5000	100	75	12,264
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1. 1250	200	123	20,045
		United Kingdom Gilt	国債証券	6. 0000	963	1,175	190,752
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 2500	1,600	1,838	298,154
		United Kingdom Gilt	国債証券	5. 0000	1,275	1,367	221,861
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 2500	915	1,075	174,498
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 7500	550	697	113,094
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 2500	850	1,152	186,977
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 2500	770	974	158,094
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 2500	1,300	1,431	232,156
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 5000	911	1,157	187,713
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 7500	907	1,069	173,539
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 2500	543	701	113,815
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 2500	1,130	1,363	221,203
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 5000	300	356	57,895
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 0000	527	709	115,038
		United Kingdom Gilt	国債証券	4. 2500	1,000	1,214	196,987
		United Kingdom Gilt	国債証券	3. 7500	700	855	138,795
		United Kingdom Gilt	国債証券	3. 2500	675	728	118,108
		United Kingdom Gilt	国債証券	2. 2500	1,390	1,392	225,807
		United Kingdom Gilt	国債証券	3. 5000	638	809	131,377
		United Kingdom Gilt	国債証券	2. 7500	1,000	1,012	164,210
		United Kingdom Gilt	国債証券	3. 5000	740	831	134,808
通貨小計		銘柄数	44銘柄				
	金 額				37,977	38,197	6,195,990

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		
イスラエル		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	千イスラエル・シェケル	千イスラエル・シェケル	千円	2042/01/31	
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	1,200	1,507	58,691	2024/03/31	
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	1,650	1,683	65,572	2025/08/31	
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	500	481	18,769	2027/03/31	
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	4,000	3,815	148,574	2027/03/31	
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	1,200	1,194	46,505	2047/03/31	
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,700	1,449	56,435	2030/03/31	
通貨小計		銘柄数	7銘柄						
		金 額			11,250	10,897	424,355		
デンマーク		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		2039/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	6,740	9,008	170,528	2023/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	670	674	12,777	2025/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,830	2,840	53,773	2027/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,200	2,975	56,316	2029/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,700	4,226	80,002	2052/11/15	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	1,408	26,663	2031/11/15	
通貨小計		銘柄数	8銘柄						
		金 額			25,540	25,680	486,130		
ノルウェー		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		2024/03/14	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,300	6,329	85,390	2025/03/13	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	150	145	1,956	2026/02/19	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,430	1,352	18,242	2027/02/17	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,000	2,826	38,125	2028/04/26	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,000	3,763	50,770	2029/09/06	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	2,000	1,822	24,588	2030/08/19	
通貨小計		銘柄数	8銘柄						
		金 額			21,380	20,125	271,486		
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		2039/03/30	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,520	3,045	40,358	2023/11/13	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,150	4,142	54,888	2025/05/12	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,820	3,874	51,336	2026/11/12	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,780	4,576	60,639	2028/05/12	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,550	2,373	31,449	2032/06/01	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	500	513	6,802	2029/11/12	
通貨小計		銘柄数	8銘柄						
		金 額			25,320	24,686	327,093		
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		2026/03/05	
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	24,200	21,337	140,092	2047/11/07	
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	11,450	10,025	65,823	2024/09/05	
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,900	27,048	177,588	2023/12/07	
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,740	6,594	43,298	2024/12/05	
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	6,340	6,399	42,016	2027/06/03	
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	20,800	19,263	126,475	2036/11/20	
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	2,750	2,922	19,190	2029/05/31	
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,500	6,241	40,977	2038/11/18	
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	5,000	4,685	30,763	2031/05/29	
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,700	20,701	135,912	2042/11/13	
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	14,050	12,082	79,329	2034/11/23	
通貨小計		銘柄数	12銘柄						
		金 額			158,730	146,498	961,839		
中国		China Government Bond	国債証券	3.2500	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		2028/11/22	
		China Government Bond	国債証券	3.2900	6,500	6,711	134,324	2029/05/23	
		China Government Bond	国債証券	3.1300	3,000	3,110	62,261	2029/11/21	
		China Government Bond	国債証券	2.9400	2,800	2,862	57,283	2024/10/17	
		China Government Bond	国債証券	2.6800	14,000	14,204	284,286	2030/05/21	
		China Government Bond	国債証券	2.8800	3,000	2,969	59,424	2023/11/05	
		China Government Bond	国債証券	3.0200	19,000	19,193	384,156	2025/10/22	
		China Government Bond	国債証券	3.2800	4,000	4,072	81,505	2027/12/03	
		China Government Bond	国債証券	3.2700	8,500	8,780	175,729	2030/11/19	
		China Government Bond	国債証券	3.8100	4,000	4,136	82,787	2050/09/14	
		China Government Bond	国債証券	3.7200	3,000	3,255	65,154	2051/04/12	
		China Government Bond	国債証券	3.0200	1,600	1,713	34,286	2031/05/27	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,800	1,823	36,502	2026/05/05	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7400	7,000	7,094	141,993	2026/08/04	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5900	10,000	10,075	201,661	2027/08/03	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0800	6,500	6,826	136,624	2048/10/22	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8600	3,400	3,841	76,876	2049/07/22	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7700	1,800	1,966	39,367	2025/03/08	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	10,000	10,419	208,546	2050/03/16	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	1,100	1,113	22,278	2028/10/14	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	3,500	3,532	70,695	2051/10/18	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	3,300	3,429	68,645	2031/11/18	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	5,300	5,323	106,549	2032/05/15	
	通貨小計		銘柄数	23銘柄					
			金 額			124,500	127,855	2,558,941	
	マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		2030/04/15
			MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,760	1,773	54,146	2031/06/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	1,000	985	30,099	2027/03/15	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	末 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	3.8440	1,400	1,315	40,159	2033/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,500	1,460	44,594	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,150	1,157	35,337	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	500	478	14,599	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,600	1,616	49,354	2023/08/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	1,420	1,361	41,561	2046/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	2,700	2,729	83,358	2024/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	500	493	15,082	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,000	997	30,460	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	1,500	1,498	45,773	2026/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,200	1,164	35,567	2029/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,187	36,264	2034/07/05
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,216	37,149	2040/05/22
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	1,400	1,197	36,562	2050/06/15
通貨小計	銘柄数 金 額	17銘柄			23,280	22,570	689,224	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,640	2,152	64,785	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,815	1,410	42,453	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,900	2,653	79,843	2024/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	2,300	1,675	50,409	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	2,000	1,779	53,536	2024/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.2500	1,800	1,106	33,305	2030/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.2500	900	655	19,721	2026/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	700	418	12,587	2032/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	600	543	16,367	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	710	682	20,533	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	1,800	1,384	41,651	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,230	3,712	111,724	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄			22,395	18,173	546,920	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（アイルランド）		IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	688	761	107,193	2025/03/13
		IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	300	311	43,918	2024/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	680	697	98,172	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	410	366	51,553	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	520	507	71,493	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	570	515	72,539	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	752	105,933	2028/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	150	133	18,823	2033/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	1,100	1,026	144,555	2031/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	300	282	39,770	2029/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	300	230	32,431	2050/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	—	200	161	22,713	2031/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	200	139	19,609	2041/04/22
国 小 計	銘柄数 金 額	13銘柄			6,218	5,885	828,708	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オランダ）		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	580	694	97,728	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,400	1,724	242,871	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	980	1,224	172,365	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	890	925	130,240	2033/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	750	758	106,737	2023/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	910	1,026	144,469	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	980	994	140,044	2024/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	690	664	93,587	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,670	1,596	224,792	2026/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,470	1,399	197,076	2027/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	393	55,382	2024/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	900	845	119,014	2028/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	624	87,929	2029/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	189	26,611	2040/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	750	642	90,486	2030/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	433	61,086	2052/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	754	106,178	2031/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	265	37,318	2029/01/15
国 小 計	銘柄数 金 額	18銘柄			15,320	15,155	2,133,921	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ベルギー）		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,170	1,143	161,021	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	300	269	37,974	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	460	419	58,995	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	595	578	81,488	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	614	484	68,265	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	470	390	54,975	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	400	396	55,826	2023/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	730	694	97,716	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	500	490	69,014	2024/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	310	272	38,315	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	400	344	48,519	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	880	823	116,005	2028/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	500	448	63,198	2033/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,100	1,018	143,353	2029/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	350	276	38,980	2050/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	400	340	47,877	2030/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	600	406	57,278	2040/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	300	271	38,248	2027/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,800	1,453	204,698	2031/10/22

区 分		銘 柄	種 類	当 期 年 利 率	額 面 金 額	未 来		償 還 年 月 日
						評 価 額		
						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	270	116	16,399	2071/06/22	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	200	163	23,021	2032/06/22	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	300	212	29,907	2053/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,000	1,201	169,100	2028/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	750	956	134,670	2035/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	965	1,180	166,235	2041/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	700	773	108,975	2026/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	300	344	48,479	2032/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	500	507	71,506	2023/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	390	457	64,434	2045/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	800	821	115,653	2024/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	300	316	44,591	2034/06/22	
国 小 計	銘柄数 金 額	31銘柄			18,354	17,576	2,474,729	
ユーロ（フランス）	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,415	3,906	550,057	2025/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,600	3,418	481,296	2032/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,210	1,520	214,043	2035/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,232	1,565	220,400	2055/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,265	1,516	213,591	2038/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,200	1,255	176,743	2023/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,143	2,739	385,670	2041/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,000	1,291	181,865	2060/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,640	3,886	547,198	2026/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,910	4,082	574,833	2027/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,340	1,481	208,614	2045/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,500	3,567	502,311	2024/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,986	2,048	288,400	2030/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,360	3,387	477,019	2024/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,400	4,269	601,194	2025/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,250	2,124	299,081	2031/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,400	3,240	456,287	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,150	1,837	258,755	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,100	832	117,233	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,070	1,933	272,240	2026/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	1,614	227,323	2039/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,343	189,176	2027/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,800	1,586	223,437	2048/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,500	2,333	328,532	2028/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	1,580	222,489	2034/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,750	2,543	358,070	2028/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,157	303,713	2024/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,650	1,279	180,199	2050/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,400	3,065	431,685	2029/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,057	289,735	2029/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,100	666	93,883	2052/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,300	910	128,171	2040/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,497	351,673	2030/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	200	80	11,378	2072/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	1,780	250,645	2031/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	825	116,246	2027/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	300	177	24,978	2053/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	600	476	67,148	2032/05/25	
国 小 計	銘柄数 金 額	38銘柄			78,471	76,884	10,825,331	
ユーロ（ドイツ）	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	455	564	79,451	2027/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	800	973	137,064	2028/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	800	947	133,370	2028/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	2,096	2,785	392,192	2030/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,660	2,170	305,550	2031/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	3,270	4,340	611,156	2034/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,090	1,394	196,365	2037/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,020	1,378	194,153	2039/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,810	2,613	368,010	2040/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	656	814	114,619	2042/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,098	1,240	174,648	2044/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	760	772	108,723	2023/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,300	4,356	613,347	2024/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,575	1,801	253,704	2046/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,990	2,005	282,338	2024/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,000	1,991	280,344	2024/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,165	164,132	2025/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,800	3,758	529,229	2025/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,883	1,822	256,599	2026/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,850	3,625	510,514	2026/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,550	1,464	206,193	2027/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,100	2,939	413,852	2027/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,460	1,298	182,830	2048/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,050	989	139,311	2028/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,800	1,659	233,681	2028/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,800	1,648	232,130	2029/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	967	136,229	2050/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	618	87,109	2030/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	237	33,502	2035/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	1,401	197,302	2030/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	954	134,449	2031/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	155	21,901	2036/05/15	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり） マザーファンド

		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	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	243	34,218	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,115	157,132	2031/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	600	348	49,013	2052/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	991	139,532	2023/10/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	490	69,107	2024/04/05
国 小 計	銘柄数 金 額	37銘柄		56,163	58,046	8,173,016	
ユーロ（スペイン）	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,420	1,714	241,470	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	3,100	3,064	431,416	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	910	854	120,300	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,565	2,566	361,397	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,400	1,382	194,650	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	989	909	128,047	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,480	1,387	195,305	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,049	1,961	276,177	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,100	2,008	282,773	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,320	1,227	172,888	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,170	1,107	155,902	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,650	1,545	217,644	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	850	745	104,898	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	740	104,226	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,400	1,195	168,293	2035/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	900	774	109,102	2029/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	842	118,564	2030/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	100	56	7,890	2050/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	1,589	223,815	2030/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	950	668	94,061	2040/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	800	626	88,200	2031/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	200	99	13,997	2071/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	866	122,039	2028/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	500	353	49,768	2037/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	719	101,246	2031/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	1,000	801	112,792	2032/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	680	844	118,907	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	900	1,003	141,348	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	800	977	137,685	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,043	1,248	175,748	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,000	1,141	160,704	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	2,188	2,281	321,175	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,700	1,950	274,629	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,090	1,400	197,199	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	3,700	3,849	542,017	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,084	1,108	156,032	2024/10/31
国 小 計	銘柄数 金 額	36銘柄		46,538	45,613	6,422,322	
ユーロ（イタリア）	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	2,700	3,153	443,996	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,135	1,310	184,531	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,100	3,087	434,786	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	905	780	109,955	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	920	884	124,506	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,500	1,218	171,538	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	900	870	122,501	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,400	1,087	153,093	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,250	996	140,321	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	3,700	3,650	514,036	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,000	727	102,457	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,700	1,448	203,886	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,700	1,611	226,937	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	950	840	118,313	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,550	1,451	204,418	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	700	600	84,521	2038/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,500	2,317	326,247	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,400	1,337	188,324	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,300	1,279	180,089	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	700	644	90,748	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	500	470	66,187	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,100	1,051	148,031	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	1,400	1,341	188,909	2026/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	500	417	58,758	2030/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	150	106	15,033	2050/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	500	360	50,745	2036/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	1,591	224,024	2030/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	600	502	70,722	2030/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	600	415	58,439	2041/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,000	773	108,977	2031/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	100	58	8,275	2051/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	200	130	18,349	2037/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,600	1,186	167,047	2031/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	200	122	17,306	2045/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	450	268	37,872	2072/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	500	404	57,004	2029/02/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	500	321	45,277	2052/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	400	354	49,965	2038/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	1,540	1,698	239,150	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	1,488	1,719	242,135	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,300	1,482	208,764	2033/02/01

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
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,650	1,786	251,574
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	1,270	1,250	176,094
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,140	1,252	176,320
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,870	1,937	272,869
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,900	3,071	432,447
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,714	1,883	265,172
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	4,250	4,465	628,762
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,080	2,215	311,976
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,025	1,106	155,819
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,830	2,946	414,805
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,110	2,166	305,058
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,370	1,349	190,044
国 小 計	銘柄数	53銘柄					
	金 額				71,847	69,510	9,787,137
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	190	168	23,778
		Finland Government Bond	国債証券	0.8750	800	782	110,113
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	180	172	24,230
		Finland Government Bond	国債証券	1.3750	270	219	30,973
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	200	186	26,268
		Finland Government Bond	国債証券	1.1250	150	131	18,464
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	456	64,297
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	269	37,875
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	350	257	36,227
		Finland Government Bond	国債証券	0.2500	150	101	14,360
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	200	104	14,739
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	200	165	23,307
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	371	52,263
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	200	215	30,275
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	120	125	17,694
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	460	470	66,192
		Finland Government Bond	国債証券	2.0000	350	355	50,071
国 小 計	銘柄数	17銘柄					
	金 額				5,020	4,553	641,137
ユーロ（オーストリア）					千ユーロ	千ユーロ	
		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	540	534	75,197
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	490	469	66,165
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	270	225	31,790
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	280	186	26,215
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,000	940	132,409
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	150	121	17,111
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	562	79,181
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	700	632	89,088
		Austria Government Bond	国債証券	—	450	382	53,824
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	393	55,403
		Austria Government Bond	国債証券	0.8500	100	40	5,729
		Austria Government Bond	国債証券	—	500	412	58,095
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	383	54,024
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	200	147	20,728
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	150	74	10,501
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	200	177	24,957
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	380	463	65,251
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	800	972	136,881
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	700	784	110,504
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	170	223	31,518
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	630	714	100,656
		Austria Government Bond	国債証券	1.7500	280	283	39,884
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	630	634	89,277
		Austria Government Bond	国債証券	1.6500	880	888	125,050
国 小 計	銘柄数	24銘柄					
	金 額				11,100	10,649	1,499,450
通貨小計		銘柄数	267銘柄				
	金 額				309,031	303,876	42,785,754
合 計		銘柄数	554銘柄				
	金 額						122,375,149

(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。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘 柄 別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外 国		百万円	百万円
	US 2YR NOTE (CBT) (アメリカ)	280	—

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	122,375,149	98.3
コール・ローン等、その他	2,120,401	1.7
投資信託財産総額	124,495,550	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝135.01円、1カナダ・ドル＝104.20円、1オーストラリア・ドル＝93.10円、1シンガポール・ドル＝96.95円、1イギリス・ポンド＝162.21円、1イスラエル・シェケル＝38.942円、1デンマーク・クローネ＝18.93円、1ノルウェー・クローネ＝13.49円、1スウェーデン・クローネ＝13.25円、1メキシコ・ペソ＝6.565円、1オフショア・人民元＝20.014円、1マレーシア・リンギット＝30.536円、1南アフリカ・ランド＝8.42円、1ポーランド・ズロチ＝30.093円、1ユーロ＝140.80円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（123,970,109千円）の投資信託財産総額（124,495,550千円）に対する比率は、99.6％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	250,197,435,277円
コール・ローン等	1,024,545,039
公社債（評価額）	122,375,149,528
未収入金	125,705,971,494
未収利息	810,738,948
前払費用	30,000,154
差入委託証拠金	251,030,114
(B) 負債	130,076,644,054
未払金	130,057,582,122
未払解約金	19,061,932
(C) 純資産総額（A－B）	120,120,791,223
元本	133,574,429,591
次期繰越損益金	△ 13,453,638,368
(D) 受益権総口数	133,574,429,591口
1万口当り基準価額（C／D）	8,993円

* 期首における元本額は113,403,229,819円、当作成期間中における追加設定元本額は33,395,160,755円、同解約元本額は13,223,960,983円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） 108,109,338,430円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） 4,161,900,030円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用） 1,564,129円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用） 3,239,349,686円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用） 18,062,277,316円
* 当期末の計算口数当りの純資産額は8,993円です。
* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は13,453,638,368円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,083,779,205円
受取利息	3,084,971,375
その他収益金	67,780
支払利息	△ 1,259,950
(B) 有価証券売買損益	△ 22,001,327,273
売買益	25,747,247,464
売買損	△ 47,748,574,737
(C) 先物取引等損益	△ 19,513,013
取引益	21,398,787
取引損	△ 40,911,800
(D) その他費用	△ 12,206,581
(E) 当期損益金（A＋B＋C＋D）	△ 18,949,267,662
(F) 前期繰越損益金	4,514,657,781
(G) 解約差損益金	115,808,446
(H) 追加信託差損益金	865,163,067
(I) 合計（E＋F＋G＋H）	△ 13,453,638,368
次期繰越損益金（I）	△ 13,453,638,368

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。
(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)

運用報告書(全体版) 第 6 期

(決算日 2022年 6 月15日)
(作成対象期間 2021年 6 月16日～2022年 6 月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年 9 月26日）		
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います。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックス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	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		純資産総額の30%以下
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、外国の公社債に投資し、投資成果を FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざしております。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/>

<2735>

最近5期の運用実績

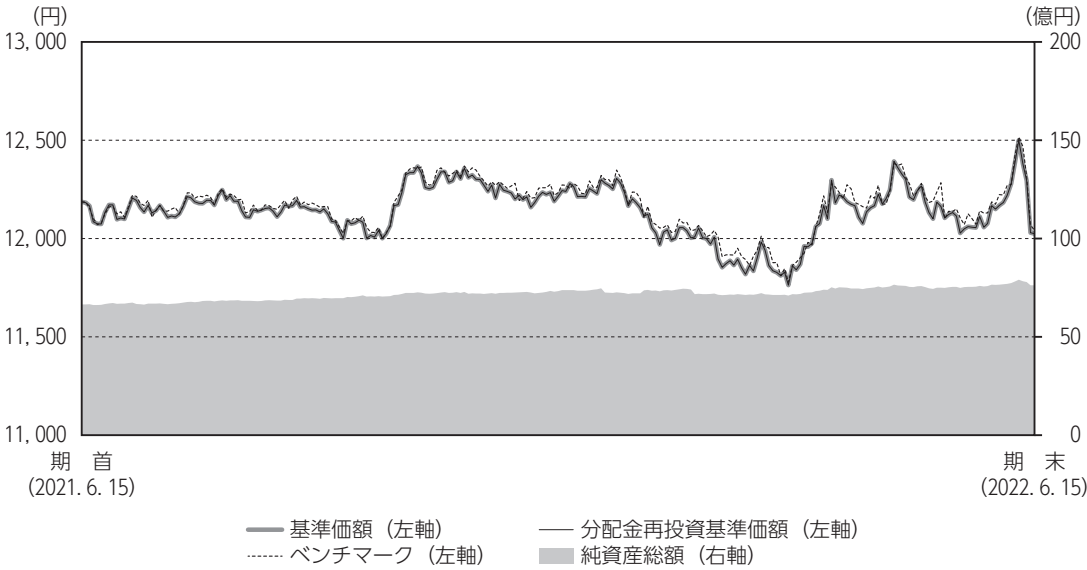
決 算 期	基 準 価 額			FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2 期末 (2018年 6 月15日)	10,709	0	0.8	10,815	1.8	98.6	—	2,405
3 期末 (2019年 6 月17日)	10,978	0	2.5	11,109	2.7	98.5	—	3,676
4 期末 (2020年 6 月15日)	11,579	0	5.5	11,801	6.2	98.3	—	4,949
5 期末 (2021年 6 月15日)	12,187	0	5.3	12,457	5.6	98.7	—	6,651
6 期末 (2022年 6 月15日)	12,025	0	△ 1.3	12,308	△ 1.2	98.4	—	7,620

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注2) FTSE 世界国債インデックス（除く日本、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、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。FTSE 世界国債インデックス（除く日本、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) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。
(注7) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■ 基準価額・騰落率

期 首：12,187円
期 末：12,025円（分配金 0 円）
騰落率：△1.3%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

「外国債券インデックスマザーファンド」を通じて日本を除く先進国国債に投資した結果、為替相場で円安が進んだものの、債券市場で金利が上昇（債券価格は下落）したことから、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%		%	%	%
(期首) 2021年 6 月15日	12,187	—	12,457	—	98.7	—
6 月末	12,099	△ 0.7	12,375	△ 0.7	98.3	—
7 月末	12,178	△ 0.1	12,483	0.2	98.4	—
8 月末	12,170	△ 0.1	12,464	0.1	98.0	—
9 月末	12,083	△ 0.9	12,382	△ 0.6	98.1	—
10月末	12,339	1.2	12,610	1.2	98.1	—
11月末	12,198	0.1	12,475	0.1	98.3	—
12月末	12,270	0.7	12,572	0.9	98.4	—
2022年 1 月末	12,055	△ 1.1	12,346	△ 0.9	98.3	—
2 月末	11,835	△ 2.9	12,173	△ 2.3	98.5	—
3 月末	12,221	0.3	12,506	0.4	98.4	—
4 月末	12,243	0.5	12,509	0.4	98.3	—
5 月末	12,167	△ 0.2	12,457	△ 0.0	98.0	—
(期末) 2022年 6 月15日	12,025	△ 1.3	12,308	△ 1.2	98.4	—

(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. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■海外債券市況

主要国の国債金利は、上昇しました。

当作成期首より、主要国の国債金利は、米国など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低下しましたが、2021年9月に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、上昇に転じました。2022年に入ってから、ロシアがウクライナに侵攻したことで原油価格が高騰し、インフレ期待が上昇したことで、金利上昇が加速しました。その後も、インフレ率の上振れなどから各国で金融政策正常化が意識され、主要国の金利は上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに金利は上昇しました。

■為替相場

為替相場は円安となりました。

当作成期首より、米ドル円は比較的狭いレンジでの推移となりましたが、2021年9月以降は米国金利が上がったことにより上昇（円安）しました。2022年に入っても、期待インフレ率の上昇により米国金利がさらに上がったため、米ドル円も上げ幅を拡大しました。また、世界的に利上げ観測が高まっている一方で、日本の金融政策が相対的に緩和的であることなどから、その他の通貨も対円で上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに円安が進みました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ～ 2022. 6. 15)

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れました。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

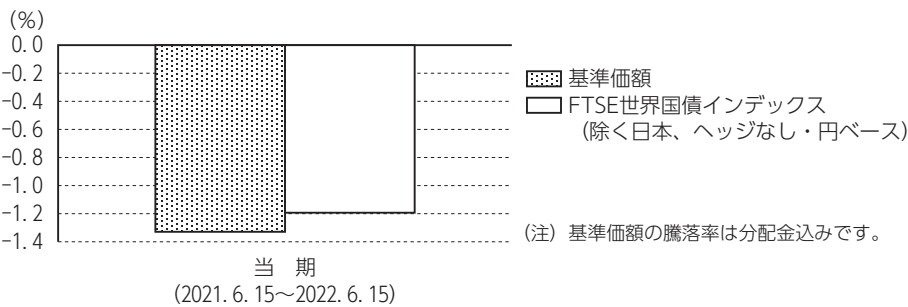
組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックスマザーファンド	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△1.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△1.3%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。ただし、これ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。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	2,025

- （注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
 （注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
 （注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

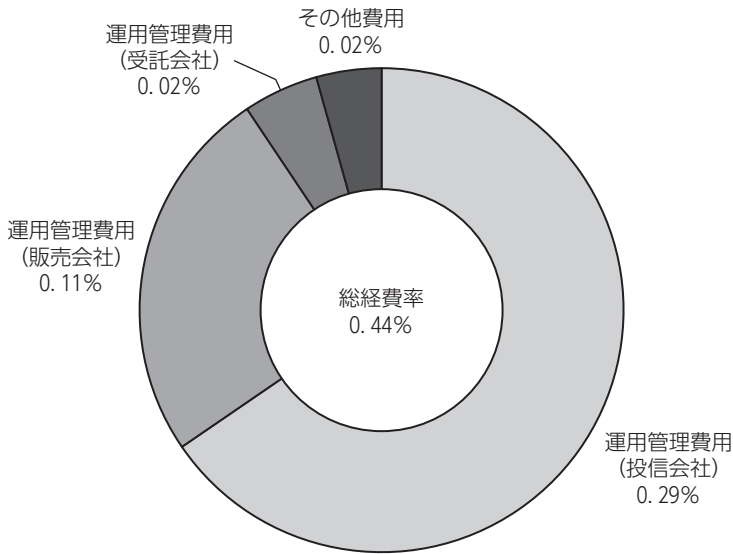
項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	51円	0. 418%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12, 141円です。
(投 信 会 社)	(35)	(0. 286)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(13)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	3	0. 021	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. 013)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0. 008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0. 000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	53	0. 439	

- (注 1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。
- (注 2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。
- (注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。
- (注 4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1 万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1 口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0. 44%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6月16日から2022年6月15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	655, 819	2, 048, 587	324, 872	1, 016, 427

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	2, 120, 293	2, 451, 240	7, 597, 619

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15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	7, 597, 619	99. 5
コール・ローン等、その他	38, 924	0. 5
投資信託財産総額	7, 636, 544	100. 0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝135. 01円、1カナダ・ドル＝104. 20円、1オーストラリア・ドル＝93. 10円、1シンガポール・ドル＝96. 95円、1イギリス・ポンド＝162. 21円、1イスラエル・シェケル＝38. 942円、1デンマーク・クローネ＝18. 93円、1ノルウェー・クローネ＝13. 49円、1スウェーデン・クローネ＝13. 25円、1メキシコ・ペソ＝6. 565円、1オフショア・人民元＝20. 014円、1マレーシア・リンギット＝30. 536円、1ポーランド・ズロチ＝30. 093円、1ユーロ＝140. 80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（232, 842, 571千円）の投資信託財産総額（233, 898, 338千円）に対する比率は、99. 5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	7, 636, 544, 365円
コール・ローン等	38, 924, 876
外国債券インデックス マザーファンド（評価額）	7, 597, 619, 489
(B) 負債	15, 706, 506
未払信託報酬	15, 402, 599
その他未払費用	303, 907
(C) 純資産総額（A－B）	7, 620, 837, 859
元本	6, 337, 300, 973
次期繰越損益金	1, 283, 536, 886
(D) 受益権総口数	6, 337, 300, 973口
1万口当り基準価額（C／D）	12, 025円

* 期首における元本額は5, 457, 959, 297円、当作成期間中における追加設定元本額は2, 102, 589, 183円、同解約元本額は1, 223, 247, 507円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12, 025円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 6, 665円
受取利息	840
支払利息	△ 7, 505
(B) 有価証券売買損益	△ 63, 153, 203
売買益	11, 836, 851
売買損	△ 74, 990, 054
(C) 信託報酬等	△ 30, 621, 398
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 93, 781, 266
(E) 前期繰越損益金	399, 854, 454
(F) 追加信託差損益金	977, 463, 698
（配当等相当額）	(392, 390, 652)
（売買損益相当額）	(585, 073, 046)
(G) 合計（D＋E＋F）	1, 283, 536, 886
次期繰越損益金（G）	1, 283, 536, 886
追加信託差損益金	977, 463, 698
（配当等相当額）	(392, 390, 652)
（売買損益相当額）	(585, 073, 046)
分配準備積立金	399, 858, 245
繰越損益金	△ 93, 785, 057

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	883, 689, 097
(d) 分配準備積立金	399, 858, 245
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	1, 283, 547, 342
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	1, 283, 547, 342
(h) 受益権総口数	6, 337, 300, 973口

<補足情報>

当ファンド（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））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6月15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6月16日から2022年6月15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	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 2023/4/14	790,367
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.375% 2031/11/15	1,022,248	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) 1.875% 2032/2/15	897,130	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2022/11/30	736,251
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 0.375% 2024/9/15	848,795	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2023/5/15	630,327
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) 0.125% 2022/6/30	604,766
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2% 2051/8/15	781,896	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.125% 2022/12/31	583,924
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2031/5/15	699,257	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 1.75% 2023/5/25	578,812
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.375% 2051/5/15	696,719	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2023/2/15	537,083
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.375% 2028/10/31	690,613	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.5% 2023/3/15	535,344
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 0.625% 2026/7/31	667,034	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2.25% 2022/10/25	487,862

(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6月15日現在における外国債券インデックスマザーファンド（75,409,227千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

作 成 期		2022年6月15日現在						
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちB B格 以下組入 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
		千アメリカ・ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	千アメリカ・ドル 964,623	千アメリカ・ドル 872,910	117,851,629	50.4	—	22.1	18.1	10.2
カナダ	千カナダ・ドル 49,221	千カナダ・ドル 44,650	4,652,632	2.0	—	1.0	0.5	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 42,534	千オーストラリア・ドル 37,820	3,521,107	1.5	—	1.1	0.4	0.0
シンガポール	千シンガポール・ドル 11,030	千シンガポール・ドル 10,470	1,015,081	0.4	—	0.2	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 70,612	千イギリス・ポンド 71,375	11,577,757	5.0	—	3.9	0.6	0.5
イスラエル	千イスラエル・シケル 24,300	千イスラエル・シケル 23,697	922,846	0.4	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 45,211	千デンマーク・クローネ 46,934	888,471	0.4	—	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 37,630	千ノルウェー・クローネ 34,905	470,872	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 48,205	千スウェーデン・クローネ 47,350	627,394	0.3	—	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 291,735	千メキシコ・ペソ 271,753	1,784,194	0.8	—	0.4	0.3	0.1
中国	千オフショア・人民元 225,900	千オフショア・人民元 231,967	4,642,686	2.0	—	0.9	0.8	0.2
マレーシア	千マレーシア・リンギット 40,255	千マレーシア・リンギット 39,008	1,191,192	0.5	—	0.3	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 39,450	千ポーランド・ズロチ 31,760	955,807	0.4	—	0.2	0.2	0.1
ユ ー ロ 圏	アイルランド	千ユーロ 12,353	千ユーロ 11,379	1,602,218	0.7	—	0.5	0.0
	オランダ	千ユーロ 28,548	千ユーロ 27,831	3,918,735	1.7	—	1.2	0.4
	ベルギー	千ユーロ 34,826	千ユーロ 33,685	4,742,859	2.0	—	1.5	0.4
	フランス	千ユーロ 148,961	千ユーロ 144,067	20,284,741	8.7	—	5.3	2.5
	ドイツ	千ユーロ 108,055	千ユーロ 108,235	15,239,508	6.5	—	4.0	1.7
	スペイン	千ユーロ 88,003	千ユーロ 85,065	11,977,175	5.1	—	3.1	1.5
	イタリア	千ユーロ 139,978	千ユーロ 131,177	18,469,760	7.9	—	4.5	2.4
	フィンランド	千ユーロ 9,836	千ユーロ 8,847	1,245,772	0.5	—	0.3	0.1
	オーストリア	千ユーロ 22,679	千ユーロ 21,412	3,014,908	1.3	—	0.7	0.4
	小計	593,239	571,702	80,495,680	34.4	—	21.0	9.5
合 計	—	—	230,597,354	98.7	—	51.8	31.2	15.6

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15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6月15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	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,568	4,532	611,902	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	4,984	673,011	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,176	698,851	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	4,829	651,974	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	678	91,544	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	924	124,775	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	794	107,297	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	807	109,079	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	847	114,433	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	2,720	367,321	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,324	178,865	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	1,000	135,061	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	607	82,031	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	583	78,779	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	1,044	140,982	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,222	164,990	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,189	160,584	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,334	180,207	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,149	155,183	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	1,847	249,412	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,123	151,645	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,583	213,854	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,442	194,789	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,493	201,694	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,524	205,785	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,331	179,735	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,487	200,870	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,212	163,758	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,231	1,915	258,613	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	1,395	188,378	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	2,389	322,542	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	2,002	270,379	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	3,157	426,328	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	2,084	281,416	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	3,248	438,557	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	3,140	423,979	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	6,021	813,013	2024/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	1,746	235,833	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	5,746	775,844	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,746	2,430	328,187	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,515	744,619	2025/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	2,072	279,769	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,554	749,867	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,835	2,511	339,035	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,466	738,075	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,873	1,623	219,188	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,583	753,837	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	659	584	78,948	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,866	4,533	612,048	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,148	2,543	343,460	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,729	7,158	966,451	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,823	2,281	308,001	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,465	332,830	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,945	397,735	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	4,950	668,389	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,780	2,131	287,827	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,721	367,453	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,349	317,213	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,446	330,272	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	4,944	667,582	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,444	329,994	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,000	869	117,395	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,448	330,567	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,459	332,063	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,640	3,424	462,333	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,436	328,988	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,345	2,092	282,538	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,252	304,129	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,550	4,449	600,713	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	6,038	815,322	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	1,783	240,779	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	2,923	394,742	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,157	696,376	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,333	314,983	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,518	745,029	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,918	394,061	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,950	2,515	339,561	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,931	260,758	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,500	2,426	327,581	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,130	692,722	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,134	288,185	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,398	458,874	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,094	417,852	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	2,711	366,063	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,350	6,075	820,268	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,530	341,660	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,642	356,722	2025/02/28

2022年6月15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	3.0000	3,000	2,695	363,891	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	2,825	381,462	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,800	3,504	473,154	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	6,245	843,146	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	1,861	251,347	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,479	469,810	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,491	336,390	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,486	335,742	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	2,927	395,280	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,850	3,832	517,371	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	6,432	868,384	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,220	3,800	513,075	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,447	330,416	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,578	483,110	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,507	473,501	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,452	331,051	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	2,986	403,255	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,451	331,010	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	3,978	537,123	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,700	3,599	485,954	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,520	4,381	591,602	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	2,927	395,220	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	1,988	268,521	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,500	3,386	457,177	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,473	333,883	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	6,229	841,077	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	3,945	532,695	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,415	326,106	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	4,262	575,502	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,402	324,418	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,245	438,221	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,378	321,175	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	4,121	556,478	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	3,615	488,117	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,426	462,583	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,675	361,251	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,834	382,688	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,383	456,842	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	2,618	353,482	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,500	5,308	716,736	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,333	315,109	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,133	558,052	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	3,578	483,105	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,555	345,067	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,811	514,636	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,303	311,022	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,867	387,119	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	953	128,796	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	2,757	372,246	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,850	5,182	699,651	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	3,604	486,698	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	1,836	247,994	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,856	385,693	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,306	311,339	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,391	322,862	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,700	1,607	217,035	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,000	4,327	584,228	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	6,500	5,917	798,987	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	3,958	534,396	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	268	36,183	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	4,875	658,194	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,500	1,377	185,973	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,390	187,780	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,800	5,451	736,024	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,464	332,685	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,400	2,068	279,214	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	3,352	452,628	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	3,313	447,375	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,006	405,860	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,719	367,216	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,500	5,345	721,726	2023/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	5,875	793,231	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	2,998	404,863	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	967	130,684	2023/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,063	413,667	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,500	5,311	717,085	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	10,000	7,963	1,075,111	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,246	573,367	2027/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	6,700	4,151	560,469	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	6,000	3,946	532,800	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	2,982	402,647	2027/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,925	259,934	2023/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	5,823	786,236	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,375	455,739	2027/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,144	424,596	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,200	4,029	544,048	2023/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	7,700	7,376	995,873	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	9,800	7,942	1,072,370	2030/11/15

2022年6月15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	0.2500	4,000	3,573	482,444	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,000	3,394	458,229	2027/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,800	4,509	608,862	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,100	3,497	472,139	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,100	4,566	616,521	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,258	574,899	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,859	386,074	2023/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,250	573,839	2027/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	1,000	892	120,527	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,000	3,801	513,286	2024/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	7,000	5,980	807,439	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,900	4,177	564,027	2051/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	10,700	8,826	1,191,627	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,000	4,739	639,873	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,452	601,105	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,365	589,345	2028/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,700	3,526	476,056	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,000	2,677	361,424	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,894	255,746	2024/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,509	473,798	2028/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,595	485,441	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	3,000	2,838	383,287	2024/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	8,700	7,463	1,007,619	2031/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,100	4,801	648,284	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,500	4,034	544,651	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,249	708,672	2028/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	5,109	689,860	2051/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,800	3,029	409,024	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	972	131,248	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,491	471,352	2028/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,400	3,935	531,295	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,877	253,448	2024/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,500	1,453	196,279	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	4,356	588,184	2028/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	5,000	4,484	605,486	2026/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	5,500	5,162	696,984	2024/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	3,000	2,806	378,889	2024/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	10,300	8,501	1,147,734	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	6,900	5,034	679,672	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	3,700	2,688	362,943	2041/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.1250	2,500	2,415	326,052	2023/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	6,000	5,315	717,591	2026/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	5,000	4,281	578,058	2028/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.1250	3,000	2,892	390,473	2023/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	5,000	4,305	581,332	2028/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	5,000	4,442	599,734	2026/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	7,500	6,995	944,459	2024/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	7,000	6,070	819,621	2028/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,500	3,120	421,331	2026/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,442	194,817	2023/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	2,000	1,871	252,719	2024/10/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	2,000	1,871	252,698	2024/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	9,000	7,482	1,010,225	2031/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,600	3,962	535,023	2051/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	4,000	3,035	409,879	2041/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	4,000	3,843	518,940	2023/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	6,000	5,240	707,465	2028/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	4,000	3,598	485,782	2026/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,612	487,677	2026/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.5000	5,000	4,800	648,095	2023/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	5,600	4,923	664,731	2028/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	2,200	2,066	279,037	2024/12/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	2,500	2,402	324,300	2023/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	4,000	3,489	471,141	2028/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,606	486,921	2026/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	1,000	940	126,929	2025/01/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,000	2,881	389,096	2024/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	7,400	6,426	867,665	2032/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	3,700	3,503	473,056	2025/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	4,300	3,836	517,948	2029/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	3,900	3,034	409,626	2052/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	1,500	1,215	164,083	2042/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,000	4,498	607,274	2029/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	4,000	3,876	523,331	2024/02/29
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	1,000	925	124,967	2027/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	5,000	4,762	642,985	2025/03/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	3,000	2,781	375,519	2029/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	5,000	4,758	642,505	2027/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	2,000	1,959	264,543	2024/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	2,000	1,948	263,037	2025/04/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	3,000	2,848	384,555	2032/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,930	395,613	2025/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	2,000	1,792	242,045	2052/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	1,500	1,402	189,319	2042/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	4,500	4,424	597,386	2024/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	3,000	2,870	387,561	2029/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,886	389,667	2027/04/30

2022年 6 月15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	2. 5000	4, 500	4, 420	596, 876	2024/05/31
通貨小計	銘柄数	263銘柄						
	金 額				964, 623	872, 910	117, 851, 629	
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	518	53, 988	2064/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 7500	983	1, 111	115, 821	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 7500	1, 117	1, 328	138, 451	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 0000	1, 012	1, 179	122, 919	2037/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 0000	913	972	101, 365	2041/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 5000	961	963	100, 375	2045/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	1, 253	1, 232	128, 403	2023/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 5000	1, 405	1, 380	143, 836	2024/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	1, 337	1, 179	122, 872	2048/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	1, 156	1, 117	116, 421	2025/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	969	897	93, 496	2026/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 0000	1, 240	1, 096	114, 293	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0000	650	595	62, 021	2028/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0000	1, 300	1, 279	133, 307	2023/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0000	3, 710	2, 750	286, 619	2051/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	1, 220	1, 118	116, 575	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	1, 200	1, 177	122, 671	2024/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	1, 400	1, 342	139, 878	2024/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2500	3, 450	2, 885	300, 630	2030/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2500	700	660	68, 794	2025/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 5000	2, 890	2, 628	273, 839	2025/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 5000	2, 000	1, 545	161, 014	2030/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	2, 100	1, 862	194, 069	2026/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	1, 200	1, 134	118, 207	2024/04/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 0000	300	270	28, 159	2026/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	3, 400	2, 849	296, 925	2031/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	100	96	10, 069	2023/08/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 7500	1, 000	940	98, 027	2024/10/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 7500	1, 450	994	103, 599	2053/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 5000	1, 000	961	100, 178	2023/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2500	200	179	18, 753	2027/03/01
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 7500	3, 000	2, 873	299, 452	2024/02/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	1, 700	1, 414	147, 376	2031/12/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	200	189	19, 737	2025/04/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	400	385	40, 208	2024/05/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0000	1, 000	865	90, 226	2032/06/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	100	91	9, 506	2029/12/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	400	383	40, 011	2027/09/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	200	196	20, 525	2024/08/01		
通貨小計	銘柄数	39銘柄						
	金 額				49, 221	44, 650	4, 652, 632	
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	4. 7500	1, 989	2, 084	194, 092	2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	573	569	53, 038	2024/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 2500	1, 354	1, 306	121, 589	2029/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 2500	1, 798	1, 788	166, 501	2025/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 5000	1, 258	1, 315	122, 501	2033/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 2500	1, 748	1, 788	166, 481	2026/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 7500	1, 113	1, 071	99, 722	2037/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	1, 307	1, 136	105, 785	2035/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 2500	792	707	65, 879	2039/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	1, 672	1, 592	148, 250	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	1, 178	1, 083	100, 845	2028/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 0000	1, 252	1, 025	95, 434	2047/03/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	1, 800	1, 691	157, 481	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	1, 900	1, 762	164, 077	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 5000	2, 870	2, 598	241, 933	2030/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	1, 390	1, 134	105, 595	2041/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	2, 840	2, 316	215, 645	2031/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2500	1, 700	1, 325	123, 387	2032/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	2, 400	2, 232	207, 817	2024/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 0000	2, 500	1, 974	183, 837	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 7500	1, 400	837	77, 940	2051/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	1, 600	1, 429	133, 097	2025/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 0000	2, 500	1, 924	179, 145	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 5000	1, 200	1, 051	97, 919	2026/09/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 7500	1, 100	892	83, 095	2032/11/21
		AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3. 0000	1, 300	1, 181	110, 011	2033/11/21
通貨小計	銘柄数	26銘柄						
	金 額				42, 534	37, 820	3, 521, 107	
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	785	76, 162	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3. 0000	923	926	89, 869	2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 8750	809	793	76, 942	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 7500	400	374	36, 343	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 7500	671	672	65, 216	2023/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3. 3750	568	577	56, 003	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 8750	625	617	59, 866	2029/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 3750	524	516	50, 090	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2. 7500	688	642	62, 265	2046/03/01

2022年6月15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	2.1250	450	436	42,279	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	750	667	64,754	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	538	52,176	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	490	485	47,022	2024/02/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	312	30,335	2039/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	710	555	53,897	2050/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	750	692	67,135	2025/11/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	600	529	51,319	2031/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	200	158	15,369	2051/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	200	185	18,028	2026/11/01
通貨小計	銘柄数	19銘柄					
	金 額			11,030	10,470	1,015,081	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	921	915	148,573	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,582	1,575	255,582	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,426	231,328	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,760	1,366	221,702	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,450	1,269	205,921	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,810	1,451	235,508	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,410	1,345	218,174	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	2,300	2,268	368,020	2023/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,500	1,444	234,309	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,040	792	128,568	2071/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	1,800	1,764	286,217	2024/04/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,210	989	160,528	2049/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	660	107,150	2054/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	800	720	116,862	2029/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,900	1,818	294,989	2025/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,190	922	149,557	2041/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	2,300	1,947	315,904	2030/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	1,000	496	80,581	2061/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,394	226,275	2026/01/30
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,600	1,419	230,244	2028/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	654	106,132	2050/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,700	1,307	212,015	2035/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,300	1,258	204,160	2024/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	1,300	1,060	172,066	2031/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	500	338	54,895	2046/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	500	461	74,786	2026/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	300	213	34,554	2051/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.2500	100	94	15,369	2025/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	600	469	76,156	2039/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.5000	700	618	100,314	2029/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.8750	300	249	40,514	2033/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	300	226	36,792	2053/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.0000	100	86	14,049	2032/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	420	259	42,095	2073/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,158	187,978	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,240	2,573	417,416	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,579	256,141	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,662	1,953	316,957	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,357	1,720	279,033	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	2,316	375,713	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,366	1,729	280,463	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,356	220,012	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,116	2,687	436,006	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,600	1,886	305,964	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	1,735	281,498	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	1,745	283,061	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,560	1,855	301,058	2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,174	1,579	256,271	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	1,915	310,649	2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	1,897	307,729	2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,866	2,012	326,505	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,582	1,584	256,998	2023/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,386	1,757	285,003	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,092	1,105	179,317	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,724	1,936	314,066	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	55銘柄					
	金 額			70,612	71,375	11,577,757	
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	1,800	2,033	79,206	2026/10/30
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,600	2,009	78,255	2042/01/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,000	2,041	79,481	2024/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,217	86,339	2025/08/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,716	66,858	2027/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,400	2,388	93,011	2047/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,800	1,713	66,745	2028/09/28
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,500	1,489	58,011	2023/11/30
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	2,400	2,045	79,673	2030/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.5000	1,600	1,495	58,255	2025/04/30
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,700	1,301	50,672	2037/05/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.1500	2,000	1,961	76,368	2023/07/31
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.5000	200	182	7,098	2026/02/27
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.4000	900	849	33,083	2024/10/31

2022年6月15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	
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	% 1.3000	千イスラエル・シケル 300	千イスラエル・シケル 251	千円 9,782	2032/04/30
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金 額				24,300	23,697	922,846	
デンマーク		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 13,662	千デンマーク・クローネ 18,259	345,660	2039/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	4,881	92,415	2023/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	6,035	114,255	2025/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	7,100	6,600	124,953	2027/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	8,590	7,724	146,217	2029/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,500	2,054	38,884	2052/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	412	7,813	2031/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	965	18,271	2024/11/15
通貨小計	銘柄数	8銘柄						
	金 額				45,211	46,934	888,471	
ノルウェー		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	千ノルウェー・クローネ 4,095	千ノルウェー・クローネ 4,114	55,503	2024/03/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	5,395	5,215	70,360	2025/03/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,340	4,104	55,364	2026/02/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,450	4,192	56,553	2027/02/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,293	44,424	2028/04/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	3,508	47,332	2029/09/06
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	6,800	5,948	80,250	2030/08/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,500	2,971	40,090	2031/09/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1250	1,700	1,556	20,992	2032/05/18
	通貨小計	銘柄数	9銘柄					
金 額					37,630	34,905	470,872	
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 4,655	千スウェーデン・クローネ 5,626	74,551	2039/03/30
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	8,025	8,010	106,139	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,595	7,703	102,068	2025/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	6,874	91,086	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,050	4,700	62,282	2028/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,300	3,388	44,896	2032/06/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	7,400	6,785	89,907	2029/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	5,000	4,261	56,461	2031/05/12
通貨小計	銘柄数	8銘柄						
	金 額				48,205	47,350	627,394	
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 37,290	千メキシコ・ペソ 32,879	215,869	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	21,300	18,650	122,449	2047/11/07
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	23,800	23,073	151,491	2024/09/05
		MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	7,000	5,954	39,091	2027/03/04
		MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	1,000	891	5,853	2025/03/06
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	30,033	29,386	192,934	2023/12/07
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	23,919	24,143	158,514	2024/12/05
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	27,968	25,902	170,061	2027/06/03
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	9,431	61,925	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,544	28,368	186,251	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	18,894	17,705	116,248	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	32,515	29,651	194,678	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	21,654	18,622	122,262	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,944	7,091	46,562	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金 額				291,735	271,753	1,784,194	
中国		China Government Bond	国債証券	3.2200	千オフショア・人民元 5,200	千オフショア・人民元 5,336	106,804	2025/12/06
		China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,162	103,326	2028/11/22
		China Government Bond	国債証券	3.2900	5,000	5,184	103,768	2029/05/23
		China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,141	102,901	2026/06/06
		China Government Bond	国債証券	3.1200	12,000	12,281	245,804	2026/12/05
		China Government Bond	国債証券	3.1300	5,000	5,110	102,292	2029/11/21
		China Government Bond	国債証券	2.8500	6,000	6,062	121,343	2027/06/04
		China Government Bond	国債証券	2.6800	6,500	6,433	128,753	2030/05/21
		China Government Bond	国債証券	2.8800	27,000	27,275	545,906	2023/11/05
		China Government Bond	国債証券	3.2700	6,500	6,721	134,529	2030/11/19
		China Government Bond	国債証券	3.0300	7,000	7,130	142,706	2026/03/11
		China Government Bond	国債証券	3.8100	7,300	7,921	158,543	2050/09/14
		China Government Bond	国債証券	3.0100	5,000	5,077	101,619	2028/05/13
		China Government Bond	国債証券	3.7200	3,000	3,212	64,287	2051/04/12
		China Government Bond	国債証券	3.0200	5,800	5,876	117,619	2031/05/27
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,522	90,512	2026/08/12
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7400	5,000	5,037	100,830	2026/08/04
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5700	11,000	11,305	226,263	2024/06/22
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5900	5,500	5,776	115,605	2027/08/03
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	15,000	15,498	310,192	2024/09/21
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	5,000	5,305	106,188	2028/05/17
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6100	10,000	10,384	207,833	2025/06/07
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5400	4,500	4,730	94,686	2028/08/16
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0800	3,100	3,502	70,093	2048/10/22
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8600	3,300	3,606	72,174	2049/07/22
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7700	11,000	11,461	229,400	2025/03/08

2022年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	6,500	6,577	131,646	2050/03/16
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	5,500	5,550	111,093	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	3,500	3,637	72,806	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	4,000	4,017	80,414	2031/11/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	5,000	4,955	99,174	2027/01/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	7,200	7,164	143,384	2032/02/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	5,000	5,005	100,179	2029/03/24
通貨小計	銘柄数	33銘柄					
	金 額			225,900	231,967	4,642,686	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,311	70,587	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,186	36,241	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,541	47,078	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,281	39,129	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	726	22,174	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,340	40,934	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,836	56,069	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	1,300	1,287	39,325	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,071	32,708	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,747	53,375	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,166	35,621	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,302	1,315	40,162	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	891	27,220	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,550	1,544	47,158	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,550	1,567	47,853	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,175	35,895	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,950	1,945	59,398	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,208	36,905	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,198	36,584	2033/11/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	600	597	18,259	2038/06/08
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	649	19,835	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,610	2,533	77,358	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,179	36,008	2048/07/06
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400	399	12,211	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,187	36,264	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,520	46,436	2040/05/22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	1,950	1,667	50,925	2050/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,800	1,568	47,882	2031/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	500	466	14,259	2032/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	400	390	11,926	2042/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5040	500	504	15,397	2029/04/30
通貨小計	銘柄数	31銘柄					
	金 額			40,255	39,008	1,191,192	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,377	3,569	107,411	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	2,463	74,147	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,870	2,625	79,017	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840	3,524	106,079	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,400	3,024	91,012	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	2,000	1,660	49,976	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,000	1,844	55,509	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	2,200	1,601	48,208	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	861	25,933	2024/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	900	537	16,184	2032/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	500	418	12,591	2027/05/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	749	22,559	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,125	2,042	61,455	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,650	2,806	84,459	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,591	4,029	121,259	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			39,450	31,760	955,807	
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,031	1,140	160,635	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	631	88,861	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	961	985	138,740	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	931	831	117,063	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,047	147,525	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	497	69,994	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	752	105,933	2028/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	750	668	94,117	2033/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	750	700	98,560	2031/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	950	894	125,939	2029/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	700	537	75,672	2050/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	350	270	38,113	2035/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	738	103,991	2027/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	679	95,614	2030/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	-	800	645	90,855	2031/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	400	278	39,218	2041/04/22
	IRISH TREASURY	国債証券	0.3500	100	80	11,382	2032/10/18
国小計	銘柄数	17銘柄					
	金 額			12,353	11,379	1,602,218	

外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15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		
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,139	1,363	191,919	2028/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,755	2,162	304,456	2037/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,729	2,159	304,101	2042/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,468	1,525	214,823	2033/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,399	197,108	2023/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,929	2,175	306,243	2047/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,536	216,353	2024/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,725	242,920	2025/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,938	1,852	260,866	2026/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,094	294,944	2027/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,376	193,839	2024/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,267	178,521	2028/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,070	150,735	2029/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	680	95,800	2040/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,199	168,908	2030/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	740	104,202	2027/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,150	623	87,812	2052/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,089	153,369	2031/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	641	90,339	2038/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	795	111,954	2029/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	94	13,288	2026/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	300	257	36,223	2032/07/15	
国小計	銘柄数	22銘柄						
	金 額			28,548	27,831	3,918,735		
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,699	1,660	233,824	2025/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	1,594	224,553	2031/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	963	135,690	2038/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,863	1,812	255,149	2026/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	982	138,309	2047/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	740	614	86,556	2066/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	940	931	131,191	2023/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,100	1,045	147,244	2027/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,029	144,930	2024/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	580	509	71,686	2057/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	600	516	72,778	2037/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,490	1,395	196,417	2028/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	650	583	82,157	2033/04/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,388	195,482	2029/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	700	553	77,960	2050/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,037	146,026	2030/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	860	583	82,098	2040/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,086	152,994	2027/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	—	1,600	1,292	181,954	2031/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	530	228	32,191	2071/06/22	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	400	327	46,043	2032/06/22	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	600	424	59,815	2053/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,048	288,485	2028/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,904	2,428	341,883	2035/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	1,962	276,312	2041/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,106	155,835	2026/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	895	126,047	2032/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,359	191,351	2023/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	843	989	139,277	2045/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,545	217,572	2024/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	788	111,033	2034/06/22	
国小計	銘柄数	31銘柄						
	金 額			34,826	33,685	4,742,859		
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	3,460	487,239	2025/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	4,062	571,967	2029/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,227	4,242	597,362	2032/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	3,340	470,365	2035/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,764	2,241	315,572	2055/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	2,846	400,843	2038/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	4,997	5,227	735,991	2023/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,664	4,683	659,401	2041/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,717	2,217	312,263	2060/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,646	3,892	548,100	2026/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	5,699	5,950	837,846	2027/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,588	2,861	402,906	2045/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	5,086	5,184	729,929	2024/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,087	5,246	738,718	2030/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,899	4,939	695,511	2024/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,388	477,129	2025/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	4,993	703,095	2025/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,620	5,305	747,038	2031/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,387	4,181	588,744	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	4,169	3,563	501,745	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,387	1,049	147,820	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,050	3,782	532,644	2026/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	2,305	324,566	2039/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,262	459,427	2027/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,550	2,248	316,536	2048/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,400	4,106	578,216	2028/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	3,467	488,241	2034/05/25	

2022年6月15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		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	4,577	644,527	2028/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,333	469,375	2024/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,150	2,443	344,016	2050/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,350	3,922	552,303	2029/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,330	4,152	584,740	2025/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	3,601	507,037	2029/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,770	1,679	236,415	2052/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,820	397,089	2026/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	1,540	216,906	2040/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	3,330	468,897	2030/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	980	395	55,756	2072/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	98	13,829	2024/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	969	136,504	2044/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,600	3,722	524,076	2031/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,100	2,843	400,404	2027/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,300	768	108,240	2053/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	1,271	179,061	2032/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	95	13,508	2025/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	200	166	23,388	2038/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	300	280	39,429	2028/02/25	
国小計	銘柄数	47銘柄						
	金 額			148,961	144,067	20,284,741		
ユーロ（ドイツ）				千ユーロ	千ユーロ			
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,056	148,706	2024/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,447	203,780	2027/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	2,630	370,417	2028/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,124	158,377	2028/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	2,592	365,060	2030/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,048	3,984	561,034	2031/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,305	3,059	430,799	2034/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,571	4,569	643,323	2037/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	1,791	252,208	2039/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,739	2,511	353,574	2040/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,274	2,821	397,323	2042/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	3,172	446,641	2044/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,624	228,748	2023/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,581	222,659	2024/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	3,064	431,539	2046/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,606	226,154	2024/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,042	4,023	566,575	2024/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,149	302,610	2025/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,134	3,099	436,475	2025/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,368	2,291	322,691	2026/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,279	320,894	2026/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,200	3,968	558,716	2027/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,180	307,052	2027/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,770	2,463	346,876	2048/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,790	252,086	2028/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,100	2,858	402,452	2028/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,015	283,715	2029/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,675	376,721	2029/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,250	1,360	191,572	2050/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,546	217,773	2030/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,665	234,515	2035/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,839	258,998	2027/11/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,576	221,965	2030/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,052	148,218	2030/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	781	110,004	2031/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,088	153,312	2036/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,808	254,698	2028/11/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	668	94,101	2050/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,600	3,090	435,136	2031/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	602	84,784	2031/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,273	179,298	2032/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	994	140,019	2023/06/16	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	99	13,951	2023/09/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	580	81,689	2052/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	4,150	584,458	2023/12/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	98	13,836	2024/03/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2000	100	98	13,808	2024/06/14	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,882	265,112	2023/10/13	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,884	265,372	2024/04/05	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,651	232,535	2024/10/18	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,313	325,683	2025/04/11	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,199	309,672	2025/10/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	95	13,489	2025/10/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,083	293,420	2026/04/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,220	171,779	2026/10/09	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	92	13,080	2027/04/16	
国小計	銘柄数	56銘柄						
	金 額			108,055	108,235	15,239,508		
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	3,202	450,972	2029/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	2,021	284,595	2025/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	1,926	271,271	2030/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,193	308,843	2025/10/31	

2022年 6 月15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	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 9500	2, 733	2, 698	379, 984	2026/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 9000	1, 952	1, 794	252, 727	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 4500	1, 550	1, 452	204, 543	2066/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 3000	2, 630	2, 517	354, 488	2026/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	1, 900	1, 817	255, 842	2027/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 3500	1, 750	1, 627	229, 208	2033/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4500	2, 050	1, 940	273, 163	2027/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4000	2, 400	2, 248	316, 573	2028/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7000	1, 500	1, 314	185, 114	2048/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 3500	2, 400	2, 384	335, 737	2023/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4000	2, 900	2, 706	381, 142	2028/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4500	1, 600	1, 480	208, 453	2029/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 8500	1, 850	1, 579	222, 387	2035/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	2, 300	2, 228	313, 771	2024/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 6000	2, 800	2, 410	339, 428	2029/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 5000	1, 360	1, 145	161, 248	2030/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2, 500	2, 375	334, 505	2025/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 0000	1, 400	784	110, 464	2050/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 8000	2, 400	2, 206	310, 616	2027/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2500	2, 400	2, 119	298, 420	2030/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2000	1, 300	914	128, 715	2040/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	460	64, 850	2026/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 1000	2, 200	1, 722	242, 551	2031/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	290	40, 897	2024/05/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4500	650	323	45, 492	2071/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	433	61, 019	2028/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 8500	900	636	89, 583	2037/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 5000	1, 900	1, 518	213, 743	2031/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 0000	600	394	55, 592	2042/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	803	113, 100	2027/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 7000	2, 100	1, 682	236, 863	2032/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 9000	600	415	58, 447	2052/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	93	13, 232	2025/05/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 8000	100	87	12, 333	2029/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 7500	2, 179	2, 706	381, 028	2032/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 2000	2, 254	2, 514	353, 999	2037/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 9000	2, 158	2, 637	371, 406	2040/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 8000	1, 682	1, 772	249, 569	2024/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 7000	1, 973	2, 361	332, 455	2041/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 6500	2, 789	3, 001	422, 575	2025/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 9000	1, 965	2, 242	315, 785	2026/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 4000	1, 901	1, 981	279, 047	2023/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 1500	1, 770	2, 030	285, 937	2028/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 1500	1, 299	1, 669	235, 010	2044/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 8000	1, 970	2, 049	288, 587	2024/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	2, 097	2, 143	301, 844	2024/10/31
国小計	銘柄数	50銘柄						
	金 額				88, 003	85, 065	11, 977, 175	
ユーロ (イタリア)		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9. 0000	906	995	140, 129	2023/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7. 2500	1, 110	1, 296	182, 531	2026/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6. 5000	2, 392	2, 762	388, 898	2027/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 5000	1, 814	1, 806	254, 420	2024/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 2500	1, 509	1, 302	183, 340	2046/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	2, 487	2, 390	336, 572	2025/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 6500	2, 065	1, 677	236, 151	2032/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0000	2, 891	2, 794	393, 502	2025/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7000	1, 610	1, 250	176, 057	2047/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 6000	2, 386	2, 250	316, 900	2026/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	2, 324	1, 852	260, 885	2036/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2500	1, 068	980	138, 042	2026/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 6500	1, 550	1, 529	215, 339	2023/10/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 8000	968	704	99, 178	2067/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 4500	1, 500	1, 277	179, 900	2033/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2000	1, 510	1, 431	201, 573	2027/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 8500	1, 300	1, 289	181, 528	2024/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 4500	1, 850	1, 636	230, 399	2048/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0500	2, 700	2, 529	356, 084	2027/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4500	1, 600	1, 553	218, 701	2024/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 9500	1, 300	1, 114	156, 967	2038/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0000	2, 100	1, 946	274, 048	2028/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4500	1, 300	1, 248	175, 723	2025/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 8000	2, 550	2, 436	343, 019	2028/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 4500	2, 200	2, 221	312, 721	2023/10/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 5000	1, 550	1, 525	214, 721	2025/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 3500	1, 270	1, 169	164, 643	2035/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 8500	1, 650	1, 551	218, 420	2049/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 0000	1, 900	1, 815	255, 690	2029/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 7500	2, 200	2, 170	305, 621	2024/07/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 1000	2, 100	2, 012	283, 364	2026/07/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 1000	1, 250	1, 077	151, 745	2040/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 3500	1, 900	1, 585	223, 282	2030/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 3500	1, 300	1, 222	172, 066	2025/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 8500	2, 350	2, 107	296, 776	2027/01/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 4500	1, 550	1, 103	155, 341	2050/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4500	1, 500	1, 081	152, 235	2036/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 6000	2, 000	1, 987	279, 797	2023/06/15

2022年6月15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	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,300	2,226	313,425	2025/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	1,591	224,024	2030/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,100	1,758	247,528	2030/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3000	1,300	1,282	180,634	2023/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,200	1,940	273,270	2027/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,549	218,169	2026/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,500	1,037	146,097	2041/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,900	1,470	207,057	2031/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,065	150,041	2024/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	1,200	705	99,309	2051/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	700	456	64,223	2037/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,580	222,488	2028/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,300	1,705	240,130	2031/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	700	430	60,573	2045/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	975	137,336	2026/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,439	202,656	2024/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	460	274	38,713	2072/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	667	93,967	2028/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,443	203,202	2031/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	948	133,493	2024/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,160	163,438	2024/01/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	963	135,611	2026/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,700	1,270	178,861	2032/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	900	728	102,608	2029/02/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	280	39,455	2024/12/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	600	385	54,333	2052/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	194	27,384	2023/11/29
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1000	300	269	37,972	2027/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	500	472	66,523	2025/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	800	751	105,851	2029/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	300	258	36,357	2032/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	300	266	37,474	2038/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	3,254	3,588	505,321	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	3,292	463,604	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,058	289,861	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	2,488	350,374	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	2,698	379,920	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	2,245	316,140	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,332	328,464	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,243	315,835	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	2,464	347,013	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,175	306,244	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	2,567	361,472	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	1,957	275,610	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,283	321,583	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,260	318,215	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,318	2,283	321,550	2030/03/01
国小計	銘柄数	85銘柄					
	金 額			139,978	131,177	18,469,760	
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	323	45,555	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	272	38,402	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	775	109,173	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	700	693	97,603	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	293	41,298	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	746	105,075	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	670	585	82,474	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	456	64,297	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	448	63,126	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	194	27,373	2024/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	227	32,087	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	271	38,295	2040/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	500	419	59,083	2030/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	209	29,479	2052/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	496	69,922	2031/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	185	26,131	2026/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	169	23,817	2043/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	717	100,967	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	407	57,360	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	415	58,565	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	537	75,680	2024/04/15
国小計	銘柄数	21銘柄					
	金 額			9,836	8,847	1,245,772	
ユーロ (オーストリア)				千ユーロ	千ユーロ		
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	1,373	1,357	191,195	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,079	152,045	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	655	92,310	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	159	22,470	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	—	900	892	125,672	2023/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,203	169,484	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	590	478	67,305	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	1,124	158,362	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	980	885	124,723	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,300	1,268	178,542	2024/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	—	980	832	117,217	2030/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	459	64,637	2051/03/20

2022年6月15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	
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	254	35,840	2040/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.8500	350	142	20,051	2120/06/30
		Austria Government Bond	国債証券	—	1,200	990	139,429	2031/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	480	460	64,829	2025/04/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	441	62,186	2036/10/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	300	149	21,003	2071/04/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	263	37,138	2028/10/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	500	439	61,818	2032/02/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	265	37,436	2049/05/23
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,006	141,665	2027/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,373	1,668	234,922	2037/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	981	138,130	2026/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	445	62,666	2062/01/26
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	723	820	115,515	2044/06/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	970	136,605	2023/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	775	109,259	2034/05/23
		Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	940	132,439	2024/10/21
国小計	銘柄数	29銘柄						
	金 額				22,679	21,412	3,014,908	
通貨小計	銘柄数	358銘柄						
	金 額				593,239	571,702	80,495,680	
合 計	銘柄数	893銘柄						
	金 額						230,597,354	

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第22期 (決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日)

外国債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

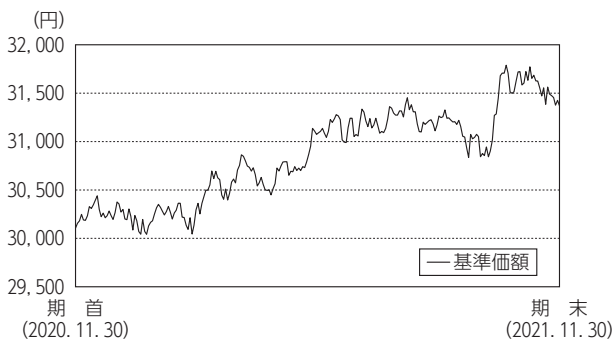
運用方針	投資成果をFTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の公社債
株式組入制限	純資産総額の30%以下

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：30,106円 期末：31,370円 騰落率：4.2%

【基準価額の主な変動要因】

日本を除く先進国国債に主に投資した結果、債券市場で金利は上昇（債券価格は下落）したものの、為替相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了。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。

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 組入比率	
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率	%	%
(期首) 2020年11月30日	30,106	—	30,435	—	98.5	—
12月末	30,356	0.8	30,690	0.8	98.5	—
2021年 1 月末	30,316	0.7	30,621	0.6	98.2	—
2 月末	30,045	△ 0.2	30,493	0.2	98.5	—
3 月末	30,706	2.0	30,924	1.6	98.4	—
4 月末	30,696	2.0	31,035	2.0	98.5	—
5 月末	31,109	3.3	31,499	3.5	98.8	—
6 月末	31,058	3.2	31,389	3.1	98.6	—
7 月末	31,273	3.9	31,662	4.0	98.7	—
8 月末	31,264	3.8	31,613	3.9	98.3	—
9 月末	31,051	3.1	31,407	3.2	98.4	—
10 月末	31,722	5.4	31,985	5.1	98.4	—
(期末) 2021年11月30日	31,370	4.2	31,642	4.0	98.6	—

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の原データをもとに、当ファンドの設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

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

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

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

■ 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
外 国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 290, 158	千アメリカ・ドル 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 (—)
	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 — (—)

■ 主要な売買銘柄
公 社 債

(2020年12月 1 日から2021年11月30日まで)

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

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

(注 1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。
(注 2) () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注 3) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

作 成 期		当 期			末			
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちB B 格 以下組入 比	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5 年以上	2 年以上	2 年未満
アメリカ	千アメリカ・ドル 922, 829	千アメリカ・ドル 955, 962	千円 108, 759, 849	% 46. 6	% —	% 21. 2	% 16. 7	% 8. 6
カナダ	千カナダ・ドル 48, 671	千カナダ・ドル 50, 556	4, 512, 686	1. 9	—	0. 9	0. 6	0. 4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 46, 852	千オーストラリア・ドル 49, 050	3, 987, 292	1. 7	—	1. 2	0. 4	0. 1
シンガポール	千シンガポール・ドル 10, 980	千シンガポール・ドル 11, 571	962, 856	0. 4	—	0. 3	0. 1	0. 0
イギリス	千イギリス・ポンド 73, 322	千イギリス・ポンド 93, 472	14, 166, 718	6. 1	—	4. 8	0. 8	0. 5
イスラエル	千イスラエル・シケル 27, 300	千イスラエル・シケル 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, 134	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
ユ ー ロ 区 域	アイルランド	千ユーロ 12, 877	千ユーロ 14, 293	1, 835, 439	0. 8	—	0. 6	0. 2
	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
	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
	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
	ドイツ	千ユーロ 110, 312	千ユーロ 130, 913	16, 810, 567	7. 2	—	4. 6	1. 7
	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
	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
	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
	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
	小計	603, 330	704, 049	90, 406, 985	38. 7	—	25. 0	9. 7
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			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	
アメリカ			%	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

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	末 評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
						千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	%	1,060	1,500	170,708	2039/08/15
	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	2044/08/15
	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	2044/11/15
	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
	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

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	
					千アメリカ・ドル	千円	
	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
	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
	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

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. 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
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 2500	4, 000	3, 968	451, 484	2028/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0. 7500	3, 000	2, 949	335, 589	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0. 2500	2, 000	1, 977	224, 987	2024/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0. 1250	1, 500	1, 494	170, 008	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 2500	5, 000	4, 955	563, 827	2028/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0. 8750	5, 000	4, 939	562, 001	2026/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 3750	5, 500	5, 450	620, 134	2024/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 3750	3, 000	2, 971	338, 040	2024/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1. 2500	9, 300	9, 076	1, 032, 635	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2. 0000	6, 900	7, 083	805, 862	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1. 7500	3, 000	2, 901	330, 135	2041/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 1250	2, 500	2, 488	283, 102	2023/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 6250	6, 000	5, 855	666, 162	2026/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1. 0000	5, 000	4, 871	554, 270	2028/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 1250	3, 000	2, 984	339, 548	2023/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1. 1250	5, 000	4, 908	558, 405	2028/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 7500	5, 000	4, 904	557, 979	2026/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 3750	7, 500	7, 421	844, 375	2024/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1. 2500	7, 000	6, 926	788, 051	2028/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 8750	3, 500	3, 451	392, 640	2026/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 2500	1, 500	1, 494	170, 061	2023/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0. 6250	2, 000	1, 991	226, 570	2024/10/15
通貨小計	銘柄数	255銘柄					
	金 額			922, 829	955, 962	108, 759, 849	
千カナダ・ドル							
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2. 7500	405	487	43, 542	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 7500	983	1, 280	114, 286	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 7500	1, 117	1, 581	141, 163	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 0000	1, 012	1, 444	128, 961	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 0000	913	1, 226	109, 472	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 5000	961	1, 251	111, 737	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	1, 253	1, 265	112, 953	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 5000	1, 405	1, 454	129, 802	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	1, 337	1, 566	139, 843	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	1, 156	1, 196	106, 802	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	969	974	87, 022	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 0000	1, 240	1, 211	108, 142	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0000	650	671	59, 960	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 7500	4, 300	4, 352	388, 485	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0000	1, 300	1, 324	118, 226	2023/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0000	3, 710	3, 760	335, 701	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	1, 220	1, 287	114, 949	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	1, 200	1, 232	110, 024	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	1, 400	1, 414	126, 263	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2500	3, 450	3, 377	301, 477	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2500	700	701	62, 587	2025/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 5000	2, 890	2, 806	250, 511	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	700	697	62, 243	2022/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 5000	2, 000	1, 820	162, 510	2030/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	2, 100	2, 004	178, 924	2026/03/01

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	末 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	0.2500	1,200	1,177	105,147	2024/04/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,491	133,114	2023/02/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,100	1,091	97,400	2023/05/01
		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		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		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
		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	19銘柄						
	金 額				10,980	11,571	962,856	
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	921	971	147,252	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,682	2,767	419,439	2065/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,528	231,649	2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,940	2,161	327,604	2047/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,350	2,596	393,488	2037/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,810	2,303	349,090	2057/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,410	1,461	221,510	2027/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	3,000	3,017	457,376	2023/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,500	1,599	242,424	2028/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	940	1,325	200,886	2071/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	1,800	1,824	276,553	2024/04/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,210	1,435	217,549	2049/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	1,018	154,341	2054/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	800	809	122,721	2029/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,900	1,910	289,593	2025/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,190	1,232	186,728	2041/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	2,300	2,294	347,765	2023/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	2,300	2,219	336,418	2030/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	750	679	102,953	2061/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,474	223,457	2026/01/30

		当		期		末		
区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 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	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
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,416	4,009	607,628	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,600	2,155	326,678	2030/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	2,427	367,948	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	2,207	334,626	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,560	2,224	337,187	2034/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,174	2,403	364,198	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,454	372,045	2040/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	2,714	411,397	2052/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,166	3,124	473,503	2044/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,582	1,632	247,411	2023/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,386	2,889	437,971	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,092	1,160	175,847	2024/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,724	2,607	395,192	2045/01/22	
通貨小計	銘柄数 金 額	54銘柄			73,322	93,472	14,166,718	
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	2,000	2,567	92,447	2026/10/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	4.2500	1,800	1,901	68,481	2023/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,900	3,080	110,934	2042/01/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,000	2,168	78,085	2024/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,422	87,223	2025/08/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,941	69,928	2027/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.2500	1,000	1,012	36,478	2022/11/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,400	3,166	114,016	2047/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,800	1,987	71,563	2028/09/28	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,500	1,541	55,502	2023/11/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	2,400	2,413	86,922	2030/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.5000	1,600	1,611	58,044	2025/04/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,700	1,660	59,799	2037/05/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.1500	2,000	2,002	72,120	2023/07/31	
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.5000	200	200	7,234	2026/02/27	
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.4000	900	905	32,594	2024/10/31		
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄			27,300	30,584	1,101,379	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	13,662	24,709	426,740	2039/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,053	87,265	2023/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	6,555	113,207	2025/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	7,900	8,302	143,377	2027/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	9,590	10,134	175,029	2029/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,300	4,338	74,924	2022/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,700	2,714	46,877	2052/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	502	8,681	2031/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,016	17,561	2024/11/15	
	通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄			50,511	63,327	1,093,665
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	8,204	8,311	104,811	2023/05/24	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,254	53,647	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	5,395	5,457	68,817	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,340	4,347	54,826	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,450	4,505	56,810	2027/02/17	
	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	4,655	7,006	87,785	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	8,025	8,305	104,072	2023/11/13	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,595	8,291	103,894	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	7,537	94,447	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,050	5,268	66,008	2028/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,300	3,991	50,009	2032/06/10	

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	
						千スウェーデン・クローネ	千円	
		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	8銘柄						
	金 額				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 31,290	千メキシコ・ペソ 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	14銘柄						
	金 額				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 3,000	千オフショア・人民元 3,163	56,409	2051/04/12
		China Government Bond	国債証券	3.0200	3,800	3,851	68,676	2031/05/27
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,504	80,324	2026/08/12
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5700	10,000	10,019	178,641	2023/05/20
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	5,500	5,517	98,385	2028/10/14
通貨小計	銘柄数	5銘柄						
	金 額				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 2,373	千マレーシア・リンギット 2,401	64,488	2027/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,253	33,667	2030/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,595	42,836	2026/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,362	36,593	2031/06/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	754	20,265	2027/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	1,016	27,294	2023/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,432	38,470	2033/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,920	51,578	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	800	864	23,208	2043/09/30
		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	30銘柄						
	金 額				38,656	39,646	1,064,579	
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 4,259	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	14銘柄						
	金 額				41,500	40,366	1,108,694	
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 1,235	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

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	末 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	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
		IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	350	351	45,186	2035/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	822	105,623	2027/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	811	104,176	2030/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	—	800	786	100,959	2031/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	400	398	51,181	2041/04/22
国 小 計	銘柄数	17銘柄						
	金 額				12,877	14,293	1,835,439	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (オランダ)		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	548	599	77,044	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,139	1,562	200,633	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,555	2,507	322,002	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	832	106,904	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,729	3,023	388,241	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,509	193,881	2033/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,443	185,388	2023/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,929	3,226	414,283	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,624	208,663	2024/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,850	237,606	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,938	2,038	261,732	2026/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,358	302,836	2027/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,422	182,675	2024/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,457	187,112	2028/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,253	160,990	2029/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	980	125,867	2040/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,431	183,793	2030/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	821	105,480	2027/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,050	1,002	128,710	2052/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,322	169,772	2031/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	892	114,575	2038/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	600	613	78,837	2029/01/15
国 小 計	銘柄数	22銘柄						
	金 額				28,587	33,774	4,337,032	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (ベルギー)		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,699	1,786	229,408	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	1,952	250,677	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	1,311	168,357	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,863	1,995	256,184	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	1,506	193,426	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	640	935	120,071	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	940	957	122,930	2023/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,100	1,176	151,113	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,087	139,634	2024/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	580	831	106,772	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	600	696	89,412	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,490	1,603	205,858	2028/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	650	737	94,713	2033/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,630	209,372	2029/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	700	870	111,814	2050/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,244	159,807	2030/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	660	644	82,824	2040/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,228	157,777	2027/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,600	1,594	204,704	2031/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	680	596	76,655	2071/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,357	302,698	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,904	3,103	398,469	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	2,705	347,415	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,226	157,496	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	1,103	141,758	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,401	180,020	2023/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	843	1,424	182,883	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,634	209,938	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	1,009	129,595	2034/06/22
国 小 計	銘柄数	29銘柄						
	金 額				33,676	40,353	5,181,793	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (フランス)		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	1,985	2,243	288,101	2023/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	3,815	489,959	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	4,758	611,022	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,227	5,242	673,220	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	4,263	547,451	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,764	3,453	443,514	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	3,808	489,063	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	4,997	5,478	703,469	2023/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,664	6,425	825,044	2041/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,717	3,534	453,888	2060/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,646	4,298	551,978	2026/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	5,699	6,777	870,339	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,588	4,121	529,197	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,047	4,198	539,137	2023/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	5,086	5,462	701,487	2024/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,087	6,243	801,757	2030/05/25

区 分		当 期			末		
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,899	5,255	674,877
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,627	465,850
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	5,421	696,207
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,420	6,210	797,553
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,787	3,959	508,487
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	4,169	4,724	606,616
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,387	1,838	236,106
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,050	4,196	538,912
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	3,182	408,649
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,668	471,041
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,850	3,790	486,690
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,424	311,339
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,400	4,709	604,712
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	4,454	571,986
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	5,307	681,572
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,456	443,789
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,950	3,556	456,741
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,350	4,586	588,892
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,830	3,909	501,995
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	4,253	546,219
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,424	311,272
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,770	2,769	355,592
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,067	393,859
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	2,203	282,976
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	4,024	516,788
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	880	731	93,876
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	13,041
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	985	126,557
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,700	3,684	473,140
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	1,634	209,920
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	700	693	89,060
国 小 計	銘柄数 金 額	47銘柄			152,793	178,981	22,982,963
ユーロ（ドイツ）					千ユーロ	千ユーロ	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,120	143,912
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,646	211,378
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	3,008	386,344
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,293	166,104
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	3,049	391,545
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,448	5,369	689,555
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,305	3,819	490,479
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,571	5,918	759,935
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	2,394	307,518
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,739	3,384	434,580
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,574	4,431	569,108
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	4,525	581,099
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,450	186,220
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,879	241,377
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,677	215,388
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,650	211,915
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	4,435	569,540
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,684	216,368
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,042	4,239	544,336
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,283	293,243
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,134	3,336	428,490
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,368	2,488	319,591
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,497	320,721
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,200	4,393	564,217
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,446	314,171
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,770	3,738	480,064
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	2,028	260,437
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,100	3,267	419,519
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,323	298,378
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,112	399,626
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,250	2,261	290,335
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,815	233,135
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,946	249,971
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,070	265,826
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,867	239,805
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,251	160,705
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	931	119,606
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	917	117,819
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,553	199,510
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,118	143,566
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,600	2,682	344,469
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	724	93,011
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	12,947
		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

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	—	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	56銘柄					
	金 額				110,312	130,913	16,810,567
					千ユーロ	千ユーロ	
ユーロ（スペイン）		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	3,792	486,939
		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
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	2,254	3,384	434,594
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	2,158	3,666	470,871
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	1,881	241,646
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,973	3,321	426,539
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,789	3,311	425,203
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,537	325,845
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	1,958	2,096	269,174
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	2,087	268,044
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,397	307,867
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	2,399	308,119
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,180	280,009
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,300	295,387
国 小 計	銘柄数	49銘柄					
	金 額				90,321	105,873	13,595,192
					千ユーロ	千ユーロ	
ユーロ（イタリア）		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	906	1,069	137,360
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,495	192,048
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,248	417,195
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,957	251,402
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	1,968	252,752
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,621	336,690
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	2,198	282,349
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,891	2,040	261,957
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	1,923	246,936
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,359	1,384	177,746
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,386	2,543	326,595
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	2,617	336,145
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	1,123	144,280
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	1,550	1,580	203,010
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	1,112	142,796

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

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
		Finland Government Bond	国債証券	—	500	506	64,988
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	371	47,674
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	610	78,380
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	204	26,301
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	781	100,334
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	470	60,445
		Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	460	59,108
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	603	77,514
		Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	564	72,448
国 小 計	銘柄数	21銘柄					
	金 額				10,032	10,846	1,392,797
ユーロ (オーストリア)					千ユーロ	千ユーロ	
		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	1,373	1,471	188,907
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,196	153,672
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	988	126,904
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	325	41,782
		Austria Government Bond	国債証券	—	900	911	117,017
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,347	172,977
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	894	114,873
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	1,283	164,849
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	980	1,033	132,720
		Austria Government Bond	国債証券	—	800	814	104,592
		Austria Government Bond	国債証券	—	980	991	127,339
		Austria Government Bond	国債証券	—	1,000	1,009	129,692
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	747	96,037
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	374	48,070
		Austria Government Bond	国債証券	0.8500	350	328	42,241
		Austria Government Bond	国債証券	—	1,200	1,206	154,959
		Austria Government Bond	国債証券	—	480	489	62,891
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	599	76,933
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,144	146,949
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,373	2,201	282,667
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,082	138,967
		Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	906	116,455
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	723	92,859
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	1,008	129,455
		Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,005	129,096
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	992	127,477
		Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	996	127,958
国 小 計	銘柄数	27銘柄					
	金 額				22,501	26,075	3,348,351
通貨小計		349銘柄					
					603,330	704,049	90,406,985
合 計	銘柄数	846銘柄					
	金 額					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・シェケル＝36.011円、1デンマーク・クローネ＝17.27円、1ノルウェー・クローネ＝12.61円、1スウェーデン・クローネ＝12.53円、1メキシコ・ペソ＝5.252円、1オフショア・人民元＝17.83円、1マレーシア・リンギット＝26.851円、1ポーランド・ズロチ＝27.465円、1ユーロ＝128.41円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産 (232,057,536千円) の投資信託財産総額 (233,916,004千円) に対する比率は、99.2% です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

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

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

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワ外国債券インデックスVA	498,388,691円
ダイワ国内重視/バランスファンド30VA（一般投資家私募）	10,756,510円
ダイワ国内重視/バランスファンド50VA（一般投資家私募）	79,498,163円
ダイワ国際分散/バランスファンド30VA（一般投資家私募）	22,023,940円
ダイワ国際分散/バランスファンド50VA（一般投資家私募）	312,397,465円
外国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	211,430,078円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	505,972,682円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	2,311,980,333円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	842,742,592円
D－I's 外国債券インデックス	744,003円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	7,190,607円
iFree 外国債券インデックス	1,686,822,876円
iFree 8資産バランス	1,443,360,479円
iFree 年金バランス	229,923,693円
DCダイワ外国債券インデックス	49,590,694,433円
ダイワ・ライフ・バランス30	964,870,268円
ダイワ・ライフ・バランス50	601,682,079円
ダイワ・ライフ・バランス70	393,993,399円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	578,219,728円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	439,097,748円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	160,496,213円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	28,543,954円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	10,558,255円
ダイワつみたてインデックス外国債券	599,439,774円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,367,466円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,453,811円
ダイワつみたてインデックスバランス70	1,909,053円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	317,987円
ダイワ世界/バランスファンド40VA	163,610,849円
ダイワ世界/バランスファンド60VA	135,308,646円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,912,241,392円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	231,133,046円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	143,219,876円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	43,309,779円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	2,367,106,464円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,825,688,039円
ダイワライフスタイル25	33,014,942円
ダイワライフスタイル50	65,372,616円
ダイワライフスタイル75	17,425,714円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は31,370円です。

■損益の状況

当期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日

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

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

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

ダイワファンドラップ 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)

運用報告書(全体版)

第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券		
信託期間	無期限（設定日：2016年 9月26日）		
運用方針	海外の債券市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。		
主要投資 対 象	ベビーファンド	イ．外国債券インデックスマ ザーファンドの受益証券 ロ．ダイワ新興国債券イン デックス・マザーファンド の受益証券	
	外 国 債 券 インデックス マザーファンド	外国の公社債	
	ダイワ新興国債券 インデックス・ マザーファンド	新興国通貨建ての債券	
組入制限	ベビーファンドの マザーファンド組入上限比率	無制限	
	外国債券インデックスマザー ファンドの株式組入上限比率	純資産総額の30%以下	
	ダイワ新興国債券インデックス・ マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売 買益（評価益を含みます。）等とし、原則とし て、信託財産の成長に資することを目的に、 配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案 して分配金額を決定します。ただし、配当等 収益が少額の場合には、分配を行なわないこ とがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2733>

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			公 社 債 組入比率	債 券 先物比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率			
	円	円	%	%	%	百万円
2 期末 (2018年 6 月15日)	10,746	0	△ 0.0	98.1	—	1,195
3 期末 (2019年 6 月17日)	11,026	0	2.6	98.0	—	1,344
4 期末 (2020年 6 月15日)	11,508	0	4.4	97.8	—	1,706
5 期末 (2021年 6 月15日)	12,204	0	6.0	98.3	—	1,952
6 期末 (2022年 6 月15日)	11,993	0	△ 1.7	98.1	—	2,294

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

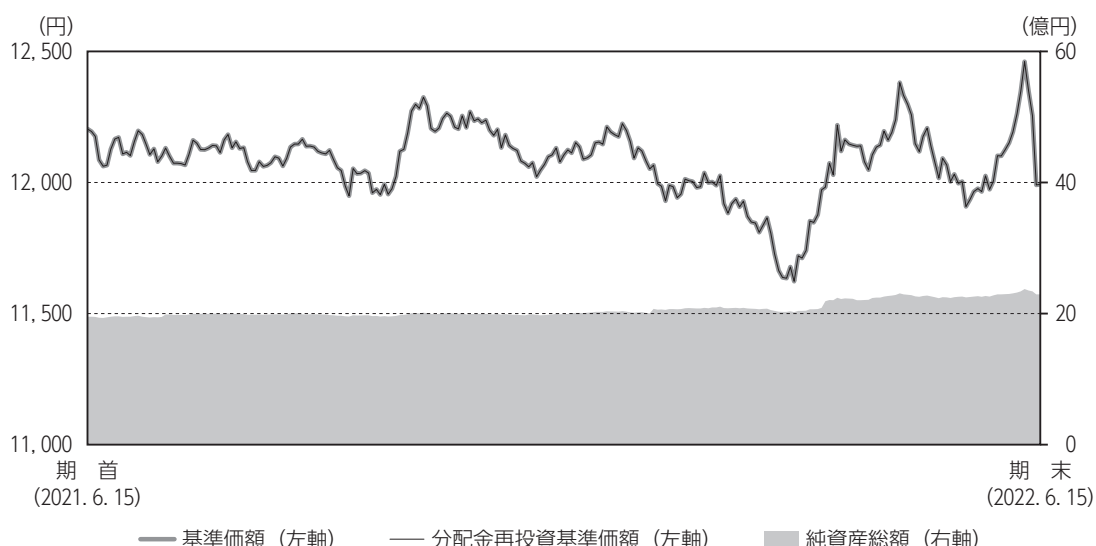
(注4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

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



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

■基準価額・騰落率

期 首：12,204円

期 末：11,993円（分配金 0 円）

騰落率：△1.7%（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	△0.9%	79.7%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	△3.2%	20.0%

■基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて、主に海外の債券に投資した結果、為替相場で円安が進んだものの、債券市場で金利が上昇（債券価格は下落）したことから、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
(期首) 2021年 6月15日	円 12,204	% —	% 98.3	% —
6 月末	12,103	△ 0.8	97.9	—
7 月末	12,131	△ 0.6	98.0	—
8 月末	12,135	△ 0.6	97.7	—
9 月末	12,036	△ 1.4	97.8	—
10月末	12,253	0.4	97.8	—
11月末	12,060	△ 1.2	97.8	—
12月末	12,182	△ 0.2	98.1	—
2022年 1 月末	12,007	△ 1.6	98.0	—
2 月末	11,810	△ 3.2	98.3	—
3 月末	12,163	△ 0.3	97.9	—
4 月末	12,176	△ 0.2	97.8	—
5 月末	12,102	△ 0.8	97.6	—
(期末) 2022年 6月15日	11,993	△ 1.7	98.1	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■海外債券市況

海外債券市場では、金利は上昇しました。

当作成期首より、主要国の国債金利は、米国など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低下しましたが、2021年9月に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、上昇に転じました。2022年に入ってから、ロシアがウクライナに侵攻したことで原油価格が高騰し、インフレ期待が上昇したことで、金利上昇が加速しました。その後も、インフレ率の上振れなどから各国で金融政策正常化が意識され、主要国の金利は上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに金利は上昇しました。

新興国でも、米国の金利が上昇したことや多くの国で利上げが行われたことなどから、先進国と同様に金利は上昇しました。

■為替相場

為替相場は円安となりました。

当作成期首より、米ドル円は比較的狭いレンジでの推移となりましたが、2021年9月以降は米国金利が上がったことにより上昇（円安）しました。その後2022年に入っても、期待インフレ率の上昇により米国金利がさらに上がったため、米ドル円も上げ幅を拡大しました。また、世界的に利上げ観測が高まっている一方で、日本の金融政策が相対的に緩和的であることなどから、その他の通貨も対円で上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに円安が進みました。

新興国でも、多くの国で利上げが行われたことなどから、多くの通貨は対円で上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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6月16日 ～2022年6月15日
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	1,992

- （注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	52円	0. 429%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12, 082円です。
(投 信 会 社)	(36)	(0. 297)	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)	(13)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	5	0. 039	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. 026)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0. 008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(1)	(0. 005)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	57	0. 468	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

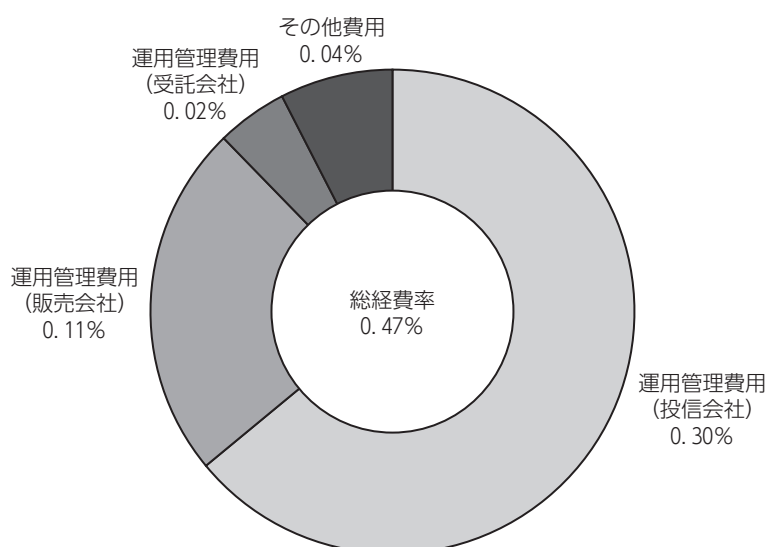
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.47%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6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	95, 851	135, 624	38, 393	55, 465
外国債券インデックスマザーファンド	127, 742	398, 825	35, 871	112, 094

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	262, 791	320, 250	458, 470
外国債券インデックスマザーファンド	498, 273	590, 145	1, 829, 156

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	458, 470	19. 9
外国債券インデックスマザーファンド	1, 829, 156	79. 6
コール・ローン等、その他	11, 666	0. 5
投資信託財産総額	2, 299, 293	100. 0

- (注1) 評価額の単位未満は切捨て。
- (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝135.01円、1カナダ・ドル＝104.20円、1オーストラリア・ドル＝93.10円、1シンガポール・ドル＝96.95円、1イギリス・ポンド＝162.21円、1エジプト・ポンド＝7.204円、1イスラエル・シェケル＝38.942円、1トルコ・リラ＝7.825円、1デンマーク・クローネ＝18.93円、1ノルウェー・クローネ＝13.49円、1スウェーデン・クローネ＝13.25円、1メキシコ・ペソ＝6.565円、1フィリピン・ペソ＝2.535円、1アルゼンチン・ペソ＝1.101円、100チリ・ペソ＝15.542円、100コロンビア・ペソ＝3.401円、100インドネシア・ルピア＝0.92円、1ブラジル・レアル＝26.374円、1チエコ・コルナ＝5.692円、1ルーマニア・レイ＝28.483円、1オフショア・人民元＝20.014円、1マレーシア・リンギット＝30.536円、1南アフリカ・ランド＝8.42円、1タイ・バーツ＝3.85円、1ペルー・ソル＝35.932円、1ポーランド・ズロチ＝30.093円、100ハンガリー・フォリント＝35.115円、1ウルグアイ・ペソ＝3.368円、1ドミニカ・ペソ＝2.458円、1ユーロ＝140.80円です。
- (注3) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(24,791,417千円)の投資信託財産総額(25,007,878千円)に対する比率は、99.1%です。
外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(232,842,571千円)の投資信託財産総額(233,898,338千円)に対する比率は、99.5%です。

★「外国債券インデックスマザーファンド」の第22期にかかる運用状況については212～226ページをご参照ください。

＜補足情報＞

当ファンド（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））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6月15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。199～211ページをご参照ください。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2, 299, 293, 448円
コール・ローン等	11, 666, 767
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（評価額）	458, 470, 137
外国債券インデックスマザーファンド（評価額）	1, 829, 156, 544
(B) 負債	4, 683, 299
未払信託報酬	4, 595, 021
その他未払費用	88, 278
(C) 純資産総額（A－B）	2, 294, 610, 149
元本	1, 913, 328, 634
次期繰越損益金	381, 281, 515
(D) 受益権総口数	1, 913, 328, 634口
1万口当り基準価額（C／D）	11, 993円

- * 期首における元本額は1,600,235,730円、当作成期間中における追加設定元本額は483,164,155円、同解約元本額は170,071,251円です。
- * 当期末の計算口数当りの純資産額は11,993円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1, 764円
受取利息	90
支払利息	△ 1, 854
(B) 有価証券売買損益	△ 24, 886, 645
売買益	1, 830, 076
売買損	△ 26, 716, 721
(C) 信託報酬等	△ 9, 024, 269
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 33, 912, 678
(E) 前期繰越損益金	152, 810, 001
(F) 追加信託差損益金	262, 384, 192
(配当等相当額)	(114, 551, 325)
(売買損益相当額)	(147, 832, 867)
(G) 合計（D＋E＋F）	381, 281, 515
次期繰越損益金（G）	381, 281, 515
追加信託差損益金	262, 384, 192
(配当等相当額)	(114, 551, 325)
(売買損益相当額)	(147, 832, 867)
分配準備積立金	152, 811, 045
繰越損益金	△ 33, 913, 722

- (注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
- (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
- (注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程（総額）」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	228, 473, 278
(d) 分配準備積立金	152, 811, 045
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	381, 284, 323
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	381, 284, 323
(h) 受益権総口数	1, 913, 328, 634口

<補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の決算日（2021年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 10.5% 2026/12/21	151,198	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2022/7/1	209,806
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2023/7/1	149,929	Mexican Bonos (メキシコ) 6.5% 2022/6/9	176,262
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	140,106	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	132,848
Poland Government Bond (ポーランド) 0.25% 2026/10/25	132,125	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	111,695
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8.75% 2048/2/28	121,388	Poland Government Bond (ポーランド) 5.75% 2022/9/23	105,665
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8% 2030/1/31	109,977	Colombian TES (コロンビア) 7% 2022/5/4	104,290
THAILAND GOVERNMENT BOND (タイ) 1% 2027/6/17	109,478	Malaysia Government Investment Issue (マレーシア) 3.948% 2022/4/14	94,312
Mexican Bonos (メキシコ) 7.75% 2031/5/29	108,788	Poland Government Bond (ポーランド) 2.25% 2022/4/25	93,023
Mexican Bonos (メキシコ) 8% 2024/9/5	108,238	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 7% 2022/5/15	90,178
RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ (ロシア) 6.9% 2031/7/23	106,642	Mexican Bonos (メキシコ) 8.5% 2029/5/31	76,819

(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6月15日現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（17,421,108千円）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

2022年6月15日現在								
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちB B格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
		千円	千円	%	%	%	%	%
エジプト	千エジプト・ポンド 52,500	千エジプト・ポンド 50,439	363,373	1.5	1.5	0.5	1.0	—
トルコ	千トルコ・リラ 37,720	千トルコ・リラ 30,070	235,307	0.9	0.9	0.3	0.4	0.3
メキシコ	千メキシコ・ペソ 387,850	千メキシコ・ペソ 360,645	2,367,817	9.5	—	4.2	4.1	1.2
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 9,982	25,310	0.1	—	0.1	—	—
チリ	千チリ・ペソ 3,815,000	千チリ・ペソ 3,432,312	533,460	2.1	—	1.2	0.8	0.2
コロンビア	千コロンビア・ペソ 39,925,000	千コロンビア・ペソ 31,618,206	1,075,588	4.3	—	2.9	1.4	0.0
インドネシア	千インドネシア・ルピア 272,429,000	千インドネシア・ルピア 275,798,470	2,537,345	10.2	—	6.4	2.5	1.2
ブラジル	千ブラジル・レアル 103,950	千ブラジル・レアル 89,775	2,367,787	9.5	—	1.2	3.0	5.3
チェコ	千チェコ・コルナ 240,800	千チェコ・コルナ 193,230	1,099,967	4.4	—	2.3	1.6	0.5
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 27,570	千ルーマニア・レイ 23,594	672,069	2.7	—	1.1	0.9	0.8
中国	千オフショア・人民元 125,550	千オフショア・人民元 128,071	2,563,282	10.3	—	4.9	3.6	1.8
ロシア	千ロシア・ルーブル 1,194,420	千ロシア・ルーブル —	—	—	—	—	—	—
マレーシア	千マレーシア・リンギット 85,930	千マレーシア・リンギット 83,314	2,544,176	10.2	—	5.5	3.4	1.3
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 336,590	千南アフリカ・ランド 284,720	2,397,347	9.6	—	7.6	1.7	0.3
タイ	千タイ・バーツ 665,360	千タイ・バーツ 639,648	2,462,645	9.9	—	5.9	2.9	1.1
ペルー	千ペルー・ソル 18,100	千ペルー・ソル 16,235	583,372	2.3	—	2.0	0.3	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 68,960	千ポーランド・ズロチ 55,654	1,674,840	6.7	—	2.2	2.9	1.6
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 2,663,800	千ハンガリー・フォリント 2,003,969	703,695	2.8	—	1.3	1.1	0.4
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 9,800	千ウルグアイ・ペソ 8,526	28,723	0.1	—	0.1	—	—
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 10,851	26,672	0.1	0.1	—	0.1	—
合 計	—	—	24,262,786	97.3	2.5	49.6	31.8	15.8

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15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6月15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	
エジプト	ARAB REP EGYPT	国債証券	16.1000	千エジプト・ポンド 1,500	千エジプト・ポンド 1,512	千円 10,896	2029/05/07
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3500	1,000	979	7,059	2024/09/10
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4000	4,000	3,818	27,506	2029/09/10
	ARAB REP EGYPT	国債証券	13.5360	1,500	1,439	10,369	2025/01/14
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.6640	4,500	4,257	30,670	2030/10/06
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5560	2,000	1,900	13,693	2027/10/13
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3690	9,000	8,680	62,533	2025/10/20
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.2920	6,000	5,658	40,763	2028/01/05
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.0600	10,000	9,544	68,758	2026/01/12
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4830	9,000	8,732	62,908	2026/04/06
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5630	1,000	967	6,966	2026/07/06
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5310	3,000	2,949	21,245	2024/09/14
通貨小計	銘柄数	12銘柄					
	金 額			52,500	50,439	363,373	
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	千トルコ・リラ 2,780	千トルコ・リラ 2,500	19,569	2023/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	553	4,327	2024/03/20
	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	1,630	1,257	9,840	2024/07/24
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	2,690	1,930	15,103	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	2,570	1,915	14,990	2026/02/11
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,168	16,966	2027/02/24
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	2,500	1,825	14,286	2027/08/11
	Turkey Government Bond	国債証券	12.2000	2,600	2,467	19,305	2023/01/18
	Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	2,000	1,650	12,911	2028/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	16.2000	2,800	2,626	20,556	2023/06/14
	Turkey Government Bond	国債証券	12.6000	6,100	4,943	38,687	2025/10/01
	Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	8,400	6,231	48,763	2030/11/13
通貨小計	銘柄数	12銘柄					
	金 額			37,720	30,070	235,307	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 52,400	千メキシコ・ペソ 46,202	303,340	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,800	24,341	159,817	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	41,000	39,749	260,972	2024/09/05
	Mexican Bonos	国債証券	6.7500	17,500	17,203	112,949	2023/03/09
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	13,000	11,057	72,599	2027/03/04
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,250	26,663	175,056	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	26,550	26,799	175,950	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	36,230	33,554	220,299	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	7,854	51,569	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	31,730	30,467	200,032	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,100	27,270	179,042	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	41,350	37,708	247,576	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	26,120	22,462	147,478	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,430	9,311	61,133	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金 額			387,850	360,645	2,367,817	
フィリピン	Philippine Government International Bond	国債証券	6.2500	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 9,982	25,310	2036/01/14
通貨小計	銘柄数	1銘柄					
	金 額			10,000	9,982	25,310	
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ 500,000	千チリ・ペソ 466,770	72,546	2026/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	570,000	495,164	76,959	2035/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	510,000	479,053	74,455	2043/01/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	685,000	606,430	94,253	2030/09/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.0000	250,000	241,850	37,589	2023/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	850,000	765,297	118,944	2025/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.3000	250,000	194,652	30,253	2028/10/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	200,000	183,094	28,457	2028/10/01
通貨小計	銘柄数	8銘柄					
	金 額			3,815,000	3,432,312	533,460	
コロンビア	Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	千コロンビア・ペソ 90,000	千コロンビア・ペソ 88,179	2,999	2027/06/28
	Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	43,132	1,467	2023/03/21
	Colombian TES	国債証券	10.0000	3,850,000	3,831,366	130,335	2024/07/24
	Colombian TES	国債証券	6.0000	4,870,000	3,798,843	129,229	2028/04/28
	Colombian TES	国債証券	7.5000	4,710,000	4,162,556	141,601	2026/08/26
	Colombian TES	国債証券	7.7500	3,600,000	2,889,396	98,291	2030/09/18
	Colombian TES	国債証券	7.0000	4,650,000	3,408,961	115,966	2032/06/30
	Colombian TES	国債証券	6.2500	2,700,000	2,353,941	80,076	2025/11/26
	Colombian TES	国債証券	7.2500	4,200,000	2,991,576	101,767	2034/10/18
	Colombian TES	国債証券	5.7500	3,200,000	2,507,552	85,301	2027/11/03
	Colombian TES	国債証券	7.2500	2,310,000	1,428,919	48,608	2050/10/26

2022年6月15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	
		Colombian TES	国債証券	%	千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ	千円	
		COLOMBIAN TES	国債証券	6.2500	1,900,000	1,188,355	40,425	2036/07/09
		COLOMBIAN TES	国債証券	7.0000	2,300,000	1,737,397	59,102	2031/03/26
		COLOMBIAN TES	国債証券	9.2500	1,500,000	1,188,030	40,414	2042/05/28
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金 額				39,925,000	31,618,206	1,075,588	
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	8,250,000	8,492,220	78,128	2036/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	6,000,000	6,425,520	59,114	2031/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	5,472,060	50,342	2032/08/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,234,227	66,554	2038/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	10,543,500	97,000	2024/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	4,700,000	5,033,747	46,310	2039/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	12,000,000	12,654,840	116,424	2029/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	17,800,000	17,434,922	160,401	2030/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	15,700,000	15,980,559	147,021	2025/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	9,300,000	9,190,632	84,553	2035/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	11,500,000	11,809,695	108,649	2040/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	14,400,000	14,052,960	129,287	2026/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	15,800,000	14,860,532	136,716	2031/02/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	4,300,000	3,850,306	35,422	2036/06/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	12,600,000	11,708,046	107,714	2032/04/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	5.1250	9,000,000	8,444,880	77,692	2027/04/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	5,700,000	5,528,658	50,863	2042/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	3,600,000	4,141,044	38,097	2025/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	2,180,000	2,635,576	24,247	2030/08/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,393,076	31,216	2031/07/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,824,000	13,721,551	126,238	2026/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	4,978,617	45,803	2032/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	12,530,000	12,749,901	117,299	2027/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	6,910,000	7,008,191	64,475	2023/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	11,450,000	11,046,960	101,632	2028/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	7,075,000	6,613,710	60,846	2033/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,520,000	13,149,004	120,970	2034/03/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	15,150,000	15,977,038	146,988	2024/03/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	10,620,000	11,666,494	107,331	2029/03/15	
通貨小計	銘柄数	29銘柄						
	金 額				272,429,000	275,798,470	2,537,345	
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,710	10,513	277,292	2023/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,390	9,716	256,253	2025/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,950	9,832	259,321	2027/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	8,100	7,043	185,759	2029/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	4,600	3,888	102,568	2031/01/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	19,300	16,854	444,532	2023/07/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	27,700	22,734	599,616	2024/01/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	9,300	7,195	189,789	2024/07/01	
	BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL	国債証券	—	2,900	1,996	52,653	2025/07/01	
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金 額				103,950	89,775	2,367,787	
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	19,600	16,483	93,830	2028/08/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	12,100	12,002	68,323	2024/05/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	21,100	19,034	108,352	2025/09/17	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	17,900	14,950	85,103	2026/06/26	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	16,000	11,417	64,992	2030/05/15	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	11,900	11,018	62,721	2023/10/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	22,500	17,597	100,172	2027/02/10	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	18,000	15,143	86,204	2029/07/23	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	19,000	13,490	76,797	2033/10/13	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	16,200	11,459	65,230	2031/03/13	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	10,000	6,725	38,282	2029/11/29	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	9,500	8,221	46,799	2036/12/04	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	14,500	10,420	59,318	2032/06/23	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	17,500	15,469	88,057	2025/02/14	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	10,000	5,487	31,238	2040/04/24	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,000	4,311	24,541	2024/12/12	
通貨小計	銘柄数	16銘柄						
	金 額				240,800	193,230	1,099,967	
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	5.8500	1,430	1,404	40,013	2023/04/26	
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,046	29,821	2025/02/24	
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,100	1,856	52,882	2027/07/26	
	Romania Government Bond	国債証券	3.5000	1,090	1,066	30,391	2022/12/19	
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,600	1,460	41,587	2024/04/29	

2022年6月15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	
			%	千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ	千円	
	Romania Government Bond	国債証券	4.2500	1,500	1,444	41,137	2023/06/28
	Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,121	60,439	2029/02/12
	Romania Government Bond	国債証券	4.8500	1,600	1,405	40,023	2026/04/22
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,400	958	27,300	2031/09/24
	Romania Government Bond	国債証券	4.5000	900	836	23,814	2024/06/17
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,500	1,305	37,185	2025/07/28
	Romania Government Bond	国債証券	4.0000	1,600	1,516	43,189	2023/10/25
	Romania Government Bond	国債証券	4.1500	1,600	1,284	36,598	2028/01/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.7000	1,300	1,166	33,219	2024/11/25
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	2,100	1,726	49,174	2026/06/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1500	2,000	1,471	41,905	2030/10/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	800	558	15,895	2034/10/11
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,300	965	27,489	2027/10/25
通貨小計	銘柄数	18銘柄					
	金 額			27,570	23,594	672,069	
中国				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	3.2900	2,700	2,742	54,881	2023/10/18
	China Government Bond	国債証券	3.2200	3,700	3,797	75,995	2025/12/06
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,956	99,193	2028/11/22
	China Government Bond	国債証券	3.1900	4,000	4,070	81,475	2024/04/11
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,900	6,117	122,447	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,935	98,784	2026/06/06
	China Government Bond	国債証券	3.1200	4,200	4,298	86,031	2026/12/05
	China Government Bond	国債証券	3.1300	5,700	5,826	116,613	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2.9400	4,500	4,565	91,377	2024/10/17
	China Government Bond	国債証券	2.8500	8,600	8,690	173,925	2027/06/04
	China Government Bond	国債証券	2.6800	8,000	7,917	158,466	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	1.9900	6,500	6,423	128,566	2025/04/09
	China Government Bond	国債証券	2.3600	6,150	6,168	123,467	2023/07/02
	China Government Bond	国債証券	2.8800	4,900	4,950	99,071	2023/11/05
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,126	142,635	2025/10/22
	China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,164	103,370	2027/12/03
	China Government Bond	国債証券	3.2700	7,300	7,548	151,087	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3.0300	3,900	3,972	79,508	2026/03/11
	China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	6,293	125,965	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	2.8400	4,000	4,041	80,886	2024/04/08
	China Government Bond	国債証券	3.0100	5,000	5,077	101,619	2028/05/13
	China Government Bond	国債証券	3.7200	2,000	2,141	42,858	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.0200	5,800	5,876	117,619	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	1,500	1,507	30,170	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	1,800	1,816	36,357	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	1,000	1,039	20,801	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	1,000	1,004	20,103	2031/11/18
通貨小計	銘柄数	27銘柄					
	金 額			125,550	128,071	2,563,282	
ロシア				千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル		
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	46,760	—	—	2027/02/03
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	24,400	—	—	2023/01/25
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	46,160	—	—	2028/01/19
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	33,800	—	—	2023/08/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	43,000	—	—	2031/09/17
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	45,600	—	—	2026/09/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	54,000	—	—	2022/12/07
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	46,100	—	—	2033/03/23
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	48,600	—	—	2024/10/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	48,000	—	—	2024/02/28
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.2500	55,000	—	—	2034/05/10
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.9000	49,000	—	—	2029/05/23
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.9500	46,000	—	—	2026/10/07
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	55,000	—	—	2024/07/17
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1500	59,000	—	—	2025/11/12
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6500	65,000	—	—	2030/04/10
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	38,000	—	—	2039/03/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.0000	68,000	—	—	2027/10/06
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	4.5000	71,000	—	—	2025/07/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.1000	63,000	—	—	2035/07/18
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	5.7000	65,000	—	—	2028/05/17
	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ	国債証券	6.9000	74,000	—	—	2031/07/23
	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ	国債証券	6.7000	50,000	—	—	2029/03/14
通貨小計	銘柄数	23銘柄					
	金 額			1,194,420	—	—	
マレーシア				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,826	55,778	2027/07/26
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0940	2,000	2,035	62,166	2023/11/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	3,500	3,509	107,162	2028/10/31

2022年6月15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	
			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1280	1,900	1,934	59,069	2025/08/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	1,600	1,595	48,724	2029/07/09
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.6550	3,700	3,737	114,117	2024/10/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	4,200	4,207	128,483	2026/03/31
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	4,000	3,758	114,778	2030/10/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4220	3,700	3,573	109,109	2027/09/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4470	3,100	2,723	83,171	2036/07/15
	MALAYSIA T-BILL	国債証券	4.4170	2,100	1,990	60,797	2041/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,450	2,386	72,878	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	2,500	2,515	76,828	2023/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	3,250	3,164	96,620	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,763	53,843	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	4,450	4,477	136,741	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	2,300	2,199	67,155	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,400	1,414	43,185	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	3,800	3,786	115,615	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,720	1,738	53,102	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	2,520	2,489	76,014	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	2,600	2,593	79,198	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,500	1,510	46,132	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,412	43,132	2023/04/20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	2,000	1,998	61,031	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,950	2,863	87,436	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	3,300	3,299	100,747	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	2,350	2,146	65,555	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	3,600	3,128	95,526	2040/05/22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	3,600	3,078	94,016	2050/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	2,900	2,526	77,144	2031/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	1,000	933	28,519	2032/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1930	1,000	995	30,390	2032/10/07
通貨小計	銘柄数	33銘柄					
	金 額			85,930	83,314	2,544,176	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	47,950	50,788	427,640	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	14,720	9,701	81,690	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	13,280	8,271	69,645	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	19,540	15,528	130,749	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	8,880	8,998	75,771	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	45,520	35,582	299,608	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	29,900	23,975	201,872	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	42,400	37,201	313,238	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	27,600	21,711	182,811	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	34,900	29,565	248,941	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	28,800	24,467	206,012	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	23,100	18,926	159,365	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	12銘柄					
	金 額			336,590	284,720	2,397,347	
タイ	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	36,050	40,374	155,440	2029/06/22
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	23,300	23,859	91,860	2023/06/16
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	31,610	33,058	127,274	2025/12/12
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	28,700	29,934	115,246	2031/06/20
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	29,600	28,956	111,482	2036/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	35,400	34,676	133,502	2026/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	24,000	24,135	92,920	2022/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	37,500	39,641	152,620	2032/06/25
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	34,900	28,404	109,358	2046/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.4000	21,500	21,772	83,822	2023/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	26,500	26,483	101,962	2028/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	40,500	38,326	147,556	2038/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.4500	34,000	33,571	129,250	2024/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	36,500	33,021	127,131	2029/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	15,500	12,609	48,547	2035/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	0.9500	34,000	32,908	126,699	2025/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	0.7500	39,900	39,079	150,456	2024/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.5850	32,900	26,321	101,337	2035/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	36,000	32,902	126,676	2031/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	19,000	14,463	55,685	2042/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	32,000	29,527	113,680	2027/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	16,000	15,618	60,132	2024/09/17
通貨小計	銘柄数	22銘柄					
	金 額			665,360	639,648	2,462,645	
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	5.7000	730	725	26,076	2024/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	2,870	2,680	96,315	2028/08/12

2022年 6 月15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		
			%	千ペルー・ソル	千ペルー・ソル	千円		
	Peru Government Bond	国債証券	6. 1500	2, 550	2, 209	79, 377	2032/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5. 9400	2, 700	2, 439	87, 656	2029/02/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5. 4000	2, 050	1, 612	57, 945	2034/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5. 3500	1, 000	723	25, 981	2040/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	8. 2000	1, 565	1, 634	58, 745	2026/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6. 9000	2, 065	1, 817	65, 293	2037/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6. 9500	2, 570	2, 392	85, 980	2031/08/12	
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金 額			18, 100	16, 235	583, 372		
ポーランド				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ			
	Poland Government Bond	国債証券	2. 5000	7, 490	6, 107	183, 804	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2. 5000	5, 240	4, 072	122, 565	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2. 5000	4, 500	4, 394	132, 253	2023/01/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2. 5000	4, 700	4, 299	129, 401	2024/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2. 7500	7, 150	5, 207	156, 708	2029/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2. 2500	5, 000	4, 447	133, 842	2024/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	0. 7500	4, 700	3, 902	117, 445	2025/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	1. 2500	5, 600	3, 443	103, 617	2030/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	0. 2500	5, 700	4, 150	124, 902	2026/10/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 7500	2, 500	1, 493	44, 956	2032/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	4. 0000	4, 530	4, 353	131, 009	2023/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2. 7500	5, 700	4, 382	131, 896	2028/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	3. 2500	6, 150	5, 397	162, 436	2025/07/25	
通貨小計	銘柄数	13銘柄						
	金 額			68, 960	55, 654	1, 674, 840		
ハンガリー				千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント			
	Hungary Government Bond	国債証券	3. 0000	98, 500	89, 689	31, 494	2024/06/26	
	Hungary Government Bond	国債証券	3. 0000	170, 000	131, 928	46, 326	2027/10/27	
	Hungary Government Bond	国債証券	1. 7500	140, 000	137, 611	48, 322	2022/10/26	
	Hungary Government Bond	国債証券	2. 7500	130, 000	103, 321	36, 281	2026/12/22	
	Hungary Government Bond	国債証券	6. 7500	88, 000	81, 273	28, 539	2028/10/22	
	Hungary Government Bond	国債証券	3. 0000	225, 000	156, 739	55, 039	2030/08/21	
	Hungary Government Bond	国債証券	2. 5000	110, 000	97, 519	34, 244	2024/10/24	
	Hungary Government Bond	国債証券	3. 2500	272, 000	185, 789	65, 240	2031/10/22	
	Hungary Government Bond	国債証券	1. 5000	40, 000	37, 382	13, 126	2023/08/23	
	Hungary Government Bond	国債証券	1. 0000	200, 000	158, 440	55, 636	2025/11/26	
	Hungary Government Bond	国債証券	3. 0000	202, 000	109, 251	38, 363	2038/10/27	
	Hungary Government Bond	国債証券	1. 5000	169, 000	132, 267	46, 445	2026/04/22	
	Hungary Government Bond	国債証券	2. 0000	135, 000	91, 536	32, 143	2029/05/23	
	Hungary Government Bond	国債証券	2. 2500	215, 000	124, 592	43, 750	2033/04/20	
	Hungary Government Bond	国債証券	1. 5000	100, 000	76, 377	26, 819	2026/08/26	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 0000	70, 000	35, 619	12, 507	2041/04/25	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	75, 000	41, 580	14, 600	2034/06/22	
	Hungary Government Bond	国債証券	6. 0000	81, 800	80, 090	28, 123	2023/11/24	
	Hungary Government Bond	国債証券	5. 5000	142, 500	132, 959	46, 688	2025/06/24	
通貨小計	銘柄数	19銘柄						
	金 額			2, 663, 800	2, 003, 969	703, 695		
ウルグアイ				千ウルグアイ・ペソ	千ウルグアイ・ペソ			
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8. 5000	2, 800	2, 558	8, 619	2028/03/15	
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8. 2500	7, 000	5, 967	20, 103	2031/05/21	
通貨小計	銘柄数	2銘柄						
	金 額			9, 800	8, 526	28, 723		
ドミニカ共和国				千ドミニカ・ペソ	千ドミニカ・ペソ			
	Dominican Republic International Bond	国債証券	9. 7500	11, 000	10, 851	26, 672	2026/06/05	
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金 額			11, 000	10, 851	26, 672		
合 計	銘柄数	294銘柄						
	金 額					24, 262, 786		

(注 1) 邦貨換算金額は、2022年 6 月15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。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

運用報告書 第11期 (決算日 2021年7月5日)

(作成対象期間 2020年7月7日～2021年7月5日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

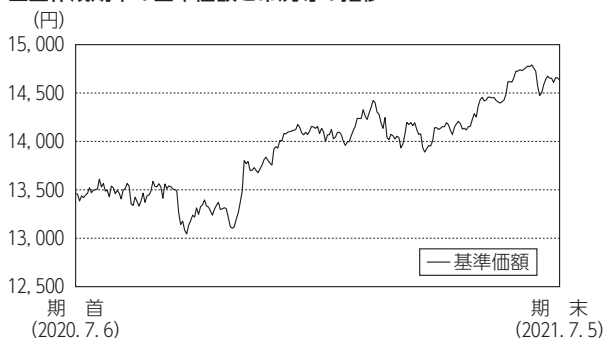
運用方針	投資成果を J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (円換算) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	新興国通貨建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

【基準価額・騰落率】

期首：13,460円 期末：14,635円 騰落率：8.7%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○新興国債券市況

新興国債券価格は、多くの国で下落(金利は上昇)しました。

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

○為替相場

新興国為替市場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

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

◆前作成期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

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

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (円換算) は、J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (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。J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (米ドルベース) は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J. P. Morgan はその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J. P. Morgan からの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J. P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

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

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

《今後の運用方針》

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

■ 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	13
（保管費用）	(12)
（その他）	(1)
合 計	13

(注 1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。
(注 2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況
公 社 債

(2020年 7 月 7 日から2021年 7 月 5 日まで)

			買 付 額	売 付 額
			千トルコ・リラ 7, 490	千トルコ・リラ 3, 507 (—)
外 国	トルコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 73, 031	千メキシコ・ペソ 20, 003 (—)
	メキシコ	国債証券	千チリ・ペソ 687, 215	千チリ・ペソ 57, 691 (—)
	チリ	国債証券	千コロンビア・ペソ 6, 549, 900	千コロンビア・ペソ 2, 892, 000 (—)
	コロンビア	国債証券	千インドネシア・ルピア 62, 416, 644	千インドネシア・ルピア 3, 465, 000 (—)
	インドネシア	国債証券	千ブラジル・レアル 29, 279	千ブラジル・レアル 15, 421 (—)
	ブラジル	国債証券	千チェコ・コルナ 29, 444	千チェコ・コルナ 15, 794 (—)
	チェコ	国債証券	千ルーマニア・レイ 4, 869	千ルーマニア・レイ 1, 012 (—)
	ルーマニア	国債証券	千オフショア・人民元 89, 993	千オフショア・人民元 9, 471 (—)
	中国	国債証券	千ロシア・ルーブル 298, 895	千ロシア・ルーブル 104, 221 (—)
	ロシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 21, 127	千マレーシア・リンギット 2, 197 (—)
	マレーシア	国債証券	千南アフリカ・ランド 30, 142	千南アフリカ・ランド 5, 607 (—)
	南アフリカ	国債証券	千タイ・バーツ 166, 995	千タイ・バーツ 38, 130 (—)
	タイ	国債証券	千ペルー・ソル 764	千ペルー・ソル 926 (—)
	ペルー	国債証券	千ポーランド・ズロチ 20, 869	千ポーランド・ズロチ 3, 613 (—)
	ポーランド	国債証券	千ハンガリー・フォリント 789, 018	千ハンガリー・フォリント 90, 602 (—)
	ハンガリー	国債証券	千ウルグアイ・ペソ 6, 996	千ウルグアイ・ペソ 5, 464 (—)
	ウルグアイ	国債証券		

(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 7 月 7 日から2021年 7 月 5 日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	千円 309, 188	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2022/1/1	千円 134, 458
China Government Bond (中国) 2. 36% 2023/7/2	176, 741	Thailand Government Bond (タイ) 3. 65% 2021/12/17	108, 962
China Government Bond (中国) 2. 68% 2030/5/21	143, 302	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	98, 282
Mexican Bonos (メキシコ) 6. 75% 2023/3/9	123, 869	China Government Bond (中国) 2. 36% 2023/7/2	85, 852
Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 6. 5% 2031/2/15	122, 145	Russian Federal Bond - OFZ (ロシア) 7% 2021/12/15	70, 878
China Government Bond (中国) 3. 27% 2030/11/19	121, 040	Mexican Bonos (メキシコ) 7. 25% 2021/12/9	53, 367
Poland Government Bond (ポーランド) 0. 75% 2025/4/25	115, 880	Poland Government Bond (ポーランド) 5. 75% 2021/10/25	50, 962
China Government Bond (中国) 3. 02% 2025/10/22	110, 931	China Government Bond (中国) 2. 68% 2030/5/21	48, 410
Poland Government Bond (ポーランド) 1. 25% 2030/10/25	109, 534	Poland Government Bond (ポーランド) 2. 75% 2028/4/25	48, 104
China Government Bond (中国) 2. 85% 2027/6/4	107, 997	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	45, 491

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

■組入資産明細表

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

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

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

			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			
トルコ		Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	% 千トルコ・リラ	790	千トルコ・リラ 千円	714	9,157	2022/09/14
		Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	2,780	2,367	30,350	2023/03/08		
		Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	579	7,428	2024/03/20		
		Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	1,630	1,313	16,840	2024/07/24		
		Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	2,690	2,012	25,800	2025/03/12		
		Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	2,570	2,014	25,820	2026/02/11		
		Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,400	2,299	29,483	2022/03/02		
		Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,291	29,373	2027/02/24		
		Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	1,900	1,766	22,639	2022/08/17		
		Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	2,500	1,862	23,876	2027/08/11		
		Turkey Government Bond	国債証券	12.2000	1,400	1,301	16,686	2023/01/18		
		Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	2,000	1,638	21,001	2028/03/08		
		Turkey Government Bond	国債証券	16.2000	1,400	1,366	17,518	2023/06/14		
		Turkey Government Bond	国債証券	12.6000	3,500	2,989	38,328	2025/10/01		
		Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	4,300	3,272	41,954	2030/11/13		
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄			33,510	27,790	356,260			
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ	34,400	千メキシコ・ペソ	33,456	187,788	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	20,500	21,529	120,847	2047/11/07		
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	26,000	27,356	153,551	2024/09/05		
		Mexican Bonos	国債証券	6.7500	23,000	23,427	131,497	2023/03/09		
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,250	28,553	160,271	2023/12/07		
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	26,550	29,628	166,306	2024/12/05		
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	30,230	31,418	176,354	2027/06/03		
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	9,257	51,963	2036/11/20		

		当 期			未 評 価 額		
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額		償還年月日
					千メキシコ・ペソ	千円	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	27,730	30,354	170,380	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	20,400	22,403	125,753	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,450	23,581	132,365	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	28,450	28,719	161,202	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	20,120	20,587	115,560	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,430	10,951	61,472	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄		324,900	341,228	1,915,315	
フィリピン		Philippine Government International Bond	国債証券	6.2500	10,000	11,966	2036/01/14
通貨小計	銘柄数 金 額	1銘柄		10,000	11,966	27,025	
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	500,000	516,710	78,086	2026/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	570,000	571,305	86,336	2035/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	410,000	451,594	68,245	2043/01/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	410,000	407,330	61,556	2030/09/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.0000	250,000	257,000	38,838	2023/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	650,000	630,175	95,233	2025/03/01
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		2,790,000	2,834,115	428,297	
コロンビア	Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	90,000	106,914	3,170	2027/06/28
	Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	46,078	1,366	2023/03/21
	Colombian TES	国債証券	7.0000	3,635,000	3,754,773	111,347	2022/05/04
	Colombian TES	国債証券	10.0000	3,050,000	3,480,904	103,226	2024/07/24
	Colombian TES	国債証券	6.0000	4,290,000	4,131,827	122,529	2028/04/28
	Colombian TES	国債証券	7.5000	3,710,000	3,927,702	116,476	2026/08/26
	Colombian TES	国債証券	7.7500	2,700,000	2,821,311	83,665	2030/09/18
	Colombian TES	国債証券	7.0000	3,000,000	2,946,090	87,366	2032/06/30
	Colombian TES	国債証券	6.2500	2,700,000	2,746,386	81,444	2025/11/26
	Colombian TES	国債証券	7.2500	3,400,000	3,371,270	99,975	2034/10/18
	Colombian TES	国債証券	5.7500	2,400,000	2,306,040	68,385	2027/11/03
	Colombian TES	国債証券	7.2500	1,410,000	1,294,323	38,383	2050/10/26
	Colombian TES	国債証券	6.2500	1,200,000	1,053,336	31,236	2036/07/09
通貨小計	銘柄数 金 額	13銘柄		31,630,000	31,986,957	948,573	
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	8,250,000	9,070,050	69,839	2036/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	6,000,000	6,906,360	53,178	2031/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	5,791,940	44,597	2032/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,486,734	57,647	2038/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	10,917,500	84,064	2024/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	7,200,000	7,973,424	61,395	2039/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	12,000,000	13,383,720	103,054	2029/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	14,300,000	14,802,073	113,975	2030/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	16,000,000	16,792,160	129,299	2025/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	9,300,000	9,618,246	74,060	2035/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	10,000,000	10,241,900	78,862	2040/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	9,200,000	9,239,284	71,142	2026/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	15,800,000	15,727,636	121,102	2031/02/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	2,300,000	2,267,064	17,456	2036/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	3,600,000	4,337,496	33,398	2025/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	2,180,000	2,756,174	21,222	2030/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,561,000	27,419	2031/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,824,000	14,441,234	111,197	2026/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,278,627	40,645	2032/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	10,330,000	10,953,518	84,342	2027/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	11,060,000	11,397,661	87,761	2022/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	10,910,000	11,163,766	85,961	2023/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	11,450,000	11,454,236	88,197	2028/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	7,075,000	7,055,968	54,330	2033/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,520,000	13,825,961	106,459	2034/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	13,150,000	14,375,185	110,688	2024/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	8,120,000	9,411,648	72,469	2029/03/15
通貨小計	銘柄数 金 額	27銘柄		244,089,000	260,230,570	2,003,775	
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,210	10,590	232,688	2023/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,690	11,250	247,193	2025/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	9,150	9,660	212,242	2027/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	5,300	5,608	123,221	2029/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	2,400	2,521	55,404	2031/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	6,100	5,721	125,705	2022/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	12,700	10,957	240,739	2023/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	23,200	19,157	420,911	2024/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	5,400	4,268	93,792	2024/07/01
通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄		85,150	79,736	1,751,898	

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
				%	千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ	千円	
チェコ		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	15,600	16,388	84,415	2028/08/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	8,600	9,670	49,813	2024/05/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	8,700	9,143	47,099	2022/09/12
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	16,100	16,614	85,580	2025/09/17
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	17,900	17,356	89,405	2026/06/26
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	16,000	14,903	76,768	2030/05/15
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	9,900	9,723	50,085	2023/10/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	15,500	14,331	73,820	2027/02/10
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	12,000	12,883	66,365	2029/07/23
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	17,000	17,306	89,143	2033/10/13
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	13,000	12,302	63,372	2031/03/13
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	6,000	5,198	26,775	2029/11/29
		Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	7,500	9,789	50,427	2036/12/04
通貨小計	銘柄数 金 額	13銘柄			163,800	165,613	853,073	
ルーマニア		Romania Government Bond	国債証券	5.8500	1,430	1,521	40,607	2023/04/26
		Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,237	33,017	2025/02/24
		Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,100	2,452	65,462	2027/07/26
		Romania Government Bond	国債証券	3.5000	1,090	1,111	29,661	2022/12/19
		Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,600	1,636	43,687	2024/04/29
		Romania Government Bond	国債証券	3.4000	1,700	1,716	45,815	2022/03/08
		Romania Government Bond	国債証券	4.2500	1,500	1,557	41,573	2023/06/28
		Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,918	77,892	2029/02/12
		Romania Government Bond	国債証券	4.8500	1,600	1,750	46,715	2026/04/22
		Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,400	1,423	37,995	2031/09/24
		Romania Government Bond	国債証券	4.5000	900	952	25,424	2024/06/17
		Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,500	1,564	41,754	2025/07/28
		Romania Government Bond	国債証券	4.1500	800	856	22,857	2028/01/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	800	820	21,887	2026/06/24	
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄			20,170	21,520	574,354	
中国		China Government Bond	国債証券	3.2900	3,900	3,958	67,983	2023/10/18
		China Government Bond	国債証券	3.2200	5,700	5,776	99,215	2025/12/06
		China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,853	83,356	2028/11/22
		China Government Bond	国債証券	3.1900	6,700	6,782	116,487	2024/04/11
		China Government Bond	国債証券	3.2900	8,200	8,309	142,714	2029/05/23
		China Government Bond	国債証券	3.2500	6,800	6,900	118,508	2026/06/06
		China Government Bond	国債証券	3.1200	7,000	7,051	121,109	2026/12/05
		China Government Bond	国債証券	3.1300	7,000	6,996	120,155	2029/11/21
		China Government Bond	国債証券	2.9400	4,500	4,519	77,615	2024/10/17
		China Government Bond	国債証券	2.8500	8,600	8,512	146,206	2027/06/04
		China Government Bond	国債証券	2.6800	9,400	9,051	155,459	2030/05/21
		China Government Bond	国債証券	1.9900	8,000	7,738	132,913	2025/04/09
		China Government Bond	国債証券	2.3600	6,150	6,110	104,945	2023/07/02
		China Government Bond	国債証券	2.8800	4,900	4,919	84,486	2023/11/05
		China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,028	120,716	2025/10/22
		China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,071	87,099	2027/12/03
		China Government Bond	国債証券	3.2700	7,300	7,394	127,006	2030/11/19
		China Government Bond	国債証券	3.0300	1,700	1,707	29,334	2026/03/11
		China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	5,931	101,869	2050/09/14
		China Government Bond	国債証券	2.8400	1,000	1,002	17,215	2024/04/08
		China Government Bond	国債証券	3.0100	1,000	995	17,094	2028/05/13
		China Government Bond	国債証券	3.7200	1,000	1,009	17,340	2051/04/12
通貨小計	銘柄数 金 額	22銘柄			121,450	121,621	2,088,833	
ロシア		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	46,760	49,399	74,592	2027/02/03
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	32,910	33,371	50,391	2022/07/20
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	14,400	14,453	21,824	2023/01/25
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	46,160	46,513	70,234	2028/01/19
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	33,800	33,977	51,305	2023/08/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	31,000	34,234	51,693	2031/09/17
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	51,600	53,618	80,963	2026/09/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	51,000	51,669	78,020	2022/12/07
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	46,100	48,232	72,830	2033/03/23
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	48,600	49,001	73,992	2024/10/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	38,000	37,718	56,955	2024/02/28
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.2500	45,000	45,598	68,853	2034/05/10
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.9000	51,000	50,885	76,836	2029/05/23
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.9500	51,000	53,381	80,606	2026/10/07
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	55,000	55,784	84,235	2024/07/17
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1500	59,000	59,551	89,922	2025/11/12
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6500	65,000	67,699	102,226	2030/04/10
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	38,000	40,211	60,718	2039/03/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.0000	58,000	55,369	83,608	2027/10/06
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	4.5000	39,000	35,787	54,038	2025/07/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.1000	53,000	48,373	73,044	2035/07/18
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	5.7000	65,000	60,749	91,730	2028/05/17
通貨小計	銘柄数 金 額	22銘柄			1,019,330	1,025,580	1,548,626	

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	末 評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
マレーシア		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3. 9480	千マレーシア・リンギット 3, 400	千マレーシア・リンギット 3, 457	千円 92, 510	2022/04/14
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4. 2580	1, 800	1, 930	51, 657	2027/07/26
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4. 0940	2, 000	2, 098	56, 142	2023/11/30
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4. 3690	1, 700	1, 836	49, 128	2028/10/31
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4. 1300	1, 600	1, 703	45, 566	2029/07/09
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3. 6550	1, 700	1, 774	47, 471	2024/10/15
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3. 7260	2, 200	2, 310	61, 816	2026/03/31
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3. 4650	2, 500	2, 532	67, 755	2030/10/15
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3. 4220	2, 200	2, 261	60, 493	2027/09/30
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3. 4470	900	849	22, 714	2036/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 5020	1, 750	1, 809	48, 412	2027/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 7330	2, 350	2, 463	65, 899	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 1810	1, 740	1, 835	49, 094	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 9550	2, 950	3, 114	83, 320	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 2540	1, 800	1, 886	50, 471	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 8000	1, 400	1, 451	38, 843	2023/08/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 9000	2, 000	2, 132	57, 044	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 6200	1, 200	1, 208	32, 340	2021/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 0590	3, 020	3, 183	85, 170	2024/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 8990	2, 520	2, 662	71, 222	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 7620	2, 600	2, 816	75, 344	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 7570	1, 400	1, 445	38, 664	2023/04/20
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 9060	2, 000	2, 117	56, 648	2026/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 8850	2, 150	2, 266	60, 648	2029/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 4780	1, 100	1, 139	30, 476	2024/06/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 8280	2, 350	2, 350	62, 869	2034/07/05
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3. 7570	1, 800	1, 698	45, 451	2040/05/22
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 0650	1, 900	1, 832	49, 025	2050/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2. 6320	1, 000	946	25, 322	2031/04/15
通貨小計	銘柄数	29銘柄						
	金 額				57, 030	59, 115	1, 581, 530	
南アフリカ		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10. 5000	千南アフリカ・ランド 34, 550	千南アフリカ・ランド 39, 114	304, 698	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6. 2500	11, 220	7, 951	61, 938	2036/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6. 5000	12, 580	8, 450	65, 830	2041/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7. 0000	12, 440	10, 643	82, 914	2031/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7. 7500	11, 380	11, 811	92, 010	2023/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 7500	31, 520	26, 664	207, 712	2048/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 5000	20, 900	17, 941	139, 765	2037/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 0000	26, 900	25, 449	198, 254	2030/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 7500	17, 600	14, 911	116, 159	2044/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 2500	19, 600	17, 845	139, 014	2032/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8. 8750	20, 600	18, 654	145, 320	2035/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9. 0000	13, 800	12, 114	94, 371	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	12銘柄						
	金 額				233, 090	211, 551	1, 647, 990	
タイ		Thailand Government Bond	国債証券	4. 8750	千タイ・バーツ 30, 050	千タイ・バーツ 37, 447	129, 566	2029/06/22
		Thailand Government Bond	国債証券	3. 6250	23, 300	24, 707	85, 486	2023/06/16
		Thailand Government Bond	国債証券	3. 8500	26, 610	30, 235	104, 615	2025/12/12
		Thailand Government Bond	国債証券	3. 6500	22, 700	26, 734	92, 500	2031/06/20
		Thailand Government Bond	国債証券	1. 8750	17, 200	17, 432	60, 316	2022/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3. 4000	23, 600	26, 977	93, 340	2036/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2. 1250	29, 400	31, 300	108, 298	2026/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2. 0000	24, 000	24, 530	84, 876	2022/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3. 7750	32, 500	38, 725	133, 988	2032/06/25
		Thailand Government Bond	国債証券	2. 8750	24, 900	26, 233	90, 766	2046/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2. 4000	24, 500	25, 611	88, 614	2023/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2. 8750	26, 500	29, 363	101, 598	2028/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3. 3000	31, 500	35, 587	123, 131	2038/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1. 4500	30, 000	30, 844	106, 721	2024/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1. 6000	27, 500	27, 615	95, 548	2029/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1. 6000	15, 500	14, 550	50, 344	2035/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	0. 9500	28, 000	28, 310	97, 954	2025/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	0. 7500	20, 900	21, 005	72, 679	2024/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1. 5850	12, 400	11, 536	39, 915	2035/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2. 0000	9, 000	9, 215	31, 887	2031/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2. 0000	7, 000	6, 518	22, 554	2042/06/17
通貨小計	銘柄数	21銘柄						
	金 額				487, 060	524, 481	1, 814, 706	
ペルー		Peru Government Bond	国債証券	5. 7000	千ペルー・ソル 730	千ペルー・ソル 811	23, 105	2024/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6. 3500	1, 970	2, 191	62, 418	2028/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6. 1500	1, 850	1, 919	54, 670	2032/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	5. 9400	1, 900	2, 066	58, 854	2029/02/12
		Peru Government Bond	国債証券	5. 4000	2, 050	1, 925	54, 841	2034/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	5. 3500	1, 000	877	24, 999	2040/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	8. 2000	1, 565	1, 937	55, 203	2026/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6. 9000	2, 065	2, 172	61, 899	2037/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6. 9500	1, 920	2, 135	60, 839	2031/08/12
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金 額				15, 050	16, 037	456, 833	

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	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	千ポーランド・ズロチ 3,610	千ポーランド・ズロチ 3,858	千円 112,726	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,990	6,350	185,551	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,140	4,398	128,511	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,200	3,261	95,279	2022/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,500	4,658	136,096	2023/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,500	5,784	169,008	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	6,450	7,025	205,258	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,100	3,248	94,921	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,978	116,250	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,900	3,757	109,780	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	2,400	2,274	66,439	2026/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	3,530	3,818	111,572	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,500	4,873	142,395	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	3,550	3,863	112,866	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金 額			58,370	61,151	1,786,658	
ハンガリー	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	千ハンガリー・フォリント 98,500	千ハンガリー・フォリント 102,454	38,388	2024/06/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	170,000	177,242	66,410	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.7500	140,000	141,610	53,059	2022/10/26
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000	134,329	50,331	2026/12/22
	Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	88,000	113,546	42,544	2028/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	145,000	150,913	56,545	2030/08/21
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	160,000	164,003	61,449	2024/10/24
	Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	202,000	213,354	79,940	2031/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	40,000	40,205	15,064	2023/08/23
	Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	130,000	124,800	46,760	2025/11/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	75,000	73,125	27,398	2038/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	95,000	92,569	34,684	2026/04/22
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	80,000	77,824	29,159	2029/05/23
	Hungary Government Bond	国債証券	2.2500	100,000	94,008	35,223	2033/04/20
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	100,000	97,222	36,427	2026/08/26
	Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	131,800	146,192	54,776	2023/11/24
	Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	125,000	132,406	49,610	2022/06/24
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	142,500	161,975	60,689	2025/06/24
通貨小計	銘柄数	18銘柄					
	金 額			2,152,800	2,237,781	838,465	
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	千ウルグアイ・ペソ 2,800	千ウルグアイ・ペソ 2,923	7,438	2028/03/15
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.2500	7,000	7,165	18,230	2031/05/21
通貨小計	銘柄数	2銘柄					
	金 額			9,800	10,088	25,669	
ドミニカ共和国	Dominican Republic International Bond	国債証券	9.7500	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 12,443	24,280	2026/06/05
通貨小計	銘柄数	1銘柄					
	金 額			11,000	12,443	24,280	
合 計	銘柄数	262銘柄					
	金 額					20,672,166	

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	20,672,166	95.5
コール・ローン等、その他	983,961	4.5
投資信託財産総額	21,656,127	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=111.16円、1トルコ・リラ=12.819円、1メキシコ・ペソ=5.613円、1フィリピン・ペソ=2.258円、1アルゼンチン・ペソ=1.16円、100チリ・ペソ=15.112円、100コロンビア・ペソ=2.965円、100インドネシア・ルピア=0.77円、1ブラジル・レアル=21.971円、1チェコ・コルナ=5.151円、1ルーマニア・レイ=26.689円、1オフショア・人民元=17.174円、1ロシア・ルーブル=1.51円、1マレーシア・リンギット=26.753円、1南アフリカ・ランド=7.79円、1タイ・バーツ=3.46円、1ペルー・ソル=28.486円、1ポーランド・ズロチ=29.216円、100ハンガリー・フォリント=37.468円、1ウルグアイ・ペソ=2.544円、1ドミニカ・ペソ=1.951円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産 (20,973,875千円) の投資信託財産総額 (21,656,127千円) に対する比率は、96.8% です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	22, 222, 755, 636円
コール・ローン等	674, 373, 087
公社債（評価額）	20, 672, 166, 113
未収入金	604, 557, 331
未収利息	255, 476, 931
前払費用	16, 182, 174
(B) 負債	923, 205, 227
未払金	919, 638, 550
未払解約金	3, 560, 737
その他未払費用	5, 940
(C) 純資産総額（A－B）	21, 299, 550, 409
元本	14, 553, 919, 275
次期繰越損益金	6, 745, 631, 134
(D) 受益権総口数	14, 553, 919, 275口
1 万口当り基準価額（C／D）	14, 635円

* 期首における元本額は11, 831, 677, 635円、当作成期間中における追加設定元本額は3, 356, 035, 460円、同解約元本額は633, 793, 820円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、新興国債券インデックスファンド（FOFs 用）（適格機関投資家専用）139, 125, 730円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）264, 519, 469円、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）431, 390, 249円、D－I's 新興国債券インデックス54, 698, 190円、i F r e e 新興国債券インデックス3, 803, 181, 162円、i F r e e 8資産バランス2, 737, 955, 446円、DCダイワ新興国債券インデックスファンド6, 926, 685, 621円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券162, 851, 958円、ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド33, 511, 450円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14, 635円です。

■損益の状況

当期 自 2020年7月7日 至 2021年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	967, 591, 713円
受取利息	967, 675, 396
支払利息	△ 83, 683
(B) 有価証券売買損益	617, 999, 402
売買益	1, 665, 193, 821
売買損	△ 1, 047, 194, 419
(C) その他費用	△ 16, 880, 636
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	1, 568, 710, 479
(E) 前期繰越損益金	4, 093, 541, 775
(F) 解約差損益金	△ 253, 784, 839
(G) 追加信託差損益金	1, 337, 163, 719
(H) 合計（D＋E＋F＋G）	6, 745, 631, 134
次期繰越損益金（H）	6, 745, 631, 134

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

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

ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス

運用報告書(全体版) 第６期

(決算日 2022年６月15日)
(作成対象期間 2021年６月16日～2022年６月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／不動産投信（リート）／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年 9月26日）		
運用方針	投資成果を東証ＲＥＩＴ指数（配当込み。）の動きに連動させることをめざして運用を行います。		
主要投資 対 象	ベビーファンド	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザー ファンドの受益証券	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴ マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場 （上場予定を含みます。）の 不動産投資信託の受益証券お よび不動産投資法人の投資証 券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売 買益（評価益を含みます。）等とし、原則とし て、信託財産の成長に資することを目的に、配 当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して 分配金額を決定します。ただし、配当等収益が 少額の場合には、分配を行なわないことがあり ます。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果を東証ＲＥＩＴ指数の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<4640>

最近5期の運用実績

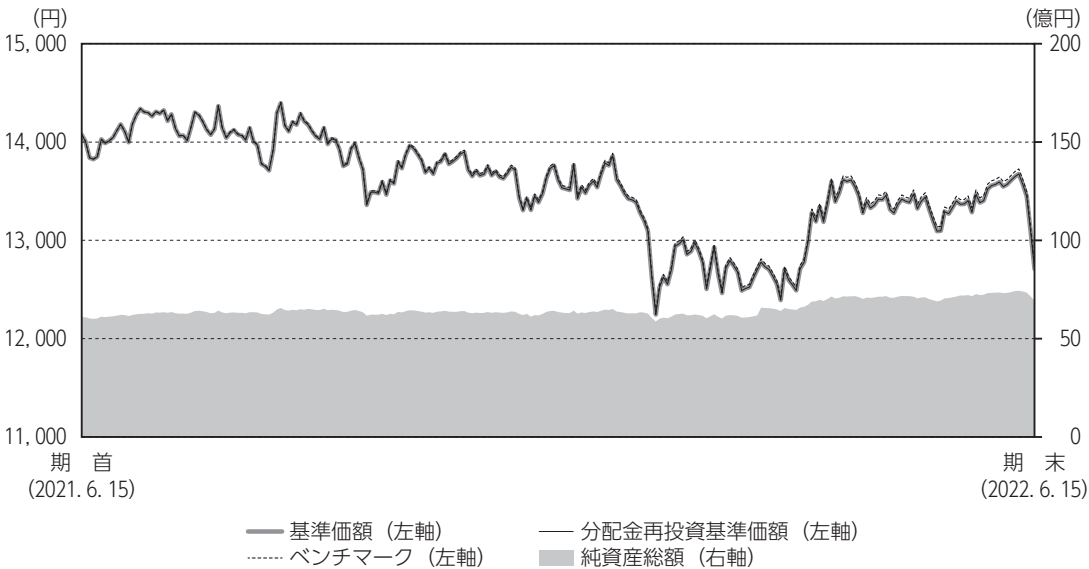
決 算 期	基 準 価 額			東証REIT指数 (配当込み)		投資信託 証券 組入比率	不動産投信 指数 先物比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2 期末 (2018年 6 月15日)	10,250	0	3.5	3,398.25	3.8	98.3	1.5	2,355
3 期末 (2019年 6 月17日)	11,818	0	15.3	3,934.65	15.8	98.4	1.4	3,254
4 期末 (2020年 6 月15日)	10,318	0	△ 12.7	3,448.87	△ 12.3	96.3	2.6	4,081
5 期末 (2021年 6 月15日)	14,075	0	36.4	4,720.99	36.9	96.9	2.4	6,102
6 期末 (2022年 6 月15日)	12,709	0	△ 9.7	4,278.73	△ 9.4	97.2	2.4	6,943

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注 2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注 3) 投資信託証券および不動産投信指数先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
(注 4) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期 首：14,075円
期 末：12,709円（分配金 0円）
騰落率：△9.7%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券を通じて、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、国内リート市況が下落したことを反映して、基準価額も下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%		%	%	%
(期首)2021年6月15日	14,075	—	4,720.99	—	96.9	2.4
6月末	14,106	0.2	4,732.24	0.2	97.5	2.4
7月末	14,207	0.9	4,767.40	1.0	96.3	2.4
8月末	14,166	0.6	4,755.00	0.7	97.1	2.5
9月末	13,718	△ 2.5	4,605.71	△ 2.4	97.0	2.5
10月末	13,877	△ 1.4	4,660.54	△ 1.3	97.5	2.5
11月末	13,306	△ 5.5	4,470.13	△ 5.3	97.4	2.5
12月末	13,761	△ 2.2	4,624.94	△ 2.0	97.4	2.5
2022年1月末	13,004	△ 7.6	4,372.24	△ 7.4	97.4	2.5
2月末	12,620	△ 10.3	4,243.65	△ 10.1	97.4	2.5
3月末	13,485	△ 4.2	4,536.64	△ 3.9	97.5	2.5
4月末	13,322	△ 5.3	4,483.12	△ 5.0	97.5	2.5
5月末	13,556	△ 3.7	4,563.32	△ 3.3	97.5	2.4
(期末)2022年6月15日	12,709	△ 9.7	4,278.73	△ 9.4	97.2	2.4

(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

(2021.6.16～2022.6.15)

国内リート市況

国内リート市況は下落しました。

国内リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展による経済活動の正常化期待から上昇が続きました。その後は、国内外で長期金利が上昇したことや中国の大手不動産会社の資金繰り懸念などから投資家のリスク回避姿勢が強まり、下落が続きました。2021年末から2022年初めにかけては、新型コロナウイルスの新しい変異株であるオミクロン株が確認されたことやウクライナ情勢の悪化、米国金融政策の引き締めペース加速への懸念から、投資家のリスク選好姿勢が後退したことなどを背景に、軟調に推移しました。3月中旬以降は、F R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げ決定で悪材料出尽くし観測が強まったことや、ロシアとウクライナによる停戦協議の進展期待もあり、国内リート市況は一時反発しました。しかしその後は、F R Bの利上げペースが一層加速するとの懸念などから、当作成期末にかけて下落しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

ダイワJ-REITマザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

当ファンド

国内リートへの投資は、「ダイワ J-REIT マザーファンド」の受益証券を通じて行いました。

ダイワ J-REIT マザーファンド

ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物含む。）については、当作成期を通じて99～100%程度としました。

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

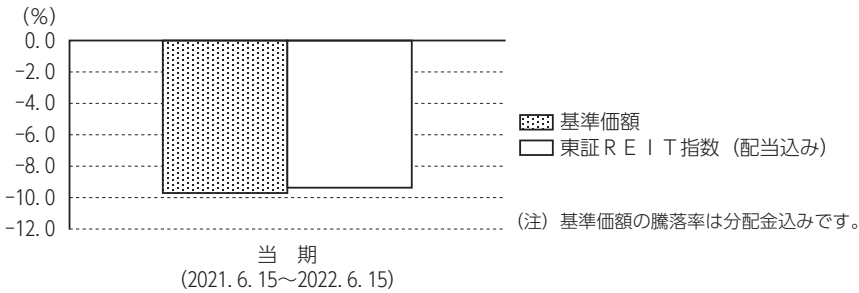
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ J-REIT マザーファンド	東証 REIT 指数（配当込み）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△9.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△9.7%となりました。

ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率の違い、先物取引の影響、運用管理費用、売買等のコストが控除されたことが差異の要因となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークは東証 REIT 指数（配当込み）です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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 6 月16日 ～2022年 6 月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	3,934

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

■ダイワJ-REITマザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16~2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	46円	0. 341%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は13, 547円です。
(投 信 会 社)	(28)	(0. 209)	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)	(15)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0. 002	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0. 001)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 001)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	47	0. 348	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

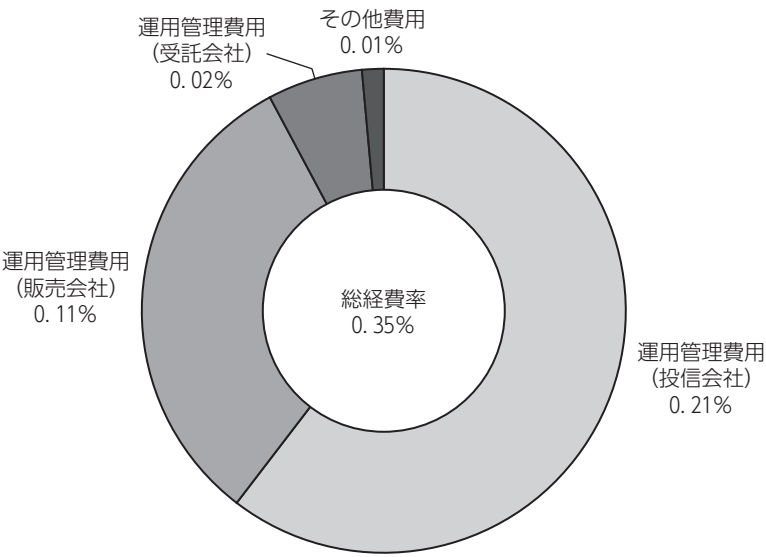
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.35%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 6 月16日から2022年 6 月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ J-REIT マザーファンド	597,730	1,997,230	152,234	514,980

(注) 単位未満は切捨て。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2021年 6 月16日から2022年 6 月15日まで)

種 類	当 期		
	ダイワ J-REIT マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
投資信託証券	2,442	2,072	13,083

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 単位未満は切捨て。

利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2021年 6 月16日から2022年 6 月15日まで)

決 算 期	当			期		
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況 B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況 D	D/C
区 分						
投資信託証券	百万円 86,193	百万円 2,803	% 3.3	百万円 73,951	百万円 686	% 0.9
不動産投信 指数先物取引	48,457	—	—	48,862	—	—
コール・ローン	2,227,929	—	—	—	—	—

(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) 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 6 月16日から2022年 6 月15日まで)

種 類	当 期
	ダイワ J-REIT マザーファンド
	買 付 額
	百万円
投資信託証券	1,485

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 単位未満は切捨て。

(5) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社、大和証券オフィス投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、大和証券リビング投資法人です。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千円	千円	千円
ダイワJ-R E I T マザーファンド	1,742,654	2,188,150	6,939,720

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワJ-R E I T マザーファンド	6,939,720	99.6
コール・ローン等、その他	25,258	0.4
投資信託財産総額	6,964,978	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

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	6,964,978,851円
コール・ローン等	25,258,380
ダイワJ-R E I Tマザーファンド (評価額)	6,939,720,471
(B) 負債	21,680,187
未払解約金	10,102,771
未払信託報酬	11,393,726
その他未払費用	183,690
(C) 純資産総額 (A - B)	6,943,298,664
元本	5,463,295,501
次期繰越損益金	1,480,003,163
(D) 受益権総口数	5,463,295,501口
1万口当り基準価額 (C / D)	12,709円

* 期首における元本額は4,336,083,892円、当作成期間中における追加設定元本額は1,972,084,634円、同解約元本額は844,873,025円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,709円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3,278円
受取利息	318
支払利息	△ 3,596
(B) 有価証券売買損益	△ 603,971,781
売買益	37,154,433
売買損	△ 641,126,214
(C) 信託報酬等	△ 22,559,079
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 626,534,138
(E) 前期繰越損益金	1,020,861,311
(F) 追加信託差損益金	1,085,675,990
(配当等相当額)	(1,128,740,648)
(売買損益相当額)	(△ 43,064,658)
(G) 合計 (D + E + F)	1,480,003,163
次期繰越損益金 (G)	1,480,003,163
追加信託差損益金	1,085,675,990
(配当等相当額)	(1,128,740,648)
(売買損益相当額)	(△ 43,064,658)
配準備積立金	1,020,863,659
繰越損益金	△ 626,536,486

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程 (総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	1,128,740,648
(d) 配準備積立金	1,020,863,659
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,149,604,307
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,149,604,307
(h) 受益権総口数	5,463,295,501口

東証R E I T指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

《お知らせ》
■マザーファンドにおける運用の基本方針の記載変更について
当ファンドの主要投資対象である「ダイワJ-R E I Tマザーファンド」において、株式会社東京証券取引所が東証R E I T指数の算出等にかかる業務を株式会社J P X総研に移管したことに伴い、信託約款における運用の基本方針の記載を、下記の通り変更しました。（下線部を削除）
現 行：東京証券取引所が算出・公表する「東証R E I T指数」（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
変更後：「東証R E I T指数」（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の決算日（2022年３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６月15日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの主要な売買銘柄
投資信託証券

(2021年６月16日から2022年６月15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
日本ビルファンド	8.445	5,801,317	686,952	インベスコ・オフィス・Ｊリート	264.318	6,012,934	22,748
ＧＬＰ投資法人	24.404	4,476,348	183,426	日本ビルファンド	6.676	4,640,954	695,169
日本プロロジスリート	12.144	4,455,172	366,862	ジャパンリアルエステイト	6.212	4,099,623	659,952
ジャパンリアルエステイト	6.303	4,096,537	649,934	ＧＬＰ投資法人	19.418	3,606,567	185,733
大和ハウスリート投資法人	12.155	3,960,229	325,810	日本プロロジスリート	9.725	3,565,867	366,670
野村不動産マスターＦ	20.383	3,364,783	165,077	野村不動産マスターＦ	20.089	3,317,831	165,156
日本都市ファンド投資法人	31.833	3,332,350	104,682	日本都市ファンド投資法人	28.716	2,954,606	102,890
アドバンス・レジデンス	7.815	2,816,234	360,362	大和ハウスリート投資法人	8.944	2,925,500	327,090
ユナイテッド・アーバン投資法人	17.598	2,619,604	148,858	オリックス不動産投資	12.38	2,313,124	186,843
日本プライムリアルティ	6.143	2,492,023	405,668	アドバンス・レジデンス	5.667	2,024,644	357,269

(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６月15日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（139,303,981千口）の内容です。

(1)国内投資信託証券

銘柄	2022年６月15日現在	
	口数	評価額
	千口	千円
エスコンジャパンリート	8.307	1,064,126
サンケイリアルエステート	13.067	1,253,125
SOSILA 物流リート投	19.191	2,721,283
東海道リート投資法	3.159	365,180
日本アコモデーションファンド投資法人	14.244	9,130,404
森ヒルズリート	48.511	6,995,286
産業ファンド	58.566	10,073,352
アドバンス・レジデンス	41.247	13,797,121
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	29.519	5,965,789
ＡＰＩ投資法人	21.986	8,662,484
ＧＬＰ投資法人	133.61	20,602,662
コンフォリア・レジデンシャル	19.191	6,150,715
日本プロロジスリート	67.495	21,463,410
星野リゾート・リート	6.913	4,562,580
Ｏｎｅリート投資法人	7.159	1,867,067
イオンリート投資	48.515	7,088,041
ヒューリックリート投資法	38.485	5,918,993
日本リート投資法人	12.73	4,563,705
積水ハウス・リート投資	125.223	9,454,336
トーセイ・リート投資法人	8.619	1,097,198
ケネディクス商業リート	16.471	4,328,578
ヘルスケア＆メディカル投資	10.106	1,516,910
サムティ・レジデンシャル	9.345	1,221,391
野村不動産マスターＦ	133.405	21,291,438
いちごホテルリート投資	6.834	610,276
ラサールロジポート投資	50.502	8,393,432
スターアジア不動産投	42.633	2,515,347
マリモ地方創生リート	4.831	645,421
三井不ロジパーク	16.25	8,222,500
大江戸温泉リート	6.659	443,489
投資法人みらい	49.971	2,408,602
森トラスト・ホテルリート投	9.679	1,179,870
三菱地所物流 REIT	11.985	5,177,520
CRE ロジスティクスファンド	15.977	3,027,641
ザイマックス・リート	6.658	814,939
タカラレーベン不動産投	16.268	1,830,150
アドバンス・ロジスティクス投資法人	16.085	2,380,580
日本ビルファンド	48.095	32,367,935
ジャパンリアルエステイト	41.254	24,876,162

銘柄		2022年６月15日現在	
銘柄	口数	金額	評価額
		千口	千円
日本都市ファンド投資法人	208.146	21,022,746	
オリックス不動産投資	82.197	14,392,694	
日本プライムリアルティ	28.189	10,937,332	
NTT 都市開発リート投資法人	39.543	5,658,603	
東急リアル・エステート	27.659	5,083,724	
グローバル・ワン不動産投資法人	28.263	2,916,741	
ユナイテッド・アーバン投資法人	92.869	12,537,315	
森トラスト総合リート	29.484	3,992,133	
インヴェンシブル投資法人	181.574	6,963,362	
フロンティア不動産投資	14.462	7,288,848	
平和不動産リート	28.123	3,900,660	
日本ロジスティクスファンド投資法人	27.816	8,525,604	
福岡リート投資法人	21.336	3,424,428	
ケネディクス・オフィス投資法人	12.762	8,001,774	
いちごオフィスリート投資法人	33.803	2,738,043	
大和証券オフィス投資法人	8.722	5,651,856	
阪急阪神リート投資法人	18.634	2,653,481	
スターツプロシード投資法人	6.424	1,478,804	
大和ハウスリート投資法人	61.942	17,963,180	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	126.383	7,709,363	
大和証券リビング投資法人	55.743	6,209,770	
ジャパンエクセレント投資法人	37.844	4,601,830	
合 計	口数、金額	2,410.663	429,701,345
	銘柄数 < 比率 >	61 銘柄	<97.3%>

(注１) < >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６月15日現在	
		買建額	売建額
国内	東証 ＲＥＩＴ	百万円 10,402	百万円 —

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

運用報告書 第36期（決算日 2022年3月15日）

（作成対象期間 2021年9月16日～2022年3月15日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	東京証券取引所が算出・公表する「東証ＲＥＩＴ指数」（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

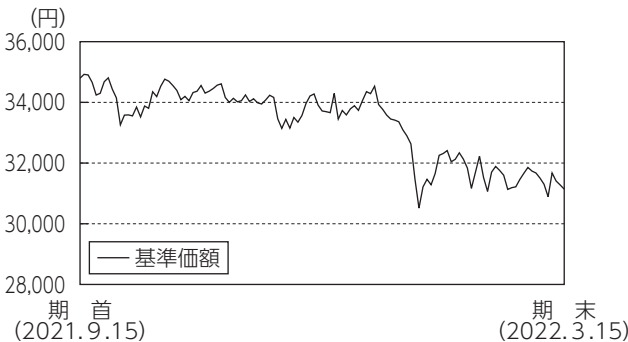
Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数(配当込み)		投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	%	%
(期首)2021年9月15日	34,797	—	4,692.90	—	96.7	2.5
9月末	34,150	△ 1.9	4,605.71	△ 1.9	97.1	2.5
10月末	34,555	△ 0.7	4,660.54	△ 0.7	97.5	2.5
11月末	33,143	△ 4.8	4,470.13	△ 4.7	97.5	2.5
12月末	34,288	△ 1.5	4,624.94	△ 1.4	97.5	2.5
2022年1月末	32,411	△ 6.9	4,372.24	△ 6.8	97.4	2.5
2月末	31,460	△ 9.6	4,243.65	△ 9.6	97.5	2.5
(期末)2022年3月15日	31,141	△10.5	4,200.48	△10.5	97.0	2.5

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注3) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：34,797円 期末：31,141円 騰落率：△10.5%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、新型コロナウイルスの新しい変異株であるオミクロン株が確認されたことなどを背景に国内リート市況が下落したことにより、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内リート市況

国内リート市況は下落しました。

国内リート市況は、当作成期首より、国内外で長期金利が上昇したことや、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念などから投資家のリスク回避姿勢が強まり、下落が続きました。その後は、割安感から買いが入り上昇に転じましたが、2021年11月に南アフリカにおいて新型コロナウイルスの新しい変異株であるオミクロン株が確認されたことが懸念され、軟調に推移しました。2022年に入ると、年初から公募増資の発表が相次ぎ、需給悪化から下落しました。加えて、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選好姿勢が悪化したことや、ウクライナ情勢の悪化などを背景に、軟調に推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

◆ポートフォリオについて

ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）については、当作成期を通じて99～100%程度としました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△10.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△10.5%となりました。

ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率の違い、先物取引の影響、売買等のコストなどが差異の要因となりました。

*ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。

《今後の運用方針》

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

■1万口当りの費用の明細

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

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。
(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2021年9月16日から2022年3月15日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内	千口 138.714	千円 27,144,862	千口 191.226 (—)	千円 35,916,458 (—)

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 売付()内は償還による減少分、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9月16日から2022年3月15日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 不動産投信指数先物取引	百万円 25,298	百万円 25,500	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
投資信託証券

(2021年9月16日から2022年3月15日まで)

当 期				期 末			
買 付		金 額		金 額		金 額	
銘柄	口数	千円	円	銘柄	口数	千円	円
日本ビルファンド	3,384	2,267,738	670,135	日本ビルファンド	3,69	2,524,525	684,153
日本プロロジスリート	5,049	1,890,675	374,465	ジャパンリアルエステイト	3,307	2,140,318	647,208
ジャパンリアルエステイト	1,923	1,239,860	644,753	G L P 投資法人	10,706	1,949,782	182,120
G L P 投資法人	6,225	1,147,436	184,327	日本プロロジスリート	5,23	1,899,349	363,164
野村不動産マスターフ	6,216	992,103	159,604	野村不動産マスターフ	10,69	1,717,991	160,710
日本都市ファンド投資法人	9.7	962,668	99,244	日本都市ファンド投資法人	16.68	1,638,533	98,233
大和ハウスリート投資法人	2,888	950,529	329,130	大和ハウスリート投資法人	4,965	1,617,214	325,723
三井不動産パーク	1,596	919,736	576,275	オリックス不動産投資	6,589	1,164,804	176,780
三菱地所物流 R E I T	1.92	855,871	445,766	アドバンス・レジデンス	3,306	1,155,348	349,470
日本プライムリアルティ	2,119	811,986	383,193	ユナイテッド・アーバン投資法人	7,441	1,015,159	136,427

(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	口数	当 期		期 末	
		口数	評価額	口数	評価額
		千口	千円	千口	千円
エスコンジャパンリート		8.096	7.818	1,029.630	
サンケイリアルエステート		12.735	12.297	1,301.022	
S O S I L A 物流リート投		16.867	18.061	2,709.150	
東海道リート投資法		3.079	2.973	325.543	
日本アコモデーションファンド投資法人		13.883	13.405	8,217.265	
森ヒルズリート		47.279	45.653	6,144.893	
産業ファンド		57.079	55.115	9,446.711	
アドバンス・レジデンス		40.201	38.817	12,518.482	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		27.461	27.781	5,422.851	
A P I 投資法人		21.428	20.691	8,038.453	
G L P 投資法人		130.219	125.738	21,790.395	
コンフォリア・レジデンシャル		18.103	18.06	5,508.300	
日本プロロジスリート		63.699	63.518	21,532.602	
星野リゾート・リート		6.203	6.506	4,176.852	
O n e リート投資法人		6.267	6.737	1,866.149	
イオンリート投資		47.284	45.657	6,419.374	
ヒューリックリート投資法		35.345	36.218	5,516.001	
日本リート投資法人		12.407	11.98	4,222.950	
積水ハウス・リート投資		118.257	117.845	8,732.314	
トーセイ・リート投資法人		8.401	8.112	1,027.790	
ケネディクス商業リート		16.053	15.501	4,100.014	
ヘルスケア&メディカル投資		8.576	9.51	1,383.705	
サムティ・レジデンシャル		9.108	8.794	1,019.224	
野村不動産マスターフ		130.019	125.545	18,630.878	
いちごホテルリート投資		6.661	6.432	512.630	
ラサールロジポート投資		49.22	47.527	7,851.460	
スターアジア不動産投		41.551	40.121	2,335.042	
マリモ地方創生リート		3.767	4.547	576.559	
三井不動産パーク		14.945	15.293	7,982.946	
大江戸温泉リート		6.49	6.266	409.796	
投資法人みらい		45.835	47.027	2,269.052	
森トラスト・ホテルリート投		9.433	9.109	1,069.396	
三菱地所物流 R E I T		10.218	11.279	4,900.725	
C R E ロジスティクスファンド		15.541	15.035	2,927.314	
ザイマックス・リート		5.836	6.266	721.843	
タカラレーベン不動産投		15.855	15.31	1,717.782	
伊藤忠アドバンスロジ		15.677	15.138	2,211.661	
日本ビルファンド		45.567	45.261	28,876.518	
ジャパンリアルエステイト		40.207	38.823	23,332.623	
日本都市ファンド投資法人		202.863	195.883	18,275.883	
オリックス不動産投資		80.111	77.354	12,546.818	
日本プライムリアルティ		26.423	26.528	9,841.888	
N T T 都市開発リート投資法人		36.315	37.213	5,418.212	
東急リアル・エステート		26.957	26.029	4,653.985	
グローバル・ワン不動産投資法人		27.919	26.959	2,890.004	
ユナイテッド・アーバン投資法人		90.512	87.397	10,811,008	
森トラスト総合リート		28.735	27.747	3,745.845	
インヴェンシブル投資法人		176.965	170.876	6,664.164	
フロンティア不動産投資		14.095	13.61	6,294.625	
平和不動産リート		26.047	25.151	3,337.537	
日本ロジスティクスファンド投資法人		26.27	26.177	7,709.126	
福岡リート投資法人		20.794	20.079	3,114.252	
ケネディクス・オフィス投資法人		12.438	12.01	8,106.750	
いちごオフィスリート投資法人		32.945	31.811	2,595.777	
大和証券オフィス投資法人		8.5	8.208	5,745.600	
阪急阪神リート投資法人		18.161	17.536	2,483.097	
スターツプロシード投資法人		6.261	6.046	1,347.653	
大和ハウスリート投資法人		60.37	58.293	17,866.804	
ジャパン・ホテル・リート投資法人		123.175	118.937	6,910.239	
大和証券リビング投資法人		52.589	52.459	5,828.194	
ジャパンエクセレント投資法人		37.308	36.024	4,463.373	
合 計	口数、金額、銘柄数<比率>	2,320.605 61銘柄	2,268.093 61銘柄	399,426,751 <97.0%>	

(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		期 末	
	買 建	売 建	買 建	売 建
国内 東証 R E I T	百万円 10,337		百万円 -	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年3月15日現在

項 目	当 期		期 末	
	評価額	比率	評価額	比率
投資信託証券	千円 399,426,751	% 96.4	千円 399,426,751	% 96.4
コール・ローン等、その他	14,762,613	3.6	14,762,613	3.6
投資信託財産総額	414,189,365	100.0	414,189,365	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

2022年3月15日現在

項 目	当 期	期 末
(A) 資産		419,218,740,625円
コール・ローン等		6,638,010,617
投資信託証券(評価額)		399,426,751,850
未収入金		3,181,884,052
未収配当金		4,806,079,106
差入委託証拠金		5,166,015,000
(B) 負債		7,276,441,000
未払金		184,856,000
未払解約金		2,062,210,000
差入委託証拠金代用有価証券		5,029,375,000
(C) 純資産総額(A－B)		411,942,299,625
元本		132,282,348,763
次期繰越損益金		279,659,950,862
(D) 受益権総口数		132,282,348,763口
1万口当り基準価額(C／D)		31,141円

* 期首における元本額は137,936,526,812円、当作成期間中における追加設定元本額は9,698,245,164円、同解約元本額は15,352,423,213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Ｊ－ＲＥＩＴオープン	4,717,690,898円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン (毎月分配型)	115,809,276,949円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン (年1回決算型)	349,988,867円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	10,912,637円
i F r e e J － R E I T インデックス	610,923,825円
i F r e e 8資産バランス	1,493,803,230円
DC・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	5,312,633,236円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,522,613円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	5,068,402円
ダイワ国内 R E I T インデックス (投資－任専用)	313,398円
ダイワ・ノーロード J － R E I T ファンド	95,801,012円
ダイワファンドラップ J － R E I T インデックス	2,074,049,260円
ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス (ダイワ S M A 専用)	321,257,153円
ダイワファンドラップオンライン J － R E I T インデックス	530,113,475円
ダイワ・インデックスセレクト J － R E I T	943,993,808円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は31,141円です。

■損益の状況

当期 自2021年9月16日 至2022年3月15日

項 目	当 期	期 末
(A) 配当等収益		7,977,261,954円
受取配当金		7,978,262,875
受取利息		1,318
その他収益金		345
支払利息	△	1,002,584
(B) 有価証券売買損益	△	55,710,936,011
売買益		252,573,529
売買損	△	55,963,509,540
(C) 先物取引等損益	△	1,237,417,990
取引損	△	1,237,417,990
(D) 当期損益金(A + B + C)	△	48,971,092,047
(E) 前期繰越損益金		342,046,097,462
(F) 解約差損益金	△	35,919,608,889
(G) 追加信託差損益金		22,504,554,336
(H) 合計(D + E + F + G)		279,659,950,862
次期繰越損益金(H)		279,659,950,862

(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。

東証 R E I T 指数の指数値および同指数にかかる標章または商標は、株式会社 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「 J P X 」といいます。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよび同指数にかかる標章または商標に関するすべての権利は J P X が有します。 J P X は、同指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、 J P X により提供、保証または販売されるものではなく、本商品の設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス (為替ヘッジあり)

運用報告書(全体版)

第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年 9月26日）		
運用方針	投資成果を S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの受益証券	
	先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	イ. 先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。） ロ. 先進国のリート指数との連動をめざす E T F（上場投資信託証券） ハ. 先進国のリートを対象としたリート指数先物取引	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2736>

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ヘッジ・円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指 先 物 比 率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2 期末 (2018年 6 月15日)	9,722	0	△ 1.2	9,861	△ 0.1	0.8	99.1	1.0	8,688
3 期末 (2019年 6 月17日)	10,760	0	10.7	11,020	11.8	0.6	98.4	1.0	10,895
4 期末 (2020年 6 月15日)	9,117	0	△ 15.3	9,402	△ 14.7	2.2	94.5	3.2	12,056
5 期末 (2021年 6 月15日)	12,187	0	33.7	12,690	35.0	0.9	97.8	1.7	17,785
6 期末 (2022年 6 月15日)	10,481	0	△ 14.0	11,006	△ 13.3	3.6	98.8	2.3	16,269

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注 2) S & P 先進国 REIT 指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスである S & P グローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとの REIT 制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

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

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

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

(注 6) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

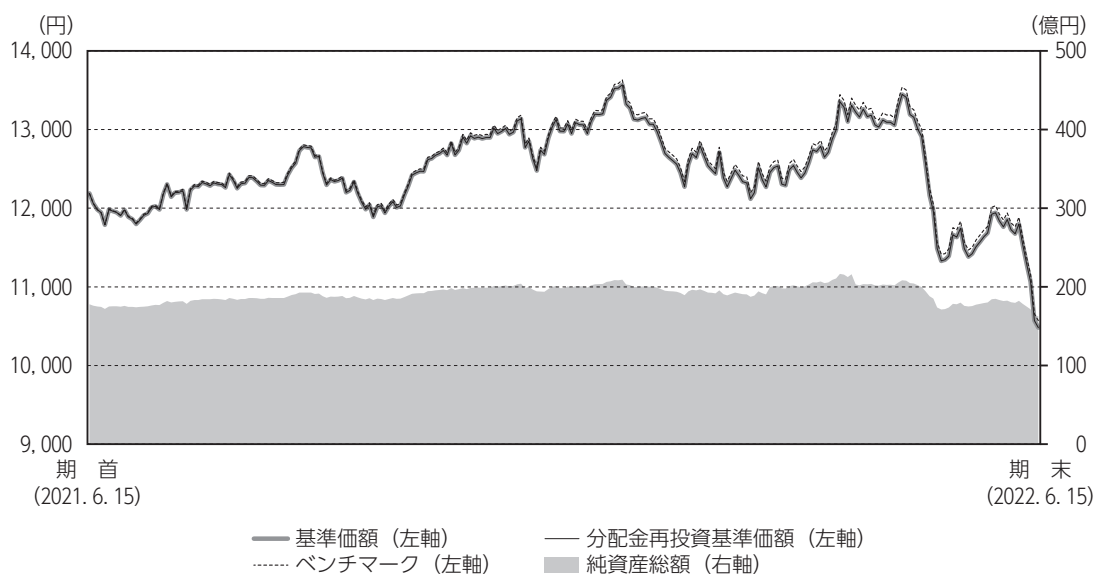
※当ファンドの約款変更に伴い、参考指数「S & P 先進国 REIT 指数（除く日本）（現地通貨ベース）」からベンチマーク「S & P 先進国 REIT 指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）」に変更しました。

S & P 先進国 REIT 指数（除く日本）（「当インデックス」）は S&P Dow Jones Indices LLC（「S P D J I」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's® および S & P® は Standard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones® は Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが S P D J I に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、S P D J I、Dow Jones、S & P またはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 REIT 指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。



運用経過

基準価額等の推移について



（注）分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期 首：12,187円

期 末：10,481円（分配金 0円）

騰落率：△14.0%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、海外リート市場の下落が主な要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ヘッジ・円ベース)		投資信託 受益証券 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	(ベンチマーク)	騰 落 率			
	円	%		%	%	%	%
(期首)2021年6月15日	12,187	—	12,690	—	0.9	97.8	1.7
6月末	11,859	△ 2.7	12,359	△ 2.6	0.8	98.0	1.7
7月末	12,285	0.8	12,812	1.0	2.0	95.0	1.6
8月末	12,514	2.7	13,057	2.9	1.5	97.1	2.0
9月末	12,041	△ 1.2	12,568	△ 1.0	0.5	98.8	2.0
10月末	12,824	5.2	13,384	5.5	1.4	98.2	2.9
11月末	12,852	5.5	13,426	5.8	0.9	96.1	2.2
12月末	13,523	11.0	14,134	11.4	1.7	97.5	2.6
2022年1月末	12,555	3.0	13,146	3.6	1.4	95.6	2.7
2月末	12,513	2.7	13,112	3.3	0.7	97.0	2.7
3月末	13,284	9.0	13,922	9.7	0.1	98.7	7.2
4月末	12,911	5.9	13,542	6.7	1.3	100.8	3.2
5月末	11,943	△ 2.0	12,528	△ 1.3	2.5	94.5	2.2
(期末)2022年6月15日	10,481	△ 14.0	11,006	△ 13.3	3.6	98.8	2.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展により経済活動の正常化が順次進んだことや、好調な経済指標の発表などからおおむね上昇しました。しかし2021年9月に入ると、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念から世界的に市場心理が悪化したことに加え、世界的にインフレの長期化が懸念されて長期金利が急上昇したことで、売られる展開となりました。10月については、好調な決算発表や米国長期金利の低下に加え、中国の大手不動産会社に対する信用不安の後退などから上昇に転じたものの、11月からは新型コロナウイルスの新変異株であるオミクロン株への懸念などから下落に転じました。その後は、年末にかけてオミクロン株への過度の懸念の後退などから上昇する局面はあったものの、2022年に入ると、2021年12月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）議事録を受けて米国の金融引き締めに対する懸念が高まり、米国を中心に下落に転じました。2月以降は、欧米の中央銀行高官の金融政策に対する発言やロシアのウクライナへの侵攻、ロシアとウクライナの断片的な停戦協定による状況改善期待などから、一進一退の展開となりました。4月以降は、米国の金融引き締めの加速懸念などからリスク回避の展開となり、海外リート市場も米国を中心に軟調に推移し、当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

引き続き「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。また、保有外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

ポートフォリオについて

（2021. 6. 16 ～ 2022. 6. 15）

■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」および「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の受益証券への投資を90～110%の範囲で行いました。また、2022年3月に主要投資対象を「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」から「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」に変更しました。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」が保有する外貨建資産の当ファンド相当分については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。なお、マザーファンドの組入比率が100%程度にならないのは、為替の売りヘッジ予約による評価損益が発生する影響が主因です。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウェイトで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物を組み入れました。

■先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウェイトで組成し、保有する外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物を組み入れました。

*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

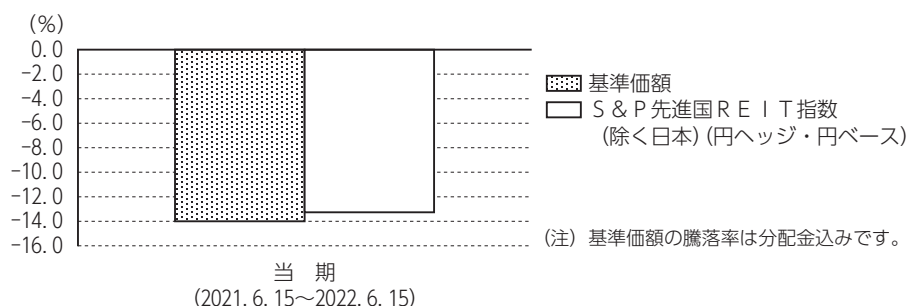
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）
先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△13.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△14.0%となりました。

マザーファンドについては、配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のズレも、かい離要因としてあげられます。また、為替ヘッジを行う時に、通貨間の金利差等による損益（為替ヘッジコスト）が発生します。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



*ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	3,133

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

主として「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の受益証券に投資します。

■先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場または店頭登録のリートに投資し、保有する外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	54円	0.434%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12,475円です。
（投 信 会 社）	(38)	(0.302)	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）	(14)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	4	0.034	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（先物・オプション）	(0)	(0.004)	
（投資信託受益証券）	(0)	(0.003)	
（投資信託証券）	(3)	(0.027)	
有価証券取引税	6	0.044	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（投資信託受益証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(5)	(0.044)	
そ の 他 費 用	2	0.015	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(1)	(0.005)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0.006)	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）	(1)	(0.004)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	66	0.527	

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

（注2）各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

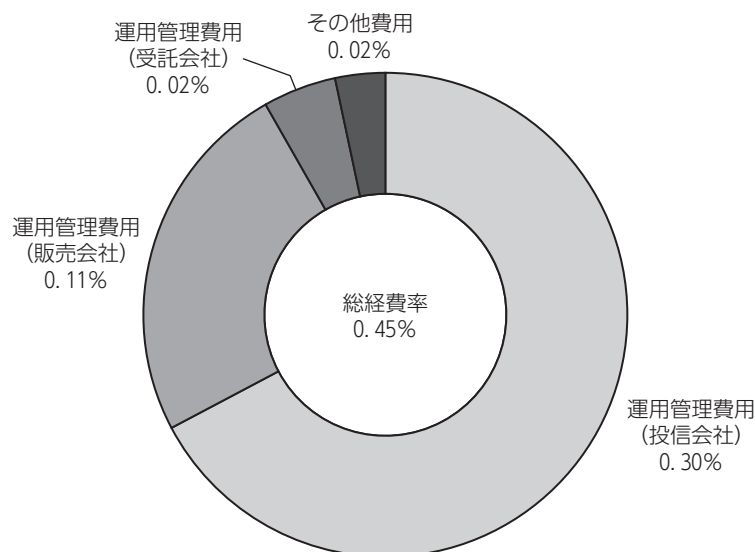
（注3）各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.45%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6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	20,677,310	22,060,398	2,141,320	2,300,681
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	1,311,187	3,966,820	7,417,704	24,600,072

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	—	18,535,989	16,269,038
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	6,106,516	—	—

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	16,269,038	99.7
コール・ローン等、その他	44,718	0.3
投資信託財産総額	16,313,756	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝135.01円、1カナダ・ドル＝104.20円、1オーストラリア・ドル＝93.10円、1香港・ドル＝17.20円、1シンガポール・ドル＝96.95円、1ニュージーランド・ドル＝83.95円、1イギリス・ポンド＝162.21円、1イスラエル・シェケル＝38.942円、100韓国・ウォン＝10.46円、1ユーロ＝140.80円です。

(注3) 先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（21,257,560千円）の投資信託財産総額（21,489,082千円）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

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	16,313,756,591円
コール・ローン等	44,718,355
先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド（評価額）	16,269,038,236
(B) 負債	44,227,541
未払解約金	1,342,516
未払信託報酬	42,349,051
その他未払費用	535,974
(C) 純資産総額（A－B）	16,269,529,050
元本	15,522,412,035
次期繰越損益金	747,117,015
(D) 受益権総口数	15,522,412,035口
1万口当り基準価額（C／D）	10,481円

＊期首における元本額は14,593,897,109円、当作成期間中における追加設定元本額は5,111,449,724円、同解約元本額は4,182,934,798円です。

＊当期末の計算口数当りの純資産額は10,481円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 7,213円
受取利息	1,240
支払利息	△ 8,453
(B) 有価証券売買損益	△ 2,650,781,471
売買益	3,569,464,782
売買損	△ 6,220,246,253
(C) 信託報酬等	△ 84,654,240
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 2,735,442,924
(E) 前期繰越損益金	2,541,462,080
(F) 追加信託差損益金	941,097,859
(配当等相当額)	(2,321,738,980)
(売買損益相当額)	(△ 1,380,641,121)
(G) 合計（D＋E＋F）	747,117,015
次期繰越損益金（G）	747,117,015
追加信託差損益金	941,097,859
(配当等相当額)	(2,321,738,980)
(売買損益相当額)	(△ 1,380,641,121)
分配準備積立金	2,541,468,191
繰越損益金	△ 2,735,449,035

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	2,321,738,980
(d) 分配準備積立金	2,541,468,191
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	4,863,207,171
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	4,863,207,171
(h) 受益権総口数	15,522,412,035口

《お知らせ》

■投資対象ファンドの変更について

当ファンドの投資対象ファンドを「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」から「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」に変更しました。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の第1期決算日が到来しておりませんので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在における先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	□数	金額	平均単価	銘柄	□数	金額	平均単価
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 107.449	千円 1,400,753	円 13,036	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 43.937	千円 575,901	円 13,107

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	□数	金額	平均単価	銘柄	□数	金額	平均単価
PROLOGIS INC (アメリカ)	千口 98.06	千円 1,866,778	円 19,037	PROLOGIS INC (アメリカ)	千口 12.507	千円 258,005	円 20,628
EQUINIX INC (アメリカ)	11.929	1,048,731	87,914	EQUINIX INC (アメリカ)	1.519	142,322	93,694
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	20.215	900,173	44,529	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	2.577	125,134	48,558
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	43.546	704,404	16,176	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	5.555	89,621	16,133
WELLTOWER INC (アメリカ)	57.646	643,034	11,154	WELLTOWER INC (アメリカ)	7.323	87,822	11,992
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	37.583	634,199	16,874	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	4.774	87,699	18,370
REALTY INCOME CORP (アメリカ)	73.57	604,370	8,214	REALTY INCOME CORP (アメリカ)	9.518	84,301	8,857
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	18.509	544,810	29,434	GOODMAN GROUP (オーストラリア)	39.715	83,793	2,109
GOODMAN GROUP (オーストラリア)	249.655	508,682	2,037	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	2.351	72,336	30,768
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	45.257	483,169	10,676	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	5.749	63,807	11,098

(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6月15日現在における先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド（23,434,151千口）の内容です。

(1) 外国投資信託受益証券

銘柄	2022年6月15日現在		
	□数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円
VANGUARD REAL ESTATE ETF	63.512	5,545	748,747
合計	□数、金額 銘柄数<比率>	63.512 1銘柄	5,545 <3.6%>

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	2022年6月15日現在		
	□数	評価額	
		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
MANULIFE US REAL ESTATE INV	203.4	118	16,064
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	95.4	65	8,822
PRIME US REIT	68.4	47	6,418
(アメリカ)			
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15.189	292	39,475
URBAN EDGE PROPERTIES	12.73	189	25,625
XENIA HOTELS & RESORTS INC	13.204	204	27,631
AVALONBAY COMMUNITIES INC	16.158	2,992	403,990
SIMON PROPERTY GROUP INC	37.991	3,666	495,015
BOSTON PROPERTIES INC	16.434	1,489	201,107
APARTMENT INVNT & MGMT CO -A	18.583	108	14,702

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

銘 柄	2022年6月15日現在		
	口 数	価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
VORNADO REALTY TRUST	18.382	532	71,871
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	9.959	187	25,318
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9.474	432	58,326
NEXPOINT RESIDENTIAL	2.627	160	21,631
EQUITY RESIDENTIAL	39.508	2,717	366,870
APPLE HOSPITALITY REIT INC	24.552	363	49,124
EPR PROPERTIES	8.648	376	50,859
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.427	89	12,085
CITY OFFICE REIT INC	5.316	60	8,224
GLOBAL NET LEASE INC	11.978	157	21,233
EQUINIX INC	10.41	6,438	869,287
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8.943	220	29,762
CHATHAM LODGING TRUST	5.953	65	8,816
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6.366	507	68,517
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	14.038	216	29,262
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2.867	94	12,726
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6.929	35	4,789
HOST HOTELS & RESORTS INC	82.551	1,418	191,474
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	34.138	1,124	151,819
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17.628	286	38,698
RLJ LODGING TRUST	19.259	225	30,447
FARMLAND PARTNERS INC	3.465	48	6,483
PHYSICIANS REALTY TRUST	25.468	421	56,906
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8.218	104	14,168
KIMCO REALTY CORP	71.293	1,368	184,805
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7.367	79	10,761
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	25.532	690	93,277
WHITESTONE REIT	5.635	60	8,102
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	27.151	1,174	158,612
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14.352	186	25,131
PARK HOTELS & RESORTS INC	27.34	419	56,622
INVITATION HOMES INC	68.994	2,320	313,259
JBG SMITH PROPERTIES	13.198	305	41,250
ALEXANDER & BALDWIN INC	8.385	152	20,614
CLIPPER REALTY INC	1.647	12	1,681
GLADSTONE LAND CORP	3.8	83	11,312
AMERICOLD REALTY TRUST	30.842	892	120,505
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7.984	110	14,972
VICI PROPERTIES INC	97.469	2,741	370,170
BRT APARTMENTS CORP	1.402	29	3,920
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3.145	359	48,524
SAFEHOLD INC	1.726	59	8,053
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	15.076	102	13,779
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	14.055	282	38,103
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4.224	75	10,179
STORE CAPITAL CORP	28.372	703	94,958
CREATIVE MEDIA AND COMMUNITY TRUST	1.854	12	1,739
BROADSTONE NET LEASE INC	18.644	360	48,605
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	12.994	97	13,174
LIFE STORAGE INC	9.483	971	131,128
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6.088	175	23,671
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	25.513	536	72,369
PARAMOUNT GROUP INC	18.985	138	18,659
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	16.35	109	14,767
NETSTREIT CORP	4.837	90	12,277
APARTMENT INCOME REIT CO	18.149	715	96,639
CTO REALTY GROWTH INC	0.728	41	5,653
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	18.528	1,073	144,909
STAG INDUSTRIAL INC	20.373	619	83,644
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1.311	22	3,090
INDUS REALTY TRUST INC	0.807	46	6,289
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2.085	29	4,031
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	13.116	419	56,683
ORION OFFICE REIT INC	6.912	80	10,815
VENTAS INC	46.15	2,235	301,753
CARETRUST REIT INC	11.218	187	25,277
INVENTRUST PROPERTIES CORP	7.776	202	27,295
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	34.434	686	92,746
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5.911	114	15,482
SABRA HEALTH CARE REIT INC	26.438	347	46,901
UMH PROPERTIES INC	5.564	94	12,762
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3.127	75	10,153

銘 柄	2022年6月15日現在		
	口 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
IRON MOUNTAIN INC	33.475	1,582	213,680
TERRENO REALTY CORP	8.728	478	64,668
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	14.764	534	72,216
SUN COMMUNITIES INC	13.407	2,024	273,394
ACADIA REALTY TRUST	10.226	164	22,214
ALEXANDER'S INC	0.262	56	7,675
PROLOGIS INC	85.553	9,467	1,278,179
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16.827	2,277	307,535
BRANDYWINE REALTY TRUST	19.784	188	25,401
SAUL CENTERS INC	1.591	67	9,141
VERIS RESIDENTIAL INC	9.253	130	17,564
CAMDEN PROPERTY TRUST	11.815	1,488	200,988
COUSINS PROPERTIES INC	17.19	507	68,557
SITE CENTERS CORP	20.756	260	35,140
DUKE REALTY CORP	44.031	2,254	304,364
EASTGROUP PROPERTIES INC	4.704	715	96,647
ESSEX PROPERTY TRUST INC	7.543	1,932	260,919
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	15.063	706	95,378
FEDERAL REALTY INVS TRUST	8.18	778	105,092
GETTY REALTY CORP	4.815	121	16,349
WELLTOWER INC	50.323	3,897	526,203
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	62.35	1,461	197,314
HIGHWOODS PROPERTIES INC	12.127	407	55,077
SERVICE PROPERTIES TRUST	19.087	106	14,353
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	17.058	424	57,344
EQUITY COMMONWEALTH	13.075	356	48,191
KILROY REALTY CORP	12.144	602	81,289
LTC PROPERTIES INC	4.552	162	21,939
LXP INDUSTRIAL TRUST	32.697	334	45,203
MID-AMERICA APARTMENT COMM	13.334	2,133	288,089
MACERICH CO/THE	24.63	228	30,792
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19.96	1,370	185,051
NATL HEALTH INVESTORS INC	5.301	299	40,422
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	20.305	804	108,640
REALTY INCOME CORP	65.408	4,106	554,481
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	12.986	333	45,023
PENN REAL ESTATE INVEST TST	7.636	2	298
PUBLIC STORAGE	17.638	5,253	709,248
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2.325	432	58,366
REGENCY CENTERS CORP	17.815	1,008	136,134
RPT REALTY	10.289	99	13,391
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	12.022	174	23,615
SL GREEN REALTY CORP	7.411	364	49,167
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	29.173	53	7,247
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3.682	58	7,918
UDR INC	34.575	1,463	197,548
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.565	77	10,515
WP CAREY INC	22.036	1,784	240,892
WASHINGTON REIT	9.785	216	29,182
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4.132	23	3,218
AGREE REALTY CORP	8.241	552	74,545
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	27.628	764	103,173
CUBESMART	25.297	983	132,754
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	25.358	262	35,399
DIGITAL REALTY TRUST INC	32.809	4,087	551,788
CEDAR REALTY TRUST INC	1.501	37	5,064
EXTRA SPACE STORAGE INC	15.48	2,457	331,759
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4.032	40	5,454
CENTERSPACE	1.734	133	18,059
KITE REALTY GROUP TRUST	25.32	440	59,481
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1.965	50	6,767
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	16.088	1,036	139,922
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4.549	82	11,165
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	24.35	216	29,192
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	68.999	1,030	139,174
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	11.605	46	6,267
DOUGLAS EMMETT INC	20.288	459	62,095
アメリカ・ドル通貨計	口 数、金 額	2,922,589	113,621
	銘 柄 数 < 比 率 >	149 銘柄	<74.6%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2	14	1,475

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

銘 柄		2022年6月15日現在		
		口 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
		千口	千カナダ・ドル	千円
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T		4.6	16	1,754
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I		5.6	22	2,316
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS		3.6	36	3,833
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN		5.725	73	7,629
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		7.1	85	8,922
SLATE GROCERY REIT		3.6	51	5,326
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		6.7	113	11,847
SLATE OFFICE REIT		4.9	22	2,384
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		2.5	38	4,011
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		13	158	16,499
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI		11	185	19,370
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E		5.5	33	3,478
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E		2.4	31	3,261
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		4	316	33,014
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		14.6	178	18,636
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		8.1	99	10,415
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		13	185	19,303
CHOICE PROPERTIES REIT		19.8	271	28,244
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		2.4	40	4,251
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		6.2	98	10,284
PLAZA RETAIL REIT		6.3	27	2,822
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		8.8	239	24,913
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		10.5	463	48,337
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		17.1	216	22,575
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		18.7	376	39,185
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV		3	58	6,126
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		2.7	119	12,463
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		6.1	96	10,011
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		7.7	265	27,712
カナダ・ドル通貨計	口 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	227.225 30 銘柄	3,938	410,410
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)				
DEXUS/AU		132.82	1,204	112,155
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI		33.012	51	4,794
HOME CONSORTIUM LTD		21.693	98	9,189
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN		46.291	38	3,555
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR		39.378	123	11,474
CROMWELL PROPERTY GROUP		167.757	117	10,932
CENTURIA INDUSTRIAL REIT		65.291	191	17,810
RURAL FUNDS GROUP		45.313	121	11,348
WAYPOINT REIT		87.433	196	18,315
CHARTER HALL LONG WALE REIT		75.404	327	30,467
CENTURIA OFFICE REIT		52.359	91	8,530
CENTURIA CAPITAL GROUP		75.235	145	13,553
IRONGATE GROUP		65.105	123	11,455
HOMECO DAILY NEEDS REIT		176.023	219	20,402
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA		137.848	365	34,009
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		34.802	121	11,275
NATIONAL STORAGE REIT		133.591	287	26,740
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT		26.502	70	6,563
GDI PROPERTY GROUP		64.299	61	5,746
SCENTRE GROUP		640.95	1,634	152,164
ARENA REIT		41.056	159	14,830
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS		22.847	73	6,806
BWP TRUST		58.372	214	19,998
GPT GROUP		236.551	984	91,615
CHARTER HALL RETAIL REIT		64.281	244	22,741
MIRVAC GROUP		486.873	998	92,922
STOCKLAND		294.787	1,061	98,800
ABACUS PROPERTY GROUP		45.39	122	11,409
GOODMAN GROUP		209.94	3,760	350,058
VICINITY CENTRES		477.829	833	77,627
CHARTER HALL GROUP		57.635	658	61,277
INGENIA COMMUNITIES GROUP		43.391	154	14,421
オーストラリア・ドル通貨計	口 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	4,160.058 32 銘柄	14,854	1,382,995
		千口	千香港・ドル	千円
(香港)				
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		289	884	15,210
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		128	483	8,322
FORTUNE REIT		183	1,237	21,277
PROSPERITY REIT		156	413	7,110

銘 柄		2022年6月15日現在		
		口 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
		千口	千香港・ドル	千円
LINK REIT		255.7	17,489	300,825
CHAMPION REIT		241	845	14,549
香 港 ・ ド ル 通 貨 計		1,252.7	21,354	367,296
銘 柄 数 < 比 率 >		6 銘柄		<1.8%>
(シンガポール)		千口	千シンガポール・ドル	千円
KEPPEL DC REIT		163.3	315	30,555
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		153.8	43	4,249
AIMS APAC REIT		57.8	78	7,565
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL		355.3	454	44,091
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT		66.4	52	5,085
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL		203.2	159	15,464
EC WORLD REIT		32.9	19	1,881
IREIT GLOBAL		64.5	39	3,814
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRST		414.7	1,140	110,564
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL		628.4	1,332	129,157
SUNTEC REIT		265.6	438	42,487
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		390.1	631	61,268
KEPPEL REIT		243	274	26,621
ASCOTT RESIDENCE TRUST		238.7	269	26,150
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		621.4	248	24,097
CDL HOSPITALITY TRUSTS		103.4	129	12,530
FRASERS CENTREPOINT TRUST		132.4	295	28,624
STARHILL GLOBAL REIT		166.8	95	9,217
CAPITALAND CHINA TRUST		133.9	151	14,669
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		45.9	220	21,360
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		236.7	572	55,534
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		267.2	470	45,592
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		124.3	79	7,712
SPH REIT		113	106	10,298
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT		284.1	109	10,604
シンガポール・ドル通貨計		5,506.8	7,727	749,200
銘 柄 数 < 比 率 >		25 銘柄		<3.6%>
(ニュージーランド)		千口	千ニュージーランド・ドル	千円
ARGOSY PROPERTY LTD		107.307	126	10,584
KIWI PROPERTY GROUP LTD		199.256	189	15,891
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST		54.226	145	12,222
GOODMAN PROPERTY TRUST		132.996	266	22,385
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND		164.981	219	18,420
ニュージーランド・ドル通貨計		658.766	947	79,505
銘 柄 数 < 比 率 >		5 銘柄		<0.4%>
(イギリス)		千口	千イギリス・ポンド	千円
ASSURA PLC		347.117	230	37,387
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		71.016	62	10,102
STANDARD LIFE INV PROP INC		51.354	40	6,630
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		100.969	81	13,249
PICTON PROPERTY INCOME LTD		64.471	61	9,903
REGIONAL REIT LTD		54.681	43	7,069
NEWRIVER REIT PLC		39.166	34	5,597
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES		101.897	151	24,528
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		73.284	58	9,521
CUSTODIAN REIT PLC		51.902	53	8,705
PRS REIT PLC/THE		64.664	69	11,202
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		45.413	55	8,987
LXI REIT PLC		109.114	155	25,239
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		46.825	40	6,630
AEW UK REIT PLC		20.041	24	3,933
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST		94.111	108	17,555
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		117.956	149	24,204
HOME REIT PLC		66.127	75	12,206
LAND SECURITIES GROUP PLC		88.454	647	104,970
SEGRO PLC		141.566	1,351	219,254
HAMMERSON PLC		417.915	95	15,496
UNITE GROUP PLC/THE		46.99	497	80,719
BRITISH LAND CO PLC		110.429	559	90,745
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		29.888	185	30,058
DERWENT LONDON PLC		13.211	364	59,188
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		156.924	214	34,720
WORKSPACE GROUP PLC		16.231	106	17,297
SAFESTORE HOLDINGS PLC		24.82	251	40,864
SHAFTESBURY PLC		33.926	194	31,588

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

銘柄		2022年6月15日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千イギリス・ポンド	千円
BIG YELLOW GROUP PLC		20.359	254	41,280
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		115.214	265	43,059
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		71.398	40	6,497
TRITAX BIG BOX REIT PLC		219.898	398	64,597
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	3,027.331	6,923	1,122,994
	銘柄数 < 比率 >	33銘柄		<5.5%>
(イスラエル)		千口	千イスラエル・シェケル	千円
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT		26.7	243	9,494
REIT 1 LTD		25.897	458	17,850
イスラエル・シェケル通貨計	口数、金額	52.597	702	27,344
	銘柄数 < 比率 >	2銘柄		<0.1%>
(韓国)		千口	千韓国・ウォン	千円
SK REITS LTD		7.476	50,238	5,254
D&D PLATFORM REIT LTD		6.865	35,698	3,734
JR GLOBAL		2.822	588	61
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		7.432	58,712	6,141
LOTTE REIT CO LTD		15.417	92,347	9,659
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1		11.781	56,195	5,878
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD		3.918	22,724	2,376
JR REIT XXVII		14.711	80,910	8,463
KORAMCO ENERGY PLUS REIT		5.393	33,868	3,542
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L		18.659	116,991	12,237
韓国・ウォン通貨計	口数、金額	94.474	548,275	57,349
	銘柄数 < 比率 >	10銘柄		<0.3%>
ユーロ (アイルランド)		千口	千ユーロ	千円
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		53.167	68	9,686
HIBERNIA REIT PLC		76.097	121	17,121
国小計	口数、金額	129.264	190	26,808
	銘柄数 < 比率 >	2銘柄		<0.1%>
ユーロ (オランダ)		千口	千ユーロ	千円
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		4.541	101	14,245
WERELDHAVE NV		4.993	70	9,884
NSI NV		2.198	75	10,692
VASTNED RETAIL NV		2.242	50	7,055
国小計	口数、金額	13.974	297	41,877
	銘柄数 < 比率 >	4銘柄		<0.2%>
ユーロ (ベルギー)		千口	千ユーロ	千円
AEDIFICA		4.175	396	55,786
COFINIMMO		3.389	381	53,729
BEFIMMO		2.813	132	18,615
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS		2.935	72	10,248
RETAIL ESTATES		1.308	80	11,289
WAREHOUSES DE PAUW SCA		16.147	496	69,932
CARE PROPERTY INVEST		3.339	77	10,883
XIOR STUDENT HOUSING NV		2.396	98	13,932
MONTEA NV		1.175	99	14,045
国小計	口数、金額	37.677	1,835	258,463
	銘柄数 < 比率 >	9銘柄		<1.3%>
ユーロ (フランス)		千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		13.386	716	100,834
ICADE		3.682	173	24,448
CARMILA		5.596	74	10,542
ALTAREA		0.528	66	9,411
GECINA SA		6.251	598	84,229
KLEPIERRE		22.429	422	59,433
COVIVIO		5.437	308	43,405
MERCIALYS		6.169	50	7,066
国小計	口数、金額	63.478	2,410	339,371
	銘柄数 < 比率 >	8銘柄		<1.7%>
ユーロ (ドイツ)		千口	千ユーロ	千円
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		1.766	22	3,167
HAMBORNER REIT AG		8.773	72	10,240
国小計	口数、金額	10.539	95	13,407
	銘柄数 < 比率 >	2銘柄		<0.1%>
ユーロ (スペイン)		千口	千ユーロ	千円
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		7.263	35	4,969
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		31.023	201	28,348

銘 柄		2022年6月15日現在		
		口 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		千口 38.351	千ユーロ 370	千円 52,108
国 小 計	口 数 、 金 額	76.637	606	85,426
	銘 柄 数 < 比 率 >	3 銘柄		<0.4%>
ユーロ（イタリア） COIMA RES SPA IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZI		千口 2.686 6.703	千ユーロ 26 23	千円 3,728 3,317
国 小 計	口 数 、 金 額	9.389	50	7,046
	銘 柄 数 < 比 率 >	2 銘柄		<0.0%>
ユーロ（その他） CROMWELL REIT EUR		千口 38.3	千ユーロ 77	千円 10,947
国 小 計	口 数 、 金 額	38.3	77	10,947
	銘 柄 数 < 比 率 >	1 銘柄		<0.1%>
ユ ー ロ 通 貨 計	口 数 、 金 額	379.258	5,563	783,349
	銘 柄 数 < 比 率 >	31 銘柄		<3.8%>
合 計	口 数 、 金 額	18,281.798	—	20,320,475
	銘 柄 数 < 比 率 >	323 銘柄		<98.8%>

（注1）邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

（注2）< >内は純資産総額に対する評価額の比率。

（注3）評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘 柄 別		2022年6月15日現在	
		買 建 額	売 建 額
外 国	DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	百万円 379	百万円 —
	STOXX 600 REAL (ドイツ)	95	—

（注1）外貨建の評価額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

（注2）単位未満は切捨て。

ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド

運用報告書 第17期（決算日 2021年11月30日）

（作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日）

ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

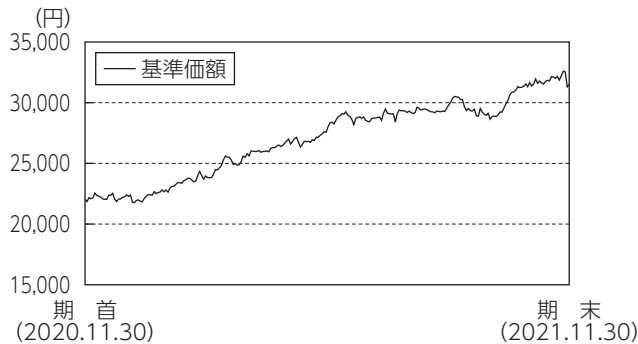
運用方針	S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

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）（円ベース）		投資信託 受益証券 組入比率		不動産 投資指数 先物比率	
	円	騰落率	（ベンチマーク）	騰落率	%	%	%	%
(期首)2020年11月30日	22,044	% -	25,605	% -	0.5	97.0	2.5	
12月末	22,276	1.1	25,887	1.1	0.7	97.1	2.2	
2021年1月末	22,806	3.5	26,474	3.4	1.0	96.6	2.4	
2月末	24,006	8.9	27,999	9.3	0.9	96.6	2.4	
3月末	25,793	17.0	29,872	16.7	0.7	97.0	2.3	
4月末	27,005	22.5	31,406	22.7	1.6	96.7	1.8	
5月末	27,611	25.3	32,186	25.7	0.7	97.7	1.7	
6月末	28,466	29.1	33,118	29.3	0.8	97.6	1.7	
7月末	29,191	32.4	34,044	33.0	2.0	96.3	1.7	
8月末	29,804	35.2	34,715	35.6	1.5	97.0	2.0	
9月末	29,119	32.1	33,918	32.5	0.5	97.5	2.0	
10月末	31,656	43.6	36,792	43.7	1.3	95.9	2.9	
(期末)2021年11月30日	31,508	42.9	36,654	43.1	0.9	97.0	2.3	

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース）は、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、S & P グローブ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスである S & P グローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとの R E I T 制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注5) 不動産投資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：22,044円 期末：31,508円 騰落率：42.9%

【基準価額の主な変動要因】

米国を中心としたリート市況の上昇等を受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は上昇しました。

海外リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン開発で高い効果を示す結果が報告され、経済活動正常化への期待が高まったことなどから、上昇しました。2021年に入っても、各国におけるワクチン接種の進展や渡航制限、行動規制の緩和などにより、上昇傾向が続きました。しかし9月に入ると、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念から世界的に市場心理が悪化したことに加えインフレの長期化が懸念されて長期金利が急上昇したことで、売られる展開となりました。10月以降は、好調な決算発表や米国長期金利の低下に加え、中国大手不動産会社に対する信用不安の後退などから、再度上昇に転じました。当作成期末にかけては、新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念から、不安定な相場展開となりました。

○為替相場

為替相場は上昇（円安）しました。

対円為替相場は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展などで市場のリスク選好度が強まったことで、おおむね上昇しました。2021年に入っても、米国の追加経済対策への期待が高まったことや、世界的にワクチン接種が進み感染状況が改善基調にあったことなどから、おおむね円安傾向となりました。7月以降は、新型コロナウイルスの変異株の影響により世界的に感染が再拡大し、景気回復への不透明感が高まったことなどから、円高に転じました。しかし9月以降は、インフレ懸念から世界的に金利が上昇したことで日本との金利差拡大などが意識され、再度円安が進行しました。当作成期末にかけては、新たな変異株への懸念から、おおむね円高となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

また、運用の効率化を図るため、E T F（上場投資信託証券）ならびに不動産投資指数先物取引を利用することがあります。

◆ポートフォリオについて

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウェイトで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行います。

また、運用の効率化を図るため、E T F（上場投資信託証券）および不動産投資指数先物を組み入れました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は43.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は42.9%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。

なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

*ベンチマークは S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース）です。

《今後の運用方針》

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

また、運用の効率化を図るため、E T F（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（「当インデックス」）は S & P Dow Jones Indices LLC（「S P D J I」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®および S & P®は Standard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®は Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが S P D J I に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、S P D J I、Dow Jones、S & P またはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	4円
（先物・オプション）	(1)
（投資信託受益証券）	(1)
（投資信託証券）	(2)
有価証券取引税	3
（投資信託受益証券）	(0)
（投資信託証券）	(3)
その他費用	17
（保管費用）	(7)
（その他）	(10)
合 計	23

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

(注 2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 716.6 (-)	千アメリカ・ドル 70,733 (-)	千口 700.15 (-)	千アメリカ・ドル 69,035 (-)

(注 1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注 4) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 1,438.7 (△ 249.81)	千アメリカ・ドル 59,811 (△ 1,626)	千口 217.753 (-)	千アメリカ・ドル 12,693 (-)
	カナダ	千口 119.6 (△ 10.8)	千カナダ・ドル 2,136 (△ 198)	千口 15.2 (-)	千カナダ・ドル 327 (-)
	オーストラリア	千口 1,952.08 (4,741)	千オーストラリア・ドル 8,098 (27)	千口 586.648 (-)	千オーストラリア・ドル 2,691 (-)
	香港	千口 329.7 (-)	千香港ドル 8,843 (-)	千口 19 (-)	千香港ドル 1,361 (-)
	シンガポール	千口 3,018.1 (891.885)	千シンガポール・ドル 4,660 (42)	千口 2,182.22 (-)	千シンガポール・ドル 1,219 (-)
	ニュージーランド	千口 291.95 (-)	千ニュージーランド・ドル 526 (-)	千口 - (-)	千ニュージーランド・ドル - (-)
	イギリス	千口 1,536.61 (△ 69.036)	千イギリス・ポンド 3,619 (△ 65)	千口 128.23 (-)	千イギリス・ポンド 616 (-)
	イスラエル	千口 20 (-)	千イスラエル・シェケル 349 (-)	千口 - (-)	千イスラエル・シェケル - (-)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	韓国	千口 93.93 (20.575)	千韓国ウォン 577,802 (34,813)	千口 - (-)	千韓国ウォン - (-)
	ユーロ (アイルランド)	千口 63 (-)	千ユーロ 80 (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)
	ユーロ (オランダ)	千口 5.55 (0.457)	千ユーロ 106 (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)
	ユーロ (ベルギー)	千口 21.07 (0.68)	千ユーロ 1,141 (28)	千口 2.88 (-)	千ユーロ 194 (-)
	ユーロ (フランス)	千口 37.9 (0.13)	千ユーロ 1,661 (17)	千口 9.98 (-)	千ユーロ 613 (-)
	ユーロ (ドイツ)	千口 16.94 (-)	千ユーロ 226 (△ 21)	千口 2.6 (-)	千ユーロ 46 (-)
	ユーロ (スペイン)	千口 43.07 (-)	千ユーロ 357 (△ 37)	千口 9.5 (-)	千ユーロ 89 (-)
	ユーロ (イタリア)	千口 12.19 (-)	千ユーロ 62 (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)
	ユーロ (その他)	千口 70 (△ 283.68)	千ユーロ 54 (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)
	ユーロ (ユーロ 通貨計)	千口 269.72 (△ 282.413)	千ユーロ 3,690 (△ 13)	千口 24.96 (-)	千ユーロ 945 (-)

(注 1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注 4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	不動産投信指数先物取引	百万円 4,583	百万円 4,460	百万円 -	百万円 -

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘柄	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
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)		716.6	7,762,024	10,831	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)		700.15	7,590,754	10,841

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘柄	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
PROLOGIS INC (アメリカ)		36.6	448,224	12,246	PROLOGIS INC (アメリカ)		9.3	126,652	13,618
EQUINIX INC (アメリカ)		4.7	378,799	80,595	EQUINIX INC (アメリカ)		1.1	93,308	84,825
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		16.8	259,246	15,431	GOODMAN GROUP (オーストラリア)		42.049	74,392	1,769
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT (アメリカ)		11.3	221,399	19,592	PUBLIC STORAGE (アメリカ)		2	65,114	32,557
PUBLIC STORAGE (アメリカ)		7.6	221,005	29,079	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		4.4	61,403	13,955
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		17.4	212,800	12,229	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		3.6	59,690	16,580
REALTY INCOME CORP (アメリカ)		28.2	199,312	7,067	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD (フランス)		6.46	56,998	8,823
WELLTOWER INC (アメリカ)		21.1	172,105	8,156	UDR INC (アメリカ)		8.6	49,608	5,768
GOODMAN GROUP (オーストラリア)		104.78	170,916	1,631	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)		5.7	49,572	8,696
SUN COMMUNITIES INC (アメリカ)		9.5	167,703	17,653	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		2	46,515	23,257

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国投資信託受益証券

銘柄	柄	期首		期末	
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
VANGUARD REAL ESTATE ETF		17.5	33.95	3,693	420,239
合 計	口数、金額 銘柄数<比率>	17.5	33.95	3,693	420,239
		1銘柄	1銘柄		<0.9%>

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
 (注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
 (注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	柄	期首		期末	
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
MANULIFE US REAL ESTATE INV		320.562	364.562	258	29,448
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		151.4	193.4	152	17,382
EAGLE HOSPITALITY TRUST		90	90	3	350
PRIME US REIT		99	147	121	13,797
(アメリカ)					
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST		29.5	33.2	714	81,246
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP		13.7	—	—	—
URBAN EDGE PROPERTIES		21.982	28.682	499	56,876
XENIA HOTELS & RESORTS INC		25.4	28.8	461	52,523
AVALONBAY COMMUNITIES INC		31.4	36	8,668	986,167
SIMON PROPERTY GROUP INC		71.847	84.847	13,570	1,543,907
BOSTON PROPERTIES INC		31.4	36.7	4,049	460,709
APARTMENT INVT & MGMT CO -A		32.467	36.789	280	31,893
VORNADO REALTY TRUST		35.064	41.064	1,707	194,255
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI		18	21.2	444	50,529
NATIONAL STORAGE AFFILIATES		13.9	21.1	1,307	148,761
NEXPOINT RESIDENTIAL		4.8	5.5	423	48,187
QTS REALTY TRUST INC-CL A		13.6	—	—	—
EQUITY RESIDENTIAL		76.5	88	7,587	863,213
APPLE HOSPITALITY REIT INC		43.8	54.8	843	95,950
EPR PROPERTIES		16.1	18.9	895	101,878
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH		3.5	7.1	106	12,164
CITY OFFICE REIT INC		9.3	10.9	184	20,945
GLOBAL NET LEASE INC		19.833	25.933	374	42,603
EQUINIX INC		19.6	23.2	19,024	2,164,360
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST		15.529	19.829	539	61,361
CHATHAM LODGING TRUST		7.4	10.8	133	15,137
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT		7.1	8.8	129	14,697
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES		12.3	14.2	1,153	131,213
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN		25.7	31.4	558	63,516
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I		4.9	6	261	29,700
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC		—	13.1	60	6,900
HOST HOTELS & RESORTS INC		157.6	184.3	3,026	344,291
AMERICAN HOMES 4 RENT- A		59.008	70.708	2,874	327,006
CORESITE REALTY CORP		9.5	11.4	1,953	222,263

銘柄	柄	期首		期末	
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN		34.1	39.4	973	110,718
RLJ LODGING TRUST		35.871	41.871	540	61,498
FARMLAND PARTNERS INC		2.9	6.7	78	8,987
PHYSICIANS REALTY TRUST		46.1	56.1	1,015	115,587
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN		14	15.7	224	25,506
CYRUSONE INC		25.9	32	2,860	325,400
KIMCO REALTY CORP		94.4	158.362	3,686	419,432
GLOBAL MEDICAL REIT INC		9.8	15.6	256	29,142
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A		48.85	56.55	1,923	218,874
WHITESTONE REIT		8.5	11.2	106	12,066
GAMING AND LEISURE PROPERTIE		46.349	57.437	2,629	299,154
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A		27.2	32.3	575	65,447
PARK HOTELS & RESORTS INC		51.68	61.08	1,097	124,874
DIGITALBRIDGE GROUP INC		105.011	126.711	1,046	119,075
INVITATION HOMES INC		125.297	148.797	6,140	698,644
JBG SMITH PROPERTIES		25.132	29.932	857	97,597
ALEXANDER & BALDWIN INC		16.5	18.7	417	47,507
CLIPPER REALTY INC		1.4	1.4	12	1,427
GLADSTONE LAND CORP		4.5	6.4	183	20,889
AMERICOLD REALTY TRUST		45.1	67.4	2,183	248,446
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT		14.3	16.9	376	42,818
VICI PROPERTIES INC		118.2	157.4	4,427	503,735
RETAIL VALUE INC		2.815	4.49	27	3,075
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A		12.5	—	—	—
BRT APARTMENTS CORP		1.3	2.9	54	6,222
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP		10.1	—	—	—
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER		4.9	6.1	1,619	184,290
SAFEHOLD INC		3.2	3.3	233	26,599
WASHINGTON PRIME GROUP INC		29.96	—	—	—
AMERICAN FINANCE TRUST INC		22.4	29.6	239	27,243
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY		22.9	30.5	834	94,973
CORECIVIC INC		25.224	—	—	—
COREPOINT LODGING INC		6.7	10.7	165	18,832
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC		3.4	7.4	225	25,661
STORE CAPITAL CORP		50.5	63.1	2,128	242,215

銘柄	期首		期末	
	□数	□数	評価価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2.4	5.9	41	4,752
BROADSTONE NET LEASE INC	—	41	1,042	118,573
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	22.4	25.3	231	26,337
LIFE STORAGE INC	10.4	20.25	2,708	308,138
AMERICAN ASSETS TRUST INC	10.1	13.2	464	52,892
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	20.082	26.582	664	75,545
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	9.2	12.2	165	18,835
PARAMOUNT GROUP INC	36.4	40.2	332	37,869
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29.2	36.5	346	39,366
NETSTREIT CORP	—	9.9	216	24,655
APARTMENT INCOME REIT CO	—	40.489	2,100	238,935
CTO REALTY GROWTH INC	—	1.2	66	7,605
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	27.4	35.6	2,527	287,565
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	23.7	29.7	568	64,639
STAG INDUSTRIAL INC	32.5	41.8	1,816	206,630
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	—	2.6	46	5,324
INDUS REALTY TRUST INC	—	1.1	81	9,324
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	—	3.2	56	6,411
ORION OFFICE REIT INC	—	14.223	264	30,097
VENTAS INC	83.379	101.629	4,992	567,941
CARETRUST REIT INC	21.503	24.503	494	56,255
GEO GROUP INC/THE	27.4	31.6	269	30,630
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	64.3	76.7	1,794	204,104
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	10.6	11.8	284	32,313
SABRA HEALTH CARE REIT INC	44.987	56.987	742	84,478
UMH PROPERTIES INC	8.6	10.6	245	27,966
IRON MOUNTAIN INC	63.8	74.7	3,500	398,245
TERRENO REALTY CORP	15.2	18.2	1,389	158,049
VEREIT INC	240.908	—	—	—
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22.32	30.72	1,406	160,071
SUN COMMUNITIES INC	21.8	29.9	5,882	669,289
ACADIA REALTY TRUST	17.011	22.811	487	55,433
ALEXANDER'S INC	0.4	0.5	129	14,760
PROLOGIS INC	163.619	190.919	29,264	3,329,372
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26.2	35.8	7,348	836,017
BRANDYWINE REALTY TRUST	38.3	43.3	578	65,814
SAUL CENTERS INC	2.4	3.2	160	18,316
MACK-CALI REALTY CORP	20.2	20.1	343	39,081
CAMDEN PROPERTY TRUST	21.8	26	4,390	499,461
COUSINS PROPERTIES INC	32.906	38.406	1,480	168,486
SITE CENTERS CORP	31.878	46.278	722	82,240
DUKE REALTY CORP	82.1	97.7	5,808	660,806
EASTGROUP PROPERTIES INC	8.7	10.4	2,128	242,202
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14.467	16.767	5,809	660,977
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	27.8	33.3	2,032	231,290
FEDERAL REALTY INVS TRUST	15.4	18.1	2,280	259,443
GETTY REALTY CORP	7.703	9.803	302	34,440
WELLTOWER INC	93.2	109.1	8,950	1,018,305
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	120.3	139.2	4,741	539,400
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23.1	26.9	1,182	134,505
SERVICE PROPERTIES TRUST	36.5	41.7	372	42,413
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30.1	37.6	1,187	135,048
EQUITY COMMONWEALTH	27.375	31.475	804	91,563
KILROY REALTY CORP	23.2	27.1	1,762	200,560
LTC PROPERTIES INC	8.4	9.6	306	34,851
LEXINGTON REALTY TRUST	60	70.1	1,055	120,027
MID-AMERICA APARTMENT COMM	25.328	29.928	6,284	715,030
MACERICH CO/THE	21.979	54.979	1,089	123,910
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	37.5	44.1	3,740	425,563
NATL HEALTH INVESTORS INC	9.6	11.9	622	70,793
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	38.4	45.3	2,057	234,084
REALTY INCOME CORP	77.117	142.239	9,928	1,129,540
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	24	28.5	731	83,233
PENN REAL ESTATE INVEST TST	—	17	20	2,359
PUBLIC STORAGE	33.8	39.4	13,076	1,487,709
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4.3	5.1	892	101,586
REGENCY CENTERS CORP	34.92	39.52	2,796	318,150
RPT REALTY	17.8	21.1	276	31,471
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17.6	26.3	532	60,620
SL GREEN REALTY CORP	16.4	17.357	1,222	139,118
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	49	57.5	162	18,513
TAUBMAN CENTERS INC	13.3	—	—	—
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6	7.6	144	16,462
UDR INC	65.3	72	4,137	470,762
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2.6	3.1	173	19,753
WP CAREY INC	38.5	47.6	3,748	426,466
WASHINGTON REIT	17.8	21.6	553	62,934
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	25.9	—	—	—
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	—	7	78	8,903
AGREE REALTY CORP	11.7	17.8	1,236	140,684
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50.748	61.648	1,711	194,700
CUBESMART	43.3	52.1	2,862	325,711
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45.526	56.326	636	72,412
DIGITAL REALTY TRUST INC	59.778	72.978	12,317	1,401,413

銘柄	期首		期末	
	□数	□数	評価価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
CEDAR REALTY TRUST INC	—	3.1	68	7,783
EXTRA SPACE STORAGE INC	28.6	34.5	7,005	796,984
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7.875	7.875	72	8,206
CENTERSPACE	2.46	3.66	377	42,930
KITE REALTY GROUP TRUST	18.95	55.741	1,133	128,925
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	21	24.9	517	58,838
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2.233	3.633	120	13,726
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	30.5	35.9	1,884	214,428
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6.3	8.8	193	22,025
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	42.342	54.342	498	56,693
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	117.1	153.8	3,305	376,028
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21	21	124	14,167
DOUGLAS EMMETT INC	36.5	45.3	1,517	172,651
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	46.7	—	—	—
アメリカ・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	5,540.075 155銘柄	6,511.212 157銘柄	315,743 35,922,148 <73.9%>
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	—	4.2	39	3,557
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	—	9.4	38	3,431
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	—	11.4	50	4,477
NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT UNITS	—	4.3	52	4,694
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13.1	17.1	197	17,614
SLATE GROCERY REIT	8.1	7	93	8,335
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10.2	14.7	337	30,126
SLATE OFFICE REIT	5.1	5.1	25	2,262
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4.2	4.2	93	8,311
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	19.7	28	382	34,115
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	17.6	22.2	514	45,952
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11.2	11.2	81	7,277
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	8.5	—	—	—
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4.1	4.1	55	4,940
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6.2	8.5	858	76,622
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	18.3	27	452	40,416
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	16.2	17.5	298	26,617
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	24.7	27.6	508	45,379
CHOICE PROPERTIES REIT	36.8	43.2	628	56,143
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4.2	4.2	75	6,718
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11.9	14.1	244	21,785
PLAZA RETAIL REIT	11.1	11.1	51	4,587
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	16.3	19.1	592	52,850
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	19.5	22.8	1,332	118,973
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21.79	21.79	252	22,522
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	32.566	38.166	620	55,358
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	34.3	42	929	82,926
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5.4	7.2	162	14,460
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4.7	5.9	325	29,033
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9.5	12.3	216	19,355
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13.3	16.8	723	64,541
カナダ・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	388.556 27銘柄	482.156 30銘柄	10,232 913,388 < 1.9%>
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU	—	284.343	3,085	250,789
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	78.38	93.38	344	28,010
CROMWELL PROPERTY GROUP	435.284	371.284	317	25,805
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	95.11	144.87	533	43,337
AVENTUS GROUP	88	103	342	27,881
RURAL FUNDS GROUP	78.595	108.595	321	26,129
WAYPOINT REIT	177.83	202.491	532	43,291
CHARTER HALL LONG WALE REIT	98.668	149.458	720	58,560
CENTURIA OFFICE REIT	84.95	118.83	263	21,444
CENTURIA CAPITAL GROUP	97.59	166.05	524	42,654
IRONGATE GROUP	119.63	149.63	235	19,157
HOME CONSORTIUM	35	48	363	29,537
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	17.5	130.34	183	14,939
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	241.86	291.52	816	66,353
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	70.547	79.167	323	26,256
NATIONAL STORAGE REIT	206.195	288.195	708	57,631
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	29.76	54.67	179	14,576
GDI PROPERTY GROUP	123.31	123.31	135	10,976
SCENTRE GROUP	1,194.91	1,372.159	4,171	339,090
ARENA REIT	79.89	93.89	415	33,811
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38.3	47.12	160	13,023
BWP TRUST	105.55	123.87	510	41,485
DEXUS	251.73	—	—	—
GPT GROUP	444	506.413	2,628	213,653
CHARTER HALL RETAIL REIT	120.4	139.51	574	46,723
MIRVAC GROUP	908.06	1,042.307	3,022	245,714
STOCKLAND	550.01	631.087	2,745	223,159
ABACUS PROPERTY GROUP	81.12	107.93	385	31,321
GOODMAN GROUP	381.71	444.441	10,911	886,957
VICINITY CENTRES	878.9	1,022.946	1,733	140,948
CHARTER HALL GROUP	105.06	123.136	2,335	189,884
INGENIA COMMUNITIES GROUP	68.66	94.74	582	47,363
オーストラリア・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	7,286.509 31銘柄	8,656.682 31銘柄	40,109 3,260,470 < 6.7%>

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

銘柄	期首	当	期末	
	□ 数	□ 数	評 価 額	外貨建金額 邦貨換算金額
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	349	398	1,337	19,510
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193	250	1,135	16,559
FORTUNE REIT	311	378	3,046	44,451
PROSPERITY REIT	300	300	930	13,568
LINK REIT	476.9	564.6	38,788	565,917
CHAMPION REIT	431	481	1,972	28,772
香港ドル □ 数、金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	2,060.9 6銘柄	2,371.6 6銘柄	47,209	688,780 < 1.4%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
KEPPEL DC REIT	293.783	331.683	786	65,410
FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	126.2	419.876	123	10,306
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	455	583.9	589	49,072
AIMS APAC REIT	89	119	166	13,862
FRASERS HOSPITALITY TRUST	121.8	—	—	—
FRASERS LOGISTICS & COMMERC	591.19	783.99	1,160	96,548
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86	134	119	9,923
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	208.9	208.9	181	15,122
EC WORLD REIT	57	57	46	3,889
IREIT GLOBAL	105.124	175.124	111	9,253
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	722.377	905.877	2,708	225,380
CAPITALAND INTEGRATED COMMERC	1,029.422	1,346.522	2,881	239,774
SUNTEC REIT	473.4	565.4	853	71,040
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	608.2	770.8	1,472	122,504
KEPPEL REIT	375.4	501.4	556	46,310
ASCOTT RESIDENCE TRUST	417.456	505.456	505	42,058
ESR-REIT	559.902	709.902	340	28,354
CDL HOSPITALITY TRUSTS	161.6	191.6	216	18,015
FRASERS CENTREPOINT TRUST	211.776	281.176	649	54,046
STARHILL GLOBAL REIT	308.8	383.8	247	20,598
CAPITALAND CHINA TRUST	179.396	269.442	320	26,680
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	86.3	98.3	491	40,897
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	467.2	—	—	—
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	384.78	513.769	1,376	114,571
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	244.5	354.5	317	26,400
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	498.484	579.884	1,211	100,846
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182.1	248.1	145	12,076
SPH REIT	220.6	275.6	278	23,162
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	202.1	—	—	—
SABANA INDUSTRIAL REIT TRUST	219.4	—	—	—
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	541.063	651.063	289	24,107
(非上場)				
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	10.046	—	—	—
シンガポール・ドル □ 数、金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	10,238.299 32銘柄	11,966.064 27銘柄	18,149	1,510,218 < 3.1%>
(ニュージーランド)	千口	千口	千ニュージーランド・ドル	千円
ARGOSY PROPERTY LTD	158.52	224.47	317	24,625
KIWI PROPERTY GROUP LTD	357.92	423.8	483	37,457
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	76.8	102.92	293	22,781
GOODMAN PROPERTY TRUST	248.22	299.22	725	56,256
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	245.82	328.82	506	39,259
ニュージーランド・ドル □ 数、金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	1,087.28 5銘柄	1,379.23 5銘柄	2,326	180,380 < 0.4%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
ASSURA PLC	594.52	707.1	483	73,249
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	129.57	159.57	129	19,613
STANDARD LIFE INV PROP INC	100	100	74	11,276
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	177.71	220.71	168	25,589
PICTON PROPERTY INCOME LTD	121.11	146.11	145	22,011
REGIONAL REIT LTD	81.31	111.31	100	15,166
NEURIVER REIT PLC	69.33	69.33	61	9,288
CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	183.29	224.81	374	56,696
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	135.49	155.49	143	21,680
CUSTODIAN REIT PLC	89.42	109.42	106	16,086
GCP STUDENT LIVING PLC	96.86	112.86	237	36,006
PRS REIT PLC/THE	—	119.64	123	18,676
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	67.9	90.9	107	16,366
LXI REIT PLC	118.038	180.188	269	40,800
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	75.2	98.2	93	14,124
AEW UK REIT PLC	25.61	49.61	55	8,451
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	180	201.12	206	31,274
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	150	207	251	38,118
HOME REIT PLC	—	60	70	10,684
RDI REIT PLC	41.036	—	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	166.381	198.461	1,490	225,891
SEGRO PLC	263.74	317.05	4,494	681,138
HAMMERSON PLC	811.984	1,076.984	332	50,453
UNITE GROUP PLC/THE	87.26	105.39	1,143	173,306
BRITISH LAND CO PLC	208.52	247.76	1,291	195,788
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	53.581	67.061	483	73,280
DERWENT LONDON PLC	24.39	29.63	1,014	153,807
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	283.37	346.37	519	78,796
WORKSPACE GROUP PLC	26.46	32.26	263	39,896
SAFESTORE HOLDINGS PLC	46.35	54.57	731	110,826
SHAFTESBURY PLC	53.85	75.77	484	73,495
BIG YELLOW GROUP PLC	36.96	45.64	739	112,058

銘柄	期首	当	期末	
	□ 数	□ 数	評 価 額	外貨建金額 邦貨換算金額
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	203.15	237.15	645	97,763
TRITAX BIG BOX REIT PLC	121.6	121.6	63	9,657
イギリス・ポンド □ 数、金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	5,194.25 33銘柄	6,533.594 34銘柄	17,987	2,726,240 < 5.6%>
(イスラエル)	千口	千口	千イスラエル・シェケル	千円
REIT 1 LTD	28.84	48.84	1,050	37,813
イスラエル・シェケル □ 数、金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	28.84 1銘柄	48.84 1銘柄	1,050	37,813 < 0.1%>
(韓国)	千口	千口	千韓国ウォン	千円
ESR KENDALL SQUARE REIT LTD	—	13.16	987	94
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6	11.44	91,520	8,767
LOTTE REIT CO LTD	17.96	34.375	192,500	18,441
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	17.96	25.06	122,418	11,727
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	—	5.6	32,704	3,133
JR REIT XXVII	—	31.29	168,340	16,126
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	—	8.5	55,760	5,341
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	—	27	175,500	16,812
韓国ウォン □ 数、金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	41.92 3銘柄	156.425 8銘柄	839,729	80,446 < 0.2%>
ユーロ (アイルランド)	千口	千口	千ユーロ	千円
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	82.05	102.05	156	20,075
HIBERNIA REIT PLC	116.24	159.24	207	26,582
国 小 計 □ 数、金額 銘柄数<比率>	198.29 2銘柄	261.29 2銘柄	363	46,658 < 0.1%>
ユーロ (オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	—	9.887	176	22,725
WERELDHAVE NV	6.47	8.97	107	13,833
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES-CV	8.23	—	—	—
NSI NV	3.231	4.131	141	18,115
VASTNED RETAIL NV	3.75	4.7	105	13,609
国 小 計 □ 数、金額 銘柄数<比率>	21.681 4銘柄	27.688 4銘柄	531	68,284 < 0.1%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円
AEDIFICA	6.256	8.886	1,060	136,127
COFINIMMO	5.3	6.88	961	123,419
BEFIMMO	5.07	5.86	186	23,891
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	4.61	5.48	148	19,034
RETAIL ESTATES	1.94	2.54	175	22,537
WAREHOUSES DE PAUW SCA	25.48	34.45	1,420	182,345
CARE PROPERTY INVEST	4.9	6.1	156	20,052
XIOR STUDENT HOUSING NV	2.7	4.58	224	28,817
MONTEA NV	2.15	2.5	320	41,091
国 小 計 □ 数、金額 銘柄数<比率>	58.406 9銘柄	77.276 9銘柄	4,651	597,318 < 1.2%>
ユーロ (フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円
ALTAREA RIGHTS	—	0.01	0	2
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	26.77	28.68	1,720	220,967
ICADE	5.94	7.67	488	62,689
CARMILA	10	11.8	151	19,455
ALTAREA	0.74	1.01	162	20,880
CECINA SA	10.521	13.391	1,598	205,226
KLEPIERRE	39.94	48.64	926	119,014
COVIVIO	8.992	11.652	854	109,763
MERCIALYS	4.03	12.13	102	13,138
国 小 計 □ 数、金額 銘柄数<比率>	106.933 8銘柄	134.983 9銘柄	6,005	771,140 < 1.6%>
ユーロ (ドイツ)	千口	千口	千ユーロ	千円
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	34.82	43.86	853	109,656
HAMBORNER REIT AG	11.98	17.28	163	21,050
国 小 計 □ 数、金額 銘柄数<比率>	46.8 2銘柄	61.14 2銘柄	1,017	130,707 < 0.3%>
ユーロ (スペイン)	千口	千口	千ユーロ	千円
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10.53	14.53	68	8,853
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	50.033	63.533	522	67,101
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	66.1	82.17	815	104,775
国 小 計 □ 数、金額 銘柄数<比率>	126.663 3銘柄	160.233 3銘柄	1,407	180,730 < 0.4%>
ユーロ (イタリア)	千口	千口	千ユーロ	千円
COIMA RES SPA	—	5.19	37	4,818
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6.24	13.24	46	5,993
国 小 計 □ 数、金額 銘柄数<比率>	6.24 1銘柄	18.43 2銘柄	84	10,811 < 0.0%>
ユーロ (その他)	千口	千口	千ユーロ	千円
CROMWELL REIT EUR	294.6	80.92	204	26,289
国 小 計 □ 数、金額 銘柄数<比率>	294.6 1銘柄	80.92 1銘柄	204	26,289 < 0.1%>
ユーロ通貨計	859.613 30銘柄	821.96 32銘柄	14,266	1,831,939 < 3.8%>
合 計 □ 数、金額 銘柄数<比率>	32,726.242 323銘柄	38,927.763 331銘柄	—	47,151.826 <97.0%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国	百万円	百万円
	DJ US REAL ESTATE（アメリカ）892	—
	STOXX 600 REAL（ドイツ）210	—

(注1) 外貨建の評価額は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 420,239	% 0.9
投資信託証券	47,151,826	96.7
コール・ローン等、その他	1,208,291	2.4
投資信託財産総額	48,780,356	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1香港ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.21円、1ニュージーランド・ドル=77.53円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シェケル=36.01円、100韓国ウォン=9.58円、1ユーロ=128.41円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（48,020,659千円）の投資信託財産総額（48,780,356千円）に対する比率は、98.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	49,434,462,118円
コール・ローン等	751,562,447
投資信託受益証券(評価額)	420,239,075
投資信託証券(評価額)	47,151,826,564
未収入金	668,763,396
未収配当金	56,716,807
差入委託証拠金	385,353,829
(B) 負債	805,521,183
未払金	803,305,110
未払株式払込金	2,215,073
未払解約金	1,000
(C) 純資産総額(A－B)	48,628,940,935
元本	15,433,680,362
次期繰越損益金	33,195,260,573
(D) 受益権総口数	15,433,680,362口
1万口当り基準価額(C／D)	31,508円

* 期首における元本額は13,110,290,968円、当作成期間中における追加設定元本額は5,480,584,788円、同解約元本額は3,157,195,394円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：
ダイワファンドラップ 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり） 6,291,808,323円
ダイワファンドラップ 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし） 1,162,934,430円
ダイワファンドラップオンライン 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり） 333,980,799円
ダイワファンドラップオンライン 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし） 289,623,388円
D－I’s グローバル R E I T インデックス 2,223,608円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050 8,326,903円
i F r e e 外国 R E I T インデックス 632,249,938円
i F r e e 8資産バランス 1,462,352,614円
グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型） 236,948,723円
グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型） 113,742,003円
DCダイワ・グローバル R E I T インデックスファンド 3,300,676,766円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030 6,106,352円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040 5,186,807円
ダイワバランスファンド2020－07（適格機関投資家専用） 183,749,014円
ダイワバランスファンド2021－02（適格機関投資家専用） 184,925,099円
ダイワ・インデックスセレクト グローバル R E I T 243,151,995円
ダイワ・ノーロード グローバル R E I T ファンド 59,517,654円
ダイワ外国 R E I T インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワ S M A 専用） 912,182,345円
ダイワ外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワ S M A 専用） 3,993,601円
* 当期末の計算口数当りの純資産額は31,508円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月1日 至2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,170,369,078円
受取配当金	1,166,078,286
受取利息	273
その他収益金	4,393,512
支払利息	△ 102,993
(B) 有価証券売買損益	12,530,341,971
売買益	12,953,251,906
売買損	△ 422,909,935
(C) 先物取引等損益	199,972,869
取引益	211,186,295
取引損	△ 11,213,426
(D) その他費用	△ 24,978,913
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	13,875,705,005
(F) 前期繰越損益金	15,789,555,929
(G) 解約差損益金	△ 5,533,781,623
(H) 追加信託差損益金	9,063,781,262
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	33,195,260,573
次期繰越損益金(I)	33,195,260,573

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。
(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス (為替ヘッジなし)

運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2022年6月15日)
(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）		
運用方針	投資成果をS＆P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2737>

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 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	(ベンチマーク)	期 中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2 期末 (2018年 6 月15日)	10,864	0	1.3	11,093	2.9	0.8	97.8	1.0	1,189
3 期末 (2019年 6 月17日)	11,931	0	9.8	12,298	10.9	0.6	98.2	1.0	1,667
4 期末 (2020年 6 月15日)	10,120	0	△ 15.2	10,533	△ 14.4	2.2	94.6	3.2	2,091
5 期末 (2021年 6 月15日)	14,252	0	40.8	14,945	41.9	0.9	97.3	1.7	3,226
6 期末 (2022年 6 月15日)	14,737	0	3.4	15,564	4.1	4.0	94.8	1.8	3,454

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

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

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

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

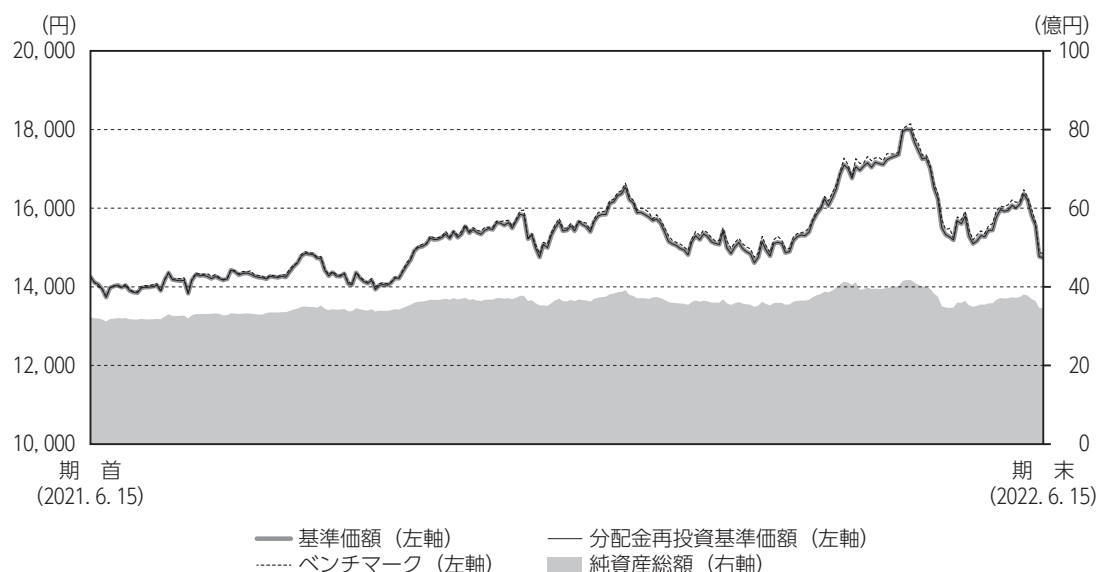
(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

S & P先進国REIT指数（除く日本）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's® およびS & P® はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones® はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P先進国REIT指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任を負いません。



運用経過

基準価額等の推移について



（注）分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

*ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）です。

■基準価額・騰落率

期 首：14,252円

期 末：14,737円（分配金0円）

騰落率：3.4%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券を通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、リート市況は下落したものの、為替相場が上昇（円安）したことを受けて、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 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	(ベンチマーク)	騰 落 率			
	円	%		%	%	%	%
(期首)2021年 6 月15日	14,252	—	14,945	—	0.9	97.3	1.7
6 月末	13,865	△ 2.7	14,555	△ 2.6	0.8	97.6	1.7
7 月末	14,213	△ 0.3	14,962	0.1	2.0	96.3	1.7
8 月末	14,506	1.8	15,257	2.1	1.5	97.0	2.0
9 月末	14,167	△ 0.6	14,906	△ 0.3	0.5	97.5	2.0
10 月末	15,396	8.0	16,169	8.2	1.3	95.9	2.9
11 月末	15,318	7.5	16,109	7.8	0.9	97.0	2.3
12 月末	16,322	14.5	17,195	15.1	1.7	95.8	2.6
2022年 1 月末	15,149	6.3	15,963	6.8	1.5	95.8	2.7
2 月末	15,142	6.2	16,023	7.2	0.7	96.5	2.7
3 月末	17,015	19.4	17,943	20.1	0.9	96.9	2.1
4 月末	17,281	21.3	18,206	21.8	—	98.6	1.5
5 月末	15,964	12.0	16,830	12.6	2.0	96.2	1.8
(期末)2022年 6 月15日	14,737	3.4	15,564	4.1	4.0	94.8	1.8

(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. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展により経済活動の正常化が順次進んだことや、好調な経済指標の発表などからおおむね上昇しました。しかし2021年9月に入ると、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念から世界的に市場心理が悪化したことに加え、世界的にインフレの長期化が懸念されて長期金利が急上昇したことで、売られる展開となりました。10月については、好調な決算発表や米国長期金利の低下に加え、中国の大手不動産会社に対する信用不安の後退などから上昇に転じたものの、11月からは新型コロナウイルスの新変異株であるオミクロン株への懸念などから下落に転じました。その後は、年末にかけてオミクロン株への過度の懸念の後退などから上昇する局面はあったものの、2022年に入ると、2021年12月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）議事録を受けて米国の金融引き締めに対する懸念が高まり、米国を中心に下落に転じました。2月以降は、欧米の中央銀行高官の金融政策に対する発言やロシアのウクライナへの侵攻、ロシアとウクライナの断片的な停戦協定による状況改善期待などから、一進一退の展開となりました。4月以降は、米国の金融引き締めの加速懸念などからリスク回避の展開となり、海外リート市場も米国を中心に軟調に推移し、当作成期末を迎えました。

■為替相場

為替相場は上昇しました。

為替相場は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大を受け、おおむね対円で下落（円高）しました。2021年9月からは、FRB（米国連邦準備制度理事会）による金融引き締め観測等から米国金利が上昇したことで、米ドル高が進行しました。その後も、インフレ懸念から世界的に金利が上昇したことで、日本との金利差拡大などが意識され、おおむね円安となりました。2022年3月以降は、ウクライナ情勢などを受けて資源価格が高騰したことや、米国で早期の金融政策正常化が意識されたことから米国金利が上昇した一方で、日銀は金融緩和姿勢を継続したことから金融政策の相違が意識され、円安が進行しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

主として「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

ポートフォリオについて

（2021. 6. 16 ～ 2022. 6. 15）

■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ100%行いました。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエイトで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物を組み入れました。

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）

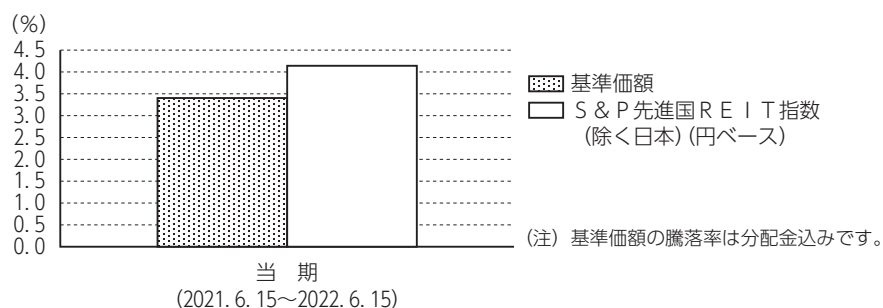
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は4.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は3.4%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。

なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	4,737

- （注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
 （注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
 （注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

■当ファンド

主として「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	66円	0. 434%	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15, 223円です。
(投 信 会 社)	(46)	(0. 302)	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)	(17)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	4	0. 029	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(1)	(0. 004)	
(投資信託受益証券)	(1)	(0. 004)	
(投資信託証券)	(3)	(0. 021)	
有価証券取引税	1	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
(投資信託受益証券)	(0)	(0. 000)	
(投資信託証券)	(1)	(0. 009)	
そ の 他 費 用	11	0. 069	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)	(4)	(0. 029)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(5)	(0. 035)	みなし配当にかかる税金支払い、信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	82	0. 542	

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

(注 2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

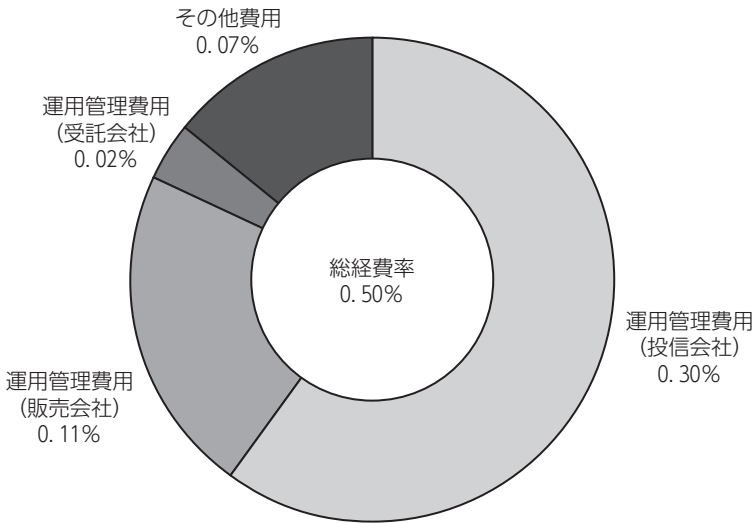
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1 口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0. 50%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6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	258,009	803,035	224,183	726,240

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	1,102,903	1,136,729	3,453,951

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	3,453,951	99.8
コール・ローン等、その他	8,529	0.2
投資信託財産総額	3,462,480	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝135.01円、1カナダ・ドル＝104.20円、1オーストラリア・ドル＝93.10円、1香港・ドル＝17.20円、1シンガポール・ドル＝96.95円、1ニュージーランド・ドル＝83.95円、1イギリス・ポンド＝162.21円、1イスラエル・シェケル＝38.942円、100韓国・ウォン＝10.46円、1ユーロ＝140.80円です。

(注3) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(25,085,971千円)の投資信託財産総額(25,549,246千円)に対する比率は、98.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,462,480,857円
コール・ローン等	8,434,244
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド(評価額)	3,453,951,613
未収入金	95,000
(B) 負債	8,205,770
未払信託報酬	8,103,288
その他未払費用	102,482
(C) 純資産総額 (A - B)	3,454,275,087
元本	2,343,884,195
次期繰越損益金	1,110,390,892
(D) 受益権総口数	2,343,884,195口
1万口当り基準価額 (C / D)	14,737円

* 期首における元本額は2,264,129,492円、当作成期間中における追加設定元本額は709,209,320円、同解約元本額は629,454,617円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,737円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,138円
受取利息	178
支払利息	△ 1,316
(B) 有価証券売買損益	70,571,736
売買益	150,024,668
売買損	△ 79,452,932
(C) 信託報酬等	△ 15,793,885
(D) 当期損益金 (A + B + C)	54,776,713
(E) 前期繰越損益金	555,017,995
(F) 追加信託差損益金	500,596,184
(配当等相当額)	(420,576,233)
(売買損益相当額)	(80,019,951)
(G) 合計 (D + E + F)	1,110,390,892
次期繰越損益金 (G)	1,110,390,892
追加信託差損益金	500,596,184
(配当等相当額)	(420,576,233)
(売買損益相当額)	(80,019,951)
分配準備積立金	609,795,846
繰越損益金	△ 1,138

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

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

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

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	54,777,132
(c) 収益調整金	500,596,184
(d) 分配準備積立金	555,018,714
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,110,392,030
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,110,392,030
(h) 受益権総口数	2,343,884,195口

★「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の第17期にかかる運用状況については273～278ページをご参照ください。

< 補足情報 >

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国 R E I T インデックス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド」の決算日（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 6 月15日）現在におけるダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンドの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 インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2021年 6 月16日から2022年 6 月15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
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 694.09	千円 8,502,428	円 12,249	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 642.43	千円 7,906,750	円 12,307

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2021年 6 月16日から2022年 6 月15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
PROLOGIS INC (アメリカ)	千口 15.6	千円 232,601	円 14,910	PROLOGIS INC (アメリカ)	千口 98.606	千円 1,879,113	円 19,056
VICI PROPERTIES INC (アメリカ)	61.765	220,757	3,574	EQUINIX INC (アメリカ)	12.01	1,059,530	88,220
EQUINIX INC (アメリカ)	2.097	193,347	92,201	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	20.655	918,442	44,465
GOODMAN GROUP (オーストラリア)	69.269	132,061	1,906	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	44.242	714,721	16,154
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT (アメリカ)	5.871	126,281	21,509	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	37.687	640,587	16,997
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	3.511	124,433	35,441	WELLTOWER INC (アメリカ)	56.5	633,755	11,216
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC (アメリカ)	29.069	113,149	3,892	REALTY INCOME CORP (アメリカ)	72.2	594,605	8,235
REALTY INCOME CORP (アメリカ)	14.686	113,043	7,697	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	18.811	551,516	29,318
WELLTOWER INC (アメリカ)	11.676	111,920	9,585	GOODMAN GROUP (オーストラリア)	252.169	515,656	2,044
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	6.305	110,257	17,487	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	46.649	494,904	10,609

(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 6 月15日におけるダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド（8,345,562千口）の内容です。

(1) 外国投資信託受益証券

銘 柄		2022年 6 月15日現在		
		口 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(アメリカ)		千口	千アメリカ・ドル	千円
VANGUARD REAL ESTATE ETF		85.16	7,436	1,003,957
合 計	口 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	85.16	7,436	1,003,957
		1 銘柄		<4.0%>

(注 1) 邦貨換算金額は、2022年 6 月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注 2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注 3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘 柄		2022年 6 月15日現在		
		口 数	評 価 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
MANULIFE US REAL ESTATE INV		247.362	144	19,536
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		110.2	75	10,191
EAGLE HOSPITALITY TRUST		90	—	—
PRIME US REIT		79.1	54	7,422
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST		18.096	348	47,030
URBAN EDGE PROPERTIES		15.182	226	30,561
XENIA HOTELS & RESORTS INC		15.7	243	32,854
AVALONBAY COMMUNITIES INC		19.241	3,563	481,073
SIMON PROPERTY GROUP INC		45.189	4,361	588,804
BOSTON PROPERTIES INC		19.564	1,773	239,410

銘 柄	2022年6月15日現在		
	口 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	20.988	122	16,604
VORNADO REALTY TRUST	21.821	631	85,317
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11.878	223	30,196
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11.3	515	69,567
NEXPOINT RESIDENTIAL	3.126	190	25,740
EQUITY RESIDENTIAL	47.062	3,236	437,017
APPLE HOSPITALITY REIT INC	29.2	432	58,424
EPR PROPERTIES	10.284	447	60,480
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.9	101	13,753
CITY OFFICE REIT INC	6	68	9,283
GLOBAL NET LEASE INC	14.233	186	25,230
EQUINIX INC	12.387	7,661	1,034,376
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10.629	262	35,373
CHATHAM LODGING TRUST	6.665	73	9,871
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7.6	605	81,798
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16.7	257	34,812
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3.2	105	14,205
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7.8	39	5,391
HOST HOTELS & RESORTS INC	98.272	1,688	227,939
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	40.673	1,339	180,882
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	21	341	46,100
RLJ LODGING TRUST	22.921	268	36,237
FARMLAND PARTNERS INC	3.9	54	7,297
PHYSICIANS REALTY TRUST	30.3	501	67,702
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	9.3	118	16,033
KIMCO REALTY CORP	84.828	1,628	219,890
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8.3	89	12,124
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	30.395	822	111,044
WHITESTONE REIT	6.4	68	9,202
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	32.274	1,396	188,540
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17.1	221	29,943
PARK HOTELS & RESORTS INC	32.48	498	67,267
INVITATION HOMES INC	82.143	2,762	372,960
JBG SMITH PROPERTIES	15.732	364	49,170
ALEXANDER & BALDWIN INC	10	182	24,585
CLIPPER REALTY INC	1.89	14	1,929
GLADSTONE LAND CORP	4.251	93	12,655
AMERICOLD REALTY TRUST	36.695	1,061	143,374
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9	125	16,877
VICI PROPERTIES INC	115.665	3,253	439,276
BRT APARTMENTS CORP	1.6	33	4,473
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3.589	410	55,374
SAFEHOLD INC	1.957	67	9,131
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	16.943	114	15,486
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	16.743	336	45,390
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4.75	84	11,447
STORE CAPITAL CORP	33.77	837	113,024
CREATIVE MEDIA AND COMMUNITY TRUST	2.1	14	1,970
BROADSTONE NET LEASE INC	22.2	428	57,876
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14.668	110	14,872
LIFE STORAGE INC	11.313	1,158	156,433
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7.274	209	28,283
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	30.319	637	86,001
PARAMOUNT GROUP INC	22.593	164	22,206
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	19.5	130	17,612
NETSTREIT CORP	5.5	103	13,960
APARTMENT INCOME REIT CO	21.601	851	115,020
CTO REALTY GROWTH INC	0.86	49	6,678
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	22.079	1,279	172,682
STAG INDUSTRIAL INC	24.266	737	99,627
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1.5	26	3,535
INDUS REALTY TRUST INC	0.861	49	6,710
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2.3	32	4,446
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	15.569	498	67,284
ORION OFFICE REIT INC	7.823	90	12,241
VENTAS INC	54.913	2,659	359,050
CARETRUST REIT INC	13.304	222	29,978
INVENTRUST PROPERTIES CORP	9.5	247	33,347
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	41.01	818	110,458
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	6.654	129	17,428
SABRA HEALTH CARE REIT INC	31.443	413	55,780
UMH PROPERTIES INC	6.244	106	14,322

銘 柄	2022年6月15日現在		
	口 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3.6	86	11,689
IRON MOUNTAIN INC	39.886	1,885	254,603
TERRENO REALTY CORP	10.35	568	76,686
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17.593	637	86,054
SUN COMMUNITIES INC	15.994	2,415	326,148
ACADIA REALTY TRUST	12.211	196	26,526
ALEXANDER'S INC	0.3	65	8,789
PROLOGIS INC	101.813	11,266	1,521,107
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20.071	2,717	366,823
BRANDYWINE REALTY TRUST	23.542	223	30,226
SAUL CENTERS INC	1.8	76	10,342
VERIS RESIDENTIAL INC	11	154	20,880
CAMDEN PROPERTY TRUST	14.031	1,767	238,684
COUSINS PROPERTIES INC	20.455	604	81,578
SITE CENTERS CORP	24.678	309	41,780
DUKE REALTY CORP	52.4	2,682	362,215
EASTGROUP PROPERTIES INC	5.578	848	114,604
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8.934	2,288	309,035
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17.907	839	113,386
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9.707	923	124,711
GETTY REALTY CORP	5.403	135	18,345
WELLTOWER INC	59.876	4,637	626,094
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	74.221	1,739	234,882
HIGHWOODS PROPERTIES INC	14.4	484	65,401
SERVICE PROPERTIES TRUST	22.7	126	17,070
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	20.259	504	68,105
EQUITY COMMONWEALTH	15.575	425	57,405
KILROY REALTY CORP	14.409	714	96,450
LTC PROPERTIES INC	5.408	193	26,065
LXP INDUSTRIAL TRUST	38.895	398	53,772
MID-AMERICA APARTMENT COMM	15.878	2,540	343,054
MACERICH CO/THE	29.279	271	36,604
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	23.715	1,628	219,865
NATL HEALTH INVESTORS INC	6.3	355	48,039
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	24.12	955	129,052
REALTY INCOME CORP	77.825	4,886	659,744
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	15.41	395	53,427
PENN REAL ESTATE INVEST TST	17	4	665
PUBLIC STORAGE	20.956	6,241	842,669
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2.764	513	69,386
REGENCY CENTERS CORP	21.226	1,201	162,199
RPT REALTY	11.6	111	15,097
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	14.316	208	28,122
SL GREEN REALTY CORP	8.838	434	58,634
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	32.9	60	8,172
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4.1	65	8,817
UDR INC	41.167	1,742	235,212
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.8	89	12,095
WP CAREY INC	26.243	2,124	286,882
WASHINGTON REIT	11.6	256	34,595
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4.7	27	3,661
AGREE REALTY CORP	9.8	656	88,647
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	32.906	910	122,883
CUBESMART	30.158	1,172	158,264
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	30.126	311	42,055
DIGITAL REALTY TRUST INC	39.096	4,870	657,524
CEDAR REALTY TRUST INC	1.7	42	5,735
EXTRA SPACE STORAGE INC	18.429	2,925	394,960
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4.575	45	6,189
CENTERSPACE	2.06	158	21,454
KITE REALTY GROUP TRUST	30.169	524	70,872
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2.2	56	7,577
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	19.19	1,236	166,902
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5.121	93	12,569
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	28.942	257	34,698
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	82.122	1,226	165,644
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13.105	52	7,077
DOUGLAS EMMETT INC	24.186	548	74,025
アメリカ・ドル通貨計	口 数、金 額	3,561.29	18,230.059
	銘 柄 数 < 比 率 >	150 銘柄	<71.9%>

銘 柄	2022年6月15日現在		
	口 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)			
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2.3	16	1,696
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	5.1	18	1,944
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	6.2	24	2,564
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	4.3	43	4,579
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	6.741	86	8,983
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8.4	101	10,555
SLATE GROCERY REIT	4	56	5,918
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8	135	14,146
SLATE OFFICE REIT	5.1	23	2,481
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2.8	43	4,493
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15.5	188	19,671
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12.2	206	21,483
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	6.1	37	3,858
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2.7	35	3,668
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4.5	356	37,141
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	16.2	198	20,678
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	9.7	119	12,472
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	15.2	216	22,569
CHOICE PROPERTIES REIT	22.6	309	32,238
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2.7	45	4,782
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	7.4	117	12,275
PLAZA RETAIL REIT	7	30	3,136
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10	271	28,311
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12	530	55,242
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	19.966	252	26,359
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	21.4	430	44,842
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3.3	64	6,739
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3.2	141	14,771
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	7.2	113	11,816
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8.8	303	31,671
カナダ・ドル通貨計	260.607	4,521	471,098
銘 柄 数 < 比 率 >	30 銘柄		<1.9%>
(オーストラリア)			
DEXUS/AU	155.65	1,411	131,433
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	38.4	59	5,577
HOME CONSORTIUM LTD	25.79	117	10,924
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	53.9	44	4,139
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	46.82	146	13,643
CROMWELL PROPERTY GROUP	199.444	139	12,997
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	76	222	20,731
RURAL FUNDS GROUP	53.875	144	13,492
WAYPOINT REIT	101.781	229	21,320
CHARTER HALL LONG WALE REIT	86.122	373	34,797
CENTURIA OFFICE REIT	62.25	108	10,142
CENTURIA CAPITAL GROUP	89.45	173	16,114
IRONGATE GROUP	77.4	146	13,619
HOMECO DAILY NEEDS REIT	204.898	255	23,749
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	165.43	438	40,814
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	41.377	143	13,405
NATIONAL STORAGE REIT	152.575	328	30,540
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	31.51	83	7,803
GDI PROPERTY GROUP	71.46	68	6,386
SCENTRE GROUP	760.116	1,938	180,455
ARENA REIT	48.81	189	17,631
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	27.16	86	8,091
BWP TRUST	67.951	250	23,280
GPT GROUP	277.21	1,153	107,362
CHARTER HALL RETAIL REIT	73.41	278	25,970
MIRVAC GROUP	570.551	1,169	108,892
STOCKLAND	350.431	1,261	117,450
ABACUS PROPERTY GROUP	53.96	145	13,563
GOODMAN GROUP	248.1	4,443	413,687
VICINITY CENTRES	556.686	971	90,438
CHARTER HALL GROUP	68.052	777	72,353
INGENIA COMMUNITIES GROUP	51.59	184	17,146
オーストラリア・ドル通貨計	4,888.159	17,486	1,627,959
銘 柄 数 < 比 率 >	32 銘柄		<6.4%>
(香港)			
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	321	982	16,894
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	142	536	9,232

銘 柄		2022年6月15日現在		
		口 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
		千口	千香港・ドル	千円
FORTUNE REIT		203	1,372	23,603
PROSPERITY REIT		174	461	7,930
LINK REIT		303.6	20,766	357,179
CHAMPION REIT		268	940	16,179
香港・ドル通貨計		1,411.6	25,059	431,020
		銘 柄 数 < 比 率 >	6 銘柄	<1.7%>
(シンガポール)		千口	千シンガポール・ドル	千円
KEPPEL DC REIT		186.483	359	34,893
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		170.976	48	4,724
AIMS APAC REIT		64.3	86	8,415
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI		411.29	526	51,039
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		73.8	58	5,652
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL		262.44	206	19,973
EC WORLD REIT		36.5	21	2,087
IREIT GLOBAL		71.624	43	4,235
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		483.177	1,328	128,821
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		732.122	1,552	150,475
SUNTEC REIT		307.4	507	49,174
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		460.6	746	72,341
KEPPEL REIT		277.6	313	30,412
ASCOTT RESIDENCE TRUST		272.656	308	29,870
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T		730.702	292	28,336
CDL HOSPITALITY TRUSTS		127.7	159	15,475
FRASERS CENTREPOINT TRUST		151.176	337	32,684
STARHILL GLOBAL REIT		198.4	113	10,963
CAPITALAND CHINA TRUST		159.142	179	17,434
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		54.6	262	25,408
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		285.969	692	67,093
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		309.284	544	52,773
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		147.8	94	9,170
SPH REIT		134.4	126	12,248
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		337.763	130	12,607
シンガポール・ドル通貨計		6,447.904	9,038	876,314
		銘 柄 数 < 比 率 >	25 銘柄	<3.5%>
(ニュージーランド)		千口	千ニュージーランド・ドル	千円
ARGOSY PROPERTY LTD		119.25	140	11,762
KIWI PROPERTY GROUP LTD		221.44	210	17,660
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		60.26	161	13,582
GOODMAN PROPERTY TRUST		147.8	296	24,877
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL		183.35	243	20,471
ニュージーランド・ドル通貨計		732.1	1,052	88,355
		銘 柄 数 < 比 率 >	5 銘柄	<0.3%>
(イギリス)		千口	千イギリス・ポンド	千円
ASSURA PLC		407.27	270	43,866
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		83.32	73	11,852
STANDARD LIFE INV PROP INC		56.2	44	7,256
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		118.46	95	15,545
PICTON PROPERTY INCOME LTD		75.64	71	11,619
REGIONAL REIT LTD		59.84	47	7,736
NEWRIVER REIT PLC		42.86	37	6,124
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE		117.59	174	28,306
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		85.98	68	11,171
CUSTODIAN REIT PLC		60.9	62	10,214
PRS REIT PLC/THE		75.872	81	13,144
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		53.28	65	10,543
LXI REIT PLC		125.918	179	29,126
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		51.24	44	7,256
AEW UK REIT PLC		21.93	26	4,304
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS		110.42	126	20,597
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		136.123	172	27,931
HOME REIT PLC		77.587	88	14,322
LAND SECURITIES GROUP PLC		105.957	775	125,742
SEGRO PLC		170.889	1,631	264,669
HAMMERSON PLC		482.269	110	17,883
UNITE GROUP PLC/THE		56.29	596	96,695
BRITISH LAND CO PLC		132.28	670	108,701
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		35.071	217	35,270
DERWENT LONDON PLC		15.83	437	70,922
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		184.12	251	40,737
WORKSPACE GROUP PLC		20.759	136	22,123

銘柄	2022年6月15日現在			
	口数	評価額		外貨建金額 邦貨換算金額
		外貨建金額	邦貨換算金額	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	千口 29.124	千イギリス・ポンド 295	千円 47,950	
SHAFTESBURY PLC	39.8	228	37,057	
BIG YELLOW GROUP PLC	23.89	298	48,439	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	135.177	311	50,519	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	78.138	43	7,110	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	263.418	477	77,382	
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,533.442 33銘柄	8,212 <5.3%>	1,332,126
(イスラエル)	千口	千イスラエル・シェケル	千円	
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	31.07	283	11,047	
REIT 1 LTD	26.1	461	17,990	
イスラエル・シェケル通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	57.17 2銘柄	745 <0.1%>	29,038
(韓国)	千口	千韓国・ウォン	千円	
SK REITS LTD	8.7	58,464	6,115	
D&D PLATFORM REIT LTD	8	41,600	4,351	
JR GLOBAL	3.137	653	68	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8.26	65,254	6,825	
LOTTE REIT CO LTD	17.135	102,638	10,736	
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	13.09	62,439	6,531	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5.6	32,480	3,397	
JR REIT XXVII	16.35	89,925	9,406	
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5.99	37,617	3,934	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	20.74	130,039	13,602	
韓国・ウォン通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	107.002 10銘柄	621,111 <0.3%>	64,968
ユーロ (アイルランド)	千口	千ユーロ	千円	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	54.94	71	10,009	
HIBERNIA REIT PLC	84.78	135	19,075	
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	139.72 2銘柄	206 <0.1%>	29,085
ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千円	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5.057	112	15,863	
WERELDHAVE NV	5.16	72	10,214	
NSI NV	2.271	78	11,047	
VASTNED RETAIL NV	2.32	51	7,300	
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	14.808 4銘柄	315 <0.2%>	44,427
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千円	
AEDIFICA	4.776	453	63,816	
COFINIMMO	3.882	437	61,545	
BEFIMMO	3.13	147	20,713	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	3.03	75	10,580	
RETAIL ESTATES	1.457	89	12,575	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	18.468	568	79,985	
CARE PROPERTY INVEST	3.45	79	11,245	
XIOR STUDENT HOUSING NV	2.67	110	15,526	
MONTEA NV	1.31	111	15,659	
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	42.173 9銘柄	2,071 <1.2%>	291,647
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千円	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	15.315	819	115,364	
ICADE	4.098	193	27,211	
CARMILA	5.78	77	10,888	
ALTAREA	0.55	69	9,803	
GECINA SA	7.153	684	96,383	
KLEPIERRE	25.657	482	67,987	
COVIVIO	6.222	352	49,672	
MERCIALYS	6.37	51	7,296	
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	71.145 8銘柄	2,731 <1.5%>	384,608
ユーロ (ドイツ)	千口	千ユーロ	千円	
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1.82	23	3,264	
HAMBORNER REIT AG	9.07	75	10,586	
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	10.89 2銘柄	98 <0.1%>	13,851
ユーロ (スペイン)	千口	千ユーロ	千円	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7.5	36	5,132	

銘 柄		2022年 6 月15日現在		
		口 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
		千口	千ユーロ	千円
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		34. 559	224	31, 579
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		43. 87	423	59, 607
国 小 計	口 数 、 金 額	85. 929	684	96, 318
	銘 柄 数 < 比 率 >	3 銘柄		<0. 4%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ (イタリア)				
COIMA RES SPA		2. 77	27	3, 845
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		6. 93	24	3, 429
国 小 計	口 数 、 金 額	9. 7	51	7, 275
	銘 柄 数 < 比 率 >	2 銘柄		<0. 0%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ (その他)				
CROMWELL REIT EUR		43. 52	88	12, 439
国 小 計	口 数 、 金 額	43. 52	88	12, 439
	銘 柄 数 < 比 率 >	1 銘柄		<0. 0%>
ユ ー ロ 通 貨 計	口 数 、 金 額	417. 885	6, 247	879, 652
	銘 柄 数 < 比 率 >	31 銘柄		<3. 5%>
合 計	口 数 、 金 額	21, 417. 159	—	24, 030, 593
	銘 柄 数 < 比 率 >	324 銘柄		<94. 8%>

(注 1) 邦貨換算金額は、2022年 6 月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注 2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注 3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘 柄 別		2022年 6 月15日現在	
		買 建 額	売 建 額
外 国	DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	百万円 329	百万円 —
	STOXX 600 REAL (ドイツ)	134	—

(注 1) 外貨建の評価額は、2022年 6 月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注 2) 単位未満は切捨て。