

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

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

運用報告書 (全体版)
第17期

(決算日 2023年1月10日)
(作成対象期間 2022年1月12日～2023年1月10日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。
当ファンドは、内外の債券、リート（不動産投資信託）および株式に投資し、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先（コールセンター）
TEL 0120-106212
(営業日の9:00～17:00)
<https://www.daiwa-am.co.jp/>
<3719>
<3720>
<3721>

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	無期限（設定日：2006年1月12日）	
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	下記の各マザーファンドの受益証券
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債
	ダイワ日本債券インデックス マザーファンド（BPI）	内外の公社債等（各種の債権や 資産を担保・裏付けとして発行 された証券を含みます。）
	ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上 場予定を含みます。）および店 頭登録（登録予定を含みます す。）の不動産投資信託の受益 証券または不動産投資法人の投 資証券
	ダイワJ－REIT アクティブ・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場 （上場予定を含みます。）の不 動産投資信託の受益証券および 不動産投資法人の投資証券
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	北米の金融商品取引所上場また は店頭登録の株式およびハイブ リッド優先証券（上場予定およ び店頭登録予定を含みます。）
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	欧州の金融商品取引所上場株式 および店頭登録株式（上場予定 および店頭登録予定を含みます す。）
	ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド	アジア・オセアニアの金融商品 取引所上場株式および店頭登録 株式（上場予定および店頭登録 予定を含みます。）
ダイワ好配当日本株マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株 式（上場予定を含みます。）	
組入制限	株式組入上限比率	
	外国債券インデックスマザーファンド	純資産総額の30％以下
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	純資産総額の10％以下
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	無制限
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	
投資信託証券組入上限比率		
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	無制限	
ダイワJ－REITアクティブ・マザーファンド		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とし、原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			合 成 指 数		株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 組入比率	投資証券 組入比率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
13期末(2019年1月10日)	15,715	0	△ 4.2	16,858	△ 2.8	16.8	－	50.7	29.0	－	3,597
14期末(2020年1月10日)	17,628	0	12.2	19,069	13.1	18.0	－	50.3	28.9	0.3	4,925
15期末(2021年1月12日)	17,702	0	0.4	19,048	△ 0.1	19.0	－	49.4	28.6	0.4	5,838
16期末(2022年1月11日)	19,976	0	12.8	21,707	14.0	18.0	－	49.9	28.7	0.3	7,477
17期末(2023年1月10日)	19,057	0	△ 4.6	20,870	△ 3.9	17.1	－	50.8	28.7	0.2	7,978

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注2) 合成指数は、下記の指数と配分比率をもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

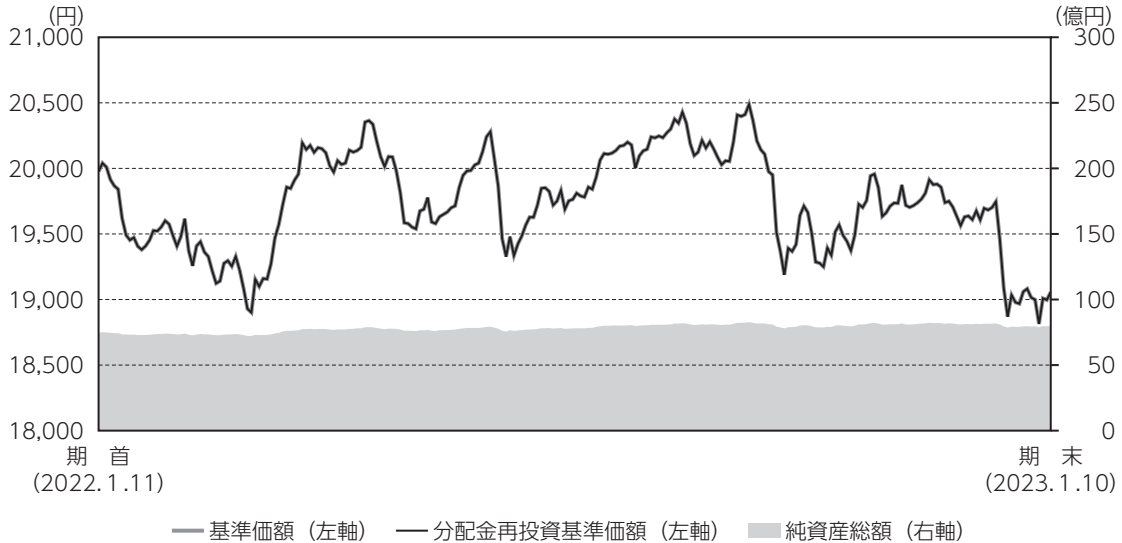
投資対象資産	指 数	配 分 比 率
海 外 債 券	F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）	25%
国 内 債 券	N O M U R A - B P I 総合指数	25%
海 外 リ ー ト	S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）	15%
国 内 リ ー ト	東証 R E I T 指数（配当込み）	15%
海 外 株 式	M S C I コクサイ指数（グロス配当込み）	10%
国 内 株 式	T O P I X（配当込み）	10%

(注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注4) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
(注5) 先物比率は買建比率－売建比率です。
(注6) 公社債組入比率はハイブリッド優先証券を含みます。また、新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



（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：19,976円

期 末：19,057円（分配金0円）

騰落率：△4.6%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、内外の債券

およびリーートの価格下落などがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

■組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	△5.1%	24.9%
外国債券インデックスマザーファンド	△2.6%	24.7%
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	△9.3%	15.0%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	△4.1%	14.6%
ダイワ好配当日本株マザーファンド	1.0%	9.9%
ダイワ北米好配当株マザーファンド	△2.2%	7.7%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	4.1%	2.0%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	△0.3%	0.4%

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）

年 月 日	基 準 価 額		合 成 指 数		株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 組入比率	投資証券 組入比率	不 動 産 投信指数 先物比率
	騰 落 率		(参考指数)	騰 落 率					
(期首)2022年 1 月11日	円	%		%	%	%	%	%	%
	19,976	－	21,707	－	18.0	－	49.9	28.7	0.3
1 月末	19,526	△2.3	21,199	△2.3	17.7	－	50.7	28.2	0.3
2 月末	19,276	△3.5	20,987	△3.3	17.5	－	50.6	28.3	0.3
3 月末	20,175	1.0	22,034	1.5	17.7	－	49.3	30.0	0.3
4 月末	20,090	0.6	21,888	0.8	17.3	－	49.8	29.5	0.3
5 月末	19,946	△0.2	21,682	△0.1	17.4	－	49.8	29.0	0.3
6 月末	19,824	△0.8	21,567	△0.6	16.9	－	50.5	29.0	0.2
7 月末	20,200	1.1	22,053	1.6	17.0	－	49.8	29.7	0.2
8 月末	20,147	0.9	21,998	1.3	17.1	－	50.2	29.0	0.2
9 月末	19,367	△3.0	21,126	△2.7	16.6	－	51.8	27.7	0.2
10月末	19,943	△0.2	21,930	1.0	17.1	－	50.4	29.0	0.2
11月末	19,750	△1.1	21,677	△0.1	17.1	－	50.2	29.1	0.3
12月末	18,999	△4.9	20,830	△4.0	17.0	－	50.5	28.8	0.3
(期末)2023年 1 月10日	19,057	△4.6	20,870	△3.9	17.1	－	50.8	28.7	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

(2022.1.12～2023.1.10)

■海外債券市況

主要国の国債金利は、上昇（債券価格は下落）しました。

当作成期首より2022年2月にかけては、物資の供給制約やインフレは金利上昇圧力となったものの、新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念が高まったことなどから、金利はおおむねレンジ内で推移しました。3月から10月にかけては、世界の主要な中央銀行が政策金利見通しを大幅に引き上げたことや、商品市況の高止まりなどから期待インフレ率が上昇したことにより、金利は上昇基調で推移しました。その後、11月から当作成期末にかけては、インフレ率の低下や軟調な経済指標を受けて、金利は低下基調で推移しました。

■国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇しました。

国内長期金利は、当作成期首より、世界的なインフレ圧力の高まりや各国での金融引き締め加速観測を受け、2022年2月に0.2%台まで上昇しました。その後、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ため、3月下旬には0.2%台半ばまで上昇しました。4月から11月にかけては、世界で予想以上にインフレが進んだため各国の金利が上昇し、日本の金利にも上昇圧力がかけられましたが、日銀が長期金利を0.25%までにとどめる方針を強く示したこともあり、0.2%から0.25%程度のレンジで推移しました。12月から当作成期末にかけては、日銀が長期金利の変動許容幅を拡大したことにより長期金利は上昇し、0.4%から0.5%前後で推移しました。

■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、当作成期首から2022年2月にかけて、長期金利の上昇や、ウクライナをめぐる地政学リスクの高まりを受けて下落しました。3月から4月中旬にかけては、ロシアとウクライナの停戦交渉への期待などを背景に反発したものの、その後は、米国の利上げペースへの懸念から軟調に推移しました。7月にかけては、長期金利の低下などを受けていったんは反発しましたが、8月半ば以降は、金利上昇やインフレ率の高止まり、主要中央銀行の積極的な利上げによる景気悪化懸念などから、大きく下落しました。11月以降は、長期金利の落ち着きや米国CPI（消費者物価指数）の下振れなどを支援材料に、上昇基調となりました。

■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、2022年初から公募増資の発表が相次ぎ、需給悪化から下落した流れを受けて、下落して始まりました。加えて、米国金融政策の引き締めペース加速への懸念も下落要因となりました。1月下旬には割安感から買いが入り、月末にかけて上昇しました。その後は、米国金利の動向やウクラ

イナ情勢をめぐって上下動はありましたが、おおむね横ばい圏での推移となりました。6月中旬に、米国でのインフレ関連指標の上振れから米国金融政策の引き締め加速が意識され、株式市況が大きく下落する中、国内リート市況も下落しましたが、下旬に金融市場が落ち着きを取り戻すと、上昇に転じました。9月下旬から10月中旬までは、欧米を中心とした金融引き締めによる世界的な景気後退リスクから国内リート市場は下落しました。10月には公募増資の発表が相次ぎ、需給悪化も下落の要因となりました。10月下旬に米国の長期金利が低下すると、国内リート市況は割安感が意識され大きく反発しました。12月に日銀が金融緩和の見直しを発表すると大幅に下落し当作成期末を迎えました。

■海外株式市況

・北米

北米株式市況は下落傾向が続きました。

北米株式市況は、当作成期首より2022年3月半ばにかけて、F R B（米国連邦準備制度理事会）による金融引き締め懸念で金利が上昇したことや、ロシアによるウクライナ侵攻で地政学リスクが顕在化したことなどを受け、大きく下落しました。F R Bの利上げ決定後はいったん反発しましたが、4月から6月半ばにかけては、インフレ率の予想以上の上昇を受けてF R Bが利上げを加速するとの思惑が強まったことなどから、下落しました。6月半ばにF R Bが利上げ幅の拡大を決定した後は、悪材料出尽くし観測から上昇に転じ、またインフレ率がピークアウトするとの期待感などもあり、8月中旬にかけて上昇が続きました。その後は、F R B議長がインフレ抑制姿勢を強調したこと、予想以上のインフレ率の上昇や英国の財政悪化懸念などで欧米の金利が上昇したこと、企業業績の見通しの下方修正が相次いだことなどが嫌気され、10月半ばにかけて下落しました。11月末にかけては、英国市場の混乱が収束して欧米の金利上昇が一服したことや、米国のインフレ率が予想を下回ったことなどが好感されて上昇しましたが、当作成期末にかけては、米国の景況感や企業業績の悪化が懸念され、株価は下落しました。

米国ハイブリッド優先証券市況は下落しました。

米国ハイブリッド優先証券市況は、インフレ率の高止まりとF R Bのタカ派的な姿勢を背景に長期金利が上昇したことに加え、景気後退懸念によりクレジットスプレッドが拡大したことから、6月末まで大きく下落しました。7月には、経済指標の一部が予想を下振れたことで金融引き締め懸念が後退し、反発する局面もありましたが、その後、F R B議長がインフレ抑制姿勢を強調したことから、再び下落しました。11月にはインフレ率が予想を下回り長期金利が下落したことから、当作成期末にかけては下げ幅を縮めました。

・欧州

欧州株式市況は下落しました。

欧州株式市況は、欧州における物価上昇が市場予想を上回り金利上昇懸念が強まったほか、ロシアがウクライナ侵攻を開始したことなどをを受けて、当作成期首から下落して始まりました。E C B（欧州中央銀行）が量的緩和を終了して利上げをするとの方針を表明したほか、F R B（米国連邦準備制

度理事会）もインフレ抑制を最優先に利上げを続ける方針を明確に示したことで、世界的な景気悪化懸念が強まり、2022年9月にかけて下落基調で推移しました。10月に入ると、これまでの下落を受けた割安感から押し目買いが入ったほか、ユーロ圏のCPI（消費者物価指数）の伸びが鈍化したことなどを受けて、上昇に転じました。

・アジア・オセアニア

アジア・オセアニア株式市況は下落しました。

アジア・オセアニア株式市況は、当作成期首から2022年7月中旬にかけて、資源価格の高騰が好感されたオーストラリアは底堅く推移したものの、米国の金融引き締め加速やウクライナ情勢への警戒感などを背景に、台湾や韓国を中心に下落しました。8月中旬にかけては、米国のインフレピークアウト観測などから投資家心理が上向き、堅調に推移しました。10月にかけては、世界的なインフレ率の高止まりや主要中央銀行の積極的な利上げによる景気悪化懸念などを背景に、下落しました。当作成期末にかけては、金融政策をめぐる思惑に左右され、上下する展開となりました。

■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2022年3月上旬にかけて、FRB（米国連邦準備制度理事会）による金融引き締め懸念で金利が上昇したことや、ロシアによるウクライナ侵攻で地政学リスクが顕在化したことなどを受け、大きく下落しました。ウクライナでの停戦期待などもあり反発する場面もありましたが、4月以降は、中国・上海市のロックダウン（都市封鎖）の影響や、FRBが利上げを加速するとの思惑が強まったことなどから、上値の重い展開となりました。その後6月から11月にかけては、欧米のインフレ率がピークアウトするとの期待感や、国内における新型コロナウイルスの水際対策緩和による経済活動の正常化などが好感された一方で、予想以上のインフレ率の上昇を受けて欧米の金利が上昇したことなどが嫌気され、一進一退で推移しました。12月に入ると、世界的な景況感の悪化により上値の重い展開となり、また日銀の政策変更発表を受けて為替相場で急速な円高が進行したことなどが懸念され、当作成期末にかけて株価は下落しました。

■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2022年2月にかけて、主要国の金利がおおむねレンジ内で推移したこともあり、金利と同様にレンジ内での推移となりました。3月から10月にかけては、世界の主要な中央銀行が政策金利見通しを大幅に引き上げたのに対し、日銀は指値オペを行い長期金利上昇の抑制を図るなど、金融政策の相違がより明確となって、円安が大きく進行しました。その後、11月から当作成期末にかけては、インフレ率が低下したことで米国金利が下落したことや、日銀が長期金利の変動許容幅を拡大し日本国債の金利が上昇したことを受けて、円高基調で推移しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行ってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入出や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド

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

■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

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

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

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

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

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

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

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

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

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

※Ｃ＆Ｓ：コーヘン＆スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

※アムンディ・アイルランド：アムンディ・アイルランド・リミテッド

ポートフォリオについて

(2022.1.12～2023.1.10)

■当ファンド

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

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

■外国債券インデックスマザーファンド

当作成期におきましては、外国の公社債に投資し、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。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を99%前後の高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドへの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

■ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、C & S に運用の指図にかかる権限を委託しております。当ファンドでは、信託財産の中長期的な成長をめざし、保有不動産の価値や期待される成長性などと比べてリート価格が魅力的であるとする銘柄に着目するとともに、安定的な配当利回りの確保をめざしてポートフォリオを構築しました。国・地域別配分では、大きなリスクを取らず各地域に分散して投資を行いました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

リートの組入比率につきましては、通常の状態では信託財産の純資産総額の80％程度以上に維持することを基本としており、おおむね95～98％台程度で推移させました。また、東証ＲＥＩＴ指数先物への投資も行い、先物と合計で95～100％程度で推移させました。リート銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資しました。個別銘柄では、当作成期を通じて見ると、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト、ラサールロジポート、ＧＬＰなどを東証ＲＥＩＴ指数と比較してオーバーウエートとし、大和証券リビング、ジャパンリアルエステイト、星野リゾート・リート等をアンダーウエートとしました。

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

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

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

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

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

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

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

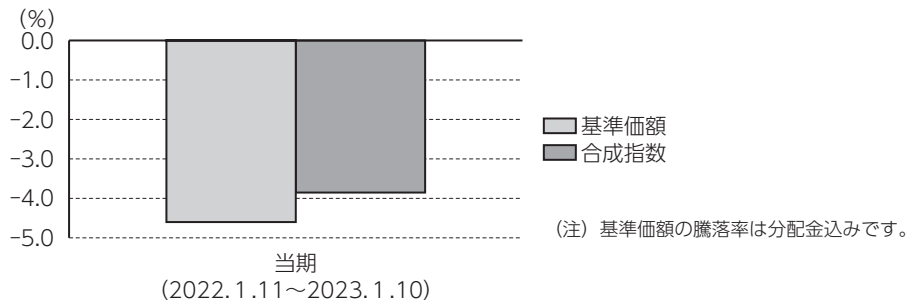
株式等の組入比率は、おおむね高位で推移させました。金融政策や政治情勢に対する不透明感が高まる中で、事業の安定性が高い企業に注目したほか、株主還元の向上に取り組む企業などに注目して、銘柄の入れ替えを行いました。業種構成は銀行業、電気・ガス業、保険業などの比率を引き上げた一方、化学、その他製品、輸送用機器などの比率を引き下げました。個別銘柄では、業績見通しや配当利回りの水準などを総合的に勘案して、三井住友トラストＨＤ、東レ、三菱ＵＦＪフィナンシャルＧなどを買付けました。一方で、三井住友フィナンシャルＧ、大日本印刷、トヨタ自動車などを売却しました。

*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）
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	NOMURA－ＢＰＩ総合指数

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数（合成指数）との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、確定拠出型年金向けファンドであることを考慮し、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	
	2022年1月12日 ～2023年1月10日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配可能額	（円）	10,397

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

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行ってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド

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

■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

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

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

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

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

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

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

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

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2022.1.12～2023.1.10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	195円	0.987%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は19,739円です。
（投 信 会 社）	(97)	(0.494)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(87)	(0.439)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(11)	(0.055)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	10	0.048	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）	(3)	(0.015)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.002)	
（投 資 証 券）	(6)	(0.031)	
有価証券取引税	2	0.010	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株 式）	(0)	(0.000)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.000)	
（投 資 証 券）	(2)	(0.010)	
そ の 他 費 用	4	0.019	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)	(0.012)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(2)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(△0)	(△0.001)	税金の払戻し、信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	210	1.065	

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

（注2）各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

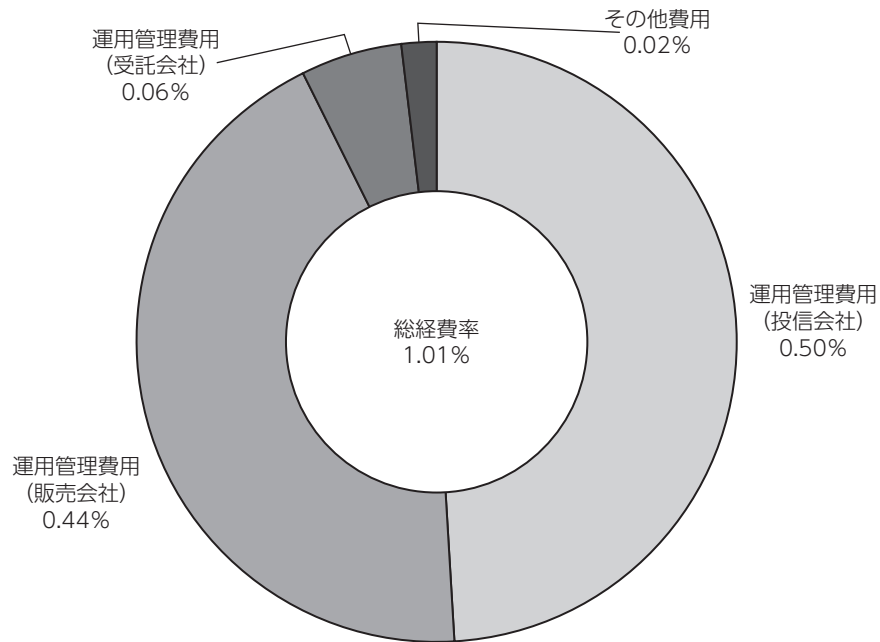
（注3）各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.01%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年1月12日から2023年1月10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	80,827	254,194	19,978	63,163
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (BPI)	249,239	313,840	47,672	59,961
ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド	68,425	239,868	19,303	74,281
ダイワ好配当日本株 マザーファンド	24,821	85,669	18,000	64,034
ダイワ北米好配当株 マザーファンド	18,075	79,492	8,630	39,228
ダイワ欧州好配当株 マザーファンド	11,955	25,019	10,399	23,023
ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド	3,135	9,114	1,608	4,685
ダイワJ-REIT アクティブ・マザーファンド	44,668	151,966	9,967	34,811

(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

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

項 目	当 期
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	15,502,104千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,283,816千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.01
	ダイワ北米好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	2,712,756千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,303,035千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.82
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	130,741千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,402,015千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.09
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	481,959千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	657,485千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.73

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) 外国債券インデックスマザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D／C
公社債	百万円 11,525	百万円 —	% —	百万円 4,579	百万円 100	% 2.2
コール・ローン	48,108	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合4.8%

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

(4) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(5) ダイワ好配当日本株マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D／C
株式	百万円 8,006	百万円 1,658	% 20.7	百万円 7,495	百万円 1,757	% 23.4
コール・ローン	165,591	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合4.8%

(6) ダイワ北米好配当株マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(7) ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(8) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(9) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

決 算 期	期					
	当			期		
区 分	買付額等	うち利害	B／A	売付額等	うち利害	D／C
	A	関係人との取引状況B		C	関係人との取引状況D	
投資証券	百万円 92,608	百万円 19,625	% 21.2	百万円 68,268	百万円 14,401	% 21.1
不動産投信 指数先物取引	9,981	－	－	9,878	－	－
コール・ローン	701,749	－	－	－	－	－

(注) 平均保有割合0.8%

(10) 利害関係人の発行する有価証券等

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

種 類	当 期		
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
投資証券	百万円 330	百万円 －	百万円 1,669

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

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

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

種 類	当 期	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	
	買 付 額	売 付 額
投資証券	百万円 3,143	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(12) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額（Ａ）	3,789千円
うち利害関係人への支払額（Ｂ）	593千円
(Ｂ)／(Ａ)	15.7%

(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、大和証券オフィス投資法人です。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期	期 末
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	586,462	647,312	1,974,431
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,429,239	1,630,806	1,988,116
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	301,604	350,726	1,193,067
ダイワ好配当日本株マザーファンド	214,965	221,786	788,428
ダイワ北米好配当株マザーファンド	129,184	138,629	611,148
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	67,165	68,720	156,738
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	8,505	10,032	29,654
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	315,250	349,951	1,167,368

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年1月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックスマザーファンド	1,974,431	24.6
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,988,116	24.8
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	1,193,067	14.9
ダイワ好配当日本株マザーファンド	788,428	9.8
ダイワ北米好配当株マザーファンド	611,148	7.6
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	156,738	2.0
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	29,654	0.4
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	1,167,368	14.5
コール・ローン等、その他	119,550	1.4
投資信託財産総額	8,028,504	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10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝131.85円、1カナダ・ドル＝98.42円、1オーストラリア・ドル＝91.10円、1香港ドル＝16.89円、1シンガポール・ドル＝99.04円、1ニュージーランド・ドル＝84.00円、1台湾ドル＝4.318円、1イギリス・ポンド＝160.47円、1イスラエル・シェケル＝37.95円、1スイス・フラン＝143.04円、1デンマーク・クローネ＝19.01円、1ノルウェー・クローネ＝13.29円、1スウェーデン・クローネ＝12.66円、1メキシコ・ペソ＝6.89円、100韓国ウォン＝10.62円、1オフショア人民元＝19.455円、1マレーシア・リンギット＝30.139円、1ポーランド・ズロチ＝30.135円、1ユーロ＝141.38円です。

(注3) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（233,724,784千円）の投資信託財産総額（235,643,294千円）に対する比率は、99.2%です。
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（87,658,041千円）の投資信託財産総額（88,798,324千円）に対する比率は、98.7%です。
ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（4,543,021千円）の投資信託財産総額（4,698,382千円）に対する比率は、96.7%です。
ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,544,169千円）の投資信託財産総額（1,558,827千円）に対する比率は、99.1%です。
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（693,686千円）の投資信託財産総額（698,248千円）に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年1月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	8,028,504,889円
コール・ローン等	111,822,121
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,974,431,831
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド(B P I)(評価額)	1,988,116,423
ダイワ・グローバル R E I T・ マザーファンド(評価額)	1,193,067,743
ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額)	788,428,356
ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額)	611,148,635
ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額)	156,738,770
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド(評価額)	29,654,136
ダイワ J - R E I T アクティブ・ マザーファンド(評価額)	1,167,368,874
未収入金	7,728,000
(B) 負債	50,034,182
未払解約金	9,710,688
未払信託報酬	39,990,328
その他未払費用	333,166
(C) 純資産総額(A - B)	7,978,470,707
元本	4,186,631,287
次期繰越損益金	3,791,839,420
(D) 受益権総口数	4,186,631,287口
1万口当り基準価額(C / D)	19,057円

* 期首における元本額は3,743,206,897円、当作成期間中における追加設定元本額は810,744,400円、同解約元本額は367,320,010円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は19,057円です。

■損益の状況

当期 自2022年1月12日 至2023年1月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 28,673円
受取利息	752
支払利息	△ 29,425
(B) 有価証券売買損益	△ 289,472,168
売買益	31,142,411
売買損	△ 320,614,579
(C) 信託報酬等	△ 77,883,687
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 367,384,528
(E) 前期繰越損益金	1,307,259,035
(F) 追加信託差損益金	2,851,964,913
(配当等相当額)	(3,045,580,029)
(売買損益相当額)	(△ 193,615,116)
(G) 合計(D + E + F)	3,791,839,420
次期繰越損益金(G)	3,791,839,420
追加信託差損益金	2,851,964,913
(配当等相当額)	(3,045,580,029)
(売買損益相当額)	(△ 193,615,116)
分配準備積立金	1,307,276,853
繰越損益金	△ 367,402,346

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程（総額）」をご参照ください。
(注4) 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：9,532,625円（未監査）

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	3,045,580,029
(d) 分配準備積立金	1,307,276,853
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	4,352,856,882
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e - f)	4,352,856,882
(h) 受益権総口数	4,186,631,287口

NOMURA - B P I 総合指数の知的財産権およびその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等並びに当ファンド及び同指数に関連して行われる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。

F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			合 成 指 数		株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 組入比率	投資証券 組入比率	不 動 産 投信指数 先物比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
13期末(2019年1月10日)	16,467	0	△ 6.2	17,381	△ 4.3	28.0	－	35.4	32.3	－	4,290
14期末(2020年1月10日)	18,888	0	14.7	20,196	16.2	29.9	－	34.8	32.1	0.3	5,783
15期末(2021年1月12日)	18,830	0	△ 0.3	20,272	0.4	31.3	－	34.0	31.5	0.5	6,484
16期末(2022年1月11日)	21,960	0	16.6	23,850	17.6	29.9	－	34.5	31.7	0.3	8,604
17期末(2023年1月10日)	20,999	0	△ 4.4	22,955	△ 3.8	28.5	－	35.5	31.9	0.3	9,398

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注2) 合成指数は、下記の指数と配分比率をもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

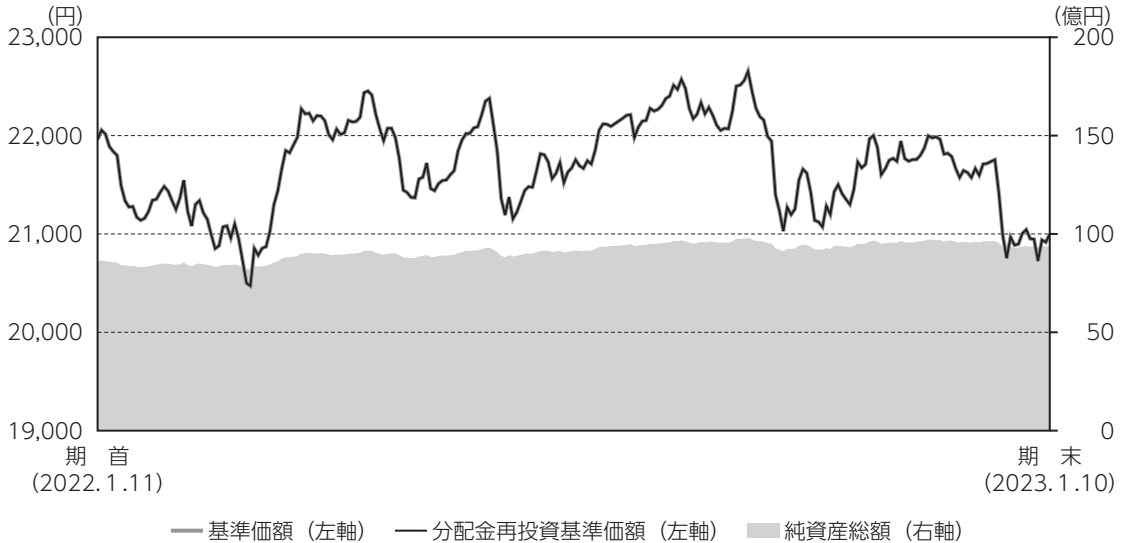
投資対象資産	指 数	配 分 比 率
海 外 債 券	F T S E世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）	16.7%
国 内 債 券	NOMURA－B P I 総合指数	16.7%
海 外 リ ー ト	S & P先進国 R E I T 指数（除く日本）	16.7%
国 内 リ ー ト	東証 R E I T 指数（配当込み）	16.7%
海 外 株 式	M S C I コクサイ指数（グロス配当込み）	16.7%
国 内 株 式	T O P I X（配当込み）	16.7%

(注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注4) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
(注5) 先物比率は買建比率－売建比率です。
(注6) 公社債組入比率はハイブリッド優先証券を含みます。また、新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



(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：21,960円

期 末：20,999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

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、内外の債券およびリーートの価格下落などがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	△9.3%	16.6%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	△5.1%	16.6%
外国債券インデックスマザーファンド	△2.6%	16.5%
ダイワ好配当日本株マザーファンド	1.0%	16.5%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	△4.1%	16.2%
ダイワ北米好配当株マザーファンド	△2.2%	12.8%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	4.1%	3.3%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	△0.3%	0.6%

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）

年 月 日	基 準 価 額		合 成 指 数 (参考指数)	指 数 騰 落 率	株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 組入比率	投資証券 組入比率	不 動 産 投信指数 先物比率
	円	騰 落 率							
(期首)2022年 1 月11日	21,960	% －	23,850	% －	% 29.9	% －	% 34.5	% 31.7	% 0.3
1 月末	21,343	△2.8	23,132	△3.0	29.6	－	35.2	31.5	0.3
2 月末	21,072	△4.0	22,911	△3.9	29.2	－	35.0	31.5	0.3
3 月末	22,228	1.2	24,308	1.9	29.2	－	34.3	33.0	0.3
4 月末	22,074	0.5	24,043	0.8	28.7	－	34.6	32.8	0.3
5 月末	21,954	△0.0	23,817	△0.1	28.8	－	34.5	32.1	0.3
6 月末	21,733	△1.0	23,563	△1.2	28.3	－	34.9	32.3	0.3
7 月末	22,206	1.1	24,228	1.6	28.2	－	34.6	32.9	0.3
8 月末	22,206	1.1	24,220	1.6	28.4	－	35.3	32.1	0.3
9 月末	21,196	△3.5	23,079	△3.2	27.9	－	36.4	31.0	0.3
10月末	21,966	0.0	24,172	1.4	28.6	－	35.3	31.9	0.3
11月末	21,820	△0.6	23,953	0.4	28.5	－	34.9	32.3	0.3
12月末	20,946	△4.6	22,917	△3.9	28.3	－	35.2	32.0	0.3
(期末)2023年 1 月10日	20,999	△4.4	22,955	△3.8	28.5	－	35.5	31.9	0.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2022.1.12～2023.1.10)

4～6 ページをご参照ください。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

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

■外国債券インデックスマザーファンド

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

■ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド

■ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

7～8 ページをご参照ください。

ポートフォリオについて

(2022.1.12～2023.1.10)

■当ファンド

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

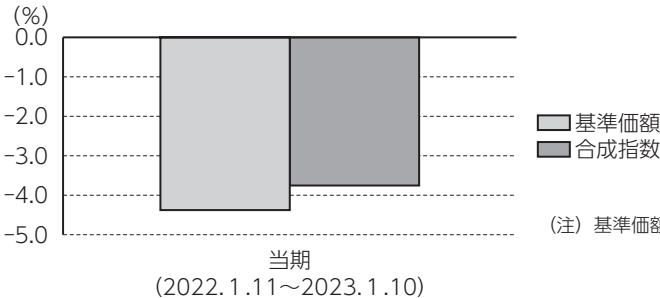
- | | |
|--------------------------------|---|
| ・外国債券インデックスマザーファンド | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I） | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ北米好配当株マザーファンド | } … 3 ファンド合計で純資産総額の16.7%
（各地域の時価総額に応じて配分しました。） |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

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

9～10ページをご参照ください。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数（合成指数）との騰落率の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金について

当作成期は、確定拠出型年金向けファンドであることを考慮し、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	
	2022年1月12日 ～2023年1月10日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配可能額	（円）	12,680

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

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

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

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



今後の運用方針

当ファンド

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

- ・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の16.7%
 - ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI） …純資産総額の16.7%
 - ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド …純資産総額の16.7%
 - ・ダイワJーREITアクティブ・マザーファンド …純資産総額の16.7%
 - ・ダイワ北米好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ好配当日本株マザーファンド
- … 3 ファンド合計で純資産総額の16.7%
（各地域の時価総額に応じて配分します。）
- …純資産総額の16.7%

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

12～13ページをご参照ください。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2022.1.12~2023.1.10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	250円	1.152%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は21,689円です。
（投 信 会 社）	(126)	(0.581)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(112)	(0.516)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(12)	(0.055)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	14	0.063	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）	(5)	(0.025)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
（ハイブリッド優先証券）	(1)	(0.004)	
（投 資 証 券）	(7)	(0.035)	
有価証券取引税	2	0.011	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株 式）	(0)	(0.001)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.000)	
（投 資 証 券）	(2)	(0.011)	
そ の 他 費 用	5	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）	(3)	(0.014)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(2)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(△0)	(△0.001)	税金の払戻し、信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	271	1.248	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

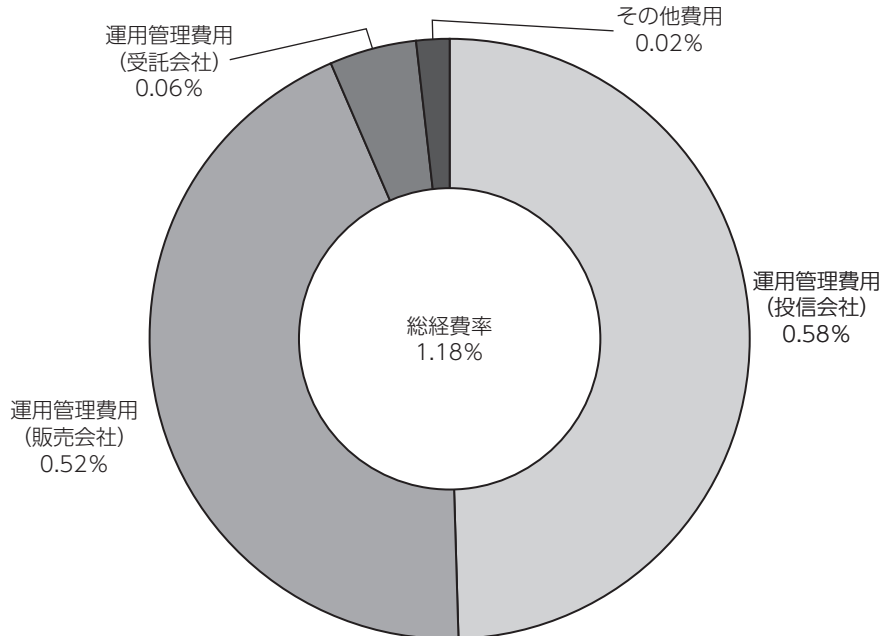
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.18%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

(2022年1月12日から2023年1月10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	73,749	232,167	13,355	42,345
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (BPI)	219,294	276,234	34,028	42,887
ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド	90,889	318,888	14,435	55,137
ダイワ好配当日本株 マザーファンド	38,245	132,501	12,637	44,998
ダイワ北米好配当株 マザーファンド	32,043	140,815	6,310	28,692
ダイワ欧州好配当株 マザーファンド	19,069	39,765	12,367	27,329
ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド	5,334	15,512	1,972	5,778
ダイワJ-REIT アクティブ・マザーファンド	64,781	221,328	8,667	30,326

(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
(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

項 目	当 期
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	15,502,104千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,283,816千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.01
	ダイワ北米好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	2,712,756千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,303,035千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.82
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	130,741千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,402,015千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.09
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	481,959千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	657,485千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.73

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) 外国債券インデックスマザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2022年1月12日から2023年1月10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
公社債	百万円 11,525	百万円 —	% —	百万円 4,579	百万円 100
コール・ローン	48,108	—	—	—	—

(注) 平均保有割合3.8%

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

(4) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(5) ダイワ好配当日本株マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2022年1月12日から2023年1月10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
株式	百万円 8,006	百万円 1,658	% 20.7	百万円 7,495	百万円 1,757
コール・ローン	165,591	—	—	—	—

(注) 平均保有割合9.4%

(6) ダイワ北米好配当株マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(7) ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(8) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(9) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

決 算 期	期					
	当		期			
区 分	買付額等	うち利害	B／A	売付額等	うち利害	D／C
	A	関係人との取引状況B		C	関係人との取引状況D	
投資証券	百万円 92,608	百万円 19,625	% 21.2	百万円 68,268	百万円 14,401	% 21.1
不動産投信 指数先物取引	9,981	－	－	9,878	－	－
コール・ローン	701,749	－	－	－	－	－

(注) 平均保有割合1.1%

(10) 利害関係人の発行する有価証券等

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

種 類	当 期		
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
投資証券	百万円 330	百万円 －	百万円 1,669

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

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

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

種 類	当 期	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	
	買 付 額	売 付 額
投資証券	百万円 3,143	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(12) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額（Ａ）	5,787千円
うち利害関係人への支払額（Ｂ）	922千円
(Ｂ)／(Ａ)	15.9%

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

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

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	評 価 額
	口 数	口 数	
外国債券インデックスマザーファンド	千口 448,579	千口 508,972	千円 1,552,468
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,094,214	1,279,480	1,559,814
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	383,107	459,562	1,563,292
ダイワ好配当日本株マザーファンド	410,404	436,012	1,549,982
ダイワ北米好配当株マザーファンド	246,321	272,054	1,199,350
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	128,098	134,800	307,453
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	16,368	19,730	58,317
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	401,490	457,604	1,526,476

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年1月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックスマザーファンド	千円 1,552,468	% 16.4
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,559,814	16.5
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド	1,563,292	16.5
ダイワ好配当日本株マザーファンド	1,549,982	16.4
ダイワ北米好配当株マザーファンド	1,199,350	12.7
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	307,453	3.2
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	58,317	0.6
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	1,526,476	16.1
コール・ローン等、その他	148,166	1.6
投資信託財産総額	9,465,322	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10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝131.85円、1カナダ・ドル＝98.42円、1オーストラリア・ドル＝91.10円、1香港ドル＝16.89円、1シンガポール・ドル＝99.04円、1ニュージーランド・ドル＝84.00円、1台湾ドル＝4.318円、1イギリス・ポンド＝160.47円、1イスラエル・シェケル＝37.95円、1スイス・フラン＝143.04円、1デンマーク・クローネ＝19.01円、1ノルウェー・クローネ＝13.29円、1スウェーデン・クローネ＝12.66円、1メキシコ・ペソ＝6.89円、100韓国ウォン＝10.62円、1オフショア人民元＝19.455円、1マレーシア・リンギット＝30.139円、1ポーランド・ズロチ＝30.135円、1ユーロ＝141.38円です。

(注3) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（233,724,784千円）の投資信託財産総額（235,643,294千円）に対する比率は、99.2%です。
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（87,658,041千円）の投資信託財産総額（88,798,324千円）に対する比率は、98.7%です。
ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（4,543,021千円）の投資信託財産総額（4,698,382千円）に対する比率は、96.7%です。
ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,544,169千円）の投資信託財産総額（1,558,827千円）に対する比率は、99.1%です。
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（693,686千円）の投資信託財産総額（698,248千円）に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年1月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	9,465,322,131円
コール・ローン等	140,338,341
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,552,468,767
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)(評価額)	1,559,814,203
ダイワ・グローバル R E I T・マザーファンド(評価額)	1,563,292,232
ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額)	1,549,982,435
ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額)	1,199,350,111
ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額)	307,453,714
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド(評価額)	58,317,861
ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド(評価額)	1,526,476,467
未収入金	7,828,000
(B) 負債	66,510,834
未払解約金	11,212,138
未払信託報酬	54,906,595
その他未払費用	392,101
(C) 純資産総額(A - B)	9,398,811,297
元本	4,475,748,849
次期繰越損益金	4,923,062,448
(D) 受益権総口数	4,475,748,849口
1万口当り基準価額(C / D)	20,999円

* 期首における元本額は3,918,064,052円、当作成期間中における追加設定元本額は926,048,289円、同解約元本額は368,363,492円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は20,999円です。

■損益の状況

当期 自2022年1月12日 至2023年1月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 35,266円
受取利息	876
支払利息	△ 36,142
(B) 有価証券売買損益	△ 300,240,783
売買益	47,343,799
売買損	△ 347,584,582
(C) 信託報酬等	△ 105,945,563
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 406,221,612
(E) 前期繰越損益金	1,730,754,153
(F) 追加信託差損益金	3,598,529,907
(配当等相当額)	(3,944,856,254)
(売買損益相当額)	(△ 346,326,347)
(G) 合計(D + E + F)	4,923,062,448
次期繰越損益金(G)	4,923,062,448
追加信託差損益金	3,598,529,907
(配当等相当額)	(3,944,856,254)
(売買損益相当額)	(△ 346,326,347)
分配準備積立金	1,730,775,163
繰越損益金	△ 406,242,622

(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ひ、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程（総額）」をご参照ください。
(注4) 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：14,771,639円（未監査）

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	3,944,856,254
(d) 分配準備積立金	1,730,775,163
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	5,675,631,417
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e - f)	5,675,631,417
(h) 受益権総口数	4,475,748,849口

NOMURA - B P I 総合指数の知的財産権およびその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等並びに当ファンド及び同指数に関連して行われる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。

FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			合 成 指 数		株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 組入比率	投資証券 組入比率	不 動 産 投信指数 先物比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
13期末(2019年1月10日)	17,206	0	△ 8.5	17,971	△ 6.2	41.5	—	13.7	39.5	—	4,424
14期末(2020年1月10日)	20,384	0	18.5	21,668	20.6	44.8	—	13.1	38.5	0.4	6,327
15期末(2021年1月12日)	20,216	0	△ 0.8	21,740	0.3	46.5	—	12.4	37.6	0.6	7,237
16期末(2022年1月11日)	24,728	0	22.3	26,787	23.2	44.7	—	12.8	37.9	0.4	10,544
17期末(2023年1月10日)	23,715	0	△ 4.1	25,778	△ 3.8	42.7	—	14.0	38.3	0.3	12,038

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 合成指数は、下記の指数と配分比率をもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。

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

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

(注4) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

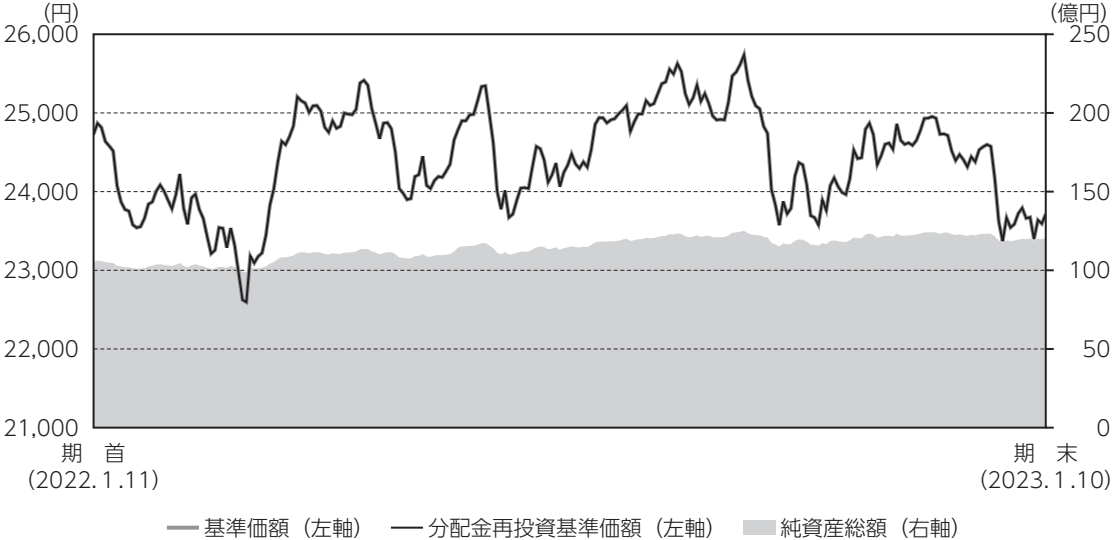
(注5) 先物比率は買建比率－売建比率です。

(注6) 公社債組入比率はハイブリッド優先証券を含みます。また、新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



(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：24,728円
期 末：23,715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

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、内外の債券およびリーートの価格下落などがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
ダイワ好配当日本株マザーファンド	1.0%	24.7%
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	△9.3%	20.0%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	△4.1%	19.5%
ダイワ北米好配当株マザーファンド	△2.2%	19.2%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	△5.1%	5.0%
外国債券インデックスマザーファンド	△2.6%	5.0%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	4.1%	4.9%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	△0.3%	0.9%

年 月 日	基 準 価 額		合 成 指 数 (参考指数)	騰 落 率	株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 組入比率	投資証券 組入比率	不 動 産 投信指数 先物比率
	円	騰 落 率							
(期首)2022年 1 月11日	24,728	% －	26,787	% －	% 44.7	% －	% 12.8	% 37.9	% 0.4
1 月末	23,841	△3.6	25,732	△3.9	44.7	－	13.2	37.8	0.4
2 月末	23,543	△4.8	25,497	△4.8	43.8	－	13.1	37.9	0.4
3 月末	25,126	1.6	27,460	2.5	43.2	－	13.4	39.2	0.4
4 月末	24,870	0.6	27,018	0.9	42.9	－	13.4	39.1	0.3
5 月末	24,785	0.2	26,745	△0.2	42.8	－	13.2	38.4	0.4
6 月末	24,400	△1.3	26,261	△2.0	42.5	－	13.1	38.9	0.3
7 月末	25,036	1.2	27,212	1.6	42.3	－	13.1	39.3	0.3
8 月末	25,121	1.6	27,279	1.8	42.7	－	13.8	38.5	0.3
9 月末	23,718	△4.1	25,695	△4.1	42.3	－	14.2	37.6	0.3
10月末	24,794	0.3	27,237	1.7	42.8	－	13.8	38.3	0.3
11月末	24,734	0.0	27,077	1.1	42.6	－	13.4	38.6	0.3
12月末	23,674	△4.3	25,751	△3.9	42.4	－	13.7	38.5	0.3
(期末)2023年 1 月10日	23,715	△4.1	25,778	△3.8	42.7	－	14.0	38.3	0.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2022.1.12～2023.1.10)

4～6 ページをご参照ください。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

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

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

ポートフォリオについて

(2022.1.12～2023.1.10)

■当ファンド

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

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

■外国債券インデックスマザーファンド

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

■ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

■ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

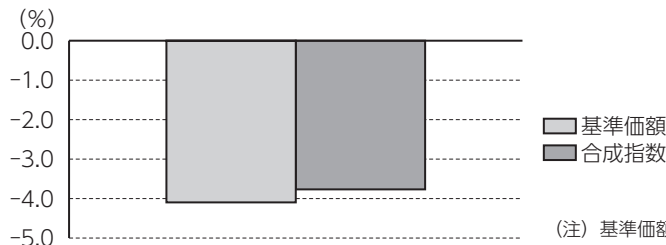
■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

9～10ページをご参照ください。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数（合成指数）との騰落率の対比です。



当期
(2022.1.11～2023.1.10)

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金について

当作成期は、確定拠出型年金向けファンドであることを考慮し、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	
	2022年1月12日 ～2023年1月10日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配可能額	（円）	15,962

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



今後の運用方針

当ファンド

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

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

- …純資産総額の5%
 - …純資産総額の5%
 - …純資産総額の20%
 - …純資産総額の20%
 - …3ファンド合計で純資産総額の25%
（各地域の時価総額に応じて配分します。）
 - …純資産総額の25%

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

12～13ページをご参照ください。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2022.1.12~2023.1.10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	321円	1.316%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は24,415円です。
(投 信 会 社)	(163)	(0.669)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(145)	(0.592)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(13)	(0.055)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	21	0.084	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)	(9)	(0.037)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(ハイブリッド優先証券)	(1)	(0.006)	
(投 資 証 券)	(10)	(0.041)	
有価証券取引税	3	0.014	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.001)	
(ハイブリッド優先証券)	(0)	(0.000)	
(投 資 証 券)	(3)	(0.013)	
そ の 他 費 用	6	0.024	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)	(0.017)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(2)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	351	1.439	

(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。

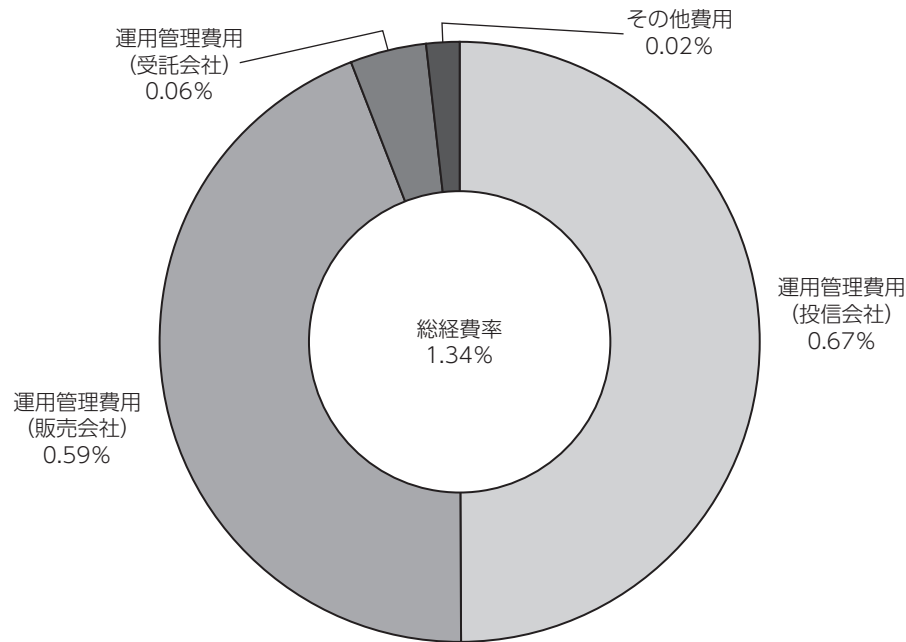
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.34%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。
(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年1月12日から2023年1月10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	37,890	119,320	6,294	19,783
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (BPI)	109,690	138,238	19,292	24,312
ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド	166,252	591,565	15,969	62,050
ダイワ好配当日本株 マザーファンド	105,789	368,729	22,841	80,052
ダイワ北米好配当株 マザーファンド	87,426	388,316	13,631	61,720
ダイワ欧州好配当株 マザーファンド	43,059	90,500	18,698	41,044
ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド	11,637	34,111	3,746	10,918
ダイワJ-REIT アクティブ・マザーファンド	124,217	429,173	9,604	32,754

(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

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

項 目	当 期
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	15,502,104千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,283,816千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.01
	ダイワ北米好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	2,712,756千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,303,035千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.82
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	130,741千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,402,015千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.09
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	481,959千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	657,485千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.73

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) 外国債券インデックスマザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2022年1月12日から2023年1月10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
公社債	百万円 11,525	百万円 —	% —	百万円 4,579	百万円 100
コーポ・ローン	48,108	—	—	—	—

(注) 平均保有割合1.4%

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

(4) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(5) ダイワ好配当日本株マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2022年1月12日から2023年1月10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
株式	百万円 8,006	百万円 1,658	% 20.7	百万円 7,495	百万円 1,757
コーポ・ローン	165,591	—	—	—	—

(注) 平均保有割合17.7%

(6) ダイワ北米好配当株マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(7) ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(8) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(9) ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

決 算 期	期					
	当			期		
区 分	買付額等	うち利害	B／A	売付額等	うち利害	D／C
	A	関係人との取引状況B		C	関係人との取引状況D	
投資証券	百万円 92,608	百万円 19,625	% 21.2	百万円 68,268	百万円 14,401	% 21.1
不動産投信 指数先物取引	9,981	－	－	9,878	－	－
コール・ローン	701,749	－	－	－	－	－

(注) 平均保有割合1.6%

(10) 利害関係人の発行する有価証券等

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

種 類	当 期		
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
投資証券	百万円 330	百万円 －	百万円 1,669

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

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

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

種 類	当 期	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	
	買 付 額	売 付 額
投資証券	百万円 3,143	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(12) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額（Ａ）	9,699千円
うち利害関係人への支払額（Ｂ）	1,561千円
(Ｂ)／(Ａ)	16.1%

(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、大和証券オフィス投資法人です。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	評 価 額
	口 数	口 数	
	千口	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	164,219	195,815	597,277
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	400,305	490,703	598,216
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	558,687	708,970	2,411,703
ダイワ好配当日本株マザーファンド	752,625	835,574	2,970,384
ダイワ北米好配当株マザーファンド	449,713	523,508	2,307,888
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	235,101	259,462	591,783
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	30,022	37,914	112,062
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	588,220	702,833	2,344,512

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年1月10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	597,277	4.9
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	598,216	4.9
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	2,411,703	19.9
ダイワ好配当日本株マザーファンド	2,970,384	24.5
ダイワ北米好配当株マザーファンド	2,307,888	19.0
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	591,783	4.9
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	112,062	0.9
ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド	2,344,512	19.3
コール・ローン等、その他	198,301	1.7
投資信託財産総額	12,132,130	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10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝131.85円、1カナダ・ドル＝98.42円、1オーストラリア・ドル＝91.10円、1香港ドル＝16.89円、1シンガポール・ドル＝99.04円、1ニュージーランド・ドル＝84.00円、1台湾ドル＝4.318円、1イギリス・ポンド＝160.47円、1イスラエル・シェケル＝37.95円、1スイス・フラン＝143.04円、1デンマーク・クローネ＝19.01円、1ノルウェー・クローネ＝13.29円、1スウェーデン・クローネ＝12.66円、1メキシコ・ペソ＝6.89円、100韓国ウォン＝10.62円、1オフショア人民元＝19.455円、1マレーシア・リンギット＝30.139円、1ポーランド・ズロチ＝30.135円、1ユーロ＝141.38円です。

(注3) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（233,724,784千円）の投資信託財産総額（235,643,294千円）に対する比率は、99.2%です。
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（87,658,041千円）の投資信託財産総額（88,798,324千円）に対する比率は、98.7%です。
ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（4,543,021千円）の投資信託財産総額（4,698,382千円）に対する比率は、96.7%です。
ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（1,544,169千円）の投資信託財産総額（1,558,827千円）に対する比率は、99.1%です。
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（693,686千円）の投資信託財産総額（698,248千円）に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年1月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	12,132,130,789円
コール・ローン等	187,220,313
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	597,277,947
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)(評価額)	598,216,236
ダイワ・グローバル R E I T・マザーファンド(評価額)	2,411,703,959
ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額)	2,970,384,682
ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額)	2,307,888,064
ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額)	591,783,162
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド(評価額)	112,062,867
ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド(評価額)	2,344,512,559
未収入金	11,081,000
(B) 負債	94,081,061
未払解約金	13,837,692
未払信託報酬	79,745,040
その他未払費用	498,329
(C) 純資産総額(A - B)	12,038,049,728
元本	5,076,067,557
次期繰越損益金	6,961,982,171
(D) 受益権総口数	5,076,067,557口
1万口当り基準価額(C / D)	23,715円

* 期首における元本額は4,264,260,205円、当作成期間中における追加設定元本額は1,255,999,989円、同解約元本額は444,192,637円です。
 * 当期末の計算口数当りの純資産額は23,715円です。

■損益の状況

当期 自2022年1月12日 至2023年1月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 46,113円
受取利息	1,150
支払利息	△ 47,263
(B) 有価証券売買損益	△ 327,248,160
売買益	84,600,244
売買損	△ 411,848,404
(C) 信託報酬等	△ 151,500,214
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 478,794,487
(E) 前期繰越損益金	2,454,557,280
(F) 追加信託差損益金	4,986,219,378
(配当等相当額)	(5,647,906,216)
(売買損益相当額)	(△ 661,686,838)
(G) 合計(D + E + F)	6,961,982,171
次期繰越損益金(G)	6,961,982,171
追加信託差損益金	4,986,219,378
(配当等相当額)	(5,647,906,216)
(売買損益相当額)	(△ 661,686,838)
分配準備積立金	2,454,582,841
繰越損益金	△ 478,820,048

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
 (注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。
 (注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程（総額）」をご参照ください。
 (注4) 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用：24,880,913円（未監査）

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	5,647,906,216
(d) 分配準備積立金	2,454,582,841
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	8,102,489,057
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e - f)	8,102,489,057
(h) 受益権総口数	5,076,067,557口

NOMURA - B P I 総合指数の知的財産権およびその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等並びに当ファンド及び同指数に関連して行われる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。

F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

外国債券インデックスマザーファンド

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（2022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（2023年1月10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

(2022年1月12日から2023年1月10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)	2.875% 2032/5/15	1,278,650	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.25% 2023/11/15	1,011,232
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	1.875% 2032/2/15	1,244,886	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ)	2023/4/14	790,367
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	2.75% 2032/8/15	980,234	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.125% 2023/8/15	771,610
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	3% 2052/8/15	795,757	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	4.25% 2023/10/25	728,066
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	2.75% 2029/5/31	781,179	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.25% 2023/6/15	722,087
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	4.125% 2032/11/15	684,050	China Government Bond (中国)	2.88% 2023/11/5	708,723
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	2.875% 2052/5/15	654,171	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.5% 2023/8/15	655,479
China Government Bond (中国)	2.88% 2023/11/5	643,842	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.75% 2023/11/15	653,796
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	1.75% 2025/3/15	631,326	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2023/5/15	638,124
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	2.5% 2027/3/31	628,636	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	0.5% 2023/11/30	634,837

(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、2023年1月10日現在における外国債券インデックスマザーファンド（76,916,702千口）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

2023年1月10日現在									
区 分	額 面 金 額	価 額		組 入 比 率	うちBBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
アメリカ	千アメリカ・ドル 975,745	千アメリカ・ドル 881,702	千円 116,252,495	% 49.6	% —	% 22.2	% 17.6	% 9.8	
カナダ	千カナダ・ドル 50,298	千カナダ・ドル 46,715	4,597,696	2.0	—	1.1	0.4	0.4	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 43,434	千オーストラリア・ドル 39,544	3,602,524	1.5	—	1.0	0.4	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 10,749	千シンガポール・ドル 10,560	1,045,871	0.4	—	0.3	0.1	0.1	
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 6,230	千ニュージーランド・ドル 5,482	460,503	0.2	—	0.1	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 78,230	千イギリス・ポンド 67,473	10,827,409	4.6	—	3.4	0.9	0.3	
イスラエル	千イスラエル・シェケル 20,200	千イスラエル・シェケル 19,676	746,707	0.3	—	0.2	0.1	0.0	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 38,365	千デンマーク・クローネ 39,077	742,860	0.3	—	0.2	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 35,136	466,961	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 38,180	千スウェーデン・クローネ 36,943	467,708	0.2	—	0.1	0.1	—	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 280,702	千メキシコ・ペソ 268,613	1,850,773	0.8	—	0.5	0.2	0.1	

2023年1月10日現在									
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちＢＢ格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
中国	千オフショア人民元 459,500	千オフショア人民元 466,887	千円 9,083,385	% 3.9	% －	% 1.8	% 1.7	% 0.4	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 40,253	千マレーシア・リンギット 40,234	1,212,675	0.5	－	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 38,225	千ポーランド・ズロチ 33,444	1,007,870	0.4	－	0.1	0.2	0.1	
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 11,953	千ユーロ 10,668	1,508,329	0.6	－	0.5	0.2	0.0	
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 27,863	千ユーロ 26,063	3,684,837	1.6	－	1.0	0.4	0.2	
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 32,548	千ユーロ 30,150	4,262,686	1.8	－	1.3	0.4	0.2	
ユーロ (フランス)	千ユーロ 152,464	千ユーロ 141,475	20,001,876	8.5	－	5.0	2.6	0.9	
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 114,516	千ユーロ 109,225	15,442,365	6.6	－	3.7	2.1	0.8	
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 87,202	千ユーロ 82,025	11,596,777	4.9	－	3.0	1.4	0.5	
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 134,771	千ユーロ 125,029	17,676,687	7.5	－	4.2	2.3	1.0	
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 9,706	千ユーロ 8,354	1,181,188	0.5	－	0.3	0.2	0.0	
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 20,870	千ユーロ 18,859	2,666,347	1.1	－	0.7	0.4	0.1	
ユーロ (小計)	591,893	551,853	78,021,096	33.3	－	19.6	9.9	3.7	
合 計	－	－	230,386,538	98.2	－	51.2	32.0	15.1	

- (注1) 邦貨換算金額は、2023年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の中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)

2023年1月10日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	% 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	5.229	5,126	5,126	675,896	2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	4,912	4,782	630,542	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.0000	855	906	119,526	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.1250	709	784	103,424	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.2500	738	798	105,225	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.2500	714	834	109,971	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.3750	2,391	2,692	354,997	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.5000	1,176	1,302	171,674	2036/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.0000	847	983	129,651	2037/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	548	598	78,893	2038/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.5000	519	574	75,754	2038/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.5000	1,049	1,031	135,998	2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.2500	1,121	1,207	159,150	2039/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.5000	1,060	1,174	154,888	2039/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	1,210	1,319	174,027	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.6250	1,010	1,134	149,600	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	1,678	1,826	240,784	2040/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.8750	1,091	1,114	146,955	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.2500	1,469	1,571	207,251	2040/11/15	

外国債券インデックスマザーファンド

2023年1月10日現在							
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.7500	1,254	1,427	188,189	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	4.3750	1,365	1,482	195,462	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.7500	1,517	1,511	199,226	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	1,450	1,316	173,616	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	1,623	1,469	193,733	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	1,353	1,197	157,940	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	5,231	4,435	584,816	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	1,630	1,378	181,693	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	2,626	2,357	310,800	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	2,298	1,977	260,724	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.6250	3,214	3,109	409,976	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.7500	2,081	2,049	270,264	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.6250	3,307	3,193	421,124	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.3750	3,327	3,088	407,269	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	6,162	5,970	787,159	2024/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	1,929	1,719	226,658	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	5,921	5,712	753,203	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	2,746	2,393	315,571	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	5,743	5,494	724,434	2025/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	2,563	2,042	269,314	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	5,788	5,535	729,905	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	1,835	1,596	210,472	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	5,743	5,458	719,702	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	1,873	1,594	210,200	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	5,840	5,572	734,776	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	659	573	75,558	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	4,866	4,542	598,871	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	3,148	2,498	329,390	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	7,729	7,191	948,202	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	2,823	2,236	294,889	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	5,400	4,979	656,504	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	2,780	2,092	275,893	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	5,300	4,960	653,976	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	1,000	849	111,959	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	2,500	2,442	321,990	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	3,640	3,431	452,409	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	2,480	2,418	318,816	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	2,345	2,035	268,375	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	2,300	2,237	295,067	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	4,550	4,419	582,657	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	6,400	6,051	797,884	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	2,000	1,736	228,923	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	3,000	2,903	382,868	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	5,300	5,121	675,283	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	2,400	2,315	305,301	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	5,900	5,539	730,384	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	3,000	2,896	381,966	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	1,450	1,201	158,471	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	2,000	1,921	253,294	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	2,500	2,409	317,738	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	5,500	5,150	679,053	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	2,500	2,072	273,226	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	3,500	3,376	445,175	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	3,200	3,077	405,832	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	2,800	2,696	355,579	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	6,350	6,072	800,710	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	2,600	2,514	331,545	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	2,700	2,623	345,898	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	3,000	2,607	343,788	2048/02/15

2023年1月10日現在							
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	2,900	2,810	370,519	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	3,800	3,383	446,051	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	6,500	6,246	823,609	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	1,900	1,850	243,938	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	3,550	3,453	455,392	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	3,000	2,908	383,513	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	6,700	6,428	847,644	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	3,220	2,803	369,704	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	2,500	2,432	320,698	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	3,600	3,486	459,655	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	2,500	2,435	321,123	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	2,500	2,434	321,021	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.1250	3,700	3,597	474,331	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.3750	3,020	2,820	371,938	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	3,000	2,911	383,837	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	1,500	1,446	190,724	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	2,500	2,451	323,200	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	6,600	6,234	822,000	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	4,000	3,911	515,681	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.6250	2,500	2,409	317,636	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	3.0000	4,700	4,110	541,904	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	2,500	2,396	315,935	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	3,300	3,220	424,597	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	2,500	2,378	313,565	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.8750	4,650	3,975	524,141	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	3,900	3,623	477,777	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	3,500	3,399	448,170	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	2,800	2,672	352,319	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.1250	3,000	2,835	373,869	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	3,500	3,365	443,698	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	2,800	2,625	346,146	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	5,500	5,280	696,168	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	2,500	2,338	308,327	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	4,700	4,173	550,264	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	4,600	3,450	454,961	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	2,800	2,568	338,648	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	4,000	3,804	501,562	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,500	2,314	305,120	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	3,000	2,861	377,291	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	1,000	951	125,501	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	3,000	2,771	365,464	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,850	2,547	335,948	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	4,500	3,470	457,530	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,000	1,846	243,426	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	3,000	2,852	376,049	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,500	2,317	305,545	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,500	2,385	314,495	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	1,700	1,606	211,868	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	5,000	4,371	576,322	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.5000	6,500	5,947	784,237	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	5,400	3,806	501,895	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	300	270	35,648	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	5,200	4,882	643,756	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.5000	1,500	1,387	182,894	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	1,600	1,407	185,619	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	6,800	5,535	729,905	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.3750	2,700	2,481	327,152	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.5000	2,400	2,095	276,353	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	5,600	3,238	427,060	2050/05/15

外国債券インデックスマザーファンド

2023年1月10日現在								
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	5,000	3,303	435,540	2040/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.5000	3,500	3,046	401,713	2027/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	3,000	2,741	361,508	2025/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	6,500	5,933	782,300	2025/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.5000	3,500	3,041	401,049	2027/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	3,400	3,091	407,643	2025/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	8,000	6,480	854,388	2030/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.3750	5,000	4,309	568,161	2027/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	6,700	4,003	527,828	2050/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	5,000	3,283	432,889	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.5000	3,500	3,026	399,046	2027/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	4,000	3,623	477,766	2025/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.3750	4,000	3,429	452,224	2027/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	3,500	3,173	418,373	2025/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	9,800	8,065	1,063,422	2030/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	4,000	3,608	475,809	2025/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.5000	4,000	3,442	453,869	2027/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	6,800	4,342	572,547	2050/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.3750	5,100	3,488	460,012	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.3750	5,100	4,604	607,134	2025/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	5,000	4,322	569,888	2027/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.6250	5,000	4,311	568,444	2027/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.3750	1,000	901	118,922	2025/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	4,000	3,821	503,872	2024/01/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	7,000	6,062	799,394	2028/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	5,900	4,018	529,799	2051/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	10,700	8,975	1,183,403	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.1250	5,000	4,762	627,968	2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.3750	5,000	4,493	592,448	2026/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.1250	5,000	4,408	581,221	2028/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.8750	4,700	3,496	460,953	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.5000	3,000	2,700	356,054	2026/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	2,000	1,901	250,710	2024/03/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	4,000	3,542	467,054	2028/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	4,000	3,623	477,766	2026/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.3750	3,000	2,846	375,289	2024/04/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	8,700	7,533	993,349	2031/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	5,100	4,815	634,919	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	4,500	4,066	536,217	2026/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	6,000	5,304	699,443	2028/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.3750	6,400	4,901	646,322	2051/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.2500	3,800	3,003	395,989	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	4,000	3,529	465,409	2028/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.7500	4,400	3,966	523,042	2026/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.2500	2,000	1,883	248,310	2024/06/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.2500	5,000	4,406	580,983	2028/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	0.8750	5,000	4,520	596,074	2026/06/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.3750	5,500	5,176	682,527	2024/07/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.3750	3,000	2,815	371,227	2024/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.2500	10,300	8,610	1,135,347	2031/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.0000	6,900	4,837	637,827	2051/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.7500	3,700	2,666	351,541	2041/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.6250	6,000	5,363	707,132	2026/07/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.0000	5,000	4,335	571,688	2028/07/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.1250	5,000	4,357	574,549	2028/08/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.7500	5,000	4,480	590,720	2026/08/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.3750	7,500	7,021	925,794	2024/09/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.2500	5,000	4,383	577,898	2028/09/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.8750	3,500	3,146	414,819	2026/09/30	

2023年1月10日現在							
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.6250	2,000	1,876	247,453	2024/10/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.7500	4,500	4,220	556,491	2024/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.3750	12,000	10,072	1,328,051	2031/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.8750	6,600	4,480	590,715	2051/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.0000	4,000	3,007	396,599	2041/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.3750	6,000	5,289	697,370	2028/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.1250	7,000	6,339	835,915	2026/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.2500	4,000	3,634	479,148	2026/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.5000	5,600	4,965	654,681	2028/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.0000	2,200	2,069	272,845	2024/12/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.7500	2,500	2,406	317,356	2023/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.3750	4,000	3,523	464,581	2028/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.2500	4,000	3,629	478,573	2026/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.1250	1,000	941	124,082	2025/01/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	0.8750	3,000	2,883	380,147	2024/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.8750	10,400	9,087	1,198,120	2032/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.5000	3,700	3,501	461,716	2025/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.7500	4,300	3,859	508,842	2029/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.2500	3,900	2,901	382,545	2052/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.3750	2,500	2,004	264,270	2042/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.8750	5,000	4,523	596,357	2029/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.5000	4,000	3,863	509,420	2024/02/29
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.8750	1,000	928	122,383	2027/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	1.7500	5,000	4,753	626,775	2025/03/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.3750	3,000	2,789	367,734	2029/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.5000	5,000	4,757	627,210	2027/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.2500	2,000	1,944	256,427	2024/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.6250	2,000	1,936	255,314	2025/04/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.8750	9,300	8,826	1,163,742	2032/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.7500	3,000	2,910	383,806	2025/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.8750	5,000	4,270	563,091	2052/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.2500	1,500	1,380	181,982	2042/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.5000	4,500	4,383	577,981	2024/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.8750	3,000	2,869	378,398	2029/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.7500	3,000	2,882	380,004	2027/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.5000	4,500	4,378	577,305	2024/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.7500	6,000	5,697	751,204	2029/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.6250	2,000	1,911	252,039	2027/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.8750	2,000	1,945	256,551	2025/06/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.2500	4,000	3,910	515,591	2029/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.2500	3,000	2,941	387,805	2027/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.0000	3,000	2,925	385,736	2025/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.7500	4,070	3,906	515,014	2027/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.0000	1,000	979	129,089	2024/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.1250	2,500	2,444	322,297	2025/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.7500	7,500	7,033	927,376	2032/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.0000	5,200	4,567	602,166	2052/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.3750	1,000	937	123,567	2042/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.0000	3,970	3,885	512,337	2024/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	2.6250	3,360	3,165	417,316	2029/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.2500	3,890	3,821	503,925	2024/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.1250	2,500	2,439	321,704	2027/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.1250	3,500	3,397	447,953	2029/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.5000	2,300	2,270	299,427	2025/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	4.2500	3,500	3,495	460,861	2024/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.8750	2,500	2,537	334,556	2029/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	4.1250	1,500	1,527	201,390	2027/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	4.2500	3,400	3,422	451,298	2025/10/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	4.3750	1,000	1,001	132,012	2024/10/31

外国債券インデックスマザーファンド

2023年1月10日現在								
区 分		銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	4.1250	3,000	3,056	402,934	2027/10/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	4.1250	5,000	5,247	691,849	2032/11/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	4.5000	1,500	1,520	200,539	2025/11/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	4.0000	1,900	2,019	266,287	2052/11/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	4.0000	3,000	3,068	404,631	2029/10/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	4.5000	3,000	3,012	397,187	2024/11/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.8750	2,500	2,539	334,826	2029/11/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	3.8750	3,000	3,028	399,319	2027/11/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	4.0000	1,000	1,025	135,206	2042/11/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国 債 証 券	4.0000	3,500	3,505	462,157	2025/12/15
通貨小計	銘 柄 数 額	265銘柄			975,745	881,702	116,252,495	
					千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
カナダ		Canada Government International Bond	国 債 証 券	2.7500	605	557	54,891	2064/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	983	1,135	111,734	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	1,117	1,376	135,491	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.0000	1,012	1,225	120,662	2037/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	913	1,017	100,168	2041/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	961	1,016	100,092	2045/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,405	1,375	135,394	2024/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,337	1,251	123,163	2048/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,156	1,119	110,220	2025/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	969	911	89,677	2026/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	1,240	1,132	111,474	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	650	616	60,642	2028/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	3,710	2,935	288,900	2051/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,220	1,164	114,651	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,200	1,174	115,562	2024/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,400	1,346	132,521	2024/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	3,450	3,041	299,363	2030/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	700	663	65,345	2025/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,890	2,661	261,957	2025/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,000	1,643	161,792	2030/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	2,100	1,896	186,673	2026/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,200	1,144	112,668	2024/04/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	300	275	27,127	2026/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	3,400	3,007	296,035	2031/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	1,000	947	93,264	2024/10/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	2,650	1,947	191,707	2053/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	200	184	18,147	2027/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	3,000	2,891	284,559	2024/02/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	2,100	1,845	181,615	2031/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	200	190	18,731	2025/04/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	400	386	38,054	2024/05/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	1,500	1,370	134,873	2032/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	100	95	9,374	2029/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	400	392	38,602	2027/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	200	196	19,305	2024/08/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	1,000	983	96,774	2025/10/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	770	733	72,152	2032/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	360	354	34,866	2024/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	200	203	19,986	2028/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	300	299	29,464	2025/02/01
通貨小計	銘 柄 数 額	40銘柄			50,298	46,715	4,597,696	
					千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
オーストラリア		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	1,989	2,094	190,776	2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	573	569	51,850	2024/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,354	1,331	121,314	2029/04/21

2023年1月10日現在								
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,798	1,796	163,652	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.5000	1,258	1,341	122,169	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	1,748	1,797	163,714	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	1,113	1,088	99,166	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,307	1,162	105,921	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	792	716	65,296	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,672	1,620	147,592	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	1,178	1,107	100,918	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	1,252	1,040	94,814	2047/03/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,500	1,440	131,194	2028/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,900	1,804	164,361	2029/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	2,870	2,663	242,666	2030/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,390	1,149	104,748	2041/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	2,840	2,393	218,021	2031/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,700	1,371	124,946	2032/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	2,400	2,270	206,811	2024/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	2,000	1,635	148,964	2030/12/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,400	858	78,193	2051/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,600	1,467	133,657	2025/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	2,500	1,993	181,614	2031/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,200	1,080	98,452	2026/09/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,600	1,341	122,208	2032/11/21	
	AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国 債 証 券	3.0000	1,300	1,212	110,488	2033/11/21	
	AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国 債 証 券	3.7500	1,200	1,196	109,007	2034/05/21	
通貨小計	銘 金 額	27銘柄		43,434	39,544	3,602,524		
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	793	78,599	2027/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	3.0000	923	922	91,379	2024/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.8750	809	809	80,203	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	400	413	40,920	2042/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	3.3750	568	593	58,786	2033/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.8750	625	626	62,073	2029/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.3750	524	517	51,248	2025/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.7500	688	720	71,342	2046/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.1250	450	439	43,569	2026/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.2500	750	698	69,196	2036/08/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.6250	550	546	54,090	2028/05/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.0000	490	483	47,922	2024/02/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.3750	350	327	32,410	2039/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	1.8750	540	474	46,956	2050/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	0.5000	750	702	69,578	2025/11/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	1.6250	600	544	53,883	2031/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	1.8750	200	177	17,601	2051/10/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	1.2500	200	189	18,742	2026/11/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.6250	240	234	23,265	2032/08/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	3.0000	220	243	24,129	2072/08/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国 債 証 券	2.8750	100	100	9,971	2027/09/01	
通貨小計	銘 金 額	21銘柄		10,749	10,560	1,045,871		
ニュージーランド				千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル			
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.5000	600	602	50,641	2027/04/15	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	400	374	31,479	2033/04/14	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	490	403	33,934	2037/04/15	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	600	558	46,888	2029/04/20	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	530	428	36,023	2031/05/15	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	350	231	19,450	2041/05/15	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	700	659	55,402	2024/05/15	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	400	323	27,204	2028/05/15	

外国債券インデックスマザーファンド

2023年1月10日現在							
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	% ニュージーランド・ドル 500	ニュージーランド・ドル 438	千円 36,847	2026/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	440	364	30,607	2032/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	380	282	23,765	2051/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	640	613	51,531	2025/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	200	199	16,727	2034/05/15
通貨小計	銘 柄 数 額	13銘柄		6,230	5,482	460,503	
イギリス	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	2.0000	千イギリス・ポンド 921	千イギリス・ポンド 888	142,631	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	2.5000	1,282	939	150,825	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.5000	1,465	1,370	219,932	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.5000	1,760	1,074	172,407	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.7500	1,450	1,102	176,891	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.7500	1,810	1,093	175,461	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.2500	1,410	1,281	205,659	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.6250	1,500	1,361	218,439	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.6250	1,040	566	90,884	2071/10/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.0000	1,800	1,746	280,186	2024/04/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.7500	1,210	774	124,359	2049/01/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.6250	850	499	80,202	2054/10/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.8750	1,500	1,268	203,578	2029/10/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.6250	1,900	1,781	285,849	2025/06/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.2500	1,190	762	122,420	2041/10/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.3750	1,300	1,025	164,606	2030/10/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.5000	1,700	600	96,393	2061/10/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.1250	1,500	1,360	218,391	2026/01/30
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.1250	1,600	1,355	217,456	2028/01/31
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.6250	1,100	490	78,685	2050/10/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.6250	1,700	1,168	187,472	2035/07/31
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.1250	1,300	1,255	201,459	2024/01/31
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.2500	2,500	1,898	304,572	2031/07/31
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.8750	2,000	1,061	170,271	2046/01/31
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	0.3750	500	445	71,553	2026/10/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	1.2500	800	432	69,375	2051/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国 債 証 券	0.2500	1,100	1,027	164,902	2025/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国 債 証 券	1.1250	900	599	96,172	2039/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国 債 証 券	0.5000	700	585	93,946	2029/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国 債 証 券	0.8750	2,300	1,740	279,283	2033/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国 債 証 券	1.5000	300	171	27,515	2053/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国 債 証 券	1.0000	2,100	1,684	270,263	2032/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国 債 証 券	1.1250	820	353	56,772	2073/10/22
	UNITED KINGDOM GILT	国 債 証 券	4.1250	2,000	2,029	325,722	2027/01/29
	UNITED KINGDOM GILT	国 債 証 券	3.7500	1,000	975	156,564	2038/01/29
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	6.0000	949	1,072	172,115	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	2,240	2,369	380,153	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	5.0000	1,472	1,518	243,721	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,362	1,420	227,958	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.7500	1,357	1,487	238,621	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,708	1,814	291,147	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,366	1,405	225,525	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,232	1,275	204,693	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.5000	2,116	2,257	362,297	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.7500	1,600	1,739	279,212	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,343	1,392	223,482	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,446	1,495	239,919	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.5000	1,560	1,678	269,371	2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.0000	1,174	1,213	194,750	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	4.2500	1,577	1,626	260,966	2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	3.7500	1,552	1,492	239,446	2052/07/22

2023年1月10日現在								
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	3.2500	1,866	千イギリス・ポンド	千円	2044/01/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	3.5000	1,386	1,655	265,702	2068/07/22	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	2.7500	1,092	1,301	208,844	2024/09/07	
	United Kingdom Gilt	国 債 証 券	3.5000	1,524	1,079	173,167	2045/01/22	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	55銘柄		78,230	67,473	10,827,409		
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	6.2500	1,800	千イスラエル・シェケル	74,955	2026/10/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	5.5000	1,600	1,975	77,713	2042/01/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	3.7500	2,000	2,047	75,783	2024/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	1.7500	2,300	1,996	83,232	2025/08/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	2.0000	1,800	2,193	64,568	2027/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	3.7500	2,400	1,701	94,018	2047/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	2.2500	1,200	2,477	42,996	2028/09/28	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	1.0000	2,400	1,132	77,827	2030/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	0.5000	1,600	2,050	56,478	2025/04/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国 債 証 券	1.5000	1,700	1,488	50,439	2037/05/31	
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国 債 証 券	0.5000	200	1,329	6,915	2026/02/27	
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国 債 証 券	0.4000	900	182	32,188	2024/10/31	
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国 債 証 券	1.3000	300	848	9,588	2032/04/30	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	13銘柄		20,200	19,676	746,707		
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.5000	13,662	千デンマーク・クローネ	334,211	2039/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	6,013	17,580	111,824	2025/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	5,100	5,882	88,591	2027/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	8,590	4,660	143,824	2029/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	3,500	7,565	38,613	2052/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	500	2,031	7,668	2031/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,000	403	18,126	2024/11/15	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	7銘柄		38,365	39,077	742,860		
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	4,095	千ノルウェー・クローネ	54,236	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	5,395	4,080	69,573	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	4,340	5,235	54,991	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	4,450	4,137	56,216	2027/02/17	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	3,500	4,229	44,205	2028/04/26	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	3,850	3,326	47,124	2029/09/06	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.3750	6,800	3,545	79,884	2030/08/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	3,500	6,010	39,956	2031/09/17	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.1250	1,700	3,006	20,772	2032/05/18	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	9銘柄		37,630	35,136	466,961		
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	3,655	千スウェーデン・クローネ	55,823	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	7,595	4,409	95,923	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	7,180	7,576	86,394	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	5,050	6,824	59,341	2028/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	3,300	4,687	42,438	2032/06/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	6,400	3,352	74,059	2029/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.1250	5,000	5,849	53,727	2031/05/12	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	7銘柄		38,180	36,943	467,708		
メキシコ	Mexican Bonos	国 債 証 券	5.7500	37,290	千メキシコ・ペソ	234,517	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.0000	21,300	34,036	136,356	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.0000	23,800	19,790	158,674	2024/09/05	
	MEXICAN BONOS	国 債 証 券	5.5000	7,000	23,029	42,924	2027/03/04	

外国債券インデックスマザーファンド

2023年1月10日現在							
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	MEXICAN BONOS	国 債 証 券	5.0000	千メキシコ・ペソ1,000	千メキシコ・ペソ911	千円6,283	2025/03/06
	MEXICAN BONOS	国 債 証 券	8.0000	9,000	8,373	57,692	2053/07/31
	MEXICAN BONOS	国 債 証 券	7.5000	10,000	9,261	63,812	2033/05/26
	Mexican Bonos	国 債 証 券	10.0000	23,919	24,053	165,728	2024/12/05
	Mexican Bonos	国 債 証 券	7.5000	27,968	26,885	185,240	2027/06/03
	Mexican Bonos	国 債 証 券	10.0000	8,874	9,877	68,057	2036/11/20
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.5000	29,544	29,487	203,170	2029/05/31
	Mexican Bonos	国 債 証 券	8.5000	18,894	18,551	127,818	2038/11/18
	Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	32,515	31,014	213,690	2031/05/29
	Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	21,654	19,665	135,497	2042/11/13
	Mexican Bonos	国 債 証 券	7.7500	7,944	7,446	51,306	2034/11/23
通貨小計	銘 柄 数 額 金	15銘柄		280,702	268,613	1,850,773	
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5,323	103,563	2025/12/06
	China Government Bond	国 債 証 券	3.2500	5,000	5,153	100,263	2028/11/22
	China Government Bond	国 債 証 券	3.2900	5,000	5,188	100,933	2029/05/23
	China Government Bond	国 債 証 券	3.2500	5,000	5,125	99,719	2026/06/06
	China Government Bond	国 債 証 券	3.1200	12,000	12,241	238,161	2026/12/05
	China Government Bond	国 債 証 券	3.1300	8,000	8,196	159,462	2029/11/21
	China Government Bond	国 債 証 券	2.8500	13,000	13,114	255,143	2027/06/04
	China Government Bond	国 債 証 券	2.6800	6,500	6,432	125,142	2030/05/21
	China Government Bond	国 債 証 券	3.0200	18,000	18,285	355,740	2025/10/22
	China Government Bond	国 債 証 券	3.2800	9,000	9,281	180,568	2027/12/03
	China Government Bond	国 債 証 券	3.2700	12,500	12,959	252,127	2030/11/19
	China Government Bond	国 債 証 券	3.0300	7,000	7,122	138,576	2026/03/11
	China Government Bond	国 債 証 券	3.8100	7,300	8,030	156,239	2050/09/14
	China Government Bond	国 債 証 券	3.0100	7,000	7,115	138,423	2028/05/13
	China Government Bond	国 債 証 券	3.7200	14,000	15,148	294,715	2051/04/12
	China Government Bond	国 債 証 券	3.0200	15,800	16,019	311,658	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.6900	4,500	4,518	87,898	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7400	5,000	5,049	98,236	2026/08/04
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5700	11,000	11,235	218,591	2024/06/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5900	5,500	5,771	112,292	2027/08/03
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.6900	15,000	15,393	299,479	2024/09/21
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.6900	5,000	5,300	103,119	2028/05/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.6100	17,000	17,560	341,646	2025/06/07
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5400	4,500	4,735	92,131	2028/08/16
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0800	4,500	5,146	100,118	2048/10/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.8600	6,300	6,954	135,300	2049/07/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7700	11,000	11,386	221,535	2025/03/28
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.3900	12,000	12,259	238,512	2050/03/16
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.9100	5,500	5,557	108,127	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5300	3,500	3,668	71,375	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.8900	6,000	6,009	116,917	2031/11/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.3700	17,000	16,839	327,606	2027/01/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	7,200	7,119	138,507	2032/02/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2600	10,000	9,975	194,067	2025/02/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.8000	15,000	15,003	291,892	2029/03/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.3200	5,500	5,595	108,864	2052/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7600	5,000	4,949	96,283	2032/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	4,000	3,989	77,620	2029/06/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.6900	4,000	3,936	76,580	2032/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.1800	25,000	24,832	483,126	2025/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.6000	12,000	11,711	227,845	2032/09/01
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.9900	22,000	21,878	425,643	2024/09/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.6200	9,500	9,391	182,717	2029/09/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.4400	17,200	17,066	332,022	2027/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.1200	4,000	3,931	76,487	2052/10/25

2023年1月10日現在								
区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.8000	千オフショア人民元	千オフショア人民元	千円	2032/11/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2800	18,000	17,914	348,533	2025/11/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7900	12,000	11,989	233,249	2029/12/15
通貨小計	銘 柄 数 額	48銘柄			459,500	466,887	9,083,385	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.5020		千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.4980		2,373	2,345	70,705	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.3920		1,178	1,217	36,693	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.3920		1,514	1,548	46,662	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.2320		1,300	1,323	39,880	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8920		731	734	22,139	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8440		1,427	1,404	42,342	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.7330		1,886	1,867	56,299	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.9350		1,300	1,399	42,193	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.1810		1,057	1,068	32,189	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.9550		1,737	1,754	52,867	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.2540		1,220	1,229	37,042	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.7360		930	966	29,138	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.9000		1,550	1,559	46,995	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.0590		1,550	1,564	47,160	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8990		1,190	1,196	36,060	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.7620		1,950	2,057	62,022	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8820		1,200	1,208	36,415	2033/11/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.6420		1,200	1,260	37,995	2038/06/08
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.8930		600	641	19,323	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.9060		650	654	19,731	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8850		2,310	2,301	69,368	2048/07/06
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.9210		1,200	1,267	38,198	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.4780		400	399	12,053	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.8280		1,300	1,268	38,230	2040/05/22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.7570		1,750	1,622	48,897	2050/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.0650		2,650	2,447	73,774	2031/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	2.6320		1,800	1,630	49,151	2032/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	3.5820		1,400	1,357	40,908	2042/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.6960		400	421	12,711	2029/04/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国 債 証 券	4.5040		500	514	15,518	
通貨小計	銘 柄 数 額	30銘柄			40,253	40,234	1,212,675	
ポーランド	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.5000		千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		2026/07/25
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.5000		4,377	3,920	118,143	2027/07/25
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.5000		3,170	2,778	83,721	2024/04/25
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.7500		2,870	2,749	82,863	2029/10/25
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.2500		4,840	4,056	122,228	2024/10/25
	Poland Government Bond	国 債 証 券	0.7500		3,400	3,194	96,276	2025/04/25
	Poland Government Bond	国 債 証 券	1.2500		2,000	1,793	54,035	2030/10/25
	Poland Government Bond	国 債 証 券	0.2500		3,000	2,170	65,395	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—		2,200	1,797	54,165	2024/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—		1,000	915	27,576	2032/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500		1,800	1,285	38,729	2027/05/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500		500	461	13,906	2029/04/25
	Poland Government Bond	国 債 証 券	5.7500		827	832	25,081	2028/04/25
	Poland Government Bond	国 債 証 券	2.7500		3,650	3,172	95,598	2025/07/25
	Poland Government Bond	国 債 証 券	3.2500		4,591	4,318	130,149	
通貨小計	銘 柄 数 額	14銘柄			38,225	33,444	1,007,870	
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国 債 証 券	5.4000		千ユーロ	千ユーロ		2025/03/13
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	3.4000		1,031	1,091	154,324	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	2.4000		607	612	86,617	2030/05/15
					961	949	134,200	

外国債券インデックスマザーファンド

2023年1月10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		
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	2.0000	千ユーロ 931	千ユーロ 779	千円 110,230	2045/02/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	1.0000	1,073	1,024	144,815	2026/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	1.7000	550	470	66,490	2037/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	0.9000	800	735	104,046	2028/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	1.3000	750	651	92,096	2033/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	1.3500	750	684	96,770	2031/03/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	1.1000	950	869	122,987	2029/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	1.5000	600	442	62,556	2050/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	0.4000	350	259	36,749	2035/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	0.2000	500	452	64,040	2027/05/15	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	0.2000	800	665	94,153	2030/10/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	—	800	635	89,815	2031/10/18	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	0.5500	400	262	37,123	2041/04/22	
	IRISH TREASURY	国 債 証 券	0.3500	100	79	11,309	2032/10/18	
国 小 計	銘 柄 数 金 額	17銘柄		11,953	10,668	1,508,329		
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	千ユーロ 1,139	千ユーロ 1,302	184,094	2028/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,755	2,031	287,203	2037/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.7500	1,729	2,028	286,828	2042/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,468	1,459	206,369	2033/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	1,929	2,037	288,095	2047/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	1,514	1,500	212,202	2024/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,791	1,693	239,444	2025/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,938	1,811	256,165	2026/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	2,200	2,045	289,129	2027/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,400	1,364	192,866	2024/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	1,350	1,237	175,027	2028/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,200	1,045	147,821	2029/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	900	645	91,294	2040/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,400	1,166	164,962	2030/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	800	726	102,643	2027/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,250	652	92,197	2052/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,300	1,055	149,268	2031/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	900	613	86,711	2038/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	900	778	110,074	2029/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	100	92	13,111	2026/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	600	498	70,431	2032/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	300	275	38,894	2054/01/15	
国 小 計	銘 柄 数 金 額	22銘柄		27,863	26,063	3,684,837		
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.8000	千ユーロ 1,699	千ユーロ 1,628	230,276	2025/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.0000	1,774	1,547	218,767	2031/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.9000	1,058	903	127,739	2038/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.0000	1,463	1,391	196,695	2026/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.6000	1,244	930	131,494	2047/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	2.1500	740	615	87,005	2066/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.8000	1,100	1,019	144,166	2027/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.5000	1,050	1,011	143,043	2024/10/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	2.2500	580	490	69,392	2057/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.4500	600	486	68,837	2037/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.8000	1,490	1,362	192,617	2028/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.2500	650	560	79,233	2033/04/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.9000	1,500	1,353	191,393	2029/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	1.7000	700	521	73,713	2050/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.1000	1,220	1,013	143,290	2030/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	0.4000	860	546	77,242	2040/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	—	1,200	1,063	150,394	2027/10/22	

2023年1月10日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	—	1,600	1,261	178,360	2031/10/22	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.6500	530	248	35,189	2071/06/22	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.3500	400	318	45,056	2032/06/22	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4000	800	538	76,130	2053/06/22	
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	400	380	53,742	2039/04/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	5.5000	1,706	1,949	275,689	2028/03/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	5.0000	1,904	2,284	322,992	2035/03/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.2500	1,604	1,845	260,862	2041/03/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.5000	1,001	1,060	149,985	2026/03/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	4.0000	780	853	120,694	2032/03/28	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	3.7500	643	709	100,357	2045/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	2.6000	1,505	1,502	212,442	2024/06/22	
	Belgium Government Bond	国 債 証 券	3.0000	747	748	105,875	2034/06/22	
国 小 計	銘 柄 数 額	30銘柄		32,548	30,150	4,262,686		
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.0000	千ユーロ	千ユーロ			
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	3,025	3,297	466,212	2025/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	3,323	3,893	550,476	2029/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	3,227	4,062	574,315	2032/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	2,659	3,150	445,404	2035/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,764	2,121	299,959	2055/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	2,374	2,661	376,214	2038/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.5000	3,164	3,803	537,686	2041/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	1,217	1,501	212,342	2060/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	3,646	3,750	530,296	2026/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	5,899	5,963	843,066	2027/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	3,088	3,209	453,739	2045/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	6,086	6,049	855,327	2024/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	5,087	5,075	717,581	2030/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	4,899	4,815	680,749	2024/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	3,492	3,322	469,794	2025/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	5,101	4,881	690,175	2025/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	5,120	4,717	667,027	2031/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	4,387	4,097	579,292	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	4,169	3,382	478,255	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,387	1,028	145,419	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	4,050	3,710	524,594	2026/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	2,570	2,175	307,554	2039/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	3,400	3,185	450,331	2027/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	2,550	2,099	296,840	2048/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	5,400	4,919	695,512	2028/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	3,950	3,335	471,617	2034/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	4,950	4,473	632,514	2028/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	3,400	3,292	465,516	2024/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	2,850	2,069	292,533	2050/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	4,350	3,835	542,303	2029/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	4,330	4,085	577,605	2025/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	4,200	3,536	499,934	2029/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	2,770	1,591	225,042	2052/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	3,000	2,770	391,650	2026/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,200	1,457	205,992	2040/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	4,000	3,272	462,595	2030/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,480	633	89,614	2072/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	100	97	13,718	2024/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,500	922	130,490	2044/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	4,600	3,653	516,577	2031/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	3,100	2,795	395,265	2027/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	2,100	1,178	166,595	2053/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,100	1,638	231,719	2032/05/25	

外国債券インデックスマザーファンド

2023年1月10日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	2025/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,100	1,984	280,553	2038/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	200	156	22,177	2038/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7500	300	274	38,790	2028/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	2,800	2,626	371,324	2032/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,000	916	129,570	2043/05/25
国 小 計	銘 柄 数 額	48銘柄		152,464	141,475	20,001,876	
ユーロ (ドイツ)	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.2500	千ユーロ	千ユーロ		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.5000	974	1,008	142,633	2024/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.5000	1,167	1,377	194,794	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.6250	2,162	2,504	354,129	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	950	1,072	151,658	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.2500	1,951	2,457	347,435	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.5000	3,048	3,768	532,758	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	2,305	2,882	407,507	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	3,271	3,927	555,268	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2500	1,325	1,675	236,899	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7500	1,739	2,337	330,474	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,974	2,275	321,666	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	2,808	2,935	415,010	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	1,561	1,547	218,853	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	2,679	2,828	399,944	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,594	1,572	222,254	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	4,042	3,946	557,942	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,194	2,106	297,764	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	2,134	2,058	291,024	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	4,168	3,941	557,203	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,420	2,230	315,356	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	4,200	3,874	547,824	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	3,300	3,055	431,917	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	2,770	2,283	322,853	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,900	1,744	246,683	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	4,100	3,682	520,585	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	2,200	1,959	277,052	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	3,000	2,601	367,793	2029/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,850	1,605	227,052	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,750	1,501	212,309	2030/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,100	1,581	223,611	2035/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,000	1,798	254,212	2027/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,800	1,529	216,232	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,200	1,020	144,253	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	900	755	106,876	2031/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,400	1,029	145,483	2036/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,000	1,762	249,120	2028/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,100	621	87,821	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	3,600	2,990	422,860	2031/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	700	581	82,251	2031/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	3,800	3,117	440,717	2032/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	400	331	46,889	2038/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7000	2,700	2,579	364,716	2032/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.8000	1,200	1,101	155,747	2053/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.1000	200	198	28,056	2029/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,200	650	92,021	2052/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	100	97	13,718	2024/03/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2000	100	96	13,671	2024/06/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.4000	530	511	72,287	2024/09/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2000	1,500	1,489	210,515	2024/12/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,920	1,859	262,912	2024/04/05
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,700	1,626	229,927	2024/10/18

2023年1月10日現在								
区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	2025/04/11
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,400	2,271	321,155	2025/10/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,300	2,155	304,808	2025/10/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	100	94	13,302	2025/10/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,200	2,042	288,731	2026/04/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	1,300	1,192	168,608	2026/10/09
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	100	90	12,840	2027/04/16
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.3000	3,000	2,872	406,054	2027/10/15
国 小 計	銘 柄 数 額	59銘柄			114,516	109,225	15,442,365	
ユーロ (スペイン)		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.0000	2,652	3,107	439,399	2029/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.6000	2,045	1,994	282,024	2025/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.9500	2,052	1,905	269,452	2030/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.1500	2,192	2,161	305,544	2025/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.9500	2,733	2,663	376,530	2026/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.9000	1,952	1,749	247,275	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.4500	1,550	1,461	206,680	2066/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.3000	2,630	2,494	352,680	2026/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	1,900	1,801	254,723	2027/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.3500	1,750	1,607	227,324	2033/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4500	2,050	1,922	271,801	2027/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4000	2,400	2,225	314,654	2028/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7000	1,200	1,022	144,560	2048/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4000	2,900	2,680	378,915	2028/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4500	1,600	1,466	207,364	2029/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.8500	2,250	1,894	267,888	2035/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	2,300	2,213	312,898	2024/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.6000	2,800	2,400	339,382	2029/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	2,560	2,147	303,625	2030/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	2,500	2,364	334,247	2025/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	1,400	772	109,264	2050/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.8000	2,400	2,193	310,083	2027/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	2,400	2,106	297,854	2030/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2000	1,300	889	125,806	2040/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	500	459	64,935	2026/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.1000	2,200	1,725	243,998	2031/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	300	288	40,813	2024/05/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4500	650	324	45,852	2071/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	500	432	61,206	2028/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.8500	1,900	1,317	186,200	2037/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,900	1,519	214,859	2031/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.0000	600	385	54,478	2042/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	900	803	113,559	2027/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7000	2,100	1,684	238,088	2032/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.9000	600	407	57,553	2052/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	100	93	13,237	2025/05/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.8000	100	87	12,304	2029/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5500	1,700	1,599	226,088	2032/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.4500	1,000	966	136,618	2043/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.7500	2,179	2,652	374,991	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.2000	1,754	1,896	268,086	2037/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.9000	1,158	1,367	193,270	2040/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.8000	1,682	1,717	242,775	2024/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.7000	1,973	2,280	322,374	2041/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.6500	2,789	2,920	412,963	2025/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.9000	1,965	2,172	307,173	2026/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.1500	1,770	1,976	279,470	2028/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	5.1500	1,299	1,608	227,398	2044/10/31	

外国債券インデックスマザーファンド

2023年1月10日現在								
区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	2024/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.8000 2.7500	1,970 2,097	1,994 2,097	281,938 296,550	2024/10/31
国 小 計	銘 柄 数 金 額	50銘柄			87,202	82,025	11,596,777	
ユーロ (イタリア)		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	7.2500	1,110	1,267	179,203	2026/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	6.5000	2,392	2,715	383,882	2027/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,814	1,797	254,142	2024/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	1,509	1,273	180,016	2046/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	2,487	2,396	338,774	2025/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.6500	2,065	1,695	239,722	2032/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	2,891	2,794	395,118	2025/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7000	1,610	1,229	173,848	2047/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.6000	2,386	2,255	318,921	2026/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2500	2,324	1,842	260,474	2036/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2500	1,068	987	139,559	2026/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.8000	968	689	97,445	2067/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.4500	1,500	1,271	179,716	2033/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.2000	1,510	1,437	203,287	2027/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.8500	1,300	1,279	180,834	2024/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.4500	1,650	1,430	202,192	2048/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0500	2,700	2,543	359,608	2027/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4500	1,600	1,555	219,955	2024/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.9500	1,300	1,096	155,070	2038/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	2,100	1,951	275,889	2028/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4500	1,300	1,253	177,258	2025/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.8000	2,550	2,438	344,728	2028/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,550	1,524	215,488	2025/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.3500	1,270	1,148	162,441	2035/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.8500	1,650	1,518	214,626	2049/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	1,900	1,818	257,068	2029/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	2,200	2,158	305,213	2024/07/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.1000	2,100	2,014	284,784	2026/07/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.1000	1,250	1,054	149,085	2040/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.3500	1,900	1,603	226,633	2030/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.3500	1,300	1,230	173,935	2025/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.8500	2,350	2,131	301,311	2027/01/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.4500	1,550	1,095	154,931	2050/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.4500	1,500	1,077	152,327	2036/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.8500	1,500	1,453	205,438	2025/07/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9500	2,000	1,615	228,373	2030/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.6500	2,100	1,777	251,324	2030/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9500	2,200	1,964	277,705	2027/09/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	1,700	1,562	220,892	2026/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.8000	1,500	1,024	144,890	2041/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9000	1,900	1,497	211,773	2031/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	－	1,100	1,067	150,875	2024/01/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7000	1,200	707	99,978	2051/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9500	700	457	64,701	2037/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	1,900	1,599	226,206	2028/03/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.6000	1,800	1,364	192,972	2031/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	700	420	59,474	2045/04/30
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	－	1,100	988	139,729	2026/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	－	1,500	1,444	204,170	2024/04/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.1500	460	275	38,991	2072/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	800	675	95,455	2028/07/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9500	1,900	1,468	207,556	2031/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	－	1,000	953	134,784	2024/08/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	－	1,200	1,162	164,367	2024/01/30

2023年1月10日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
			—	3,100	2,755	389,585	2026/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9500	1,700	1,294	183,057	2032/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.4500	900	738	104,460	2029/02/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	300	283	40,054	2024/12/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.1500	800	514	72,698	2052/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.1000	300	272	38,571	2027/04/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.2000	500	475	67,159	2025/08/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.8000	800	754	106,614	2029/06/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.5000	1,600	1,389	196,427	2032/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.2500	300	261	37,020	2038/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.7500	100	98	13,881	2024/05/30	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.6500	200	191	27,123	2027/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.0000	500	483	68,420	2035/04/30	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.5000	300	301	42,605	2026/01/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	4.4000	300	302	42,819	2033/05/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.8500	300	298	42,252	2029/12/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.4000	1,500	1,479	209,213	2028/04/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.2500	3,254	3,560	503,437	2029/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	6.0000	2,849	3,277	463,315	2031/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.7500	1,805	2,032	287,329	2033/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	2,298	2,439	344,852	2034/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.0000	2,740	2,657	375,728	2037/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	2,044	2,184	308,836	2039/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	2,118	2,202	311,378	2025/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	5.0000	2,243	2,403	339,747	2040/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000	2,070	2,143	303,092	2026/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.7500	2,410	2,546	360,004	2028/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.7500	1,813	1,894	267,784	2044/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	4.5000	2,194	2,229	315,215	2024/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.7500	2,201	2,224	314,510	2024/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国 債 証 券	3.5000	2,318	2,279	322,324	2030/03/01	
国 小 計	銘 柄 数 額	85銘柄		134,771	125,029	17,676,687		
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.7500	千ユーロ	千ユーロ			
				364	310	43,939	2031/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.8750	279	266	37,734	2025/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.5000	811	761	107,659	2026/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	1.3750	360	276	39,147	2047/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.5000	800	724	102,476	2027/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	1.1250	470	392	55,480	2034/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.5000	500	444	62,805	2028/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.5000	500	434	61,390	2029/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	—	200	191	27,088	2024/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.1250	310	216	30,618	2036/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.2500	400	254	35,967	2040/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	—	500	405	57,275	2030/09/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.1250	400	200	28,398	2052/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	0.1250	600	479	67,767	2031/09/15	
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	200	182	25,732	2026/09/15	
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	450	288	40,816	2043/04/15	
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	300	267	37,805	2032/09/15	
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.3750	270	256	36,202	2027/04/15	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	4.0000	667	690	97,684	2025/07/04	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	2.7500	389	392	55,432	2028/07/04	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	2.6250	407	393	55,592	2042/07/04	
	Finland Government Bond	国 債 証 券	2.0000	529	524	74,173	2024/04/15	
国 小 計	銘 柄 数 額	22銘柄		9,706	8,354	1,181,188		

外国債券インデックスマザーファンド

2023年1月10日現在								
区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ユーロ（オーストリア）		Austria Government Bond	国 債 証 券	1.2000	千ユーロ 1,373	千ユーロ 1,326	千円 187,479	2025/10/20
		Austria Government Bond	国 債 証 券	0.7500	1,126	1,056	149,354	2026/10/20
		Austria Government Bond	国 債 証 券	1.5000	784	602	85,228	2047/02/20
		Austria Government Bond	国 債 証 券	1.5000	240	160	22,648	2086/11/02
		Austria Government Bond	国 債 証 券	0.5000	1,280	1,173	165,964	2027/04/20
		Austria Government Bond	国 債 証 券	2.1000	540	437	61,799	2117/09/20
		Austria Government Bond	国 債 証 券	0.7500	1,200	1,097	155,099	2028/02/20
		Austria Government Bond	国 債 証 券	0.5000	1,280	1,123	158,845	2029/02/20
		Austria Government Bond	国 債 証 券	—	800	769	108,793	2024/07/15
		Austria Government Bond	国 債 証 券	—	980	808	114,246	2030/02/20
		Austria Government Bond	国 債 証 券	0.7500	700	427	60,387	2051/03/20
		Austria Government Bond	国 債 証 券	—	400	238	33,706	2040/10/20
		Austria Government Bond	国 債 証 券	0.8500	350	168	23,859	2120/06/30
		Austria Government Bond	国 債 証 券	—	1,200	960	135,831	2031/02/20
		Austria Government Bond	国 債 証 券	—	480	452	63,977	2025/04/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	600	418	59,121	2036/10/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7000	300	148	20,975	2071/04/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	—	300	257	36,458	2028/10/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9000	500	423	59,894	2032/02/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.8500	300	247	34,948	2049/05/23
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	300	294	41,692	2026/07/15
		Austria Government Bond	国 債 証 券	6.2500	825	958	135,449	2027/07/15
		Austria Government Bond	国 債 証 券	4.1500	1,373	1,561	220,772	2037/03/15
		Austria Government Bond	国 債 証 券	4.8500	875	938	132,672	2026/03/15
		Austria Government Bond	国 債 証 券	3.8000	338	411	58,202	2062/01/26
		Austria Government Bond	国 債 証 券	3.1500	723	748	105,810	2044/06/20
		Austria Government Bond	国 債 証 券	2.4000	771	733	103,656	2034/05/23
		Austria Government Bond	国 債 証 券	1.6500	932	915	129,470	2024/10/21
国 小 計		銘 金 柄 数 額	28銘柄					
		金 額			20,870	18,859	2,666,347	
通 貨 小 計		銘 金 柄 数 額	361銘柄					
		金 額			591,893	551,853	78,021,096	
合 計		銘 金 柄 数 額	925銘柄					
		金 額					230,386,538	

（注1）邦貨換算金額は、2023年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

（注2）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の決算日（2022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（2023年1月10日）現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の組入資産の内容等を掲載いたしました。

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

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
151 5年国債 0.005% 2027/3/20		449,928	137 5年国債 0.1% 2023/9/20		591,416
154 5年国債 0.1% 2027/9/20		440,052	138 5年国債 0.1% 2023/12/20		561,080
368 10年国債 0.2% 2032/9/20		398,194	135 5年国債 0.1% 2023/3/20		420,726
439 2年国債 0.005% 2024/8/1		390,705	136 5年国債 0.1% 2023/6/20		380,733
366 10年国債 0.2% 2032/3/20		388,931	430 2年国債 0.005% 2023/11/1		250,272
153 5年国債 0.005% 2027/6/20		370,170	422 2年国債 0.1% 2023/3/1		240,405
367 10年国債 0.2% 2022/6/20		359,729	428 2年国債 0.005% 2023/9/1		240,333
365 10年国債 0.1% 2031/12/20		346,999	329 10年国債 0.8% 2023/6/20		201,860
150 5年国債 0.005% 2026/12/20		329,954	429 2年国債 0.005% 2023/10/1		180,223
433 2年国債 0.005% 2024/2/1		250,214	425 2年国債 0.005% 2023/6/1		155,147

(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、2023年1月10日現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）（34,357,539千円）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）

2023年1月10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			
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
国債証券	39,016,000	38,233,810	91.3	—	58.4	21.4	11.5	
地方債証券	1,400,000	1,429,751	3.4	—	1.3	2.2	—	
特殊債券(除く金融債券)	700,000	718,256	1.7	—	0.5	1.0	0.2	
普通社債券	1,300,000	1,276,323	3.0	—	0.7	1.9	0.5	
合 計	42,416,000	41,658,141	99.5	—	60.8	26.4	12.2	

(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）

2023年1月10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	433 2年国債	0.0050	250,000	250,037	2024/02/01
	434 2年国債	0.0050	170,000	170,028	2024/03/01
	139 5年国債	0.1000	640,000	640,793	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	83,000	83,595	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	19,000	19,429	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	25,000	25,653	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	12,000	12,299	2024/03/20
	435 2年国債	0.0050	30,000	30,003	2024/04/01
	436 2年国債	0.0050	200,000	200,012	2024/05/01
	437 2年国債	0.0050	150,000	150,000	2024/06/01
	140 5年国債	0.1000	470,000	470,573	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	320,000	322,691	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	18,000	18,617	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	17,000	17,534	2024/06/20
	438 2年国債	0.0050	20,000	19,998	2024/07/01
	439 2年国債	0.0050	390,000	389,937	2024/08/01
	440 2年国債	0.0050	200,000	199,966	2024/09/01
	141 5年国債	0.1000	620,000	620,886	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	210,000	211,719	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	53,000	54,867	2024/09/20
	441 2年国債	0.0050	80,000	79,985	2024/10/01
	442 2年国債	0.0050	200,000	199,962	2024/11/01
	142 5年国債	0.1000	320,000	320,496	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	300,000	301,626	2024/12/20
	143 5年国債	0.1000	630,000	630,957	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	80,000	80,646	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	14,000	14,633	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	25,000	26,021	2025/03/20
	144 5年国債	0.1000	580,000	580,916	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	135,000	136,200	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	17,000	17,772	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	14,000	14,670	2025/06/20
	145 5年国債	0.1000	710,000	711,143	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	190,000	191,837	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	65,000	68,423	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	28,000	29,550	2025/09/20
	146 5年国債	0.1000	360,000	360,579	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	15,000	15,112	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	580,000	579,072	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	140,000	140,200	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	31,000	33,016	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	6,000	6,428	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	35,000	37,387	2026/03/20
	148 5年国債	0.0050	500,000	498,710	2026/06/20
	343 10年国債	0.1000	270,000	270,183	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	33,000	35,511	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	15,000	16,090	2026/06/20
	149 5年国債	0.0050	450,000	448,263	2026/09/20
	344 10年国債	0.1000	90,000	89,966	2026/09/20
	150 5年国債	0.0050	330,000	328,254	2026/12/20
	345 10年国債	0.1000	410,000	409,356	2026/12/20

2023年1月10日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	92 20年国債	2.1000	60,000	64,620	2026/12/20
	151 5年国債	0.0050	450,000	446,913	2027/03/20
	346 10年国債	0.1000	250,000	249,272	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	18,000	19,373	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	45,000	48,619	2027/03/20
	1 フリリピン共和国	0.7600	100,000	97,309	2027/04/22
	153 5年国債	0.0050	370,000	366,825	2027/06/20
	347 10年国債	0.1000	400,000	398,240	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	30,000	32,778	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	63,000	68,280	2027/06/20
	154 5年国債	0.1000	440,000	437,443	2027/09/20
	348 10年国債	0.1000	430,000	427,501	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	25,000	27,304	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	64,000	69,601	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	380,000	377,218	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	53,000	57,812	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	480,000	475,704	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	35,000	38,474	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	18,000	19,971	2028/03/20
	351 10年国債	0.1000	470,000	464,844	2028/06/20
	102 20年国債	2.4000	10,000	11,129	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	21,000	23,259	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	64,000	70,201	2028/06/20
	352 10年国債	0.1000	500,000	493,575	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	38,000	41,791	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	16,000	17,685	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	440,000	433,598	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	40,000	44,111	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	68,000	74,197	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	410,000	403,304	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	60,000	65,631	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	27,000	29,860	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	350,000	343,514	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	35,000	39,015	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	40,000	44,337	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	390,000	382,001	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	70,000	77,804	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	360,000	351,756	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	45,000	50,114	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	42,000	47,056	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	9,000	10,223	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	480,000	467,649	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	27,000	30,310	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	77,000	85,903	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	4,000	4,525	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	390,000	378,947	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	13,000	14,434	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	23,000	25,198	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	98,000	105,958	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	460,000	445,712	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	8,000	9,462	2030/11/20

2023年1月10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	
	361 10年国債	0.1000	460,000	444,755	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	42,000	47,131	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	100,000	111,454	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	450,000	434,133	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	25,000	28,320	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	21,000	23,449	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	110,000	121,966	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	8,000	9,079	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	380,000	365,913	2031/06/20
	128 20年国債	1.9000	32,000	35,555	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	95,000	104,786	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	400,000	384,748	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	28,000	30,941	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	164,511	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	9,000	10,441	2031/11/20
	365 10年国債	0.1000	350,000	336,721	2031/12/20
	132 20年国債	1.7000	25,000	27,484	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	150,000	166,188	2031/12/20
	366 10年国債	0.2000	390,000	379,723	2032/03/20
	134 20年国債	1.8000	15,000	16,654	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	20,000	22,030	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	180,000	196,698	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	12,000	13,899	2032/05/20
	367 10年国債	0.2000	360,000	352,328	2032/06/20
	137 20年国債	1.7000	18,000	19,884	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	250,000	273,920	2032/06/20
	368 10年国債	0.2000	400,000	391,988	2032/09/20
	140 20年国債	1.7000	100,000	110,681	2032/09/20
	141 20年国債	1.7000	48,000	53,151	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	185,000	206,598	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	25,000	26,199	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	100,000	109,704	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	130,000	141,367	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	9,000	9,957	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	210,000	232,348	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	11,000	12,613	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	200,000	221,100	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	11,000	12,497	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	220,000	240,730	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	22,000	25,933	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	195,000	211,073	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	21,000	25,003	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	240,000	259,507	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	26,000	30,973	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	225,000	240,459	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	17,000	20,062	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	260,000	271,481	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	20,000	23,383	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	200,000	208,420	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	15,000	17,545	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	275,000	289,407	2035/06/20
	20 30年国債	2.5000	16,000	19,111	2035/09/20

2023年1月10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	
	154 20年国債	1.2000	230,000	238,947	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	16,000	18,737	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	220,000	222,807	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	17,000	20,337	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	200,000	187,218	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	16,000	19,137	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	210,000	190,436	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	15,000	17,958	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	225,000	211,835	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	17,000	19,923	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	220,000	209,233	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	32,000	37,919	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	190,000	182,576	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	200,000	188,834	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	32,000	38,344	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	210,000	197,469	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	160,000	149,830	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	34,000	40,750	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	260,000	238,921	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	155,000	141,883	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	43,000	50,888	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	215,000	202,005	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	160,000	145,110	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	56,000	65,412	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	250,000	222,137	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	155,000	134,735	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	76,000	87,541	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	175,000	151,413	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	140,000	120,563	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	45,000	52,501	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	215,000	187,684	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	200,000	173,794	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	95,000	106,167	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	230,000	198,938	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	165,000	144,744	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	110,000	126,420	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	170,000	148,574	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	180,000	153,844	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	120,000	134,041	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	190,000	165,034	2041/09/20
	179 20年国債	0.5000	190,000	164,646	2041/12/20
	36 30年国債	2.0000	138,000	154,255	2042/03/20
	180 20年国債	0.8000	160,000	146,366	2042/03/20
	181 20年国債	0.9000	160,000	148,913	2042/06/20
	37 30年国債	1.9000	165,000	181,658	2042/09/20
	182 20年国債	1.1000	140,000	134,764	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	110,000	119,079	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	105,000	115,452	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	80,000	86,451	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	80,000	84,916	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	85,000	90,123	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	95,000	100,611	2044/06/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

2023年1月10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	
	44 30年国債	1.7000	85,000	89,915	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	105,000	107,031	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	115,000	117,044	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	125,000	129,378	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	110,000	109,434	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	120,000	119,172	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	110,000	96,091	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	155,000	119,632	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	120,000	96,990	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	95,000	78,352	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	118,000	101,714	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	96,000	82,507	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	100,000	85,689	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	105,000	89,705	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	30,000	35,553	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	165,000	140,419	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	97,000	80,272	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	100,000	86,624	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	95,000	77,968	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	48,000	54,728	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	110,000	85,308	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	110,000	82,634	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	90,000	67,344	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	86,000	64,743	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	19,000	21,715	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	115,000	86,161	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	140,000	109,544	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	106,000	82,646	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	106,000	84,795	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	54,000	61,427	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	166,000	132,472	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	66,000	52,541	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	203,000	161,208	2051/09/20
	73 30年国債	0.7000	120,000	95,245	2051/12/20
	5 40年国債	2.0000	61,000	66,582	2052/03/20
	74 30年国債	1.0000	155,000	133,313	2052/03/20
	75 30年国債	1.3000	160,000	148,904	2052/06/20
	76 30年国債	1.4000	80,000	76,014	2052/09/20
	6 40年国債	1.9000	40,000	42,572	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	41,000	41,593	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	40,000	37,542	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	40,000	27,288	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	91,000	73,124	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	85,000	65,698	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	99,000	67,967	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	252,000	171,753	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	273,000	198,959	2061/03/20
	15 40年国債	1.0000	250,000	198,567	2062/03/20
種別 小計	銘柄数	254銘柄			
	金額		39,016,000	38,233,810	
地方債証券	3 兵庫県公債12年	0.5600	100,000	100,851	2025/04/16
	401 大阪府公債	0.4770	100,000	100,769	2025/10/29

2023年1月10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	
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	104,245	2025/11/21
	27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	100,841	2025/11/27
	751 東京都公債	0.3700	100,000	100,555	2025/12/19
	27-15 北海道公債	0.2200	100,000	100,032	2026/02/26
	28-1 静岡県公債	0.0800	100,000	99,648	2026/03/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,484	2026/06/19
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	99,626	2027/03/25
	29-6 千葉県公債	0.2450	100,000	99,307	2028/01/25
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	110,333	2029/12/14
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	110,693	2030/05/24
	11兵庫県公債20年	1.8400	100,000	108,364	2030/08/16
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	94,998	2031/06/30
種別 小計	銘柄数	14銘柄			
	金額		1,400,000	1,429,751	
特殊債券 (除く金融債)	65 地方公共団体	0.5350	100,000	100,544	2024/10/28
	241 政保道路機構	0.4500	100,000	100,753	2025/03/31
	261 政保道路機構	0.3810	100,000	100,723	2025/11/28
	127 都市再生	0.0750	100,000	99,046	2026/09/18
	80 住宅支援機構	1.5890	100,000	104,614	2026/09/18
	81 政保道路機構	2.1000	100,000	110,195	2029/05/31
	47日本政策投資CO	1.0270	100,000	102,378	2029/09/20
種別 小計	銘柄数	7銘柄			
	金額		700,000	718,256	
普通社債券	32東日本旅客鉄道	2.2600	100,000	102,456	2024/03/19
	25 西日本高速道	0.5240	100,000	100,518	2024/12/20
	497 関西電力	1.0020	100,000	101,398	2025/06/20
	14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	99,508	2025/12/19
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,121	2026/08/21
	17 パナソニック	0.4700	100,000	99,682	2026/09/18
	7 三井住友海上	0.1900	100,000	98,902	2026/11/13
	6 楽天カード	0.6200	100,000	95,583	2026/12/17
	80 三菱地所	2.3050	100,000	107,631	2027/03/19
	9 ソフトバンク	0.4800	100,000	97,673	2027/12/03
	65 東京瓦斯	0.2250	100,000	94,968	2030/09/10
	18 楽天グループ	1.0500	100,000	83,412	2031/12/02
	5 NTTファイナンス	0.4890	100,000	95,465	2032/09/17
種別 小計	銘柄数	13銘柄			
	金額		1,300,000	1,276,323	
合計	銘柄数	288銘柄			
	金額		42,416,000	41,658,141	

(注) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド」の決算日（2022年9月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2023年1月10日）現在におけるダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンドの主要な売買銘柄
投資証券

(2022年1月12日から2023年1月10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
CAPITALAND ASCENDAS REIT (シンガポール)				10,395.2		2,757,507		265	DUKE REALTY CORP (アメリカ)				291.727		2,408,975		8,257
BRITISH LAND CO PLC (イギリス)				3,263.525		2,413,208		739	VICI PROPERTIES INC (アメリカ)				525.481		2,089,591		3,976
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)				150.025		2,377,941		15,850	HEALTHPEAK PROPERTIES INC (アメリカ)				543.593		2,028,164		3,731
INVITATION HOMES INC (アメリカ)				487.866		2,261,566		4,635	CAPITALAND INTEGRATED COMMER (シンガポール)				9,600.332		2,020,289		210
MID-AMERICA APARTMENT COMM (アメリカ)				94.657		2,245,397		23,721	AMERICAN TOWER CORP (アメリカ)				49.362		1,704,124		34,523
CAMDEN PROPERTY TRUST (アメリカ)				99.579		1,931,453		19,396	KLEPIERRE (フランス)				555.349		1,701,181		3,063
WELLTOWER INC (アメリカ)				182.893		1,850,905		10,120	PROLOGIS INC (アメリカ)				92.804		1,649,297		17,771
LXI REIT PLC (イギリス)				7,813.046		1,798,779		230	KEPPEL REIT (シンガポール)				17,264.3		1,630,619		94
UNITE GROUP PLC/THE (イギリス)				832.485		1,421,557		1,707	ESSEX PROPERTY TRUST INC (アメリカ)				42.005		1,575,323		37,503
GREAT PORTLAND ESTATES PLC (イギリス)				1,314.579		1,361,766		1,035	PUBLIC STORAGE (アメリカ)				35.565		1,527,546		42,950

(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、2023年1月10日現在におけるダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド（26,103,872千口）の内容です。

外国投資証券

銘	柄	2023年1月10日現在				銘	柄	2023年1月10日現在			
		口数	評価額		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		
(シンガポール)		千口	千アメリカ・ドル	千円			千口	千アメリカ・ドル	千円		
DIGITAL CORE REIT UNITS		7,127.756	4,205	554,478		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9.913	2,107	277,835		
(アメリカ)						FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	65.418	3,193	421,090		
SIMON PROPERTY GROUP INC		167.16	19,778	2,607,778		WELLTOWER INC	455.438	31,548	4,159,628		
EQUINIX INC		20.955	14,273	1,881,988		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	51.48	1,352	178,311		
HOST HOTELS & RESORTS INC		401.683	6,507	857,982		HIGHWOODS PROPERTIES INC	109.582	3,059	403,398		
KIMCO REALTY CORP		423.095	8,923	1,176,507		MID-AMERICA APARTMENT COMM	92.486	14,405	1,899,380		
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS		499.757	10,379	1,368,596		REALTY INCOME CORP	383.173	24,791	3,268,731		
INVITATION HOMES INC		736.461	21,946	2,893,651		PUBLIC STORAGE	64.43	18,118	2,388,905		
AMERICOLD REALTY TRUST		361.289	10,437	1,376,202		UDR INC	264.885	10,190	1,343,568		
VICI PROPERTIES INC		39.758	1,271	167,642		AGREE REALTY CORP	47.676	3,438	453,352		
APARTMENT INCOME REIT CO		143.284	4,999	659,141		DIGITAL REALTY TRUST INC	233.707	23,637	3,116,555		
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN		112.864	6,333	835,128		EXTRA SPACE STORAGE INC	60.269	8,877	1,170,514		
SPIRIT REALTY CAPITAL INC		146.044	5,904	778,516		アメリカ・ドル計	口数、金額	12,792.415	320,158	42,212,838	
SUN COMMUNITIES INC		86.146	12,386	1,633,103		通 貨 計	銘柄数<比率>	29銘柄		<47.5%>	
PROLOGIS INC		269.163	31,239	4,118,869		(カナダ)		千口	千カナダ・ドル	千円	
CAMDEN PROPERTY TRUST		91.816	10,376	1,368,092		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	916.877	19,877	1,956,382		
COUSINS PROPERTIES INC		200.632	4,843	638,583		カナダ・ドル計	口数、金額	916.877	19,877	1,956,382	
SITE CENTERS CORP		126.095	1,632	215,301		通 貨 計	銘柄数<比率>	1銘柄		< 2.2%>	

銘 柄		2023年1月10日現在		
		口 数	評 価	額
			外貨建金額	邦貨換算金額
(オーストラリア)		千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU		1,699,564	13,188	1,201,482
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI		4,209,541	7,387	673,023
NATIONAL STORAGE REIT		5,475,616	12,539	1,142,317
MIRVAC GROUP		4,341,128	9,376	854,229
STOCKLAND		3,680,286	13,396	1,220,397
GOODMAN GROUP		2,553,296	45,448	4,140,373
CHARTER HALL GROUP		2,451,604	29,860	2,720,294
INGENIA COMMUNITIES GROUP		3,345,619	15,021	1,368,488
オーストラリア・ドル 貨 計		□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	27,756,654 8銘柄	146,219 13,320,608 <15.0%>
(香港)		千口	千香港ドル	千円
LINK REIT		3,035,092	179,677	3,034,752
香 港 ド ル 貨 計		□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	3,035,092 1銘柄	179,677 3,034,752 < 3.4%>
(シンガポール)		千口	千シンガポール・ドル	千円
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI		11,282.2	13,538	1,340,866
CAPITALAND ASCENDAS REIT		8,716.1	24,143	2,391,181
CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU		4,446.3	4,624	457,976
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		5,691.477	21,286	2,108,177
シンガポール・ドル 通 貨 計		□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	30,136,077 4銘柄	63,592 6,298,202 < 7.1%>
(ニュージーランド)		千口	千ニュージーランド・ドル	千円
GOODMAN PROPERTY TRUST		5,190.882	10,563	887,329
ニュージーランド・ドル 通 貨 計		□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	5,190,882 1銘柄	10,563 887,329 < 1.0%>
(イギリス)		千口	千イギリス・ポンド	千円
INDUSTRIALS REIT LIMITED LTD		1,541.074	1,964	315,302
ASSURA PLC		9,434.729	5,292	849,348
LXI REIT PLC		3,287.157	3,799	609,778
URBAN LOGISTICS REIT PLC		1,740.264	2,366	379,793
SEGRO PLC		1,082.927	8,715	1,398,559
UNITE GROUP PLC/THE		578.79	5,437	872,592
BRITISH LAND CO PLC		3,044.475	12,482	2,003,042
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		1,064.153	5,655	907,614
SAFESTORE HOLDINGS PLC		707.854	6,841	1,097,840
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		2,130.642	3,826	614,059
TRITAX BIG BOX REIT PLC		2,739.205	4,059	651,428
イギリス・ポンド 通 貨 計		□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	27,351.27 11銘柄	60,443 9,699,361 <10.9%>
ユーロ (オランダ)		千口	千ユーロ	千円
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		233.074	5,570	787,552
国 小 計		□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	233,074 1銘柄	5,570 787,552 < 0.9%>
ユーロ (ベルギー)		千口	千ユーロ	千円
AEDIFICA		53.758	4,303	608,404
WAREHOUSES DE PAUW SCA		226.463	6,390	903,529
国 小 計		□ 数 、 金 額 銘柄数<比率>	280,221 2銘柄	10,694 1,511,933 < 1.7%>
ユーロ (フランス)		千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		101.975	5,541	783,432
ICADE		118.734	5,264	744,318

銘 柄		2023年1月10日現在		
		□ 数	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千ユーロ	千円
ARGAN		37.204	2,980	421,318
KLEPIERRE		540.374	12,342	1,744,932
COVIVIO		94.995	5,599	791,721
MERCIALYS		271.872	2,797	395,519
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄数<比率>	1,165.154 6銘柄	34,525	4,881,241 < 5.5%>
ユーロ (スペイン)		千口	千ユーロ	千円
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		697.528	6,232	881,138
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄数<比率>	697,528 1銘柄	6,232	881,138 < 1.0%>
ユ ー ロ 通 貨 計		□ 数、金 額 銘柄数<比率>	2,375.977 10銘柄	57,022 8,061,866 < 9.1%>
合 計	□ 数、金 額 銘柄数<比率>	109,555.244 65銘柄	—	85,471,341 <96.3%>

(注1) 邦貨換算金額は、2023年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
 (注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
 (注3) 評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の決算日（2022年11月10日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2023年1月10日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの主要な売買銘柄
投資証券

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

買				付					売				付				
銘		柄		口	数	金	額	平均単価	銘		柄		口	数	金	額	平均単価
				千口		千円		円					千口		千円		円
ＧＬＰ投資法人				34.891		5,873,004		168,324	オリックス不動産投資				16.763		3,061,961		182,661
日本ビルファンド				7.98		5,274,560		660,972	ケネディクス・オフィス投資法人				5.374		2,941,768		547,407
日本プロロジスリート				14.604		4,876,774		333,934	野村不動産マスターＦ				17.611		2,858,784		162,329
大和ハウスリート投資法人				15.743		4,870,886		309,400	ジャパンリアルエステイト				4.567		2,834,708		620,693
日本プライムリアルティ				10.601		4,156,763		392,110	森ヒルズリート				17.989		2,741,339		152,389
ケネディクス・オフィス投資法人				6.924		3,816,900		551,256	日本ロジスティクスファンド投資法人				8.373		2,643,937		315,769
産業ファンド				21.524		3,632,021		168,742	大和ハウスリート投資法人				8.196		2,612,549		318,759
三井不ロジパーク				6.883		3,572,487		519,030	ジャパン・ホテル・リート投資法人				38.036		2,564,044		67,411
アドバンス・レジデンス				8.715		2,964,079		340,112	ジャパンエクセレント投資法人				19.136		2,545,449		133,018
オリックス不動産投資				17.093		2,962,415		173,311	産業ファンド				13.501		2,489,127		184,366

(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、2023年1月10日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド（42,460,993千口）の内容です。

(1) 国内投資証券

銘	柄	2023年1月10日現在			
		口数	評	価	額
		千口			千円
エスコンジャパンリート		2.176			257,638
サンケイリアルエステート		12.057			1,059,810
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投		3.826			512,684
日本アコモデーションファンド投資法人		5.696			3,394,816
森ヒルズリート		11.169			1,722,259
産業ファンド		19.79			2,913,088
アドバンス・レジデンス		13.607			4,578,755
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		26.561			5,367,978
ＡＰＩ投資法人		5.754			2,336,124
ＧＬＰ投資法人		63.909			9,254,023
コンフォリア・レジデンシャル		8.594			2,498,275
日本プロロジスリート		25.222			7,591,822
Oneリート投資法人		4.172			1,016,299
イオンリート投資		24.002			3,614,701

銘	柄	2023年1月10日現在			
		口数	評	価	額
		千口			千円
ヒューリックリート投資法		15.335			2,445,932
日本リート投資法人		7.215			2,445,885
積水ハウス・リート投資		41.631			3,089,020
ケネディクス商業リート		12.761			3,148,138
野村不動産マスターＦ		42.02			6,626,554
ラサールロジポート投資		29.507			4,600,141
スターアジア不動産投		24.633			1,335,108
三井不ロジパーク		9.006			4,205,802
三菱地所物流ＲＥＩＴ		10.366			4,286,341
ＣＲＥロジスティクスファンド		1.445			261,978
ザイマックス・リート		2.69			314,730
タカラレーベン不動産投		2.304			226,252
日本ビルファンド		19.958			11,635,514
ジャパンリアルエステイト		9.19			5,275,060

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

銘柄		2023年1月10日現在	
		□数	評価額
		千口	千円
日本都市ファンド投資法人		54.998	5,703,292
オリックス不動産投資		21.29	3,810,910
日本プライムリアルティ		13.124	4,731,202
ＮＴＴ都市開発リート投資法人		9.251	1,256,285
グローバル・ワン不動産投資法人		4.576	489,632
ユナイテッド・アーバン投資法人		28.713	4,312,692
森トラスト総合リート		0.936	135,064
インヴィンシブル投資法人		62.828	3,254,490
フロンティア不動産投資		4.005	2,010,510
日本ロジスティクスファンド投資法人		1.13	348,605
ケネディクス・オフィス投資法人		12.461	3,931,445
大和証券オフィス投資法人		2.68	1,669,640
阪急阪神リート投資法人		3.364	495,180
大和ハウスリート投資法人		24.334	6,957,090
ジャパン・ホテル・リート投資法人		24.169	1,875,514
ジャパンエクセレント投資法人		4.99	652,193
合計	□数、金額	727.445	137,648,483
	銘柄数<比率>	44銘柄	<97.2%>

(注1) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別			2023年1月10日現在	
			買建額	売建額
国内	東証ＲＥＩＴ		百万円 2,393	百万円 －

(注) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の決算日（2022年10月17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（2023年1月10日）現在におけるダイワ北米好配当株マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ北米好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2022年1月12日から2023年1月10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
PEPSICO INC (アメリカ)		3.101	68,431	22,067	MICRON TECHNOLOGY INC (アメリカ)		12.455	94,996	7,627
UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)		0.865	57,129	66,045	NORFOLK SOUTHERN CORP (アメリカ)		1.99	66,574	33,454
INTL BUSINESS MACHINES CORP (アメリカ)		2.633	50,247	19,083	ESSENTIAL UTILITIES INC (アメリカ)		10.358	65,456	6,319
COSTCO WHOLESALE CORP (アメリカ)		0.697	47,311	67,878	SUNCOR ENERGY INC (カナダ)		14.801	59,189	3,999
CARDINAL HEALTH INC (アメリカ)		6.172	43,313	7,017	RENEWABLE ENERGY GROUP INC (アメリカ)		12.962	57,170	4,410
BARRICK GOLD CORP (カナダ)		15.819	42,292	2,673	WASTE MANAGEMENT INC (アメリカ)		2.473	52,679	21,301
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)		2.652	40,520	15,279	ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO (アメリカ)		4.831	51,094	10,576
KLA CORP (アメリカ)		0.859	40,486	47,131	DOW INC (アメリカ)		7.029	48,726	6,932
PROCTER & GAMBLE CO/THE (アメリカ)		1.993	39,374	19,756	TE CONNECTIVITY LTD (スイス)		2.208	41,575	18,829
NORFOLK SOUTHERN CORP (アメリカ)		1.159	39,117	33,751	PEPSICO INC (アメリカ)		1.687	39,103	23,179

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

買		付			売		付		
銘	柄	証 券 数	金 額	平均単価	銘	柄	証 券 数	金 額	平均単価
		千証券	千円	円			千証券	千円	円
MORGAN STANLEY 6.375 I (アメリカ)		14.93	50,742	3,398	MORGAN STANLEY 6.375 I (アメリカ)		12.527	42,680	3,407
FIFTH THIRD BANCORP 6 A (アメリカ)		15.49	49,066	3,167	WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R (アメリカ)		11.644	40,973	3,518
RGA FR (アメリカ)		12.175	45,514	3,738	GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.5 J (アメリカ)		10.508	35,965	3,422
WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R (アメリカ)		12.934	43,991	3,401	CHARLES SCHWAB CORP 5.95 D (アメリカ)		8.569	29,144	3,401
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B (アメリカ)		12.003	40,061	3,337	REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B (アメリカ)		8.213	28,268	3,441
GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.5 J (アメリカ)		11.823	37,802	3,197	CAPITAL ONE FINANCIAL CO 4.8 J (アメリカ)		10.442	27,782	2,660
MORGAN STANLEY DEP REPSTG SH NON 6.5 (アメリカ)		10.325	37,494	3,631	WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z (アメリカ)		10.126	26,799	2,646
PNC FINANCIAL SERVICES FR P (アメリカ)		11.052	36,056	3,262	BANK OF AMERICA CORP 5.875 HH (アメリカ)		7.582	26,228	3,459
BANK OF AMERICA CORP 5.875 HH (アメリカ)		10.185	32,659	3,206	SYNCHRONY FINANCIAL 5.625 A (アメリカ)		9.13	24,466	2,679
REINSURANCE GRP OF AMER FR (アメリカ)		9.598	32,377	3,373	FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I (アメリカ)		6.634	24,266	3,657

(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、2023年1月10日現在におけるダイワ北米好配当株マザーファンド（1,041,508千口）の内容です。

(1) 外国株式

銘 柄	2023年1月10日現在			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ABBOTT LABORATORIES	10.61	118	15,688	ヘルスケア
ADOBE INC	16.51	564	74,443	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	23.17	199	26,272	素材
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8.89	277	36,532	素材
CITIGROUP INC	33.18	157	20,797	金融
DANAHER CORP	9.54	243	32,081	ヘルスケア
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	35.25	370	48,912	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	17.27	147	19,439	生活必需品
APPLE INC	110.02	1,431	188,797	情報技術
BOEING CO/THE	12.96	270	35,639	資本財・サービス
NISOURCE INC	59.84	166	21,997	公益事業
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	38.58	185	24,487	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	131.29	543	71,613	コミュニケーション・サービス
JPMORGAN CHASE & CO	45.9	630	83,135	金融
CATERPILLAR INC	7.81	192	25,395	資本財・サービス
MORGAN STANLEY	35.53	311	41,056	金融
BROADCOM INC	15.41	888	117,213	情報技術
DEERE & CO	7.49	320	42,287	資本財・サービス
TELEFLEX INC	9.71	249	32,921	ヘルスケア
COLGATE-PALMOLIVE CO	22.01	173	22,847	生活必需品
COSTCO WHOLESALE CORP	6.97	333	43,996	生活必需品
DIAMONDBACK ENERGY INC	20.7	292	38,616	エネルギー
CSX CORP	62.62	201	26,536	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	13.4	326	43,012	ヘルスケア
AMAZON.COM INC	62.83	548	72,370	一般消費財・サービス
EXXON MOBIL CORP	24.87	269	35,568	エネルギー
FORD MOTOR CO	102.76	130	17,193	一般消費財・サービス
NEXTERA ENERGY INC	28.71	241	31,823	公益事業
FREEMONT-MCMORAN INC	43.76	187	24,711	素材
GENERAL MOTORS CO	39.82	143	18,858	一般消費財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	11.64	410	54,176	金融
ALPHABET INC-CL A	53.29	469	61,845	コミュニケーション・サービス
HOME DEPOT INC	8.39	266	35,156	一般消費財・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20.33	291	38,478	情報技術
JOHNSON & JOHNSON	30.56	536	70,747	ヘルスケア
KLA CORP	8.59	350	46,247	情報技術
MCDONALD'S CORP	18.72	500	65,963	一般消費財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	36.91	477	63,007	コミュニケーション・サービス
PHILLIPS 66	31.3	319	42,098	エネルギー
MOTOROLA SOLUTIONS INC	13.62	354	46,800	情報技術
MERCK & CO. INC.	21.48	237	31,261	ヘルスケア
NIKE INC -CL B	29.36	366	48,330	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	11.59	294	38,849	資本財・サービス
NORTHROP GRUMMAN CORP	4.95	245	32,333	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	26.3	269	35,474	生活必需品
EVERGY INC	36.49	234	30,926	公益事業

銘 柄	2023年1月10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	
PFIZER INC	22.15	107	14,132	ヘルスケア
DOW INC	23.77	131	17,325	素材
PROCTER & GAMBLE CO/THE	28.29	430	56,711	生活必需品
PEPSICO INC	14.14	253	33,433	生活必需品
TESLA INC	16.08	192	25,393	一般消費財・サービス
AT&T INC	79.58	151	19,977	コミュニケーション・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	17.88	324	42,833	資本財・サービス
UNITEDHEALTH GROUP INC	8.65	423	55,891	ヘルスケア
ELEVANCE HEALTH INC	7.84	369	48,657	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	30.22	286	37,761	コミュニケーション・サービス
WALMART INC	14.03	203	26,813	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14.03	357	47,182	金融
VISA INC-CLASS A SHARES	14.26	311	41,100	情報技術
NVIDIA CORP	15.53	242	32,000	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	6.7	110	14,512	金融
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	6.26	341	45,073	ヘルスケア
MASTERCARD INC - A	8.2	304	40,108	情報技術
ONEOK INC	38.41	259	34,280	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	140.12	474	62,611	金融
ADVANCED MICRO DEVICES	19.93	134	17,669	情報技術
EATON CORP PLC	20.66	332	43,824	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	158.19	300	39,566	素材
CARDINAL HEALTH INC	41.81	324	42,761	ヘルスケア
INTEL CORP	31.72	92	12,258	情報技術
TARGET CORP	15.61	244	32,179	一般消費財・サービス
MICROSOFT CORP	61.73	1,402	184,855	情報技術
MEDTRONIC PLC	32.62	252	33,349	ヘルスケア
CHUBB LTD	8.25	184	24,312	金融
COMCAST CORP-CLASS A	43.33	162	21,452	コミュニケーション・サービス
アメリカ・ドル 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,360.92 75銘柄	24,451 <70.2%>	
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル	千円	
SUNCOR ENERGY INC	88.53	373	36,760	エネルギー
ENBRIDGE INC	37.41	205	20,206	エネルギー
カナダ・ドル 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	125.94 2銘柄	578 <1.2%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,486.86 77銘柄	— <71.5%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2023年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものである。

(注2) < >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。

(注1) 邦貨換算金額は、2023年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場
の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで
邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

銘柄	2023年1月10日現在		
	証券数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千証券	千アメリカ・ドル	千円
CHS INC 7.5 4	5,317	139	18,430
CHARLES SCHWAB CORP 5.95 D	0.72	17	2,347
REINSURANCE GRP OF AMER 5.75	0.608	14	1,930
MORGAN STANLEY 5.85 K	1.933	46	6,185
AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	6.877	143	18,941
NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A	4.388	102	13,567
FIRST REPUBLIC BANK 5.125 H	8.43	179	23,685
VALLEY NATIONAL BANCORP FR	2.297	57	7,616
ENBRIDGE INC 6.375 B	1.438	35	4,641
BANK OF AMERICA CORP 6 GG	3.24	81	10,684
BANK OF AMERICA CORP 5.875 HH	2.603	63	8,435
AT&T INC 5.625	6.582	159	20,966
JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	3.116	77	10,176
NISOURCE INC 6.5 B	2.81	70	9,315
JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	3.131	80	10,564
CITIZENS FINANCIAL GROUP 6.35 D	9.556	237	31,373
CMS ENERGY CORP 5.875	12.484	298	39,357
REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	1.39	32	4,317
ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.2 19-A	9.83	223	29,485
ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	1.1	25	3,422
BANK OF AMERICA CORP 5.375 KK	2.662	59	7,883
SYNOVUS FINANCIAL CORP 5.875 E	2.676	63	8,418
ALLSTATE CORP 5.1 H	4.777	104	13,774
SEMPRA ENERGY 5.75	6.407	152	20,105
FIFTH THIRD BANCORP 6 A	10.855	259	34,249
BANK OF AMERICA CORP 5 LL	1.588	33	4,413
FIRST REPUBLIC BANK 4.7 J	7.241	145	19,218
SOUTHERN CO 4.95 2020	0.764	16	2,144
WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	13.547	268	35,437
FIRST HORIZON CORP 6.5	10.027	250	33,051
ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	8.532	214	28,281
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	4.159	86	11,395
UNITED STATES CELLULAR C 6.25	1.403	26	3,494
FIRST REPUBLIC BANK 4.125 K	7.3	127	16,757
BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	3.167	53	7,065
WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA	9.717	192	25,431
BANK OF AMERICA CORP 4.125 PP	12.288	217	28,725
WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC	11.331	207	27,369
FIRST REPUBLIC BANK 4.25 L	9.315	167	22,144
WASHINGTON FEDERAL INC 4.875 A	4.812	91	12,073
FIRST HORIZON CORP 6.1 D	10.983	271	35,811
JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ	12.6	253	33,458

銘柄	2023年1月10日現在		
	証券数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千証券	千アメリカ・ドル	千円
JPMORGAN CHASE & CO 4.625 LL	8.403	171	22,546
KEMPER CORP FR	6.36	130	17,266
WESCO INTERNATIONAL INC FR	5.224	141	18,631
WTFNLL FR	6.744	173	22,887
PACWL FR	1.881	48	6,349
MORGAN STANLEY DEP REPSTG SH NON 6.5	4.785	122	16,214
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 5.95	1.269	31	4,141
KEY FR	1.258	31	4,111
ARCH CAPITAL GROUP LTD. 4.55	2.628	50	6,659
RGA FR	12.175	317	41,849
AQNCN FR	7.125	171	22,621
LINCOLN NATIONAL CORPORATION 9	4.9	137	18,122
ATHENE HLDG LTD DEP SHR REPSTG I	3.25	82	10,909
GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.5 J	1.315	32	4,331
FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I	0.649	16	2,158
MORGAN STANLEY 6.875 F	1.589	40	5,323
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B	3.79	96	12,732
WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R	1.29	32	4,347
GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K	6.563	169	22,299
MORGAN STANLEY 6.375 I	3.996	100	13,213
WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	3.258	78	10,301
CITIGROUP INC 7.125 J	6.132	156	20,649
合 計	証券数、金額 銘柄数<比率>	338,585 64銘柄	7,689 <22.1%>

(注1) 邦貨換算金額は、2023年1月10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) 外国投資証券

銘柄	柄	2023年1月10日現在		
		□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千□	千アメリカ・ドル	千円
DIGITALBRIDGE GROUP INC 7.125 J		7,569	153	20,258
PUBLIC STORAGE 4.625 L		3,915	78	10,370
合 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	11,484 2銘柄	232	30,629 <0.7%>

(注1) 邦貨換算金額は、2023年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の決算日（２０２２年１０月１７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（２０２３年１月１０日）現在におけるダイワ欧州好配当株マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ欧州好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2022年1月12日から2023年1月10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
NESTLE SA-REG (スイス)		0.307	5,159	16,804	KONINKLIJKE PHILIPS NV (オランダ)		8.213	15,657	1,906
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN (スイス)		0.072	3,298	45,807	GIVAUDAN-REG (スイス)		0.018	9,975	554,196
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG (ドイツ)		1.163	2,959	2,545	KONINKLIJKE DSM NV (オランダ)		0.368	8,593	23,351
SANOFI (フランス)		0.214	2,938	13,732	HALEON PLC (イギリス)		16.774	8,525	508
ZURICH INSURANCE GROUP AG (スイス)		0.05	2,922	58,446	DEUTSCHE POST AG-REG (ドイツ)		0.864	5,887	6,814
NOVARTIS AG-REG (スイス)		0.241	2,861	11,873	SCHNEIDER ELECTRIC SE (フランス)		0.179	3,786	21,151
SCHNEIDER ELECTRIC SE (フランス)		0.149	2,790	18,725	CAPGEMINI SE (フランス)		0.134	3,448	25,734
CAPGEMINI SE (フランス)		0.096	2,438	25,402	EUROAPI (フランス)		0.169	351	2,080
TOTALENERGIES SE (フランス)		0.346	2,357	6,814					
SIEMENS AG-REG (ドイツ)		0.154	2,292	14,886					

(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、2023年1月10日現在におけるダイワ欧州好配当株マザーファンド（683,447千口）の内容です。

外国株式

銘 柄		2023年1月10日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		百株	千イギリス・ポンド	千円	
SHELL PLC		124.08	295	47,368	エネルギー
UNILEVER PLC		47.36	198	31,881	生活必需品
PRUDENTIAL PLC		156.6	195	31,336	金融
AVIVA PLC		326.08	148	23,808	金融
GSK		134.19	190	30,607	ヘルスケア
M&G PLC		725.46	140	22,613	金融
TESCO PLC		933.08	226	36,414	生活必需品
VODAFONE GROUP PLC		1,072.47	95	15,263	コミュニケーション・サービス
NATIONAL GRID PLC		188.56	195	31,392	公益事業
HSBC HOLDINGS PLC		457.91	257	41,384	金融
イギリス・ポンド 通 貨 計		株数、金額 銘柄数<比率>	4,165.79 10銘柄	1,944 <20.0%>	
(スイス)		百株	千スイス・フラン	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		13.85	403	57,729	ヘルスケア
NESTLE SA-REG		58.85	656	93,960	生活必需品
ZURICH INSURANCE GROUP AG		9.53	428	61,315	金融
NOVARTIS AG-REG		46.3	394	56,498	ヘルスケア
GIVAUDAN-REG		0.81	244	35,025	素材
スイス・フラン 通 貨 計		株数、金額 銘柄数<比率>	129.34 5銘柄	2,128 <19.5%>	

銘 柄		2023年1月10日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
(スウェーデン)		百株	外貨建金額	邦貨換算金額	
ELECTROLUX AB-SER B		26.23	千スウェーデン・クロネ	千円	一般消費財・サービス
スウェーデン・クロネ通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	26.23 1銘柄	428	5,423	< 0.3%>
ユーロ (オランダ)		百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		68.64	189	26,837	生活必需品
KONINKLIJKE DSM NV		18.45	222	31,431	素材
KONINKLIJKE KPN NV		927.64	278	39,384	コミュニケーション・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,014.73 3銘柄	690	97,653	< 6.3%>
ユーロ (フランス)		百株	千ユーロ	千円	
TOTALENERGIES SE		66.45	387	54,789	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		90.94	265	37,587	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		28.65	414	58,659	資本財・サービス
BNP PARIBAS		42.09	248	35,120	金融
CAPGEMINI SE		18.45	307	43,509	情報技術
AXA SA		127.93	350	49,566	金融
SANOFI		41.07	371	52,513	ヘルスケア
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	415.58 7銘柄	2,346	331,748	<21.3%>

銘 柄		2023年1月10日現在		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		
ユーロ (ドイツ)		百株	千ユーロ	千円	
SIEMENS AG-REG		29.54	408	57,775	資本財・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		31.61	284	40,212	一般消費財・サービス
BASF SE		38.78	204	28,970	素材
ALLIANZ SE-REG		12.08	258	36,488	金融
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		10.94	354	50,159	金融
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		223.08	442	62,623	コミュニケーション・サービス
DEUTSCHE POST AG-REG		62.87	237	33,638	資本財・サービス
国 小 計	株数、金額	408.9	2,191	309,869	
	銘柄数<比率>	7銘柄		<19.9%>	
ユーロ (スペイン)		百株	千ユーロ	千円	
ENAGAS SA		90.15	145	20,583	公益事業
国 小 計	株数、金額	90.15	145	20,583	
	銘柄数<比率>	1銘柄		< 1.3%>	
ユーロ (イタリア)		百株	千ユーロ	千円	
INTESA SANPAOLO		1,060.84	236	33,423	金融
ENI SPA		136.46	190	26,901	エネルギー
ENEL SPA		508.01	284	40,213	公益事業
国 小 計	株数、金額	1,705.31	711	100,538	
	銘柄数<比率>	3銘柄		< 6.4%>	
ユーロ通貨計		株数、金額	3,634.67	6,085	860,393
		銘柄数<比率>	21銘柄		<55.2%>
ファンド合計		株数、金額	7,956.03	—	1,482,417
		銘柄数<比率>	37銘柄		<95.1%>

(注1) 邦貨換算金額は、2023年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場
の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで
邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の決算日（2022年10月17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（2023年１月10日）現在におけるダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2022年１月12日から2023年１月10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
UNITED OVERSEAS BANK LTD (シンガポール)		11	30,166	2,742	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD (オーストラリア)		7.8	21,594	2,768
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD (香港)		35.5	18,240	513	MEDIATEK INC (台湾)		6	19,533	3,255
SHENG SIONG GROUP LTD (シンガポール)		102	16,599	162	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL (オーストラリア)		1.9	17,450	9,184
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)		6	13,096	2,182	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT (台湾)		90.125	12,027	133
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS (シンガポール)		46.6	12,526	268	KB FINANCIAL GROUP INC (韓国)		2.2	11,415	5,188
CHAILEASE HOLDING CO LTD (ケイマン諸島)		14	12,472	890	MERIDA INDUSTRY CO LTD (台湾)		12	11,054	921
AIA GROUP LTD (香港)		8.8	11,275	1,281	HANA FINANCIAL GROUP (韓国)		2.4	10,350	4,312
CSL LTD (オーストラリア)		0.42	10,459	24,903	POSCO (韓国)		0.33	9,406	28,503
MEDIATEK INC (台湾)		3	9,713	3,237	SUN HUNG KAI PROPERTIES (香港)		6	8,693	1,448
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD (オーストラリア)		2.95	8,742	2,963	DBS GROUP HOLDINGS LTD (シンガポール)		2.5	8,218	3,287

(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、2023年１月10日現在におけるダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド（236,240千口）の内容です。

外国株式

銘柄		2023年1月10日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		百株	千円		
BHP GROUP LTD		67.5	324	29,516	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD		59.78	209	19,082	エネルギー
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		70	210	19,131	金融
WESTPAC BANKING CORP		101	236	21,502	金融
SANTOS LTD		191.34	136	12,393	エネルギー
RIO TINTO LTD		7	83	7,574	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		25	258	23,531	金融
MACQUARIE GROUP LTD		10.8	188	17,129	金融
CSL LTD		8.2	227	20,692	ヘルスケア
WESFARMERS LTD		49.3	233	21,256	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>	589.92 10銘柄	2,105	191,811 <27.5%>	
(香港)		百株	千香港ドル	千円	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H		850	360	6,087	資本財・サービス
CHINA RESOURCES BEER HOLDING		80	480	8,107	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		26	981	16,573	金融
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL		230	189	3,193	資本財・サービス

銘柄		2023年1月10日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千香港ドル	千円	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H		800	400	6,756	金融
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		80	332	5,614	公益事業
AIA GROUP LTD		280	2,444	41,285	金融
SANDS CHINA LTD		208	582	9,836	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		25	234	3,954	資本財・サービス
LI NING CO LTD		60	433	7,326	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		355	974	16,458	金融
CHINA MERCHANTS BANK-H		55	257	4,352	金融
香港ドル 通貨計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,049 12銘柄	7,669	129,545 <18.6%>	
(シンガポール)		百株	千シンガポール・ドル	千円	
CAPITALAND INVESTMENT LTD		428	159	15,811	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD		105	322	31,894	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD		53	186	18,503	金融
SHENG SIONG GROUP LTD		935	156	15,464	生活必需品
KEPPEL CORP LTD		95	69	6,877	資本財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		466	116	11,584	コミュニケーション・サービス

銘 柄		2023年1月10日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千シンガポール・ドル	千円	
WILMAR INTERNATIONAL LTD		170	70	7,020	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>	2,252 7銘柄	1,081	107,156 <15.3%>	
(台湾)		百株	千台湾ドル	千円	
DELTA ELECTRONICS INC		30	849	3,666	情報技術
NANYA TECHNOLOGY CORP		100	567	2,448	情報技術
MEDIATEK INC		30	2,025	8,744	情報技術
CTBC FINANCIAL HOLDING CO.LT		1,340	3,102	13,395	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO		692.6	1,870	8,074	金融
NOVATEK MICROELECTRONICS COR		40	1,394	6,019	情報技術
CHAILEASE HOLDING CO LTD		140	3,234	13,964	金融
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC		280	13,468	58,156	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY		230	2,279	9,842	情報技術
UNITED MICROELECTRONICS CORP		570	2,536	10,952	情報技術
台 湾 ド ル 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,452.6 10銘柄	31,324	135,264 <19.4%>	
(韓国)		百株	千韓国ウォン	千円	
KIA CORP		4	25,640	2,722	一般消費財・サービス
SK HYNIX INC		20	172,000	18,266	情報技術
HYUNDAI MOTOR CO		2	32,800	3,483	一般消費財・サービス
SAMSUNG SDI CO LTD		0.9	54,000	5,734	情報技術
NAVER CORP		1.9	37,335	3,964	コミュニケーション・サービス
LG CHEM LTD		0.5	31,200	3,313	素材
KB FINANCIAL GROUP INC		13.5	77,220	8,200	金融
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD		70.1	425,507	45,188	情報技術
SK TELECOM		11.47	54,482	5,786	コミュニケーション・サービス
HANA FINANCIAL GROUP		19.5	94,867	10,074	金融
韓 国 ウ ォ ン 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	143.87 10銘柄	1,005,052	106,736 <15.3%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	9,487.39 49銘柄	—	670,513 <96.0%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2023年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の決算日（2022年10月17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（2023年1月10日）現在におけるダイワ好配当日本株マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ好配当日本株マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

買				付				売				付					
銘		柄	株 数	金 額	平均単価	銘		柄	株 数	金 額	平均単価	銘		柄	株 数	金 額	平均単価
			千株	千円	円				千株	千円	円				千株	千円	円
三井住友トラストHD			104.6	444,807	4,252	しまむら			34.3	404,856	11,803						
東レ			583.7	428,353	733	三井住友フィナンシャルG			95.4	387,448	4,061						
小松製作所			130.8	405,469	3,099	大日本印刷			119.9	347,302	2,896						
大阪瓦斯			180	380,095	2,111	任天堂			52.1	311,078	5,970						
アステラス製薬			176.5	342,369	1,939	旭化成			260.2	265,559	1,020						
任天堂			7.1	314,544	44,302	豊田自動織機			30.9	234,142	7,577						
三菱UFJフィナンシャルG			416.1	297,446	714	三菱商事			56.1	220,898	3,937						
三井不動産			113.5	297,353	2,619	トヨタ自動車			115.6	220,097	1,903						
上組			106.2	292,286	2,752	日鉄物産			28	214,337	7,654						
りそなホールディングス			486.7	285,497	586	KDDI			47	188,361	4,007						

(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、2023年1月10日現在におけるダイワ好配当日本株マザーファンド（4,640,307千口）の内容です。

国内株式

銘	柄	2023年1月10日現在				銘	柄	2023年1月10日現在				銘	柄	2023年1月10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
建設業 (1.2%)						東京応化工業		10.9		67,362		ファインシンター		17.8		18,316	
オリエンタル白石		294.4		83,315		住友ベークライト		22.8		89,376		機械 (5.0%)					
大和ハウス		34.4		103,475		旭有機材		23.1		62,924		ツガミ		95.5		116,319	
食料品 (1.7%)						富士フィルムHLDGS		43.2		284,385		フリュー		45.4		47,170	
ブルボン		22.4		47,152		デクセリアルズ		49.7		128,772		小松製作所		110.7		315,605	
アサヒグループホールディン		47.8		193,924		信越ポリマー		63.8		72,285		三精テクノロジーズ		28.5		22,315	
太陽化学		22.3		32,736		医薬品 (2.1%)						IHI		67.8		248,148	
繊維製品 (3.1%)						アステラス製薬		176.5		335,614		スター精密		21.8		34,596	
富士紡ホールディングス		9.8		30,919		ガラス・土石製品 (1.7%)						電気機器 (10.7%)					
東レ		508.4		374,945		AGC		58.2		264,810		日立		74.4		484,864	
セーレン		22.7		53,118		鉄鋼 (1.6%)						富士電機		57.1		295,778	
ワコールホールディングス		8.9		21,039		日本製鉄		72.9		172,627		ダイヘン		11.6		45,472	
パルプ・紙 (0.2%)						大和工業		15.8		71,179		IDEC		39.5		110,797	
レンゴー		36.6		32,500		非鉄金属 (1.1%)						TDK		57.9		250,707	
化学 (8.4%)						昭和電線HLDGS		53.2		92,461		京セラ		4.4		28,626	
共和レザー		64.4		32,071		アサヒHD		40.3		78,302		村田製作所		6.3		43,860	
日本曹達		36.8		150,328		金属製品 (1.2%)						東京エレクトロン		9.8		415,912	
東亜合成		67.4		74,679		三和ホールディングス		63.2		76,345		輸送用機器 (7.3%)					
大阪ソーダ		34.1		130,432		日東精工		77.4		37,539		トヨタ紡織		37.4		66,422	
信越化学		13.6		226,576		マルゼン		30.9		55,620		豊田自動織機		6.7		49,178	

銘柄	2023年1月10日現在		銘柄	2023年1月10日現在	
	株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円
デンソー	34.2	223,839	その他金融業 (2.8%)		
いすゞ自動車	172.6	263,042			
トヨタ自動車	127.9	233,673			
プレス工業	116	48,488	不動産業 (1.8%)		
ミクニ	67.4	21,770			
豊田合成	114.9	233,132			
精密機器 (0.7%)			東急不動産HD	88.9	56,184
セイコーグループ	38.9	115,533	AND DOホールディングス	46.8	36,504
電気・ガス業 (2.8%)			三井不動産	51.1	120,289
関西電力	162.1	197,599	東京建物	40.7	63,573
大阪瓦斯	119.1	240,582	サービス業 (3.2%)		
陸運業 (0.9%)			ディップ	12.8	46,144
丸全昭和運輸	13.8	40,917	電通グループ	45.7	187,370
九州旅客鉄道	34.2	96,820	日本空調サービス	74.6	50,504
倉庫・運輸関連業 (2.6%)			フルキャストホールディングス	33	86,427
三井倉庫HOLD	38.2	135,228	ベルシステム24HLDGS	93.3	124,182
上組	106.2	276,438	日本管財	5.9	14,525
情報・通信業 (9.3%)				千株	千円
SRAホールディングス	7.5	22,200	合計 株数、金額	7,430.6	15,667,612
BIPROGY	131.4	423,765	銘柄数<比率>	101銘柄	<95.0%>
日本電信電話	155.8	575,836	(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。		
KDDI	67.9	266,235	(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。		
光通信	9.6	170,976	(注3) 評価額の単位未満は切捨て。		
卸売業 (10.1%)					
エレマテック	21.7	33,135			
ダイワボウHD	129.6	246,888			
レスターホールディングス	11.1	22,621			
TOKAIホールディングス	36.3	30,637			
三洋貿易	84	91,056			
コメダホールディングス	16	38,384			
第一興商	12.5	48,125			
萩原電気HLDGS	17.3	41,554			
ダイトロン	42.5	95,285			
伊藤忠	127.8	513,628			
スターゼン	20.8	42,536			
三菱商事	72.5	306,385			
阪和興業	16.6	60,922			
稲畑産業	7.1	16,841			
小売業 (2.7%)					
パルグループHLDGS	72.9	185,384			
丸井グループ	69.9	148,956			
サンドラッグ	23	88,550			
銀行業 (9.2%)					
三菱UFJフィナンシャルG	867.7	775,116			
りそなホールディングス	261.7	185,257			
三井住友トラストHD	104.6	476,557			
証券、商品先物取引業 (0.6%)					
SBIホールディングス	35.6	91,100			
保険業 (7.9%)					
MS&AD	54.2	223,900			
第一生命HLDGS	116.3	334,188			
東京海上HD	250	684,625			

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第23期 (決算日 2022年11月30日)

(作成対象期間 2021年12月1日～2022年11月30日)

外国債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

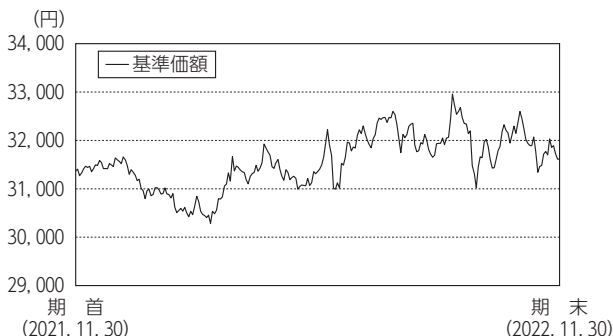
運用方針	投資成果を FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の公社債
株式組入制限	純資産総額の30%以下

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債	債券
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率	組入比率	先物比率
(期首) 2021年11月30日	31,370	—	31,642	—	98.6	—
12月末	31,565	0.6	31,887	0.8	98.7	—
2022年1月末	31,023	△ 1.1	31,315	△ 1.0	98.6	—
2月末	30,464	△ 2.9	30,877	△ 2.4	98.8	—
3月末	31,472	0.3	31,719	0.2	98.7	—
4月末	31,539	0.5	31,729	0.3	98.6	—
5月末	31,355	△ 0.0	31,595	△ 0.1	98.3	—
6月末	32,104	2.3	32,541	2.8	98.5	—
7月末	32,322	3.0	32,621	3.1	98.1	—
8月末	31,939	1.8	32,293	2.1	97.8	—
9月末	31,662	0.9	31,843	0.6	98.1	—
10月末	32,600	3.9	32,773	3.6	98.3	—
(期末) 2022年11月30日	31,615	0.8	31,857	0.7	98.1	—

(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。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：31,370円 期末：31,615円 騰落率：0.8%

【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、上昇しました。

当作成期首より2022年2月にかけては、物資の供給制約やインフレは金利上昇圧力となったものの、新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念が高まったことなどから、金利はおおむねレンジ内で推移しました。その後3月から当作成期末にかけては、世界の主要な中央銀行が政策金利見通しを大幅に引き上げたことや、商品市況の高止まりなどから期待インフレ率が上昇したことにより、金利は上昇基調で推移しました。

○為替相場

為替相場は、大きく円安が進みました。

対円為替相場は、当作成期首より2022年2月にかけて、主要国の金利がおおむねレンジ内で推移したこともあり、金利と同様にレンジ内での推移となりました。その後3月から当作成期末にかけては、世界の主要な中央銀行が政策金利見通しを大幅に引き上げたのに対し、日銀は指値オペを行い長期金利上昇の抑制を図るなど、金融政策の相違がより明確となっており、円安が大きく進行しました。

◆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0.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は0.8%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。なお、この値は、ファンドとベンチマークの為替評価レポートの時間差による影響を修正したものです。

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

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用) (その他)	4 (4) (0)
合 計	4

(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

(2021年12月 1 日から2022年11月30日まで)

			買 付 額	売 付 額
			千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル
外 国	アメリカ	国債証券	234, 334 ()	185, 257 ()
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 11, 048 ()	千カナダ・ドル 10, 170 ()
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 2, 053 ()	千オーストラリア・ドル 6, 914 ()
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1, 039 ()	千シンガポール・ドル 1, 259 ()
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 5, 293 ()	千ニュージーランド・ドル — ()
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 8, 539 ()	千イギリス・ポンド 10, 907 ()
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シェケル 267 ()	千イスラエル・シェケル 6, 099 ()
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 787 ()	千デンマーク・クローネ 7, 987 ()
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 3, 665 ()	千ノルウェー・クローネ 8, 215 ()
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローネ 965 ()	千スウェーデン・クローネ 928 ()
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 27, 642 ()	千メキシコ・ペソ 18, 952 ()

			買 付 額	売 付 額
外 国	中国	国債証券	千オフショア・人民元 374, 773	千オフショア・人民元 12, 067 ()
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 4, 986	千マレーシア・リンギット 4, 345 ()
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 3, 486	千ポーランド・ズロチ 7, 293 ()
	ユーロ (アイルランド)	国債証券	千ユーロ 98	千ユーロ 1, 003 ()
	ユーロ (オランダ)	国債証券	千ユーロ 2, 111	千ユーロ 2, 818 ()
	ユーロ (ベルギー)	国債証券	千ユーロ 2, 109	千ユーロ 3, 311 ()
	ユーロ (フランス)	国債証券	千ユーロ 15, 516	千ユーロ 19, 384 ()
	ユーロ (ドイツ)	国債証券	千ユーロ 20, 093	千ユーロ 18, 359 ()
	ユーロ (スペイン)	国債証券	千ユーロ 7, 146	千ユーロ 11, 081 ()
	ユーロ (イタリア)	国債証券	千ユーロ 13, 166	千ユーロ 21, 244 ()
国	ユーロ (フィンランド)	国債証券	千ユーロ 944	千ユーロ 1, 317 ()
	ユーロ (オーストリア)	国債証券	千ユーロ 2, 696	千ユーロ 4, 329 ()
	ユーロ (ユーロ通貨計)	国債証券	千ユーロ 63, 883	千ユーロ 82, 850 ()

(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

(2021年12月 1 日から2022年11月30日まで)

当 期		期	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2.875% 2032/5/15	1,278,650	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 2023/4/14	790,367
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.875% 2032/2/15	1,244,886	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) 1.375% 2031/11/15	1,022,248	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.125% 2023/8/15	771,610
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2.75% 2032/8/15	980,234	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2023/11/15	756,844
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.125% 2026/10/31	830,790	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2022/11/30	736,251
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2.75% 2029/5/31	781,179	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4.25% 2023/10/25	728,066
China Government Bond (中国) 2.88% 2023/11/5	735,284	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2023/6/15	722,087
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.875% 2051/11/15	727,265	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2023/8/15	655,479
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) 1.75% 2023/5/15	638,124
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2.875% 2052/5/15	654,171	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 1.75% 2023/5/25	586,499

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

■組入資産明細表

(1)外国 (外貨建) 公社債 (通貨別)

作 成 期	当 期				未			
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5 年以上	2 年以上	2 年未満
アメリカ	千アメリカ・ドル 973,856	千アメリカ・ドル 864,609	千円 120,068,309	% 49.7	% —	% 21.7	% 17.4	% 10.7
カナダ	千カナダ・ドル 49,798	千カナダ・ドル 46,591	4,759,828	2.0	—	1.1	0.4	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 42,234	千オーストラリア・ドル 38,584	3,580,216	1.5	—	1.0	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 10,749	千シンガポール・ドル 10,365	1,047,303	0.4	—	0.3	0.1	0.1
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 6,030	千ニュージーランド・ドル 5,308	457,242	0.2	—	0.1	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 72,730	千イギリス・ポンド 67,102	11,154,519	4.6	—	3.6	0.7	0.3
イスラエル	千イスラエル・シェケル 21,700	千イスラエル・シェケル 21,202	855,180	0.4	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 43,211	千デンマーク・クローネ 45,111	871,107	0.4	—	0.2	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 34,949	485,804	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 46,624	612,648	0.3	—	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 292,735	千メキシコ・ペソ 273,185	1,972,998	0.8	—	0.4	0.3	0.2
中国	千オフショア・人民元 381,000	千オフショア・人民元 388,062	7,534,316	3.1	—	1.5	1.1	0.5
マレーシア	千マレーシア・リンギット 39,353	千マレーシア・リンギット 38,885	1,197,267	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 38,225	千ポーランド・ズロチ 31,959	981,527	0.4	—	0.1	0.2	0.1

外国債券インデックスマザーファンド

作成期		当 期				末			
区 分		額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちＢＢ格 以下組入 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
ユ ー ロ	アイルランド	千ユーロ 11,953	千ユーロ 10,959	千円 1,573,613	% 0.7	% —	% 0.5	% 0.2	% 0.0
	オランダ	千ユーロ 27,863	千ユーロ 26,921	3,865,379	1.6	—	1.0	0.4	0.2
	ベルギー	千ユーロ 32,548	千ユーロ 31,167	4,474,981	1.9	—	1.3	0.4	0.2
	フランス	千ユーロ 150,364	千ユーロ 143,593	20,617,203	8.5	—	5.0	2.6	0.9
	ドイツ	千ユーロ 113,416	千ユーロ 111,332	15,985,058	6.6	—	3.8	1.8	1.0
	スペイン	千ユーロ 87,203	千ユーロ 84,565	12,141,857	5.0	—	3.0	1.5	0.6
	イタリア	千ユーロ 135,077	千ユーロ 128,493	18,449,036	7.6	—	4.3	2.4	0.9
	フィンランド	千ユーロ 9,706	千ユーロ 8,576	1,231,438	0.5	—	0.3	0.2	0.0
	オーストリア	千ユーロ 20,870	千ユーロ 19,419	2,788,191	1.2	—	0.7	0.4	0.1
	小計	589,000	565,028	81,126,760	33.6	—	20.0	9.8	3.9
合 計		—	—	236,705,030	98.1	—	50.6	31.0	16.5

(注 1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注 2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
(注 3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。
(注 4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

		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			
アメリカ			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円			
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	4,926	684,164	2023/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,106	709,072	2024/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	4,758	660,860	2024/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	900	125,017	2026/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	775	107,639	2027/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	786	109,158	2028/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	822	114,211	2030/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	2,650	368,034	2031/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,274	176,932	2036/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	960	133,423	2037/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	583	81,073	2038/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	560	77,827	2038/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	1,002	139,224	2039/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,173	162,896	2039/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,142	158,658	2039/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,282	178,084	2039/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,103	153,224	2040/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	1,775	246,508	2040/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,080	150,045	2040/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,526	211,947	2040/11/15		

当			期		未			償還年月日
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,386	192,610	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,439	199,903	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,466	203,587	2041/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,273	176,898	2041/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,424	197,870	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,159	161,041	2042/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,231	4,281	594,560	2042/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	1,330	184,755	2042/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	2,278	316,408	2043/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	1,909	265,194	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	3,012	418,325	2043/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	1,984	275,648	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	3,090	429,208	2044/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	2,981	414,030	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	5,933	823,986	2024/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	1,656	230,010	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	5,671	787,624	2024/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,746	2,304	320,082	2044/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,451	757,087	2025/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	1,963	272,726	2045/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,488	762,175	2025/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,835	1,536	213,406	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,408	751,074	2025/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,873	1,532	212,866	2045/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,518	766,395	2025/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	659	551	76,575	2045/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,866	4,490	623,526	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,148	2,396	332,855	2046/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,729	7,101	986,150	2026/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,823	2,146	298,138	2046/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	4,914	682,519	2026/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,780	2,007	278,772	2046/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	4,894	679,684	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,430	337,586	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,000	817	113,590	2046/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,427	337,075	2023/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,434	338,019	2023/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,640	3,385	470,198	2027/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,409	334,668	2024/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,345	1,960	272,246	2047/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,226	309,244	2024/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,550	4,396	610,508	2024/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	5,969	828,980	2027/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	1,672	232,323	2047/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	2,887	400,999	2024/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,093	707,358	2024/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,303	319,883	2024/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,462	758,579	2027/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,878	399,778	2024/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,450	1,157	160,765	2047/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,907	264,913	2024/08/31	

外国債券インデックスマザーファンド

当			期		未			償還年月日
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
			%	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	2.1250	2,500	2,394	332,506	2024/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,072	704,469	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	1,995	277,181	2047/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,355	465,956	2024/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,056	424,400	2024/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	2,677	371,793	2024/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,350	5,984	831,049	2028/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,495	346,576	2025/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,605	361,765	2025/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,000	2,513	349,085	2048/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	2,791	387,665	2025/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,800	3,266	453,558	2048/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	6,152	854,381	2028/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	1,834	254,792	2025/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,426	475,847	2025/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	2,888	401,116	2025/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	6,328	878,883	2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,220	2,707	376,049	2048/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,411	334,940	2025/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,457	480,184	2025/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,417	335,659	2025/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,415	335,416	2025/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	3,934	546,431	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,700	3,537	491,318	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,020	2,727	378,757	2048/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	2,887	400,920	2025/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	1,964	272,749	2023/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	1,500	1,432	198,864	2025/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,444	339,401	2023/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	6,127	850,945	2029/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	3,898	541,354	2024/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,383	330,968	2026/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	3,969	551,189	2049/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,371	329,298	2026/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,205	445,201	2024/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,352	326,736	2026/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	3,836	532,740	2049/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	3,560	494,496	2029/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,381	469,524	2024/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,641	366,781	2026/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,802	389,122	2026/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,346	464,663	2024/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	2,591	359,929	2026/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,500	5,245	728,398	2024/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,309	320,727	2026/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,092	568,270	2029/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	3,326	461,956	2049/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,534	351,939	2026/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,775	524,250	2024/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,283	317,067	2026/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,839	394,346	2024/09/30	

当				未			償還年月日
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	945	131,232	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	2,733	379,552	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,850	2,504	347,791	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	3,347	464,899	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	1,819	252,715	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,829	392,929	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,284	317,276	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,367	328,743	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,700	1,593	221,324	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,000	4,285	595,127	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	6,500	5,864	814,357	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	3,668	509,488	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	266	36,970	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	4,837	671,828	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,500	1,373	190,765	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,384	192,282	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,800	5,421	752,827	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,457	341,214	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,400	2,061	286,301	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	3,104	431,149	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	3,176	441,141	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	2,997	416,219	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,711	376,557	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	5,871	815,413	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	2,990	415,262	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,059	424,809	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	8,000	6,344	880,991	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,238	588,635	2027/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	6,700	3,838	533,033	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	3,151	437,614	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	2,975	413,191	2027/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,583	497,598	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,371	468,247	2027/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,136	435,632	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,915	266,044	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	9,800	7,908	1,098,253	2030/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,568	495,599	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,000	3,383	469,930	2027/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,800	4,172	579,385	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,100	3,358	466,338	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,100	4,551	632,002	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,247	589,815	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,859	397,116	2023/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,237	588,419	2027/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	1,000	890	123,726	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,000	3,797	527,422	2024/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	7,000	5,956	827,199	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,900	3,865	536,753	2051/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	10,700	8,796	1,221,625	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,000	4,729	656,806	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,436	616,110	2026/01/31

外国債券インデックスマザーファンド

当			期		未			償還年月日
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
			%	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	1.1250	5,000	4,334	601,897	2028/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,700	3,370	468,082	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,000	2,665	370,120	2026/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,888	262,244	2024/03/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,483	483,795	2028/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,577	496,837	2026/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	3,000	2,827	392,621	2024/04/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	8,700	7,378	1,024,672	2031/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,100	4,781	663,993	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,500	4,013	557,317	2026/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,215	724,259	2028/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	4,730	656,923	2051/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,800	2,899	402,650	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,470	481,951	2028/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,400	3,913	543,478	2026/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,868	259,523	2024/06/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	4,328	601,126	2028/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	5,000	4,458	619,110	2026/06/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	5,500	5,136	713,314	2024/07/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	3,000	2,792	387,826	2024/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	10,300	8,410	1,167,975	2031/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	6,900	4,659	647,084	2051/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	3,700	2,562	355,809	2041/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	6,000	5,287	734,300	2026/07/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	5,000	4,257	591,280	2028/07/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	5,000	4,281	594,585	2028/08/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	5,000	4,417	613,437	2026/08/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	7,500	6,964	967,149	2024/09/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	5,000	4,305	597,842	2028/09/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,500	3,100	430,582	2026/09/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	2,000	1,861	258,459	2024/10/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	4,500	4,184	581,145	2024/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	9,000	7,384	1,025,535	2031/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	6,600	4,312	598,896	2051/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	4,000	2,892	401,656	2041/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	4,000	3,843	533,805	2023/10/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	6,000	5,193	721,285	2028/10/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	7,000	6,250	868,037	2026/10/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,583	497,648	2026/11/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.5000	5,000	4,793	665,631	2023/11/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	5,600	4,877	677,297	2028/11/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	2,200	2,052	284,974	2024/12/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	2,500	2,394	332,565	2023/12/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	4,000	3,458	480,334	2028/12/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,577	496,782	2026/12/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	1,000	932	129,539	2025/01/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,000	2,868	398,316	2024/01/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	10,400	8,885	1,233,864	2032/02/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	3,700	3,471	482,126	2025/02/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	4,300	3,791	526,463	2029/01/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	3,900	2,799	388,760	2052/02/15	

		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	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	2.3750	2,500	1,931	268,192	2042/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,000	4,441	616,853	2029/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	4,000	3,843	533,777	2024/02/29
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	1,000	915	127,146	2027/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	5,000	4,714	654,695	2025/03/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	3,000	2,741	380,660	2029/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	5,000	4,695	652,008	2027/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	2,000	1,935	268,841	2024/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	2,000	1,920	266,716	2025/04/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	9,300	8,647	1,200,879	2032/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,888	401,082	2025/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	5,000	4,133	574,026	2052/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	1,500	1,337	185,716	2042/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	4,500	4,362	605,798	2024/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	3,000	2,823	392,034	2029/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,845	395,175	2027/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	4,500	4,356	605,017	2024/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	6,000	5,602	777,985	2029/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	2,000	1,887	262,067	2027/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	2,000	1,931	268,202	2025/06/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	4,000	3,847	534,355	2029/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	3,000	2,905	403,482	2027/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	3,000	2,902	403,116	2025/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	4,070	3,855	535,403	2027/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	1,000	974	135,321	2024/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	2,500	2,426	336,905	2025/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	7,500	6,888	956,567	2032/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	3,700	3,150	437,547	2052/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.3750	1,000	908	126,175	2042/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	3,970	3,867	537,139	2024/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	3,360	3,111	432,135	2029/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	3,890	3,802	528,098	2024/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	2,500	2,409	334,607	2027/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	3,500	3,342	464,187	2029/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	2,300	2,254	313,012	2025/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,500	3,481	483,517	2024/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,499	347,063	2029/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	1,500	1,509	209,646	2027/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,400	3,398	471,969	2025/10/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	1,000	997	138,511	2024/10/31
通貨小計	銘柄数 金 額	264銘柄		973,856	864,609	120,068,309	
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	563	57,596	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,140	116,519	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,386	141,641	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,235	126,169	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	913	1,026	104,833	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	961	1,026	104,833	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,374	140,405	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,265	129,285	2048/12/01

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			未 期		
		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
				%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,116	114,010
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	907	92,751
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,128	115,238
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	650	616	62,947
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,710	2,968	303,214
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,167	119,283
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,173	119,841
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,342	137,177
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	3,050	311,627
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	700	661	67,548
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,649	270,625
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,000	1,648	168,427
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,100	1,887	192,859
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,141	116,605
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	300	274	28,033
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,400	3,020	308,611
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,000	944	96,462
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,450	1,079	110,273
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	966	98,709
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	200	183	18,764
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,000	2,884	294,695
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,100	1,852	189,293
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	200	189	19,373
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	400	385	39,423
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,500	1,376	140,634
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	100	95	9,757
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	391	40,005
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	200	195	20,016
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,000	980	100,211
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	770	736	75,246
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	360	353	36,135
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	200	202	20,738
通貨小計	銘柄数	40銘柄			49,798	46,591	4,759,828
	金 額						
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	2,104	195,291
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	573	569	52,875
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,354	1,339	124,256
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,798	1,801	167,120
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,258	1,354	125,713
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,748	1,803	167,309
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,099	102,051
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,307	1,176	109,148
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	725	67,327
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,672	1,626	150,948
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,178	1,111	103,149
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	1,054	97,838
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,500	1,446	134,196
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,900	1,814	168,378
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,870	2,680	248,762
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,390	1,163	107,981

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	
				%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	2,410	223,663	2031/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,700	1,383	128,375	2032/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,266	210,320	2024/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,000	1,645	152,669	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,400	870	80,819	2051/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,465	135,991	2025/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,008	186,408	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,081	100,324	2026/09/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,600	1,353	125,585	2032/11/21
		AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.0000	1,300	1,225	113,707	2033/11/21
通貨小計	銘柄数	26銘柄						
	金 額				42,234	38,584	3,580,216	
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	788	79,640	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	923	921	93,142	2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	809	797	80,556	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	393	39,714	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	585	59,198	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	617	62,436	2029/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	516	52,224	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	679	68,611	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	437	44,231	2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	750	687	69,422	2036/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	540	54,632	2028/05/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	490	482	48,766	2024/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	320	32,393	2039/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	540	443	44,767	2050/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	750	699	70,649	2025/11/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	600	535	54,122	2031/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	200	165	16,717	2051/10/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	200	187	18,940	2026/11/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	240	231	23,440	2032/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	220	233	23,606	2072/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	100	99	10,085	2027/09/01
通貨小計	銘柄数	21銘柄						
	金 額				10,749	10,365	1,047,303	
ニュージーランド					千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル		
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	600	603	51,974	2027/04/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	400	380	32,768	2033/04/14
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	490	412	35,550	2037/04/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	600	560	48,255	2029/04/20
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	530	430	37,117	2031/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	350	235	20,326	2041/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	700	658	56,757	2024/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	400	322	27,785	2028/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	500	436	37,631	2026/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	440	368	31,715	2032/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	380	284	24,546	2051/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	640	613	52,812	2025/04/15
通貨小計	銘柄数	12銘柄						
	金 額				6,030	5,308	457,242	

外国債券インデックスマザーファンド

当			期		未			償還年月日
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	千イギリス・ポンド 921	千イギリス・ポンド 893	千円 148,512	2025/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,282	1,116	185,532	2065/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,382	229,794	2026/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,760	1,200	199,520	2047/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,450	1,170	194,550	2037/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,810	1,272	211,591	2057/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,410	1,292	214,782	2027/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,500	1,378	229,182	2028/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,040	694	115,507	2071/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	1,800	1,745	290,207	2024/04/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,210	869	144,588	2049/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	574	95,580	2054/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	1,500	1,291	214,768	2029/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,900	1,785	296,750	2025/06/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,190	835	138,819	2041/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	1,300	1,051	174,817	2030/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	1,700	737	122,672	2061/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,367	227,360	2026/01/30	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,600	1,368	227,402	2028/01/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	564	93,829	2050/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,700	1,226	203,878	2035/07/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,300	1,253	208,354	2024/01/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	2,500	1,955	325,129	2031/07/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	500	297	49,387	2046/01/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	500	448	74,594	2026/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	800	492	81,906	2051/07/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.2500	100	93	15,535	2025/01/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	900	643	106,898	2039/01/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.5000	700	594	98,764	2029/01/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.8750	300	236	39,270	2033/07/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	300	195	32,529	2053/07/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.0000	2,100	1,738	288,908	2032/01/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	820	441	73,419	2073/10/22	
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.1250	2,000	2,052	341,137	2027/01/29	
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,088	180,943	2028/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,240	2,454	407,985	2032/06/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,528	254,071	2025/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,362	1,491	247,952	2036/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,357	1,574	261,740	2038/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	2,035	338,348	2055/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,366	1,541	256,319	2046/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,287	213,959	2027/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,116	2,437	405,119	2042/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,600	1,789	297,533	2030/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	1,536	255,412	2049/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	1,586	263,806	2039/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,560	1,751	291,074	2034/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,174	1,384	230,156	2060/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	1,740	289,284	2040/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	1,666	276,987	2052/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,866	1,799	299,114	2044/01/22	

区 分		当 期			未 期		
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
				%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,386	1,534	255,081
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,092	1,081	179,742
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,524	1,530	254,395
通貨小計		54銘柄					
		金 額			72,730	67,102	11,154,519
イスラエル					千イスラエル・シェケル	千イスラエル・シェケル	
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	1,800	1,989	80,230
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,600	2,051	82,743
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,000	2,009	81,051
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,204	88,903
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,704	68,754
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,400	2,479	100,012
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,200	1,132	45,659
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,500	1,475	59,528
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	2,400	2,045	82,492
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.5000	1,600	1,494	60,266
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,700	1,330	53,681
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.5000	200	182	7,358
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.4000	900	850	34,313
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	1.3000	300	252	10,182
通貨小計		14銘柄					
		金 額			21,700	21,202	855,180
デンマーク					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	13,662	18,287	353,135
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	4,821	93,098
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	5,954	114,984
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,100	4,729	91,335
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	8,590	7,706	148,821
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,500	2,239	43,246
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	414	7,998
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	957	18,488
通貨小計		8銘柄					
		金 額			43,211	45,111	871,107
ノルウェー					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,072	56,608
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	5,395	5,200	72,284
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,340	4,099	56,987
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,450	4,188	58,218
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,299	45,856
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	3,530	49,068
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	6,800	5,992	83,301
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,500	3,003	41,750
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1250	1,700	1,563	21,728
通貨小計		9銘柄					
		金 額			37,630	34,949	485,804
スウェーデン					千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,655	5,812	76,369
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	8,025	7,951	104,478
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,595	7,612	100,025
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	6,867	90,242

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	
			%	千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ	千円	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 7500	5, 050	4, 728	62, 130	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	3, 300	3, 421	44, 952	2032/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 7500	6, 400	5, 906	77, 616	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 1250	5, 000	4, 325	56, 832	2031/05/12
通貨小計	銘柄数	8銘柄					
	金 額			47, 205	46, 624	612, 648	
メキシコ				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
	Mexican Bonos	国債証券	5. 7500	37, 290	33, 350	240, 865	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8. 0000	21, 300	18, 817	135, 906	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8. 0000	23, 800	22, 992	166, 057	2024/09/05
	MEXICAN BONOS	国債証券	5. 5000	7, 000	6, 065	43, 808	2027/03/04
	MEXICAN BONOS	国債証券	5. 0000	1, 000	898	6, 486	2025/03/06
	MEXICAN BONOS	国債証券	8. 0000	3, 000	2, 636	19, 039	2053/07/31
	Mexican Bonos	国債証券	8. 0000	28, 033	27, 286	197, 068	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10. 0000	23, 919	23, 833	172, 131	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7. 5000	27, 968	26, 130	188, 719	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10. 0000	8, 874	9, 413	67, 983	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8. 5000	29, 544	28, 513	205, 928	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8. 5000	18, 894	17, 700	127, 833	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	7. 7500	32, 515	29, 769	214, 998	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	7. 7500	21, 654	18, 672	134, 859	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7. 7500	7, 944	7, 104	51, 311	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			292, 735	273, 185	1, 972, 998	
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. 2200	5, 200	5, 313	103, 162	2025/12/06
	China Government Bond	国債証券	3. 2500	5, 000	5, 155	100, 100	2028/11/22
	China Government Bond	国債証券	3. 2900	5, 000	5, 171	100, 408	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3. 2500	5, 000	5, 132	99, 656	2026/06/06
	China Government Bond	国債証券	3. 1200	12, 000	12, 285	238, 532	2026/12/05
	China Government Bond	国債証券	3. 1300	8, 000	8, 191	159, 047	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2. 8500	13, 000	13, 116	254, 661	2027/06/04
	China Government Bond	国債証券	2. 6800	6, 500	6, 405	124, 358	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	2. 8800	37, 000	37, 276	723, 735	2023/11/05
	China Government Bond	国債証券	3. 0200	18, 000	18, 336	356, 001	2025/10/22
	China Government Bond	国債証券	3. 2800	9, 000	9, 257	179, 741	2027/12/03
	China Government Bond	国債証券	3. 2700	12, 500	12, 986	252, 130	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3. 0300	7, 000	7, 125	138, 335	2026/03/11
	China Government Bond	国債証券	3. 8100	7, 300	7, 983	154, 999	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	3. 0100	7, 000	7, 089	137, 644	2028/05/13
	China Government Bond	国債証券	3. 7200	8, 000	8, 618	167, 320	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3. 0200	5, 800	5, 868	113, 936	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 6900	4, 500	4, 513	87, 620	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7400	5, 000	5, 037	97, 803	2026/08/04
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 5700	11, 000	11, 249	218, 402	2024/06/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 5900	5, 500	5, 751	111, 661	2027/08/03
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 6900	15, 000	15, 413	299, 248	2024/09/21
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 6900	5, 000	5, 297	102, 851	2028/05/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 6100	17, 000	17, 537	340, 488	2025/06/07
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 5400	4, 500	4, 722	91, 690	2028/08/16

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未		償還年月日
						評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
				%	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	4.0800	4,500	5,070	98,444	2048/10/22
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8600	6,300	6,931	134,575	2049/07/22
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7700	11,000	11,372	220,804	2025/03/08
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	12,000	12,187	236,619	2050/03/16
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	5,500	5,543	107,635	2028/10/14
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	3,500	3,632	70,524	2051/10/18
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	6,000	6,011	116,709	2031/11/18
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	17,000	16,825	326,662	2027/01/20
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	7,200	7,116	138,165	2032/02/17
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2600	10,000	9,963	193,451	2025/02/24
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	15,000	14,962	290,508	2029/03/24
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	5,500	5,547	107,703	2052/04/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	5,000	4,931	95,740	2032/05/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	4,000	3,977	77,230	2029/06/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,000	3,924	76,196	2032/08/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	12,000	11,715	227,456	2032/09/01
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9900	2,000	1,988	38,602	2024/09/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	9,500	9,349	181,528	2029/09/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	2,200	2,174	42,217	2027/10/15
通貨小計	銘柄数	44銘柄						
	金 額				381,000	388,062	7,534,316	
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,325	71,598	2027/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,197	36,857	2030/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,535	47,288	2026/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,298	39,969	2031/06/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	728	22,427	2027/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,371	42,220	2033/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,853	57,061	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	1,300	1,368	42,127	2043/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,067	32,864	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,740	53,583	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,206	37,133	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	949	29,233	2046/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,550	1,546	47,601	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,550	1,563	48,140	2024/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,184	36,474	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,950	2,036	62,688	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,201	36,991	2025/03/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,231	37,917	2033/11/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	600	632	19,462	2038/06/08
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	649	19,987	2026/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,310	2,266	69,782	2029/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,254	38,626	2048/07/06
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400	400	12,316	2024/06/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,237	38,086	2034/07/05
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,604	49,396	2040/05/22
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	2,650	2,439	75,111	2050/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,800	1,596	49,161	2031/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	500	478	14,735	2032/07/15

外国債券インデックスマザーファンド

		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	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 6960	千マレーシア・リンギット 400	千マレーシア・リンギット 412	千円 12, 687	2042/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4. 5040	500	510	15, 733	2029/04/30
通貨小計	銘柄数	30銘柄						
	金 額				39, 353	38, 885	1, 197, 267	
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 3, 742	114, 954	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2. 5000	3, 170	2, 624	80, 601	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2. 5000	2, 870	2, 712	83, 292	2024/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2. 7500	4, 840	3, 811	117, 058	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2. 2500	3, 400	3, 122	95, 909	2024/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	0. 7500	2, 000	1, 742	53, 509	2025/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	1. 2500	3, 000	2, 019	62, 022	2030/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	0. 2500	2, 200	1, 703	52, 332	2026/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1, 000	891	27, 392	2024/07/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 7500	1, 800	1, 192	36, 612	2032/04/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 7500	500	436	13, 416	2027/05/25
		Poland Government Bond	国債証券	5. 7500	827	785	24, 137	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2. 7500	3, 650	2, 996	92, 013	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3. 2500	4, 591	4, 176	128, 273	2025/07/25
	通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金 額				38, 225	31, 959	981, 527	
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, 105	158, 770	2025/03/13
		IRISH TREASURY	国債証券	3. 4000	607	617	88, 676	2024/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	2. 4000	961	973	139, 774	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	2. 0000	931	832	119, 510	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1. 0000	1, 073	1, 035	148, 700	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1. 7000	550	491	70, 602	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0. 9000	800	746	107, 202	2028/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1. 3000	750	671	96, 369	2033/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1. 3500	750	700	100, 569	2031/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1. 1000	950	884	127, 024	2029/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1. 5000	600	475	68, 280	2050/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0. 4000	350	270	38, 879	2035/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0. 2000	500	458	65, 857	2027/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0. 2000	800	681	97, 851	2030/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	—	800	653	93, 791	2031/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0. 5500	400	277	39, 905	2041/04/22
		IRISH TREASURY	国債証券	0. 3500	100	82	11, 849	2032/10/18
	国 小 計	銘柄数	17銘柄					
	金 額				11, 953	10, 959	1, 573, 613	
ユーロ (オランダ)		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 5000	千ユーロ 1, 139	千ユーロ 1, 327	190, 588	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 0000	1, 755	2, 127	305, 453	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 7500	1, 729	2, 158	309, 937	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 5000	1, 468	1, 508	216, 597	2033/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	1, 929	2, 193	314, 923	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0000	1, 514	1, 512	217, 232	2024/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	1, 791	1, 711	245, 690	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 5000	1, 938	1, 836	263, 735	2026/07/15

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
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,078	298,458
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,367	196,404
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,258	180,698
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,064	152,892
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	687	98,719
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,198	172,016
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	736	105,758
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,250	720	103,458
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,087	156,158
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	646	92,812
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	792	113,801
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	93	13,471
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	600	513	73,684
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	298	42,884
国 小 計	銘柄数	22銘柄					
	金 額				27,863	26,921	3,865,379
					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	1,646	236,460	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	1,594	228,883	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	950	136,508	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,463	1,408	202,171	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	999	143,439	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	740	665	95,480	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,100	1,035	148,616	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,019	146,371	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	580	533	76,568	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	600	510	73,329	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,490	1,384	198,813	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	650	580	83,277	2033/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,377	197,752	2029/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	700	565	81,205	2050/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,037	149,016	2030/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	860	583	83,840	2040/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,079	154,933	2027/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	1,600	1,298	186,456	2031/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	530	265	38,076	2071/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	400	328	47,112	2032/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	800	588	84,552	2053/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	400	57,556	2039/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	1,994	286,336	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,904	2,372	340,706	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	1,946	279,416	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,078	154,876	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	879	126,347	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	643	750	107,812	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,515	217,635	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	776	111,424	2034/06/22
国 小 計	銘柄数	30銘柄					
	金 額				32,548	31,167	4,474,981

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
						千ユーロ	千円	
ユーロ（フランス）	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	3,350	481,028	2025/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	3,967	569,715	2029/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,227	4,190	601,600	2032/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	3,264	468,649	2035/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,764	2,273	326,393	2055/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	2,785	399,960	2038/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,164	3,996	573,760	2041/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,217	1,599	229,611	2060/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,646	3,803	546,138	2026/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	5,899	6,062	870,422	2027/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,088	3,404	488,750	2045/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	6,086	6,091	874,684	2024/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,087	5,200	746,737	2030/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,899	4,856	697,314	2024/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,352	481,356	2025/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	4,934	708,437	2025/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,120	4,839	694,815	2031/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,387	4,145	595,159	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	4,169	3,533	507,360	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,387	1,113	159,901	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,050	3,761	540,078	2026/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	2,294	329,495	2039/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,233	464,300	2027/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,550	2,254	323,636	2048/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,400	5,000	717,996	2028/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	3,449	495,306	2034/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	4,550	653,408	2028/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,305	474,674	2024/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,850	2,244	322,263	2050/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,350	3,904	560,641	2029/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,330	4,116	591,039	2025/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	3,604	517,597	2029/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,770	1,752	251,555	2052/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,798	401,802	2026/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	1,550	222,683	2040/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	3,350	481,004	2030/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,480	689	99,047	2072/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	97	13,985	2024/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	991	142,307	2044/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,600	3,756	539,311	2031/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,100	2,831	406,592	2027/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,500	930	133,574	2053/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,687	242,242	2032/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,999	287,075	2025/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	200	164	23,684	2038/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	300	278	40,003	2028/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,300	1,256	180,354	2032/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,000	973	139,740	2043/05/25	
国 小 計	銘柄数	48銘柄						
	金 額			150,364	143,593	20,617,203		

区 分	銘 柄	種 類	当 期 年 利 率	未 期 額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
					千ユーロ	千円	
ユーロ（ドイツ）	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,020	146,464	2024/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,397	200,596	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	2,544	365,364	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,090	156,531	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	2,512	360,744	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,048	3,856	553,669	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,305	2,978	427,616	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,271	4,089	587,184	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	1,744	250,423	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,739	2,448	351,552	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,974	2,395	343,938	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	3,123	448,521	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,556	223,523	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	3,024	434,255	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,582	227,200	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,042	3,977	571,029	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,125	305,157	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,080	298,773	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,368	2,264	325,091	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,257	324,141	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,200	3,926	563,742	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,300	3,099	445,096	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,770	2,474	355,284	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,772	254,453	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,100	3,744	537,610	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	1,994	286,385	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,651	380,722	2029/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,850	1,770	254,262	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,531	219,934	2030/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,646	236,402	2035/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,825	262,044	2027/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,562	224,362	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,041	149,571	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	773	111,026	2031/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,077	154,666	2036/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,791	257,281	2028/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	684	98,333	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,600	3,065	440,202	2031/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	596	85,618	2031/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,515	217,609	2032/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	400	348	49,967	2038/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	2,700	2,650	380,517	2032/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,200	1,197	171,963	2053/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	200	202	29,114	2029/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	721	103,610	2052/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	4,116	591,047	2023/12/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	97	13,997	2024/03/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2000	100	97	13,965	2024/06/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	530	515	73,947	2024/09/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,869	268,442	2024/04/05
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,637	235,086	2024/10/18
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,291	329,009	2025/04/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,177	312,635	2025/10/10

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			未 期		
		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	—	100	94	13,635
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,065	296,506
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,207	173,308
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	92	13,218
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	3,000	2,915	418,631
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	430	418	60,058
国 小 計	銘柄数	59銘柄					
	金 額				113,416	111,332	15,985,058
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	3,177	456,296
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	2,015	289,384
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	1,951	280,224
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,187	314,107
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	2,700	387,750
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	1,872	268,869
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	1,603	230,249
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,630	2,530	363,315
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	1,828	262,599
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,750	1,663	238,812
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	1,954	280,649
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,400	2,264	325,194
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,200	1,098	157,749
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,900	2,728	391,786
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,496	214,834
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,250	1,974	283,477
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,226	319,742
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,452	352,140
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,360	1,166	167,542
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,383	342,190
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	844	121,300
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,226	319,667
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,400	2,157	309,839
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,300	944	135,615
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	464	66,684
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	2,200	1,770	254,188
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	289	41,626
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	650	365	52,450
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	439	63,106
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	1,900	1,384	198,779
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,562	224,316
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	600	412	59,176
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	813	116,794
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	2,100	1,736	249,261
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9000	600	444	63,775
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	94	13,548
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	100	88	12,752
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	1,000	970	139,282
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,000	1,022	146,832
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,179	2,733	392,465
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,754	1,980	284,429
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,158	1,434	205,974
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	1,732	248,799
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,973	2,406	345,478

		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			
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	千ユーロ 2,789	千ユーロ 2,961	千円 425,260	2025/07/30		
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,214	317,906	2026/07/30		
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	1,937	278,117	2023/10/31		
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,018	289,774	2028/10/31		
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	1,705	244,854	2044/10/31		
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,012	288,965	2024/04/31		
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,116	303,911	2024/10/31		
国 小 計	銘柄数	51銘柄								
	金 額				87,203	84,565	12,141,857			
ユーロ (イタリア)		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	千ユーロ 906	千ユーロ 958	137,686	2023/11/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,287	184,838	2026/11/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	2,759	396,158	2027/11/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,809	259,802	2024/12/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	1,377	197,760	2046/09/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,407	345,681	2025/06/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	1,745	250,625	2032/03/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,891	2,814	404,064	2025/12/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	1,338	192,191	2047/03/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,386	2,275	326,689	2026/06/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	1,941	278,829	2036/09/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	997	143,281	2026/12/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	756	108,569	2067/03/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,312	188,422	2033/09/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,454	208,898	2027/06/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,285	184,597	2024/05/15		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,250	1,175	168,744	2048/03/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,700	2,574	369,643	2027/08/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,566	224,933	2024/11/15		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,152	165,524	2038/09/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	1,978	284,108	2028/02/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,260	180,953	2025/05/15		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,550	2,481	356,349	2028/12/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,533	220,136	2025/11/15		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,198	172,016	2035/03/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,650	1,650	237,015	2049/09/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	1,855	266,464	2029/08/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,200	2,170	311,668	2024/07/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	2,100	2,034	292,092	2026/07/15		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	1,250	1,119	160,673	2040/03/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	1,638	235,313	2030/04/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,300	1,236	177,552	2025/02/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,152	309,019	2027/01/15		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,550	1,196	171,741	2050/09/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,135	162,968	2036/03/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,500	1,460	209,688	2025/07/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	1,652	237,323	2030/08/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,100	1,823	261,811	2030/12/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,200	1,987	285,362	2027/09/15		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,571	225,706	2026/02/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,500	1,096	157,431	2041/03/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,900	1,536	220,669	2031/04/01		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,069	153,533	2024/01/15		

外国債券インデックスマザーファンド

		当 期			未				
区 分		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日	
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円			
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 7000	1, 200	784	112, 647	2051/09/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 9500	700	484	69, 572	2037/03/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	1, 900	1, 620	232, 664	2028/03/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 6000	1, 800	1, 399	200, 999	2031/08/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	700	459	66, 022	2045/04/30	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1, 100	993	142, 709	2026/04/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1, 500	1, 448	207, 978	2024/04/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 1500	460	302	43, 387	2072/03/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 5000	800	684	98, 331	2028/07/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 9500	1, 900	1, 509	216, 683	2031/12/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1, 000	956	137, 377	2024/08/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1, 200	1, 165	167, 359	2024/01/30	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3, 100	2, 776	398, 705	2026/08/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 9500	1, 700	1, 331	191, 243	2032/06/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 4500	900	753	108, 121	2029/02/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	285	40, 952	2024/12/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 1500	800	569	81, 787	2052/09/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	195	28, 029	2023/11/29	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 1000	300	275	39, 581	2027/04/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2000	500	477	68, 555	2025/08/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 8000	800	769	110, 476	2029/06/15	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 5000	3, 300	2, 950	423, 675	2032/12/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 2500	300	275	39, 541	2038/03/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 7500	100	98	14, 157	2024/05/30	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 6500	200	194	27, 884	2027/12/01	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 0000	500	504	72, 484	2035/04/30	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 5000	300	303	43, 568	2026/01/15	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5. 2500	3, 254	3, 638	522, 447	2029/11/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6. 0000	2, 849	3, 361	482, 669	2031/05/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5. 7500	1, 805	2, 096	301, 055	2033/02/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5. 0000	2, 298	2, 529	363, 198	2034/08/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4. 0000	2, 740	2, 785	399, 959	2037/02/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5. 0000	2, 044	2, 304	330, 851	2039/08/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5. 0000	2, 118	2, 223	319, 225	2025/03/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5. 0000	2, 243	2, 543	365, 265	2040/09/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4. 5000	2, 070	2, 167	311, 221	2026/03/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4. 7500	2, 410	2, 591	372, 090	2028/09/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4. 7500	1, 813	2, 027	291, 120	2044/09/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4. 5000	2, 194	2, 245	322, 385	2024/03/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3. 7500	2, 201	2, 242	322, 023	2024/09/01	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3. 5000	2, 318	2, 329	334, 472	2030/03/01	
		国 小 計	銘柄数	84銘柄					
			金 額			135, 077	128, 493	18, 449, 036	
		ユーロ (フィンランド)		Finland Government Bond	国債証券	0. 7500	千ユーロ 364	千ユーロ 318	45, 696
Finland Government Bond	国債証券			0. 8750	279	269	38, 765	2025/09/15	
Finland Government Bond	国債証券			0. 5000	811	768	110, 313	2026/04/15	
Finland Government Bond	国債証券			1. 3750	360	297	42, 672	2047/04/15	
Finland Government Bond	国債証券			0. 5000	800	736	105, 721	2027/09/15	
Finland Government Bond	国債証券			1. 1250	470	405	58, 202	2034/04/15	
Finland Government Bond	国債証券			0. 5000	500	451	64, 832	2028/09/15	
Finland Government Bond	国債証券			0. 5000	500	442	63, 535	2029/09/15	
Finland Government Bond	国債証券			—	200	192	27, 691	2024/09/15	
Finland Government Bond	国債証券			—	200	192	27, 691	2024/09/15	

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	0.1250	310	225	32,404
		Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	269	38,764
		Finland Government Bond	国債証券	—	500	416	59,801
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	219	31,568
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	493	70,830
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	183	26,407
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	450	308	44,354
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	300	275	39,491
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	270	259	37,306
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	700	100,523
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	398	57,262
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	413	59,392
		Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	528	75,897
国 小 計	銘柄数	22銘柄					
	金 額				9,706	8,576	1,231,438
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	1,340	192,406
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,070	153,750
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	645	92,621
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	170	24,516
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,191	171,119
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	465	66,812
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	1,115	160,188
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,148	164,924
		Austria Government Bond	国債証券	—	800	773	111,020
		Austria Government Bond	国債証券	—	980	826	118,690
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	464	66,622
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	255	36,677
		Austria Government Bond	国債証券	0.8500	350	177	25,537
		Austria Government Bond	国債証券	—	1,200	984	141,336
		Austria Government Bond	国債証券	—	480	456	65,493
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	438	62,987
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	300	157	22,561
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	262	37,690
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	500	434	62,439
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	264	37,954
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	298	42,875
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	974	139,886
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,373	1,623	233,065
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	951	136,652
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	441	63,427
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	723	800	114,895
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	762	109,419
		Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	923	132,618
国 小 計	銘柄数	28銘柄					
	金 額				20,870	19,419	2,788,191
通貨小計		361銘柄					
	金 額				589,000	565,028	81,126,760
合 計		920銘柄					
	金 額						236,705,030

(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

項 目	2022年11月30日現在 当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	236,705,030	98.0
コール・ローン等、その他	4,798,267	2.0
投資信託財産総額	241,503,298	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＝138.87円、1カナダ・ドル＝102.16円、1オーストラリア・ドル＝92.79円、1シンガポール・ドル＝101.04円、1ニュージーランド・ドル＝86.13円、1イギリス・ポンド＝166.23円、1イスラエル・シェケル＝40.334円、1デンマーク・クローネ＝19.31円、1ノルウェー・クローネ＝13.90円、1スウェーデン・クローネ＝13.14円、1メキシコ・ペソ＝7.222円、1オフショア・人民元＝19.415円、1マレーシア・リンギット＝30.789円、1ポーランド・ズロチ＝30.711円、1ユーロ＝143.58円です。
- (注3) 当期末における外貨建純資産 (239,018,141千円) の投資信託財産総額 (241,503,298千円) に対する比率は、99.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年11月30日現在	
項 目	当 期 末
(A) 資産	243,630,679,092円
コール・ローン等	3,229,062,310
公社債 (評価額)	236,705,030,930
未収入金	2,127,602,130
未収利息	1,496,086,797
前払費用	72,896,925
(B) 負債	2,278,360,508
未払金	2,156,399,997
未払解約金	121,960,511
(C) 純資産総額 (A－B)	241,352,318,584
元本	76,340,507,617
次期繰越増益金	165,011,810,967
(D) 受益権総口数	76,340,507,617口
1万口当り基準価額 (C／D)	31,615円

- * 期首における元本額は74,475,307,643円、当作成期間中における追加設定元本額は9,175,662,845円、同解約元本額は7,310,462,871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 447,343,827円
- ダイワ国内重視バランスファンド30VA (一般投資家私募) 9,071,985円
- ダイワ国内重視バランスファンド50VA (一般投資家私募) 51,739,813円
- ダイワ国際分散バランスファンド30VA (一般投資家私募) 19,793,735円
- ダイワ国際分散バランスファンド50VA (一般投資家私募) 243,846,488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) 347,889,324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) 589,471,225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) 2,679,395,542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) 612,758,959円
- D－I's 外国債券インデックス 992,049円
- DCダイワ・ターゲットイヤー2050 12,619,026円

- iFree 外国債券インデックス 2,022,055,185円
- iFree 8資産バランス 1,843,024,587円
- iFree 年金バランス 342,801,665円
- DCダイワ外国債券インデックス 50,603,926,450円
- ダイワ・ライフ・バランス30 1,059,415,494円
- ダイワ・ライフ・バランス50 676,505,626円
- ダイワ・ライフ・バランス70 451,133,774円
- DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／安定コース) 638,338,066円
- DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／6分散コース) 501,969,526円
- DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／成長コース) 192,677,874円
- DCダイワ・ターゲットイヤー2030 31,943,484円
- DCダイワ・ターゲットイヤー2040 13,831,284円
- ダイワつみたてインデックス外国債券 1,384,617,622円
- ダイワつみたてインデックスバランス30 3,873,500円
- ダイワつみたてインデックスバランス50 1,528,422円
- ダイワつみたてインデックスバランス70 2,590,775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) 159,668,286円
- ダイワ世界バランスファンド40VA 115,798,326円
- ダイワ世界バランスファンド60VA 36,264,152円
- ダイワ・バランスファンド35VA 3,287,759,159円
- ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用) 199,611,808円
- ダイワ・インデックスセレクト 外国債券 150,551,922円
- ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド 49,437,293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) 1,733,569,277円
- ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス 5,720,730,269円
- ダイワライフスタイル25 28,448,488円
- ダイワライフスタイル50 58,536,147円
- ダイワライフスタイル75 14,977,183円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は31,615円です。

■損益の状況

当期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日	
項 目	当 期
(A) 配当等収益	4,847,008,138円
受取利息	4,848,738,797
その他収益金	670,149
支払利息	△ 2,400,808
(B) 有価証券売買損益	△ 3,113,711,608
売買益	39,783,690,491
売買損	△ 42,897,402,099
(C) その他費用	△ 30,384,699
(D) 当期損益金 (A＋B＋C)	1,702,911,831
(E) 前期繰越増益金	159,156,806,959
(F) 解約差損益金	△ 15,621,363,864
(G) 追加信託差損益金	19,773,456,041
(H) 合計 (D＋E＋F＋G)	165,011,810,967
次期繰越増益金 (H)	165,011,810,967

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

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

運用報告書 第18期（決算日 2022年11月30日）

（作成対象期間 2021年12月1日～2022年11月30日）

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

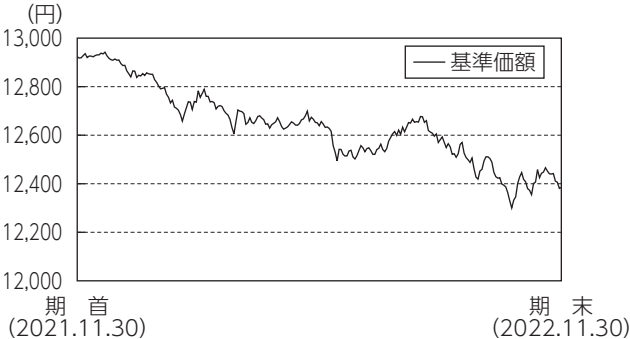
運 用 方 針	投資成果をNOMURA－BPI総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主 要 投 資 対 象	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総合指数		公社債組入比率	債券先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首)2021年11月30日	12,923	—	12,954	—	98.9	—
12月末	12,895	△0.2	12,927	△0.2	99.4	—
2022年 1月末	12,803	△0.9	12,834	△0.9	99.1	—
2月末	12,739	△1.4	12,769	△1.4	99.5	—
3月末	12,704	△1.7	12,733	△1.7	99.5	—
4月末	12,672	△1.9	12,702	△1.9	99.5	—
5月末	12,653	△2.1	12,683	△2.1	99.1	—
6月末	12,537	△3.0	12,567	△3.0	99.4	—
7月末	12,621	△2.3	12,650	△2.3	99.5	—
8月末	12,593	△2.6	12,620	△2.6	99.1	—
9月末	12,459	△3.6	12,484	△3.6	99.5	—
10月末	12,446	△3.7	12,473	△3.7	99.1	—
(期末)2022年11月30日	12,385	△4.2	12,408	△4.2	99.1	—

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) NOMURA-BPI 総合指数は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。
(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。
(注4) 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：12,923円 期末：12,385円 騰落率：△4.2%

【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、金利が上昇（債券価格は下落）したことが主な要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆ 投資環境について

○ 国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇基調で推移しました。
国内長期金利は、日銀の長短金利操作の下、当作成期首より2021年中はゼロ％をやや上回る狭いレンジで推移しました。
2022年に入ると、世界的なインフレ圧力の高まりや各国での金融

引き締め加速観測を受け、長期金利は2月に0.2％台まで上昇しました。その後、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ため、3月下旬には0.2％台半ばまで上昇しました。その後4月から当作成期末にかけては、世界で予想以上にインフレが進んだため各国の金利が上昇し、日本の金利にも上昇圧力がかかりましたが、日銀が長期金利を0.25％までにとどめる方針を強く示したこともあり、0.2％から0.25％程度のレンジで推移しました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行ってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

◆ ポートフォリオについて

当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を99％前後の高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドへの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

◆ ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△4.2％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。
当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差は0.0％程度で、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度を適切にコントロールしたことから、目立った超過損益は発生しませんでした。
＊ベンチマークはNOMURA-BPI 総合指数です。

《今後の運用方針》

ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行ってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■ 1 万口当りの費用の明細

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

(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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	12,107,241	4,243,337 (－)
	地方債証券	－	201,504 (－)
	特殊債券	－	100,637 (－)
	社債券	100,000	(－) (－)

(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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当 期			期		
買 付			売 付		
銘 柄	金 額		銘 柄	金 額	
	千円			千円	
151 5年国債 0.005% 2027/3/20	449,928		137 5年国債 0.1% 2023/9/20	591,416	
439 2年国債 0.005% 2024/8/1	390,705		135 5年国債 0.1% 2023/3/20	420,726	
366 10年国債 0.2% 2032/3/20	388,931		136 5年国債 0.1% 2023/6/20	380,733	
149 5年国債 0.005% 2026/9/20	381,767		419 2年国債 0.1% 2022/12/1	350,801	
153 5年国債 0.005% 2027/6/20	370,170		430 2年国債 0.005% 2023/11/1	250,272	
367 10年国債 0.2% 2032/6/20	359,729		422 2年国債 0.1% 2023/3/1	240,405	
365 10年国債 0.1% 2031/12/20	332,219		428 2年国債 0.005% 2023/9/1	240,333	
364 10年国債 0.1% 2031/9/20	265,603		329 10年国債 0.8% 2023/6/20	201,860	
150 5年国債 0.005% 2026/12/20	260,069		429 2年国債 0.005% 2023/10/1	180,223	
430 2年国債 0.005% 2023/11/1	250,647		134 5年国債 0.1% 2022/12/20	170,397	

(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		未	
区 分	額面金額	評 価 額	組入比率	5年B格以下 格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年末満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	38,553,000	38,457,616	91.0	—	58.9	20.6	11.5
地方債証券	1,400,000	1,441,583	3.4	—	1.3	2.1	—
特殊債券 (除く金融債券)	700,000	722,617	1.7	—	0.5	1.0	0.2
普通社債券	1,300,000	1,287,679	3.0	—	0.9	1.9	0.2
合 計	41,953,000	41,909,497	99.1	—	61.6	25.6	11.9

(注 1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
(注 2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。
(注 3) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

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

当 期		期 末			
区 分	銘 柄	年利率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	431 2年国債	0.0050	150,000	150,127	2023/12/01
	138 5年国債	0.1000	560,000	561,086	2023/12/20
	332 10年国債	0.6000	65,000	65,464	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	42,000	42,875	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	30,000	30,593	2023/12/20
	433 2年国債	0.0050	250,000	250,217	2024/02/01
	434 2年国債	0.0050	170,000	170,147	2024/03/01
	139 5年国債	0.1000	640,000	641,324	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	83,000	83,711	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	19,000	19,483	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	25,000	25,734	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	12,000	12,336	2024/03/20
	435 2年国債	0.0050	30,000	30,027	2024/04/01
	436 2年国債	0.0050	200,000	200,198	2024/05/01
	437 2年国債	0.0050	150,000	150,123	2024/06/01
	140 5年国債	0.1000	470,000	471,057	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	320,000	323,200	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	18,000	18,682	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	17,000	17,592	2024/06/20
	438 2年国債	0.0050	20,000	20,015	2024/07/01
	439 2年国債	0.0050	390,000	390,292	2024/08/01
	440 2年国債	0.0050	200,000	200,140	2024/09/01
	141 5年国債	0.1000	620,000	621,506	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	210,000	212,026	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	53,000	55,041	2024/09/20
	441 2年国債	0.0050	80,000	80,065	2024/10/01
	142 5年国債	0.1000	320,000	320,819	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	300,000	302,001	2024/12/20
	143 5年国債	0.1000	580,000	581,531	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	80,000	80,763	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	14,000	14,680	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	25,000	26,100	2025/03/20
	144 5年国債	0.1000	530,000	531,552	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	135,000	136,428	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	17,000	17,830	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	14,000	14,719	2025/06/20
	145 5年国債	0.1000	710,000	712,186	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	190,000	192,183	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	65,000	68,662	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	28,000	29,656	2025/09/20
	146 5年国債	0.1000	360,000	361,152	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	15,000	15,139	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	580,000	580,000	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	140,000	140,438	2026/03/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

当		期		末		償還年月日
区	分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	
			%	千円	千円	
	85	20年国債	2.1000	31,000	33,141	2026/03/20
	86	20年国債	2.3000	6,000	6,454	2026/03/20
	87	20年国債	2.2000	35,000	37,533	2026/03/20
	148	5年国債	0.0050	500,000	499,820	2026/06/20
	343	10年国債	0.1000	270,000	270,812	2026/06/20
	88	20年国債	2.3000	33,000	35,675	2026/06/20
	89	20年国債	2.2000	15,000	16,163	2026/06/20
	149	5年国債	0.0050	450,000	449,572	2026/09/20
	344	10年国債	0.1000	90,000	90,238	2026/09/20
	150	5年国債	0.0050	260,000	259,526	2026/12/20
	345	10年国債	0.1000	410,000	410,828	2026/12/20
	92	20年国債	2.1000	60,000	64,973	2026/12/20
	151	5年国債	0.0050	450,000	448,744	2027/03/20
	346	10年国債	0.1000	250,000	250,320	2027/03/20
	93	20年国債	2.0000	18,000	19,488	2027/03/20
	94	20年国債	2.1000	45,000	48,915	2027/03/20
	1	フィリピン共和国	0.7600	100,000	98,662	2027/04/22
	153	5年国債	0.0050	370,000	368,571	2027/06/20
	347	10年国債	0.1000	400,000	400,180	2027/06/20
	95	20年国債	2.3000	30,000	33,012	2027/06/20
	96	20年国債	2.1000	63,000	68,754	2027/06/20
	154	5年国債	0.1000	140,000	139,932	2027/09/20
	348	10年国債	0.1000	430,000	429,793	2027/09/20
	97	20年国債	2.2000	25,000	27,502	2027/09/20
	98	20年国債	2.1000	64,000	70,101	2027/09/20
	349	10年国債	0.1000	380,000	379,521	2027/12/20
	99	20年国債	2.1000	53,000	58,269	2027/12/20
	350	10年国債	0.1000	480,000	479,241	2028/03/20
	100	20年国債	2.2000	35,000	38,822	2028/03/20
	101	20年国債	2.4000	18,000	20,155	2028/03/20
	351	10年国債	0.1000	440,000	439,027	2028/06/20
	102	20年国債	2.4000	10,000	11,247	2028/06/20
	103	20年国債	2.3000	21,000	23,504	2028/06/20
	104	20年国債	2.1000	64,000	70,928	2028/06/20
	352	10年国債	0.1000	500,000	498,705	2028/09/20
	105	20年国債	2.1000	38,000	42,286	2028/09/20
	106	20年国債	2.2000	16,000	17,897	2028/09/20
	353	10年国債	0.1000	440,000	438,548	2028/12/20
	107	20年国債	2.1000	40,000	44,678	2028/12/20
	108	20年国債	1.9000	68,000	75,136	2028/12/20
	354	10年国債	0.1000	410,000	408,335	2029/03/20
	109	20年国債	1.9000	60,000	66,530	2029/03/20
	110	20年国債	2.1000	27,000	30,275	2029/03/20
	355	10年国債	0.1000	350,000	348,187	2029/06/20
	111	20年国債	2.2000	35,000	39,602	2029/06/20
	112	20年国債	2.1000	40,000	45,001	2029/06/20
	356	10年国債	0.1000	390,000	387,511	2029/09/20
	113	20年国債	2.1000	70,000	79,032	2029/09/20
	357	10年国債	0.1000	360,000	357,123	2029/12/20
	114	20年国債	2.1000	45,000	50,945	2029/12/20
	115	20年国債	2.2000	42,000	47,840	2029/12/20
	2	30年国債	2.4000	9,000	10,402	2030/02/20
	358	10年国債	0.1000	480,000	475,516	2030/03/20
	116	20年国債	2.2000	27,000	30,851	2030/03/20
	117	20年国債	2.1000	77,000	87,429	2030/03/20
	3	30年国債	2.3000	4,000	4,609	2030/05/20
	359	10年国債	0.1000	390,000	385,663	2030/06/20
	118	20年国債	2.0000	13,000	14,707	2030/06/20
	119	20年国債	1.8000	23,000	25,679	2030/06/20
	120	20年国債	1.6000	98,000	107,963	2030/06/20
	360	10年国債	0.1000	460,000	454,194	2030/09/20
	4	30年国債	2.9000	8,000	9,656	2030/11/20
	361	10年国債	0.1000	460,000	453,656	2030/12/20
	123	20年国債	2.1000	42,000	48,094	2030/12/20
	124	20年国債	2.0000	100,000	113,723	2030/12/20
	362	10年国債	0.1000	450,000	443,250	2031/03/20
	125	20年国債	2.2000	25,000	28,928	2031/03/20
	126	20年国債	2.0000	21,000	23,958	2031/03/20

当		期		末		償還年月日
区	分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	
			%	千円	千円	
	127	20年国債	1.9000	110,000	124,603	2031/03/20
	5	30年国債	2.2000	8,000	9,281	2031/05/20
	363	10年国債	0.1000	380,000	373,973	2031/06/20
	128	20年国債	1.9000	32,000	36,359	2031/06/20
	129	20年国債	1.8000	95,000	107,147	2031/06/20
	364	10年国債	0.1000	380,000	373,638	2031/09/20
	130	20年国債	1.8000	28,000	31,669	2031/09/20
	131	20年国債	1.7000	150,000	168,370	2031/09/20
	6	30年国債	2.4000	9,000	10,678	2031/11/20
	365	10年国債	0.1000	335,000	329,673	2031/12/20
	132	20年国債	1.7000	25,000	28,146	2031/12/20
	133	20年国債	1.8000	150,000	170,203	2031/12/20
	366	10年国債	0.2000	390,000	390,534	2032/03/20
	134	20年国債	1.8000	15,000	17,066	2032/03/20
	135	20年国債	1.7000	20,000	22,573	2032/03/20
	136	20年国債	1.6000	180,000	201,531	2032/03/20
	7	30年国債	2.3000	12,000	14,222	2032/05/20
	367	10年国債	0.2000	360,000	358,822	2032/06/20
	137	20年国債	1.7000	18,000	20,339	2032/06/20
	139	20年国債	1.6000	250,000	280,175	2032/06/20
	368	10年国債	0.2000	130,000	129,377	2032/09/20
	140	20年国債	1.7000	100,000	113,062	2032/09/20
	141	20年国債	1.7000	48,000	54,292	2032/12/20
	142	20年国債	1.8000	185,000	211,048	2032/12/20
	10	30年国債	1.1000	25,000	26,797	2033/03/20
	143	20年国債	1.6000	100,000	112,202	2033/03/20
	144	20年国債	1.5000	130,000	144,573	2033/03/20
	11	30年国債	1.7000	9,000	10,189	2033/06/20
	145	20年国債	1.7000	210,000	237,755	2033/06/20
	12	30年国債	2.1000	11,000	12,916	2033/09/20
	146	20年国債	1.7000	200,000	226,454	2033/09/20
	13	30年国債	2.0000	11,000	12,808	2033/12/20
	147	20年国債	1.6000	220,000	246,765	2033/12/20
	14	30年国債	2.4000	22,000	26,598	2034/03/20
	148	20年国債	1.5000	195,000	216,547	2034/03/20
	15	30年国債	2.5000	21,000	25,656	2034/06/20
	149	20年国債	1.5000	215,000	238,607	2034/06/20
	16	30年国債	2.5000	26,000	31,813	2034/09/20
	150	20年国債	1.4000	225,000	247,016	2034/09/20
	17	30年国債	2.4000	17,000	20,624	2034/12/20
	151	20年国債	1.2000	260,000	279,099	2034/12/20
	18	30年国債	2.3000	20,000	24,059	2035/03/20
	152	20年国債	1.2000	200,000	214,480	2035/03/20
	19	30年国債	2.3000	15,000	18,060	2035/06/20
	153	20年国債	1.3000	275,000	297,987	2035/06/20
	20	30年国債	2.5000	16,000	19,672	2035/09/20
	154	20年国債	1.2000	205,000	219,362	2035/09/20
	21	30年国債	2.3000	16,000	19,292	2035/12/20
	155	20年国債	1.0000	220,000	229,539	2035/12/20
	22	30年国債	2.5000	17,000	20,939	2036/03/20
	156	20年国債	0.4000	200,000	193,052	2036/03/20
	23	30年国債	2.5000	16,000	19,735	2036/06/20
	157	20年国債	0.2000	210,000	196,637	2036/06/20
	24	30年国債	2.5000	15,000	18,503	2036/09/20
	158	20年国債	0.5000	225,000	218,646	2036/09/20
	25	30年国債	2.3000	17,000	20,532	2036/12/20
	159	20年国債	0.6000	220,000	215,941	2036/12/20
	26	30年国債	2.4000	32,000	39,096	2037/03/20
	160	20年国債	0.7000	190,000	188,407	2037/03/20
	161	20年国債	0.6000	200,000	194,912	2037/06/20
	27	30年国債	2.5000	32,000	39,540	2037/09/20
	162	20年国債	0.6000	210,000	203,899	2037/09/20
	163	20年国債	0.6000	160,000	154,764	2037/12/20
	28	30年国債	2.5000	34,000	42,021	2038/03/20
	164	20年国債	0.5000	260,000	246,844	2038/03/20
	165	20年国債	0.5000	155,000	146,541	2038/06/20
	29	30年国債	2.4000	43,000	52,504	2038/09/20
	166	20年国債	0.7000	215,000	208,760	2038/09/20

当 期		未			
区 分	銘 柄	年利率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
167	20年国債	0.5000	160,000	150,075	2038/12/20
30	30年国債	2.3000	56,000	67,527	2039/03/20
168	20年国債	0.4000	250,000	229,782	2039/03/20
169	20年国債	0.3000	155,000	139,492	2039/06/20
31	30年国債	2.2000	76,000	90,354	2039/09/20
170	20年国債	0.3000	175,000	156,700	2039/09/20
171	20年国債	0.3000	140,000	124,814	2039/12/20
32	30年国債	2.3000	45,000	54,186	2040/03/20
172	20年国債	0.4000	215,000	194,256	2040/03/20
173	20年国債	0.4000	200,000	180,066	2040/06/20
33	30年国債	2.0000	95,000	109,854	2040/09/20
174	20年国債	0.4000	230,000	206,337	2040/09/20
175	20年国債	0.5000	165,000	150,201	2040/12/20
34	30年国債	2.2000	110,000	130,821	2041/03/20
176	20年国債	0.5000	150,000	136,083	2041/03/20
177	20年国債	0.4000	180,000	159,724	2041/06/20
35	30年国債	2.0000	120,000	138,771	2041/09/20
178	20年国債	0.5000	190,000	171,304	2041/09/20
179	20年国債	0.5000	190,000	170,832	2041/12/20
36	30年国債	2.0000	138,000	159,548	2042/03/20
180	20年国債	0.8000	160,000	151,753	2042/03/20
181	20年国債	0.9000	160,000	154,353	2042/06/20
37	30年国債	1.9000	165,000	187,684	2042/09/20
182	20年国債	1.1000	60,000	59,757	2042/09/20
38	30年国債	1.8000	95,000	106,210	2043/03/20
39	30年国債	1.9000	105,000	119,179	2043/06/20
40	30年国債	1.8000	80,000	89,252	2043/09/20
41	30年国債	1.7000	80,000	87,680	2043/12/20
42	30年国債	1.7000	85,000	93,077	2044/03/20
43	30年国債	1.7000	95,000	103,933	2044/06/20
44	30年国債	1.7000	85,000	92,905	2044/09/20
45	30年国債	1.5000	105,000	110,589	2044/12/20
46	30年国債	1.5000	115,000	120,961	2045/03/20
47	30年国債	1.6000	105,000	112,354	2045/06/20
48	30年国債	1.4000	110,000	113,228	2045/09/20
49	30年国債	1.4000	120,000	123,331	2045/12/20
50	30年国債	0.8000	110,000	99,629	2046/03/20
51	30年国債	0.3000	155,000	124,251	2046/06/20
52	30年国債	0.5000	120,000	100,628	2046/09/20
53	30年国債	0.6000	95,000	81,251	2046/12/20
54	30年国債	0.8000	118,000	105,449	2047/03/20
55	30年国債	0.8000	96,000	85,475	2047/06/20
56	30年国債	0.8000	100,000	88,708	2047/09/20
57	30年国債	0.8000	105,000	92,799	2047/12/20
1	40年国債	2.4000	30,000	36,666	2048/03/20
58	30年国債	0.8000	150,000	132,075	2048/03/20
59	30年国債	0.7000	97,000	83,049	2048/06/20
60	30年国債	0.9000	100,000	89,504	2048/09/20
61	30年国債	0.7000	95,000	80,612	2048/12/20
2	40年国債	2.2000	48,000	56,355	2049/03/20
62	30年国債	0.5000	110,000	88,173	2049/03/20
63	30年国債	0.4000	110,000	85,401	2049/06/20
64	30年国債	0.4000	90,000	69,609	2049/09/20
65	30年国債	0.4000	86,000	66,641	2049/12/20
3	40年国債	2.2000	19,000	22,400	2050/03/20
66	30年国債	0.4000	115,000	88,949	2050/03/20
67	30年国債	0.6000	140,000	113,121	2050/06/20
68	30年国債	0.6000	106,000	85,355	2050/09/20
69	30年国債	0.7000	106,000	87,528	2050/12/20
4	40年国債	2.2000	54,000	63,139	2051/03/20
70	30年国債	0.7000	166,000	136,498	2051/03/20
71	30年国債	0.7000	66,000	54,093	2051/06/20
72	30年国債	0.7000	203,000	165,995	2051/09/20
73	30年国債	0.7000	120,000	97,996	2051/12/20
5	40年国債	2.0000	61,000	68,461	2052/03/20
74	30年国債	1.0000	155,000	137,269	2052/03/20
75	30年国債	1.3000	160,000	153,134	2052/06/20
76	30年国債	1.4000	80,000	78,191	2052/09/20

当 期		未			
区 分	銘 柄	年利率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
6	40年国債	1.9000	40,000	43,788	2053/03/20
7	40年国債	1.7000	41,000	42,883	2054/03/20
8	40年国債	1.4000	40,000	38,750	2055/03/20
9	40年国債	0.4000	40,000	28,282	2056/03/20
10	40年国債	0.9000	91,000	75,719	2057/03/20
11	40年国債	0.8000	85,000	67,973	2058/03/20
12	40年国債	0.5000	99,000	70,435	2059/03/20
13	40年国債	0.5000	252,000	177,899	2060/03/20
14	40年国債	0.7000	273,000	205,852	2061/03/20
15	40年国債	1.0000	145,000	119,398	2062/03/20
種別	銘柄数	-----	258銘柄	-----	-----
小計	金 額	-----	38,553,000	38,457,616	-----
地方債証券	3 兵庫県公債12年	0.5600	100,000	101,020	2025/04/16
	401 大阪府公債	0.4770	100,000	100,988	2025/10/29
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	104,612	2025/11/21
	27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	101,064	2025/11/27
	751 東京都公債	0.3700	100,000	100,760	2025/12/19
	27-15 北海道公債	0.2200	100,000	100,222	2026/02/26
	28-1 静岡県公債	0.0800	100,000	99,832	2026/03/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,710	2026/06/19
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,051	2027/03/25
	29-6 千葉県公債	0.2450	100,000	99,989	2028/01/25
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	112,369	2029/12/14
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	112,943	2030/05/24
	11兵庫県公債20年	1.8400	100,000	110,696	2030/08/16
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	97,322	2031/06/30
種別	銘柄数	-----	14銘柄	-----	-----
小計	金 額	-----	1,400,000	1,441,583	-----
特 殊 債 券 除く金融債券	65 地方公共団体	0.5350	100,000	100,669	2024/10/28
	241 政保道路機構	0.4500	100,000	100,900	2025/03/31
	261 政保道路機構	0.3810	100,000	100,932	2025/11/28
	127 都市再生	0.0750	100,000	99,315	2026/09/18
	80 住宅支援機構	1.5890	100,000	105,060	2026/09/18
	81 政保道路機構	2.1000	100,000	111,858	2029/05/31
	47日本政策投資CO	1.0270	100,000	103,878	2029/09/20
種別	銘柄数	-----	7銘柄	-----	-----
小計	金 額	-----	700,000	722,617	-----
普通社債券	32東日本旅客鉄道	2.2600	100,000	102,781	2024/03/19
	25 西日本高速道	0.5240	100,000	100,650	2024/12/20
	497 関西電力	1.0020	100,000	101,709	2025/06/20
	14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	99,661	2025/12/19
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,368	2026/08/21
	17 パナソニック	0.4700	100,000	100,154	2026/09/18
	7 三井住友海上	0.1900	100,000	99,403	2026/11/13
	60 楽天カード	0.6200	100,000	95,907	2026/12/17
	8 三菱地所	2.3050	100,000	108,265	2027/03/19
	9 ソフトバンク	0.4800	100,000	98,340	2027/12/03
	65 東京瓦斯	0.2250	100,000	97,144	2030/09/10
	18 楽天グループ	1.0500	100,000	86,407	2031/12/02
	5 NTTファイナンス	0.4890	100,000	97,885	2032/09/17
種別	銘柄数	-----	13銘柄	-----	-----
小計	金 額	-----	1,300,000	1,287,679	-----
合計	銘柄数	-----	292銘柄	-----	-----
小計	金 額	-----	41,953,000	41,909,497	-----

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	41,909,497	98.8
コール・ローン等、その他	506,960	1.2
投資信託財産総額	42,416,457	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11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	42,416,457,467円
コール・ローン等	430,711,043
公社債(評価額)	41,909,497,020
未収利息	73,960,289
前払費用	2,289,115
(B) 負債	139,468,714
未払金	135,408,450
未払解約金	4,060,264
(C) 純資産総額(A－B)	42,276,988,753
元本	34,135,552,866
次期繰越損益金	8,141,435,887
(D) 受益権総口数	34,135,552,866口
1万口当り基準価額(C／D)	12,385円

* 期首における元本額は28,295,749,520円、当作成期間中における追加設定元本額は6,672,798,337円、同解約元本額は832,994,991円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

日本債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	1,509,919,138円
iFree 日本債券インデックス	3,696,009,628円
iFree 8資産バランス	4,700,707,358円
ダイワ・ライフ・バランス30	9,972,029,435円
ダイワ・ライフ・バランス50	6,944,671,544円
ダイワ・ライフ・バランス70	2,311,095,059円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	1,633,964,980円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	1,282,581,388円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	492,975,132円
ダイワつみたてインデックス日本債券	1,253,226,133円
ダイワつみたてインデックスバランス30	36,466,976円
ダイワつみたてインデックスバランス50	15,711,858円
ダイワつみたてインデックスバランス70	13,313,259円
ダイワ世界バランスファンド40VA	216,676,466円
ダイワ世界バランスファンド60VA	56,204,512円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,385円です。

■損益の状況

当期 自2021年12月1日 至2022年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	241,757,056円
受取利息	241,810,807
支払利息	△ 53,751
(B) 有価証券売買損益	△1,906,903,190
売買益	2,392,200
売買損	△1,909,295,390
(C) 当期損益金(A＋B)	△1,665,146,134
(D) 前期繰越損益金	8,272,126,456
(E) 解約差損益金	△ 219,663,037
(F) 追加信託差損益金	1,754,118,602
(G) 合計(C＋D＋E＋F)	8,141,435,887
次期繰越損益金(G)	8,141,435,887

(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。

NOMURA－BPIの知的財産権およびその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等並びに当ファンド及び同指数に関連して行われる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンド

運用報告書 第35期（決算日 2022年9月15日）

（作成対象期間 2022年3月16日～2022年9月15日）

ダイワ・グローバルＲＥＩＴ・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

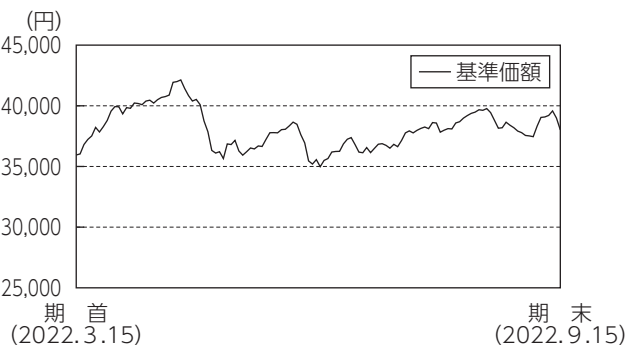
運 用 方 針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投 資 信 託 証 券 組 入 制 限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本、円換算)		投資信託証券 組入比率
	円	騰 落 率 (参考指数)	円	騰 落 率	
(期首)2022年3月15日	35,947	—	32,123	—	95.8
3月末	39,918	11.0	35,717	11.2	97.1
4月末	40,524	12.7	36,281	12.9	96.0
5月末	37,780	5.1	33,550	4.4	96.4
6月末	36,803	2.4	32,739	1.9	97.5
7月末	38,617	7.4	34,487	7.4	98.2
8月末	37,917	5.5	33,769	5.1	97.1
(期末)2022年9月15日	38,013	5.7	34,197	6.5	97.6

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本、円換算) は、S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：35,947円 期末：38,013円 騰落率：5.7%

【基準価額の主な変動要因】

保有銘柄が下落したことはマイナス要因となりましたが、主要通貨の為替相場がおおむね円安に推移したことや配当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

○ 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2022年3月末にかけては、年初来の金利上昇や地政学リスクの高まりを受けた下落からの自律反発およびロシアとウクライナの停戦期待を背景に上昇しました。4月下旬から6月半ばにかけては、米国の利上げペースへの懸念から急落しました。その後、7月にかけては長期金利の低下などを受けていったんは反発しましたが、8月半ば以降は金利上昇から下落して当作成期末を迎え、当作成期首比では下落となりました。

○ 為替相場

主要通貨の為替相場は上昇 (円安) しました。

当作成期首より、米ドル円は、F R B (米国連邦準備制度理事会) の利上げ観測の高まりを背景に、米国金利が上昇したことなどから、大きく上昇しました。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、米ドル以外の通貨も対円で上昇しました。オーストラリア・ドルやカナダ・ドルは、資源価格の上昇などを背景に、堅調に推移しました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

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

※ C & S：コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

◆ ポートフォリオについて

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

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

国・地域別配分では、大きなリスクを取らず各地域に分散して投資を行いました。銘柄選択は、C & S が独自の評価方法によって魅力的であると判断した銘柄を、マクロ経済分析やポートフォリオ全体のバランスを考慮しながら組み入れました。

◆ ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (投資信託証券)	11円 (11)
有価証券取引税 (投資信託証券)	8 (8)
その他費用 (保管費用) (その他)	3 (5) (△ 2)
合 計	21

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

■ 売買および取引の状況
投資信託証券

(2022年 3 月 16 日から 2022 年 9 月 15 日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 (4,418.714 ー)	千アメリカ・ドル (93,092 △ 58)	千口 (1,890.325 ー)	千アメリカ・ドル (112,649 ー)
	カナダ	千口 (97.366 ー)	千カナダ・ドル (2,200 ー)	千口 (129.606 ー)	千カナダ・ドル (2,832 ー)
	オーストラリア	千口 (3,390.655 ー)	千オーストラリア・ドル (20,446 ー)	千口 (2,957.175 ー)	千オーストラリア・ドル (10,615 ー)

■ 主要な売買銘柄
投資信託証券

(2022年 3 月 16 日から 2022 年 9 月 15 日まで)

当				期			
買		付		売		付	
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT (シンガポール)	千口 6,067.5	千円 1,598,812	円 263	CAPITALAND INTEGRATED COMMER (シンガポール)	千口 9,600.332	千円 2,020,289	円 210
CAMDEN PROPERTY TRUST (アメリカ)	71.62	1,422,529	19,862	DUKE REALTY CORP (アメリカ)	230.579	1,928,004	8,361
MID-AMERICA APARTMENT COMM (アメリカ)	51.785	1,240,977	23,964	AMERICAN TOWER CORP (アメリカ)	49.362	1,704,124	34,523
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR (アメリカ)	142.206	1,067,823	7,508	VICI PROPERTIES INC (アメリカ)	404.425	1,610,027	3,981
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	56.26	1,028,128	18,274	PROLOGIS INC (アメリカ)	75.488	1,387,939	18,386
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN (アメリカ)	112.864	1,027,467	9,103	ESSEX PROPERTY TRUST INC (アメリカ)	30.142	1,154,314	38,295
LXI REIT PLC (イギリス)	3,872.495	942,935	243	BRITISH LAND CO PLC (イギリス)	1,490.384	1,085,270	728
PROLOGIS INC (アメリカ)	48.233	831,274	17,234	HEALTHPEAK PROPERTIES INC (アメリカ)	200.326	761,105	3,799
WELLTOWER INC (アメリカ)	70.958	816,570	11,507	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	16.467	721,686	43,826
KLEPIERRE (フランス)	253.951	795,186	3,131	WELLTOWER INC (アメリカ)	56.262	633,340	11,256

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	香港	千口 (78.7 ー)	千香港ドル (4,983 ー)	千口 (92.8 ー)	千香港ドル (5,928 ー)
	シンガポール	千口 (10,766.9 ー)	千シンガポール・ドル (23,872 △ 261)	千口 (13,671.132 ー)	千シンガポール・ドル (26,199 ー)
	ニュージーランド	千口 (436.569 ー)	千ニュージーランド・ドル (917 ー)	千口 (ー ー)	千ニュージーランド・ドル (ー ー)
	イギリス	千口 (12,540.792 38.515)	千イギリス・ポンド (22,050 117)	千口 (7,401.563 ー)	千イギリス・ポンド (23,821 ー)
国	ユーロ (オランダ)	千口 (ー 3.549)	千ユーロ (ー 35)	千口 (98.865 ー)	千ユーロ (2,327 ー)
	ユーロ (ベルギー)	千口 (140.382 2.291)	千ユーロ (7,156 192)	千口 (76.32 ー)	千ユーロ (5,479 ー)
	ユーロ (フランス)	千口 (384.739 0.613)	千ユーロ (12,768 △ 848)	千口 (80.837 ー)	千ユーロ (1,918 ー)
	ユーロ (スペイン)	千口 (ー ー)	千ユーロ (ー △ 187)	千口 (256.066 ー)	千ユーロ (2,698 ー)
	ユーロ (ユーロ 通貨計)	千口 (525.121 6.453)	千ユーロ (19,924 △ 808)	千口 (512.088 ー)	千ユーロ (12,424 ー)

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

■組入資産明細表
外国投資信託証券

銘柄	期 首		当 期		期 末	
	口 数		口 数		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		
DIGITAL CORE REIT UNITS (アメリカ)	3,686,356	6,827,856	5,189	743,815		
SIMON PROPERTY GROUP INC	195,032	200.28	20,034	2,871,674		
EQUINIX INC	17,537	20.585	12,900	1,849,115		
AMERICAN TOWER CORP	49,362	—	—	—		
HOST HOTELS & RESORTS INC	617,981	401.683	7,358	1,054,815		
KIMCO REALTY CORP	484,985	535,466	11,148	1,598,011		
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	207,439	267,456	6,287	901,306		
INVITATION HOMES INC	598,385	678,566	25,928	3,716,520		
AMERICOLD REALTY TRUST	388,691	361,289	10,473	1,501,309		
VICI PROPERTIES INC	515,459	111,034	3,688	528,716		
APARTMENT INCOME REIT CO	162,985	143,284	5,957	853,983		
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN VENTAS INC	—	112,864	6,977	1,000,119		
	62,523	—	—	—		
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	137,874	146,044	6,000	860,175		
SUN COMMUNITIES INC	78,873	81,031	12,640	1,811,821		
PROLOGIS INC	190,286	163,031	19,739	2,829,501		
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,817	79,467	10,391	1,489,460		
COUSINS PROPERTIES INC	144,965	191,103	5,198	745,081		
SITE CENTERS CORP	137,129	126,095	1,606	230,268		
DUKE REALTY CORP	512,189	321.04	18,440	2,643,266		
ESSEX PROPERTY TRUST INC	47,602	17.46	4,619	662,193		
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	—	142,206	7,320	1,049,358		
WELLTOWER INC	336,919	351.615	26,012	3,728,628		
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	450,246	268,653	7,097	1,017,400		
HIGHWOODS PROPERTIES INC	104,729	109,582	3,325	476,722		
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,952	71,361	11,967	1,715,384		
REALTY INCOME CORP	333,411	339,229	22,188	3,180,566		
PUBLIC STORAGE	95,735	83,528	27,119	3,887,362		
REGENCY CENTERS CORP	15.8	—	—	—		
UDR INC	348,171	301,058	13,749	1,970,827		
AGREE REALTY CORP	58,738	47,676	3,502	502,085		
DIGITAL REALTY TRUST INC	102,197	154,007	17,877	2,562,508		
EXTRA SPACE STORAGE INC	85,033	74,241	14,228	2,039,482		
アメリカ・ドル 通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	10,200,401 31銘柄	12,728,79 30銘柄	348,970 <49.6%>	50,021,486 <49.6%>	
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円		
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	966,116	933,876	18,621	2,026,948		
カナダ・ドル 通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	966,116 1銘柄	933,876 1銘柄	18,621 < 2.0%>	2,026,948 < 2.0%>	
(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	2,553,751	2,763,045	22,795	2,203,148		
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	4,059,571	4,357,289	7,211	696,973		
NATIONAL STORAGE REIT	5,361,464	5,875,625	14,336	1,385,625		
MIRVAC GROUP	6,543,51	4,589,534	9,500	918,207		
GOODMAN GROUP	2,476,694	2,675,53	50,005	4,833,046		
CHARTER HALL GROUP	2,340,586	2,560,788	32,393	3,130,877		
INGENIA COMMUNITIES GROUP	2,468,127	3,415,372	14,242	1,376,499		
オーストラリア・ドル 通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	25,803,703 7銘柄	26,237,183 7銘柄	150,485 <14.4%>	14,544,377 <14.4%>	

銘柄	期 首		当 期		期 末	
	口 数		口 数		評 価 額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円		
LINK REIT	3,018,192	3,004,092	184,451	3,368,079		
香港・ドル 通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	3,018,192 1銘柄	3,004,092 1銘柄	184,451 < 3.3%>	3,368,079 < 3.3%>	
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円		
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	12,554.6	12,984.6	17,788	1,813,756		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TR	—	6,003.8	17,170	1,750,741		
CAPITALAND INTEGRATED COMM	9,600.332	—	—	—		
KEPPEL REIT	13,722.7	13,625.6	14,851	1,514,300		
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	5,260.877	5,620.277	26,583	2,710,495		
シンガポール・ドル 通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	41,138,509 4銘柄	38,234,277 4銘柄	76,395 < 7.7%>	7,789,293 < 7.7%>	
(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		
GOODMAN PROPERTY TRUST	4,390.107	4,826.676	10,425	897,958		
ニュージーランド・ドル 通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	4,390.107 1銘柄	4,826.676 1銘柄	10,425 < 0.9%>	897,958 < 0.9%>	
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円		
INDUSTRIALS REIT LIMITED LTD	1,321.95	1,752.72	2,970	491,053		
ASSURA PLC	8,694.087	9,165.898	5,788	956,742		
LXI REIT PLC	3,940.551	7,681.562	11,322	1,871,516		
URBAN LOGISTICS REIT PLC	1,478.117	1,782.367	2,931	484,629		
HOME REIT PLC	—	2,989.106	3,347	553,357		
SEGRO PLC	1,298,241	996,727	8,866	1,465,607		
HAMMERSON PLC	1,602.925	—	—	—		
UNITE GROUP PLC/THE	358.845	575.532	5,853	967,468		
BRITISH LAND CO PLC	2,761.811	1,402.704	5,697	941,786		
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	860.303	433.557	2,151	355,590		
DERWENT LONDON PLC	61.971	—	—	—		
WORKSPACE GROUP PLC	221.39	136.774	686	113,489		
SAFESTORE HOLDINGS PLC	549.97	500.239	4,894	809,067		
BIG YELLOW GROUP PLC	279.23	174,482	2,105	348,100		
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	—	1,338,782	2,747	454,081		
TRITAX BIG BOX REIT PLC	4,521.534	4,198,219	6,826	1,128,319		
イギリス・ポンド 通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	27,950,925 14銘柄	33,128,669 14銘柄	66,191 <10.9%>	10,940,810 <10.9%>	
ユーロ (オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円		
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	340.422	245.106	5,005	715,574		
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	340,422 1銘柄	245,106 1銘柄	5,005 < 0.7%>	715,574 < 0.7%>	
ユーロ (ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円		
AEDIFICA	63,574	85,485	7,509	1,073,684		
COFINIMMO	34,878	13.3	1,266	181,022		
WAREHOUSES DE PAUW SCA	222,358	273.154	7,773	1,111,443		
XIOR STUDENT HOUSING NV	63.17	78,394	2,888	413,014		
国 小 計	口数、金額 銘柄数<比率>	383,98 4銘柄	450,333 4銘柄	19,438 < 2.8%>	2,779,165 < 2.8%>	
ユーロ (フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	71,796	132,449	6,749	964,990		
ICADE	88.25	123,696	5,395	771,411		
ARGAN	29,189	36,327	3,098	443,020		

銘柄		期 首	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千ユーロ 千円
KLEPIERRE		372.106	550.041	11,160 1,595,592
COVIVIO		75.64	98.983	5,290 756,402
国 小 計	口数、金額	636.981	941.496	31,694 4,531,417
	銘柄数<比率>	5銘柄	5銘柄	< 4.5%>
ユーロ (スペイン)		千口	千口	千ユーロ 千円
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		843.412	587.346	5,247 750,297
国 小 計	口数、金額	843.412	587.346	5,247 750,297
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄	< 0.7%>
ユーロ通貨計		2,204.795	2,224.281	61,386 8,776,454
		11銘柄	11銘柄	< 8.7%>
合 計	口数、金額	115,672.748	121,317.844	- 98,365,409
	銘柄数<比率>	70銘柄	69銘柄	<97.6%>

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

■投資信託財産の構成

2022年9月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託証券	千円 98,365,409	% 96.6
コール・ローン等、その他	3,448,354	3.4
投資信託財産総額	101,813,764	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、9月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝143.34円、1カナダ・ドル＝108.85円、1オーストラリア・ドル＝96.65円、1香港ドル＝18.26円、1シンガポール・ドル＝101.96円、1ニュージーランド・ドル＝86.13円、1イギリス・ポンド＝165.29円、1ユーロ＝142.97円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産 (100,000,827千円) の投資信託財産総額 (101,813,764千円) 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9月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	102,268,299,468円
コール・ローン等	2,588,252,423
投資信託証券(評価額)	98,365,409,579
未収入金	1,069,628,107
未収配当金	245,009,359
(B) 負債	1,471,113,211
未払金	1,039,113,211
未払解約金	432,000,000
(C) 純資産総額(A－B)	100,797,186,257
元本	26,516,518,549
次期繰越損益金	74,280,667,708
(D) 受益権総口数	26,516,518,549口
1万口当り基準価額(C／D)	38,013円

* 期首における元本額は27,965,246,633円、当作成期間中における追加設定元本額は863,924,613円、同解約元本額は2,312,652,697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・グローバル R E I T ・オープン (毎月分配型) 21,337,741,502円
ダイワ・バランス3資産 (外債・海外リート・好配当日本株) 21,230,905円
安定重視ポートフォリオ (奇数月分配型) 9,238,623円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型) 7,805,961円
成長重視ポートフォリオ (奇数月分配型) 38,679,507円
6資産バランスファンド (分配型) 73,223,112円
6資産バランスファンド (成長型) 206,027,563円
リソナワールド・リート・ファンド 971,185,194円
世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型) 20,521,015円
常陽3分法ファンド 92,469,284円
ダイワ資産分散インカムオープン (奇数月決算型) 22,872,037円
ダイワ・グローバル R E I T ・オープン (為替ヘッジあり/毎月分配型) 55,162,369円
ダイワ・グローバル R E I T ・オープン (為替ヘッジなし/資産成長型) 624,045,722円
ダイワ・グローバル R E I T ・オープン (為替ヘッジあり/資産成長型) 579,796,650円
D Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース) 317,186,904円
D Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース) 412,997,288円
D Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース) 631,396,588円
グローバル R E I T ファンド2021-07 (適格機関投資家専用) 844,256,696円
ライフハーモニー (ダイワ世界資産分散ファンド) (分配型) 209,952,116円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド (部分為替ヘッジあり) 17,938,039円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド (為替ヘッジなし) 22,791,474円
* 当期末の計算口数当りの純資産額は38,013円です。

■損益の状況

当期 自2022年3月16日 至2022年9月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,088,154,564円
受取配当金	2,087,470,607
受取利息	1,446,771
その他収益金	54,550
支払利息	△ 817,364
(B) 有価証券売買損益	3,748,456,778
売買益	18,233,273,699
売買損	△14,484,816,921
(C) その他費用	△ 6,947,838
(D) 当期損益金(A + B + C)	5,829,663,504
(E) 前期繰越損益金	72,560,810,120
(F) 解約差損益金	△ 6,581,278,303
(G) 追加信託差損益金	2,471,472,387
(H) 合計(D + E + F + G)	74,280,667,708
次期繰越損益金(H)	74,280,667,708

(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。

S & P先進国 R E I T 指数はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「S P D J I」）の商品であり、これの使用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。S & P[®]、S&P 500[®]、US 500、The 500、iBoxx[®]、iTraxx[®]およびCDX[®]は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「S & P」）の商標です。Dow Jones[®]は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはS P D J Iに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンドは、S P D J I、Dow Jones、S & P、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、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 指数のいかなる過誤、遺漏、または中断に対して一切責任を負いません。

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

運用報告書 第34期（決算日 2022年11月10日）

（作成対象期間 2022年5月11日～2022年11月10日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

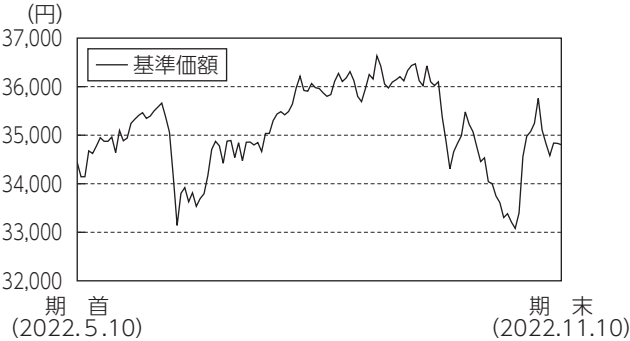
運 用 方 針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数(配当込み)		投資信託証券先物組入比率	不動産投信指数先物比率
	円	騰落率	(参考指数)	騰落率		
(期首)2022年 5月10日	34,436	%	4,443.73	%	%	%
5月末	35,331	2.6	4,563.32	2.7	97.3	1.8
6月末	34,781	1.0	4,487.40	1.0	97.3	1.7
7月末	35,976	4.5	4,628.79	4.2	97.4	1.7
8月末	36,427	5.8	4,683.62	5.4	97.3	1.6
9月末	34,834	1.2	4,488.86	1.0	97.3	1.6
10月末	35,244	2.3	4,564.72	2.7	97.4	1.6
(期末)2022年11月10日	34,804	1.1	4,497.56	1.2	97.3	1.6

(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：34,436円 期末：34,804円 騰落率：1.1%

【基準価額の主な変動要因】

公募増資による需給悪化懸念の高まりや米国金利の上昇によって下落する場面はあったものの、当作成期を通じてみれば、Ｊリート市況が上昇したことにより、基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆ 投資環境について

○ Ｊリート市況

Ｊリート市況は、当作成期首より2022年6月上旬までは、米国でインフレ懸念が後退し、長期金利が低下する中で上昇しましたが、6月中旬に米国でインフレ関連指標の上振れから金融引き締め加速が意識され、株式市場が大きく下落する中、Ｊリート市場も下落しました。6月下旬から8月上旬にかけては、米国でインフレ懸念が後退し、利上げペース鈍化期待から長期金利が低下すると、Ｊリート市場は上昇しました。8月中旬から9月中旬までは、米国の長期金利が上昇し、今後も海外金融政策の引き締めが続くことが意識される中、横ばい圏と底堅い推移でした。9月下旬から10月中旬までは、欧米を中心とした金融引き締めによる世界的な景気後退リス

クが投資家に強く意識され、米国の長期金利が上昇する中、株式市場と同様にＪリート市場も下落しました。また、10月にはＪリート市場で公募増資の発表が相次ぎ、需給悪化も下落の要因になりました。10月下旬に米国の長期金利が低下すると、Ｊリート市場は割安感が意識され大きく反発しましたが、11月に入り米国の長期金利が上昇すると下落に転じるなど、変動の大きな推移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」

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

◆ ポートフォリオについて

リーートの組入比率につきましては、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本としており、おおむね95～98%台程度で推移させました。また、東証REIT指数先物への投資も行い、先物と合計で95～100%程度で推移させました。リーート銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資しました。個別銘柄では、当作成期を通じて見ると、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト、ＧＬＰ、ラサールロジポートなどを東証REIT指数と比較してオーバーウエートとし、大和証券リビング、ジャパンリアルエステイト、星野リゾート・リートなどをアンダーウエートとしました。

◆ ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
当ファンドは、参考指数として東証REIT指数（配当込み）を用いています。当作成期における参考指数の騰落率は1.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は1.1%となりました。
投資口価格のパフォーマンスが参考指数を下回った産業ファンドをアンダーウエートとしたことや、参考指数を上回ったインヴィンシブルやジャパンエクセレントをオーバーウエートとしたことがプラスに寄与しました。他方、投資口価格のパフォーマンスが参考指数を下回ったＧＬＰをオーバーウエートとしていたことや、投資口価格のパフォーマンスが参考指数を上回った東急リアル・エステートやジャパン・ホテル・リートをアンダーウエートとしたことなどが、マイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (先物・オプション) (投資信託証券)	24円 (0) (24)
有価証券取引税	－
その他費用	－
合 計	24

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

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2022年 5月11日から2022年11月10日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内	255.859	45,471,948	229.215 (－)	36,891,949 (－)

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2022年 5月11日から2022年11月10日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	百万円	百万円	百万円	百万円
不動産投信指数先物取引	4,908	5,143	－	－

(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

(2022年 5月11日から2022年11月10日まで)

当				期			
買		付		売		付	
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
G L P 投資法人	24.662	4,056,147	164,469	ジャパン・ホテル・リート投資法人	35.329	2,389,449	67,634
日本プロロジスリート	8.47	2,814,535	332,294	産業ファンド	12.059	2,219,443	184,048
大和ハウスリート投資法人	8.054	2,462,501	305,748	日本ロジスティクスファンド投資法人	6.202	1,960,465	316,102
日本プライムリアルティ	6.153	2,453,175	398,695	ジャパンエクセレント投資法人	13.78	1,829,975	132,799
三井不ロジパーク	4.612	2,375,086	514,979	野村不動産マスターＦ	10.493	1,722,458	164,153
ケネディクス・オフィス投資法人	3.258	2,089,265	641,272	大和ハウスリート投資法人	5.111	1,606,116	314,247
日本ビルファンド	2.959	1,979,545	668,991	ケネディクス・オフィス投資法人	2.122	1,356,263	639,143
インヴィンシブル投資法人	47.664	1,945,905	40,825	ユナイテッド・アーバン投資法人	8.731	1,295,647	148,396
産業ファンド	11.229	1,829,206	162,900	ジャパンリアルエステイト	1.949	1,222,420	627,203
ラサールロジポート投資	10.131	1,705,615	168,356	オリックス不動産投資	6.066	1,142,738	188,384

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
 (1) 国内投資信託証券

銘 柄	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
エスコンジャパンリート	3.766	2.162	249,278
サンケイリアルエステート	10.318	11.831	1,093,184
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投	－	5.625	784,125
日本アコモデーションファンド投資法人	3.827	4.044	2,511,324
森ヒルズリート	20.995	14.577	2,327,946
産業ファンド	18.048	17.218	2,689,451
アドバンス・レジデンス	12.226	13.291	4,479,067
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	24.354	25.211	5,296,831
ＡＰＩ投資法人	7.882	6.779	2,938,696
ＧＬＰ投資法人	43.079	64.037	9,720,816
コンフォリア・レジデンシャル	7.659	7.081	2,202,191
日本プロロジスリート	19.012	27.072	8,500,608
Ｏｎｅリート投資法人	－	4.951	1,222,401
イオンリート投資	18.866	22.713	3,659,064
ヒューリックリート投資法	17.597	15.035	2,580,006
日本リート投資法人	6.375	6.404	2,305,440
積水ハウス・リート投資	48.247	39.609	3,168,720
ケネディクス商業リート	6.644	11.458	3,069,598
ヘルスケア&メディカル投資	1.57	－	－
野村不動産マスターＦ	43.34	42.122	7,097,557
ラサールロジポート投資	24.49	32.901	5,362,863
スターアジア不動産投	－	5.092	283,624
三井不ロジパーク	4.594	8.309	4,100,491
三菱地所物流ＲＥＩＴ	6.909	8.273	3,706,304
ＣＲＥロジスティクスファンド	1.223	－	－
ザイマックス・リート	1.224	1.186	143,268
タカラレーベン不動産投	－	2.254	226,977
日本ビルファンド	17.085	18.493	11,872,506
ジャパンリアルエステイト	10.04	10.132	6,099,464
日本都市ファンド投資法人	56.608	53.388	5,755,226
オリックス不動産投資	20.877	20.194	3,828,782
日本プライムリアルティ	6.533	10.587	4,134,223
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	0.808	8.322	1,195,039
東急リアル・エステート	4.602	－	－
グローバル・ワン不動産投資法人	9.251	4.601	518,532
ユナイテッド・アーバン投資法人	31.793	28.019	4,326,133
森トラスト総合リート	1.165	2.595	380,946
インヴィンシブル投資法人	57.863	82.89	3,763,206
フロンティア不動産投資	4.696	3.784	1,956,328
平和不動産リート	3.484	－	－
日本ロジスティクスファンド投資法人	7.248	2.36	757,560
福岡リート投資法人	5.746	0.44	74,756

銘 柄	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
ケネディクス・オフィス投資法人	4.952	12.109	4,068,624
いちごオフィスリート投資法人	12.727	9.017	772,756
大和証券オフィス投資法人	2.53	2.53	1,702,690
阪急阪神リート投資法人	3.173	5.432	828,380
大和ハウスリート投資法人	19.263	22.206	6,717,315
ジャパン・ホテル・リート投資法人	37.973	11.95	889,080
ジャパンエクセレント投資法人	20.727	9.749	1,324,889
合 計	□ 数、金 額	691.389	718.033
	銘 柄 数<比率>	45銘柄	45銘柄
			<97.3%>

(注1) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
 (注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内 東証ＲＥＩＴ	百万円 2,328	百万円 －

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年11月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託証券	140,686,276	96.6
コール・ローン等、その他	4,926,166	3.4
投資信託財産総額	145,612,442	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11月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	146,760,042,760円
コール・ローン等	2,446,143,083
投資信託証券(評価額)	140,686,276,400
未収入金	1,019,649,027
未収配当金	1,377,214,250
差入委託証拠金	1,230,760,000
(B) 負債	2,123,694,834
未払金	966,756,834
未払解約金	9,338,000
差入委託証拠金代用有価証券	1,147,600,000
(C) 純資産総額(A－B)	144,636,347,926
元本	41,557,096,335
次期繰越損益金	103,079,251,591
(D) 受益権総口数	41,557,096,335口
1万口当り基準価額(C／D)	34,804円

* 期首における元本額は39,918,696,415円、当作成期間中における追加設定元本額は2,240,368,194円、同解約元本額は601,968,274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ファンド(ＦＯＦｓ用) (適格機関投資家専用)	38,686,979,949円
安定重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	9,693,026円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	8,333,819円
成長重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	41,127,418円
6資産バランスファンド (分配型)	76,983,197円
6資産バランスファンド (成長型)	214,916,634円
世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	21,416,625円
ダイワ資産分散インカムオープン (奇数月決算型)	24,472,294円
ＤＣダイワ・ワールドアセット (六つの羽／安定コース)	344,438,177円
ＤＣダイワ・ワールドアセット (六つの羽／6分散コース)	447,825,965円
ＤＣダイワ・ワールドアセット (六つの羽／成長コース)	683,355,898円
ＤＣダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブファンド	252,387,244円
ライフハーモニー (ダイワ世界資産分散ファンド) (成長型)	53,281,917円
ライフハーモニー (ダイワ世界資産分散ファンド) (安定型)	18,604,861円
ライフハーモニー (ダイワ世界資産分散ファンド) (分配型)	91,575,837円
ダイワ・アクティブＪリート・ファンド (年4回決算型)	581,703,474円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は34,804円です。

■損益の状況

当期 自2022年5月11日 至2022年11月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,612,483,918円
受取配当金	2,612,910,128
受取利息	294
その他収益金	1
支払利息	△ 426,505
(B) 有価証券売買損益	△ 1,243,796,665
売買益	3,396,957,881
売買損	△ 4,640,754,546
(C) 先物取引等損益	31,371,390
取引益	117,063,390
取引損	△ 85,692,000
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	1,400,058,643
(E) 前期繰越損益金	97,546,451,868
(F) 解約差損益金	△ 1,483,141,726
(G) 追加信託差損益金	5,615,882,806
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	103,079,251,591
次期繰越損益金(H)	103,079,251,591

(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ＲＥＩＴ指数の指数値および同指数にかかる標準または商標は、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準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。

ダイワ北米好配当株マザーファンド

運用報告書 第34期（決算日 2022年10月17日）

（作成対象期間 2022年4月16日～2022年10月17日）

ダイワ北米好配当株マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

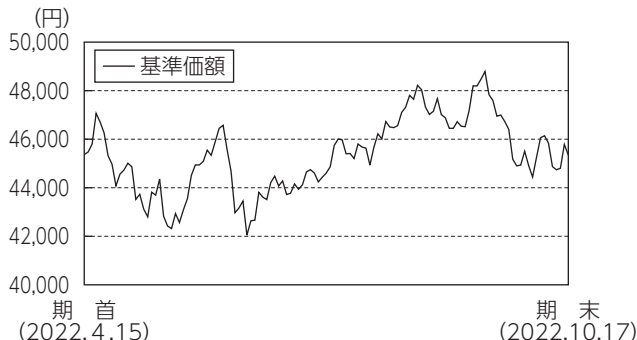
運 用 方 針	北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券
株 式 組 入 制 限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準価額		MSCIノースアメリカ指数 (配当込み、円換算)		株式組入率		ハイブリッド優先証券組入率		投資信託証券組入率	
	円	騰落率	(参考指数)	騰落率	%	%	%	%	%	%
(期首)2022年4月15日	45,366	-	55,635	-	74.9	16.7	0.5			
4月末	44,559	△1.8	53,868	△3.2	74.2	19.4	0.5			
5月末	44,940	△0.9	53,276	△4.2	72.1	18.6	0.5			
6月末	44,280	△2.4	52,173	△6.2	73.1	17.0	0.5			
7月末	45,679	0.7	54,742	△1.6	73.9	17.6	0.1			
8月末	46,450	2.4	55,372	△0.5	73.6	20.6	-			
9月末	44,915	△1.0	52,844	△5.0	72.0	20.1	0.4			
(期末)2022年10月17日	45,346	△0.0	53,333	△4.1	71.7	19.1	0.6			

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) MSCIノースアメリカ指数 (配当込み、円換算) は、MSCI Inc. (「MSCI」) の承諾を得て、MSCIノースアメリカ指数 (配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIノースアメリカ指数 (配当込み、米ドルベース) は、MSCI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。

《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：45,366円 期末：45,346円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

当作成期は、米ドルが対円で上昇 (円安) したことはプラス要因となりましたが、北米株式市況や米国ハイブリッド優先証券市況が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。

◆ 投資環境について

○ 北米株式市況

北米株式市況は下落しました。

北米株式市況は、当作成期首から2022年6月半ばにかけて、インフレ率の予想以上の上昇を受けてF R B (米国連邦準備制度理事会) が利上げを加速するとの思惑が強まったことなどから、一時的な反発はあったものの下落しました。6月半ばにF R Bが利上げ幅拡大を決定した後は、悪材料出尽くし観測から上昇に転じ、またインフレ率がピークアウトするとの期待感より、8月中旬にかけて上昇が続きました。その後は、F R B議長が景気を犠牲にすることでインフレを抑制する姿勢を強調したことや、予想以上のインフレ率の上昇で欧米の金利が上昇したことなどが嫌気され、当作成期末にかけて株価は下落しました。

○ 米国ハイブリッド優先証券市況

米国ハイブリッド優先証券市況は下落しました。

米国ハイブリッド優先証券市況は、当作成期首から2022年6月末にかけて、インフレ率の高止まりから、F R B (米国連邦準備制度理事会) がタカ派的な姿勢を強め金利が上昇したことや、景気後退が意識されたことによるクレジットスプレッドの拡大により下落しました。7月は、C P I (消費者物価指数) は市場予想を上振れたものの、その後に発表された経済指標の中に予想を下振れたものが多く見られたことを背景に金利が低下したことがプラスとなりました。その後は、引き続きインフレ率の高止まりを背景に金利が上昇していることや、景気後退懸念の高まりを受けて、当作成期末にかけて大きく下落しました。

○ 為替相場

米ドル為替相場は対円で上昇しました。

米ドル対円為替相場は、米国金利が上昇したことなどから、当作成期首より上昇しました。その後は、米国景気への懸念などからリスク回避姿勢が強まり米ドルは下落しましたが、2022年6月には米国で大幅な利上げが行われたことなどから、米ドルは再度上昇しました。7月後半には、米国金利が低下に転じると日米金利差の縮小が意識され、円が買い戻されたことで円高米ドル安となりました。8月は、米国金利の上昇により日米金利差が再度拡大したことなどから、円安米ドル高が進行しました。9月に入ると、F R B (米国連邦準備制度理事会) が大幅な金融引き締めを決定したのに対し、日銀は金融緩和政策の維持を決定したことで急速に円安米ドル高が進行しました。これを受け、日本政府・日銀は円買い介入を実施したものの影響は限定的なものととどまり、円安米ドル高基調のまま当作成期末を迎えました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

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

※ C & S：コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	11円
(株式)	(4)
(ハイブリッド優先証券)	(7)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	0
(株式)	(0)
(ハイブリッド優先証券)	(0)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	7
(保管費用)	(7)
(その他)	(0)
合 計	18

(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

(2022年4月16日から2022年10月17日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 711.29 (86.72)	千アメリカ・ドル 5,929 (△ 1)	百株 587.52	千アメリカ・ドル 4,655
	カナダ	百株 5.2 (ー)	千カナダ・ドル 27 (ー)	百株 74.38	千カナダ・ドル 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) ハイブリッド優先証券

(2022年4月16日から2022年10月17日まで)

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	アメリカ	千証券 195.951 (△ 9.598)	千アメリカ・ドル 4,727 (△ 241)	千証券 160.979 (ー)	千アメリカ・ドル 3,778 (ー)

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 投資信託証券

(2022年4月16日から2022年10月17日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 13.014 (△ 2.697)	千アメリカ・ドル 285 (△ 68)	千口 8.828 (ー)	千アメリカ・ドル 205 (ー)

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2022年4月16日から2022年10月17日まで)

当				期			
買		付		売		付	
銘柄	柄	株 数	金 額 平均単価	銘柄	柄	株 数	金 額 平均単価
		千株	千円 円			千株	千円 円
UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)		0.865	57,129 66,045	ESSENTIAL UTILITIES INC (アメリカ)		10.358	65,496 6,323
INTL BUSINESS MACHINES CORP (アメリカ)		2.633	50,247 19,083	MICRON TECHNOLOGY INC (アメリカ)		7.821	57,986 7,414
CARDINAL HEALTH INC (アメリカ)		6.172	43,313 7,017	DOW INC (アメリカ)		7.029	48,726 6,932
BARRICK GOLD CORP (カナダ)		15.819	42,292 2,673	TE CONNECTIVITY LTD (スイス)		2.208	41,575 18,829
NORFOLK SOUTHERN CORP (アメリカ)		1.159	39,117 33,751	PEPSICO INC (アメリカ)		1.687	39,130 23,195
COSTCO WHOLESALE CORP (アメリカ)		0.553	38,109 68,914	NORTHROP GRUMMAN CORP (アメリカ)		0.581	36,646 63,075
ONEOK INC (アメリカ)		3.841	35,367 9,207	DUKE ENERGY CORP (アメリカ)		2.295	34,996 15,248
CHEVRON CORP (アメリカ)		1.481	35,209 23,774	SUNCOR ENERGY INC (カナダ)		7.438	34,699 4,665
EVERGY INC (アメリカ)		3.649	34,347 9,412	ALBEMARLE CORP (アメリカ)		1.002	27,246 27,192
DUKE ENERGY CORP (アメリカ)		2.295	34,180 14,893	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A (アメリカ)		0.532	26,844 50,459

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

(2022年4月16日から2022年10月17日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘柄	柄	証券数	金額	平均単価	銘柄	柄	証券数	金額	平均単価
		千証券	千円	円			千証券	千円	円
WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R (アメリカ)		12.934	43,991	3,401	REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B (アメリカ)		8.213	28,273	3,442
MORGAN STANLEY DEP REPTG SH NON 6.5 (アメリカ)		10.325	37,494	3,631	BANK OF AMERICA CORP 5.875 HH (アメリカ)		7.582	26,273	3,465
REINSURANCE GRP OF AMER 6.2 (アメリカ)		9.598	32,377	3,373	SYNCHRONY FINANCIAL 5.625 A (アメリカ)		9.13	24,466	2,679
CHARLES SCHWAB CORP 5.95 D (アメリカ)		9.289	30,420	3,274	MORGAN STANLEY 6.375 I (アメリカ)		6.99	24,003	3,434
JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ (アメリカ)		10.946	30,238	2,762	CHARLES SCHWAB CORP 5.95 D (アメリカ)		6.876	23,509	3,419
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B (アメリカ)		8.559	29,147	3,405	WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R (アメリカ)		6.391	22,728	3,556
WTFNL FR (アメリカ)		6.744	23,050	3,417	FIFTH THIRD BANCORP 6 A (アメリカ)		6.558	21,239	3,238
AT&T INC 5.625 (アメリカ)		6.582	22,729	3,453	HUNTINGTON BANCSHARES 5.7 C (アメリカ)		6.794	20,191	2,971
WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z (アメリカ)		7.122	21,514	3,020	FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I (アメリカ)		5.399	19,916	3,688
WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA (アメリカ)		7.223	21,490	2,975	SOUTHERN CO 4.95 2020 (アメリカ)		7.271	19,325	2,657

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
(1) 外国株式

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ABBOTT LABORATORIES	10.34	10.61	107	15,911	ヘルスケア
ADOBE INC	16.08	16.51	475	70,647	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	22.57	23.17	227	33,758	素材
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8.5	8.89	206	30,720	素材
ALBEMARLE CORP	10.02	—	—	—	素材
ATMOS ENERGY CORP	12.98	—	—	—	公益事業
CITIGROUP INC	65.7	33.18	143	21,316	金融
DANAHER CORP	9.29	9.54	242	35,969	ヘルスケア
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	34.34	35.25	317	47,225	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45.96	28.19	235	34,930	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	21.51	—	—	—	情報技術
APPLE INC	107.18	110.02	1,522	226,252	情報技術
BOEING CO/THE	12.63	12.96	172	25,644	貴金属・サービス
NISOURCE INC	49.68	59.84	146	21,778	公益事業
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	—	15.13	58	8,636	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	121.53	131.29	477	70,981	コミュニケーション・サービス
JPMORGAN CHASE & CO	44.71	45.9	510	75,844	金融
CATERPILLAR INC	13.78	7.81	139	20,681	貴金属・サービス
ESSENTIAL UTILITIES INC	83.85	—	—	—	公益事業
MORGAN STANLEY	34.61	35.53	267	39,759	金融
BROADCOM INC	15.01	15.41	658	97,809	情報技術
DEERE & CO	12.87	13.21	471	70,111	貴金属・サービス
TELEFLEX INC	5.28	5.42	106	15,760	ヘルスケア
COLGATE-PALMOLIVE CO	17.22	22.01	156	23,331	生活必需品
COSTCO WHOLESALE CORP	—	5.53	251	37,363	生活必需品
LABORATORY CORP OF AMER HLDGS	11.14	13.4	279	41,552	ヘルスケア
AMAZON.COM INC	2.59	62.83	671	99,814	一般消費・サービス
EOG RESOURCES INC	18.5	18.99	228	34,026	エネルギー
FORD MOTOR CO	100.11	102.76	119	17,821	一般消費・サービス
NEXTERA ENERGY INC	26.93	28.71	206	30,621	公益事業
GENERAL ELECTRIC CO	13.25	—	—	—	貴金属・サービス
GENERAL MOTORS CO	38.78	39.82	130	19,463	一般消費・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	11.34	11.64	349	51,892	金融
ALPHABET INC-CL A	1.31	26.8	258	38,457	コミュニケーション・サービス
HOME DEPOT INC	8.17	8.39	231	34,466	一般消費財・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	—	26.33	316	46,970	情報技術
JOHNSON & JOHNSON	29.77	30.56	502	74,689	ヘルスケア
MCDONALD'S CORP	13.55	13.91	338	50,265	一般消費財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	35.96	36.91	467	69,530	コミュニケーション・サービス
PHILLIPS 66	30.49	31.3	294	43,770	エネルギー
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22.01	22.59	481	71,600	情報技術
MERCK & CO. INC.	20.92	21.48	198	29,425	ヘルスケア
NIKE INC -CL B	11.97	29.36	257	38,199	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	—	11.59	247	36,771	貴金属・サービス
NORTHROP GRUMMAN CORP	7.9	4.95	229	34,146	貴金属・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	31.46	26.3	224	33,323	生活必需品
EVERGY INC	—	36.49	205	30,513	公益事業
PFIZER INC	35.23	22.15	94	14,108	ヘルスケア
DOW INC	91.63	23.77	107	15,938	素材
PROCTER & GAMBLE CO/THE	24.25	28.29	353	52,585	生活必需品

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
PEPSICO INC	30.21	14.14	240	35,762	生活必需品
CHEVRON CORP	—	14.81	237	35,245	エネルギー
TESLA INC	3.02	16.08	329	48,985	一般消費・サービス
AT&T INC	—	79.58	119	17,727	コミュニケーション・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	22.75	17.88	289	42,960	資本財・サービス
UNITEDHEALTH GROUP INC	—	8.65	443	65,961	ヘルスケア
ELEVANCE HEALTH INC	4.21	7.84	369	54,849	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	18.01	18.49	174	25,952	コミュニケーション・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	18.16	18.64	288	42,861	資本財・サービス
WALMART INC	8.52	14.03	182	27,194	生活必需品
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5.32	—	—	—	情報技術
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13.67	14.03	283	42,123	金融
VISA INC-CLASS A SHARES	13.89	14.26	260	38,700	情報技術
TECK RESOURCES SUBORDINATE VOTING	50.07	—	—	—	素材
NVIDIA CORP	18.5	15.53	174	25,910	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	6.53	6.7	100	14,905	金融
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4.55	4.67	234	34,912	ヘルスケア
MASTERCARD INC - A	7.99	8.2	236	35,179	情報技術
ONEOK INC	—	38.41	207	30,863	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	136.49	140.12	444	66,009	金融
EATON CORP PLC	25.09	20.66	277	41,236	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	—	158.19	223	33,288	素材
ECOLAB INC	10.24	—	—	—	素材
CARDINAL HEALTH INC	—	61.72	420	62,444	ヘルスケア
INTEL CORP	30.89	31.72	82	12,213	情報技術
TARGET CORP	—	15.61	227	33,797	一般消費・サービス
MICROSOFT CORP	60.14	61.73	1,410	209,673	情報技術
MEDTRONIC PLC	31.78	32.62	266	39,561	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	121.33	46.34	244	36,306	情報技術
CHUBB LTD	—	8.25	155	23,143	金融
COMCAST CORP-CLASS A	42.2	43.33	130	19,350	コミュニケーション・サービス
アメリカ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,046.46 68銘柄	2,256.95 73銘柄	21,744 <70.3%>	
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円
SUNCOR ENERGY INC		158.69	88.53	381	40,873
ENBRIDGE INC		36.43	37.41	186	20,040
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	195.12 2銘柄	125.94 2銘柄	567 <1.3%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,241.58 70銘柄	2,382.89 75銘柄	— <71.7%>	2,392,426

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

銘柄	期首	当	期末	
	証券数	証券数	評価額	評価額
			外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千証券	千証券	千アメリカ・ドル	千円
CHS INC 7.5 4	4.575	5.317	135	20,141
CHARLES SCHWAB CORP 5.95 D	—	2.413	56	8,333
REINSURANCE GRP OF AMER 5.75	3.729	0.608	14	2,176
MORGAN STANLEY 5.85 K	0.633	1.933	45	6,767
AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	6.877	6.877	140	20,807
NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A	—	0.256	5	869
VALLEY NATIONAL BANCORP 5.5 B	2.076	2.297	53	8,008
SOUTHERN CO 5.25	1.961	—	—	—
ENBRIDGE INC 6.375 B	0.497	1.438	34	5,120
BANK OF AMERICA CORP 6 GG	3.97	3.24	77	11,507
BANK OF AMERICA CORP 5.875 HH	6.442	2.603	59	8,897
AT&T INC 5.625	—	6.582	152	22,614
KEYCORP 5.65 F	5.283	—	—	—
JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	3.902	3.116	74	10,997
ASSOC BANC-CORP 5.875 E	3.957	—	—	—
NISOURCE INC 6.5 B	2.81	2.81	67	10,009
JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	4.481	3.131	76	11,409
CITIZENS FINANCIAL GROUP 6.35 D	6.495	9.556	227	33,841
CMS ENERGY CORP 5.875	9.584	12.484	278	41,418
NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.65 N	0.341	—	—	—
AMERICAN FINANCIAL GROUP 5.875	2.035	—	—	—
DUKE ENERGY CORP 5.75 A	4.521	—	—	—
REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	1.367	—	—	—
ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.2 19A	4.451	8.164	181	26,970
ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	1.1	1.1	25	3,808
BANK OF AMERICA CORP 5.375 KK	4.681	2.18	46	6,877
SYNOVUS FINANCIAL CORP 5.875 E	4.851	4.519	102	15,177
SEMPRA ENERGY 5.75	6.407	6.407	144	21,489
FIFTH THIRD BANCORP 6 A	6.558	—	—	—
SYNCHRONY FINANCIAL 5.625 A	9.13	—	—	—
FIRST REPUBLIC BANK 4.7 J	—	1.622	29	4,449
SOUTHERN CO 4.95 2020	8.035	0.764	14	2,211
WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	2.488	9.61	173	25,735
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 4.8 J	2.492	—	—	—
FIRST HORIZON CORP 6.5	6.354	10.027	242	35,986
ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	7.728	8.532	208	31,039
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	—	3.876	75	11,151
UNITED STATES CELLULAR C 6.25	2.003	1.403	26	3,936
BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	3.167	3.167	51	7,699
WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA	2.494	9.717	173	25,732
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC 5.375 C	6.161	—	—	—
US CELLULAR CORP 5.5	1.667	—	—	—
WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC	—	2.575	43	6,393
FIRST REPUBLIC BANK 4.25 L	—	4.425	74	11,014
WASHINGTON FEDERAL INC 4.875 A	1.682	4.812	88	13,208
SIGNATURE BANK NEW YORK 5 a	4.9	—	—	—
FIRST HORIZON CORP 6.1 D	10.983	10.983	252	37,540
TELEPHONE & DATA SYS 6.625 UU	4.979	—	—	—
TEXAS CAPITAL BANCSHARES 5.75 B	5.524	—	—	—
JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ	1.654	12.6	233	34,734

銘柄	期首	当	期末	
	証券数	証券数	評価額	評価額
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千証券	千証券	千アメリカ・ドル	千円
FIRST HORIZON CORP 4.7 F	2.017	—	—	—
REGIONS FINANCIAL CORP 4.45 E	1.326	—	—	—
JPMORGAN CHASE & CO 4.625 LL	1.636	5.664	106	15,782
HUNTINGTON BANCSHARES 5.7 C	6.794	—	—	—
KEMPER CORP FR	4.2	6.36	121	18,043
WESCO INTERNATIONAL INC FR	2.302	5.224	138	20,611
WTFNL FR	—	6.744	166	24,805
PACWL FR	—	4.423	110	16,383
MORGAN STANLEY DEP REPGTG SH NON 6.5	—	8.944	220	32,830
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 5.95	—	1.269	30	4,495
KEY FR	—	1.258	30	4,522
ARCH CAPITAL GROUP LTD. 4.55	—	2.628	47	7,037
GOLDMAN SACHS GROUP INC 5.5 J	6.138	11.823	292	43,398
FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I	5.396	1.884	46	6,926
MORGAN STANLEY 6.875 F	1.589	1.589	39	5,924
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B	3.444	3.79	93	13,849
WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R	—	6.543	164	24,415
PNC FINANCIAL SERVICES FR P	6.731	12.342	313	46,550
GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K	—	6.563	165	24,529
MORGAN STANLEY 6.375 I	6.701	2.403	58	8,652
WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	5.18	3.258	73	10,971
合 計	証券数、金額 銘柄数<比率>	238,479 56銘柄	263,853 53銘柄	5,906 <19.1%>

(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。

(3) 外国投資信託証券

銘柄	期首	当	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
UMH PROPERTIES INC 6.75 C	2.697	—	—	—
DIGITALBRIDGE GROUP INC 7.125 J	—	4.98	104	15,541
SPIRIT REALTY CAPITAL IN 6 A	2.697	—	—	—
PUBLIC STORAGE 4.625 L	—	3.915	73	10,996
HUDSON PACIFIC PROPERTIES 4.75	2.012	—	—	—
合 計	口数、金額 銘柄数<比率>	7,406 3銘柄	8,895 2銘柄	178 <0.6%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年10月17日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	3,292,426	71.7
公社債	877,811	19.1
投資信託証券	26,537	0.6
コール・ローン等、その他	397,255	8.6
投資信託財産総額	4,594,030	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、10月17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝148.61円、1カナダ・ドル＝107.27円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（4,556,916千円）の投資信託財産総額（4,594,030千円）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

2022年10月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,594,030,514円
コール・ローン等	380,609,305
株式(評価額)	3,292,426,056
公社債(評価額)	877,811,198
投資信託証券(評価額)	26,537,808
未収入金	7,883,142
未収配当金	4,616,162
未収利息	4,146,843
(B) 負債	22,000
未払解約金	22,000
(C) 純資産総額(A－B)	4,594,008,514
元本	1,013,110,994
次期繰越損益金	3,580,897,520
(D) 受益権総口数	1,013,110,994口
1万口当り基準価額(C／D)	45,346円

*期首における元本額は974,146,634円、当作成期間中における追加設定元本額は63,187,858円、同解約元本額は24,223,498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：
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型） 4,873,667円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型） 4,133,835円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型） 74,699,368円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド 11,940,882円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型） 12,450,060円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース） 135,534,291円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース） 265,098,558円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース） 504,380,333円
*当期末の計算口数当りの純資産額は45,346円です。

■損益の状況

当期 自2022年4月16日 至2022年10月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	62,234,759円
受取配当金	34,186,101
受取利息	28,054,812
支払利息	△ 6,154
(B) 有価証券売買損益	△ 59,437,910
売買益	818,656,614
売買損	△ 878,094,524
(C) その他費用	△ 698,951
(D) 当期損益金(A + B + C)	2,097,898
(E) 前期繰越損益金	3,445,185,982
(F) 解約差損益金	△ 86,794,502
(G) 追加信託差損益金	220,408,142
(H) 合計(D + E + F + G)	3,580,897,520
次期繰越損益金(H)	3,580,897,520

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

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

運用報告書 第34期（決算日 2022年10月17日）

（作成対象期間 2022年4月16日～2022年10月17日）

ダイワ欧州好配当株マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

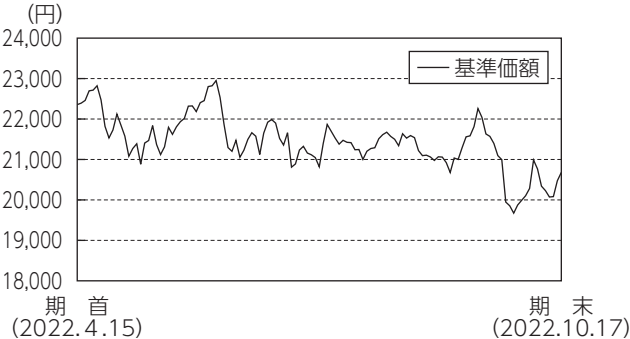
運 用 方 針	欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
株 式 組 入 制 限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		MSCIヨーロッパ指数 (配当込み、円換算) (参考指数)		株 式 組入比率	株 式 先物比率
	円	%	円	%	%	%
(期首)2022年 4月15日	22,356	—	26,228	—	93.9	—
4 月末	21,729	△ 2.8	25,301	△ 3.5	94.4	—
5 月末	22,318	△ 0.2	26,062	△ 0.6	93.1	—
6 月末	21,899	△ 2.0	25,116	△ 4.2	91.5	—
7 月末	21,240	△ 5.0	25,300	△ 3.5	89.6	—
8 月末	21,059	△ 5.8	24,965	△ 4.8	92.9	—
9 月末	19,990	△10.6	23,394	△10.8	92.5	—
(期末)2022年10月17日	20,680	△ 7.5	24,300	△ 7.4	92.5	—

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) MSCIヨーロッパ指数 (配当込み、円換算) は、MSCI Inc. (「MSCI」) の承諾を得て、MSCIヨーロッパ指数 (配当込み、ユーロベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIヨーロッパ指数 (配当込み、ユーロベース) は、MSCI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) 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：22,356円 期末：20,680円 騰落率：△7.5%

【基準価額の主な変動要因】

ユーロは対円で上昇 (円安) する展開となりましたが、欧州株式市場の下落率が大きかったため、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。

◆投資環境について

○欧州株式市況

欧州株式市場は下落しました。

欧州株式市場は、当作成期首から2022年6月中旬にかけて、ウクライナ情勢の長期化による欧州圏経済の減速懸念や、中国のロックダウン (都市封鎖) が世界的な供給網の混乱をもたらすとの懸念、またECB (欧州中央銀行) が量的緩和を終了して利上げをするとの方針を表明したことなどを受け、下落基調で推移しました。その後、米国市場での株価上昇が好感され値を戻す局面もありましたが、8月下旬から当作成期末にかけては、ECBが大規模利上げを決定したほか、FRB (米連邦準備制度理事会) もインフレ抑制を最優先に利上げを続ける方針を明確に示したことにより、世界的な景気悪化懸念が強まり、下げ幅を広げました。

○為替相場

ユーロは対円で上昇しました。

ユーロ円為替相場は、当作成期首から2022年6月中旬にかけては、ECB (欧州中央銀行) が量的緩和を終了して利上げをするとの方針を表明したことなどを受け、上昇基調で推移しました。その後、利上げによる欧州圏の景気減速が意識され、弱含む局面もありましたが、8月から当作成期末にかけては、欧州と日本の金融政策の方向性の違いによる金利差拡大が意識されたことなどから、再び上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

※アムンディ・アイルランド：アムンディ・アイルランド・リミテッド

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	0円 (0)
有価証券取引税 (株式)	2 (2)
その他費用 (保管費用) (その他)	6 (5) (1)
合 計	8

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

■ 売買および取引の状況
株 式

(2022年 4月16日から2022年10月17日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	イギリス	百株 225.87 (29.59)	千イギリス・ポンド 104 (△ 41)	百株 —	千イギリス・ポンド —
	スイス	百株 6.74 (—)	千スイス・フラン 113 (—)	百株 —	千スイス・フラン —
	スウェーデン	百株 1.37 (—)	千スウェーデン・クローネ 19 (—)	百株 —	千スウェーデン・クローネ —
	ユーロ (オランダ)	百株 57.17 (—)	千ユーロ 48 (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (フランス)	百株 21.65 (66.34)	千ユーロ 113 (—)	百株 1.69	千ユーロ 2
	ユーロ (ドイツ)	百株 21.32 (—)	千ユーロ 95 (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (スペイン)	百株 4.7 (—)	千ユーロ 9 (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (イタリア)	百株 88.88 (—)	千ユーロ 30 (—)	百株 —	千ユーロ —
国	ユーロ (ユーロ 通貨計)	百株 193.72 (66.34)	千ユーロ 296 (—)	百株 1.69	千ユーロ 2

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

■ 主要な売買銘柄
株 式

(2022年 4月16日から2022年10月17日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘	柄	株 数	金 額	平均単価	銘	柄	株 数	金 額	平均単価
NESTLE SA-REG (スイス)		千株 0.307	千円 5,159	円 16,804	EUROAPI (フランス)		千株 0.169	千円 351	円 2,080
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN (スイス)		0.072	3,298	45,807					
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG (ドイツ)		1.163	2,959	2,545					
SANOFI (フランス)		0.214	2,938	13,732					
ZURICH INSURANCE GROUP AG (スイス)		0.05	2,922	58,446					
NOVARTIS AG-REG (スイス)		0.241	2,861	11,873					
SCHNEIDER ELECTRIC SE (フランス)		0.149	2,790	18,725					
CAPGEMINI SE (フランス)		0.096	2,438	25,402					
TOTALENERGIES SE (フランス)		0.346	2,357	6,814					
SIEMENS AG-REG (ドイツ)		0.154	2,292	14,886					

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

■組入資産明細表
外国株式

銘柄	株数	期首	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千円			
SHELL PLC	117.61	124.08	281	46,981		エネルギー
HALEON PLC	—	167.74	45	7,660		生活必需品
UNILEVER PLC	44.89	47.36	183	30,666		生活必需品
PRUDENTIAL PLC	148.44	156.6	136	22,782		金融
AVIVA PLC	406.69	326.08	128	21,446		金融
GSK	159	134.19	181	30,221		ヘルスケア
M&G PLC	687.65	725.46	123	20,613		金融
TESCO PLC	884.45	933.08	188	31,454		生活必需品
VODAFONE GROUP PLC	1,016.57	1,072.47	106	17,815		コミュニケーション・サービス
NATIONAL GRID PLC	178.73	188.56	164	27,400		公益事業
HSBC HOLDINGS PLC	434.04	457.91	210	35,042		金融
イギリス・ボンド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,078.07 10銘柄	4,333.53 11銘柄	1,751 <19.8%>		
(スイス)	百株	百株	千円			
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	13.13	13.85	452	66,946		ヘルスケア
NESTLE SA-REG	55.78	58.85	621	92,083		生活必需品
ZURICH INSURANCE GROUP AG	9.03	9.53	379	56,211		金融
NOVARTIS AG-REG	43.89	46.3	351	52,103		ヘルスケア
GIVAUDAN-REG	0.77	0.81	230	34,090		素材
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	122.6 5銘柄	129.34 5銘柄	2,035 <20.5%>		
(スウェーデン)	百株	百株	千円			
ELECTROLUX AB-SER B	24.86	26.23	322	4,246		一般消費財・サービス
スウェーデン・クローネ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	24.86 1銘柄	26.23 1銘柄	322 < 0.3%>		
ユーロ(オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
KONINKLIJKE PHILIPS NV	77.85	82.13	110	16,025		ヘルスケア
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	65.06	68.64	188	27,300		生活必需品
KONINKLIJKE DSM NV	17.49	18.45	214	31,028		素材
KONINKLIJKE KPN NV	879.29	927.64	253	36,680		コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,039.69 4銘柄	1,096.86 4銘柄	766 < 7.5%>		
ユーロ(フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TOTALENERGIES SE	62.99	66.45	346	50,223		エネルギー
MICHELIN (CGDE)	21.55	90.94	207	30,054		一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	27.16	28.65	349	50,558		資本財・サービス
BNP PARIBAS	39.9	42.09	185	26,851		金融
CAPGEMINI SE	17.49	18.45	297	43,129		情報技術
AXA SA	121.26	127.93	303	43,936		金融
SANOFI	38.93	41.07	335	48,505		ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	329.28 7銘柄	415.58 7銘柄	2,025 <19.9%>		
ユーロ(ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SIEMENS AG-REG	28	29.54	307	44,550		資本財・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	29.96	31.61	237	34,335		一般消費財・サービス
BASF SE	36.76	38.78	167	24,323		素材
ALLIANZ SE-REG	11.45	12.08	202	29,282		金融

銘 柄	期 首		期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
		百株	百株	千ユーロ	千円	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		10.37	10.94	269	38,950	金融
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		211.45	223.08	397	57,609	コミュニケーション・サービス
DEUTSCHE POST AG-REG		59.59	62.87	209	30,276	資本財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	387.58 7銘柄	408.9 7銘柄	1,791	259,329 <17.6%>	
ユーロ(スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ENAGAS SA		85.45	90.15	134	19,409	公益事業
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	85.45 1銘柄	90.15 1銘柄	134	19,409 < 1.3%>	
ユーロ(イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
INTESA SANPAOLO		1,005.55	1,060.84	181	26,302	金融
ENI SPA		129.35	136.46	160	23,278	エネルギー
ENEL SPA		481.53	508.01	208	30,253	公益事業
国 小 計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,616.43 3銘柄	1,705.31 3銘柄	551	79,834 < 5.4%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,458.43 22銘柄	3,716.8 22銘柄	5,268	762,866 <51.8%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	7,683.96 38銘柄	8,205.9 39銘柄	—	1,360,633 <92.5%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年10月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	1,360,633	92.5
コール・ローン等、その他	111,049	7.5
投資信託財産総額	1,471,683	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、10月17日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝148.61円、1イギリス・ポンド＝166.80円、1スイス・フラン＝148.09円、1デンマーク・クローネ＝19.46円、1ノルウェー・クローネ＝13.94円、1スウェーデン・クローネ＝13.16円、1ユーロ＝144.79円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（1,458,394千円）の投資信託財産総額（1,471,683千円）に対する比率は、99.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年10月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,471,683,529円
コール・ローン等	110,450,494
株式(評価額)	1,360,633,831
未収配当金	599,204
(B) 負債	－
(C) 純資産総額(A－B)	1,471,683,529
元本	711,660,915
次期繰越損益金	760,022,614
(D) 受益権総口数	711,660,915口
1万口当り基準価額(C／D)	20,680円

* 期首における元本額は688,479,602円、当作成期間中における追加設定元本額は45,605,195円、同解約元本額は22,423,882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：
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型） 11,022,004円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型） 9,096,018円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型） 164,560,769円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド 26,626,416円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型） 27,594,355円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース） 70,650,530円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース） 137,781,841円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース） 264,328,982円
* 当期末の計算口数当りの純資産額は20,680円です。

■損益の状況

当期 自2022年4月16日 至2022年10月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	32,828,087円
受取配当金	32,969,321
受取利息	24,740
その他収益金	2,307
支払利息	△ 168,281
(B) 有価証券売買損益	△148,812,552
売買益	103,690,460
売買損	△252,503,012
(C) その他費用	△ 393,211
(D) 当期損益金(A + B + C)	△116,377,676
(E) 前期繰越損益金	850,697,603
(F) 解約差損益金	△ 26,469,118
(G) 追加信託差損益金	52,171,805
(H) 合計(D + E + F + G)	760,022,614
次期繰越損益金(H)	760,022,614

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

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

運用報告書 第34期（決算日 2022年10月17日）

（作成対象期間 2022年4月16日～2022年10月17日）

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

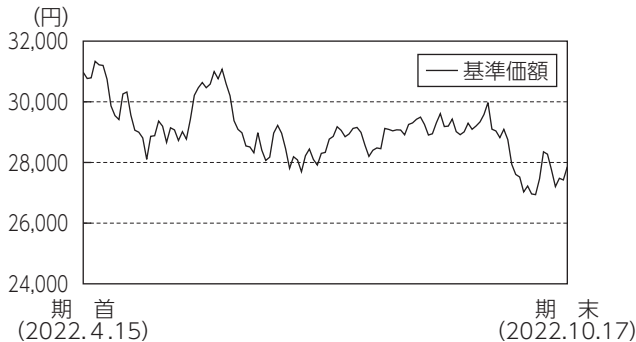
運 用 方 針	アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
株 式 組 入 制 限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		MSCI パシフィック指数 (除く日本、配当込み、円換算)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投資信託 証券 組 入 比 率
	円	騰落率 (参考指数)	円	騰落率 (参考指数)	%	%	%
(期首)2022年4月15日	30,972	—	35,634	—	97.7	—	—
4月末	29,415	△ 5.0	34,039	△4.5	96.7	—	—
5月末	30,213	△ 2.5	34,714	△2.6	93.9	—	—
6月末	28,964	△ 6.5	34,142	△4.2	93.4	—	—
7月末	28,992	△ 6.4	34,304	△3.7	94.2	—	—
8月末	29,198	△ 5.7	34,948	△1.9	95.0	—	—
9月末	27,224	△12.1	32,801	△8.0	93.9	—	—
(期末)2022年10月17日	27,861	△10.0	33,366	△6.4	94.4	—	—

- (注1) 騰落率は期首比。
 (注2) MSCI パシフィック指数 (除く日本、配当込み、円換算) は、MSCI Inc. (「MSCI」) の承諾を得て、MSCI パシフィック指数 (除く日本、配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCI パシフィック指数 (除く日本、配当込み、米ドルベース) は、MSCI 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) 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：30,972円 期末：27,861円 騰落率：△10.0%

【基準価額の主な変動要因】

アジア・オセアニア地域の通貨が円に対して上昇 (円安) したことがプラス要因となったものの、保有株式の下落がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○アジア・オセアニア株式市況

アジア・オセアニア株式市況は下落しました。

アジア・オセアニア株式市況は、当作成期首から2022年5月中

旬にかけて、米国の金融引き締め加速に対する警戒感や新型コロナウイルス感染拡大に伴う活動制限の長期化を受けた中国景気の悪化懸念を背景に、下落して始まりました。その後、米国のインフレ懸念の後退や中国政府による景気対策期待から一時的に上昇したものの、7月上旬にかけては、市場予想を上回るインフレ動向を受けた米国の金融引き締め加速懸念から世界的な株安となる中、台湾や韓国を中心に下落しました。その後、8月中旬にかけては、米国のインフレブレイクアウト観測などから投資家心理が向上し、堅調に推移しました。当作成期末にかけては、世界的なインフレ率の高止まりや主要中央銀行の積極的な利上げによる景気悪化懸念などを背景に、軟調に推移しました。

○為替相場

アジア・オセアニア地域の通貨は、対円で総じて上昇しました。

アジア・オセアニア地域の通貨は、当作成期首から2022年5月中旬にかけて、韓国ウォンや豪ドルなどが対円で下落 (円高) して始まったものの、その後7月中旬にかけては、日米の金融政策の乖離を受けた円安米ドル高の急速な進行を背景に、総じて対円で上昇しました。その後米ドル円の動きに左右され対円で上下する展開となったものの、当作成期末にかけては円安米ドル高が進行する中、おおむね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」

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

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

《今後の運用方針》

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

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

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	24円 (24)
有価証券取引税 (株式)	10 (10)
その他費用 (保管費用) (その他)	48 (29) (19)
合 計	82

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

(注 2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況
株 式

(2022年 4月16日から2022年10月17日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	オーストラリア	百株 50.8 (12.28)	千オーストラリア・ドル (164 ー)	百株 68	千オーストラリア・ドル 248
	香港	百株 723 (ー)	千香港ドル (2,384 ー)	百株 1,842	千香港ドル 1,588
	シンガポール	百株 1,589 (ー)	千シンガポール・ドル (530 ー)	百株 ー	千シンガポール・ドル ー
国	台湾	百株 250 (33.85)	千台湾ドル 2,445 (△ 186)	百株 430	千台湾ドル 7,544
	韓国	百株 15.6 (ー)	千韓国ウォン (98,563 ー)	百株 6.3	千韓国ウォン 86,105

(注 1) 金額は受渡し代金。

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

(注 3) 金額の単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄
株 式

(2022年 4月16日から2022年10月17日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘	柄	株 数	金 額	平均単価	銘	柄	株 数	金 額	平均単価
		千株	千円	円			千株	千円	円
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD (香港)		35.5	18,242	513	MEDIATEK INC (台湾)		6	19,533	3,255
SHENG SIONG GROUP LTD (シンガポール)		79	12,701	160	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD (オーストラリア)		4.9	13,772	2,810
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS (シンガポール)		46.6	12,526	268	UNITED MICROELECTRONICS CORP (台湾)		35	7,210	206
UNITED OVERSEAS BANK LTD (シンガポール)		3.1	8,106	2,614	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP (ケイマン諸島)		2	7,048	3,524
CHINA RESOURCES BEER HOLDING (香港)		8	7,522	940	CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)		73	6,290	86
CAPITALAND INVESTMENT LTD (シンガポール)		18.9	7,083	374	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL (オーストラリア)		0.7	6,199	8,856
KEPPEL CORP LTD (シンガポール)		9.5	6,980	734	CHINA MERCHANTS BANK-H (中国)		8	5,534	691
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L (バミューダ)		8	6,899	862	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD (香港)		3	4,812	1,604
DBS GROUP HOLDINGS LTD (シンガポール)		1.8	5,369	2,982	HYUNDAI MOBIS CO LTD (韓国)		0.23	4,764	20,716
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)		2	4,524	2,262	E-MART INC (韓国)		0.4	4,293	10,733

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
外国株式

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千円	千円	
BHP GROUP LTD	63	70.5	282	26,058	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	58	61.78	209	19,371	エネルギー
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	139	99	307	28,418	金融
WESTPAC BANKING CORP	96	102	239	22,138	金融
SANTOS LTD	172.34	191.34	149	13,784	エネルギー
RIO TINTO LTD	7	7	67	6,246	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	41.5	37	365	33,797	金融
MACQUARIE GROUP LTD	10	10.8	173	16,050	金融
CSL LTD	7.7	8.2	229	21,238	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	45.3	47.3	212	19,602	一般消費・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>	639.84 10銘柄	634.92 10銘柄	2,238 <30.2%>	206,706
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	—	80	406	7,700	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	22	26	641	12,137	金融
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	230	230	162	3,082	資本財・サービス
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,430	800	352	6,678	金融
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	—	80	288	5,459	公益事業
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	622	—	—	—	資本財・サービス
AIA GROUP LTD	262	286	1,940	36,733	金融
SANDS CHINA LTD	208	208	337	6,394	一般消費・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	55	25	188	3,573	資本財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	120	—	—	—	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	—	355	915	17,337	金融
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	180	—	—	—	素材
CHINA MERCHANTS BANK-H	135	55	168	3,191	金融
香港・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数 <比率>	3,264 10銘柄	2,145 10銘柄	5,403 <15.0%>	102,288
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
CAPITALAND INVESTMENT LTD	239	428	137	14,317	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD	51	82	215	22,439	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	58	76	251	26,207	金融
SHENG SIONG GROUP LTD	—	790	127	13,254	生活必需品
KEPPEL CORP LTD	—	95	63	6,613	資本財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	—	466	115	12,043	コミュニケーション・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	170	170	60	6,253	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>	518 4銘柄	2,107 7銘柄	970 <14.8%>	101,128
(台湾)	百株	百株	千台湾ドル	千円	
AIRTAIC INTERNATIONAL GROUP	20	—	—	—	資本財・サービス
DELTA ELECTRONICS INC	30	30	798	3,714	情報技術
NANYA TECHNOLOGY CORP	100	100	552	2,569	情報技術
MEDIATEK INC	60	—	—	—	情報技術
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	850	901.25	2,649	12,333	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	1,280	1,340	2,653	12,349	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	630	692.6	1,693	7,882	金融
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	30	40	970	4,514	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	百株 60	百株 70	千台湾ドル 1,249	千円 5,815	一般消費・サービス
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	240	260	10,712	49,860	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY	210	230	2,415	11,240	情報技術
UNITED MICROELECTRONICS CORP	870	570	2,205	10,267	情報技術
台湾・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数 <比率>	4,380 12銘柄	4,233.85 10銘柄	25,898 <17.6%>	120,548
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
KIA CORP	7	10	69,000	7,127	一般消費・サービス
SK HYNIX INC	18	20	191,000	19,730	情報技術
HYUNDAI MOTOR CO	2	2	33,400	3,450	一般消費・サービス
HYUNDAI MOBIS CO LTD	2.3	—	—	—	一般消費・サービス
E-MART INC	4	—	—	—	生活必需品
NAVER CORP	1.9	1.9	31,445	3,248	コミュニケーション・サービス
KB FINANCIAL GROUP INC	32	35.5	165,962	17,143	金融
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	66	70.6	397,478	41,059	情報技術
SK TELECOM	11.47	11.47	57,005	5,888	コミュニケーション・サービス
HANA FINANCIAL GROUP	41	43.5	167,257	17,277	金融
韓国ウォン 通貨計	株数、金額 銘柄数 <比率>	185.67 10銘柄	194.97 8銘柄	1,112,548 <16.8%>	114,926
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 <比率>	8,987.51 46銘柄	9,315.74 45銘柄	645,597 <94.4%>	645,597

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年10月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	645,597	94.4
コール・ローン等、その他	38,637	5.6
投資信託財産総額	684,235	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、10月17日における邦貨換算レートは、1 アメリカ・ドル＝148.61円、1 オーストラリア・ドル＝92.36円、1 香港ドル＝18.93円、1 シンガポール・ドル＝104.21円、1 台湾ドル＝4.654円、100韓国ウォン＝10.33円、1 オフショア人民元＝20.586円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産（674,561千円）の投資信託財産総額（684,235千円）に対する比率は、98.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年10月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	698,440,615円
コール・ローン等	38,595,329
株式(評価額)	645,597,978
未収入金	14,206,116
未収配当金	41,192
(B) 負債	14,253,829
未払金	14,212,829
未払解約金	41,000
(C) 純資産総額(A－B)	684,186,786
元本	245,575,170
次期繰越損益金	438,611,616
(D) 受益権総口数	245,575,170口
1万口当り基準価額(C／D)	27,861円

* 期首における元本額は231,896,540円、当作成期間中における追加設定元本額は20,183,599円、同解約元本額は6,504,969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：

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	7,897,395円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	6,802,030円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	121,568,958円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	19,413,482円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	19,992,659円
DＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	10,463,327円
DＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	20,539,793円
DＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	38,897,526円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は27,861円です。

■損益の状況

当期 自2022年4月16日 至2022年10月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	17,783,166円
受取配当金	17,781,902
受取利息	2,383
支払利息	△ 1,119
(B) 有価証券売買損益	△ 90,383,998
売買益	43,795,174
売買損	△134,179,172
(C) その他費用	△ 1,146,170
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 73,747,002
(E) 前期繰越損益金	486,343,248
(F) 解約差損益金	△ 12,744,031
(G) 追加信託差損益金	38,759,401
(H) 合計(D + E + F + G)	438,611,616
次期繰越損益金(H)	438,611,616

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

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

ダイワ好配当日本株マザーファンド

運用報告書 第35期（決算日 2022年10月17日）

（作成対象期間 2022年4月16日～2022年10月17日）

ダイワ好配当日本株マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

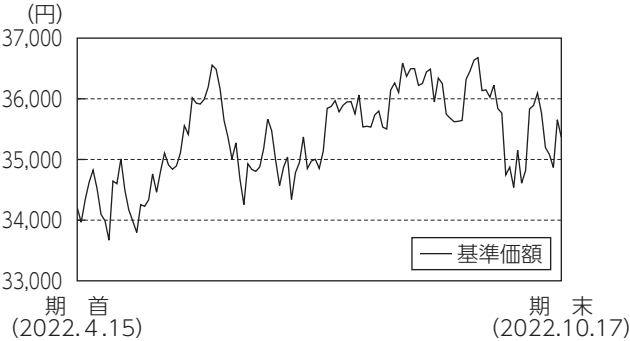
運 用 方 針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）
株 式 組 入 制 限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組 入 率	株 式 先 比
	円	騰落率 (参考指数)	騰落率	%	%	%
(期首)2022年 4 月15日	34,207	—	1,896.31	—	97.2	—
4 月末	34,644	1.3	1,899.62	0.2	96.4	—
5 月末	35,414	3.5	1,912.67	0.9	94.9	—
6 月末	34,988	2.3	1,870.82	△1.3	95.0	—
7 月末	35,753	4.5	1,940.31	2.3	94.5	—
8 月末	36,252	6.0	1,963.16	3.5	94.6	—
9 月末	34,609	1.2	1,835.94	△3.2	93.0	—
(期末)2022年10月17日	35,366	3.4	1,879.56	△0.9	93.4	—

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。
上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：34,207円 期末：35,366円 騰落率：3.4%

【基準価額の主な変動要因】

国内株式市況は一進一退の展開となり当作成期首との比較では下落しましたが、当ファンドは銘柄選択が功を奏し、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「ベンチマークとの差異について」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、やや弱含みながらも、おおむね一進一退で推移しました。

国内株式市況は、当作成期首より2022年6月半ばにかけて、米国のインフレ率が予想以上に上昇しF R B（米国連邦準備制度理事会）が利上げを加速するとの思惑が強まったことなどから、一時的な反発もあったものの下落しました。6月半ばにF R Bが利上げ幅拡大を決定した後は、悪材料出尽くし観測などから上昇に転じ、またインフレ率がピークアウトするとの期待感などもあり、8月中旬にかけて上昇が続きました。その後は、F R B議長が景気を犠牲にしてもインフレを抑制する姿勢を強調したことや、予想以上のインフレ率の上昇を受けて欧米の金利が上昇したことなどが嫌気され、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」

ウクライナ情勢を受けて不安定な株価推移が継続すると想定します。

2022年4月下旬から本格化する国内企業の決算では、部材不足や資源価格高騰の影響などから保守的な計画が発表される可能性が高いものの、期を通して見ればコロナ禍からの経済活動再開が企業業績をけん引すると期待されます。また、各国中央銀行の金融政策の変化が市場に与える影響は大きく、その動向を注視してまいります。

こうした不安定な投資環境を踏まえ、相対的に外部要因の影響を受けにくい消費財関連の企業や、コスト上昇局面においても価格競争力のある製品・サービスを有し部材不足の混乱下でも価格転嫁ができる素材関連企業やテクノロジー関連企業に注目します。個別銘柄の選別にあたりましては、構造改革の進展や新規事業の成長に変化が見られる企業や、株主還元策の向上に取り組む経営陣の姿勢に注目して、実力の再評価に余地がある銘柄の調査・選別を進めてまいります。

◆ポートフォリオについて

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

株式等の組入比率は、おおむね高位で推移させました。

業種構成は、情報・通信業、繊維製品、倉庫・運輸関連業などの組入比率を引き上げた一方、機械、化学、卸売業などの組入比率を引き下げました。当作成期末では、情報・通信業、電気機器、化学などを中心としたポートフォリオとなりました。

個別銘柄では、しまむらや三菱商事、旭化成などを売却した一方で、東レや三井住友トラストHD、上組などを買付けました。東レは、炭素繊維部門の回復や環境対応製品の成長など、高付加価値な事業の収益拡大を評価しました。三井住友トラストHDは、銀行セクターにおける相対的な業績の安定性や株主還元策の充実を評価しました。上組は、安定した収益事業を有しながら、課題であった資本政策の改善に取り組むなど経営姿勢の変化に注目しました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

参考指数の騰落率を下回った電気機器をアンダーウエートとしていたことや、参考指数の騰落率を上回った繊維製品をオーバーウエートとしていたことなどがプラス要因となりました。一方、参考指数の騰落率を上回った陸運業や医薬品をアンダーウエートとしていたことなどはマイナス要因となりました。

個別銘柄では、パルグループホールディングスやキートなどはプラスに寄与しましたが、オリックスや東京エレクトロンなどがマイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

欧米の利上げによる欧米景気の減速が警戒され、国内企業の業績への影響が懸念されます。一方で、円安による海外からの需要拡大や、新型コロナウイルスに対する水際対策緩和の効果への期待もあり、株価指標面にも割高感はない水準にあることから、国内株式市況の下値も限定的と考えます。

各企業の中長期経営計画では、付加価値の高い製品・サービスを重視する事業戦略や、株主還元策を含めた資本政策などを通じて、持続的成長による企業価値向上への姿勢を一層強める傾向が見て取れます。個別銘柄の選別にあたりましては、そのような持続的成長に向けた事業構造改革の進展や新規事業の成長に変化が見られる企業、株主還元策の向上に取り組む経営陣の姿勢に注目して調査を進めてまいります。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	17円 (17)
有価証券取引税	—
その他費用	—
合 計	17

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

■ 売買および取引の状況
株 式

(2022年4月16日から2022年10月17日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 1,400.1 (280.6)	千円 2,659,490 (-)	千株 1,263.1	千円 2,987,511

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

■ 主要な売買銘柄
株 式

(2022年4月16日から2022年10月17日まで)

当				期			
買		付		売		付	
銘	柄	株 数	金 額 平均単価	銘	柄	株 数	金 額 平均単価
		千株	千円			千株	千円
東レ		328.3	239,531	しまむら		17.3	205,656
三井住友トラストHD		48.3	202,722	キトー		56.6	149,629
上組		70.7	194,223	豊田自動織機		19	140,394
豊田合成		83.4	185,055	山九		33.3	132,132
光通信		9.6	168,231	I H I		33.6	123,634
豊田自動織機		18.6	154,775	旭化成		112.8	117,461
信越化学		7.6	122,264	三井金属		37.3	113,918
B I P R O G Y		37.4	118,334	大阪瓦斯		46	113,058
関西電力		85.2	112,254	日本製鉄		50.7	112,790
昭和電線H L D G S		53.2	95,586	三菱商事		27.8	110,163

(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
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	
建設業 (1.2%)				ソデイツク	84.4	84.4	64,566	三洋貿易	84	84	87,360	
オリエンタル白石	294.4	294.4	74,188	フリュー	45.4	45.4	51,801	コメダホールディングス	31.6	16	39,552	
住友林業	37.9	—	—	三精テクノロジーズ	28.5	28.5	21,717	萩原電気HL D G S	17.3	17.3	37,160	
大和ハウス	34.4	34.4	102,460	キトー	56.6	—	—	ダイトロン	42.5	42.5	85,382	
九電工	29.3	—	—	I H I	68.4	34.8	109,272	伊藤忠	121.7	123.8	467,840	
食料品 (1.8%)				スター精密	52.5	21.8	36,297	スターゼン	20.8	20.8	42,806	
ブルボン	22.4	22.4	47,712	電気機器 (9.5%)				三菱商事	81.3	53.5	216,193	
日本ハム	17.9	—	—	日立	70.6	71.9	461,741	稲畑産業	20	13.7	33,523	
アサヒグループホールディン	43.8	43.8	191,975	富士電機	57.1	57.1	303,772	日鉄物産	28	17.2	88,408	
太陽化学	22.3	22.3	33,137	ダイヘン	—	11.6	41,412	小売業 (3.4%)				
繊維製品 (3.4%)				I D E C	35.5	39.5	118,895	パルグループHL D G S	67.3	72.9	169,200	
富士紡ホールディングス	16.1	16.1	53,291	T D K	33.9	42.4	198,856	しまむら	24.1	6.8	81,600	
帝国繊維	15.1	10.1	15,937	村田製作所	19.6	14.3	99,771	丸井グループ	69.9	69.9	174,750	
東レ	168.7	497	360,175	東京エレクトロン	5.6	5.6	205,632	サンドラッグ	—	23	82,800	
セーレン	22.7	22.7	51,392	輸送用機器 (7.9%)				銀行業 (6.9%)				
ワコールホールディングス	51.3	14.6	34,178	トヨタ紡織	79.9	37.4	69,451	三菱UFJフィナンシャルG	690.4	638.9	431,449	
化学 (9.1%)				豊田自動織機	7.1	6.7	48,977	りそなホールディングス	197.2	359.5	199,953	
旭化成	160.8	48	46,080	デンソー	29.8	29.8	209,643	三井住友トラストHD	49.1	97.4	411,612	
共和レザー	64.4	64.4	33,745	いすゞ自動車	110.5	167.2	281,063	三井住友フィナンシャルG	18.9	—	—	
日本曹達	30.9	36.8	164,312	トヨタ自動車	169.6	157.8	315,600	証券、商品先物取引業 (0.6%)				
大阪ソーダ	21.2	34.1	121,225	プレス工業	116	116	47,212	S B I ホールディングス	35.6	35.6	92,987	
信越化学	5.3	12.9	189,888	ミクニ	67.4	67.4	21,500	保険業 (5.8%)				
エア・ウォーター	18.6	18.6	31,043	豊田合成	—	83.4	190,652	MS & A D	52.2	52.2	201,492	
四国化成	45.2	25.7	31,688	精密機器 (0.9%)				第一生命HL D G S	54.8	54.8	124,396	
東京応化工業	10.9	10.9	66,490	セイコーグループ	38.9	38.9	128,175	東京海上HD	71.6	214.8	551,928	
住友ベークライト	22.8	22.8	91,884	その他製品 (4.4%)				その他金融業 (3.5%)				
旭有機材	23.1	23.1	53,245	大日本印刷	119.9	106	309,308	プレミアグループ	50.9	88.7	142,097	
第一工業製薬	44.1	—	—	リンテック	22.4	16	35,568	オリックス	181.8	181.8	381,234	
富士フイルムHL D G S	43.2	43.2	292,809	任天堂	5	52.1	318,070	不動産業 (4.0%)				
デクセリアルズ	62.7	49.7	164,755	電気・ガス業 (1.7%)				東急不動産HD	—	88.9	70,142	
藤森工業	10	—	—	関西電力	—	85.2	95,935	AND DOホールディングス	46.8	46.8	41,043	
信越ポリマー	103.6	63.8	78,920	大阪瓦斯	120.4	74.4	162,043	三井不動産	103.4	113.5	327,163	
医薬品 (2.2%)				陸運業 (0.3%)				東京建物	80.6	80.6	168,212	
アステラス製薬	164.1	164.1	324,343	山九	33.3	—	—	サービス業 (3.7%)				
ガラス・土石製品 (2.3%)				丸全昭和運輸	13.8	13.8	41,814	ディップ	26.5	12.8	48,832	
AGC	61.4	58.2	265,683	倉庫・運輸関連業 (2.1%)				電通グループ	35.1	45.7	202,908	
ニチアス	50.7	35	79,730	三井倉庫H O L D	54.6	38.2	121,858	日本空調サービス	74.6	74.6	54,532	
鉄鋼 (0.5%)				上組	—	70.7	201,212	フルキャストホールディングス	38.7	38.7	104,180	
日本製鉄	50.7	—	—	情報・通信業 (11.4%)				ベルシステム24HL D G S	72.1	93.3	127,727	
大和工業	—	15.8	71,416	S R Aホールディングス	7.5	7.5	23,437	日本管財	5.9	5.9	14,573	
三菱製鋼	30.1	—	—	アルゴグラフィックス	31.1	13.1	49,780	合 計	株 数、金 額	6,709.2	7,126.8	15,029,591
非鉄金属 (0.6%)				B I P R O G Y	48.9	86.3	276,160	銘柄数<比率>	107銘柄	105銘柄	<93.4%>	
三井金属	37.3	—	—	日本電信電話	173.4	173.4	688,571					
昭和電線HL D G S	—	53.2	95,440	K D D I	108.6	108.6	459,052					
金属製品 (1.5%)				光通信	—	9.6	173,760					
三和ホールディングス	69.2	79.5	99,852	シーイーシー	27.5	27.5	40,810					
日東精工	77.4	77.4	40,712	卸売業 (8.7%)								
マルゼン	30.9	30.9	54,507	エレマテック	21.7	21.7	28,405					
ファインシンター	18.9	18.9	23,341	ダイワボウHD	18.5	67.2	124,723					
機械 (2.6%)				レスターホールディングス	11.1	11.1	21,645					
ツガミ	95.5	95.5	110,875	T O K A Iホールディングス	90.2	36.3	31,944					

(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。

(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。

■投資信託財産の構成

2022年10月17日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	15,029,591	92.7
コール・ローン等、その他	1,182,741	7.3
投資信託財産総額	16,212,333	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10月17日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	16,212,333,654円
コール・ローン等	902,801,019
株式(評価額)	15,029,591,670
未収入金	80,575,475
未収配当金	199,365,490
(B) 負債	119,406,182
未払金	117,314,182
未払解約金	2,092,000
(C) 純資産総額(A－B)	16,092,927,472
元本	4,550,338,173
次期繰越損益金	11,542,589,299
(D) 受益権総口数	4,550,338,173口
1万口当り基準価額(C／D)	35,366円

* 期首における元本額は4,534,466,504円、当作成期間中における追加設定元本額は206,956,118円、同解約元本額は191,084,449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：
ダイワ好配当日本株投信(季節点描) 2,602,338,168円
ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株) 22,646,905円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 19,306,006円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 16,501,568円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 292,621,415円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド 46,290,861円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型) 48,750,558円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／安定コース) 224,279,264円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／6分散コース) 439,216,103円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽／成長コース) 838,387,325円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は35,366円です。

■損益の状況

当期 自2022年4月16日 至2022年10月17日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	243,384,581円
受取配当金	243,485,320
受取利息	78
その他収益金	920
支払利息	△ 101,737
(B) 有価証券売買損益	286,314,397
売買益	953,836,756
売買損	△ 667,522,359
(C) 当期損益金(A＋B)	529,698,978
(D) 前期繰越損益金	10,976,696,990
(E) 解約差損益金	△ 483,870,551
(F) 追加信託差損益金	520,063,882
(G) 合計(C＋D＋E＋F)	11,542,589,299
次期繰越損益金(G)	11,542,589,299

(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。