

★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	
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保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
	トピックス・インデックス・マザーファンド	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）
	外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式（預託証券を含みます。）
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
	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。）
	ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債等（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。）
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債
組入制限	株式組入上限比率	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	無制限
	外国株式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）	純資産総額の10％以下
	ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	
	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
	投資信託証券組入上限比率	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	無制限
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・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、分配を行なわないことがあります。	

DCダイワ・ターゲットイヤー2020

運用報告書（全体版）
第13期

（決算日 2020年12月18日）
（作成対象期間 2019年12月19日～2020年12月18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、内外の株式、債券、リート（ＲＥＩＴ）および短期金融資産に投資し、中長期的に安定した信託財産の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/>

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			株 式 組入比率	株 式 先物比率	公 社 債 組入比率	債 券 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	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								
	円	円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
9 期末(2016年12月19日)	12,714	0	1.1	21.8	0.1	67.1	—	—	10.1	0.1	165
10期末(2017年12月18日)	13,290	0	4.5	19.5	0.2	69.2	—	0.0	10.1	0.1	159
11期末(2018年12月18日)	13,049	0	△1.8	16.8	0.2	72.0	—	0.0	10.0	0.1	143
12期末(2019年12月18日)	13,829	0	6.0	16.7	0.3	72.0	—	—	9.7	0.2	135
13期末(2020年12月18日)	13,963	0	1.0	—	—	5.1	—	—	—	—	130

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



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

■ 基準価額・騰落率

期 首：13,829円

期 末：13,963円（分配金0円）

騰落率：1.0%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

内外の株式、債券、リート（REIT）に投資した結果、内外の株式および海外債券が上昇したことなどが寄与し、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」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
ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	△0.1%	5.2%

<参考情報>

以下は、当作成期中に組み入れて当作成期末の前日に全売却したマザーファンドの期首から期末前日までの騰落率と期末前日での組入比率です。

組入ファンド	騰落率	比率
トピックス・インデックス・マザーファンド	5.7%	10.5%
外国株式インデックスマザーファンド	9.6%	5.2%
ダイワリー・REITマザーファンド	△14.3%	5.1%
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	△10.5%	5.2%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	△0.5%	48.7%
外国債券インデックスマザーファンド	4.8%	19.8%

DCダイワ・ターゲットイヤー2020

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
(期首) 2019年12月18日	円	%	%	%	%	%	%	%	%
	13,829	—	16.7	0.3	72.0	—	—	9.7	0.2
12月末	13,875	0.3	16.4	0.5	71.8	—	0.1	10.0	0.2
2020年 1 月末	13,931	0.7	16.0	0.6	71.6	—	0.1	10.0	0.2
2 月末	13,698	△0.9	14.6	0.7	74.1	—	0.1	9.2	0.2
3 月末	13,135	△5.0	15.0	0.7	72.2	—	0.1	10.6	0.3
4 月末	13,277	△4.0	15.6	0.3	72.1	—	0.0	10.4	0.3
5 月末	13,460	△2.7	15.2	0.4	72.4	—	0.1	10.1	0.3
6 月末	13,479	△2.5	15.3	0.3	73.0	—	0.0	10.0	0.3
7 月末	13,510	△2.3	14.1	0.4	74.0	—	0.0	10.0	0.3
8 月末	13,689	△1.0	14.7	0.3	73.5	—	0.0	9.9	0.3
9 月末	13,674	△1.1	14.4	0.4	73.9	—	0.1	9.7	0.3
10月末	13,504	△2.4	14.1	0.4	74.4	—	0.0	9.6	0.3
11月末	13,871	0.3	15.2	0.4	72.9	—	0.0	10.2	0.3
(期末) 2020年12月18日	13,963	1.0	—	—	5.1	—	—	—	—

(注 1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注 2) 株式組入比率は新株予約権証券を含みません。

投資環境について

(2019.12.19～2020.12.18)

■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、米中通商協議の合意に対する期待と不透明感が交錯し、横ばい圏で推移しました。その後は、新型コロナウイルスの感染拡大が懸念され、株価は2020年2月後半から3月中旬にかけて大幅に下落しました。3月下旬以降は、主要国の中央銀行による金融緩和策や、新規感染者数がピークアウトの兆候を見せた欧米で経済活動の再開が進展したこと、また国内でも5月下旬に緊急事態宣言が全面解除されたことなどが好感され、6月上旬まで株価は上昇基調で推移しました。6月中旬以降は、日米における感染状況などに一喜一憂する中、株価は横ばい圏で推移しました。11月に入ると、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通り当選確実となって選挙に対する不確実性が後退したことや、複数の開発企業が新型コロナウイルスワクチン開発において高い効果を確認したとの発表でワクチンの実用化期待が高まったことにより、株価は上昇しました。

■海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は上昇しました。

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

■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、当作成期首より、長期金利の上昇の落ち着きとともに相対的に高い配当利回りに注目が集まり、上昇しました。しかし2020年2月以降は、世界的な新型コロナウイルスの感染拡大による景気減速懸念により、投資家がリスク回避姿勢を強める中で、国内リート市場は下落に転じました。3月には、金融機関による3月末の決算対策や減損回避などの目的でロスカット（強制損切り）の売りが膨らんだことから、急落しました。5月は、新規国内感染者数の減少や緊急事態宣言の全面解除が見込まれる中、経済活動正常化への期待もあり、上昇しました。その後、10月に過去最大規模の公募増資が発表されると需給悪化懸念から下落に転じましたが、11月には米国大統領選挙および連邦議会選挙の結果や、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展によるリスク選好の中で、上昇しました。

■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、当作成期首より、主要株価指数の上昇に追従する形で上昇しました。2020年に入ると、米国の対中追加関税回避や長期金利の低下などが支援材料となり、堅調な推移となりました。

しかし2月以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて大幅に下落しました。3月下旬からは、各国の財政金融政策や新型コロナウイルスワクチン開発への期待などから上昇しました。5月以降は、世界的な経済活動の再開期待から堅調な展開となりました。その後9月以降は、感染再拡大やそれに伴うロックダウン（都市封鎖）への懸念などから下落する局面があったものの、11月に入ると、ワクチン開発で高い効果を示す結果が報告され、経済活動再開への期待が高まったことなどから上昇しました。

■国内債券市況

国内債券市場では、当作成期を通して見ると長期金利は上昇（債券価格は下落）しました。

当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて市場のリスク回避姿勢が強まったことから、長期金利は低下しました。その後は、日本政府の経済対策に伴う国債増発懸念などを受けて金利は上昇しました。2020年4月以降はおおむねレンジ内で推移しましたが、8月は米国の金利が上昇したことなどから長期金利は上昇しました。9月には、米国の追加経済対策協議の難航や欧州での感染再拡大への懸念などを背景に、国内金利は低下しました。その後はおおむねレンジ内での推移となりました。

■国内短期債券市況

国内短期債券市場では、当作成期を通して見ると短期金利は当作成期首とおおむね同程度の水準でした。

当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて市場のリスク回避姿勢が強まったことから、短期金利は低下しました。その後は、日本政府の経済対策に伴う国債増発懸念などを受けて金利は上昇しました。2020年4月以降はおおむねレンジ内で推移しましたが、8月は米国の金利が上昇したことなどから短期金利は上昇しました。9月には、米国の追加経済対策協議の難航や欧州での感染再拡大への懸念などを背景に、金利は低下しました。その後はおおむねレンジ内での推移となりました。

■海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると金利は低下（債券価格は上昇）しました。

当作成期首より、新型コロナウイルスによる世界経済の減速懸念の高まりから、金利は大きく低下しました。その後は、各国で段階的に経済活動が再開されたことや新型コロナウイルスのワクチン開発への期待から金利は一時的に上昇しましたが、感染再拡大への懸念が高まると金利は再び低下しました。2020年8月には、株価が上昇するなどリスクに対する市場心理が改善し、金利は上昇しました。10月には、米国大統領および連邦議会選挙を控えて、バイデン候補が大統領に当選し、民主党が上下院を制した場合の拡張的な財政政策を懸念する動きなどから、米国の金利を中心に上昇しました。その後はおおむねレンジ内で推移しました。

■為替相場

為替相場は、当作成期を通した大きな流れで見ると米ドルなどが下落（円高）しました。

対円為替相場は、当作成期首より横ばいで推移しましたが、2020年に入ってから、新型コロナウイルスの感染拡大懸念が高まったことなどから円高が進みました。5月以降は、経済活動の再開期待などからユーロを中心に上昇（円安）しました。7月には、米中関係の悪化や追加経済対策をめぐる不透明感から米ドルを中心に下落傾向となりました。10月以降は、感染再拡大に対する懸念や米国大統領および連邦議会選挙に対する不透明感などから、米ドルなどが下落しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

マザーファンドの受益証券への投資を通じて、2020年に近づくに従って株式等の組み入れを漸減させ、債券の組み入れを漸増させることなどにより、長期的にリスクを減少させていく運用を行ってまいります。

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマーク（M S C I コクサイ指数（円ベース））の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■ダイワJーR E I Tマザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマーク（東証R E I T指数（配当込み））の動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

■ダイワ・グローバルR E I Tインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマーク（S & P先進国R E I T指数（除く日本）（円ベース））に連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、E T F（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

■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（N O M U R AーB P I総合指数）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。

■ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

今後もベンチマーク（N O M U R AーB P I総合短期指数）との高い連動性を維持するように運用を行います。残存年限別構成やデュレーションなどを管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに配慮しつつ、ポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

■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（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））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

(2019.12.19～2020.12.18)

■当ファンド

当ファンドの特色に基づき、国内株式・海外株式・国内リート・海外リート・国内債券・海外債券の各マザーファンドの受益証券へ基本配分比率を参考に投資を行いました。

当作成期における基本配分比率は、純資産総額に対してそれぞれ以下の通りとし、比率の見直しを2020年3月に行いました。また、当作成期末におきまして、国内短期債券のマザーファンドの受益証券および短期金融資産への投資に移行しました。

	当作成期首～2020年3月	2020年3月～当作成期末
トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券	11%	10%
外国株式インデックスマザーファンドの受益証券	6%	5%
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券	5%	5%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券	5%	5%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の受益証券	50%	50%
ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	3%	5%
外国債券インデックスマザーファンドの受益証券	20%	20%

■トピックス・インデックス・マザーファンド

株式を中心に、一部ＴＯＰＩＸ先物取引も利用し、株式組入比率（株式先物を含む。）につきましては、当作成期を通じておおむね100％程度を維持しました。株式ポートフォリオは、最適化の手法（株価変動を数理的にいくつかの要因に分解し、それに基づいて、ポートフォリオがベンチマークと同じように変動するよう、銘柄、株数を決定するシステマ的な手法）を用いて構築しています。当作成期中、資金変動への対応や新規上場等によるベンチマークの構成変化に対応するため、随時、株式の売買を行いました。

■外国株式インデックスマザーファンド

外国株式を中心に、Ｓ＆Ｐ500先物取引等の株価指数先物も一部利用し、株式組入比率（投資信託証券、株価指数先物を含む。）につきましては、当作成期を通じておおむね100％程度の水準を維持しました。外国株式等のポートフォリオ構築にはリスクモデルを利用し、ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）については、当作成期を通じて99～100％程度としました。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックスマザーファンド

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエートで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。また、運用の効率化を図るため、ＥＴＦ（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物を組み入れました。

■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。

■ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの残存年限構成やデュレーションなどをベンチマークに近づけることにより、連動性を維持しました。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

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

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目		当 期 2019年12月19日 ～2020年12月18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）	5,514

（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です。



今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」の受益証券および短期金融資産への投資を通じて、リスクを抑えた運用を行ってまいります。

■ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

今後もベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行います。残存年限別構成やデュレーションなどを管理するとともに、ファンドの資金流入出や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに配慮しつつ、ポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2019.12.19~2020.12.18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	42円	0.308%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は13,593円です。
(投 信 会 社)	(19)	(0.137)	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)	(19)	(0.137)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(4)	(0.033)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0.001	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
有価証券取引税	0	0.001	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)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
そ の 他 費 用	2	0.015	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.006)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	44	0.326	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

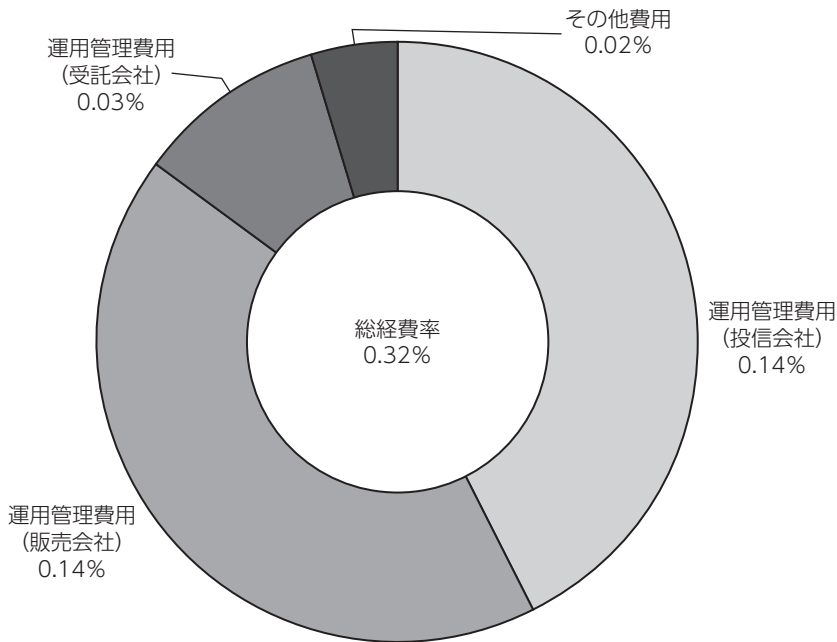
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.32%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

(2019年12月19日から2020年12月18日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	4,646	4,218	17,981	20,096
外国株式インデックスマザーファンド	1,072	2,408	4,056	11,320
外国債券インデックスマザーファンド	1,051	3,052	10,486	31,560
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	1,073	2,589	3,110	8,551
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	1,855	3,564	4,525	9,872
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	7,135	9,261	59,075	76,463
ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	2,548	2,673	48	51

(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

(2019年12月19日から2020年12月18日まで)

項 目	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	35,276,661千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	147,238,197千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.23
	外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	22,369,363千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	128,052,463千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.17

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(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) トピックス・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

(2019年12月19日から2020年12月18日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D／C
区 分						
株式	百万円 13,619	百万円 294	% 2.2	百万円 21,656	百万円 2,953	% 13.6
株式先物取引	33,674	4,983	14.8	32,418	4,172	12.9
コール・ローン	4,752,627	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.0%

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

(3) 外国株式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。

(4) 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。

(5) ダイワＪ－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

(2019年12月19日から2020年12月18日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B／A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D／C
区 分						
投資信託証券	百万円 138,771	百万円 2,673	% 1.9	百万円 63,345	百万円 8,799	% 13.9
不動産投信 指数先物取引	59,313	8,958	15.1	55,897	8,815	15.8
コール・ローン	1,492,707	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.0%

(6) ダイワ・グローバルＲＥＩＴ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。

(7) 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
(2019年12月19日から2020年12月18日まで)

決 算 期	期					
区 分	買付額等 A	うち利 害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利 害 関係人との 取引状況D	D/C
公社債	百万円 8,650	百万円 185	% 2.1	百万円 4,037	百万円 100	% 2.5
コール・ローン	38,595	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.3%

(8) ダイワ短期日本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。

(9) 利害関係人の発行する有価証券等
(2019年12月19日から2020年12月18日まで)

種 類	期		
	トピックス・インデックス・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
株式	百万円 23	百万円 31	百万円 259
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
投資信託証券	百万円 3,470	百万円 2,082	百万円 10,760

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(10) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券
(2019年12月19日から2020年12月18日まで)

種 類	当 期
	買 付 額
	トピックス・インデックス・マザーファンド
株式	百万円 65
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド
投資信託証券	百万円 5,399
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）
公社債	百万円 100

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(11) 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
(2019年12月19日から2020年12月18日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額（A）	2千円
うち利害関係人への支払額（B）	0千円
（B）／（A）	5.9%

(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、当作成期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、大和証券グループ本社、マネーパートナーズグループ、サムディ、大和証券オフィス投資法人、サムディ・レジデンシャル投資法人、大和証券リビング投資法人です。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期	末
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	13,334	—	—
外国株式インデックスマザーファンド	2,984	—	—
外国債券インデックスマザーファンド	9,435	—	—
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	2,036	—	—
ダイワ・グローバルＲＥＩＴ インデックス・マザーファンド	2,670	—	—
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	51,940	—	—
ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	4,013	6,513	6,820

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年12月18日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	6,820	5.2
コール・ローン等、その他	124,032	94.8
投資信託財産総額	130,853	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

2020年12月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	130,853,061円
コール・ローン等	472,547
ダイワ短期日本債券インデックス マザーファンド(評価額)	6,820,617
未収入金	123,559,897
(B) 負債	215,813
未払解約金	1,396
未払信託報酬	208,906
その他未払費用	5,511
(C) 純資産総額(A－B)	130,637,248
元本	93,557,729
次期繰越損益金	37,079,519
(D) 受益権総口数	93,557,729口
1万口当り基準価額(C／D)	13,963円

* 期首における元本額は98,220,848円、当作成期間中における追加設定元本額は15,979,208円、同解約元本額は20,642,327円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,963円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月19日 至2020年12月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 10円
受取利息	1
支払利息	△ 11
(B) 有価証券売買損益	2,038,513
売買益	4,350,998
売買損	△ 2,312,485
(C) 信託報酬等	△ 436,368
(D) 当期損益金(A + B + C)	1,602,135
(E) 前期繰越損益金	18,331,865
(F) 追加信託差損益金	17,145,519
(配当等相当額)	(31,660,862)
(売買損益相当額)	(△14,515,343)
(G) 合計(D + E + F)	37,079,519
次期繰越損益金(G)	37,079,519
追加信託差損益金	17,145,519
(配当等相当額)	(31,660,862)
(売買損益相当額)	(△14,515,343)
分配準備積立金	19,934,010
繰越損益金	△ 10

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

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,602,145
(c) 収益調整金	31,660,862
(d) 分配準備積立金	18,331,865
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	51,594,872
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e - f)	51,594,872
(h) 受益権総口数	93,557,729口

《お知らせ》

■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用報告書 第32期（決算日 2020年9月23日）

（作成対象期間 2019年9月20日～2020年9月23日）

トピックス・インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

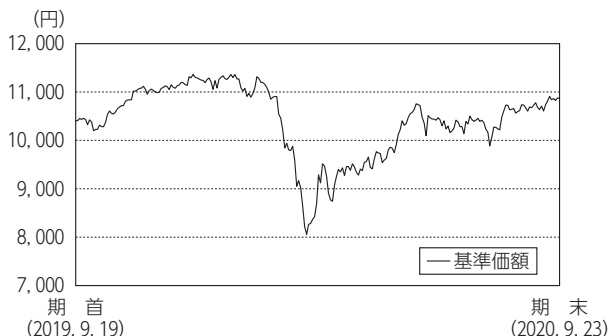
運用方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	東京証券取引所第1部上場株式（上場予定を含みます。）
株式組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首)2019年9月19日	10,406	—	1,615.66	—	99.7	0.2
9月末	10,324	△ 0.8	1,587.80	△ 1.7	98.5	1.6
10月末	10,840	4.2	1,667.01	3.2	98.9	2.0
11月末	11,051	6.2	1,699.36	5.2	98.3	1.9
12月末	11,211	7.7	1,721.36	6.5	98.5	1.5
2020年1月末	10,972	5.4	1,684.44	4.3	97.8	2.2
2月末	9,844	△ 5.4	1,510.87	△ 6.5	97.1	3.0
3月末	9,257	△ 11.0	1,403.04	△ 13.2	97.6	2.3
4月末	9,657	△ 7.2	1,464.03	△ 9.4	98.0	1.8
5月末	10,314	△ 0.9	1,563.67	△ 3.2	97.7	2.2
6月末	10,298	△ 1.0	1,558.77	△ 3.5	97.8	2.1
7月末	9,884	△ 5.0	1,496.06	△ 7.4	98.7	1.2
8月末	10,692	2.7	1,618.18	0.2	99.1	0.8
(期末)2020年9月23日	10,865	4.4	1,644.25	1.8	99.4	0.6

(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) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注4) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,406円 期末：10,865円 騰落率：4.4%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、米国が連続利下げを実施したことと過度な景気後退懸念が和らいだことや、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、上昇しました。しかし2020年1月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染拡大が懸念され下落したことに続き、2月後半以降は中国以外における感染拡大が懸念され、3月に入ると米国において感染者の増加が目立ち始めたほか、国内においても感染者の急激な増加が懸念される状況となり、株価は2月後半から3月中旬にかけて大幅に下落しました。3月下旬以降は、主要国の中央銀行による金融緩和策を受けて株価は上昇に転じました。新型コロナウイルスの新規感染者数がピークアウトしてきた欧米で経済活動の再開が進展したことや、国内でも5月下旬に緊急事態宣言が全面解除されたことなどが好感されました。しかし6月中旬以降は、米国において新型コロナウイルスの感染拡大が再び懸念され、株価は頭打ちとなりました。7月には、国内における感染拡大が再び目立ち始めたほか、米国の雇用回復への不透明感もあり7月下旬に株価は再度下落したものの、8月以降、ワクチン開発への期待の高まりや米国の緩和的な金融政策の長期化期待により、株価は反発しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は1.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.4%となりました。

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

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

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

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

(注 1) 費用の項目および算出法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の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

(2019 年 9 月 20 日から 2020 年 9 月 23 日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 14, 424. 5	千円 26, 093, 250	千株 9, 136. 059	千円 18, 563, 732
	(815. 35904)	(一)		

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2019 年 9 月 20 日から 2020 年 9 月 23 日まで)

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株式先物取引	百万円 33, 751	百万円 32, 821	百万円 —	百万円 —

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 単位未満は切捨て。

(3) 新株予約権証券

(2019 年 9 月 20 日から 2020 年 9 月 23 日まで)

	買 付		売 付	
	証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	証券 —	千円 —	証券 —	千円 —
	(17, 700)	(一)	(17, 700)	(一)

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

■ 主要な売買銘柄

株 式

(2019 年 9 月 20 日から 2020 年 9 月 23 日まで)

当 期				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
トヨタ自動車	129. 3	908, 611	7, 027	トヨタ自動車	71. 8455	521, 789	7, 262
ソニー	69	472, 389	6, 846	ソニー	64. 6	444, 591	6, 882
N T T ドコモ	148. 9	440, 065	2, 955	キーエンス	7. 7	363, 514	47, 209
ソフトバンクグループ	89. 7	406, 405	4, 530	K D D I	97. 8	300, 687	3, 074
任天堂	9. 6	384, 932	40, 097	武田薬品	73. 5	295, 341	4, 018
三菱 U F J フィナンシャル G	765. 7	370, 857	484	日本電信電話	68. 1	249, 300	3, 660
日本電信電話	114. 1	362, 502	3, 177	本田技研	81. 2	233, 730	2, 878
キーエンス	8. 3	358, 955	43, 247	ソフトバンクグループ	49. 4	231, 915	4, 694
武田薬品	90. 7	338, 265	3, 729	三菱 U F J フィナンシャル G	443. 8	223, 249	503
日立	74. 9	284, 250	3, 795	ソフトバンク	140. 7	208, 345	1, 480

(注 1) 金額は受渡し代金。
(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首			銘柄	期首			銘柄	期首		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				前田建設	49.1	53.5	42,372	中外炉工業	2	2.3	3,686
極洋	2.8	3.3	9,071	佐田建設	4.5	4.5	2,007	ヤマト	6.3	6.8	4,692
日本水産	84.9	92.4	42,134	ナカノフドー建設	5.4	5.7	2,274	太平電業	4.7	5.2	11,965
マルハニチロ	12.3	13.4	33,057	奥村組	11.5	10	26,990	高砂熟学	17	17.7	26,974
カネコ種苗	2.6	2.8	4,365	東鉄工業	8.4	9	25,551	三晃金属	0.8	0.8	1,743
サカタのタネ	10.1	11	40,150	イチケン	1.3	1.5	2,416	朝日工業社	1.5	1.4	4,452
ホクト	7.1	7.1	15,982	富士ピー・エス	2.9	3	1,941	明星工業	12.7	13.8	11,426
ホクリヨウ	1.1	1.6	1,076	浅沼組	2.4	2.4	10,068	大気社	9.5	10.4	30,357
鉱業 (0.2%)				戸田建設	81.3	87.6	62,283	ダイダン	4.7	5.1	14,331
住石ホールディングス	18.5	18.4	2,281	熊谷組	10	9.9	27,096	日比谷総合設備	6.3	6.9	12,275
日鉄鉱業	1.9	2.1	9,996	青木あすなろ建設	3.6	—	—	東芝プラントシステム	15.2	—	—
三井松島 HLDGS	3.6	3.4	2,594	北野建設	1.5	1.3	3,471	フィル・カンパニー	—	1.2	2,336
国際石油開発帝石	340.3	339.1	196,203	植木組	0.9	0.9	2,538	OSJBHD	31	33.3	8,125
石油資源開発	12.2	12.1	20,509	矢作建設	9.5	9.3	8,472	東洋エンジニア	8.3	8.7	3,027
K&O エナジーグループ	4.1	4.5	6,700	ピーエス三菱	7.4	7	4,333	レイズネクスト	12.5	11.2	14,459
建設業 (2.5%)				日本ハウス HLDGS	13.4	14.2	3,961	食料品 (3.7%)			
ヒノキヤグループ	2.1	2.3	4,503	大東建託	24.9	23.1	215,684	日本製粉	19.8	20.1	34,672
ショーバンドHD	12.1	14.3	73,502	新日本建設	8.3	9	7,992	日清製粉G本社	70.8	77.3	131,873
ミライト・ホールディングス	23.8	27.4	44,168	NIPPPO	18.5	17.4	50,460	日東富士製粉	0.4	0.5	3,250
タマホーム	4.1	5	6,845	東亜道路	1.3	1.3	4,732	昭和産業	5.7	6.3	21,829
サンヨーホームズ	1.2	0.5	329	前田道路	20.8	18.8	36,716	鳥越製粉	5.6	6	6,360
日本アクア	3.4	3.8	2,553	日本道路	1.9	2	15,740	中部飼料	7.6	8.4	14,968
ファーストコーポレーション	2.6	3	2,013	東亜建設	6.1	6.7	11,195	フィード・ワン	42.1	45.7	8,820
ベステラ	1.6	1.6	1,920	日本国土開発	11.5	20.8	13,187	東洋精糖	0.9	1.2	1,465
キャンディル	—	1.4	1,090	若築建設	3.5	3.7	4,602	日本甜菜糖	3.6	3.5	6,485
スペースバリューHD	10.4	11.1	5,605	東洋建設	25.7	23.9	9,894	三井製糖	4.9	6	11,544
ダイセキ環境ソリューション	1.6	1.8	1,285	五洋建設	83.3	84.8	58,088	塩水港精糖	6.6	6.9	1,593
第一カッター興業	1	1.1	2,483	世紀東急	10.2	10.2	8,160	日新製糖	2.9	3.3	6,270
明豊ファシリティワークス	—	2.7	1,873	福田組	2.3	2.5	13,625	森永製菓	15.8	16	66,160
安藤・間	54.4	54.9	41,120	住友林業	49.6	53.9	93,354	中村屋	1.6	1.8	7,641
東急建設	24.8	27.1	12,845	日本基礎技術	7.2	7.3	3,613	江崎グリコ	18.6	19	88,540
コムシスホールディングス	30.1	32.6	96,039	巴コーポレーション	8.7	9.2	3,578	名糖産業	3	3.3	5,260
ミサワホーム	6.7	—	—	大和ハウス	193.8	209.9	595,171	井村屋グループ	2.7	3.8	9,640
ピーアールホールディングス	9.3	9.9	7,860	ライト工業	13.5	12.2	19,568	不二家	3.5	3.8	9,044
高松コンストラクションGP	5.3	5.7	12,967	積水ハウス	214.2	229.3	442,434	山崎製パン	47.1	51.2	93,440
東建コーポレーション	2.6	2.8	21,924	日特建設	6	5.5	4,411	第一屋製パン	1.1	1.3	1,293
ソネック	0.8	0.9	807	北陸電気工事	3.4	3.6	4,140	モロゾフ	1.1	1.1	6,545
ヤマウラ	3.3	4	3,504	ユアテック	11.2	11.9	7,842	電田製菓	3.9	3.9	20,982
大成建設	69.7	70.8	262,668	日本リーテック	—	4.5	13,405	寿スピリッツ	6.6	6.6	34,518
大林組	209.8	212.7	211,849	四電工	1	1.1	2,508	カルビー	28.6	31.2	107,328
清水建設	214.1	215.5	175,632	中電工	9	8.2	19,097	森永乳業	12.6	12.6	68,292
飛島建設	6	5.9	6,531	関電工	31.8	29.8	25,955	六甲バター	4.2	4.5	8,217
長谷工コーポレーション	87.4	81.8	119,755	きんでん	46.5	50.1	92,785	ヤクルト	46.4	46.8	274,716
松井建設	7.7	8.3	5,511	東京エネシス	7.2	7	5,369	明治ホールディングス	44.4	45	364,500
銭高組	0.9	0.9	4,369	トーエネック	2	2	7,070	雪印メグミルク	15.1	16.5	41,200
鹿島建設	164	166.7	216,376	住友電設	4.8	6	14,796	プリマハム	8.8	10.7	33,651
不動テトラ	4.8	5.5	8,382	日本電設工業	11.9	11.6	25,554	日本ハム	26	26.1	122,148
大末建設	2.5	2.3	2,116	協和エクシオ	27.4	32.2	88,228	林兼産業	2	2.3	1,357
鉄建建設	4.3	4.6	9,788	新日本空調	5.6	5.6	12,381	丸大食品	6.7	7.3	13,578
西松建設	15.1	16.4	34,751	九電工	13.8	14.9	46,115	S Foods	5.6	5.5	15,983
三井住友建設	50.5	51.7	22,386	三機工業	15.3	15.3	18,329	柿安本店	—	2.3	6,124
大豊建設	4.7	4.8	14,390	日揮ホールディングス	60.4	65.8	69,616	伊藤ハム米久 HLDGS	40.3	44.2	33,592

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
サッポロホールディングス	21.4	23.3	44,736		シキボウ	3.2	4	3,940		日産化学	37.1	36.8	199,456	
アサヒグループホールディングス	131.3	143.3	533,935		日本毛織	20	21.4	21,143		ラサ工業	2.2	2.3	4,719	
キリンHD	265.9	288	565,776		ダイトウボウ	10.4	12.1	1,379		クレハ	5.7	5.7	27,388	
宝ホールディングス	47	50.7	57,798		トーア紡コーポレーション	2.5	2.6	1,294		多木化学	1.8	2.6	17,446	
オエノホールディングス	16.6	18	7,632		ダイドーリミテッド	7.2	9.7	1,940		ティカ	5	4.9	7,026	
養命酒	1.9	2.1	3,912		帝国繊維	6.9	7.5	20,272		石原産業	11.8	11.9	8,901	
コカ・コーラボラーツJHD	44	48	84,528		帝人	49.8	54.1	91,374		片倉コープアグリ	1.8	1.6	2,028	
サントリー食品インター	41.9	45.7	180,515		東レ	474.6	480.7	237,754		日本書達	9.7	9.9	30,888	
ダイドーグループHD	3.5	3.5	18,935		サカイオーベックス	1.5	1.7	3,578		東ソー	94.5	102.5	179,887	
伊藤園	19	20.8	154,336		住江織物	1.8	1.4	2,713		トクヤマ	17.6	19.2	50,419	
キーコーヒー	6.2	6.7	15,356		日本フェルト	3.5	3.5	1,725		セントラル硝子	13.4	13.5	30,550	
ユニカフェ	1.6	1.6	1,648		イチカフ	0.9	0.9	1,249		東亜合成	38.4	41.5	48,140	
ジャパンフーズ	0.9	0.9	1,170		日東製網	0.7	0.8	1,190		大阪ソーダ	6.8	6.7	17,641	
日清オイリオグループ	8	8.8	28,468		アツギ	5.1	5.3	2,883		関東電化	14.6	15.8	11,913	
不二製油グループ	15.3	16.7	54,108		ダイニツク	2.5	2.4	1,958		デンカ	24	24.2	78,892	
かどや製油	0.7	0.8	3,072		セーレン	15.1	16.4	24,731		信越化学	107.8	113.7	1,591,800	
J-オイルミルズ	3.2	3.6	14,130		ソトー	2.4	2.4	2,342		日本カーバイド	2.1	2.1	2,681	
キッコーマン	41.4	49.1	284,780		東海染工	0.8	0.9	1,026		堺化学	4.1	4.3	8,793	
味の素	138.5	150.4	326,969		小松マテーレ	10	10.8	9,644		第一稀元素化学工	6.6	7.1	5,360	
キュービー	34.9	38.1	80,352		ワコールホールディングス	17.3	16.7	32,915		エア・ウォーター	50.1	61.8	92,514	
ハウス食品G本社	23.4	25.6	93,952		ホギメディカル	7.6	7.5	27,750		大陽日酸	50.4	63.7	106,570	
カゴメ	23.8	26	93,730		レナウン	17.9	—	—		日本化学工業	2.1	2.1	5,033	
焼津水産化工	3.1	3.2	3,158		クラウディア HLDGS	1.5	1.7	540		東邦アセチレン	0.9	0.8	1,008	
アリアケジャパン	5.7	6.2	44,950		T S I ホールディングス	22.6	22.1	7,160		日本パーカライズン	33.4	33.6	33,902	
ビエトロ	0.8	0.8	1,372		マツオカコーポレーション	1.9	1.9	4,164		高圧ガス	9.7	10.6	9,094	
エバラ食品工業	1.5	1.7	3,976		ワールド	8	9.5	13,471		チタン工業	0.8	0.9	1,528	
やまみ	0.3	0.6	1,323		三陽商会	3.2	3.5	2,093		四国化成	10.3	9.7	11,155	
ニチレイ	32.6	32.6	91,247		ナイガイ	2.2	2.5	970		戸田工業	1.3	1.5	3,726	
東洋水産	32.3	35.1	200,772		オンワードホールディングス	36.8	40.1	11,027		ステラ ケミファ	3.6	3.6	10,944	
イートアンド	2.2	2.3	4,574		ルックホールディングス	2.1	2.1	1,789		保土谷化学	2.1	2.5	12,125	
大冷	0.7	0.8	1,928		ゴールドウイン	5.5	12	94,440		日本触媒	10.3	10.2	58,956	
ヨシムラ・フード・HLDGS	1.7	3.8	3,564		デサント	14.9	13	23,270		大日精化	5.1	5.9	13,528	
日清食品HD	26.6	29	290,580		キング	3.3	3	1,764		カネカ	15.8	17.2	51,531	
永谷園ホールディングス	3.4	3.4	7,986		ヤマトインターナショナル	3.7	5.7	2,052		三菱瓦斯化学	62.1	61.8	122,858	
一正蒲鉾	2.4	2.6	2,810		バルブ・紙 (0.2%)					三井化学	55.5	61.5	161,806	
フジッコ	6.8	7.4	15,332		特種東海製紙	3.9	4.1	19,044		J S R	61.4	61.8	154,500	
ロックフィールド	6.8	7.3	10,555		王子ホールディングス	275.2	277.1	136,887		東京応化工業	10.5	11.4	61,104	
日本たばこ産業	361.9	364.8	713,366		日本製紙	29.4	29.3	38,646		大阪有機化学	5.6	6.1	17,037	
ケンコーマヨネーズ	3.5	3.8	7,037		三菱製紙	10	7.3	2,642		三菱ケミカル HLDGS	408.7	442.5	289,041	
わらべや日洋HD	4.1	4.4	6,846		北越コーポレーション	40.5	39.9	14,523		K H ネオケム	10.8	11	27,071	
なとり	3.5	3.9	7,998		中越パルプ	2.6	2.8	4,256		ダイセル	90.2	86.7	70,313	
イフジ産業	1	1	945		巴川製紙	2	2.1	1,942		住友ベークライト	10.6	10.5	30,922	
ビッグルスコーポレーション	1.5	1.5	4,327		大王製紙	29.9	29	40,310		積水化学	131.5	139.9	237,550	
北の達人コーポ	24.6	23.8	13,542		阿波製紙	1.6	2	958		日本ゼオン	55.1	60.2	71,216	
ユウグレナ	26.8	29.4	27,224		レンゴー	63	62.5	50,250		アイカ工業	18.4	19.9	75,520	
ミヨシ油脂	2.4	2.5	2,875		トーモク	3.7	4.1	6,929		宇部興産	30.8	33.4	63,059	
理研ビタミン	3	6.5	14,534		ザ・バック	4.6	5	15,675		積水樹脂	10.1	11.9	26,739	
繊維製品 (0.5%)					化学 (7.4%)					タキロンシーアイ				
片倉工業	8.9	9.2	11,628		クラレ	96.3	104.8	112,869		旭有機材	4.2	3.8	5,316	
グンゼ	4.1	4.9	20,310		旭化成	435.1	439.2	408,324		日立化成	28.3	—	—	
東洋紡	26	26.4	43,876		共和レザー	3.8	3.6	2,347		ニチパン	3.2	3.5	6,121	
ユニチカ	18.1	19.8	7,246		昭和電工	43.5	47.5	98,325		リケンテクノス	16.7	16.6	6,839	
富士紡ホールディングス	3.2	3.2	11,888		住友化学	481.2	488.4	178,266		大倉工業	2.9	3.1	4,839	
倉敷紡績	5.8	6.6	13,391		住友精化	3	3	10,260		積水化成	9.1	8.9	5,366	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
群栄化学	1.6	1.4	3,710		荒川化学工業	5.6	6.1	7,759		日医工	16.5	19.2	23,347	
タイガースポリマー	3.1	3.4	1,472		メック	4.3	4.6	8,740		キッセイ薬品工業	11	12	28,344	
ミライアル	1.8	2.3	2,688		日本高純度化学	1.7	1.8	4,914		生化学工業	12.1	13.2	15,391	
ダイキアクシス	2.2	2.4	2,097		タカラバイオ	16.4	17.8	52,332		栄研化学	11	11.9	25,132	
ダイキョーニシカワ	12.9	14.1	8,093		J C U	8.1	8.2	28,659		日水製薬	2.6	2.8	3,292	
竹本容器	2.2	2.2	2,175		新田ゼラチン	4	4	2,896		鳥居薬品	3.9	4.3	12,900	
森六ホールディングス	3.3	3.6	6,595		O A T アプリオ	1	1.2	1,473		J C R ファーマ	4.4	4.8	59,136	
日本化薬	37.9	41.4	41,565		デクセリアルズ	16.2	17.6	20,380		東和薬品	9	8.6	18,885	
カーリットホールディングス	6.5	6.9	3,677		アース製薬	4.7	4.8	37,680		富士製薬工業	4.3	4.6	6,026	
日本精化	4.9	5.4	9,115		北興化学	6.4	6.6	4,732		沢井製薬	12.8	13.9	78,535	
扶桑化学工業	6.2	6.7	24,388		大成ラミック	2.1	2.2	6,263		ゼリア新薬工業	12.4	12.3	25,374	
トリケミカル	1.4	1.5	17,700		クミアイ化学	25.9	28.1	30,348		第一三共	178.7	193.5	1,888,947	
A D E K A	30.1	30.5	48,708		日本農薬	11.2	12	6,132		キョーリン製薬H D	13.8	15	33,015	
日油	23	24.9	104,331		アキレス	4.3	4.7	8,300		大幸薬品	2.8	8.3	19,828	
新日本理化	10.9	10.7	1,744		有沢製作所	9.9	10.7	10,336		ダイト	3.7	4.2	14,742	
ハリマ化成グループ	5	5.5	6,044		日東電工	43.1	46.7	303,550		大塚ホールディングス	119	140.5	629,861	
花王	149.5	162	1,328,724		レック	6.7	7.2	12,168		大正製薬H D	13.2	14.3	97,383	
第一工業製薬	2.3	2.5	10,750		三光合成	7.2	7.5	2,092		ペプチドリーム	31.6	34.4	149,640	
石原ケミカル	1.6	1.8	4,213		きもと	10.7	12.4	2,083		石油・石炭製品 (0.4%)				
日華化学	2.1	2.2	2,065		藤森工業	5.6	6.1	25,955		日本コークス工業	52.6	56	3,416	
ニイタカ	1	1.4	4,753		前澤化成工業	4.3	4.3	4,403		ニチレキ	8	8	13,872	
三洋化成	4.1	3.9	19,578		未来工業	3.4	3.5	7,290		ユシロ化学	3.2	3.7	4,961	
有機合成薬品	4.8	5.9	2,023		ウェーブロックHLDGS	1.8	2.3	1,757		ビービー・カストロール	2.2	2.4	2,844	
大日本塗料	6.9	7.5	7,710		ジェイ エス ピー	3.7	4	6,320		富士石油	15.3	17.7	3,274	
日本ペイント HOLD	50.5	54.7	603,888		エフピコ	6.9	7.5	64,050		M O R E S C O	2.3	2.3	2,217	
関西ペイント	68.8	74.5	196,680		天馬	4.2	4.5	8,050		出光興産	72.1	74.9	181,108	
神東塗料	5	6.8	1,169		信越ポリマー	11.2	12.2	10,931		ENEOS ホールディングス	1,033	1,014.5	406,814	
中国塗料	20.1	18.8	19,401		東リ	15.6	16.8	4,586		コスモエネルギーHLDGS	18.1	19.7	31,382	
日本特殊塗料	4.6	5	5,070		ニフコ	25	25.1	71,258		ゴム製品 (0.6%)				
藤倉化成	8.2	8.9	5,028		バルカー	5.1	5.5	10,439		横浜ゴム	36.1	39.4	60,715	
太陽ホールディングス	5.1	4.9	27,391		ユニ・チャーム	120.4	143.7	672,084		TOYO TIRE	35.9	35.9	61,604	
D I C	25.8	28.1	73,818		ショーエイコーポ	0.5	0.9	1,141		ブリヂストン	191.9	179.5	611,018	
サカタインクス	13.4	14.6	15,023		医薬品 (6.5%)					住友ゴム	56.1	61.2	58,507	
東洋インキSCホールディン	12.9	13.9	27,494		協和キリン	62.8	68	195,500		藤倉コンボジット	5.5	6.2	2,256	
T & K T O K A	4.7	5.1	4,171		武田薬品	545.3	562.5	2,206,687		オカモト	4.2	4.1	17,445	
富士フイルムHLDGS	129.7	129.7	685,205		アステラス製薬	549.4	586.3	951,858		フコク	2.7	3	2,046	
資生堂	124.1	134.5	835,245		大日本住友製薬	46.3	50.2	69,426		ニッタ	7	7.7	17,586	
ライオン	81.2	88	196,152		塩野義製薬	79.8	85.1	490,941		住友理工	12.1	13.3	7,368	
高砂香料	4.3	4.3	9,210		田辺三菱製薬	65.4	—	—		三ツ星ベルト	8.2	9	15,219	
マンダム	14.1	15.3	28,029		わかもと製薬	7.5	8.5	2,405		バンドー化学	11.9	12	7,356	
ミルボン	8.3	9.1	52,598		あすか製薬	7.7	7.7	11,673		ガラス・土石製品 (0.8%)				
ファンケル	27.8	27.5	91,437		日本新薬	16.3	17.7	152,928		日東紡績	9.3	10.1	45,399	
コーセー	10.6	12.8	165,120		ピオフアルミン製薬	1.1	1.2	2,984		A G C	61.7	62.1	196,546	
コタ	3.3	3.9	5,300		中外製薬	65.1	211.4	1,015,777		日本板硝子	30	32.3	13,113	
シーボン	0.8	0.8	1,565		科研製薬	10.7	11.6	56,260		石塚硝子	1.1	1.2	2,306	
ポーラ・オルビスHD	26.7	29.1	59,422		エーザイ	74.8	81	773,388		日本山村硝子	2.6	2.8	2,632	
ノエビアホールディングス	6	5.8	30,624		ロート製薬	32.1	34.7	125,440		日本電気硝子	25.1	25.5	52,530	
アジupanコスメジャパン	1.4	1.4	1,400		小野薬品	147.5	155.3	521,808		オハラ	2.5	2.7	3,369	
エステー	4.5	4.4	9,526		久光製薬	18.5	17.9	97,376		住友大阪セメント	12.6	12.8	46,208	
アグロカネショウ	2	2.7	4,533		持田製薬	9.4	9.3	37,432		太平洋セメント	39.5	43	120,357	
コニシ	11	11.1	16,894		参天製薬	116.3	126.1	267,458		日本ヒューム	6.2	6.7	5,366	
長谷川香料	8.3	11.7	24,382		扶桑薬品	2.2	2.4	6,960		日本コンクリート	13.4	14.6	4,745	
星光PMC	3.6	3.8	2,538		日本ケミファ	0.8	0.9	2,302		三谷セキサン	2.9	3.1	18,321	
小林製薬	17.5	19	191,900		ツムラ	19.4	21	68,985		アジアパイルHD	8.9	9.6	4,684	

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
東海カーボン	65.4	66.3	75,117		日本軽金属HD	168.1	170.7	30,043		東プレ	11.5	12.6	14,956	
日本カーボン	3.2	3.5	13,510		三井金属	16.7	18.2	48,029		高周波熱錬	11.9	12.9	6,669	
東洋炭素	3.7	4	7,200		東邦亜鉛	3.4	3.4	6,891		東京製鋼	3.8	4.7	2,655	
ノリタケ	3.7	3.8	13,224		三菱マテリアル	40.8	44.2	96,488		サンコール	3.5	4.9	2,200	
TOTO	48.1	48.3	232,564		住友鉱山	84.6	85.5	297,796		モリテックスチル	4.8	5.4	1,598	
日本碍子	76.3	81.6	119,788		DOWAホールディングス	14.4	17	54,485		パイオラックス	9.9	9.9	15,206	
日本特殊陶業	52.7	51.6	96,234		古河機金	10.2	12	13,884		エイチワン	6.1	6.4	3,699	
ダントーホールディングス	4.9	6.3	2,979		エス・サイエンス	27.6	37.6	1,729		日本発条	61.6	72	48,816	
MARUWA	2.2	2.6	24,206		大阪チタニウム	7.2	6.9	6,285		中央発條	0.7	0.7	2,096	
品川リフラクトリーズ	1.6	1.7	4,217		東邦チタニウム	11.1	12	8,208		アドバネクス	0.8	0.9	1,480	
黒崎播磨	1.2	1.3	3,854		UACJ	9.4	10.2	18,961		立川ブラインド	2.7	3	4,005	
ヨータイ	5.5	5.3	3,927		CKサンエツ	1.2	1.4	5,236		三益半導体	5.4	5.3	13,515	
インソライト	3.2	3.4	1,577		古河電工	17.8	20.9	53,065		機械 (5.4%)				
東京窯業	8	8.4	2,788		住友電工	230.7	250.1	307,623		日本ドライケミカル	1.7	1.7	2,660	
ニッカトー	2.8	3	2,160		フジクラ	74.8	81.2	24,847		日本製鋼所	18.8	20.4	36,393	
フジミインコーポレーテッド	5.6	6.1	22,753		昭和電線 HLDGS	7.2	7.8	9,336		三浦工業	26.7	28.9	137,853	
クニミネ工業	2.8	2.8	3,021		東京特殊電線	0.8	1	2,418		タクマ	22.5	22.7	40,360	
エーアンドエーマテリアル	1.2	1.1	1,221		タツタ電線	12.2	13.3	8,485		ツガミ	13.9	13.9	16,624	
ニチアス	17.1	18.6	46,481		カナレ電気	1.1	1.1	1,958		オークマ	7.9	7.9	40,764	
ニチハ	8.7	9.5	30,162		平河ヒューテック	2.6	3.3	3,333		芝浦機械	7	7.6	17,343	
鉄鋼 (0.6%)					リョービ	7.6	8.3	10,184		アマダ	92.7	83.3	85,299	
日本製鉄	286.9	299.9	310,396		アーレステイ	7.6	8.6	2,881		アイダエンジニア	16.7	17.7	12,797	
神戸製鋼所	113.2	123.2	51,128		アサヒHD	11.6	11.8	42,598		滝澤鉄工所	1.9	2	2,138	
中山製鋼所	8.5	8.7	3,079		金属製品 (0.6%)					FUJII	24.7	29	60,929	
合同製鐵	3	3.6	7,527		稲葉製作所	3.5	3.7	5,076		牧野フライス	7.2	7.9	31,323	
JFEホールディングス	166.8	181.8	142,349		宮地エンジニアリングG	1.9	2	3,350		オーエスジー	28.5	31.2	52,135	
東京製鐵	33.1	32.6	23,635		トーカロ	16	18.7	20,570		ダイジェット	0.7	0.7	996	
共英製鋼	7	7.6	10,678		アルファCO	2.2	2.2	2,206		旭ダイヤモンド	16.2	17.6	9,028	
大和工業	13.1	14.2	37,843		SUMCO	74	80.1	117,106		DMG森精機	39.1	42.6	64,965	
東京鐵鋼	2.5	2.7	4,625		川田テクノロジーズ	1.4	1.4	6,888		ソディック	14.5	15.4	11,550	
大阪製鐵	4.1	3.6	3,898		RS TECHNOLOGIES	1.7	1.9	6,574		ディスコ	8.4	9.1	233,688	
淀川製鋼所	8.3	8.9	16,438		信和	3.3	3.6	2,566		日東工器	3.4	3.7	7,758	
丸一鋼管	21.9	21.7	61,736		東洋製罐グループHD	39.3	42.9	45,988		日進工具	1.8	2.6	5,933	
モリ工業	1.9	2	5,126		ホッカンホールディングス	3.1	3.7	5,472		パンチ工業	4.3	5.9	2,430	
大同特殊鋼	10.1	11.1	37,018		コロナ	3.4	3.4	3,525		富士ダイス	2.7	2.9	1,980	
日本高周波	2.2	2.4	837		横河ブリッジHLDGS	11.5	12.5	24,562		豊和工業	3.4	3.9	3,295	
日本冶金工	51.2	5.5	8,926		駒井ハルテック	1.2	1.2	1,878		OKK	2.5	2.7	1,055	
山陽特殊製鋼	7.8	4.6	4,531		高田機工	0.6	0.6	1,512		石川製作所	1.5	1.7	3,150	
愛知製鋼	3.5	3.6	9,270		三和ホールディングス	63.8	63.4	74,558		東洋機械金属	4.4	4.6	1,913	
日立金属	66.5	72.1	118,532		文化シャッター	18.2	19.8	16,394		津田駒工業	1.2	1.2	994	
日本金属	1.5	1.6	979		三協立山	8.6	8.7	9,204		エンシュウ	1.6	1.5	1,408	
大平洋金属	4.2	4.5	7,533		アルインコ	4.9	4.9	4,797		島精機製作所	8.5	10.6	17,511	
新日本電工	40	43.6	9,635		東洋シャッター	1.5	1.7	1,324		オプトラン	6.9	7.5	16,282	
栗本鉄工所	3.1	3.3	6,649		LIXILグループ	91.2	98.8	205,701		NCホールディングス	2	2	1,250	
虹技	0.9	1	1,398		日本フィルコン	4.7	5	2,895		イワキポンプ	2.6	4.2	3,960	
日本鋳鉄管	0.6	0.8	999		ノーリツ	12.8	14	20,678		フリーユ	5	6.5	7,618	
三菱製鋼	4.6	4.9	2,881		長府製作所	6.3	6.8	14,558		ヤマシンフィルタ	10.8	14.6	15,607	
日亜鋼業	9	9.6	3,014		リンナイ	11	13.1	131,917		日阪製作所	7.6	8.4	7,266	
日本精線	0.9	1.1	3,784		ダイニチ工業	3.3	3.5	2,628		やまびこ	12	13	16,146	
エンビプロHD	2.3	3	1,737		日東精工	8.5	9.2	4,462		平田機工	2.9	3.2	20,192	
シンニッタン	9.6	10.4	2,360		三洋工業	0.8	0.8	1,574		ベガサスミシン製造	5.8	6.6	1,980	
新家工業	1.4	1.5	1,699		岡部	12.5	13.7	10,946		マルエエ	2.5	2.7	2,648	
非鉄金属 (0.7%)					ジーテクト	6.8	8.4	10,180		タツモ	2.9	3.1	4,603	
大紀アルミニウム	10.1	11	6,259		中国工業	1	—	—		ナプテスコ	36.4	39.5	149,112	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
三井海洋開発	6.6	7.1	11,984		加藤製作所	3.2	3.7	4,184		三菱電機	624.6	676.1	993,867	
レオン自動機	6.1	6.6	7,253		油研工業	1	1.1	1,714		富士電機	40.5	41	139,400	
S M C	18.3	21.2	1,232,144		タダノ	30.2	32.8	27,552		東洋電機製造	2.5	2.4	2,784	
ヤマハモーターロボHLDGS	4.7	—	—		フジテック	22.7	24.8	57,982		安川電機	72.4	72.9	290,506	
ホソカワミクロン	2.2	2.4	13,848		C K D	17.4	18.7	30,686		シンフォニアテクノロジー	8.7	8.8	9,952	
ユニオンツール	2.3	2.5	7,800		キトー	4.7	5.2	6,323		明電舎	12.4	12.5	20,850	
オイレス工業	8.7	8.8	13,340		平和	17.4	18.7	34,426		オリジン	1.7	1.8	2,419	
日精エーエスピー	2.1	2	8,280		理想科学工業	5.5	6	8,622		山洋電気	3	3.3	16,269	
サトーホールディングス	7.5	9.6	20,976		S A N K Y O	15.6	15	43,410		デンヨー	5.7	5.8	14,436	
技研製作所	5.4	5.9	23,423		日本金銭機械	6.9	7.3	4,255		東芝テック	7.8	8.5	38,292	
日本エアーテック	1.9	2.3	3,148		マースグループHLDGS	4	4.2	7,614		芝浦メカトロニクス	1.1	1.2	3,780	
カワタ	1.7	1.9	1,749		フクシマガリレイ	3.9	4.2	16,380		マブチモーター	17.3	18.8	76,892	
日精樹脂工業	5.2	5.6	4,950		オーイズミ	2.6	2.8	1,097		日本電産	75.2	162.7	1,576,237	
オカダアイヨン	2.1	2	2,042		ダイコク電機	2.9	3.1	3,369		ユーエムシーエレクトロニクス	3.4	4.2	1,465	
ワイエイシホールディングス	2.5	2.8	1,887		竹内製作所	10.5	11.4	23,541		トレックス・セミコンダクター	2.8	3.9	4,722	
小松製作所	282.8	306.9	728,734		アマノ	17.9	17.8	43,823		東光高岳	3.2	3.7	3,999	
住友重機械	35.7	39	98,046		J U K I	8.7	9.3	4,268		ダブル・スコープ	8.6	10.7	9,983	
日立建機	25	27.3	100,600		サンデンホールディングス	7.7	9	2,934		宮越ホールディングス	2.3	2.7	1,965	
日工	1.7	9.2	6,624		蛇の目ミシン	5.8	6	3,882		ダイヘン	6.8	7.5	32,137	
巴工業	2.7	2.7	5,305		マックス	9.5	10.4	16,296		ヤーマン	9.1	11.1	18,625	
井関農機	6.3	6.8	9,329		グローリー	17.4	17.5	41,982		J V C ケンウッド	47.8	55.1	8,430	
T O W A	5.4	6.8	7,969		新晃工業	5.8	6.3	9,519		ミマキエンジニアリング	5.6	6	2,616	
丸山製作所	1.3	1.8	2,530		大和冷機工業	9	9.8	9,163		I - P E X	2.3	2.8	6,344	
北川鉄工所	2.8	3	4,587		セガサミーホールディングス	61.9	67.1	89,108		日新電機	14.6	16	17,552	
ローツェ	2.7	3	14,985		日本ビストンリング	2.3	2.4	2,496		大崎電気	12.4	13.3	8,126	
タカキタ	2.2	2.5	1,890		リケン	2.9	3.1	7,967		オムロン	66.4	60.6	488,436	
クボタ	334.7	359	660,201		T P R	8.4	9.1	11,884		日東工業	10	10	20,860	
荏原実業	1.6	1.7	5,064		ツバキ・ナカシマ	12.8	13.8	11,095		I D E C	8.4	9.8	19,208	
三菱化工機	2.2	2.3	4,291		ホシザキ	18.3	19.9	166,762		正興電機製作所	1.4	1.8	1,927	
月島機械	12.4	12.6	16,972		大豊工業	5.1	5.4	3,083		不二電機工業	0.7	1	1,321	
帝国電機製作所	4.4	5.6	6,244		日本精工	128.4	128.4	107,984		ジーエス・ユアサコーポ	22.5	22.7	41,858	
東京機械	2.4	3.1	892		N T N	134.6	157.3	33,033		サクサホールディングス	1.6	1.5	2,238	
新東工業	14.8	16.2	11,842		ジェイテクト	59.9	65.5	55,413		メルコホールディングス	2.6	2.3	5,708	
渋谷工業	5.4	5.9	21,210		不二越	5.8	6.4	23,712		テクノメディカ	1.4	1.5	2,766	
アイチ コーポレーション	10.8	11.8	10,407		日本トムソン	18.6	19.9	7,800		ダイヤモンドエレクトリックHD	—	1.4	1,062	
小森コーポレーション	15.8	17.3	12,888		T H K	36.3	39.6	105,296		日本電気	80.9	82	484,620	
鶴見製作所	4.9	5.1	9,154		ユースン精機	4.8	5.3	3,826		富士通	60.2	65.2	937,576	
住友精密	1	1	2,387		前澤給装工業	2.4	2.4	4,977		沖電気	27.1	27.7	29,472	
日本ギア工業	1.7	2.4	715		イーグル工業	7.7	8.5	6,936		岩崎通信機	2.9	2.9	2,438	
酒井重工業	1.2	1.2	2,880		前澤工業	4.2	4	1,904		電気興業	3.3	3.3	8,844	
荏原製作所	27.7	28.1	80,815		日本ピラー工業	6.3	6.8	10,750		サンケン電気	7.3	7.4	17,826	
石井鉄工所	0.9	0.9	2,460		キッツ	25.4	27.7	17,063		ナカオ	1.2	1.3	1,898	
西島製作所	6.4	6.8	5,650		マキタ	76	88.2	441,000		アイホン	3.5	3.8	5,779	
北越工業	6.4	7	7,665		日立造船	49.6	53.6	24,012		ルネサスエレクトロニクス	297.4	290.1	221,346	
ダイキン工業	85.3	86.2	1,682,624		三菱重工業	104.7	113.9	281,219		セイコーエプソン	77.6	84.4	104,571	
オルガノ	2.2	2.4	13,512		I H I	48	49.1	71,980		ワコム	45.3	45.8	32,609	
トーヨーカネツ	2.4	3	6,777		スター精密	9.8	10.5	14,952		アルバック	12.5	12.5	48,187	
栗田工業	33.8	36.7	130,468		電気機器 (15.3%)					アクセル	2.6	2.7	2,451	
椿本チエイン	8.2	9.8	24,705		日清紡ホールディングス	41.7	42.4	31,248		E I Z O	5.7	5.3	21,094	
大同工業	3	3.2	1,955		イビデン	38.3	41.5	150,852		ジャパンディスプレイ	61.7	61.7	3,640	
木村化工機	5.2	5.7	2,473		コニカミノルタ	136.7	148.9	44,967		日本信号	15.9	17.4	18,200	
アネスト岩田	9.7	10.6	8,882		ブラザー工業	81.5	83.1	140,937		京三製作所	13.4	15.8	7,710	
ダイフク	34.4	34.7	352,552		ミネベアミツミ	115.9	125.9	254,443		能美防災	8.2	9	20,448	
サムコ	1.7	1.9	5,403		日立	281.1	325	1,198,925		ホーチキ	4	4.9	6,389	

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
星和電機	3.3	3.5	2,124		オブテックスグループ	10.3	11.2	17,248		川崎重工業	48.7	53	78,599	
エレコム	5.9	7.6	38,760		千代田インテグレ	2.9	2.9	4,787		名村造船所	18.9	22.2	3,663	
パナソニック	714.1	773.4	716,477		アイ・オー・データ	2.3	2.3	2,472		サノヤスホールディングス	8.3	9.4	1,569	
シャープ	62.1	78.8	103,779		レーザーテック	12.8	29.8	255,982		日本車輻	2.3	2.5	7,107	
アンリツ	40.2	43.6	98,318		スタンレー電気	44.1	47.5	142,975		三菱ロジスネクスト	10.3	9	8,577	
富士通ゼネラル	19.1	18.5	55,500		岩崎電気	2.4	2.6	3,926		近畿車輻	1	1	1,357	
ソニー	419.2	423.6	3,475,214		ウシオ電機	36.3	37.6	49,707		日産自動車	736.8	799.9	297,562	
T D K	32.7	32.7	381,282		岡谷電機	4.5	5.2	1,877		いすゞ自動車	197.5	196.8	186,763	
帝国通信工業	2.7	3	3,690		ヘリオステクノH	5.8	6.3	2,060		トヨタ自動車	695.9	754.3	5,341,198	
タムラ製作所	24.1	22.7	12,189		エノモト	1.7	2	2,114		日野自動車	78	85.1	55,995	
アルプスアルパイン	65.1	60.3	92,078		日本セラミック	6.3	6.9	18,471		三菱自動車工業	231.5	252.4	58,809	
池上通信機	2	2.1	1,785		遠藤照明	3.2	3.3	2,194		エフテック	4.4	4.8	2,404	
日本電波工業	5.7	6.3	2,299		古河電池	4.5	4.8	5,059		レシップホールディングス	2.5	2.6	1,591	
鈴木	3.3	3.3	2,303		双信電機	3	3.3	1,428		GMB	1.2	1.5	972	
日本トリム	1.2	0.9	3,384		山一電機	4.5	4.9	6,561		ファルテック	1.1	1.4	869	
ローランドディー・ジー	3.4	3.7	4,787		図研	4.1	4.4	12,826		武蔵精密工業	15.2	15.1	15,251	
フオスター電機	7.1	7.1	8,165		日本電子	12.3	13.4	46,766		日産車体	12.2	13.3	11,890	
S M K	1.7	1.7	4,571		カシオ	55.4	60.3	100,881		新明和工業	26.1	18.3	16,817	
ヨコオ	4.5	4.4	11,932		ファナック	59.3	63.6	1,298,712		極東開発工業	12.4	12.6	17,110	
ティアック	4.5	4.9	622		日本シイエムケイ	15.9	15.9	7,997		日信工業	11.4	13.3	29,845	
ホシデン	18.3	18.6	18,283		エンプラス	2.8	3.5	7,801		トピー工業	5.2	5.6	6,580	
ヒロセ電機	8.9	10.4	139,984		大真空	2.3	2.5	4,642		ティラド	2.3	2.4	3,232	
日本航空電子	14.3	15.6	23,181		ローム	29.9	28.2	223,062		タチエス	10.3	11.1	10,545	
T O A	6.7	7.3	6,059		浜松ホトニクス	44.8	48.5	253,655		N O K	33.6	36.6	41,065	
マクセルホールディングス	13.5	14.6	15,943		三井ハイテック	6.9	7.5	15,615		フタバ産業	17.4	18.9	10,017	
古野電気	8	8.7	8,813		新光電気工業	21	22.9	40,304		K Y B	6.5	7.6	15,944	
ユニデンホールディングス	1.8	1.9	2,998		京セラ	95.2	95	585,865		大同メタル工業	10.2	13.1	6,916	
スミダコーポレーション	4.8	5.2	3,790		太陽誘電	27.8	30.2	98,603		プレス工業	30.9	33.6	9,710	
アイコム	3.4	3.8	10,400		村田製作所	196.6	198.6	1,353,856		ミクニ	7.9	8.4	2,335	
リオン	2.9	2.8	6,711		双葉電子工業	9.9	10.8	10,292		太平洋工業	13.1	14.3	14,085	
本多通信工業	5.3	5.8	2,917		北陸電気工業	2.3	2.7	2,632		ケーヒン	14.3	15	38,880	
船井電機	6.3	6.8	3,209		ニチコン	19.7	23.1	19,011		河西工業	7.7	9.2	3,192	
横河電機	62.5	62.5	104,812		日本ケミコン	4.4	5.1	7,282		アイシン精機	51.4	55.7	183,253	
新電元工業	2.2	2.4	4,663		K O A	9.4	10.2	11,169		マツダ	196	200.4	126,252	
アズビル	39.4	42.9	154,225		市光工業	9.4	10.2	4,661		今仙電機製作所	5.7	6.1	4,135	
東亜ディーケーケー	3.1	3.3	3,026		小糸製作所	37.4	40.6	222,082		本田技研	526.8	532.4	1,352,029	
日本光電工業	27.5	28	94,920		ミツバ	11.5	12.4	4,836		スズキ	114.3	134.2	556,661	
チノー	2.2	2.3	3,171		SCREEN ホールディングス	10.9	11.8	65,254		S U B A R U	193.9	210.2	434,693	
共和電業	6.5	6.9	3,070		キャノン電子	6.5	6.1	8,869		安永	3	3.3	3,857	
日本電子材料	2.5	2.7	5,470		キャノン	336.4	336.3	579,781		ヤマハ発動機	81.4	88.9	139,839	
堀場製作所	12.4	13.5	74,655		リコー	188.2	173.2	123,664		ショーワ	14.7	15.4	35,312	
アドバンテスト	42.6	50.5	263,610		象印マホービン	18.3	18.4	31,960		T B K	7.4	7.9	3,713	
小野測器	2.6	2.7	1,455		MUTOH ホールディングス	0.9	1	1,508		エクセディ	8.5	9.3	12,582	
エスベック	5.5	6	11,118		東京エレクトロン	41.6	43	1,157,560		豊田合成	20.2	22	51,348	
キーエンス	30.7	61.3	2,838,803		輸送用機器 (7.0%)					愛三工業	9.8	10.6	5,035	
日置電機	3.3	3.3	12,771		トヨタ紡織	21.8	19.8	29,403		盟和産業	1	1	1,003	
シスメックス	48.7	48.3	482,661		芦森工業	1.3	1.3	1,147		日本プラスト	4.9	5	2,105	
日本マイクロニクス	10.9	11.8	13,263		ユニプレス	12.1	13.2	11,576		ヨロズ	5.9	6.4	6,502	
メガチップス	4.9	6.3	17,268		豊田自動織機	50.6	54.8	356,748		エフ・シー・シー	11.2	11.2	21,716	
OBARA GROUP	3.2	4	14,800		モリタホールディングス	10.9	12	23,808		シマノ	23.4	25.3	540,155	
澤藤電機	0.8	0.9	1,822		三桜工業	8	8.6	5,056		ティ・エス テック	14.5	15.7	48,277	
原田工業	2.5	3.2	2,921		デンソー	137.5	148.8	681,504		ジャムコ	3.1	3.3	2,240	
コーセル	7.6	9	9,990		東海理化電機	16.3	18	28,530		精密機器 (2.7%)				
イリソ電子工業	5.7	5.7	24,225		三井 E&SHD	21.7	21.7	8,680		テルモ	176.7	191.4	793,353	

銘柄	期 首		当 期 末		銘柄	期 首		当 期 末		銘柄	期 首		当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数		株 数	評 価 額	株 数	株 数		評 価 額	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円		千株	千株	千円			千株	千株	千円			
クリエートメディック	2.1	2.1	2,192		23.8	—	—			3	3.3	14,998			
日機装	18.7	20.4	22,664		2.5	2.6	1,682			陸運業 (3.8%)					
日本エム・ディ・エム	3.6	3.9	8,634		5.4	5.8	6,623			SBSホールディングス	5.4	5.1	10,980		
島津製作所	80.4	80.9	264,543		3.7	5.7	684			東武鉄道	65.9	70.4	237,600		
JMS	5.7	5.7	5,118		2.1	2.4	3,129			相鉄ホールディングス	21.5	21.6	63,504		
クボテック	1.3	1.9	651		4.7	4.6	8,109			東急	169.7	170.5	244,838		
長野計器	4.9	5	4,420		92.8	95.9	152,097			京浜急行	85.6	87.1	145,805		
バイ・テクノロジー	2.9	3.2	13,776		88	88.8	196,248			小田急電鉄	100.1	100.5	269,239		
東京計器	4	4.2	3,960		1.9	2.1	5,619			京王電鉄	34.9	35.1	231,309		
愛知時計	0.8	0.9	3,861		12.9	13.9	18,334			京成電鉄	46.8	47.1	145,303		
インターアクション	3.4	3.6	7,232		0.5	0.6	989			富士急行	8.5	9.3	36,688		
オーバル	6.1	6.4	1,529		3	3.3	7,477			新京成電鉄	1.6	1.7	4,301		
東京精密	11.3	12.4	41,230		51.6	56.2	78,904			東日本旅客鉄道	109.9	119	815,150		
マニー	24.9	27	76,680		2	2.1	4,819			西日本旅客鉄道	55.6	60.4	342,468		
ニコン	108.8	104.1	74,639		1.9	1.9	3,515			東海旅客鉄道	55.9	56.2	904,258		
トプコン	33.6	34.3	32,447		37.2	40.3	205,530			西武ホールディングス	77.4	88.9	115,214		
オリンパス	372.2	374.2	778,710		1.9	2.1	5,833			鴻池運輸	9.9	10.9	12,774		
理研計器	5.5	6	17,346		5.8	6.3	3,263			西日本鉄道	17.4	18.8	61,194		
タムロン	5	5.5	9,097		37.7	41.2	191,580			ハマキョウレックス	4.8	5.2	17,134		
HOYA	125.7	134.1	1,568,299		—	1.4	3,570			サカイ引越センター	3.3	3.6	18,216		
シード	2.7	2.9	2,108		0.4	0.4	643			近鉄グループHLDGS	59.2	64.1	307,039		
ノーリツ銅機	4.9	4.6	7,732		5.2	5.7	5,124			阪急阪神HLDGS	78.9	85.4	303,597		
エー・アンド・デイ	5.7	6.1	4,080		14.8	16.1	40,121			南海電鉄	26.5	30.5	73,383		
朝日インテック	53	76.6	236,311		11.7	14.4	5,241			京阪ホールディングス	26.3	28.5	128,962		
シチズン時計	68.5	79.6	24,755		35.7	41.5	2,507,430			神戸電鉄	1.5	1.5	5,835		
リズム時計	2.1	2.1	1,352		10.3	11.3	15,390			名古屋鉄道	48.6	52.4	156,571		
大研医器	5	5.1	2,866		12.9	13.7	18,878			山陽電鉄	4.6	4.7	10,711		
メニコン	8.6	9.6	67,488		29.9	32.3	42,409			日本通運	22.8	22.2	138,306		
シンシア	0.7	0.9	366		6.1	6.6	4,375			ヤマトホールディングス	103.8	112.3	303,883		
松風	3	3	4,443		3	3	9,555			山九	16.4	17.8	80,100		
セイコーHD	9.7	9.6	14,371		21.8	23.5	17,883			丸運	3.2	3.5	850		
ニプロ	43.3	46.9	58,484		6.2	6.2	12,108			丸全昭和運輸	4.8	5.2	17,732		
その他製品 (2.8%)					電気・ガス業 (1.4%)					センコグループHLDGS	32.6	34.9	34,341		
中本パックス	1.7	1.6	2,537		498.4	542	162,600			トナミホールディングス	1.4	1.5	9,210		
スノーピーク	2.8	3.5	6,636		191	205.8	277,109			ニッコンホールディングス	22.4	22.9	54,387		
パラマウントベッドHD	7.2	7.1	30,814		254.8	255.9	270,486			日石輸送	0.7	0.6	1,589		
トランザクション	4	4.4	5,064		86.3	97.1	131,279			福山通運	7.6	8.2	43,214		
粧美堂	1.8	2	804		61.4	62.2	48,578			セイノーホールディングス	44.3	47.9	76,448		
ニホンフラッシュ	2.7	6.3	8,820		146.4	168.3	183,278			エスライン	1.8	1.7	1,659		
前田工織	6.9	7.5	20,115		56.3	61.1	50,163			神奈川中央交通	1.5	1.5	6,322		
永大産業	8.3	8.6	2,812		128.8	139.3	135,121			日立物流	13	11.7	43,816		
アートネイチャー	6.6	7.2	4,795		58.5	63.7	28,728			丸和運輸機関	3.1	6.8	27,676		
パナダイナムコHLDGS	64.6	69.9	507,334		11.6	13.2	22,440			C&Fロジホールディングス	6	6.5	11,433		
アイフィスジャパン	1.5	1.8	1,405		49.7	54	90,180			九州旅客鉄道	49.6	56.3	130,672		
共立印刷	10.4	11.3	1,536		3	3.7	2,390			SGホールディングス	55.9	67.2	324,912		
SHOEI	3	6	21,330		10.9	9.7	10,456			海運業 (0.2%)					
フランスベッドHLDGS	8.8	9.2	8,040		10.3	11.3	12,181			日本郵船	49.5	53.7	101,224		
パイロットコーポレーション	10.9	11.1	34,687		120.1	130.1	313,931			商船三井	35.1	40.7	91,859		
萩原工業	3.5	3.7	5,920		121.1	131.5	273,914			川崎汽船	18.3	19.8	25,047		
トッパン・フォームズ	13.4	14.6	14,278		31	33.3	169,164			NSユニテッド海運	3.3	3.6	5,198		
フジシールインターナショナル	14	15.3	30,171		3.3	3.6	5,677			明治海運	6.3	6.6	2,402		
タカラトミー	26.2	30.5	27,694		12.8	13	4,836			飯野海運	28.1	30.2	11,264		
廣済堂	5.8	4.9	3,371		7	7.6	20,474			共栄タンカー	0.5	1.2	927		
エステルホールディングス	1.6	2	1,370		17.7	19.3	17,543			乾汽船	5.3	3.7	3,293		

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
空運業 (0.4%)				ポルトウウィン・ピットフル	8.2	8	7,664	メディカル・データ・ビジ	4.7	5	10,260
日本航空	108.2	113.5	238,123	イーブクインシアティブ	1	0.9	2,952	gumi	7.9	8.6	8,892
ANAホールディングス	108	117.3	326,563	ネクソン	173.9	167.2	448,096	ショーケース	1.3	1.6	1,684
パスコ	1.1	1.3	1,820	アイスタイル	15.8	18.4	5,704	モバイルファクトリー	1.4	1.6	2,089
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				エムアップホールディングス	2.1	1.9	6,213	テラスカイ	1	2.4	11,808
トランコム	1.7	1.8	13,680	エイチーム	4.3	4.5	3,681	デジタル・インフォメーション	2.7	2.9	3,888
日新	5.1	5.6	9,066	エニグモ	4.4	6.3	11,176	PCIホールディングス	1.3	2.8	3,628
三菱倉庫	20.5	20.4	62,118	テクノスジャパン	5.2	5.3	5,146	パイプドHD	1	0.9	1,699
三井倉庫HOLD	7.3	7.4	14,326	enish	2.7	3.5	2,152	アイビーシー	1.1	1.4	1,562
住友倉庫	21.7	23	31,418	コロプラ	20.1	21.9	20,148	ネオジャパン	1.2	1.2	2,571
渋沢倉庫	3.2	3.5	8,155	オルトプラス	4.1	4.6	2,451	PRTIME S	0.5	1.2	3,012
東陽倉庫	10.7	11.3	3,966	ブロードリーフ	30.4	32.9	18,226	ランドコンピュータ	0.9	1	1,071
日本トランスシティ	13	13.8	7,948	クロス・マーケティングG	2.6	3.2	1,190	ダブルスタンダード	0.5	0.9	4,527
ケイヒン	1.1	0.9	1,255	デジタルハーツHLDGS	2.8	3.7	3,992	オープンドア	3	3.4	4,804
中央倉庫	3.6	3.9	4,602	システム情報	3.1	4.9	7,021	マイネット	2	2.1	3,047
川西倉庫	1.2	1.1	1,257	メディアドゥ	2.2	2.1	16,296	アカツキ	2.2	2.4	10,752
安田倉庫	4.8	5.1	4,845	じげん	8.7	16.5	5,709	ベネフィットジャパン	0.4	0.5	956
ファイズホールディングス	1.1	1.4	1,614	ブイキューブ	3.3	3.7	6,626	UBICOMホールディングス	1.1	1.6	3,648
東洋埠頭	1.8	2	2,938	エンカレッジ・テクノロジー	0.8	1.3	1,171	LINE	14.1	20.4	109,344
宇徳	5	5.5	2,722	サイバーリンクス	0.9	1.2	2,826	カナミックネットワーク	3.7	6	4,860
上組	36.4	35.7	77,076	ディー・エル・イー	4.3	4.3	1,913	ノムラシステムコーポレーション	1.4	3.6	1,544
サンリツ	1.4	1.5	948	フィックスターズ	6.5	7.1	7,533	チェンジ	1.2	4.6	52,486
キムラユニティー	1.6	1.6	1,772	CARTA HOLDINGS	3	3.1	3,822	シンクロ・フード	2.6	2.7	909
キューソー流通システム	1.5	1.6	2,483	オブティム	2.7	3.5	11,200	オークネット	3.4	3.6	4,752
近鉄エクスプレス	11.2	13.7	30,277	セレス	2	2.3	5,207	セグエグループ	0.2	1.3	1,950
東海運	3.4	3.6	1,076	S H I F T	—	2.7	41,175	エイトレッド	0.7	1.1	2,538
エーアイティー	3.8	4.5	4,824	ティーガイア	4.4	5.9	11,918	AOI TYO HOLDINGS	6.2	6.7	2,793
内外トランスライン	2.1	2.1	2,608	セック	1	1	3,185	マクロミル	10.9	13.5	10,827
日本コンセプト	1.9	2	2,958	日本アジアグループ	6.5	7.3	2,292	ビーグリー	1.3	1.3	2,635
情報・通信業 (9.8%)				豆蔵ホールディングス	4.2	—	—	オロ	1.6	1.7	5,788
NECネットエスアイ	6.8	18.9	39,123	テクマトリックス	4.3	9.4	21,507	ユーザーローカル	—	0.6	2,643
クロスキャット	1.6	1.8	2,606	プロシップ	1.8	1.9	3,045	テモナ	0.8	1.3	1,765
システナ	21.9	23.7	45,551	ガンホー・オンライン・エンター	14.8	16.1	37,657	ニーズウェル	0.4	1	880
デジタルアーツ	3.3	3.3	27,390	GMOペイメントゲートウェイ	10.1	14.1	152,985	サインポスト	0.9	1.3	1,790
日鉄ソリューションズ	9.2	9.9	31,680	ザッパラス	3	2.9	1,374	ソルクシーズ	2.6	3	3,438
キューブシステム	3.3	3.5	4,721	システムリサーチ	0.8	1.8	3,367	フェイス	2.4	2.3	2,490
エイジア	1.2	1.4	3,221	インターネットインシアティブ	10	9.9	47,421	プロトコポレーション	5.5	6	7,536
コア	2.6	2.8	3,911	さくらインターネット	7.3	7	5,670	ハイマックス	0.7	0.8	1,908
ラークンホールディングス	3	3.2	6,723	ヴィンクス	1.7	1.9	2,490	野村総合研究所	116.9	94	301,740
ソリトンシステムズ	2.7	3.1	6,590	GMOグローバルサインHD	1.1	1.2	11,196	サイバネットシステム	4.4	5.1	4,523
ソフトクリエイトHD	2.7	2.9	7,911	SRAホールディングス	3.3	3.6	8,636	C Eホールディングス	1.8	4	2,704
T I S	20.4	66.3	148,445	MINORIソリューションズ	1.2	—	—	日本システム技術	1	1.2	2,260
JNSホールディングス	2.5	2.8	2,200	システムインテグレーター	1.7	2.3	1,676	インテジールホールディングス	7.7	8.4	7,946
電算システム	2.3	2.5	9,087	朝日ネット	4.9	4.7	4,601	東邦システムサイエンス	1.8	1.7	1,666
グリー	42.5	40.9	19,386	e B A S E	3.7	8	10,992	ソースネクスト	23.8	31.6	10,870
コエーテックモHD	12.5	13.6	66,640	アバント	2.2	6.3	6,652	インフォコム	6.7	7.3	29,455
三菱総合研究所	2.6	2.9	12,948	アドソル日進	2.2	2.4	6,230	H E R O Z	—	0.9	3,415
ボルテージ	1.2	1.9	1,046	フリービット	3.7	3.7	3,378	ラクスル	—	5.3	23,505
電算	0.7	0.7	1,649	コムチュア	3.4	7.5	20,325	F I G	6.4	7.7	2,094
AGS	3.5	3.7	3,426	サイバーコム	1.1	1.2	2,275	システムサポート	—	1.4	2,499
ファインデックス	5.2	5.7	7,717	アステリア	4.1	4.4	3,603	イーソル	—	3.1	3,785
ブレインパッド	1.2	1.7	7,539	アイル	1	3.7	5,646	アルテリア・ネットワークス	6.8	7.4	13,423
K L a b	11.8	12.6	11,793	マークラインズ	3.1	3.2	7,228	東海ソフト	—	0.4	538

銘柄	期首株数	当期末株数	当期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	当期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	当期末評価額
千株	千株	千円	千株	千株	千円	千株	千円	千株	千株	千円	千円
ヒト・コミュニケーションズHD	1.4	1.6	2,121	USEN—NEXT HLDGS	2.3	2.6	3,169	フィールズ	5.4	4.9	1,631
トビラシシステムズ	—	0.8	1,659	ワイヤレスゲート	2.7	3.2	2,384	双日	340	368.1	91,656
フォーカスシステムズ	4.2	4.2	4,288	コネクシオ	4.4	3.8	4,601	アルフレッサホールディングス	68.3	73.9	174,477
フレスコ	1.9	4	5,280	日本通信	53.8	51.7	11,839	横浜冷凍	17.3	17.5	16,240
フジ・メディア・HD	63.6	64.4	67,620	クロップス	1.1	1.3	1,004	神栄	0.8	1	658
オービック	21.3	23	431,020	日本電信電話	419.2	886.5	1,985,316	ラサ商事	3.3	3.4	3,134
ジャストシステム	8.7	10.8	79,920	KDDI	502.4	483.8	1,332,627	アルコニック	6.5	7.1	11,026
TDCソフト	5.4	5.9	6,254	ソフトバンク	649.9	607.9	772,336	神戸物産	10.6	23	127,650
Zホールディングス	399.9	912.6	629,694	光通信	7.2	6.8	165,036	ハイパー	—	0.9	505
トレンドマイクロ	27.3	35.5	229,685	NTTドコモ	388	474.3	1,282,981	あいホールディングス	8.8	9.5	18,012
IDホールディングス	2.4	2.5	3,750	エムティーアイ	6	6.4	5,395	ディービーエックス	2.4	2.3	2,295
日本オラクル	12.4	13.4	172,458	GMOインターネット	24.2	24	65,424	ダイワボウHD	5.6	5.7	37,563
アルファシステムズ	1.9	2.1	7,980	ファイバーゲート	1.2	2.1	3,885	マクニカ・富士エレHLDGS	17.1	15.9	31,179
フューチャー	7.4	8	18,384	アйдママーケティングコミュ	1.3	2.1	928	ラクト・ジャパン	2.3	2.5	9,287
CAC HOLDINGS	4	4.4	6,384	KADOKAWA	17.9	18	50,076	バイタルKSKHD	11.5	11.5	12,650
SBCテクノロジー	2.6	2.4	8,724	学研ホールディングス	2.1	8.9	14,498	八洲電機	4.9	5.1	5,181
トーセ	1.7	1.8	1,632	ゼンリン	12.3	13.3	15,135	メディアスホールディングス	3.5	3.7	3,304
オービックビジネスC	6.3	6.8	41,344	昭文社ホールディングス	2.7	3.1	1,556	レスターホールディングス	6.8	7	15,295
伊藤忠テクノソリューション	27.9	30.1	122,657	インプレスホールディングス	4.9	5.3	911	ジュテックHD	1.4	1.3	1,339
アイティフォー	7.5	8.1	7,209	アイネット	3.5	3.4	5,650	大光	2.6	2.8	1,954
東計電算	0.9	1	4,800	松竹	4.1	4.4	67,540	OCHIホールディングス	1.8	1.9	3,100
エックスネット	1.1	1.1	1,105	東宝	40.3	39.2	169,344	TOKAIホールディングス	32.5	34.9	37,343
大塚商会	33.2	35.9	198,527	東映	2.6	2.5	44,475	黒谷	1.4	1.6	814
サイボウズ	7.2	7.8	27,378	NTTデータ	163.2	176.7	250,030	Cominix	1.1	1.1	796
ソフトブレイン	3.6	4.1	3,558	ピー・シー・イー	0.8	1.1	5,280	三洋貿易	3.1	6.7	6,787
電通国際情報S	3.8	4.1	26,445	ビジネスB太田昭和	1.1	2.2	3,031	ビューティガレージ	1	1.1	3,001
ACCES	—	6.1	5,581	DTS	13.7	14.9	33,972	ウイン・パートナーズ	4	4.8	4,785
デジタルガレージ	12	12	41,520	スクウェア・エニックス・HD	28.5	28.3	195,553	ミタチ産業	1.8	2	1,244
イーエムシステムズ	5	9.3	8,184	シーイーシー	6.6	7.1	11,707	シッパヘルスケアHD	12.8	10.7	55,640
ウェザーニューズ	2.1	2.3	14,513	カプコン	26.3	31.3	184,983	明治電機工業	1.9	2	2,840
CII	4.6	4.8	4,497	アイ・エス・ビー	1.2	1.4	3,701	デリカフーズHLDGS	2.2	2.2	1,507
ビジネスエンジニアリング	0.6	0.8	3,040	ジャストテック	3.6	4.2	6,178	スターティアホールディングス	1.2	1.7	1,247
日本エンタープライズ	6.1	7.3	2,219	SCSK	16.2	15.3	90,423	コメダホールディングス	14.3	14.6	28,236
WOWOW	2.9	3.2	8,963	日本システムウエア	2	2.2	4,494	ピーバンドットコム	—	0.6	582
スカラ	4.3	4.6	4,204	アイネス	7.8	6.5	11,050	アセンテック	—	1.4	3,176
インテリジェントウェイブ	2.3	3.7	3,156	TKC	5.2	5.6	37,352	富士興産	2.4	2.2	1,480
IMAGICA GROUP	5.1	5.7	2,205	富士ソフト	7.9	7.1	37,062	協栄産業	0.7	0.7	924
ネットワンシステムズ	21.7	25.3	122,325	NSD	10.1	21.3	43,004	小野建	5.5	5.5	6,242
システムソフト	14.5	22.4	2,396	コナミホールディングス	25	24.2	106,238	南陽	1.3	1.4	2,452
アルゴグラフィックス	5.2	5.7	20,548	福井コンピュータHLDGS	2	2.6	8,138	佐島電機	4.5	4.5	3,784
マーベラス	9.4	10	8,060	JBCCホールディングス	4.8	4.5	7,915	エコートレーディング	1.5	1.5	879
エイベックス	10.5	11.5	11,557	ミロク情報サービス	6.1	5.9	13,233	伯東	4.2	4.1	4,809
日本ユニシス	19.1	20.7	69,448	ソフトバンクグループ	486.3	526.6	3,357,075	コンドーテック	4.7	5.2	6,708
兼松エレクトロニクス	3.3	3.6	15,408	卸売業 (4.8%)				中山福	3.5	3.7	1,794
東京放送HD	40.7	40.2	73,164	ハウスイ	0.5	0.5	456	ナガイレーベン	8.9	8.9	24,964
日本テレビHLDGS	56.3	55.1	65,183	高千穂交易	2.4	2.5	2,517	三菱食品	6.7	7.4	20,757
朝日放送グループHD	6	6.4	4,755	カワニシホールディングス	—	0.7	989	松田産業	4.5	4.9	7,428
テレビ朝日HD	16.9	18.3	30,725	伊藤忠食品	1.5	1.7	9,265	第一興商	9.1	10	34,250
スカパーJSATHD	40.5	43.9	19,755	エレマテック	5.7	6.3	6,192	メディパルHD	66.3	71.5	151,866
テレビ東京HD	5	5.5	12,919	JALUX	1.7	1.8	2,869	SPK	1.3	2.8	4,090
日本BS放送	2	2.1	2,354	あらた	4.5	5.3	27,878	萩原電気HLDGS	2.3	2.5	5,480
ビジョン	1.9	6.1	4,928	トーメンデバイス	0.9	1	4,100	アズワン	4.4	4.4	65,780
スマートパリュウ	1.8	1.8	1,996	東京エレクトロンデバイス	2.2	2.4	7,716	スズデン	2.1	2.3	2,787

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
尾家産業	2	1.9	3,135		阪和興業	10.7	12.5	27,950		日伝	5.1	6.1	14,249	
シモジマ	3.8	4.1	5,936		正栄食品	4	4.3	19,113		北沢産業	4.6	5.2	1,466	
ドウシシャ	5.8	6.3	13,230		カナデン	5.6	5.4	8,218		杉本商事	3.3	3.5	6,751	
小津産業	1.4	1.5	2,757		菱電商事	4.9	4.8	7,171		因幡電機産業	8.7	19.1	51,608	
高速	3.7	4	7,044		フルサト工業	3.4	3.4	4,947		東テク	2	2.2	5,440	
たけびし	2.1	2.4	3,674		岩谷産業	13.6	14.9	60,047		ミスミグループ本社	77.1	83.6	255,398	
リックス	1.4	1.5	2,473		ナイス	2.5	2.5	3,715		アルテック	4.5	5.6	1,506	
丸文	5.4	5.6	2,788		昭光通商	2.1	2.3	1,389		タキヒヨー	1.9	2	3,688	
ハビネット	5.1	5.5	7,243		ニチモウ	1	1	2,017		蔵王産業	1	1	1,482	
橋本総業 HLDGS	1.2	1.3	3,247		極東貿易	1.9	1.9	2,728		スズケン	28	28.1	115,772	
日本ライフライン	18.2	19.9	28,238		イワキ	8.1	8.7	4,454		ジェコス	4.2	4.6	4,328	
タカショー	3	3.9	2,577		三菱石油	16.5	16.5	16,252		グローセル	5.6	6.7	2,747	
エクセル	2.3	—	—		稲畑産業	14.8	14.8	20,453		小売業 (5.0%)				
マルカ	2.2	2.3	4,908		G S I クレオス	1.6	1.6	2,867		ローソン	15.6	16.9	85,683	
I DOM	20.8	18	11,448		明和産業	5.7	6.3	3,068		サンエー	4.6	5.5	25,795	
進和	3.6	4	8,696		クワザフ	2.2	2.1	1,104		カワチ薬品	4.8	5.2	15,449	
エスケイジャパン	1.5	1.6	513		ヤマエ久野	—	4.9	6,188		エービーシー・マート	9.6	10.4	56,160	
ダイトロン	2.6	2.8	4,239		ワキタ	13.1	14.2	14,484		ハードオフコーポレーション	2.4	2.5	1,657	
シークス	7.8	8.5	10,506		東邦ホールディングス	18.2	21.1	48,846		アスクル	6.4	7	30,520	
田中商事	2.1	2.1	1,575		サンゲツ	18.1	18.3	30,268		ゲオホールディングス	9.4	11.9	20,111	
オーハシテクニカ	3.5	3.5	4,987		ミツウロコグループ	8.2	9.8	12,602		アダストリア	8.5	9.3	15,084	
白銅	2	2.3	2,996		シナネンホールディングス	2.5	2.8	8,778		ジーフット	3.8	4.4	2,283	
ダイコー通産	—	0.4	546		伊藤忠エネクス	13.5	14.1	13,944		シー・ヴィ・エス・バイエリア	0.8	1	450	
伊藤忠	430.1	465.8	1,286,306		サンリオ	19	18.8	36,716		くら寿司	3.2	3.5	19,810	
丸紅	606.5	693.5	438,361		サンワ テクノス	3.7	4.7	4,385		キャンドゥ	2.9	3.2	6,908	
高島	1	1	1,909		リョーサン	6.8	7.4	15,688		パルグループ HLDGS	3.1	6.9	7,776	
長瀬産業	34.5	37.3	58,598		新光商事	5.8	10.3	9,259		エディオン	26.1	30.8	34,742	
蝶理	3.9	4.3	6,957		トーホー	2.8	3	5,985		サーラコーポレーション	12.5	13.4	7,825	
豊田通商	68.7	74.5	226,107		三信電気	4.2	3.6	7,110		ワッツ	2.8	2.8	2,674	
三共生興	10.5	10	4,250		東陽テクニカ	7.1	7.6	7,676		ハローズ	2.3	2.5	11,000	
兼松	24.6	25	32,925		モスフード サービス	8.1	8.8	27,060		フジオフード G 本社	2.6	5.7	7,991	
ツカモトコーポレーション	1.1	1.3	1,675		加賀電子	6.1	6.7	14,746		あみやき亭	1.3	1.4	4,197	
三井物産	506.7	577	1,089,087		ソーダニツカ	6.4	6.8	3,774		ひらまつ	12.4	11.8	2,773	
日本紙パルプ	3.5	3.8	14,231		立花エレテック	4.5	4.9	8,785		大黒天物産	1.5	1.6	9,344	
日立ハイテク	18.7	—	—		フオーバル	2.7	2.9	2,844		ハニーズホールディングス	5.4	5.8	5,834	
カメイ	8	8.6	9,546		P A L T A C	11.1	10.7	59,920		ファーマライズ HD	1.4	1.5	1,192	
東都水産	0.9	0.8	2,936		三谷産業	7.2	8.7	3,497		アルペン	4.7	5.1	10,072	
OUG ホールディングス	1	1.1	3,126		太平洋興発	2.4	2.6	1,645		ハブ	2	1.9	1,318	
スターゼン	2.3	2.5	10,250		西本 WISMETTAC HD	1.1	1.2	2,268		クオールホールディングス	9.1	9.8	12,259	
山善	24	26.2	27,955		ヤマシタヘルスケア HLDGS	0.5	0.7	1,055		ジンスホールディングス	3.3	3.6	30,420	
椿本興業	1.4	1.2	4,338		国際紙パルプ商事	14.4	15.9	4,801		ビックカメラ	36.5	39.8	44,814	
住友商事	363.8	420.5	552,957		ヤマタネ	3.1	3.3	4,362		DCM ホールディングス	33.2	37.3	56,882	
内田洋行	2.6	2.7	13,932		丸紅建材リース	0.6	0.7	1,220		ペッパーフードサービス	4.9	5.7	2,034	
三菱商事	431.6	436.9	1,145,333		日鉄物産	4.4	4.7	14,899		MonotaRO	43.7	47.5	239,400	
第一実業	2.8	3.3	12,622		泉州電業	1.9	2	6,240		東京一番フーズ	1.6	1.5	877	
キャンソマーケティング JPN	17.6	16.7	33,433		トラスコ中山	12.8	14	36,316		DD ホールディングス	2.7	2.7	2,025	
西華産業	3.5	3.7	5,246		オートバックスセブン	24.5	24.6	34,759		きちりホールディングス	1.6	1.7	1,089	
佐藤商事	5.5	5.6	5,768		モリト	4.5	4.9	3,537		アークランドサービス HD	4.5	4.9	10,353	
菱洋エレクトロ	6.2	6.8	19,788		加藤産業	9.6	9.7	35,744		J. フロントリテイリング	78.7	79.8	56,179	
東京産業	6.1	6	3,198		北恵	1.2	1.6	1,769		ドトール・日レス HD	10.8	9.7	16,121	
ユアサ商事	6.3	6.4	21,248		イノテック	3.7	3.9	4,130		マツモトキヨシ HLDGS	25.4	27.5	104,225	
神鋼商事	1.4	1.6	2,780		イエローハット	11.6	12.6	21,835		ブロンコビリー	3.2	3.5	8,326	
トルク	3.7	3.9	1,189		JK ホールディングス	5.6	6	4,812		ZOZO	66.5	45.9	133,385	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
トレジャー・ファクトリー	1.8	2	1,556		ライトオン	4.7	4.9	2,729		ライフコーポレーション	4.7	5.1	24,709	
物語コーポレーション	1.5	1.8	17,802		ジーンズメイト	1.9	2.7	588		リンガーハット	7.6	8.3	21,920	
ココカラファイン	6.9	6.9	46,023		良品計画	87.2	88.9	156,375		M r M a x H D	8.4	9.2	8,445	
三越伊勢丹HD	115.2	117.3	64,866		三城ホールディングス	7.7	6.9	1,987		テナアライド	5.6	5.9	2,460	
H a m e e	1.9	2.4	5,608		アドヴァン	9.4	10.3	13,688		AOKIホールディングス	12.3	13.5	7,735	
ウエルシアHD	16.3	39.6	180,576		アルビス	2.3	2.5	6,912		オークワ	8.8	10.5	15,519	
クリエイトSDH	9.1	11.2	42,056		コナカ	7.3	7.7	2,209		コメリ	9.5	10.3	34,659	
丸善CHI HD	7.2	5.6	2,156		ハウス ローゼ	0.8	0.8	1,312		青山商事	10.8	13.8	7,921	
ミサワ	1.1	1.6	1,132		G-7ホールディングス	1.8	3.9	10,553		しまむら	7.2	7.8	69,810	
ティーライフ	0.8	0.9	1,146		イオン北海道	6	8.5	7,165		はせがわ	3.1	3.4	1,098	
エー・ピーカンパニー	1.1	1.5	655		コジマ	10.6	11.4	5,871		高島屋	48.3	48.9	40,440	
チムニー	1.9	2	2,864		ヒマラヤ	2.2	2.2	2,074		松屋	12.4	13.5	10,138	
シュッピン	4.2	4.6	3,850		コーナン商事	8.1	9.5	38,380		エイチ・ツー・オーテイリング	31.6	31.8	23,373	
オイシックス・ラ・大地	—	6.6	21,615		エコス	2.3	2.4	5,260		近鉄百貨店	2.3	2.6	8,398	
ネクステージ	8.8	9.6	11,260		ワタミ	8.1	7.9	8,413		パルコ	5.9	—	—	
ジョイフル本田	18	19.6	33,084		マルシェ	1.5	1.5	903		丸井グループ	52.1	61.2	120,380	
鳥貴族	2	2.3	3,452		バンパシフィック HD	147.4	146.4	341,404		アクシアル リテイリング	5.1	5.5	27,032	
キリン堂ホールディングス	2.4	2.6	9,113		西松屋チェーン	13.6	14.7	19,992		井筒屋	3.3	4	696	
ホットランド	3.7	4.5	5,368		ゼンショーホールディングス	29.9	32	82,304		イオン	236.7	256.1	724,506	
すかいらーく HD	69	74.9	114,597		幸楽苑ホールディングス	3.9	4.2	7,501		イズミ	12.5	13.7	52,471	
SFP ホールディングス	2.6	3.8	5,380		ハークスレイ	1.3	1.3	1,290		平和堂	12.5	13.4	29,681	
綿半ホールディングス	2.3	2.5	8,112		サイゼリヤ	10.2	10	21,620		フジ	7.4	8.1	15,260	
ヨシックス	1	1.1	1,992		V T ホールディングス	27.8	27.6	11,785		ヤオコー	7	7.6	60,420	
ユナイテッド・スーパーマーケット	17.8	19.3	24,684		魚力	1.7	1.9	3,608		ゼビオホールディングス	7.4	8	6,320	
ゴルフダイジェスト・オン	2.5	2.9	1,954		ポプラ	1.6	1.8	759		ケーズホールディングス	64	64.4	90,417	
B E E N O S	2.2	3	5,253		フジ・コーポレーション	1.6	1.8	4,140		OLYMPIC グループ	3.6	3.4	3,515	
あさひ	5.1	5	9,515		ユナイテッドアローズ	7.1	7	11,032		日産東京販売HD	9	9.7	2,473	
日本調剤	2.2	4.1	7,002		ハイデイ日高	8.9	9.7	18,362		シルバライフ	—	0.9	1,798	
コスモス薬品	2.7	5.9	106,436		京都きもの友禅	4	3.9	889		一家ダイニングプロジ	—	0.5	306	
トーエル	3	3.2	2,640		コロワイド	20.5	22.3	44,087		GENKY DRUGSTORES	3	2.9	10,802	
オンリー	1	1.1	563		ピーシーデポコーポ	8.2	8.8	5,825		ナルミヤ・インターナショナル	—	1.4	814	
セブン&アイ・HLDGS	257.8	260.5	876,061		杏番屋	4.3	4.7	26,508		総合メディカルHD	5.4	—	—	
クリエイト・レストランツ・ホール	16.6	36.1	22,887		トップカルチャー	2.2	2.4	974		ブックオフGHD	3.2	3.9	3,584	
ツルハホールディングス	13.4	14.5	220,255		P L A N T	1.6	1.6	1,406		アインホールディングス	8.3	8.2	59,286	
サンマルクホールディングス	4.9	5.3	8,442		スギホールディングス	13.5	13.3	100,548		元気寿司	1.7	1.7	4,285	
フェリシモ	1.4	1.4	1,506		薬王堂ホールディングス	2.7	2.9	7,299		ヤマダ電機	187.6	203.4	107,191	
トリドールホールディングス	7.6	16.6	25,962		ヴィア・ホールディングス	7.6	8.1	2,770		アークランドサカモト	10.4	10.5	23,436	
TOKYO BASE	5.6	6	2,406		スクロール	9.5	10.1	9,079		ニトリホールディングス	26.6	28.8	624,240	
ウィルプラス HLDGS	0.9	1.1	640		ヨンドシーホールディングス	6.8	6.8	12,478		グルメ杵屋	4.4	4.7	5,029	
JM ホールディングス	3.1	5.1	15,555		ファミリーマート	68.8	53.2	124,488		愛眼	5	5.4	1,258	
サツドラホールディングス	0.9	0.9	1,854		木曽路	7.6	8.8	23,205		ケーユーホールディングス	3.1	2.9	2,372	
デファクトスタンダード	0.5	—	—		SRS ホールディングス	7.3	8.1	8,075		吉野家ホールディングス	21.5	22	44,858	
アレンザホールディングス	3.3	3.3	5,613		千趣会	11.2	12.2	5,124		松屋フーズ HLDGS	3	3.2	11,952	
串カツ田中 HLDGS	0.9	1.3	2,341		タカキユー	4.8	6.1	841		サガミホールディングス	8.3	8.9	12,922	
パロックジャパン	5	4.6	2,907		リテールパートナーズ	—	8.9	16,251		関西スーパーマーケット	4.6	5.5	7,315	
クスリのアオキ HLDGS	6.1	6	54,420		ケーヨー	11.4	13.7	13,549		王将フードサービス	4.5	4.9	29,988	
力の源 HD	2.3	3	2,022		上新電機	7.3	7.9	19,726		プレナス	6.9	7.2	13,017	
スシローグローバル HLDGS	6.8	36.7	100,044		日本瓦斯	9.7	10.6	47,912		ミニストップ	4.6	5	7,620	
L I X I L ビバ	5.2	—	—		ロイヤルホールディングス	10.8	11.7	22,581		アークス	11.5	13.6	36,529	
メディカルシステムネットワーク	6.6	6.4	2,944		東天紅	0.5	0.5	500		パルコホールディングス	13.3	14.7	43,129	
はるやま HLDGS	2.9	3.1	2,306		いなげや	6.9	8.2	16,596		藤久	0.5	0.6	1,164	
ノジマ	10.9	12	34,620		島忠	13	12.5	42,250		ベルク	3	3.3	25,113	
カッパ・クリエイト	8.7	9.4	15,604		チヨダ	6.5	7.1	6,830		大庄	3.3	3.5	4,445	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ファーストリテイリング	8.2	8.9	575	118	紀陽銀行	21.8	23.7	37	943	マネックスG	56.9	50	13	200
サンドラッグ	23.2	25.1	101	027	ほくほくフィナンシャルG	41.1	44.5	48	416	極東証券	8.3	8.7	5	211
サックスホールディング	5.2	5.5	3	129	広島銀行	91	99	59	499	岩井コスモホールディング	6.2	6.3	8	019
ヤマザワ	1.3	1.4	2	520	山陰合同銀行	36.6	39.9	22	942	藍澤證券	11	12	8	280
やまや	1	1.3	3	000	中国銀行	53.1	57.5	58	880	マネーパートナーズGP	7.3	6.6	1	405
ペルーナ	15.1	14.4	13	737	鳥取銀行	2.1	2.2	2	763	スパークス・グループ	24.4	30.8	6	406
銀行業 (4.9%)					伊予銀行	81.6	95.1	68	186	小林洋行	1.9	2.8		742
島根銀行	1.4	1.5	1	045	百十四銀行	6.6	7.1	12	865	保険業 (1.9%)				
じもとホールディングス	42.1	45	5	355	四国銀行	8.8	10.2	7	690	かんぽ生命保険	21.9	23.5	39	973
めびきフィナンシャルG	319.6	346	83	386	阿波銀行	9.4	10.9	28	209	SOMPOホールディングス	108.6	125.4	475	266
東京きらぼしFG	8.4	9	10	692	大分銀行	3.8	3.9	9	344	アニコムホールディングス	5.1	5.5	23	320
九州フィナンシャルG	101.2	146.2	71	491	宮崎銀行	4.1	4.5	11	011	MS & AD	161	174.3	516	363
ゆうちょ銀行	174.3	187.6	156	833	佐賀銀行	3.8	4	5	512	S O N Y F H	50.6	—	—	—
富山第一銀行	14.8	15.7	4	772	沖縄銀行	5.6	6.1	19	489	第一生命HLDGS	348.6	377.8	575	200
コンコディア・フィナンシャル	386.4	380.6	147	292	琉球銀行	14.2	15.5	14	337	東京海上HD	220.3	235.9	1,144	822
西日本フィナンシャルHD	38.9	44.6	33	316	セブン銀行	205.9	223	58	203	T&Dホールディングス	190.6	199.7	218	072
関西みらいFG	28.8	39.5	17	459	みずほフィナンシャルG	8,369.9	9,059.1	1,255	591	アドバンスクリエイト	1.4	1.6	3	659
33FG	5.3	6.2	8	698	高知銀行	2.3	2.5	2	055	その他金融業 (1.2%)				
第四北越フィナンシャルG	10.7	11.7	26	442	山口フィナンシャルG	76.8	83.5	59	285	全国保証	17.4	18.9	75	033
新生銀行	45.3	49.1	65	843	長野銀行	2	2.1	2	971	ジェイリース	1.7	2.5	1	385
あおぞら銀行	34.5	40	71	440	名古屋銀行	5	5.1	12	591	イントラスト	1.7	2.5	2	162
三菱UFJフィナンシャルG	4,240.3	4,562.2	2,006	911	北洋銀行	93.2	101.3	23	602	日本モーゲージサービス	1.1	2.8	3	180
りそなホールディングス	676	725.8	281	392	愛知銀行	2.2	2.4	7	860	C a s a	2.8	2.3	2	831
三井住友トラストHD	121.1	126	379	134	中京銀行	2.5	2.7	5	526	アルヒ	5.6	10.7	18	981
三井住友フィナンシャルG	434.1	461	1,417	114	大光銀行	2.1	2.2	3	187	プレミアグループ	3.5	3.6	7	617
千葉銀行	211.9	222.5	133	055	愛媛銀行	8.6	9	10	683	クレディセゾン	43.2	47	52	734
群馬銀行	123.3	128	46	336	トマト銀行	2.4	2.5	2	925	芙蓉総合リース	7	7	49	420
武蔵野銀行	9.2	10	16	760	京葉銀行	26.1	28.5	14	250	みずほリース	11.6	10.2	28	141
千葉興業銀行	17.1	18	4	716	栃木銀行	32.3	31.6	6	098	東京センチュリー	12.4	13.4	77	854
筑波銀行	25.9	28.1	5	901	北日本銀行	1.9	2	3	934	日本証券金融	27.2	29.5	15	428
七十七銀行	19.3	22.7	37	500	東和銀行	10.9	11.7	8	903	アイフル	94.3	102	28	050
青森銀行	4.8	5.2	13	150	福島銀行	5.4	7.3	1	832	リコリース	4.8	5.2	14	840
秋田銀行	4	4.3	7	082	大東銀行	3	3.3	2	260	イオンフィナンシャルサービス	39.4	41.1	39	086
山形銀行	6.9	7.5	10	140	トモニホールディングス	47.5	51.8	17	663	アコム	124.1	133.9	61	058
岩手銀行	4.3	4.4	11	242	フィデアホール	60.4	64.4	7	470	ジャックス	6.8	7.4	13	009
東邦銀行	55.3	59.7	13	850	池田泉州HD	65.9	76.9	14	226	オリコ	167.3	181.6	20	702
東北銀行	3.2	3.1	3	565	証券・商品先物取引業 (0.8%)					日立キャピタル	14.5	15.8	40	953
みちのく銀行	4	4.4	5	627	F P G	19.4	20.6	12	463	アプラスフィナンシャル	29.8	34.1	2	523
ふくおかフィナンシャルG	54.3	56.3	107	138	マチュリアインベストメント	2.6	2.8	1	775	オリックス	410.8	413.9	572	423
静岡銀行	152.5	162.2	121	650	SBIホールディングス	73.4	74.6	204	478	三菱UFJリース	138.9	168.4	88	410
十六銀行	8.3	8.4	17	035	日本アジア投資	5.2	6.3	1	493	九州リースサービス	3	2.9	1	856
スルガ銀行	60.5	63	24	759	ジャフコ	10.1	10.3	43	929	日本取引所グループ	166.4	191.3	554	770
八十二銀行	148.8	161	67	781	大和証券G本社	494.3	534.4	247	961	イー・ギャランティ	5.8	7.2	16	992
山梨中央銀行	7.5	7.8	6	614	野村ホールディングス	1,084	1,174.1	586	462	アサックス	2.6	3.5	2	660
大垣共立銀行	13	13.2	31	257	岡三証券グループ	52.6	57.3	20	398	NECキャピタルソリューション	2.5	2.7	5	105
福井銀行	5.3	5.7	10	009	丸三証券	18.4	19.7	9	416	不動産業 (2.0%)				
北國銀行	6.4	6.7	20	602	東洋証券	22.4	24.3	2	745	いちご	78.5	85.5	26	248
清水銀行	2.6	2.7	5	211	東海東京HD	71	76.9	21	532	日本駐車場開発	67.8	69.7	9	200
富山銀行	1.2	1.3	4	095	光世証券	1.5	1.8	1	087	スター・マイカ・HLDGS	—	3.3	4	204
滋賀銀行	12.4	13.4	34	143	水戸証券	18	19.1	4	125	ADワークスグループ	—	14.9	2	339
南都銀行	9.6	11.2	22	635	いちよし証券	12.3	12.2	5	990	ヒューリック	131.6	141.5	139	943
百五銀行	55.6	59.5	19	337	松井証券	30.2	37.7	36	003	三栄建築設計	2.4	2.7	3	855
京都銀行	22.1	23.9	121	890	だいち証券ビジ	2.5	—	—	—	野村不動産HLDGS	41	40.5	84	159

銘柄	期首			銘柄	期首			銘柄	期首		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
三重交通グループHD	12.5	13.3	6,410	サンフロンティア不動産	8.5	9.5	8,236	ウェルネット	5.7	6.6	3,801
サムティ	8.7	9.5	14,449	インテリックス	1.8	2.8	1,338	ワールドホールディングス	1.9	2.3	4,652
エー・ディー・ワークス	191.5	—	—	ランドビジネス	2.6	2.6	988	ディー・エヌ・エー	32.2	27.5	51,700
日本商業開発	3.9	4.5	7,654	サンネクスグループ	1.6	1.9	1,922	博報堂D Y HLDGS	82.9	90.5	130,410
プレサンスコーポレーション	9.8	11.1	16,006	グランディハウス	5.4	5.3	2,040	ぐるなび	8.5	11.3	8,271
ユニソホールディングス	9.4	—	—	日本空港ビルデング	19.7	21.4	100,473	タカミヤ	6.3	6.7	3,805
ハウスコム	—	0.9	1,192	サービス業 (5.7%)				ジャパンベストレスキューS	4	5	5,140
日本管理センター	4.1	3.9	5,073	日本工営	4	4.4	12,821	ファンコミュニケーションズ	16.5	18	8,604
サンセイランディック	1.8	2.5	1,837	L I F U L L	20.9	22.6	10,689	ライク	2.4	2.3	4,229
エストラスト	0.9	1.4	932	ミクシィ	—	12.4	33,033	ビジネス・ブレークスルー	2.5	3.2	1,222
フージャースHD	13.4	13.3	8,778	ジェイエイシリアルルートメント	4	4.3	5,774	エスプール	2.3	16.6	13,246
オープンハウス	8.9	19.5	71,955	日本M&Aセンター	45.1	49.2	281,916	WDBホールディングス	2.7	3	9,210
東急不動産HD	165.8	181.9	86,220	メンバーズ	2	1.9	3,361	手間いらず	—	0.4	2,212
飯田GHD	51.3	55.5	120,157	中広	0.5	0.6	310	ティア	3.5	3.6	1,602
イーグランド	0.9	1	795	UTグループ	—	10.2	34,833	CDG	0.5	0.7	1,239
ビーロット	1.4	3.4	2,410	アイティメディア	1.1	2.6	6,814	パリュウコマース	3.4	3.6	12,798
ファーストブラザーズ	1.4	1.5	1,383	タケエイ	6.2	6.2	6,355	インフォマート	32.7	65.6	63,566
ハウスドゥ	3.4	3.5	3,899	E・Jホールディングス	0.7	1.2	3,151	JPホールディングス	17.1	20.2	6,443
シアールイー	1.5	1.8	2,626	ビーネックスグループ	6.6	8.1	9,396	エコナックホールディングス	10.8	13.5	1,309
プロパティエージェント	0.8	1.1	1,499	コシダカホールディングス	14.4	15.5	6,711	EPSホールディングス	9	9	9,603
ケイアイスター不動産	1.7	2.2	5,863	アルトナー	1.4	1.8	1,614	レックス	1.5	1.7	1,878
アグレ都市デザイン	1	1.7	1,064	パソナグループ	7.3	7	10,927	プレステージ・インター	11.2	24.3	22,356
ジェイ・エス・ピー	0.7	1.3	3,898	CD S	1.5	1.6	2,180	アミューズ	3.6	3.5	8,736
テンポイノベーション	0.7	1.7	1,269	リンクアンドモチベーション	13.2	13.7	5,671	ドリームインキュベータ	1.8	1.9	2,882
グローバルリンクマネジメント	0.9	1.4	932	G C A	7.1	7.8	5,171	クイック	3.7	3.9	4,761
パーク24	33.1	36	67,428	エス・エム・エス	22	20.2	59,590	T A C	3.1	4.4	1,003
パラカ	1.6	1.7	3,065	サニーサイドアップG	1.3	2.1	1,493	ケネディクス	56.8	56.8	30,558
三井不動産	326.8	329	641,221	パーソルホールディングス	59.7	65.1	113,143	電通グループ	61.5	67.1	214,720
三菱地所	431.6	467.2	756,163	リニカル	3.4	3.2	2,726	テイクアンドギヴニーズ	2.3	2.4	1,552
平和不動産	11.3	12.2	34,599	クックパッド	19.1	22.4	8,512	ぴあ	1.7	1.8	6,255
東京建物	67.4	66.1	85,930	エスクリ	1.6	2	760	イオンファンタジー	1.9	2.5	4,262
ダイビル	18.2	17	20,706	アイ・ケイ・ケイ	2.9	3.1	1,940	シーティーエス	6.7	7.3	6,920
京阪神ビルディング	10.8	10.5	17,713	学情	2.1	2.4	2,688	ネクシーズグループ	2.1	2.4	2,702
住友不動産	138.5	149.9	469,486	スタジオアリス	3	3.2	5,296	HUグループHD	16.7	18.2	52,179
テオーシー	14.1	12.9	8,668	シミックホールディングス	3.3	3.6	4,975	アルプス技研	5.3	5.7	11,496
東京楽天地	0.9	1.2	5,382	エプコ	—	1.3	1,309	サニックス	10.6	11.4	2,964
スターツコーポレーション	8.3	9	20,871	N J S	1.3	1.4	2,696	ダイオース	1.4	1.2	1,252
フジ住宅	7.9	7.7	4,158	総合警備保障	23.7	25.9	133,385	日本空調サービス	6.8	6.8	5,066
空港施設	7.2	6.8	3,141	カカココム	44.7	48	128,544	オリエンタルランド	70.5	68.7	1,039,431
明和地所	3.4	4.2	2,184	アイコムグループ	2.3	2.4	5,064	ダスキン	15.3	16.2	47,320
ゴールドクレスト	4.8	5	7,015	セントケア・ホールディング	4.4	4	3,196	明光ネットワークジャパン	7.1	8.1	6,050
エスリード	2.3	2.7	3,680	サイネックス	0.9	1.1	966	ファルコホールディングス	3.3	3.5	5,579
日神グループHLDGS	8.9	10.3	4,356	ルネサンス	3.3	3.5	3,405	秀英予備校	1.4	1.4	641
日本エスコン	11.1	12.2	10,309	ディップ	9.6	9.1	19,292	田谷	1.2	1.2	705
タカラレーベン	28.2	30.2	9,905	デジタルホールディングス	3.3	3.5	4,812	ラウンドワン	18.5	18.1	15,004
A V A N T I A	3.5	3.8	3,040	新日本科学	8.1	7.1	5,609	リゾートトラスト	25.3	29.8	48,425
イオンモール	30.9	33.4	49,999	ツクイ	14.1	15.2	9,591	ビー・エム・エル	7.7	8.3	26,186
毎日コムネット	1.3	2	1,622	キャリアデザインセンター	1.5	1.7	1,761	ワタベウエディング	1	1	396
ファースト住建	2.6	2.9	3,007	ベネフィット・ワン	16.4	23.7	62,212	りらいあコミュニケーション	10.8	11.7	15,783
ランド	255.5	378.1	3,402	エムスリー	125.7	142.6	934,030	リソー教育	30.3	29.6	8,495
カチタス	6.9	16.6	47,907	ツカダ・グローバルHOLD	3.8	4	1,220	早稲田アカデミー	1.7	2.8	2,844
トーセイ	8.5	9.4	8,939	プラス	0.6	0.7	337	ユー・エス・エス	72.9	72.9	139,239
穴吹興産	0.7	1.5	2,338	アウトソーシング	34.2	37.1	34,132	東京個別指導学院	2.1	2.3	1,271

銘柄	期首			銘柄	期首			銘柄	期首		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
サイバーエージェント	34.3	39.9	248,178	インソース	2.9	2.8	7,848	トーカイ	5.8	6.3	13,519
楽天	278.3	301.7	368,074	ペイカレントコンサルティング	4.2	3.9	50,622	白洋舎	0.7	0.8	2,107
クワーク・アンド・リバー社	3.5	3.4	4,576	ORCHESTRA HLDGS	1.2	1.6	3,636	セコム	63.3	68.7	675,595
テー・オー・ダブリュー	5.2	10.4	3,421	アイモバイル	1.9	2.2	2,721	セントラル警備保障	2.9	3.1	10,850
山田コンサルティングGP	2.9	4.1	4,858	キャリアインデックス	2.1	2.8	1,624	丹青社	11.3	12.2	8,906
セントラルスポーツ	2.2	2.4	6,060	MS - J a p a n	2.4	2.2	1,830	メイテック	7.4	8	43,440
フルキャストホールディングス	6	6.2	10,558	船場	0.9	1.1	1,034	応用地質	6.4	6.9	8,673
エン・ジャパン	8.7	11.5	33,154	グレイステクノロジー	2.2	3	14,520	船井総研ホールディング	12.3	13.4	32,361
リソルホールディングス	0.7	0.7	2,646	ジャパンエレベーターSHD	4.7	6.8	26,044	進学会ホールディングス	2.7	2.5	1,147
テクノプロ・ホールディング	12	13	82,160	フルテック	0.8	0.9	1,235	オオバ	4.7	4.8	3,883
アトラ	1.2	1.7	448	グリーンズ	2.3	1.8	959	いであ	1.1	1.5	2,976
インタワークス	1.1	1.6	548	ツナググループ HLDGS	0.7	0.9	416	学究社	2	1.8	2,030
アイ・アールジャパンHD	2.4	2.6	31,590	GAMEWITH	—	1.7	1,110	ベネッセホールディングス	21.9	21.7	59,544
Keeper 技研	2.2	2.4	7,392	ソウルドアウト	0.9	1.3	2,087	イオンディライト	7.4	8	23,448
ファーストロジック	1.4	1.4	1,054	MS&CONSULTING	0.9	1	732	ナック	3.8	3.9	3,853
三機サービス	1.3	1.3	1,440	ミダック	—	0.8	1,846	ニチイ学館	8.5	6.2	10,310
Gunosy	4.2	4	3,796	日総工業	4	4.5	3,658	ダイセキ	10	10.9	28,983
デザインワン・ジャパン	1.2	1.5	412	キュービーネット HLDGS	3.6	2.9	5,399	ステップ	2.2	2.4	3,837
イー・ガーディアン	3.1	3.2	10,240	RPA ホールディングス	2.5	4.8	4,185		千株	千株	千円
リブセンス	3.3	4.5	1,296	スプリックス	2	2.2	1,909	合計	株数、金額	73,677.7	79,781.50004
ジャパンマテリアル	16.3	20	30,260	マネジメントソリューションズ	—	2.8	4,600	銘柄数<比率>	2,131銘柄	2,151銘柄	<99.4%>
ベクトル	7.5	8.2	8,979	プロレド・パートナーズ	—	0.9	4,581				
ウチヤマホールディングス	3	3.2	1,024	AND FACTORY	—	0.5	521				
チャムケアコーポレーション	1.9	5.5	6,391	ギークス	—	0.6	727				
ライクキッズ	1.4	—	—	カープスホールディングス	—	17.8	12,121				
キャリアリンク	2.2	2.4	2,560	フォーラムエンジニアリング	—	3.3	2,877				
IBJ	4	4.5	4,972	アドバンテッジリスクマネ	2.3	3.3	2,537				
アサンテ	2.4	2.7	4,422	リログループ	32.6	35.4	88,535				
N・フィールド	4	4.3	2,992	東祥	3.7	4	5,148				
バリューHR	1.2	2.6	4,173	エイチ・アイ・エス	9.3	10.1	19,038				
M&Aキャピタルパートナー	2.1	5.3	22,313	ラックランド	1.2	1.5	3,546				
ライオンエクスプレスHD	2.5	2.5	6,362	共立メンテナンス	9.1	10.8	43,686				
ERI ホールディングス	1.7	1.8	1,170	イチネンホールディングス	6.2	7.2	9,223				
アビスト	0.9	0.9	2,911	建設技術研究所	4.1	4.4	9,103				
シグマクシス	2.9	4.4	7,427	スペース	3.9	4.1	3,538				
ウィルグループ	3.9	4.3	3,766	長大	2.2	2.5	3,307				
エスコローAJ	8.3	9	3,366	燦ホールディングス	1.3	2.8	3,413				
リクルートホールディングス	427.5	463.1	1,986,699	スパル興業	0.4	0.4	3,200				
エラン	3.5	3.8	9,526	東京テアトル	2.4	3.1	4,042				
土木管理総合試験	2.6	2.9	1,107	タナベ経営	1.2	1.1	1,662				
ネットマーケティング	2.1	2.3	1,536	ナガワ	1.7	2	15,820				
日本郵政	489.1	527	391,877	よみうりランド	1.3	1.4	6,041				
ベルシステム24HLDGS	10	10.9	19,184	東京都競馬	3.9	4.2	22,218				
鎌倉新書	4.4	4.9	4,640	常磐興産	2.4	2.6	3,991				
SMN	0.7	1.3	1,198	カナモト	9.8	10.7	25,177				
一蔵	0.7	0.7	256	東京ドーム	22.4	26.4	20,882				
LITALICO	1.4	2.2	6,168	西尾レントオール	6.1	6	13,986				
グローバルキッズCOMP	0.9	1	888	アゴーラ・ホスピタリティG	34.8	47.5	1,330				
エアトリ	2.7	3.3	4,890	トランス・コスモス	6.6	6.2	17,918				
アトラエ	1.5	1.9	5,523	乃村工藝社	27.9	27.8	21,962				
ストライク	2.3	2.4	13,104	藤田観光	2.6	2.9	4,776				
ソラスト	14.6	18	23,814	KNT-CT ホールディングス	3.2	3.9	4,356				
セラク	1.9	2.2	4,543	日本管財	6.4	7.2	14,760				

銘柄別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	TOPIX	百万円	百万円
		912	—

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

項 目	当 期 末	
	貸 付	借 入
株式	株 7,142,800 (67,500)	株 — (—)

(注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
(注2) 当ファンドに係る当作成期中の利害関係人のうち、大和証券へ67,500株を貸付けています。

■投資信託財産の構成

2020年9月23日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 155,810,906	% 90.5
コール・ローン等、その他	16,291,853	9.5
投資信託財産総額	172,102,760	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

2020年9月23日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	172,555,328,467円
コール・ローン等	16,181,037,878
株式 (評価額)	155,810,906,285
未収入金	6,668,700
未収配当金	64,970,916
未収利息	1,190,061
その他未収収益	4,324,627
差入委託証拠金	486,230,000
(B) 負債	15,806,709,167
未払金	5,600
未払解約金	157,714,320
差入委託証拠金代用有価証券	460,980,000
受入担保金	15,187,919,669
その他未払費用	89,578
(C) 純資産総額 (A - B)	156,748,619,300
元本	144,273,817,223
次期繰越損益金	12,474,802,077
(D) 受益権総口数	144,273,817,223口
1万口当り基準価額 (C / D)	10,865円

* 期首における元本額は139,218,477,453円、当作成期間中における追加設定元本額は38,212,962,099円、同解約元本額は33,157,622,329円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、トピックス・インデックスファンド3,314,021,528円、ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A 6,818,474,579円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A 2 2,657,999円、ダイワ国内重視バランスファンド30 V A (一般投資家私募) 46,604,616円、ダイワ国内重視バランスファンド50 V A (一般投資家私募) 686,480,990円、ダイワ国際分散バランスファンド30 V A (一般投資家私募) 36,922,244円、ダイワ国際分散バランスファンド50 V A (一般投資家私募) 975,609,786円、日本株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用) 115,509,117円、D - I's T O P I X インデックス

50,828,888円、為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド12,744,127円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 22,523,341円、iFree T O P I Xインデックス1,984,833,386円、iFree 8資産バランス2,612,918,610円、iFree 年金バランス111,316,445円、D Cダイワ日本株式インデックス65,911,437,637円、ダイワ・ライフ・バランス30 3,014,014,018円、ダイワ・ライフ・バランス50 3,718,178,204円、ダイワ・ライフ・バランス70 3,338,684,763円、年金ダイワ日本株式インデックス5,125,140,712円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 12,676,182円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 49,637,084円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 35,161,355円、ダイワつみたてインデックス日本株式742,243,077円、ダイワつみたてインデックスバランス30 11,325,834円、ダイワつみたてインデックスバランス50 7,141,239円、ダイワつみたてインデックスバランス70 10,260,361円、ダイワ世界バランスファンド40 V A 146,259,723円、ダイワ世界バランスファンド60 V A 156,097,901円、ダイワ・バランスファンド35 V A 8,172,743,694円、ダイワ・バランスファンド25 V A (適格機関投資家専用) 711,092,768円、ダイワ国内バランスファンド25 V A (適格機関投資家専用) 105,455,426円、ダイワ国内バランスファンド30 V A (適格機関投資家専用) 194,955,500円、ダイワ・ノーロード T O P I Xファンド163,360,908円、ダイワファンドラップ T O P I Xインデックス10,589,328,266円、ダイワT O P I Xインデックス (ダイワSMA専用) 8,840,247,711円、ダイワファンドラップオンライン T O P I Xインデックス2,003,637,126円、ダイワ・インデックスセレクト T O P I X 1,325,135,081円、ダイワライフスタイル25 188,604,645円、ダイワライフスタイル50 670,194,395円、ダイワライフスタイル75 532,629,983円、D C・ダイワ・トピックス・インデックス (確定拠出年金専用ファンド) 11,706,727,974円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,865円です。

■損益の状況

当期 自 2019年9月20日 至 2020年9月23日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,649,405,847円
受取配当金	3,447,557,930
受取利息	20,795,599
その他収益金	189,630,937
支払利息	△ 8,578,619
(B) 有価証券売買損益	3,897,480,060
売買益	18,650,150,656
売買損	△ 14,752,670,596
(C) 先物取引等損益	△ 303,976,160
取引益	897,311,470
取引損	△ 1,201,287,630
(D) その他費用	△ 199,950
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	7,242,709,797
(F) 前期繰越損益金	5,645,547,246
(G) 解約差損益金	△ 1,278,256,907
(H) 追加信託差損益金	864,801,941
(I) 合計 (E + F + G + H)	12,474,802,077
次期繰越損益金 (I)	12,474,802,077

(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。

外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第21期（決算日 2020年11月30日）

（作成対象期間 2019年12月3日～2020年11月30日）

外国株式インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

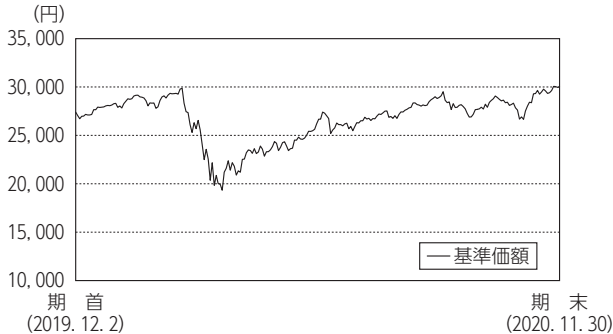
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準価額		MSCIコクサイ指数 (円ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	円	騰落率	円	騰落率	%	%	%
(期首) 2019年12月2日	27,400	—	18,243	—	90.5	6.7	2.7
12月末	28,314	3.3	18,824	3.2	92.4	5.0	2.7
2020年1月末	28,347	3.5	18,833	3.2	91.2	6.0	2.7
2月末	26,109	△ 4.7	17,323	△ 5.0	89.5	7.8	2.8
3月末	22,183	△ 19.0	14,704	△ 19.4	89.5	8.2	2.6
4月末	24,361	△ 11.1	16,099	△ 11.8	95.3	2.4	2.7
5月末	25,407	△ 7.3	16,748	△ 8.2	93.7	3.9	2.6
6月末	25,896	△ 5.5	17,045	△ 6.6	96.3	1.3	2.6
7月末	26,762	△ 2.3	17,568	△ 3.7	92.7	4.8	2.5
8月末	28,815	5.2	18,911	3.7	92.9	4.9	2.3
9月末	27,686	1.0	18,145	△ 0.5	91.9	5.9	2.3
10月末	26,911	△ 1.8	17,622	△ 3.4	92.7	4.9	2.3
(期末) 2020年11月30日	30,015	9.5	19,635	7.6	93.3	4.7	2.3

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

(注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：27,400円 期末：30,015円 騰落率：9.5%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク(MSCIコクサイ指数(円ベース))の動きをほぼ反映して、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は上昇しました。

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

○為替相場

為替相場は、当作成期を通した大きな流れで見ると米ドルなどが下落(円高)しました。

対円為替相場は、当作成期首より横ばいで推移しましたが、2020年に入ってから、新型コロナウイルスの感染拡大懸念が高まったことなどから円高が進みました。5月以降は、経済活動の再開期待などからユーロを中心に上昇しました。7月には、米中関係の悪化や追加経済対策をめぐる不透明感から米ドルを中心に下落傾向となりました。10月以降は、新型コロナウイルスの感染再拡大に対する懸念や米国大統領および連邦議会選挙に対する不透明感などから、米ドルなどが下落しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は7.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は9.5%となりました。

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

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

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (先物・オプション) (投資信託証券)	1円 (1) (0) (1) (0)
有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (投資信託証券)	1 (1) (0) (0)
その他費用 (保管費用) (その他)	6 (5) (1)
合 計	9

(注 1) 費用の項目および算出法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の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
(2019年12月 3 日から2020年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 13,951.06 (5,785.26)	千アメリカ・ドル 120,851 (△ 1,850)	百株 3,579.94	千アメリカ・ドル 7,291
	カナダ	百株 2,300 (△ 531.9)	千カナダ・ドル 8,965 (△ 334)	百株 1,004.89	千カナダ・ドル 766
	オーストラリア	百株 3,173.5 (168.63)	千オーストラリア・ドル 5,992 (29)	百株 2,203.5	千オーストラリア・ドル 784
	香港	百株 4,988 (△ 1,164.65)	千香港・ドル 19,598 (1)	百株 1,808.76	千香港・ドル 5,917
	シンガポール	百株 2,172 (777.41)	千シンガポール・ドル 1,314 (78)	百株 2,279.36	千シンガポール・ドル 434
	ニュージーランド	百株 416 (1)	千ニュージーランド・ドル 336 (1)	百株 271	千ニュージーランド・ドル 95
	イギリス	百株 11,087 (2,157.85)	千イギリス・ポンド 6,541 (△ 2)	百株 5,181.43	千イギリス・ポンド 898
	イスラエル	百株 181 (17.64)	千イスラエル・シェケル 825 (1)	百株 17.64	千イスラエル・シェケル 17
	スイス	百株 749.8 (0.12)	千スイス・フラン 5,444 (△ 120)	百株 114.3	千スイス・フラン 248
	デンマーク	百株 332.9 (1)	千デンマーク・クローネ 13,986 (1)	百株 67.2	千デンマーク・クローネ 1,876
	ノルウェー	百株 327.5 (1)	千ノルウェー・クローネ 5,160 (1)	百株 58	千ノルウェー・クローネ 821

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	スウェーデン	百株 2,038.7 (149.5)	千スウェーデン・クローネ 32,967 (1)	百株 492.5	千スウェーデン・クローネ 3,861
	ユーロ (アイルランド)	百株 52.3 (17.1)	千ユーロ 307 (148)	百株 504.6	千ユーロ 67
	ユーロ (オランダ)	百株 931.7 (△ 156.16)	千ユーロ 3,213 (△ 132)	百株 19	千ユーロ 73
	ユーロ (ベルギー)	百株 99.7 (1)	千ユーロ 704 (1)	百株 1	千ユーロ 1
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 130.2 (39.6)	千ユーロ 172 (1)	百株 1	千ユーロ 1
	ユーロ (フランス)	百株 1,114.6 (63)	千ユーロ 5,332 (△ 1)	百株 147.7	千ユーロ 407
	ユーロ (ドイツ)	百株 1,178 (143.75)	千ユーロ 5,396 (△ 89)	百株 63.2	千ユーロ 114
	ユーロ (ポルトガル)	百株 164 (827)	千ユーロ 99 (1)	百株 827	千ユーロ 7
	ユーロ (スペイン)	百株 1,954.7 (11,894.41)	千ユーロ 1,400 (244)	百株 13,870.5	千ユーロ 382
	ユーロ (イタリア)	百株 2,307.5 (1)	千ユーロ 1,399 (1)	百株 1	千ユーロ 1
外 国	ユーロ (フィンランド)	百株 419 (1)	千ユーロ 479 (1)	百株 71	千ユーロ 180
	ユーロ (オーストリア)	百株 31.5 (1)	千ユーロ 65 (1)	百株 1	千ユーロ 1
	ユーロ (ユーロ通貨圏)	百株 8,383.2 (12,828.7)	千ユーロ 18,571 (168)	百株 15,503	千ユーロ 1,234

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

(2) 新株予約権証券
(2019年12月 3 日から2020年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	アメリカ	証券 3,515	千アメリカ・ドル 54	証券 3,515 (1)	千アメリカ・ドル 16 (1)
	スイス	証券 34,320	千スイス・フラン 7	証券 1 (1)	千スイス・フラン 1 (1)

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

(3) 投資信託証券

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	アメリカ	千口 69 (△ 1.43)	千アメリカ・ドル 4,623 (—)	千口 22 (—)	千アメリカ・ドル 390 (—)
	カナダ	千口 — (4.8)	千カナダ・ドル — (103)	千口 3.7 (—)	千カナダ・ドル 35 (—)
	オーストラリア	千口 89.3 (6.466)	千オーストラリア・ドル 491 (—)	千口 6.466 (—)	千オーストラリア・ドル 5 (—)
	香港	千口 44 (—)	千香港・ドル 1,106 (—)	千口 4 (—)	千香港・ドル 275 (—)
	シンガポール	千口 144.8 (△ 23.031)	千シンガポール・ドル 315 (△ 34)	千口 — (—)	千シンガポール・ドル — (—)
国	イギリス	千口 9.3 (—)	千イギリス・ポンド 61 (—)	千口 — (—)	千イギリス・ポンド — (—)
	ユーロ (フランス)	千口 0.48 (—)	千ユーロ 49 (△ 5)	千口 — (—)	千ユーロ — (—)

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 買付()内は分割割当、合併による増減分で、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
株 式

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

当 期				期 付			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
MICROSOFT CORP (アメリカ)	千株 30.95	千円 593,011	円 19,160	BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)	千株 15.2	千円 40,017	円 2,632
AMAZON.COM INC (アメリカ)	2.15	531,816	247,356	INGENICO GROUP (フランス)	1.97	32,329	16,410
APPLE INC (アメリカ)	18.5	428,420	23,157	POWER FINANCIAL CORP (カナダ)	8	23,323	2,915
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	11.1	245,450	22,112	WHEELLOCK & CO LTD (香港)	27	23,229	860
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	1.42	208,392	146,755	APPLE INC (アメリカ)	0.5	19,006	38,013
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	9.2	198,293	21,553	GRUBHUB INC (アメリカ)	3.1	18,947	6,111
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	11.4	175,993	15,438	FLEX LTD (シンガポール)	17.25	18,027	1,045
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	1.14	165,289	144,990	POLARIS INC (アメリカ)	1.75	16,465	9,408
NVIDIA CORP (アメリカ)	3.8	139,808	36,791	SUN HUNG KAI PROPERTIES (香港)	10.5	15,103	1,438
SALESFORCE.COM INC (アメリカ)	6	136,527	22,754	MICROSOFT CORP (アメリカ)	0.7	14,844	21,205

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額 百万円	決 済 額 百万円	新規売付額 百万円	決 済 額 百万円
外国	株式先物取引	51,901	52,708	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘 柄	期 首	当	期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)					
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	33	37.5	552	57,425	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	28.5	32.3	953	99,095	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	55.5	61	726	75,458	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	41	44	387	40,285	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	16	17.8	255	26,495	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	185	173	537	55,877	金融
ABBOTT LABORATORIES	499.16	579.16	6,232	647,538	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	111.33	132.33	325	33,819	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	43.5	51.5	1,020	106,059	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	98	111	628	65,258	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	85.5	96.5	1,273	132,284	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	173.62	202.62	3,004	312,132	情報技術
QORVO INC	34	38.5	577	60,040	情報技術
AFLAC INC	216	225.5	1,021	106,078	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	36.5	43.5	478	49,688	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	42	50.5	339	35,271	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	137.5	157.7	7,522	781,539	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	64.5	70.5	273	28,396	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	31	41	1,498	155,637	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	113	144	185	19,238	金融
GARMIN LTD	39	46.5	544	56,545	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	61.3	73.1	2,030	210,994	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	205.5	227.5	4,764	494,940	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	41.75	45.75	294	30,613	金融
AUTOZONE INC	7.3	7.7	861	89,533	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	69.71	77.21	848	88,154	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	314	366.5	359	37,390	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	32	38	318	33,138	公益事業
CELANESE CORP	35	39.5	528	54,857	素材
DR HORTON INC	101.16	113.16	859	89,323	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	24.5	—	—	—	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	70	70	361	37,568	ヘルスケア
AUTODESK INC	61	72.3	1,972	204,914	情報技術
MOODY'S CORP	48	55.7	1,544	160,418	金融
DEVON ENERGY CORP	116.5	—	—	—	エネルギー
ALBEMARLE CORP	31.5	35.5	488	50,770	素材
ATMOS ENERGY CORP	33.5	40	387	40,234	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	67	80.5	424	44,123	公益事業
CITIGROUP INC	653.73	681.73	3,863	401,364	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	122.5	141.5	2,479	257,625	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	142.5	164	1,392	144,686	公益事業
ALLEGHANY CORP	4.1	4.8	283	29,415	金融
DOMINO'S PIZZA INC	11	12.7	495	51,518	一般消費財・サービス
HESS CORP	78	90	456	47,470	エネルギー
DAVITA INC	35	27.5	302	31,392	ヘルスケア
DANAHER CORP	182	208.5	4,519	469,568	ヘルスケア
FORTIVE CORP	87	98.5	703	73,095	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	162.5	180.5	1,895	196,878	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	49	—	—	—	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	56.28	—	—	—	一般消費財・サービス

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO		158	184	928	96,439	生活必需品
BUNGE LTD		40	44.5	270	28,126	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD		98.25	106.75	1,230	127,881	情報技術
APPLE INC		1,298	5,678	66,199	6,877,497	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		94	102	804	83,576	金融
BOEING CO/THE		149.9	175.6	3,801	394,962	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP		44.65	51.65	401	41,752	金融
BECTON DICKINSON AND CO		76.49	94.19	2,156	224,046	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR		67	67	123	12,870	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC		38.5	43.5	444	46,222	情報技術
CDK GLOBAL INC		36	40	186	19,423	情報技術
NISOURCE INC		110.5	126	308	32,083	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC		38.5	44.5	412	42,865	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		243.21	260.21	1,039	107,997	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC		1,169.04	1,355.04	8,208	852,815	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		363.5	455.5	10,547	1,095,738	金融
ANSYS INC		24.5	27.8	918	95,427	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP		215.5	444.17	2,154	223,802	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A		190	222	1,343	139,603	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		668.5	740	4,665	484,719	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO		910.7	997.7	12,094	1,256,458	金融
T ROWE PRICE GROUP INC		69.5	77	1,121	116,497	金融
LKQ CORP		94	91.5	329	34,202	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD		13.5	16.6	284	29,557	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B		90.62	100.62	816	84,777	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC		83	93	1,084	112,636	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC		38.1	40.1	764	79,466	金融
DOLLAR GENERAL CORP		75	83.5	1,820	189,119	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC		51.6	62.6	3,302	343,047	情報技術
CATERPILLAR INC		162	176.5	3,090	321,036	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC		70	79.5	362	37,678	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC		63	73	334	34,726	公益事業
CMS ENERGY CORP		82	93	576	59,883	公益事業
MOSAIC CO/THE		109.5	120.5	273	28,392	素材
DELTA AIR LINES INC		47.5	51.5	211	21,968	資本財・サービス
CORNING INC		232	246	912	94,790	情報技術
CISCO SYSTEMS INC		1,210.5	1,382.5	5,903	613,291	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC		37	42	214	22,309	ヘルスケア
MORGAN STANLEY		356.5	459.02	2,930	304,437	金融
WABCO HOLDINGS INC		15.5	—	—	—	その他
MSCI INC		24.5	28.2	1,134	117,847	金融
FAIR ISAAC CORP		—	10	473	49,193	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC		10	11	318	33,136	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP		16	—	—	—	資本財・サービス
COTY INC-CL A		84.39	—	—	—	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		65	75	522	54,246	情報技術
BROADCOM INC		111.22	130.52	5,154	535,541	情報技術
ACUITY BRANDS INC		11.5	—	—	—	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC		33.3	37.8	490	50,996	ヘルスケア
ARAMARK		70.5	72	260	27,062	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD		60.5	72.5	209	21,775	素材
DTE ENERGY COMPANY		52.5	62.5	803	83,456	公益事業
CENTENE CORP		121.5	189.87	1,199	124,606	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC		32	35	320	33,347	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP		130.5	143	488	50,719	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額		
			千アメリカ・ドル	千円	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	53.5	61.5	712	74,025	金融
GARTNER INC	27.2	29.2	445	46,277	情報技術
SPLUNK INC	45	51.8	1,056	109,798	情報技術
DOMINION ENERGY INC	226.41	276.41	2,184	226,973	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	117	128.5	1,081	112,339	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	41.5	42.5	242	25,202	資本財・サービス
DEERE & CO	87.5	96.5	2,527	262,614	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	81.84	98.84	1,947	202,320	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	25	28.3	402	41,772	情報技術
CABLE ONE INC	—	1.7	333	34,652	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	19	21.9	485	50,413	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	34.5	37	470	48,864	金融
VAIL RESORTS INC	11.2	13.6	384	39,938	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	41	46	201	20,903	金融
TARGA RESOURCES CORP	65.5	—	—	—	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	18	22.5	270	28,101	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	21.8	24.3	226	23,510	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	10.5	—	—	—	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	92	109	847	88,066	公益事業
COGNEX CORP	50.5	55	409	42,568	情報技術
TELEFLEX INC	13.3	15	556	57,822	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	26	28	378	39,354	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	22	24	667	69,305	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	6.5	7.1	379	39,467	ヘルスケア
WELLCARE HEALTH PLANS INC	15.2	—	—	—	その他
CATALENT INC	—	51.5	501	52,112	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	38	44.8	1,238	128,667	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	—	20	414	43,014	ヘルスケア
IDEX CORP	22.5	25.2	484	50,360	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	230.5	268	2,275	236,382	生活必需品
ROLLINS INC	43.25	49.25	280	29,179	資本財・サービス
AMETEK INC	65.25	74.25	889	92,388	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	73.5	82	707	73,493	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	36.5	43.5	179	18,632	資本財・サービス
HEICO CORP	12	14	177	18,480	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	25.5	31	328	34,080	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	11.5	12.4	400	41,577	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	75	88.5	777	80,780	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	11	13	553	57,549	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	124	144.4	5,608	582,651	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	24	26	319	33,145	情報技術
GRUBHUB INC	26	—	—	—	一般消費財・サービス
EPAM SYSTEMS INC	16.5	18	586	60,953	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	38	43.5	381	39,619	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6.9	8.8	1,142	118,646	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	69.5	—	—	—	金融
UGI CORP	52	70.5	261	27,216	公益事業
CUMMINS INC	43.5	48.5	1,110	115,400	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	215.5	253	1,976	205,384	コミュニケーション・サービス
SABRE CORP	76.5	—	—	—	情報技術
CDW CORP/DE	43.5	46.5	614	63,878	情報技術
SIGNATURE BANK	15	16.5	190	19,747	金融
COSTAR GROUP INC	9.9	13.1	1,158	120,360	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	14.9	17.1	604	62,851	金融
AMERCO	2.2	2.9	118	12,275	資本財・サービス

銘 柄	期 首	当	期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	18. 5	31. 5	636	66,101	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	12. 7	14. 8	2,239	232,700	一般消費財・サービス
HANESBRANDS INC	110	—	—	—	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	23	25	394	40,984	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	81.66	90.16	941	97,797	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	10. 2	11. 7	238	24,738	情報技術
DEXCOM INC	27	30	954	99,176	ヘルスケア
NORDSON CORP	—	17. 3	353	36,731	資本財・サービス
COPART INC	58. 5	68. 5	789	81,988	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	46. 5	51. 5	224	23,284	エネルギー
SEAGEN INC	32. 5	39. 5	668	69,401	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	22. 7	25. 1	1,193	123,993	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	13. 3	17. 1	1,011	105,088	資本財・サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	26	28	267	27,797	ヘルスケア
NIELSEN HOLDINGS PLC	99	111	180	18,727	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	575.81	673.81	993	103,253	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	79	90	1,377	143,103	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	11. 5	12. 2	651	67,668	金融
CABOT OIL & GAS CORP	120. 5	124	220	22,891	エネルギー
T-MOBILE US INC	100	183.27	2,417	251,136	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	34. 5	45. 5	491	51,075	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	1,141. 5	1,336	7,040	731,460	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	71	65	285	29,685	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	48. 5	55. 5	493	51,293	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	30. 5	—	—	—	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	86. 5	95	211	21,979	金融
CSX CORP	221. 5	252. 5	2,305	239,473	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	26. 8	31. 3	626	65,035	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	40. 75	43. 75	541	56,237	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	24	27. 5	251	26,098	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	117. 7	138. 8	44,351	4,607,658	一般消費財・サービス
FLOWSERVE CORP	35. 5	—	—	—	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	60	202. 4	1,725	179,279	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,196. 55	1,384. 05	5,562	577,887	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	37. 5	42	164	17,073	情報技術
AES CORP	201	219	460	47,870	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	12. 4	13. 5	315	32,741	金融
EOG RESOURCES INC	164	193	992	103,121	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	48. 5	52	542	56,356	情報技術
ABIOMED INC	12. 9	15. 2	413	42,936	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	46. 5	49. 5	510	53,071	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	92. 4	101. 4	1,156	120,187	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1,109. 23	1,263. 23	1,148	119,294	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	46. 9	46. 9	128	13,389	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	37	48. 5	573	59,551	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48. 87	48. 87	110	11,514	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	—	8. 5	133	13,876	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	100. 89	103. 89	255	26,497	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	40	40	154	16,065	資本財・サービス
FORTINET INC	41. 5	48	594	61,730	情報技術
MARKEL CORP	4. 1	4. 6	461	47,994	金融
NEXTERA ENERGY INC	135. 5	640. 8	4,814	500,160	公益事業
MASIMO CORP	—	17	432	44,932	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	434. 08	472. 08	1,110	115,352	素材
INSULET CORP	17. 5	22. 2	558	58,000	ヘルスケア

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
US BANCORP		428	441.5	1,951	202,779	金融
UNITED RENTALS INC		23	23.5	547	56,862	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC		17.5	19	312	32,480	情報技術
FASTENAL CO		163	186	903	93,873	資本財・サービス
FISERV INC		161.63	185.83	2,146	223,040	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO		2,468.5	2,880.5	2,995	311,225	資本財・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN		61	—	—	—	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO		361	426	1,919	199,422	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC		33	—	—	—	コミュニケーション・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP		69	79.5	1,208	125,590	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC		92.9	107.6	2,532	263,143	金融
ALPHABET INC-CL A		84	98.2	17,548	1,823,117	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C		87.47	98.87	17,729	1,841,893	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING		31.5	33.5	248	25,858	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC		168.5	200.5	1,205	125,250	生活必需品
FIRSTENERGY CORP		152.68	180.68	482	50,155	公益事業
GENUINE PARTS CO		43	48.5	477	49,560	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD		106.34	125.84	1,165	121,034	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP		207	230	604	62,795	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC		64.1	71.6	1,392	144,656	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC		30	—	—	—	資本財・サービス
HALLIBURTON CO		248	276	484	50,350	エネルギー
HOME DEPOT INC		310	352	9,714	1,009,275	一般消費財・サービス
ASSURANT INC		17.5	19	254	26,408	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC		299	318	396	41,164	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE		11.9	12.9	212	22,049	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE		43.5	47.4	701	72,905	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC		44.5	—	—	—	一般消費財・サービス
HUMANA INC		38.3	43.5	1,768	183,701	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV		81.5	93	1,478	153,564	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A		21	23.6	690	71,774	情報技術
HENRY SCHEIN INC		45	45	286	29,770	ヘルスケア
HP INC		426	473	1,053	109,434	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE		394	419	470	48,840	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C		48	59.78	252	26,227	コミュニケーション・サービス
HOLLYFRONTIER CORP		47	—	—	—	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C		60	65	276	28,760	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A		25	29.5	124	12,890	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD		119	132	435	45,295	金融
KRAFT HEINZ CO/THE		198.53	217.53	714	74,215	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP		250	291.5	3,624	376,580	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO		107	122	618	64,247	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI		40	43.5	369	38,417	資本財・サービス
ZOETIS INC		135.5	156	2,518	261,691	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC		69.79	79.79	1,144	118,952	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC		65.5	76.5	449	46,715	エネルギー
ALLEGION PLC		26.5	29	331	34,430	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC		35	—	—	—	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C		117.73	129.73	283	29,408	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC		75.57	85.07	887	92,250	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC		96.5	105	233	24,227	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC		22	24	333	34,695	ヘルスケア
JM SMUCKER CO/THE		34.2	36.7	427	44,418	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON		748	862	12,412	1,289,565	ヘルスケア
ABBVIE INC		417.79	577.72	6,059	629,542	ヘルスケア

銘柄	株数	株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額		
			千アメリカ・ドル	千円	
HOLOGIC INC	75.5	83.5	580	60,298	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	99.5	112.5	1,590	165,227	生活必需品
KROGER CO	229.5	255	826	85,913	生活必需品
KLA CORP	46.5	50.3	1,278	132,799	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	71.7	82.6	3,092	321,232	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	25.6	27.8	743	77,286	情報技術
LOWE'S COS INC	224.5	244.5	3,781	392,878	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	246.05	281.85	4,155	431,724	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	42.3	48.2	2,200	228,612	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	14.5	16.5	221	22,963	不動産
LOEWS CORP	79	83	360	37,431	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	57.99	62.49	307	31,915	金融
MCDONALD'S CORP	216	243	5,305	551,179	一般消費財・サービス
3M CO	162.5	188.5	3,334	346,408	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	676.5	787.5	21,877	2,272,857	コミュニケーション・サービス
MANPOWERGROUP INC	17.8	—	—	—	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	69.8	79	2,698	280,337	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	18.4	21.1	571	59,407	素材
CONCHO RESOURCES INC	58	62	384	39,948	エネルギー
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	66	—	—	—	その他
PHILLIPS 66	128.5	141.5	923	95,890	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	121	—	—	—	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	144.5	152.5	436	45,343	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	77.88	—	—	—	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	33.5	40.5	755	78,462	生活必需品
MYLAN NV	148.5	—	—	—	その他
METLIFE INC	235	255.5	1,212	125,950	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	181	217	978	101,696	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	15.1	18.7	509	52,951	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	48	48	220	22,899	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	47.78	56.58	981	101,961	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6.4	8	901	93,640	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	144.73	213.73	422	43,920	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	33.8	37.6	962	99,973	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	727.21	826.21	6,598	685,477	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	211.68	242.18	1,563	162,383	素材
MASCO CORP	86	87	471	49,024	資本財・サービス
M & T BANK CORP	35.69	42.89	518	53,906	金融
MARSH & MCLENNAN COS	144.5	168.5	1,926	200,192	金融
BLACK KNIGHT INC	44	50	452	47,025	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	23	25	284	29,535	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	78.72	91.22	1,170	121,635	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	48	56.8	1,271	132,098	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	18.5	21	547	56,872	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	101	118	2,507	260,528	情報技術
TRANSUNION	55	61.5	571	59,324	資本財・サービス
VISTRA CORP	100.5	142.5	279	29,001	公益事業
CAPRI HOLDINGS LTD	44.5	—	—	—	一般消費財・サービス
BEIGENE LTD-ADR	10.5	14.5	414	43,066	ヘルスケア
NETAPP INC	74.5	74.5	396	41,222	情報技術
NIKE INC -CL B	355.5	406	5,450	566,257	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	75	84.5	2,050	213,076	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	68	80	1,064	110,547	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	37.5	41.5	384	39,971	金融
ALLY FINANCIAL INC	114.5	125.5	384	39,988	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額		
			千アメリカ・ドル	千円	
NORTHROP GRUMMAN CORP	44.5	52.2	1,597	165,961	資本財・サービス
APTIV PLC	72	87	1,060	110,142	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	231.61	264.61	1,547	160,763	素材
MCKESSON CORP	55.5	52.5	945	98,176	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	81	87	716	74,485	情報技術
XYLEM INC	51.5	58.7	570	59,239	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	440.5	510	3,870	402,147	生活必需品
NUCOR CORP	87	99	545	56,640	素材
SUNRUN INC	—	39	260	27,045	資本財・サービス
WESTERN UNION CO	129.46	129.46	291	30,288	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	53	57	453	47,077	情報技術
NEWELL BRANDS INC	122.92	125.42	264	27,453	一般消費財・サービス
EVERGY INC	68.5	74	412	42,875	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	257.24	302.24	500	51,997	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	7	8.2	185	19,302	金融
OKTA INC	30	38.6	911	94,655	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	—	21.8	712	74,045	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	31.5	36	568	59,081	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	107.05	133.55	418	43,454	ヘルスケア
LINDE PLC	152.96	171.96	4,426	459,896	素材
WIX.COM LTD	14.5	17.8	460	47,825	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	83	133	345	35,925	金融
KKR & CO INC	147	163	630	65,551	金融
PAYCHEX INC	93.5	107	999	103,792	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	22	24.1	1,067	110,953	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	528.5	611.5	2,468	256,465	生活必需品
P G & E CORP	—	355	451	46,949	公益事業
PFIZER INC	1,571.13	1,819.13	6,772	703,607	ヘルスケア
CIGNA CORP	106.8	121.6	2,584	268,451	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	45.51	78.51	548	56,948	情報技術
ALTICE USA INC- A	41	109	374	38,875	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	148.5	174.5	1,179	122,586	公益事業
STERIS PLC	25	28.5	546	56,756	ヘルスケア
FOX CORP - CLASS B	48.33	54.33	156	16,216	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	99.99	108.49	316	32,866	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	95	111.2	2,588	268,955	ヘルスケア
DOW INC	210.68	240.68	1,333	138,523	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	—	28	167	17,398	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	51.8	2,442	253,797	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	37.5	41.7	1,137	118,204	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	52	315	1,597	165,982	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	46.5	53.5	588	61,178	エネルギー
POLARIS INC	15.5	—	—	—	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	707.67	809.17	11,215	1,165,220	生活必需品
EXELON CORP	273.72	322.72	1,347	139,943	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	66	73.5	910	94,555	ヘルスケア
TELADOC HEALTH INC	—	23	451	46,941	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	—	113.58	508	52,863	資本財・サービス
NVR INC	1	1.1	453	47,085	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	319	355	1,518	157,776	エネルギー
TWILIO INC - A	31.5	40.5	1,292	134,241	情報技術
DOCUSIGN INC	29	57.5	1,304	135,524	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	14	16.1	670	69,710	情報技術
MATCH GROUP INC	18	—	—	—	その他
PEPSICO INC	395.5	454	6,564	682,021	生活必需品

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL		11	13	147	15,288	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A		52	80	156	16,240	情報技術
MONGODB INC		12.5	16.2	437	45,444	情報技術
SNAP INC - A		208	295	1,357	141,070	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC		215.68	248.18	953	99,034	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		118	128	999	103,843	金融
AMCOR PLC		479	522	599	62,256	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A		—	46.5	701	72,864	情報技術
ROKU INC		24	33.5	922	95,826	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC		51.5	60	922	95,826	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A		180.8	208.5	5,215	541,786	情報技術
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A		—	126	512	53,237	情報技術
PENTAIR PLC		47.05	55.05	292	30,368	資本財・サービス
QUALCOMM INC		343.5	364.5	5,242	544,654	情報技術
INVESCO LTD		109.5	120	204	21,206	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC		20.5	23.5	352	36,604	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP		83.5	92	472	49,127	金融
DATADOG INC - CLASS A		—	43.5	419	43,574	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A		45	131	913	94,886	コミュニケーション・サービス
RAYTHEON COMPANY		79.2	—	—	—	その他
DISH NETWORK CORP-RTS		3.49	—	—	—	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC		—	25	422	43,901	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS		22	33.2	1,706	177,303	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC		67.5	74	718	74,602	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC		12.3	13.5	2,771	287,890	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC		107	118	1,292	134,285	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA		26.5	31	411	42,759	素材
RESMED INC		41.5	48.5	1,016	105,630	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC		38	43.5	542	56,399	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC		33.5	36	235	24,501	資本財・サービス
MODERNA INC		—	88	1,117	116,134	ヘルスケア
RALPH LAUREN CORP		14.5	14.5	127	13,253	一般消費財・サービス
PERKINELMER INC		31	37.3	482	50,089	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP		—	266.37	1,007	104,632	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP		—	137.18	923	95,970	資本財・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC		—	58	254	26,434	金融
AVANTOR INC		—	155	408	42,431	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE		—	47	134	13,979	金融
DYNATRACE INC		—	61	234	24,347	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A		—	13.3	1,161	120,639	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP		302.35	321.35	501	52,147	金融
IAC/INTERACTIVECORP		—	25.3	360	37,449	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC		—	81.7	1,140	118,515	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP		538.18	610.18	5,571	578,828	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A		—	65	708	73,592	一般消費財・サービス
ZSCALER INC		—	24	359	37,335	情報技術
EDISON INTERNATIONAL		103	123.5	775	80,562	公益事業
TESLA INC		37.7	242.7	14,216	1,476,941	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A		—	10	328	34,157	情報技術
NORTONLIFELOCK INC		184.5	178.5	323	33,583	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC		44.22	50.22	942	97,934	資本財・サービス
SYNOPSYS INC		43.5	50.4	1,136	118,031	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		44.15	46.85	3,011	312,866	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC		—	386.21	658	68,410	ヘルスケア
CBRE GROUP INC - A		91.5	108.5	663	68,906	不動産

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額		
			千アメリカ・ドル	千円	
TWITTER INC	211.5	259.5	1,209	125,604	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	293.5	347.5	2,107	218,957	公益事業
SYSCO CORP	137	160	1,139	118,417	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	73.03	84.03	1,129	117,364	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	39.5	43	239	24,842	金融
STEEL DYNAMICS INC	62	66	248	25,815	素材
SCHLUMBERGER LTD	392.02	460.02	1,006	104,567	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	46	50.5	255	26,520	資本財・サービス
AT&T INC	2,065.91	2,332.91	6,772	703,588	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	40.5	47	224	23,305	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	123	129	369	38,396	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	23.3	26.9	1,979	205,632	素材
SEMPRA ENERGY	79	96.7	1,261	131,062	公益事業
TIFFANY & CO	32.5	36.5	480	49,948	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	71	76.5	447	46,477	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	265	297.5	4,729	491,394	情報技術
SALESFORCE.COM INC	234.21	294.21	7,285	756,892	情報技術
WESTROCK CO	71.3	85.3	375	39,045	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	229.84	244.84	1,125	116,931	資本財・サービス
TERADYNE INC	50	55	601	62,510	情報技術
UNION PACIFIC CORP	199.5	219.8	4,519	469,579	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	248	—	—	—	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	193.88	215.88	894	92,895	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	231.37	494.79	3,656	379,924	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	197	230.5	3,892	404,434	資本財・サービス
UNUM GROUP	59	—	—	—	金融
SPRINT CORP	231.65	—	—	—	その他
IQVIA HOLDINGS INC	48.94	62.44	1,054	109,505	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	43.5	43.5	258	26,812	金融
AMEREN CORPORATION	72	80.5	635	66,060	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	267.76	310.16	10,481	1,088,927	ヘルスケア
VERISIGN INC	30	33.7	675	70,203	情報技術
VALERO ENERGY CORP	117.42	131.42	744	77,304	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	16.1	17.6	495	51,432	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	81.88	86.88	317	32,998	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	25	25	330	34,312	ヘルスケア
ANTHEM INC	72.8	83	2,596	269,723	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	509.12	591.62	8,704	904,311	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,209.22	1,274.22	3,626	376,749	金融
WASTE MANAGEMENT INC	119.5	140	1,668	173,357	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	347	402	862	89,625	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	34.5	37	515	53,572	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	19	19.5	391	40,711	一般消費財・サービス
WALMART INC	405	464	7,034	730,787	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	29	—	—	—	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	58	67.5	1,012	105,202	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	29	30.5	308	32,073	一般消費財・サービス
XEROX HOLDINGS CORP	59.11	—	—	—	情報技術
WABTEC CORP	54.11	58.61	432	44,948	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	342.5	394	2,490	258,776	一般消費財・サービス
WATERS CORP	20.5	20.5	467	48,615	ヘルスケア
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	18	—	—	—	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	91.57	—	—	—	その他
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	16.5	17.6	663	68,933	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	220	247	963	100,077	生活必需品

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
WILLIS TOWERS WATSON PLC		37. 23	41. 73	874	90, 846	金融
WESTERN DIGITAL CORP		84	97. 5	447	46, 442	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC		90. 8	104. 8	1, 003	104, 238	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP		146	168	997	103, 586	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES		489. 5	552	11, 647	1, 210, 027	情報技術
PPL CORP		211	248	721	75, 001	公益事業
PULTEGROUP INC		75	89	394	41, 016	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC		67. 5	78. 5	1, 160	120, 519	素材
NORTHERN TRUST CORP		60	64	615	63, 923	金融
NVIDIA CORP		163	201	10, 662	1, 107, 679	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP		23. 5	—	—	—	コミュニケーション・サービス
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP		127. 43	138. 43	1, 935	201, 038	金融
HD SUPPLY HOLDINGS INC		53	53	295	30, 729	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A		83	98	637	66, 177	生活必需品
NETFLIX INC		123. 2	144	7, 075	735, 082	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		113	129. 2	5, 857	608, 580	ヘルスケア
NRG ENERGY INC		79. 5	79. 5	258	26, 850	公益事業
GLOBE LIFE INC		29. 25	32. 25	309	32, 171	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA		48. 5	57	742	77, 183	金融
TEXTRON INC		68. 5	71. 5	335	34, 815	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A		117. 37	131. 37	232	24, 170	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP		59. 5	67. 5	227	23, 597	公益事業
OMNICOM GROUP		64	71. 5	450	46, 797	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP		676. 83	720. 33	4, 160	432, 247	情報技術
MASTERCARD INC - A		255	292	9, 900	1, 028, 598	情報技術
ONEOK INC		119	144	536	55, 696	エネルギー
CENTURYLINK INC		294. 52	311. 52	325	33, 852	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC		30. 2	34. 2	1, 432	148, 801	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC		89. 5	98	1, 050	109, 122	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE		30. 5	37	652	67, 810	コミュニケーション・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP		13. 3	—	—	—	情報技術
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B		56. 5	60. 5	283	29, 415	生活必需品
NOBLE ENERGY INC		145. 5	—	—	—	その他
BANK OF AMERICA CORP		2, 554. 01	2, 556. 01	7, 409	769, 811	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC		10. 5	12. 1	467	48, 553	資本財・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		52. 5	58. 5	470	48, 863	ヘルスケア
NORDSTROM INC		30	—	—	—	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO		200	226	2, 725	283, 134	金融
ANALOG DEVICES INC		106. 49	121. 99	1, 680	174, 578	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES		291	383	3, 339	346, 927	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP		83	—	—	—	その他
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP		245. 22	283. 22	1, 124	116, 841	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC		51. 5	55	748	77, 801	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		49. 5	59	480	49, 943	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP		25	27. 5	413	42, 940	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A		165	179	1, 403	145, 813	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO		174	197	1, 539	159, 964	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A		69. 7	76. 2	1, 574	163, 537	金融
AMGEN INC		173	192. 5	4, 327	449, 593	ヘルスケア
TAPESTRY INC		83. 5	—	—	—	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC		121. 36	130. 86	1, 595	165, 723	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A		46. 8	55. 8	1, 142	118, 729	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC		272	302	2, 496	259, 343	情報技術
CME GROUP INC		101	118	2, 062	214, 250	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC		116. 94	116. 94	153	15, 975	エネルギー

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ECOLAB INC		75.5	84.5	1,899	197,354	素材
EQUIFAX INC		33.5	40.5	667	69,315	資本財・サービス
GAP INC/THE		59.5	—	—	—	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC		359.5	411.5	2,470	256,632	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC		—	115	353	36,750	生活必需品
HORMEL FOODS CORP		83.5	96	453	47,074	生活必需品
STATE STREET CORP		109.43	117.43	840	87,338	金融
SUNTRUST BANKS INC		129.48	—	—	—	その他
SCHWAB (CHARLES) CORP		340	502.9	2,499	259,664	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC		136	169	1,283	133,383	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO		48.5	60	293	30,531	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC		38.5	45.5	434	45,171	素材
CARDINAL HEALTH INC		90	94.5	508	52,799	ヘルスケア
FEDEX CORP		69	82	2,356	244,844	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP		135.04	151.04	1,325	137,709	金融
FMC CORP		39.5	42	485	50,471	素材
FLEX LTD		147.5	—	—	—	情報技術
CERNER CORP		93.5	100.5	744	77,367	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		30.24	28.24	318	33,114	素材
CITRIX SYSTEMS INC		37	38	465	48,337	情報技術
INTEL CORP		1,266.5	1,386	6,576	683,239	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC		115	124	282	29,371	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP		103.5	116.5	533	55,468	金融
ILLINOIS TOOL WORKS		94.5	103	2,185	227,100	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC		461	346	226	23,544	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC		40.4	48.5	1,537	159,740	ヘルスケア
SEALED AIR CORP		44	50	222	23,131	素材
INTUITIVE SURGICAL INC		32.1	38.2	2,787	289,636	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH		34.5	40.5	484	50,372	情報技術
SNAP-ON INC		15.5	16.3	288	29,973	資本財・サービス
CARMAX INC		49.5	53.5	510	53,007	一般消費財・サービス
COMERICA INC		45	45	231	24,071	金融
INGREDION INC		19	21.5	171	17,857	生活必需品
DUKE ENERGY CORP		205.28	241.78	2,287	237,621	公益事業
TARGET CORP		144	162.8	2,926	304,050	一般消費財・サービス
DOVER CORP		42.5	48	594	61,775	資本財・サービス
WW GRAINGER INC		14	14.9	617	64,175	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC		39.5	42.5	449	46,740	資本財・サービス
CINTAS CORP		26.2	29.4	1,061	110,290	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC		138	158	567	58,994	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC		41	47.5	347	36,117	生活必需品
CLOROX COMPANY		37.5	40.5	822	85,451	生活必需品
ENTERGY CORP		54	66.5	741	77,038	公益事業
MICROSOFT CORP		2,056.5	2,359	50,772	5,274,781	情報技術
INCYTE CORP		53.5	60	499	51,893	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP		367.69	429.69	2,916	302,975	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC		379.38	438.98	5,030	522,594	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC		312	366.5	2,354	244,560	情報技術
BLACKROCK INC		32	50	3,575	371,463	金融
CENTERPOINT ENERGY INC		149	158	380	39,509	公益事業
HASBRO INC		36	44	406	42,200	一般消費財・サービス
KELLOGG CO		73	84	533	55,397	生活必需品
KEYCORP		299	326	532	55,306	金融
KANSAS CITY SOUTHERN		30	31.5	596	62,014	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A		406.61	468.11	2,689	279,439	生活必需品

銘柄		期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
KOHLS CORP		49.5	—	—	—	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE		14	17.7	603	62,651	ヘルスケア
APACHE CORP		106.1	—	—	—	エネルギー
CHUBB LTD		129.49	148.69	2,251	233,904	金融
ARROW ELECTRONICS INC		24	27	251	26,089	情報技術
ALLSTATE CORP		96	102.5	1,067	110,895	金融
EBAY INC		233.5	256.5	1,316	136,809	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC		315	365	7,715	801,587	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO		41.5	45.5	454	47,222	素材
XILINX INC		71.5	80	1,099	114,270	情報技術
DISH NETWORK CORP-A		64.5	82	294	30,591	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA		52	52	205	21,317	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A		61	74.5	1,832	190,352	生活必需品
TRIMBLE INC		70.5	82.5	498	51,811	情報技術
LENNAR CORP-A		81	90	699	72,659	一般消費財・サービス
LEAR CORP		18	18	263	27,414	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP		70	—	—	—	その他
PROGRESSIVE CORP		168	193	1,706	177,308	金融
PACCAR INC		100.37	114.87	1,007	104,707	資本財・サービス
PVH CORP		20	—	—	—	一般消費財・サービス
BIOGEN INC		56.1	56.2	1,370	142,333	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC		25.2	27.7	1,258	130,716	ヘルスケア
STARBUCKS CORP		342.5	383.5	3,783	393,079	一般消費財・サービス
PTC INC		31.5	37	401	41,748	情報技術
PERRIGO CO PLC		38	42	201	20,957	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY		88.8	109.8	965	100,302	公益事業
INTUIT INC		73.4	85.7	3,035	315,393	情報技術
BORGWARNER INC		63	82	323	33,649	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC		69	76	855	88,928	一般消費財・サービス
BALL CORP		91.84	105.84	1,019	105,954	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP		392.97	470.97	1,582	164,401	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC		86.5	95.7	1,188	123,453	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO		36.5	43.5	619	64,321	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		72.5	85.5	1,938	201,377	ヘルスケア
VF CORP		95	109	934	97,069	一般消費財・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B		100.71	183.75	644	66,938	コミュニケーション・サービス
VIACOM INC-CLASS B		100.71	—	—	—	その他
MOHAWK INDUSTRIES INC		17.2	19	248	25,769	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		26	30.7	533	55,464	ヘルスケア
CARNIVAL CORP		118.5	153	330	34,301	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A		1,281.9	1,490.9	7,715	801,553	コミュニケーション・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD		67	72	172	17,877	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		67	75	396	41,218	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD		90	90	36	3,824	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		353	403	170	17,668	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株 数、金 額	85,908.78	102,065.16	1,043,158	108,373,741	
	銘柄 数 < 比 率 >	612 銘柄	591 銘柄		<66.8%>	
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD		83	83	201	16,078	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		6	7	1,134	90,681	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		59.96	—	—	—	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN		71.87	92.87	705	56,377	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		132	149	760	60,765	素材
INTACT FINANCIAL CORP		40.5	46.5	668	53,422	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
BCE INC	45.3	49.3	281	22,478	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	57	62	1,050	83,994	素材
SUNCOR ENERGY INC	444.3	501.3	1,123	89,816	エネルギー
METRO INC/CN	77	82	492	39,374	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	95	110	808	64,621	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	346	399	2,589	206,999	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	125.5	146.5	1,628	130,174	金融
TORONTO-DOMINION BANK	516	594	4,211	336,706	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	83	91	277	22,197	金融
ROYAL BANK OF CANADA	405.5	467.5	5,056	404,265	金融
TC ENERGY CORP	261.5	310.5	1,841	147,233	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	146.29	178.29	607	48,564	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	628	—	—	—	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	514	586	1,725	137,975	素材
CAE INC	79	79	264	21,139	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	58.12	57.12	592	47,357	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	53	53	188	15,110	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	16	—	—	—	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	46.5	46.5	278	22,302	素材
HYDRO ONE LTD	92	105	311	24,907	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	54.6	59.6	383	30,639	生活必需品
WSP GLOBAL INC	30	37	353	28,291	資本財・サービス
PARKLAND CORP	44	44	174	13,926	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	53	53	174	13,962	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	72	77	419	33,507	公益事業
SSR MINING INC	—	72	165	13,233	素材
CANADIAN UTILITIES LTD-A	40	40	131	10,492	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	106	116	706	56,479	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	72	78	656	52,501	素材
STARS GROUP INC/THE	63	—	—	—	その他
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	150	189	386	30,885	公益事業
B2GOLD CORP	—	347	243	19,503	素材
AIR CANADA	41	41	101	8,148	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	379	403	375	30,061	素材
BANK OF MONTREAL	180	211	2,041	163,245	金融
POWER CORP OF CANADA	94	181	537	42,964	金融
METHANEX CORP	17	—	—	—	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	28	35	4,700	375,804	情報技術
NUTRIEN LTD	165.19	188.19	1,210	96,744	素材
AURORA CANNABIS INC	198	—	—	—	ヘルスケア
CANOPY GROWTH CORP	62	74	277	22,186	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	55	55	59	4,766	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	58	88	457	36,599	素材
CAMECO CORP	106	128	169	13,539	エネルギー
TELUS CORP	54	108	272	21,793	コミュニケーション・サービス
POWER FINANCIAL CORP	80	—	—	—	その他
TECK RESOURCES LTD-CLS B	151	151	315	25,195	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	18	18	299	23,926	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	351	389	1,220	97,562	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	8	9	400	32,034	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	92	92	736	58,865	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	22.37	25.37	247	19,776	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	—	70	267	21,356	素材
BLACKBERRY LTD	160	160	127	10,220	情報技術

銘柄		期首	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
SUN LIFE FINANCIAL INC		174.5	192.5	1,139	91,080	金融
ENBRIDGE INC		571	665	2,772	221,652	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		239.5	434.25	2,314	185,013	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP		560	638	1,430	114,360	金融
BAUSCH HEALTH COS INC		95	105	265	21,255	ヘルスケア
ENCANA CORP		368	—	—	—	その他
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		39	45	1,898	151,753	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC		33	33	192	15,426	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC		63	63	220	17,593	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO		204.5	233.5	3,305	264,306	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A		73	79	771	61,695	情報技術
HUSKY ENERGY INC		93.58	—	—	—	エネルギー
ONEX CORPORATION		26	26	185	14,821	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		138	151	342	27,380	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC		24	24	83	6,698	金融
TMX GROUP LTD		—	19	240	19,190	金融
OPEN TEXT CORP		81	87	506	40,474	情報技術
CI FINANCIAL CORP		70	70	122	9,765	金融
SAPUTO INC		71	80	288	23,031	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		193	193	348	27,836	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		256	283	1,216	97,291	生活必需品
YAMANA GOLD INC		—	323	215	17,198	素材
FORTIS INC		130	150	794	63,488	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS		—	38	337	26,944	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP		194	194	200	16,006	素材
CENOVUS ENERGY INC		314	314	218	17,472	エネルギー
DOLLARAMA INC		90	97	511	40,892	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I		22	22	87	6,977	公益事業
ALTAGAS LTD		79	91	173	13,874	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC		48	—	—	—	不動産
KEYERA CORP		60	74	173	13,879	エネルギー
INTER PIPELINE LTD		128	128	172	13,825	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,924.58 86 銘柄	12,687.79 82 銘柄	64,939	5,191,951 <3.2%>	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
MEDIBANK PRIVATE LTD		788	888	256	19,737	金融
BHP GROUP LTD		836.5	957.5	3,707	285,139	素材
SOUTH32 LTD		1,516	1,516	372	28,682	素材
ALUMINA LTD		693	—	—	—	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		266.5	305.5	694	53,406	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD		425	565	1,049	80,694	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK		133	—	—	—	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		794.5	1,024.5	2,389	183,748	金融
WESTPAC BANKING CORP		973.48	1,173.48	2,397	184,385	金融
SANTOS LTD		531	531	331	25,524	エネルギー
AUSNET SERVICES		500	650	120	9,298	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP		798.5	924.5	2,134	164,177	金融
RIO TINTO LTD		105	122.5	1,249	96,099	素材
ORIGIN ENERGY LTD		535	535	277	21,355	エネルギー
AURIZON HOLDINGS LTD		600	600	258	19,842	資本財・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		34	34	99	7,664	エネルギー
COLES GROUP LTD		345.45	430.45	772	59,392	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD		45	45	134	10,365	情報技術

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		—	250	321	24,707	素材
EVOLUTION MINING LTD		—	530	270	20,788	素材
AFTERPAY LTD		—	70	662	50,983	情報技術
TPG TELECOM LTD		—	120	93	7,171	コミュニケーション・サービス
OIL SEARCH LTD		384	642	234	18,022	エネルギー
SEEK LTD		96	107	278	21,445	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		205	235	216	16,682	生活必需品
NEWCREST MINING LTD		234	260	704	54,170	素材
INCITEC PIVOT LTD		498	—	—	—	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		501.5	574.5	4,636	356,615	金融
AMPOL LTD		71.5	79.5	243	18,728	エネルギー
ORICA LTD		115	131	221	17,006	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		384.5	464.5	477	36,689	金融
CIMIC GROUP LTD		28	28	71	5,504	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD		362	413	1,551	119,304	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD		137	157	198	15,274	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD		577	727.63	285	21,993	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD		116	116	115	8,876	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD		240	305	168	12,948	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD		1,202	1,345	418	32,171	コミュニケーション・サービス
AMP LTD		1,020	1,020	177	13,649	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		133.5	142.5	556	42,764	素材
MACQUARIE GROUP LTD		91.84	110.84	1,523	117,206	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD		174.5	184.5	612	47,082	一般消費財・サービス
CSL LTD		127.5	147.5	4,469	343,730	ヘルスケア
WESFARMERS LTD		323	370	1,845	141,970	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD		16.5	20.5	455	35,034	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD		163	163	281	21,687	素材
SUNCORP GROUP LTD		382.57	412.57	419	32,301	金融
BORAL LTD		358	—	—	—	素材
ASX LTD		58	62.5	482	37,128	金融
COMPUTERSHARE LTD		139	159	225	17,376	情報技術
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		140	—	—	—	一般消費財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		709.36	709.36	377	29,024	金融
SONIC HEALTHCARE LTD		132.5	143.5	477	36,707	ヘルスケア
CHALLENGER LTD		174	—	—	—	金融
WORLEY LTD		94	—	—	—	エネルギー
AGL ENERGY LTD		190	190	260	20,048	公益事業
BRAMBLES LTD		474	504	559	43,026	資本財・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L		14	—	—	—	一般消費財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD		42.5	57.5	366	28,161	ヘルスケア
TPG CORP LTD		87	—	—	—	コミュニケーション・サービス
REA GROUP LTD		16	16	226	17,396	コミュニケーション・サービス
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD		38	38	231	17,821	金融
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	20,170.2 58銘柄	21,308.83 53銘柄	40,966	3,150,719 <1.9%>	
(香港)		百株	百株	千香港・ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		405	475	1,957	26,223	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		650	770	4,754	63,713	一般消費財・サービス
MTR CORP		455	525	2,249	30,144	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES		455	445	4,685	62,790	不動産
SINO LAND CO		900	1,040	1,092	14,632	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		771.69	956.69	5,500	73,712	資本財・サービス

銘柄		期首		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千香港・ドル	千円	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		155	155	720	9,658	不動産
CLP HOLDINGS LTD		470	560	4,088	54,779	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		435.07	485.07	1,566	20,994	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		2,901.99	3,773.58	4,566	61,184	公益事業
HANG SENG BANK LTD		225	261	3,591	48,124	金融
WHEELOCK & CO LTD		240	—	—	—	その他
NEW WORLD DEVELOPMENT		1,830	525	2,173	29,124	不動産
WH GROUP LTD		2,950	3,210	2,105	28,217	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		337	419	16,181	216,835	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD		570	660	1,323	17,732	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		93	108	1,003	13,444	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		190	—	—	—	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD		425	—	—	—	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD		175	225	450	6,030	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD		366.4	452.4	743	9,966	金融
MICROPORT SCIENTIFIC CORP		—	260	902	12,089	ヘルスケア
SJM HOLDINGS LTD		580	580	528	7,080	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		326	382	899	12,054	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD		741.69	911.69	3,988	53,447	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		200	200	801	10,733	公益事業
PCCW LTD		1,170	1,470	686	9,198	コミュニケーション・サービス
AIA GROUP LTD		3,730	4,194	37,116	497,366	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		360	570	2,146	28,757	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD		220	—	—	—	生活必需品
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		344	609	1,689	22,645	生活必需品
SANDS CHINA LTD		720	824	2,727	36,547	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		410	470	4,756	63,735	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		1,075	1,255	3,162	42,378	金融
WYNN MACAU LTD		420	540	740	9,927	一般消費財・サービス
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	25,296.84 34銘柄	27,311.43 31銘柄	118,901	1,593,274 <1.0%>	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD		348	420	968	75,244	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD		497	629	1,615	125,490	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD		149.7	436.75	196	15,302	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD		429	513	268	20,884	資本財・サービス
UOL GROUP LTD		140	140	105	8,211	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		136	161	126	9,843	不動産
CAPITALAND LTD		775	829	260	20,223	不動産
YANGZIJANG SHIPBUILDING		693	913	83	6,525	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		514	—	—	—	コミュニケーション・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		27	27	56	4,405	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		937	1,164	1,181	91,787	金融
GENTING SINGAPORE LTD		1,700	2,090	176	13,720	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD		86	86	164	12,808	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		2,254.5	2,909.5	704	54,701	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING		440	500	201	15,615	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		288	—	—	—	資本財・サービス
SATS LTD		196	—	—	—	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD		233	273	251	19,555	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD		648	—	—	—	資本財・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD		589	659	282	21,963	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,080.2 20銘柄	11,750.25 16銘柄	6,645	516,283 <0.3%>	

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ニュージーランド)		百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD		345	415	256	18,750	公益事業
MERCURY NZ LTD		230	230	138	10,089	公益事業
A2 MILK CO LTD		214	262	384	28,100	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD		526.89	620.89	288	21,107	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		294	389	297	21,770	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD		201	—	—	—	素材
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		187	204	692	50,634	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD		118	140	210	15,353	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株 数、金 額	2,115.89	2,260.89	2,267	165,805	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8 銘柄	7 銘柄		<0.1%>	
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
TUI AG-DI		137.97	—	—	—	一般消費財・サービス
BP PLC		5,750	6,665	1,752	242,771	エネルギー
UNILEVER PLC		317.6	384.1	1,761	244,053	生活必需品
BARCLAYS PLC		4,968	5,688	793	109,936	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		527	2,795	300	41,687	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC		561	—	—	—	一般消費財・サービス
PRUDENTIAL PLC		757	849	1,028	142,566	金融
NATWEST GROUP PLC		1,457.91	1,597.91	256	35,566	金融
EVRAZ PLC		150	150	58	8,150	素材
JOHNSON MATTHEY PLC		60.64	60.64	136	18,895	素材
BAE SYSTEMS PLC		943	1,065	536	74,397	資本財・サービス
AVIVA PLC		1,138.66	1,289.66	417	57,910	金融
AVEVA GROUP PLC		20	20	67	9,352	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC		1,410	1,651	2,284	316,493	ヘルスケア
INFORMA PLC		362	499	269	37,347	コミュニケーション・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL		105.4	—	—	—	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC		1,455	1,565	249	34,541	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC		283	319	174	24,229	コミュニケーション・サービス
DCC PLC		28	31.5	179	24,815	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC		135	152	337	46,710	一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		21	24.5	265	36,830	資本財・サービス
HALMA PLC		110	122.5	271	37,678	情報技術
GVC HOLDINGS PLC		167	191	199	27,587	一般消費財・サービス
NMC HEALTH PLC		27	—	—	—	その他
JD SPORTS FASHION PLC		130	146	107	14,831	一般消費財・サービス
M&G PLC		757	837	161	22,433	金融
RELX PLC		555.46	631.46	1,100	152,405	資本財・サービス
DIAGEO PLC		675	769	2,255	312,496	生活必需品
RIO TINTO PLC		322.5	370	1,821	252,344	素材
STANDARD CHARTERED PLC		821	868	402	55,765	金融
TESCO PLC		2,817	3,207	730	101,218	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC		264.5	290.5	421	58,461	ヘルスケア
GLENCORE PLC		3,245.25	3,307.25	706	97,852	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC		81.5	102.5	146	20,357	金融
SMITHS GROUP PLC		113.83	123.83	181	25,177	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		419.83	419.83	124	17,281	金融
PEARSON PLC		235.63	235.63	153	21,220	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC		542.25	542.25	117	16,265	生活必需品
NEXT PLC		42	44.5	290	40,186	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC		932	1,177	185	25,635	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC		38.61	68.61	216	30,057	一般消費財・サービス
BUNZL PLC		96.05	112.05	259	35,954	資本財・サービス

銘柄		期 首		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
VODAFONE GROUP PLC		7,661.83	8,701.83	1,086	150,584	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		36.61	42.61	253	35,126	素材
KINGFISHER PLC		624.11	682.11	184	25,601	一般消費財・サービス
WPP PLC		384	409	306	42,466	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC		206.27	228.27	205	28,438	公益事業
SEVERN TRENT PLC		71.33	78.33	187	25,916	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC		540	612	300	41,616	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		203	234.5	1,528	211,704	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC		151.5	165.5	168	23,377	金融
SCHRODERS PLC		34.5	41.5	134	18,594	金融
SSE PLC		300	339	467	64,816	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE		79.5	—	—	—	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		310	340	213	29,630	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC		370.5	431.5	3,352	464,524	ヘルスケア
FERGUSON PLC		70.87	74.87	623	86,346	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		1,830	1,955	501	69,422	金融
3I GROUP PLC		293.91	313.91	337	46,797	金融
ASHTREAD GROUP PLC		136.5	146.5	461	63,937	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE		323.14	351.14	214	29,667	情報技術
NATIONAL GRID PLC		981.34	1,144.34	999	138,539	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC		20,814.65	22,964.65	856	118,663	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC		317.6	317.6	214	29,675	金融
IMPERIAL BRANDS PLC		288	304	429	59,514	生活必需品
CENTRICA PLC		1,761.6	—	—	—	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE		36	41.5	194	26,937	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		650.1	753.6	2,017	279,508	生活必需品
BHP GROUP PLC		605.27	687.27	1,194	165,475	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		106	115	244	33,874	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC		5,716.5	6,696.5	2,711	375,619	金融
ANGLO AMERICAN PLC		310.83	403.83	914	126,756	素材
MONDI PLC		142.5	156.5	264	36,633	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS		663	734	134	18,671	生活必需品
CARNIVAL PLC		48.61	—	—	—	一般消費財・サービス
EASYJET PLC		40	—	—	—	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC		464.89	589.39	835	115,793	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC		93	106	285	39,594	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC		2,461	2,901	351	48,754	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI		58	65.5	142	19,810	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC		121.89	132.89	228	31,696	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		51.36	56.36	269	37,270	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC		48	52	286	39,639	資本財・サービス
ITV PLC		1,021	—	—	—	コミュニケーション・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		91.99	104.99	831	115,207	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		1,233	1,350	1,808	250,524	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		1,057.18	1,223.18	1,595	220,990	エネルギー
MEGGITT PLC		241	—	—	—	資本財・サービス
G4S PLC		435	—	—	—	資本財・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		—	57	150	20,785	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC		55.5	61.5	175	24,258	金融
ANTOFAGASTA PLC		114	128	158	21,937	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		708.62	708.62	192	26,606	金融
EXPERIAN PLC		261.54	296.54	766	106,206	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株 数、金 額	87,608.13	95,671.55	49,505	6,858,983	
	銘柄 数 < 比 率 >	93 銘柄	83 銘柄		<4.2%>	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル)		百株	百株	千イスラエル・シケル	千円	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		345	345	394	12,369	金融
AZRIELI GROUP LTD		10	14	281	8,832	不動産
ICL GROUP LTD		176	236	366	11,501	素材
ELBIT SYSTEMS LTD		6	9.5	406	12,724	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM		307	357	792	24,838	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL		452	512	980	30,728	金融
NICE LTD		18.5	22	1,751	54,896	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		41	41	298	9,354	金融
株数、金額		1,355.5	1,536.5	5,272	165,244	
イスラエル・シケル通貨計		銘柄数<比率>	8銘柄	8銘柄	<0.1%>	
(スイス)		百株	百株	千スイス・フラン	千円	
DUFREY AG-REG		12.5	—	—	—	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG		1,104	1,200	1,579	181,560	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		2.3	2.8	229	26,364	素材
ADECCO GROUP AG-REG		46.5	51.5	277	31,913	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		199.4	229.8	6,951	799,208	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR		11	—	—	—	金融
SIKA AG-REG		38.4	47.1	1,086	124,871	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.03	0.03	246	28,282	生活必需品
ABB LTD-REG		538	601	1,451	166,869	資本財・サービス
SWISS RE AG		90	97.5	816	93,868	金融
NESTLE SA-REG		869	972	9,943	1,143,211	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG		5.2	5.9	570	65,553	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		12.6	12.6	314	36,186	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		751.7	799.7	936	107,709	金融
JULIUS BAER GROUP LTD		64	74	388	44,614	金融
SGS SA-REG		1.6	2	517	59,508	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		5.8	6.9	166	19,197	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG		13	14.5	191	22,063	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG		19.7	21.2	244	28,054	情報技術
ALCON INC		124.3	161.3	932	107,225	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR		8.5	9.7	222	25,582	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		44.72	48.62	1,810	208,109	金融
BALOISE HOLDING AG - REG		13.9	15.7	249	28,681	金融
CLARIANT AG-REG		57	57	104	12,041	素材
NOVARTIS AG-REG		610.5	726	5,884	676,593	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.7	1	197	22,672	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG		153.1	171.6	1,317	151,478	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG		7.7	8.3	399	45,909	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		—	10.1	96	11,135	金融
GEBERIT AG-REG		11.3	11.9	646	74,317	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG		2.6	3	1,092	125,650	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG		2.9	3.4	352	40,477	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG		16.9	18.22	407	46,859	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		—	55	430	49,549	情報技術
LONZA GROUP AG-REG		22	24	1,324	152,257	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG		15.2	15.2	67	7,762	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		142.9	172.9	831	95,555	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		10.4	10.4	425	48,915	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		16.7	18	364	41,927	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG		23.3	25.1	205	23,605	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.34	0.34	262	30,196	生活必需品
株数、金額		5,069.69	5,705.31	43,537	5,005,544	
スイス・フラン通貨計		銘柄数<比率>	39銘柄	39銘柄	<3.1%>	

銘 柄		期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
(デンマーク)						
NOVO NORDISK A/S-B		506	595	24,945	416,837	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S		184	227	2,360	39,448	金融
ISS A/S		44	—	—	—	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A		0.95	1.05	1,209	20,212	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S		17	23	446	7,454	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		56	68	8,391	140,216	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S		—	43	2,156	36,027	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B		30	36.5	3,430	57,319	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES		64	72.5	2,604	43,528	素材
COLOPLAST-B		33.5	40.5	3,765	62,924	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S		62.1	71.6	7,306	122,096	資本財・サービス
DEMANT A/S		34.25	34.25	749	12,516	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		2	2.2	2,731	45,640	資本財・サービス
TRYG A/S		33	40	724	12,104	金融
PANDORA A/S		31.5	35	2,272	37,968	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S		30.5	34.5	2,103	35,154	素材
GENMAB A/S		19.5	22.9	5,310	88,738	ヘルスケア
ORSTED A/S		55	66	7,434	124,237	公益事業
AMBU A/S-B		—	56	1,128	18,855	ヘルスケア
デンマーク・クローネ通貨計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,203.3 17 銘柄	1,469 18 銘柄	79,071 <0.8%>	1,321,281
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORSK HYDRO ASA		417	417	1,521	17,889	素材
DNB ASA		281	331	5,413	63,662	金融
ORKLA ASA		219.5	244.5	2,103	24,739	生活必需品
TELENOR ASA		208	254	3,896	45,821	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA		279.73	338.23	4,966	58,410	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		49.6	57.1	2,078	24,442	素材
MOWI ASA		128.5	141	2,582	30,369	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		55.5	73.5	1,411	16,595	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS		31	31	1,060	12,467	コミュニケーション・サービス
AKER BP ASA		29	—	—	—	エネルギー
ADEVINTA ASA		—	81	1,173	13,802	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,698.83 10 銘柄	1,968.33 10 銘柄	26,207 <0.2%>	308,201
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB		27	35.2	1,448	17,704	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS		856.3	996.3	10,575	129,235	情報技術
VOLVO AB-B SHS		414	508.5	10,164	124,215	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		18	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SKF AB-B SHARES		105.5	133	2,859	34,943	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B		66.5	76	1,559	19,057	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB		49	56.5	3,909	47,777	生活必需品
TELE2 AB-B SHS		156	168	1,861	22,746	コミュニケーション・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		482.5	574	5,361	65,513	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		465.5	528.5	4,662	56,974	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		266	318	4,970	60,745	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		235.5	282	5,150	62,941	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B		—	207	2,878	35,173	素材
SKANSKA AB-B SHS		102.5	115.5	2,396	29,286	資本財・サービス
SANDVIK AB		331.5	384.5	7,543	92,186	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS		127	156	9,282	113,426	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		184.5	229.5	10,091	123,313	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
SECURITAS AB-B SHS		95. 5	109. 5	1, 564	19, 121	資本財・サービス
TELIA CO AB		830	862	3, 173	38, 784	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB		88	110	2, 445	29, 881	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS		112. 5	132. 5	5, 061	61, 851	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		293. 5	341. 5	7, 062	86, 300	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS		22	26	1, 165	14, 240	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		—	52	1, 144	13, 979	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		—	104	2, 486	30, 386	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB		52. 5	63. 5	1, 365	16, 683	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B		168. 5	212	5, 802	70, 905	生活必需品
BOLIDEN AB		78	93	2, 780	33, 980	素材
EPIROC AB-A		206. 5	222. 5	3, 216	39, 302	資本財・サービス
EPIROC AB-B		116	135	1, 855	22, 675	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		114. 5	141. 5	1, 292	15, 793	一般消費財・サービス
NORDEA BANK ABP		897	1, 111	8, 280	101, 185	金融
EQT AB		—	81	1, 547	18, 910	金融
EVOLUTION GAMING GROUP		—	44	3, 036	37, 110	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B		73	83	3, 400	41, 554	金融
HEXAGON AB-B SHS		72	99	7, 054	86, 208	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		46	57	1, 505	18, 402	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株 数、 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	7, 152. 8 32 銘柄	8, 848. 5 36 銘柄	149, 959	1, 832, 500 <1. 1%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (アイルランド)						
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		68	75. 5	268	33, 412	素材
AIB GROUP PLC		230	—	—	—	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC		274. 6	—	—	—	金融
KINGSPAN GROUP PLC		44	50	360	44, 776	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		45. 7	51. 5	599	74, 560	生活必需品
CRH PLC		231	253. 5	865	107, 676	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		22	49. 6	763	95, 006	一般消費財・サービス
国 小 計	株 数、 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	915. 3 7 銘柄	480. 1 5 銘柄	2, 857	355, 432 <0. 2%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オランダ)						
QIAGEN N. V.		64. 98	72. 98	296	36, 917	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		264. 26	302. 1	1, 305	162, 437	ヘルスケア
NN GROUP NV		90. 5	90. 5	311	38, 744	金融
HEINEKEN NV		76	85. 5	763	94, 902	生活必需品
AEGON NV		536. 44	582. 44	178	22, 153	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		336. 33	362. 33	862	107, 303	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.		65. 38	65. 38	586	72, 894	素材
KONINKLIJKE DSM NV		53	57	780	97, 128	素材
WOLTERS KLUWER		83	89	620	77, 223	資本財・サービス
ING GROEP NV		1, 110. 5	1, 262. 5	1, 062	132, 156	金融
KONINKLIJKE KPN NV		1, 009. 5	1, 146. 5	290	36, 192	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		120. 6	139. 3	5, 103	634, 742	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA		117	130. 5	123	15, 416	金融
ADYEN NV		3	6	969	120, 598	情報技術
UNILEVER NV		416	479. 5	2, 409	299, 751	生活必需品
JUST EAT TAKEAWAY		—	40	352	43, 871	一般消費財・サービス
PROSUS NV		145	161	1, 501	186, 714	一般消費財・サービス
VOPAK		19	23	105	13, 085	エネルギー
RANDSTAD NV		32	37	190	23, 663	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		34	37. 5	293	36, 521	生活必需品

銘柄		期首		当		期末		業種等
		株数	株数	評価額				
				外貨建金額	邦貨換算金額			
		百株	百株	千ユーロ	千円			
ALTICE EUROPE NV		205	205	92	11,474	コミュニケーション・サービス		
STMICROELECTRONICS NV		199.5	210.5	699	86,950	情報技術		
AIRBUS SE		165.5	194	1,746	217,167	資本財・サービス		
ARGENX SE		—	14.5	340	42,382	ヘルスケア		
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		162	195	186	23,172	生活必需品		
EXOR NV		32.3	35.3	207	25,781	金融		
CNH INDUSTRIAL NV		298	328	301	37,508	資本財・サービス		
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		323.5	360	476	59,221	一般消費財・サービス		
FERRARI NV		34.95	41.45	740	92,052	一般消費財・サービス		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,997.24	6,753.78	22,898	2,848,130			
		27銘柄	29銘柄		<1.8%>			
		百株	百株	千ユーロ	千円			
ユーロ（ベルギー）								
GALAPAGOS NV		13	13.9	146	18,170	ヘルスケア		
UCB SA		35.5	41.3	373	46,509	ヘルスケア		
KBC GROUP NV		74.5	82.5	492	61,239	金融		
COLRUYT SA		16	16	78	9,787	生活必需品		
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		22	36	298	37,128	金融		
SOLVAY SA		22	24.5	236	29,406	素材		
UMICORE		58	63.5	243	30,257	素材		
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		216	249	1,425	177,306	生活必需品		
AGEAS		52.4	57.9	242	30,138	金融		
PROXIMUS		41	49.5	89	11,079	コミュニケーション・サービス		
TELENET GROUP HOLDING NV		14.5	14.5	50	6,323	コミュニケーション・サービス		
ELIA GROUP SA/NV		—	10.5	100	12,472	公益事業		
SOFINA		—	5.5	144	17,991	金融		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	564.9	664.6	3,921	487,811			
		11銘柄	13銘柄		<0.3%>			
		百株	百株	千ユーロ	千円			
ユーロ（ルクセンブルグ）								
AROUNDTOWN SA		271	370	222	27,612	不動産		
ARCELORMITTAL		203	233	356	44,322	素材		
EUROFINS SCIENTIFIC		3.2	44	297	36,946	ヘルスケア		
SES		110	110	86	10,808	コミュニケーション・サービス		
TENARIS SA		133	133	89	11,090	エネルギー		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	720.2	890	1,051	130,780			
		5銘柄	5銘柄		<0.1%>			
		百株	百株	千ユーロ	千円			
ユーロ（フランス）								
JCDECAUX SA		19	27	48	6,007	コミュニケーション・サービス		
TOTAL SE		679.5	810.5	3,055	380,053	エネルギー		
MICHELIN（CGDE）		50	57	617	76,745	一般消費財・サービス		
AIR LIQUIDE SA		134.77	155.77	2,151	267,564	素材		
KERING		21.8	25	1,515	188,497	一般消費財・サービス		
SCHNEIDER ELECTRIC SE		156.5	182	2,137	265,873	資本財・サービス		
BOUYGUES SA		67	74	249	31,091	資本財・サービス		
BNP PARIBAS		320.5	364.5	1,597	198,687	金融		
PEUGEOT SA		175.5	191.5	382	47,613	一般消費財・サービス		
NATIXIS		295.5	295.5	78	9,765	金融		
THALES SA		32.3	35	279	34,765	資本財・サービス		
DANONE		176	200	1,055	131,295	生活必需品		
CARREFOUR SA		170	198	272	33,862	生活必需品		
SUEZ		99.25	112.25	181	22,582	公益事業		
VIVENDI		268.91	268.91	682	84,921	コミュニケーション・サービス		
L'OREAL		71.7	82.3	2,545	316,614	生活必需品		

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首	当	期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		145.5	168.5	679	84,460	資本財・サービス
LEGRAND SA		80.17	88.17	629	78,323	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		15.5	—	—	—	生活必需品
PERNOD RICARD SA		60.87	69.37	1,107	137,793	生活必需品
EURAZEO SE		12.54	12.54	65	8,110	金融
SOCIETE GENERALE SA		220.5	269.5	466	58,084	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		79.3	91	4,513	561,401	一般消費財・サービス
ACCOR SA		53.5	61.5	185	23,131	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		47.7	53.2	637	79,238	情報技術
VALEO SA		71.5	77	258	32,102	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		64	70.5	271	33,724	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA		88	97	208	25,987	資本財・サービス
EIFFAGE		23.4	27.4	230	28,688	資本財・サービス
SODEXO SA		27	27	197	24,582	一般消費財・サービス
IPSEN		11.5	11.5	92	11,442	ヘルスケア
INGENICO GROUP		18	—	—	—	その他
ORPEA		—	18	188	23,474	ヘルスケア
AMUNDI SA		17	19.5	132	16,456	金融
TELEPERFORMANCE		17.7	19.2	528	65,672	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		24.5	30	236	29,440	コミュニケーション・サービス
FAURECIA		22.5	22.5	96	11,955	一般消費財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		8	9	264	32,866	ヘルスケア
SEB SA		6.5	6.5	97	12,086	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA		83	92.5	1,118	139,154	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA		0.8	1	89	11,132	資本財・サービス
WORLDLINE SA		23.64	78.14	611	76,061	情報技術
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		—	30	105	13,119	一般消費財・サービス
AXA SA		553.5	638.5	1,259	156,704	金融
EDENRED		69	79.5	386	48,125	情報技術
RENAULT SA		58	58	197	24,610	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL		9	10.2	839	104,462	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU		6.3	7.5	112	13,936	生活必需品
ATOS SE		29.6	32	244	30,392	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SE		39.8	43.6	677	84,218	情報技術
WENDEL		7.8	7.8	73	9,100	金融
ORANGE		583	659	704	87,622	コミュニケーション・サービス
ALSTOM		44.5	63	284	35,410	資本財・サービス
CNP ASSURANCES		48.5	48.5	65	8,131	金融
SANOFI		318.75	370.75	3,159	392,936	ヘルスケア
VINCI SA		145.5	170	1,495	186,030	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		164.5	175	346	43,086	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		343	376	370	46,130	金融
BIOMERIEUX		11.5	13.4	159	19,883	ヘルスケア
ENGIE		521.23	602.23	753	93,781	公益事業
EDF		170.5	202.5	263	32,717	公益事業
SAFRAN SA		93.2	104.2	1,281	159,412	資本財・サービス
ILIAD SA		7.4	4.9	85	10,580	コミュニケーション・サービス
ARKEMA		19.2	22.2	216	26,916	素材
ADP		9.1	9.1	98	12,280	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS		47	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SCOR SE		49.5	49.5	143	17,867	金融
GETLINK SE		124	142	202	25,132	資本財・サービス
BOLLORE		241	286	93	11,582	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額	7,675.23	8,705.13	43,379	5,395,493	
	銘柄数 < 比率 >	67 銘柄	66 銘柄		< 3.3% >	

銘	柄	期 首	当	期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ドイツ)						
BAYER AG-REG		268. 2	322. 7	1, 597	198, 720	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		53	65	163	20, 324	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		593. 5	639. 5	606	75, 436	金融
COMMERZBANK AG		281. 35	329. 35	177	22, 088	金融
VOLKSWAGEN AG		8. 9	10. 1	162	20, 212	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		52. 7	61. 2	893	111, 075	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG		217. 5	250. 5	2, 822	351, 079	資本財・サービス
E. ON SE		642	742	678	84, 353	公益事業
UNIPER SE		59. 5	66. 5	187	23, 374	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		98. 5	110	803	100, 000	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		45	50. 5	145	18, 089	資本財・サービス
CONTINENTAL AG		31. 7	35. 9	419	52, 221	一般消費財・サービス
BASF SE		261. 7	301. 2	1, 834	228, 226	素材
ALLIANZ SE-REG		120. 4	134. 7	2, 668	331, 963	金融
THYSSENKRUPP AG		114. 5	114. 5	63	7, 923	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		52	58	521	64, 825	生活必需品
RWE AG		162. 5	212	739	91, 947	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		66. 5	96. 5	97	12, 086	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		11. 8	11. 8	55	6, 889	資本財・サービス
BRENNTAG AG		47	50	319	39, 714	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		122	135. 5	515	64, 161	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		33. 2	33. 2	111	13, 841	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG		7. 1	7. 1	57	7, 139	資本財・サービス
SAP SE		279. 92	341. 92	3, 423	425, 875	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		41. 6	46. 1	1, 087	135, 205	金融
ZALANDO SE		35. 5	49. 5	398	49, 537	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG		45	49	296	36, 872	素材
KION GROUP AG		18. 5	21	147	18, 309	資本財・サービス
WIRECARD AG		34. 7	—	—	—	情報技術
COVESTRO AG		52	56	265	33, 050	素材
SARTORIUS AG-VORZUG		10. 5	12. 1	440	54, 781	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		46. 5	50	275	34, 204	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE		32	41. 5	410	51, 101	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		12. 5	12. 5	139	17, 335	ヘルスケア
METRO AG		50	50	39	4, 888	生活必需品
NEMETSCHEK SE		—	20	130	16, 181	情報技術
SCOUT24 AG		—	36	226	28, 231	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		45	86	329	41, 011	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG		14. 5	23	247	30, 804	資本財・サービス
TEAMVIEWER AG		—	44. 5	176	21, 896	情報技術
SIEMENS ENERGY AG		—	131. 25	327	40, 681	資本財・サービス
KION GROUP AG-RTS		—	21	—	—	資本財・サービス
BEIERSDORF AG		30. 9	32. 9	312	38, 834	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE-PREF		19. 5	23. 5	113	14, 106	素材
MERCK KGAA		37. 5	42. 5	566	70, 517	ヘルスケア
ADIDAS AG		51. 2	61. 7	1, 673	208, 125	一般消費財・サービス
PUMA SE		23. 6	27. 1	222	27, 680	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		31	34	272	33, 894	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		959. 5	1, 092. 5	1, 655	205, 933	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		62. 7	69. 2	490	60, 955	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		261	281	1, 590	197, 786	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		371. 5	413	1, 222	152, 077	情報技術
HANNOVER RUECK SE		17. 3	20	278	34, 602	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘		柄	期 首	当	期 末		業 種 等
			株 数	株 数	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE POST AG-REG			292	324	1,314	163,533	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG			56.4	62.6	857	106,709	金融
LANXESS AG			25	25	148	18,495	素材
MTU AERO ENGINES AG			15.3	17.1	349	43,473	資本財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE			106	110	451	56,095	不動産
SYMRISE AG			39.2	42.2	444	55,296	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI			263	338	80	10,064	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF			15.5	19.5	108	13,461	一般消費財・サービス
VONOVIA SE			153	170.5	964	119,945	不動産
LEG IMMOBILIEN AG			—	23	271	33,756	不動産
国 小 計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	6,899.87 57 銘柄	8,158.42 62 銘柄	37,393	4,651,011 <2.9%>	
ユーロ（ポルトガル）			百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS			60	77	109	13,570	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA			747	883	406	50,520	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA			139.5	150.5	143	17,891	エネルギー
国 小 計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	946.5 3 銘柄	1,110.5 3 銘柄	659	81,983 <0.1%>	
ユーロ（スペイン）			百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA			1,320.27	1,572.27	587	73,060	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA			92.5	103.5	251	31,269	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA			1,910.12	2,205.12	872	108,557	金融
IBERDROLA SA			1,703.34	1,944.34	2,230	277,387	公益事業
BANCO DE SABADELL SA			1,601.09	—	—	—	金融
BANKINTER SA			183	215	89	11,161	金融
REPSOL SA			418	494	419	52,141	エネルギー
GRIFOLS SA			85	98	239	29,778	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA			4,772.5	5,477.5	1,350	167,938	金融
AMADEUS IT GROUP SA			123.5	146	880	109,574	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA			94	94	187	23,278	公益事業
MAPFRE SA			306.5	306.5	48	6,019	金融
CAIXABANK SA			1,093	1,175	258	32,196	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV			78.76	88.76	238	29,609	資本財・サービス
AENA SME SA			20	22.5	323	40,243	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA			58	104.55	537	66,892	コミュニケーション・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL			323	360	1,018	126,628	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE			66.5	77	222	27,639	資本財・サービス
ENAGAS SA			69	79.5	165	20,547	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA			125.5	139	238	29,615	公益事業
FERROVIAL SA			142	162.7	384	47,778	資本財・サービス
BANKIA SA			301.05	—	—	—	金融
国 小 計		株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	14,886.63 22 銘柄	14,865.24 20 銘柄	10,542	1,311,317 <0.8%>	
ユーロ（イタリア）			百株	百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA			68.5	78.5	211	26,264	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI			315.43	372.43	538	67,029	金融
MEDIOBANCA SPA			170.65	188.65	145	18,137	金融
UNICREDIT SPA			576.56	696.56	633	78,788	金融
TELECOM ITALIA SPA			2,629.82	2,629.82	105	13,123	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP			1,719.5	1,719.5	73	9,168	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO			4,262.37	5,507.37	1,070	133,206	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	
ATLANTIA SPA		146.57	172.57	263	32,775	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		160	160	140	17,512	金融
MONCLER SPA		51.5	63	258	32,135	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		30.5	34.5	156	19,443	ヘルスケア
ENI SPA		725	841	721	89,770	エネルギー
PIRELLI & C SPA		110	110	47	5,944	一般消費財・サービス
DIASORIN SPA		—	8.5	146	18,268	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		—	83	89	11,087	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA		—	120.5	191	23,815	情報技術
LEONARDO SPA		109.75	131.75	78	9,809	資本財・サービス
ENEL SPA		2,307.34	2,671.34	2,271	282,488	公益事業
SNAM SPA		616	666	313	38,941	公益事業
TERNA SPA		428	463	293	36,464	公益事業
FINCOBANK SPA		180	197	258	32,135	金融
国小計		株数、金額 銘柄数＜比率＞	14,607.49 18銘柄	16,914.99 21銘柄	8,010 <0.6%>	
ユーロ（フィンランド）		百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ		156	175.5	496	61,775	素材
NOKIA OYJ		1,585	1,864	637	79,244	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		120	147	118	14,722	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		170.5	188.5	273	34,007	素材
NELES OYJ		28	—	—	—	資本財・サービス
ELISA OYJ		41.5	46	208	25,986	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		125	153	551	68,565	金融
FORTUM OYJ		138.5	138.5	267	33,221	公益事業
KONE OYJ-B		99	112.5	783	97,417	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ		36.5	—	—	—	一般消費財・サービス
NESTE OYJ		120.5	139	799	99,410	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		27.5	32	127	15,916	ヘルスケア
国小計		株数、金額 銘柄数＜比率＞	2,648 12銘柄	2,996 10銘柄	4,263 <0.3%>	
ユーロ（オーストリア）		百株	百株	千ユーロ	千円	
VERBUND AG		20	20	118	14,676	公益事業
OMV AG		44.5	44.5	131	16,339	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		87	94.5	236	29,361	金融
VOESTALPINE AG		28.5	42.5	114	14,235	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		34	44	73	9,172	金融
ANDRITZ AG		21	21	73	9,126	資本財・サービス
国小計		株数、金額 銘柄数＜比率＞	235 6銘柄	266.5 6銘柄	746 <0.1%>	
ユーロ通貨計		株数、金額 銘柄数＜比率＞	56,096.36 235銘柄	61,805.26 240銘柄	135,724 <10.4%>	
ファンド合計		株数、金額 銘柄数＜比率＞	316,681.1 1,252銘柄	354,388.8 1,214銘柄	— <93.3%>	

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

(注 2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注 3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国新株予約権証券

銘 柄	当 期 末		
	証券数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(スイス) CIF -CW	証券 34,320	千スイス・フラン 7	千円 868

(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) 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		
	□ 数	□ 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3. 867	4. 587	770	79, 997
SIMON PROPERTY GROUP INC	8. 887	10. 137	867	90, 095
BOSTON PROPERTIES INC	4. 25	4. 95	507	52, 675
VORNADO REALTY TRUST	5. 097	5. 397	217	22, 612
SBA COMMUNICATIONS CORP	3. 15	3. 65	1, 042	108, 348
EQUITY RESIDENTIAL	10. 7	12. 35	731	75, 956
EQUINIX INC	2. 288	2. 918	2, 044	212, 363
AMERICAN TOWER CORP	12. 45	14. 5	3, 394	352, 634
HOST HOTELS & RESORTS INC	21. 943	22. 243	325	33, 784
KIMCO REALTY CORP	12. 6	—	—	—
INVITATION HOMES INC	12. 7	17. 7	509	52, 885
VICI PROPERTIES INC	13. 5	15. 4	395	41, 085
VENTAS INC	10. 5	12. 2	584	60, 711
WEYERHAEUSER CO	21. 164	24. 114	692	71, 924
AGNC INVESTMENT CORP	15. 3	18. 1	281	29, 277
CROWN CASTLE INTL CORP	11. 75	13. 75	2, 298	238, 800
IRON MOUNTAIN INC	8. 21	9. 71	258	26, 853
VEREIT INC	29. 3	33. 5	245	25, 545
SUN COMMUNITIES INC	2. 75	3. 25	450	46, 800
PROLOGIS INC	17. 812	24. 402	2, 454	255, 033
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3. 07	4. 12	668	69, 400
CAMDEN PROPERTY TRUST	2. 9	3. 2	312	32, 493
DUKE REALTY CORP	10. 2	12. 15	466	48, 458
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1. 95	2. 17	542	56, 362
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2. 2	2. 36	208	21, 666
WELLTOWER INC	11. 45	13. 85	893	92, 865
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	14. 35	17. 65	527	54, 789
LIBERTY PROPERTY TRUST	4. 4	—	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3. 25	3. 75	465	48, 308
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4. 8	5. 8	340	35, 376
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	43. 7	45. 1	368	38, 233
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4. 55	5. 35	205	21, 337
REALTY INCOME CORP	8. 9	11. 2	690	71, 722
PUBLIC STORAGE	4. 37	5. 22	1, 148	119, 323
REGENCY CENTERS CORP	4. 95	5. 3	248	25, 818
SL GREEN REALTY CORP	2. 4	—	—	—
UDR INC	8. 1	9. 75	382	39, 727
WP CAREY INC	5. 1	5. 8	405	42, 113
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	6. 4	7. 6	272	28, 305

銘 柄	期 首 □ 数	当 期 □ 数	期 末 評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
DIGITAL REALTY TRUST INC	千□ 6.05	千□ 8.9	千アメリカ・ドル 1,216	千円 126,423
EXTRA SPACE STORAGE INC	3.75	4.25	467	48,568
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	13	17.25	337	35,071
ア メ リ カ ・ ド ル 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	398,058 42 銘柄	443,628 39 銘柄	28,239 2,933,750 <1.8%>
(カナダ)	千□	千□	千カナダ・ドル	千円
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	4.8	74	5,986
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2.1	2.1	50	4,071
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2.4	2.4	123	9,851
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3.7	—	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4.7	4.7	85	6,827
カ ナ ダ ・ ド ル 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	12.9 4 銘柄	14 4 銘柄	334 26,736 <0.0%>
(オーストラリア)	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円
LENDLEASE GROUP	17	21.5	305	23,480
TRANSURBAN GROUP	76.5	89.5	1,267	97,469
SYDNEY AIRPORT	33.3	42.5	285	21,965
APA GROUP	35.8	38.1	402	30,972
SCENTRE GROUP	153.922	159.922	460	35,422
DEXUS	33.15	33.15	325	25,036
GPT GROUP	56.16	63.16	299	23,025
MIRVAC GROUP	111.6	126.1	329	25,312
STOCKLAND	72	78	360	27,715
GOODMAN GROUP	50.1	52.9	984	75,715
VICINITY CENTRES	99.273	123.273	205	15,833
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	738,805 11 銘柄	828,105 11 銘柄	5,226 401,950 <0.2%>
(香港)	千□	千□	千香港・ドル	千円
LINK REIT	62.5	70.5	4,829	64,711
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	75	92	716	9,603
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	107	122	1,263	16,936
香 港 ・ ド ル 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	244.5 3 銘柄	284.5 3 銘柄	6,809 91,251 <0.1%>
(シンガポール)	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	79.6	—	—	—
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	76	101	305	23,697
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	77.2	158.032	314	24,432
SUNTEC REIT	63	63	96	7,488
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	—	91.8	179	13,978
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST (非上場)	65.5	65.5	135	10,533
ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS	—	3.737	—	—
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	361.3 5 銘柄	483.069 6 銘柄	1,031 80,129 <0.0%>
(イギリス)	千□	千□	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	21.662	21.662	144	19,961
SEGRO PLC	33.15	38.45	346	48,019
BRITISH LAND CO PLC	25.55	29.55	138	19,246
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	80,362 3 銘柄	89,662 3 銘柄	629 87,227 <0.1%>

銘柄		期首		当期		期末	
		□数	□数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千ユーロ	千円		
ユーロ（フランス）							
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		3.95	4.2	265	32,994		
ICADE		0.95	0.95	56	7,077		
GECINA SA		1.4	1.4	177	22,132		
KLEPIERRE		6.25	6.25	121	15,065		
COVIVIO		1.27	1.5	108	13,433		
ユーロ通貨計	□数、金額	13.82	14.3	729	90,703		
	銘柄数<比率>	5銘柄	5銘柄		<0.1%>		
合計	□数、金額	1,849,745	2,157,264	—	3,711,750		
	銘柄数<比率>	73銘柄	71銘柄		<2.3%>		

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

(4)先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
外国	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	5,515 百万円	— 百万円
	S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	281	—
	SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	228	—
	FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	361	—
	SWISS MKT IX FUTR (スイス)	264	—
	EURO STOXX 50 (ドイツ)	931	—

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

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	151,364,986	93.2
新株予約権証券	868	0.0
投資信託証券	3,711,750	2.3
コール・ローン等、その他	7,312,974	4.5
投資信託財産総額	162,390,580	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＝103.89円、1カナダ・ドル＝79.95円、1オーストラリア・ドル＝76.91円、1香港・ドル＝13.40円、1シンガポール・ドル＝77.69円、1ニュージーランド・ドル＝73.11円、1イギリス・ポンド＝138.55円、1イスラエル・シェケル＝31.34円、1スイス・フラン＝114.97円、1デンマーク・クローネ＝16.71円、1ノルウェー・クローネ＝11.76円、1スウェーデン・クローネ＝12.22円、1ユーロ＝124.38円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（158,608,000千円）の投資信託財産総額（162,390,580千円）に対する比率は、97.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	166, 449, 285, 915円
コール・ローン等	4, 118, 584, 936
株式（評価額）	151, 364, 986, 629
新株予約権証券（評価額）	868, 069
投資信託証券（評価額）	3, 711, 750, 912
未収入金	4, 690, 818, 189
未収配当金	182, 217, 065
差入委託証拠金	2, 380, 060, 115
(B) 負債	4, 166, 041, 745
未払金	4, 083, 574, 645
未払解約金	82, 467, 100
(C) 純資産総額（A－B）	162, 283, 244, 170
元本	54, 067, 455, 177
次期繰越損益金	108, 215, 788, 993
(D) 受益権総口数	54, 067, 455, 177口
1万口当り基準価額（C／D）	30, 015円

* 期首における元本額は48, 893, 612, 273円、当作成期間中における追加設定元本額は16, 107, 558, 260円、同解約元本額は10, 933, 715, 356円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国株式インデックスV A 429, 418, 774円、ダイワ国内重視バランスファンド3 0 V A（一般投資家私募）6, 511, 702円、ダイワ国内重視バランスファンド5 0 V A（一般投資家私募）109, 450, 582円、ダイワ国際分散バランスファンド3 0 V A（一般投資家私募）14, 001, 565円、ダイワ国際分散バランスファンド5 0 V A（一般投資家私募）353, 394, 455円、外国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）22, 667, 766円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）535, 920, 559円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）2, 255, 476, 207円、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）662, 541, 353円、D－I's 外国株式インデックス11, 396, 584円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 6, 026, 400円、iFree 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）2, 011, 620, 301円、iFree 8資産バランス1, 021, 183, 359円、iFree 年金バランス49, 879, 929円、D Cダイワ外国株式インデックス33, 018, 813, 032円、ダイワ・ライフ・バランス3 0 579, 030, 840円、ダイワ・ライフ・バランス5 0 976, 488, 397円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 722, 361, 053円、大和D C海外株式インデックスファンド1, 541, 641, 973円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 2, 282, 168円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 11, 422, 149円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 7, 627, 380円、ダイワつみたてインデックス外国株式452, 466, 523円、ダイワつみたてインデックスバランス3 0 2, 121, 988円、ダイワつみたてインデックスバランス5 0 2, 068, 375円、ダイワつみたてインデックスバランス7 0 2, 463, 419円、ダイワ世界バランスファンド4 0 V A 161, 683, 743円、ダイワ世界バランスファンド6 0 V A 284, 495, 474円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A 2, 255, 482, 425円、ダイワ・バランスファンド2 5 V A（適格機関投資家専用）110, 264, 809円、ダイワバランスファンド2020-07（適格機関投資家専用）271, 255, 135円、ダイワ・インデックスセレクト 外国株式798, 778, 255円、ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド183, 907, 812円、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワS M A専用）2, 325, 979, 029円、ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス2, 735, 745, 325円、ダイワライフスタイル2 5 17, 629, 498円、ダイワライフスタイル5 0 63, 519, 419円、ダイワライフスタイル7 5 50, 437, 420円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は30, 015円です。

■損益の状況

当期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2, 386, 798, 456円
受取配当金	2, 384, 815, 338
受取利息	196, 698
その他収益金	3, 585, 686
支払利息	△ 1, 799, 266
(B) 有価証券売買損益	11, 947, 905, 388
売買益	26, 586, 680, 910
売買損	△ 14, 638, 775, 522
(C) 先物取引等損益	△ 187, 011, 849
取引益	2, 465, 771, 200
取引損	△ 2, 652, 783, 049
(D) その他費用	△ 31, 005, 300
(E) 当期損益金（A＋B＋C＋D）	14, 116, 686, 695
(F) 前期繰越損益金	85, 075, 002, 502
(G) 解約差損益金	△ 17, 279, 132, 544
(H) 追加信託差損益金	26, 303, 232, 340
(I) 合計（E＋F＋G＋H）	108, 215, 788, 993
次期繰越損益金（I）	108, 215, 788, 993

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

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

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

運用報告書 第33期（決算日 2020年9月15日）

（作成対象期間 2020年3月17日～2020年9月15日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

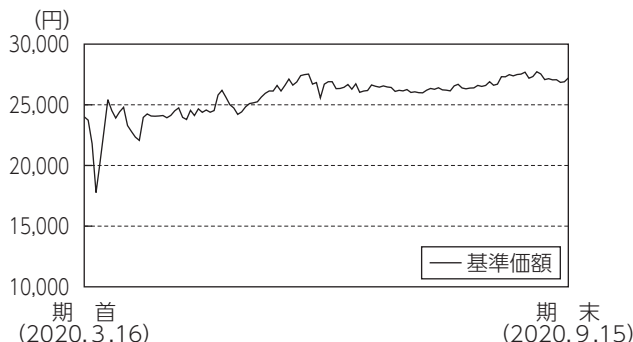
運 用 方 針	東京証券取引所が算出・公表する「東証ＲＥＩＴ指数」（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		東証ＲＥＩＴ指数(配当込み)		投資信託証券 組入比率	不動産投信 指数先物 比率
	騰 落 率	ベンチマーク	騰 落 率			
(期首)2020年3月16日	円 24,011	% —	3,237.59	% —	% 95.0	% 2.8
3月末	24,796	3.3	3,343.59	3.3	97.2	2.8
4月末	24,571	2.3	3,313.25	2.3	97.2	2.8
5月末	26,591	10.7	3,586.37	10.8	97.2	2.8
6月末	26,134	8.8	3,525.99	8.9	97.4	2.6
7月末	26,206	9.1	3,535.10	9.2	97.4	2.5
8月末	27,688	15.3	3,735.15	15.4	97.4	2.5
(期末)2020年9月15日	27,210	13.3	3,670.48	13.4	96.9	2.5

(注1) 騰落率は期首比。

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

(注3) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：24,011円 期末：27,210円 騰落率：13.3%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク（東証ＲＥＩＴ指数（配当込み））の動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、経済活動正常化への期待や底堅い決算・業績予想などを背景に国内リート市況が上昇し、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内リート市況

国内リート市況は上昇しました。

国内リート市況は、当作成期首より、金融機関による2020年3月末の決算対策や、減損回避などの目的でロスカット（強制損切り）の売りが膨らんだことから、急落しました。しかし5月には、新型コロナウイルスの新規国内感染者数の減少や緊急事態宣言の全面解除が見込まれる中、経済活動正常化への期待もあり、国内リート市場は上昇しました。当作成期末にかけては、底堅い内容となった決算・業績予想などを好感し、緩やかに上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

◆ポートフォリオについて

ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）については、当作成期を通じて99～100%程度としました。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は13.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は13.3%となりました。

ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率の違い、先物取引の影響、売買等のコストが控除されたことが差異の要因となりました。

《今後の運用方針》

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

■1万口当りの費用の明細

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

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の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

(2020年3月17日から2020年9月15日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内	471.28295	65,863,154	194.21705 (-)	26,746,048 (-)

(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

(2020年3月17日から2020年9月15日まで)

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	不動産投信指数先物取引	百万円 25,045	百万円 25,266	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託証券

(2020年3月17日から2020年9月15日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘	柄	□ 数	金 額	平均単価	銘	柄	□ 数	金 額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
ＧＬＰ投資法人		31.899	4,961,970	155,552	日本ビルファンド		2.791	1,738,833	623,014
日本ビルファンド		6.655	4,351,829	653,918	ジャパンリアルエステイト		2.882	1,639,430	568,851
ジャパンリアルエステイト		6.872	4,027,176	586,026	日本プロロジスリート		4.1	1,288,087	314,167
日本プロロジスリート		10.425	3,211,357	308,043	野村不動産マスターＦ		9.095	1,209,076	132,938
野村不動産マスターＦ		22.186	2,908,309	131,087	ユナイテッド・アーバン投資法人		10.447	1,135,841	108,724
大和ハウスリート投資法人		9.803	2,578,482	263,029	大和ハウスリート投資法人		4.111	1,087,345	264,496
産業ファンド		13.643	2,371,339	173,813	ＧＬＰ投資法人		7.169	1,075,521	150,023
ラサールロジポート投資		13.304	2,294,002	172,429	日本プライムリアルティ		3.183	941,135	295,675
アドバンス・レジデンス		6.518	2,076,018	318,505	アドバンス・レジデンス		2.68	856,562	319,612
オリックス不動産投資		13.69	1,995,920	145,794	オリックス不動産投資		5.74	821,730	143,158

(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) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

フ ァ ン ド 名	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
不動産投信	千口	千円	%
エスコンジャパンリート	6.284	632,798	0.2
サンケイリアルエステート	9.408	868,358	0.2
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投	8.566	1,159,836	0.3
日本アコモデーションファンド投資法人	12.776	7,857,240	2.2
MCUBS MidCity投資法人	47.045	3,580,124	1.0
森ヒルズリート	45.166	6,070,310	1.7
産業ファンド	54.347	9,983,543	2.8
アドバンス・レジデンス	36.521	11,376,291	3.2
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	25.084	4,718,300	1.3
A P I 投資法人	19.266	7,629,336	2.1
G L P 投資法人	110.555	18,385,296	5.1
コンフォリア・レジデンシャル	16.778	5,243,125	1.5
日本プロロジスリート	58.177	20,420,127	5.7
星野リゾート・リート	5.85	2,995,200	0.8
Oneリート投資法人	5.993	1,468,884	0.4
イオンリート投資	38.998	4,586,164	1.3
ヒューリックリート投資法	30.954	4,181,885	1.2
日本リート投資法人	12.489	4,283,727	1.2
インベスコ・オフィス・Jリート	247.014	3,433,494	1.0
積水ハウス・リート投資	113.087	8,164,881	2.3
トーセイ・リート投資法人	8.506	909,291	0.3
ケネディクス商業リート	14.138	3,049,566	0.9
ヘルスケア&メディカル投資	8.201	1,021,844	0.3
サムティ・レジデンシャル	7.401	721,597	0.2
野村不動産マスターF	124.335	16,163,550	4.5
いちごホテルリート投資	6.723	465,903	0.1
ラサールロジポート投資	42.847	7,528,217	2.1
スターアジア不動産投	39.5039	1,682,866	0.5
マリモ地方創生リート	3.602	369,565	0.1
三井不ロジパーク	11.017	5,861,044	1.6
大江戸温泉リート	6.206	402,769	0.1
投資法人みらい	41.525	1,561,340	0.4
森トラスト・ホテルリート投	8.327	905,144	0.3
三菱地所物流ＲＥＩＴ	8.651	3,706,953	1.0
ＣＲＥロジスティクスファンド	10.492	1,546,520	0.4
ザイマックス・リート	5.891	510,160	0.1
タカラレーベン不動産投	11.554	962,448	0.3
伊藤忠アドバンスロジ	12.141	1,657,246	0.5
日本ビルファンド	37.233	23,717,421	6.6
ジャパンリアルエステイト	38.449	22,646,461	6.3
日本リテールファンド	72.668	11,256,273	3.1
オリックス不動産投資	76.609	11,859,073	3.3
日本プライムリアルティ	23.938	7,516,532	2.1

フ ァ ン ド 名	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
プレミア投資法人	34.728	4,042,339	1.1
東急リアル・エステート	25.778	3,637,275	1.0
グローバル・ワン不動産投資法人	26.699	2,707,278	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人	82.227	9,234,092	2.6
森トラスト総合リート	27.479	3,712,412	1.0
インヴィンシブル投資法人	160.767	4,967,700	1.4
フロンティア不動産投資	12.76	4,459,620	1.2
平和不動産リート	23.944	2,700,883	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	25.122	7,330,599	2.0
福岡リート投資法人	19.885	2,636,751	0.7
ケネディクス・オフィス投資法人	11.894	7,243,446	2.0
いちごオフィスリート投資法人	31.898	2,370,021	0.7
大和証券オフィス投資法人	8.192	4,767,744	1.3
阪急阪神リート投資法人	17.367	2,033,675	0.6
スタートアップロシード投資法人	5.987	1,207,577	0.3
大和ハウスリート投資法人	54.858	14,784,231	4.1
ジャパン・ホテル・リート投資法人	123.86	5,982,438	1.7
大和証券リビング投資法人	48.506	5,301,705	1.5
ジャパンエクセレント投資法人	35.677	4,306,213	1.2
合 計	口 数、金 額	2,301,9439	346,486,724
	銘柄数<比率>	62銘柄	<96.9%>

※エスコンジャパンリート、サンケイリアルエステート、ＳＯＳＩＬＡ物流リート投、森ヒルズリート、産業ファンド、アドバンス・レジデンス、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、コンフォリア・レジデンシャル、日本プロロジスリート、Oneリート投資法人、イオンリート投資、ヒューリックリート投資、積水ハウス・リート投資、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート、サムティ・レジデンシャル、マリモ地方創生リート、三井不ロジパーク、三菱地所物流ＲＥＩＴ、ＣＲＥロジスティクスファンド、伊藤忠アドバンスロジ、日本プライムリアルティ、フロンティア不動産投資、大和証券オフィス投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、大和証券リビング投資法人につきましては、各ファンドで開示されている直近の有価証券報告書または有価証券届出書において、当社の利害関係人等（投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される法人等をいいます。）である大和証券、大和リアル・エステート・アセット・マネジメントが当該ファンドの運用会社または一般事務受託会社となっています。

(注1) 比率欄は、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 8,951	百万円 －

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年9月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託証券	346,486,724	96.7
コール・ローン等、その他	11,763,038	3.3
投資信託財産総額	358,249,763	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

2020年9月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	362,885,875,254円
コール・ローン等	5,846,447,737
投資信託証券(評価額)	346,486,724,240
未収入金	1,548,434,485
未収配当金	4,191,499,792
差入委託証拠金	4,812,769,000
(B) 負債	5,186,966,340
未払金	4,194,000
未払解約金	534,570,000
差入委託証拠金代用有価証券	4,648,175,000
その他未払費用	27,340
(C) 純資産総額(A－B)	357,698,908,914
元本	131,456,354,868
次期繰越損益金	226,242,554,046
(D) 受益権総口数	131,456,354,868口
1万口当り基準価額(C／D)	27,210円

* 期首における元本額は120,918,340,404円、当作成期間中における追加設定元本額は24,751,188,470円、同解約元本額は14,213,174,006円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン5,730,916,634円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）115,264,671,031円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）339,888,168円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 1,229,972円、i F r e e Ｊ－ＲＥＩＴインデックス140,025,135円、i F r e e 8資産バランス1,029,528,802円、ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン5,317,882,980円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 2,477,304円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 4,603,626円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 2,696,936円、ダイワ・ノーロード Ｊ－ＲＥＩＴファンド101,960,258円、ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス1,707,972,273円、ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）262,363,036円、ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス413,120,791円、ダイワ・インデックスセレクト Ｊ－ＲＥＩＴ1,137,017,922円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は27,210円です。

■損益の状況

当期 自2020年3月17日 至2020年9月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	7,129,533,078円
受取配当金	7,104,215,882
受取利息	23,396
その他収益金	26,737,941
支払利息	△ 1,444,141
(B) 有価証券売買損益	31,604,814,900
売買益	36,880,930,687
売買損	△ 5,276,115,787
(C) 先物取引等損益	976,920,130
取引益	1,171,384,050
取引損	△ 194,463,920
(D) その他費用	△ 57,308
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	39,711,210,800
(F) 前期繰越損益金	169,420,427,710
(G) 解約差損益金	△ 21,354,047,994
(H) 追加信託差損益金	38,464,963,530
(I) 合計(E + F + G + H)	226,242,554,046
次期繰越損益金(I)	226,242,554,046

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

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

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

運用報告書 第16期（決算日 2020年11月30日）

（作成対象期間 2019年12月3日～2020年11月30日）

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

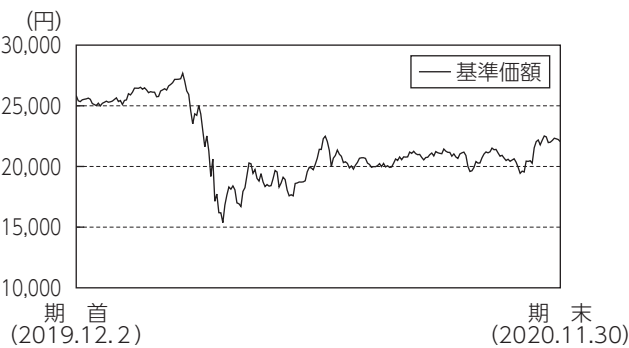
運 用 方 針	S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行います。
主 要 投 資 対 象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投 資 信 託 証 券 組 入 制 限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託証券 購入比率	投資信託証券 売却比率	不動産 売却比率
	円	騰落率 (ベンチマーク)	円	騰落率 (ベンチマーク)	%	%	%
(期首)2019年12月2日	25,842	—	29,879	—	2.0	95.1	2.9
12月末	25,654	△ 0.7	29,698	△ 0.6	1.2	97.1	1.9
2020年1月末	26,120	1.1	30,141	0.9	1.7	96.2	2.1
2月末	24,572	△ 4.9	28,596	△ 4.3	1.6	95.7	2.7
3月末	18,399	△ 28.8	21,171	△ 29.1	1.5	95.7	2.9
4月末	19,668	△ 23.9	22,705	△ 24.0	0.8	96.0	3.2
5月末	19,882	△ 23.1	23,018	△ 23.0	2.1	94.8	3.2
6月末	20,105	△ 22.2	23,265	△ 22.1	0.9	96.6	2.5
7月末	20,495	△ 22.7	23,781	△ 20.4	0.6	96.9	2.5
8月末	21,131	△ 18.2	24,446	△ 18.2	0.5	96.8	2.8
9月末	20,278	△ 21.5	23,428	△ 21.6	1.2	95.9	2.9
10月末	19,615	△ 24.1	22,704	△ 24.0	0.9	96.3	2.8
(期末)2020年11月30日	22,044	△ 14.7	25,605	△ 14.3	0.5	97.0	2.5

- (注1) 騰落率は期首比。
(注2) S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (円ベース) は、S & P 先進国 R E I T 指数 (除く日本) (円ベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、S & P ダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスである S & P グローバル 株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとの R E I T 制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注5) 不動産投資信託先物比率は買建比率・売建比率です。

《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：25,842円 期末：22,044円 騰落率：△14.7%

【基準価額の主な変動要因】

海外リート市場の下落が主な要因となり、基準価額は下落しました。
くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」を参照ください。

◆ 投資環境について

○ 海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、長期金利の上昇を背景として米国を中心に上値が重い展開となりました。2020年に入ると、米国の対中追加関税回避や長期金利の低下などが支援材料となり、堅調な推移となりました。しかし2月以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて大幅に下落しました。3月下旬からは、各国の財政金融政策や新型コロナウイルス治療薬開発への期待などから上昇しました。5月以降は、世界的な経済活動の再開期待から堅調な展開となりました。その後9月以降は、新型コロナウイルスの感染再拡大やそれに伴うロックダウン（都市封鎖）への懸念などから下落する局面があったものの、11月に入ると、ワクチン開発で高い効果を示す結果が報告され、経済活動再開への期待が高まったことなどから上昇して当作成期末を迎えました。

○ 為替相場

為替相場は、まちまちな動きとなりました。

対円為替相場は、当作成期首より、米中貿易摩擦への懸念が後退したことなどから円安傾向となりました。2020年に入ると、新型コロナウイルスに関する懸念が拡大し、特に2月下旬から3月中旬にかけて大きく円高が進行しました。その後は、大幅な下落に対する反発などから円安となりました。さらにその後も、経済活動の再開期待や世界的な金融緩和の長期化観測から円安傾向が続きました。7月以降は、米中関係の悪化などが材料となって米ドルなどが円高に転じる一方、他の通貨はリスク選好の動きからおおむね円安傾向となりました。9月以降は、新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念などから円高が進行しましたが、当作成期末にかけては、ワクチンに対する期待感から円安となりました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマーク（S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（円ベース））に連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、E T F（上場投資信託証券）ならびに不動産投資信託先物取引を利用することがあります。

◆ ポートフォリオについて

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエートで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

また、運用の効率化を図るため、E T F（上場投資信託証券）および不動産投資信託先物を組み入れました。

◆ ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△14.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△14.7%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。

なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

《今後の運用方針》

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

また、運用の効率化を図るため、E T F（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（「当インデックス」）は S & P Dow Jones Indices LLC（「S P D J I」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's® および S & P® は Standard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones® は Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスが S P D J I に、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、S P D J I、Dow Jones、S & P またはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	5円
（株式）	（ 0 ）
（先物・オプション）	（ 1 ）
（投資信託受益証券）	（ 1 ）
（投資信託証券）	（ 3 ）
有価証券取引税	3
（株式）	（ 0 ）
（投資信託受益証券）	（ 0 ）
（投資信託証券）	（ 3 ）
その他費用	14
（保管費用）	（ 8 ）
（その他）	（ 6 ）
合 計	22

（注1）費用の項目および算出法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の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

（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 — (27.78)	千アメリカ・ドル — (8)	百株 27.78	千アメリカ・ドル 9

（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) 投資信託受益証券

（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 510 (—)	千アメリカ・ドル 41,340 (—)	千口 547 (—)	千アメリカ・ドル 44,723 (—)

（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

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	アメリカ	千口 1,743.4 (△ 17.686)	千アメリカ・ドル 59,233 (32)	千口 388.388 (ー)	千アメリカ・ドル 10,376 (ー)
	カナダ	千口 149.9 (△ 7.4)	千カナダ・ドル 2,666 (△ 225)	千口 33.9 (ー)	千カナダ・ドル 626 (ー)
	オーストラリア	千口 2,620.44 (22.073)	千オーストラリア・ドル 9,234 (24)	千口 492.59 (ー)	千オーストラリア・ドル 1,812 (ー)
	香港	千口 435.3 (ー)	千香港ドル 11,372 (ー)	千口 56.9 (ー)	千香港ドル 3,970 (ー)
	シンガポール	千口 3,198.5 (△ 51.578)	千シンガポール・ドル 4,551 (△ 95)	千口 860.7 (ー)	千シンガポール・ドル 1,571 (ー)
	ニュージーランド	千口 271 (ー)	千ニュージーランド・ドル 506 (ー)	千口 51.45 (ー)	千ニュージーランド・ドル 96 (ー)
	イギリス	千口 2,809.82 (273.95)	千イギリス・ポンド 4,643 (△ 189)	千口 1,020.166 (ー)	千イギリス・ポンド 860 (ー)
	韓国	千口 35.92 (0.546)	千韓国ウォン 176,097 (ー)	千口 0.546 (ー)	千韓国ウォン 154 (ー)
	ユーロ (アイルランド)	千口 24 (ー)	千ユーロ 44 (ー)	千口 ー (ー)	千ユーロ ー (ー)
	ユーロ (オランダ)	千口 1.7 (ー)	千ユーロ 34 (ー)	千口 ー (ー)	千ユーロ ー (ー)
国	ユーロ (ベルギー)	千口 19.84 (20.066)	千ユーロ 906 (87)	千口 3.504 (ー)	千ユーロ 157 (ー)

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘	柄	口 数	金 額	平均単価	銘	柄	口 数	金 額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)		510	4,437,202	8,700	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)		547	4,798,191	8,771

(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	ユーロ (フランス)	千口 35.65 (ー)	千ユーロ 1,566 (△ 30)	千口 13.09 (ー)	千ユーロ 595 (ー)
	ユーロ (ドイツ)	千口 11.42 (ー)	千ユーロ 149 (△ 17)	千口 3.2 (ー)	千ユーロ 45 (ー)
	ユーロ (スペイン)	千口 27.31 (ー)	千ユーロ 250 (△ 1)	千口 12.5 (ー)	千ユーロ 101 (ー)
	ユーロ (その他)	千口 294.6 (ー)	千ユーロ 140 (ー)	千口 ー (ー)	千ユーロ ー (ー)
	ユーロ (ユーロ 通貨計)	千口 414.52 (20.066)	千ユーロ 3,092 (37)	千口 32.294 (ー)	千ユーロ 899 (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。

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	不動産投信指数先物取引	百万円 4,449	百万円 4,476	百万円 ー	百万円 ー

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
EQUINIX INC (アメリカ)		5.8	412,135	71,057	PROLOGIS INC (アメリカ)		8.6	82,563	9,600
PROLOGIS INC (アメリカ)		41.6	409,870	9,852	EQUINIX INC (アメリカ)		1	73,269	73,269
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		27	398,225	14,749	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT (アメリカ)		4	65,962	16,490
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		23.4	230,370	9,844	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		3.7	57,752	15,608
PUBLIC STORAGE (アメリカ)		9.6	213,646	22,254	LINK REIT (香港)		56.9	54,999	966
WELLTOWER INC (アメリカ)		29.5	196,740	6,669	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)		7.6	51,925	6,832
REALTY INCOME CORP (アメリカ)		26.6	183,110	6,883	PUBLIC STORAGE (アメリカ)		2	41,797	20,898
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT (アメリカ)		10.4	178,357	17,149	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		2.2	39,300	17,863
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		9.2	173,319	18,839	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES (アメリカ)		5.6	37,182	6,639
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)		23.2	166,803	7,189	WELLTOWER INC (アメリカ)		7.1	37,046	5,217

(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) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

(i) 外国投資信託受益証券

ファンド名	当 期 末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
VANGUARD REAL ESTATE ETF	17.5	1,485	154,336	0.5

(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) 比率欄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。

(ii) 外国投資信託証券

ファンド名	当 期 末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
不動産ファンド	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
(シンガポール)				
MANULIFE US REAL ESTATE INV	320.562	238	24,810	0.1
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	151.4	106	11,088	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90	12	1,280	0.0
PRIME US REIT	99	76	7,970	0.0
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	29.5	572	59,517	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13.7	76	7,970	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	21.982	301	31,309	0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	25.4	374	38,948	0.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC	31.4	5,271	547,616	1.9
SIMON PROPERTY GROUP INC	71.847	6,146	638,561	2.2
BOSTON PROPERTIES INC	31.4	3,216	334,141	1.2
APARTMENT INV & MGMT CO-A	32.467	999	103,820	0.4
VORNADO REALTY TRUST	35.064	1,414	146,914	0.5
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	18	395	41,103	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13.9	468	48,679	0.2
NEXPOINT RESIDENTIAL	4.8	208	21,662	0.1
QTS REALTY TRUST INC-CL A	13.6	816	84,774	0.3
EQUITY RESIDENTIAL	76.5	4,528	470,497	1.6
APPLE HOSPITALITY REIT INC	43.8	585	60,838	0.2
EPR PROPERTIES	16.1	611	63,559	0.2

ファンド名	当 期 末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.5	32	3,410	0.0
CITY OFFICE REIT INC	9.3	84	8,772	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	19.833	336	34,986	0.1
EQUINIX INC	19.6	13,730	1,426,429	4.9
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	15.529	438	45,511	0.2
CHATHAM LODGING TRUST	7.4	82	8,610	0.0
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	7.1	128	13,299	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	12.3	799	83,060	0.3
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	25.7	349	36,258	0.1
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4.9	225	23,376	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	157.6	2,304	239,374	0.8
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	59.008	1,683	174,898	0.6
CORESITE REALTY CORP	9.5	1,188	123,517	0.4
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	34.1	916	95,190	0.3
RLJ LODGING TRUST	35.871	451	46,918	0.2
FARMLAND PARTNERS INC	2.9	23	2,464	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	46.1	809	84,052	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	14	152	15,839	0.1
CYRUSONE INC	25.9	1,812	188,271	0.7
KIMCO REALTY CORP	94.4	1,422	147,794	0.5
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9.8	133	13,887	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	48.85	1,289	133,929	0.5

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ファンド名	当期末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
WHITESTONE REIT	8.5	67	7,029	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	46,349	1,926	200,119	0.7
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	27.2	443	46,060	0.2
PARK HOTELS & RESORTS INC	51.68	864	89,770	0.3
COLONY CAPITAL INC	105,011	457	47,565	0.2
INVITATION HOMES INC	125,297	3,603	374,371	1.3
JBG SMITH PROPERTIES	25,132	805	83,733	0.3
ALEXANDER & BALDWIN INC	16.5	268	27,855	0.1
CLIPPER REALTY INC	1.4	8	907	0.0
GLADSTONE LAND CORP	4.5	67	6,984	0.0
AMERICOLD REALTY TRUST	45.1	1,533	159,304	0.6
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES INC	14.3	312	32,460	0.1
VICI PROPERTIES INC	118.2	3,035	315,345	1.1
RETAIL VALUE INC	2,815	43	4,494	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I/A	12.5	206	21,414	0.1
BRT APARTMENTS CORP	1.3	17	1,832	0.0
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10.1	165	17,145	0.1
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	4.9	768	79,815	0.3
SAFEHOLD INC	3.2	213	22,197	0.1
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29.96	31	3,299	0.0
AMERICAN FINANCE TRUST INC	22.4	181	18,849	0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY TRUST	22.9	478	49,675	0.2
CORECIVIC INC	25,224	193	20,125	0.1
COREPOINT LODGING INC	6.7	45	4,705	0.0
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3.4	45	4,683	0.0
STORE CAPITAL CORP	50.5	1,683	174,864	0.6
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2.4	25	2,690	0.0
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	22.4	203	21,176	0.1
LIFE STORAGE INC	10.4	1,128	117,197	0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	10.1	304	31,667	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	20,082	258	26,830	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	9.2	73	7,684	0.0
PARAMOUNT GROUP INC	36.4	359	37,324	0.1
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29.2	283	29,425	0.1
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	27.4	1,331	138,372	0.5
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	23.7	342	35,603	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	32.5	977	101,529	0.4
VENTAS INC	83,379	3,993	414,921	1.4
CARETRUST REIT INC	21,503	424	44,075	0.2
GEO GROUP INC/THE	27.4	266	27,640	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	64.3	1,037	107,817	0.4
OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST	10.6	252	26,275	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	44,987	769	79,966	0.3
UMH PROPERTIES INC	8.6	122	12,740	0.0
IRON MOUNTAIN INC	63.8	1,698	176,442	0.6
TERRENO REALTY CORP	15.2	886	92,110	0.3
VEREIT INC	240,908	1,768	183,705	0.6
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22.32	842	87,558	0.3
SUN COMMUNITIES INC	21.8	3,021	313,924	1.1
ACADIA REALTY TRUST	17,011	251	26,084	0.1
ALEXANDER'S INC	0.4	113	11,742	0.0
PROLOGIS INC	163,619	16,460	1,710,036	5.9
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITY TRUST	26.2	4,248	441,331	1.5
BRANDYWINE REALTY TRUST	38.3	440	45,718	0.2
SAUL CENTERS INC	2.4	76	7,958	0.0
MACK-CALI REALTY CORP	20.2	283	29,422	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	21.8	2,130	221,361	0.8
COUSINS PROPERTIES INC	32,906	1,128	117,258	0.4
SITE CENTERS CORP	31,878	340	35,403	0.1
DUKE REALTY CORP	82.1	3,151	327,442	1.1

ファンド名	当期末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
EASTGROUP PROPERTIES INC	8.7	1,223	127,071	0.4
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,467	3,616	375,759	1.3
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST	27.8	1,180	122,688	0.4
FEDERAL REALTY INVS TRUST	15.4	1,360	141,383	0.5
GETTY REALTY CORP	7,703	220	22,951	0.1
WELLTOWER INC	93.2	6,015	624,911	2.2
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	120.3	3,594	373,439	1.3
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23.1	897	93,282	0.3
SERVICE PROPERTIES TRUST	36.5	449	46,679	0.2
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30.1	910	94,594	0.3
EQUITY COMMONWEALTH	27,375	726	75,479	0.3
KILROY REALTY CORP	23.2	1,463	152,086	0.5
LTC PROPERTIES INC	8.4	318	33,118	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	60	622	64,640	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	25,328	3,140	326,284	1.1
MACERICH CO/THE	21,979	238	24,774	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	37.5	2,201	228,726	0.8
NATL HEALTH INVESTORS INC	9.6	630	65,525	0.2
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	38.4	1,474	153,152	0.5
REALTY INCOME CORP	77,117	4,753	493,840	1.7
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	24	653	67,919	0.2
PUBLIC STORAGE	33.8	7,437	772,631	2.7
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4.3	570	59,280	0.2
REGENCY CENTERS CORP	34.92	1,637	170,109	0.6
RPT REALTY	17.8	137	14,313	0.0
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17.6	174	18,156	0.1
SL GREEN REALTY CORP	16.4	993	103,164	0.4
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	49	242	25,198	0.1
TAUBMAN CENTERS INC	13.3	568	59,096	0.2
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6	85	8,932	0.0
UDR INC	65.3	2,561	266,069	0.9
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME	2.6	162	16,930	0.1
WP CAREY INC	38.5	2,690	279,543	1.0
WASHINGTON REIT	17.8	427	44,437	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	25.9	571	59,357	0.2
AGREE REALTY CORP	11.7	770	80,077	0.3
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50,748	1,819	189,008	0.7
CUBESMART	43.3	1,379	143,365	0.5
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45,526	493	51,317	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	59,778	8,173	849,139	2.9
EXTRA SPACE STORAGE INC	28.6	3,146	326,837	1.1
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,875	67	7,003	0.0
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2.46	175	18,216	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	18.95	281	29,294	0.1
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP	21	310	32,289	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,233	39	4,110	0.0
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	30.5	1,234	128,298	0.4
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6.3	114	11,872	0.0
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	42,342	336	34,927	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	117.1	2,291	238,079	0.8
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	21	102	10,646	0.0
DOUGLAS EMMETT INC	36.5	1,165	121,078	0.4
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC	46.7	394	40,948	0.1
アメリカ・ドル 口数、金額 通貨 計 銘柄数 比率	5,540,075 155銘柄	197,536	20,522,019	<71.0%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	%
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13.1	141	11,332	0.0
SLATE GROCERY REIT	8.1	100	8,049	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10.2	179	14,344	0.0
SLATE OFFICE REIT	5.1	21	1,724	0.0

ファン ド 名	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	千口	千カナダ・ドル	千円	%
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	4.2	80	6,457	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	19.7	240	19,262	0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	17.6	233	18,658	0.1
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	11.2	74	5,927	0.0
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	8.5	151	12,137	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4.1	45	3,599	0.0
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	6.2	474	37,945	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	18.3	236	18,873	0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	16.2	229	18,352	0.1
CHOICE PROPERTIES REIT	24.7	385	30,806	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	36.8	489	39,130	0.1
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4.2	68	5,496	0.0
PLAZA RETAIL REIT	11.9	178	14,252	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11.1	40	3,274	0.0
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	16.3	395	31,602	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	19.5	1,001	80,040	0.3
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	21.79	199	15,975	0.1
ROCAN REAL ESTATE INVST TR	32.566	467	37,362	0.1
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	34.3	623	49,827	0.2
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5.4	116	9,282	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	4.7	164	13,144	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	9.5	139	11,165	0.0
	13.3	545	43,575	0.2
カナダ・ドル 口数、金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	388,556 27銘柄	7,024	561,600	< 1.9% >
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	78.38	235	18,084	0.1
CROMWELL PROPERTY GROUP	435.284	396	30,464	0.1
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	95.11	299	23,041	0.1
AVENTUS GROUP	88	237	18,273	0.1
RURAL FUNDS GROUP	78.595	204	15,716	0.1
WAYPOINT REIT	177.83	489	37,611	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	98.668	483	37,183	0.1
CENTURIA OFFICE REIT	84.95	192	14,831	0.1
CENTURIA CAPITAL GROUP	97.59	247	19,064	0.1
INVESTEC AUSTRALIA PROPERTY	119.63	155	11,960	0.0
HOME CONSORTIUM	35	132	10,202	0.0
HOMECO DAILY NEEDS REIT	17.5	23	1,810	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	241.86	623	47,991	0.2
GROWTHPOINT PROPERTIES AUST	70.547	263	20,238	0.1
NATIONAL STORAGE REIT	206.195	391	30,131	0.1
APN INDUSTRIA REIT	29.76	89	6,912	0.0
GDI PROPERTY GROUP	123.31	149	11,475	0.0
SCENTRE GROUP	1,194.91	3,441	264,673	0.9
ARENA REIT	79.89	223	17,204	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38.3	121	9,367	0.0
BWP TRUST	105.55	458	35,231	0.1
DEXUS	251.73	2,471	190,120	0.7
GPT GROUP	444	2,104	161,861	0.6
CHARTER HALL RETAIL REIT	120.4	463	35,650	0.1
MIRVAC GROUP	908.06	2,370	182,279	0.6
STOCKLAND	550.01	2,541	195,431	0.7
ABACUS PROPERTY GROUP	81.12	257	19,777	0.1
GOODMAN GROUP	381.71	7,103	546,339	1.9
VICINITY CENTRES	878.9	1,467	112,885	0.4
CHARTER HALL GROUP	105.06	1,399	107,627	0.4
INGENIA COMMUNITIES GROUP	68.66	318	24,502	0.1
オーストラリア・ドル 口数、金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	7,286,509 31銘柄	29,358	2,257,947	< 7.8% >
(香港)	千口	千香港ドル	千円	%
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	349	1,333	17,864	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193	717	9,620	0.0

ファン ド 名	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
FORTUNE REIT	千口	千香港ドル	千円	%
PROSPERITY REIT	311	2,183	29,255	0.1
LINK REIT	300	714	9,567	0.0
CHAMPION REIT	476.9	32,667	437,746	1.5
	431	1,973	26,451	0.1
香 港 ド ル 口数、金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	2,060.9 6銘柄	39,589	530,505	< 1.8% >
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT	293.783	837	65,048	0.2
FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	126.2	59	4,657	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	455	423	32,874	0.1
AIMS APAC REIT	89	108	8,435	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST	121.8	63	4,967	0.0
FRASERS LOGISTICS & COMMERC	591.19	821	63,842	0.2
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86	69	5,411	0.0
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	208.9	141	10,954	0.0
EC WORLD REIT	57	41	3,188	0.0
IREIT GLOBAL	105.124	67	5,267	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	722.377	2,181	169,486	0.6
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,029.422	2,048	159,151	0.6
SUNTEC REIT	473.4	724	56,271	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	608.2	1,192	92,612	0.3
KEPPEL REIT	375.4	401	31,206	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST	417.456	429	33,405	0.1
ESR-REIT	559.902	226	17,617	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS	161.6	202	15,693	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	211.776	497	38,664	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	308.8	149	11,635	0.0
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	179.396	222	17,282	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	86.3	341	26,550	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	467.2	42	3,266	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	384.78	1,135	88,185	0.3
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	244.5	152	11,872	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	498.484	1,031	80,165	0.3
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182.1	117	9,125	0.0
SPH REIT	220.6	183	14,224	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	202.1	101	7,850	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	219.4	76	5,965	0.0
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	541.063	208	16,183	0.1
(非上場)				
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	10.046	0	34	0.0
シンガポール・ドル 口数、金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	10,238,299 32銘柄	14,301	1,111,099	< 3.8% >
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
ARGOSY PROPERTY LTD	158.52	237	17,384	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	357.92	440	32,186	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	76.8	228	16,732	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST	248.22	598	43,735	0.2
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	245.82	427	31,271	0.1
ニュージーランド・ドル 口数、金額 通 貨 計 銘柄数<比率>	1,087.28 5銘柄	1,932	141,308	< 0.5% >
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	594.52	433	60,130	0.2
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	129.57	94	13,051	0.0
STANDARD LIFE INV PROP INC	100	55	7,647	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	177.71	124	17,259	0.1
PICTON PROPERTY INCOME LTD	121.11	86	11,963	0.0
REGIONAL REIT LTD	81.31	60	8,449	0.0
NEWRIVER REIT PLC	69.33	52	7,242	0.0
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	183.29	249	34,536	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	135.49	138	19,147	0.1
CUSTODIAN REIT PLC	89.42	76	10,642	0.0

ファ ン ド 名	当 期 末			
	口 数	評 価 額	比 率	
	外貨建金額	邦貨換算金額		
GCP STUDENT LIVING PLC	千口	千円	%	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	96.86	136	18,922	0.1
LXI REIT PLC	67.9	73	10,160	0.0
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	118.038	136	18,970	0.1
AEVW UK REIT PLC	75.2	78	10,939	0.0
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	25.61	19	2,710	0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	180	129	17,906	0.1
RDI REIT PLC	150	160	22,185	0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC	41.036	38	5,372	0.0
SEGRO PLC	166.381	1,106	153,319	0.5
HAMMERSON PLC	263.74	2,377	329,382	1.1
UNITE GROUP PLC/THE	811.984	181	25,143	0.1
BRITISH LAND CO PLC	87.26	862	119,508	0.4
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	208.52	980	135,813	0.5
DERWENT LONDON PLC	53.581	346	48,075	0.2
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	24.39	753	104,350	0.4
WORKSPACE GROUP PLC	283.37	394	54,651	0.2
SAFESTORE HOLDINGS PLC	26.46	185	25,662	0.1
SHAFTESBURY PLC	46.35	353	48,934	0.2
BIG YELLOW GROUP PLC	53.85	286	39,729	0.1
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	36.96	418	57,967	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	203.15	448	62,147	0.2
TRITAX BIG BOX REIT PLC	121.6	43	5,980	0.0
	370.26	596	82,592	0.3
イギリス・ボンド	5,194.25	11,479	1,590,499	
通 貨 計	口数、金額 銘柄数<比率>	33銘柄		< 5.5%>
(イスラエル)	千口	千円	%	
REIT 1 LTD	28.84	455	14,289	0.0
イスラエル・シェケル	口数、金額	28.84	455	14,289
通 貨 計	銘柄数<比率>	1銘柄		< 0.0%>
(韓国)	千口	千韓国ウォン	千円	%
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6	44,460	4,188	0.0
LOTTE REIT CO LTD	17.96	96,984	9,135	0.0
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	17.96	73,456	6,919	0.0
韓国ウォン	口数、金額	41.92	214,900	20,243
通 貨 計	銘柄数<比率>	3銘柄		< 0.1%>
ユーロ (アイルランド)	千口	千ユーロ	千円	%
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	82.05	115	14,389	0.0
HIBERNIA REIT PLC	116.24	134	16,771	0.1
国 小 計	口数、金額	198.29	250	31,160
	銘柄数<比率>	2銘柄		< 0.1%>
ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千円	%
WERELDHAVE NV	6.47	75	9,343	0.0
EUROCOMMERCIAL PROPRIET-CV	8.23	126	15,702	0.1
NSI NV	3.231	108	13,543	0.0
VASTNED RETAIL NV	3.75	87	10,844	0.0
国 小 計	口数、金額	21.681	397	49,433
	銘柄数<比率>	4銘柄		< 0.2%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千円	%
AEDIFICA	6.256	606	75,477	0.3
COFINIMMO	5.3	661	82,269	0.3
BEFIMMO	5.07	192	23,899	0.1
INTEREST OFFICES & WAREHOUS	4.61	104	13,044	0.0
RETAIL ESTATES	1.94	116	14,477	0.1
WAREHOUSES DE PAUW SCA	25.48	718	89,308	0.3
CARE PROPERTY INVEST	4.9	133	16,638	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV	2.7	136	16,959	0.1
MONTEA	2.15	208	25,912	0.1
国 小 計	口数、金額	58.406	2,878	357,988
	銘柄数<比率>	9銘柄		< 1.2%>

ファ ン ド 名	当 期 末			
	口 数	評 価 額	比 率	
	外貨建金額	邦貨換算金額		
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千円	%
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	26.77	1,690	210,300	0.7
ICADE	5.94	355	44,255	0.2
CARMILA	10	123	15,373	0.1
ALTAREA	0.74	102	12,701	0.0
GECINA SA	10.521	1,337	166,323	0.6
KLEPIERRE	39.94	774	96,274	0.3
COVIVIO	8.992	647	80,526	0.3
MERCIALYS	4.03	28	3,543	0.0
国 小 計	口数、金額	106.933	5,059	629,299
	銘柄数<比率>	8銘柄		< 2.2%>
ユーロ (ドイツ)	千口	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	34.82	478	59,506	0.2
HAMBORNER REIT AG	11.98	107	13,340	0.0
国 小 計	口数、金額	46.8	585	72,847
	銘柄数<比率>	2銘柄		< 0.3%>
ユーロ (スペイン)	千口	千ユーロ	千円	%
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10.53	51	6,417	0.0
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	50.033	406	50,500	0.2
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	66.1	524	65,237	0.2
国 小 計	口数、金額	126.663	982	122,155
	銘柄数<比率>	3銘柄		< 0.4%>
ユーロ (イタリア)	千口	千ユーロ	千円	%
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6.24	22	2,782	0.0
国 小 計	口数、金額	6.24	22	2,782
	銘柄数<比率>	1銘柄		< 0.0%>
ユーロ (その他)	千口	千ユーロ	千円	%
CROMWELL EUROPEAN REIT	294.6	142	17,771	0.1
国 小 計	口数、金額	294.6	142	17,771
	銘柄数<比率>	1銘柄		< 0.1%>
ユーロ通貨計	口数、金額	859.613	10,318	1,283,439
	銘柄数<比率>	30銘柄		< 4.4%>
合 計	口数、金額	32,726.242	—	28,032,952
	銘柄数<比率>	323銘柄		<97.0%>

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	451	—
STOXX 600 REAL (ドイツ)	271	—

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

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	154,336	0.5
投資信託証券	28,032,952	96.8
コール・ローン等、その他	778,544	2.7
投資信託財産総額	28,965,833	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＝103.89円、1カナダ・ドル＝79.95円、1オーストラリア・ドル＝76.91円、1香港ドル＝13.40円、1シンガポール・ドル＝77.69円、1ニュージーランド・ドル＝73.11円、1イギリス・ポンド＝138.55円、1イスラエル・シェケル＝31.34円、100韓国ウォン＝9.42円、1ユーロ＝124.38円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産（28,578,706千円）の投資信託財産総額（28,965,833千円）に対する比率は、98.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	29,286,393,421円
コール・ローン等	427,298,478
投資信託受益証券(評価額)	154,336,387
投資信託証券(評価額)	28,032,952,855
未収入金	357,873,678
未収配当金	67,602,662
差入委託証拠金	246,329,361
(B) 負債	386,546,524
未払金	373,445,599
未払株式払込金	5,533,125
未払解約金	7,567,800
(C) 純資産総額(A－B)	28,899,846,897
元本	13,110,290,968
次期繰越損益金	15,789,555,929
(D) 受益権総口数	13,110,290,968口
1万口当り基準価額(C／D)	22,044円

* 期首における元本額は10,530,038,419円、当作成期間中における追加設定元本額は5,074,786,065円、同解約元本額は2,494,533,516円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）6,132,754,799円、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）1,093,059,962円、ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジあり）373,261,192円、ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス（為替ヘッジなし）273,443,934円、D－I's グローバルREITインデックス1,889,346円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 1,550,762円、iFree 外国REITインデックス123,942,403円、iFree 8資産バランス1,373,085,035円、グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）58,109,678円、グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）22,959,674円、DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド2,665,764,298円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 3,110,210円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 6,033,482円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 3,580,507円、ダイワバランスファンド2020－07（適格機関投資家専用）249,211,041円、ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT 253,711,264円、ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド 52,204,021円、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）217,637,598円、ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）204,981,762円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は22,044円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月3日 至2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	906,938,843円
受取配当金	906,808,298
受取利息	16,322
その他収益金	276,441
支払利息	△ 162,218
(B) 有価証券売買損益	△ 5,029,277,719
売買益	1,259,234,903
売買損	△ 6,288,512,622
(C) 先物取引等損益	△ 27,500,056
取引益	227,997,158
取引損	△ 255,497,214
(D) その他費用	△ 17,338,657
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	△ 4,167,177,589
(F) 前期繰越損益金	16,681,310,374
(G) 解約差損益金	△ 2,568,409,291
(H) 追加信託差損益金	5,843,832,435
(I) 合計(E + F + G + H)	15,789,555,929
次期繰越損益金(I)	15,789,555,929

(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16期（決算日 2020年11月30日）

（作成対象期間 2019年12月3日～2020年11月30日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

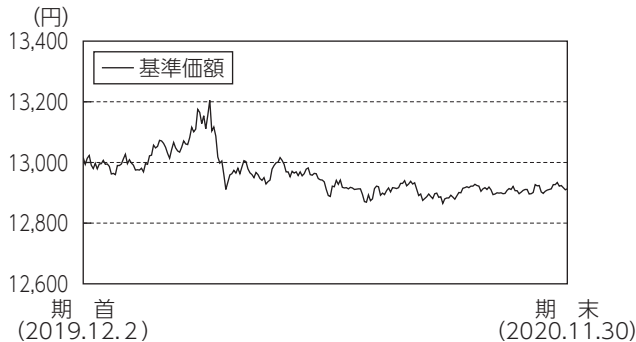
運 用 方 針	投資成果をNOMURA－BPI総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総合指数		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率		
(期首)2019年12月2日	13,016	—	13,043	—	99.2	—
12月末	13,012	△0.0	13,037	△0.0	99.2	—
2020年1月末	13,071	0.4	13,092	0.4	98.5	—
2月末	13,175	1.2	13,191	1.1	99.2	—
3月末	12,963	△0.4	12,981	△0.5	99.3	—
4月末	13,007	△0.1	13,025	△0.1	99.2	—
5月末	12,947	△0.5	12,970	△0.6	98.9	—
6月末	12,895	△0.9	12,917	△1.0	99.4	—
7月末	12,940	△0.6	12,963	△0.6	99.2	—
8月末	12,880	△1.0	12,902	△1.1	98.9	—
9月末	12,917	△0.8	12,939	△0.8	99.2	—
10月末	12,896	△0.9	12,920	△0.9	99.3	—
(期末)2020年11月30日	12,913	△0.8	12,936	△0.8	99.2	—

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) NOMURA-BPI 総合指数は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。NOMURA-BPIは、野村證券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

(注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。

上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注5) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：13,016円 期末：12,913円 騰落率：△0.8%

【基準価額の主な変動要因】

金利の上昇により債券価格が下落したため、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内債券市場

国内債券市場では、当作成期を通して見ると長期金利は上昇（債券価格は下落）しました。

当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、市場のリスク回避姿勢が強まったことから、長期金利は低下しました。その後、日本政府の経済対策に伴う国債増発懸念などを受けて、金利は上昇しました。2020年4月以降はおおむねレンジ内で推移しましたが、8月は米国の金利が上昇したことなどから、長期金利は上昇しました。9月には、米国の追加経済対策の協議難航や欧州での新型コロナウイルス感染再拡大への懸念などを背景に、国内金利は低下しました。その後はおおむねレンジ内での推移となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

ベンチマーク（NOMURA-BPI 総合指数）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、ファンドの資金流出入や毎月末に行われるベンチマークのユニパ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出や毎月末に行われるベンチマークのユニパース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△0.8%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。

《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出や毎月末に行われるベンチマークのユニパース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■ 1 万口当りの費用の明細

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

(注 1) 費用の項目および算出法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の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

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	7,010,548	3,252,923 (－)
	地方債証券	108,903	(－)
	特殊債券	208,254	100,053 (－)
	社債券	200,000	201,857 (－)

(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

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

当 期				
買 付		売 付		
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額	
	千円		千円	
137 5年国債 0.1% 2023/9/20	272,248	128 5年国債 0.1% 2021/6/20	227,919	
359 10年国債 0.1% 2030/6/20	241,516	129 5年国債 0.1% 2021/9/20	182,438	
358 10年国債 0.1% 2030/3/20	237,383	406 2年国債 0.1% 2021/11/1	180,424	
357 10年国債 0.1% 2029/12/20	219,296	403 2年国債 0.1% 2021/8/1	160,414	
138 5年国債 0.1% 2023/12/20	211,904	357 10年国債 0.1% 2029/12/20	142,396	
143 5年国債 0.1% 2025/3/20	202,232	127 5年国債 0.1% 2021/3/20	140,456	
144 5年国債 0.1% 2025/6/20	201,764	331 10年国債 0.6% 2023/9/20	123,546	
337 10年国債 0.3% 2024/12/20	183,617	142 5年国債 0.1% 2024/12/20	121,810	
414 2年国債 0.1% 2022/7/1	170,810	138 5年国債 0.1% 2023/12/20	121,120	
142 5年国債 0.1% 2024/12/20	162,685	142 20年国債 1.8% 2032/12/20	109,696	

(注 1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注 2) 単位未満は切捨て。

■ 組入資産明細表

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

区 分	当 期				末		
	額面金額	評 価 額	組入比率	うち8B	残存期間別組入比率		
				格以下 組入比率	5年以上	2年以上	2年末満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	19,067,000	20,457,090	85.4	－	55.2	20.0	10.2
地方債証券	1,500,000	1,559,084	6.5	－	3.5	2.6	0.4
特殊債券 (除く金融債券)	800,000	833,568	3.5	－	1.4	1.7	0.4
普通社債券	900,000	928,776	3.9	－	2.6	1.3	－
合 計	22,267,000	23,778,520	99.2	－	62.6	25.5	11.1

(注 1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注 2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

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

区 分	当 期				末	
	銘 柄	年利率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日	
		%	千円	千円		
国債証券	407 2年国債	0.1000	30,000	30,069	2021/12/01	
	130 5年国債	0.1000	247,000	247,531	2021/12/20	
	319 10年国債	1.1000	140,000	141,790	2021/12/20	
	320 10年国債	1.0000	35,000	35,410	2021/12/20	
	53 20年国債	2.1000	13,000	13,303	2021/12/20	
	54 20年国債	2.2000	14,000	14,341	2021/12/20	
	408 2年国債	0.1000	160,000	160,408	2022/01/01	
	409 2年国債	0.1000	40,000	40,110	2022/02/01	
	131 5年国債	0.1000	190,000	190,543	2022/03/20	
	321 10年国債	1.0000	65,000	65,946	2022/03/20	
	322 10年国債	0.9000	140,000	141,856	2022/03/20	
	55 20年国債	2.0000	41,000	42,132	2022/03/21	
	413 2年国債	0.1000	120,000	120,450	2022/06/01	
	132 5年国債	0.1000	190,000	190,663	2022/06/20	
	323 10年国債	0.9000	70,000	71,114	2022/06/20	
	324 10年国債	0.8000	80,000	81,149	2022/06/20	
	56 20年国債	2.0000	12,000	12,396	2022/06/20	
	57 20年国債	1.9000	24,000	24,755	2022/06/20	
	414 2年国債	0.1000	170,000	170,673	2022/07/01	
	415 2年国債	0.1000	100,000	100,409	2022/08/01	
	133 5年国債	0.1000	230,000	230,995	2022/09/20	
	325 10年国債	0.8000	160,000	162,688	2022/09/20	
	58 20年国債	1.9000	35,000	36,283	2022/09/20	
	417 2年国債	0.1000	130,000	130,585	2022/10/01	
	134 5年国債	0.1000	170,000	170,838	2022/12/20	
	326 10年国債	0.7000	20,000	20,341	2022/12/20	
	327 10年国債	0.8000	90,000	91,721	2022/12/20	
	59 20年国債	1.7000	3,000	3,112	2022/12/20	
	135 5年国債	0.1000	310,000	311,714	2023/03/20	
	328 10年国債	0.6000	60,000	61,009	2023/03/20	
	61 20年国債	1.0000	40,000	41,046	2023/03/20	
	136 5年国債	0.1000	150,000	150,901	2023/06/20	
	329 10年国債	0.8000	200,000	204,760	2023/06/20	
	62 20年国債	0.8000	16,000	16,382	2023/06/20	
	63 20年国債	1.8000	30,000	31,485	2023/06/20	
	137 5年国債	0.1000	410,000	412,767	2023/09/20	
	330 10年国債	0.8000	81,000	83,130	2023/09/20	
	331 10年国債	0.6000	10,000	10,206	2023/09/20	
	64 20年国債	1.9000	35,000	37,003	2023/09/20	
	138 5年国債	0.1000	280,000	282,186	2023/12/20	
	332 10年国債	0.6000	65,000	66,463	2023/12/20	

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	
	65 20年国債	1.9000	42,000	44,619	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	30,000	31,779	2023/12/20
	139 5年国債	0.1000	320,000	322,544	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	83,000	85,021	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	19,000	20,280	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	25,000	26,934	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	12,000	12,888	2024/03/20
	140 5年国債	0.1000	140,000	141,198	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	320,000	328,332	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	18,000	19,624	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	17,000	18,412	2024/06/20
	141 5年国債	0.1000	210,000	211,925	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	210,000	215,054	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	53,000	57,505	2024/09/20
	142 5年国債	0.1000	40,000	40,382	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	230,000	234,027	2024/12/20
	143 5年国債	0.1000	200,000	201,988	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	80,000	81,832	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	14,000	15,346	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	25,000	27,187	2025/03/20
	144 5年国債	0.1000	200,000	202,012	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	115,000	117,735	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	17,000	18,566	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	14,000	15,354	2025/06/20
	145 5年国債	0.1000	17,000	17,168	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	175,000	179,308	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	65,000	71,604	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	28,000	30,980	2025/09/20
	341 10年国債	0.3000	15,000	15,308	2025/12/20
	342 10年国債	0.1000	20,000	20,213	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	31,000	34,632	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	6,000	6,767	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	35,000	39,287	2026/03/20
	343 10年国債	0.1000	132,000	133,473	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	33,000	37,420	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	15,000	16,925	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	50,000	50,583	2026/09/20
	345 10年国債	0.1000	280,000	283,407	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	45,000	51,027	2026/12/20
	346 10年国債	0.1000	40,000	40,506	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	18,000	20,395	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	45,000	51,274	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	235,000	238,097	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	30,000	34,747	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	23,000	26,336	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	240,000	243,285	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	25,000	28,928	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	34,000	39,109	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	250,000	253,460	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	53,000	61,237	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	230,000	233,208	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	35,000	40,873	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	18,000	21,285	2028/03/20
	351 10年国債	0.1000	180,000	182,460	2028/06/20
	102 20年国債	2.4000	10,000	11,879	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	21,000	24,787	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	64,000	74,570	2028/06/20
	352 10年国債	0.1000	230,000	233,065	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	38,000	44,452	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	16,000	18,842	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	210,000	212,717	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	20,000	23,495	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	68,000	78,783	2028/12/20

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	
	354 10年国債	0.1000	190,000	192,373	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	60,000	69,749	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	27,000	31,837	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	90,000	91,080	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	35,000	41,726	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	40,000	47,344	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	185,000	187,121	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	70,000	83,159	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	75,000	75,781	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	45,000	53,626	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	42,000	50,432	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	9,000	11,002	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	235,000	237,293	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	27,000	32,538	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	77,000	92,078	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	4,000	4,870	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	240,000	242,059	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	13,000	15,468	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	23,000	26,928	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	75,000	86,378	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	100,000	100,733	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	8,000	10,282	2030/11/20
	123 20年国債	2.1000	42,000	50,687	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	55,000	65,825	2030/12/20
	125 20年国債	2.2000	25,000	30,538	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	21,000	25,221	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	70,000	83,353	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	8,000	9,795	2031/05/20
	128 20年国債	1.9000	32,000	38,213	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	65,000	76,937	2031/06/20
	130 20年国債	1.8000	28,000	33,229	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	70,000	82,321	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	9,000	11,288	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	25,000	29,469	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	80,000	95,178	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	15,000	17,888	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	20,000	23,627	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	75,000	87,765	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	12,000	15,018	2032/05/20
	137 20年国債	1.7000	18,000	21,312	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	120,000	140,714	2032/06/20
	141 20年国債	1.7000	48,000	57,077	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	90,000	108,090	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	15,000	16,771	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	48,000	56,609	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	70,000	81,707	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	9,000	10,744	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	130,000	155,204	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	11,000	13,720	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	115,000	137,563	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	11,000	13,613	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	100,000	118,562	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	22,000	28,435	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	85,000	99,830	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	21,000	27,517	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	120,000	141,232	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	26,000	34,192	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	115,000	133,985	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	17,000	22,187	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	120,000	136,681	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	20,000	25,892	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	100,000	113,980	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	15,000	19,467	2035/06/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

当		期		末			
区	分	銘	柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
				%	千円	千円	
		153	20年国債	1.3000	140,000	161,659	2035/06/20
		20	30年国債	2.5000	16,000	21,290	2035/09/20
		154	20年国債	1.2000	100,000	114,130	2035/09/20
		21	30年国債	2.3000	16,000	20,863	2035/12/20
		155	20年国債	1.0000	120,000	133,442	2035/12/20
		22	30年国債	2.5000	17,000	22,736	2036/03/20
		156	20年国債	0.4000	103,000	105,353	2036/03/20
		23	30年国債	2.5000	16,000	21,468	2036/06/20
		157	20年国債	0.2000	113,000	111,986	2036/06/20
		24	30年国債	2.5000	15,000	20,176	2036/09/20
		158	20年国債	0.5000	95,000	98,385	2036/09/20
		25	30年国債	2.3000	17,000	22,378	2036/12/20
		159	20年国債	0.6000	120,000	125,995	2036/12/20
		26	30年国債	2.4000	32,000	42,740	2037/03/20
		160	20年国債	0.7000	130,000	138,509	2037/03/20
		161	20年国債	0.6000	80,000	83,916	2037/06/20
		27	30年国債	2.5000	32,000	43,504	2037/09/20
		162	20年国債	0.6000	100,000	104,798	2037/09/20
		163	20年国債	0.6000	72,000	75,442	2037/12/20
		28	30年国債	2.5000	34,000	46,453	2038/03/20
		164	20年国債	0.5000	125,000	128,792	2038/03/20
		165	20年国債	0.5000	95,000	97,759	2038/06/20
		29	30年国債	2.4000	43,000	58,309	2038/09/20
		166	20年国債	0.7000	100,000	106,221	2038/09/20
		167	20年国債	0.5000	80,000	82,107	2038/12/20
		30	30年国債	2.3000	56,000	75,297	2039/03/20
		168	20年国債	0.4000	110,000	110,850	2039/03/20
		169	20年国債	0.3000	80,000	79,096	2039/06/20
		31	30年国債	2.2000	76,000	101,250	2039/09/20
		170	20年国債	0.3000	40,000	39,507	2039/09/20
		171	20年国債	0.3000	70,000	69,066	2039/12/20
		32	30年国債	2.3000	45,000	61,028	2040/03/20
		172	20年国債	0.4000	95,000	95,341	2040/03/20
		173	20年国債	0.4000	95,000	95,171	2040/06/20
		33	30年国債	2.0000	95,000	124,028	2040/09/20
		174	20年国債	0.4000	30,000	30,027	2040/09/20
		34	30年国債	2.2000	70,000	94,364	2041/03/20
		35	30年国債	2.0000	92,000	120,849	2041/09/20
		36	30年国債	2.0000	88,000	115,975	2042/03/20
		37	30年国債	1.9000	83,000	108,075	2042/09/20
		38	30年国債	1.8000	65,000	83,544	2043/03/20
		39	30年国債	1.9000	50,000	65,378	2043/06/20
		40	30年国債	1.8000	44,000	56,635	2043/09/20
		41	30年国債	1.7000	45,000	56,985	2043/12/20
		42	30年国債	1.7000	53,000	67,182	2044/03/20
		43	30年国債	1.7000	45,000	57,099	2044/06/20
		44	30年国債	1.7000	50,000	63,505	2044/09/20
		45	30年国債	1.5000	57,000	69,913	2044/12/20
		46	30年国債	1.5000	55,000	67,500	2045/03/20
		47	30年国債	1.6000	62,000	77,591	2045/06/20
		48	30年国債	1.4000	68,000	82,047	2045/09/20
		49	30年国債	1.4000	68,000	82,081	2045/12/20
		50	30年国債	0.8000	60,000	63,898	2046/03/20
		51	30年国債	0.3000	65,000	61,428	2046/06/20
		52	30年国債	0.5000	69,000	68,374	2046/09/20
		53	30年国債	0.6000	55,000	55,753	2046/12/20
		54	30年国債	0.8000	55,000	58,359	2047/03/20
		55	30年国債	0.8000	56,000	59,380	2047/06/20
		56	30年国債	0.8000	60,000	63,577	2047/09/20
		57	30年国債	0.8000	70,000	74,120	2047/12/20
		1	40年国債	2.4000	30,000	43,849	2048/03/20
		58	30年国債	0.8000	75,000	79,261	2048/03/20
		59	30年国債	0.7000	55,000	56,702	2048/06/20
		60	30年国債	0.9000	58,000	62,668	2048/09/20

		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	
	61 30年国債	0.7000	50,000	51,385		2048/12/20	
	2 40年国債	2.2000	38,000	53,814		2049/03/20	
	62 30年国債	0.5000	46,000	44,832		2049/03/20	
	63 30年国債	0.4000	55,000	52,064		2049/06/20	
	64 30年国債	0.4000	50,000	47,196		2049/09/20	
	65 30年国債	0.4000	55,000	51,829		2049/12/20	
	3 40年国債	2.2000	19,000	26,978		2050/03/20	
	66 30年国債	0.4000	102,000	95,841		2050/03/20	
	67 30年国債	0.6000	59,000	58,486		2050/06/20	
	68 30年国債	0.6000	18,000	17,797		2050/09/20	
	4 40年国債	2.2000	30,000	42,799		2051/03/20	
	5 40年国債	2.0000	35,000	48,357		2052/03/20	
	6 40年国債	1.9000	28,000	38,157		2053/03/20	
	7 40年国債	1.7000	31,000	40,689		2054/03/20	
	8 40年国債	1.4000	33,000	40,509		2055/03/20	
	9 40年国債	0.4000	40,000	36,707		2056/03/20	
	10 40年国債	0.9000	91,000	97,825		2057/03/20	
	11 40年国債	0.8000	85,000	88,561		2058/03/20	
	12 40年国債	0.5000	99,000	93,159		2059/03/20	
	13 40年国債	0.5000	109,000	102,438		2060/03/20	
種別 小計	銘柄数 金 額	251銘柄			19,067,000	20,457,090	
地方債証券	116 共同発行地方	0.8000	100,000	101,540		2022/11/25	
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	101,425		2022/12/22	
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	101,593		2023/01/31	
	25-6 大阪市公債	0.6940	100,000	102,015		2023/11/22	
	3 兵庫県公債12年	0.5600	100,000	102,338		2025/04/16	
	401 大阪府公債	0.4770	100,000	102,163		2025/10/29	
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	108,150		2025/11/21	
	751 東京都公債	0.3700	100,000	101,740		2025/12/19	
	27-15 北海道公債	0.2200	100,000	100,939		2026/02/26	
	28-1 静岡県公債	0.0800	100,000	100,237		2026/03/19	
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	100,121		2026/06/19	
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,962		2027/03/25	
	29-6 千葉県公債	0.2450	100,000	101,267		2028/01/25	
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	118,098		2029/12/14	
	11 兵庫県公債20年	1.8400	100,000	116,490		2030/08/16	
種別 小計	銘柄数 金 額	15銘柄			1,500,000	1,559,084	
特殊債券 (除く金融債)	36 地方公共団体	0.8920	100,000	101,284		2022/05/27	
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	101,426		2022/03/31	
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	101,956		2024/10/28	
	241 政保道路機構	0.4500	100,000	101,943		2025/03/31	
	261 政保道路機構	0.3810	100,000	101,851		2025/11/28	
	127 都市再生	0.0750	100,000	100,023		2026/09/18	
	81 政保道路機構	2.1000	100,000	117,179		2029/05/31	
	47 日本政策投資CO	1.0270	100,000	107,903		2029/09/20	
種別 小計	銘柄数 金 額	8銘柄			800,000	833,568	
普通社債券	32 東日本旅客鉄道	2.2600	100,000	107,232		2024/03/19	
	25 西日本高速道	0.5240	100,000	101,876		2024/12/20	
	497 関西電力	1.0020	100,000	103,721		2025/06/20	
	14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	100,009		2025/12/19	
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,909		2026/08/21	
	17 パソニック	0.4700	100,000	100,997		2026/09/18	
	83 三菱地所	2.3050	100,000	113,044		2027/03/19	
	9 ソフトバンク	0.4800	100,000	100,040		2027/12/03	
	5 NTTファイナンス	0.4890	100,000	101,944		2032/09/17	
	種別 小計	銘柄数 金 額	9銘柄			900,000	928,776
合計	銘柄数 金 額	283銘柄			22,267,000	23,778,520	

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	23,778,520	98.4
コール・ローン等、その他	383,997	1.6
投資信託財産総額	24,162,518	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

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	24,162,518,080円
コール・ローン等	331,720,502
公社債(評価額)	23,778,520,440
未収利息	50,884,824
前払費用	1,392,314
(B) 負債	200,100,000
未払金	200,000,000
未払解約金	100,000
(C) 純資産総額(A－B)	23,962,418,080
元本	18,557,007,274
次期繰越損益金	5,405,410,806
(D) 受益権総口数	18,557,007,274口
1万口当り基準価額(C／D)	12,913円

* 期首における元本額は15,576,806,254円、当作成期間中における追加設定元本額は5,111,345,542円、同解約元本額は2,131,144,522円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、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）338,783,717円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 2,224,076円、iFree 日本債券インデックス203,623,872円、iFree 8資産バランス2,301,456,849円、ダイワ・ライフ・バランス30 6,985,273,543円、ダイワ・ライフ・バランス50 4,274,421,319円、ダイワ・ライフ・バランス70 1,297,181,504円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）1,067,068,046円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）781,455,104円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）251,998,653円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 48,938,797円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 66,428,943円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 14,696,846円、ダイワつみたてインデックス日本債券407,539,350円、ダイワつみたてインデックスバランス30 25,894,956円、ダイワつみたてインデックスバランス50 9,096,977円、ダイワつみたてインデックスバランス70 4,422,197円、ダイワ世界バランスファンド40VA291,709,847円、ダイワ世界バランスファンド60VA184,792,678円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,913円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月3日 至2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	166,420,250円
受取利息	166,486,387
支払利息	△ 66,137
(B) 有価証券売買損益	△ 316,673,080
売買益	11,041,720
売買損	△ 327,714,800
(C) その他費用	△ 1,598
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 150,254,428
(E) 前期繰越損益金	4,698,249,413
(F) 解約差損益金	△ 649,271,809
(G) 追加信託差損益金	1,506,687,630
(H) 合計(D + E + F + G)	5,405,410,806
次期繰越損益金(H)	5,405,410,806

(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。

ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第14期（決算日 2020年12月18日）

（作成対象期間 2019年12月19日～2020年12月18日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

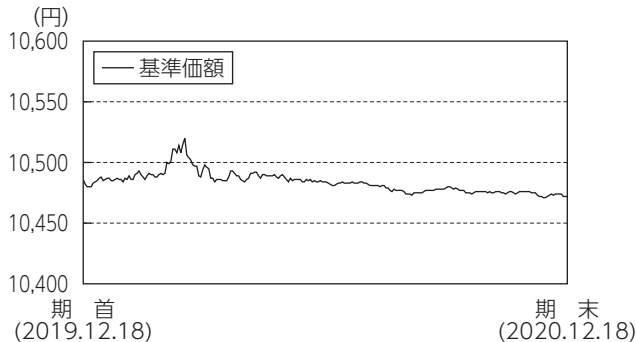
運 用 方 針	投資成果をNOMUR A－BPI 総合短期指数の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主 要 投 資 対 象	わが国の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

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 総合短期指数		公 社 債 組入比率	債券先物比率
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首)2019年12月18日	10,486	—	10,545	—	95.5	—
12月末	10,487	0.0	10,546	0.0	95.5	—
2020年 1 月末	10,491	0.0	10,550	0.0	94.9	—
2 月末	10,511	0.2	10,564	0.2	94.9	—
3 月末	10,484	△0.0	10,538	△0.1	95.2	—
4 月末	10,492	0.1	10,546	0.0	95.0	—
5 月末	10,485	△0.0	10,541	△0.0	95.0	—
6 月末	10,482	△0.0	10,537	△0.1	95.0	—
7 月末	10,481	△0.0	10,538	△0.1	94.9	—
8 月末	10,475	△0.1	10,531	△0.1	96.5	—
9 月末	10,478	△0.1	10,535	△0.1	97.0	—
10月末	10,475	△0.1	10,533	△0.1	97.0	—
11月末	10,472	△0.1	10,532	△0.1	97.1	—
(期末)2020年12月18日	10,472	△0.1	10,533	△0.1	97.2	—

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) NOMURA-BPI 総合短期指数は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。NOMURA-BPIは、野村證券株式会社が算出する、日本の公債券流通市場全体の動向を的確に表すために開発された投資収益指数で、そのうち残存期間1～3年の部分の投資収益を表したものが総合短期指数です。

NOMURA-BPIは、野村證券株式会社が公表している指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負うものではありません。

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

(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注5) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,486円 期末：10,472円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

短期金利の利回りがマイナスで推移したことから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期債券市場

国内短期債券市場では、当作成期を通して見ると短期金利は当作成期首とおおむね同程度の水準でした。

当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて市場のリスク回避姿勢が強まったことから、短期金利は低下（債券価格は上昇）しました。その後は、日本政府の経済対策に伴う国債増発懸念などを受けて金利は上昇しました。2020年4月以降はおおむねレンジ内で推移しましたが、8月は米国の金利が上昇したことなどから短期金利は上昇しました。9月には、米国の追加経済対策協議の難航や欧州での感染再拡大への懸念などを背景に、金利は低下しました。その後はおおむねレンジ内での推移となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

今後もベンチマーク（NOMURA-BPI 総合短期指数）との高い連動性を維持するように運用を行います。残存年限別構成やデュレーションなどを管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに配慮しつつ、ポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

◆ポートフォリオについて

当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの残存年限構成やデュレーションなどをベンチマークに近づけることにより、連動性を維持しました。

◆ベンチマークとの差異について

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

当ファンドとベンチマークとの騰落率の差は△0.0%程度となり、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。

《今後の運用方針》

今後もベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行います。残存年限別構成やデュレーションなどを管理するとともに、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化に対しては、売買コストに配慮しつつ、ポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

■ 1万口当りの費用の明細

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

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の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

(2019年12月19日から2020年12月18日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	15,777	13,149 (-)

(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

(2019年12月19日から2020年12月18日まで)

当			期		
買 付		額	売 付		額
銘 柄	金 額		銘 柄	金 額	
	千円			千円	
134 5年国債 0.1% 2022/12/20	6,632		132 5年国債 0.1% 2022/6/20	6,622	
132 5年国債 0.1% 2022/6/20	6,631		131 5年国債 0.1% 2022/3/20	6,527	
131 5年国債 0.1% 2022/3/20	2,512				

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

■組入資産明細表

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

区 分	当				期			末
	額面金額	評 価 額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
国債証券	6,600	6,632	97.2	-	-	97.2	-	-

(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）

当		期		末	
区 分	銘 柄	年利率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	134 5年国債	0.1000	6,600	6,632	2022/12/20

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年12月18日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	6,632	97.2
コール・ローン等、その他	188	2.8
投資信託財産総額	6,820	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

2020年12月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	6,820,445円
コール・ローン等	184,834
公社債(評価額)	6,632,340
未収利息	288
前払費用	2,983
(B) 負債	-
(C) 純資産総額(A - B)	6,820,445
元本	6,513,195
次期繰越損益金	307,250
(D) 受益権総口数	6,513,195口
1万口当り基準価額(C / D)	10,472円

*期首における元本額は4,013,246円、当作成期間中における追加設定元本額は2,548,635円、同解約元本額は48,686円です。
*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 6,513,195円です。
*当期末の計算口数当りの純資産額は10,472円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月19日 至2020年12月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	5,977円
受取利息	5,980
支払利息	△ 3
(B) 有価証券売買損益	△ 15,739
売買損	△ 15,739
(C) 当期損益金(A + B)	△ 9,762
(D) 前期繰越損益金	194,961
(E) 解約差損益金	△ 2,314
(F) 追加信託差損益金	124,365
(G) 合計(C + D + E + F)	307,250
次期繰越損益金(G)	307,250

(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。

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第21期 (決算日 2020年11月30日)

(作成対象期間 2019年12月3日～2020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。

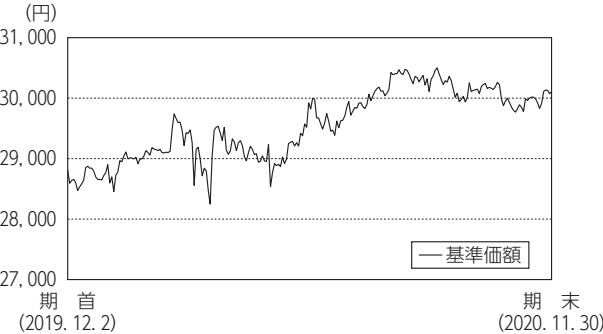
運用方針	投資成果を FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の公社債
株式組入制限	純資産総額の30%以下

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) 2019年12月2日	28,807	—	29,079	—	98.4	—
12月末	28,900	0.3	29,177	0.3	98.2	—
2020年1月末	29,132	1.1	29,333	0.9	98.3	—
2月末	29,474	2.3	29,916	2.9	98.2	—
3月末	29,517	2.5	29,656	2.0	98.3	—
4月末	28,953	0.5	29,181	0.3	98.2	—
5月末	29,377	2.0	29,685	2.1	97.9	—
6月末	29,845	3.6	30,164	3.7	98.2	—
7月末	30,143	4.6	30,493	4.9	98.0	—
8月末	30,109	4.5	30,401	4.5	98.3	—
9月末	30,250	5.0	30,538	5.0	98.1	—
10月末	29,799	3.4	30,116	3.6	98.1	—
(期末) 2020年11月30日	30,106	4.5	30,435	4.7	98.5	—

(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：28,807円 期末：30,106円 騰落率：4.5%
【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、為替市場で米ドルなどが下落 (円高) したものの債券市場で金利が低下 (債券価格は上昇) したため、基準価額は上昇しました。

◆ 投資環境について
○ 海外債券市況
主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると低下しました。
当作成期首より、新型コロナウイルスによる世界経済の減速懸念の高まりから、金利は大きく低下しました。その後は、各国で段階的に経済活動が再開されたことやワクチン開発への期待から金利は一時的に上昇しましたが、感染再拡大への懸念が高まると金利は再び低下しました。2020年8月には、株価が上昇するなどリスクに対する市場心理が改善し、金利は上昇しました。10月には、米大統領および連邦議会選挙を控えて、バイデン候補が大統領に当選し民主党が上下院を制したものの拡張的な財政政策を懸念する動きなどから、米国の金利を中心に上昇しました。

○ 為替相場
為替相場は、当作成期を通して見ると米ドルなどが下落しました。
対円為替相場は、当作成期首より横ばいで推移しましたが、2020年に入ってから、新型コロナウイルスの感染拡大懸念が高まったことなどから円高が進みました。5月以降は、経済活動の再開期待などからユーロを中心に上昇しました。7月には、米中関係の悪化や追加経済対策をめぐる不透明感から米ドルを中心に下落傾向となりました。10月以降は、感染再拡大に対する懸念や米大統領および連邦議会選挙に対する不透明感などから、米ドルなどが下落しました。

◆ 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 (FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)) に極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

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

◆ ベンチマークとの差異について
当作成期のベンチマークの騰落率は4.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.5%となりました。
当作成期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー (両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの) は0.2%程度でした。ただし、これらはファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正しています。

《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)	5 (5)
(その他)	(0)
合 計	5

(注 1) 費用の項目および算出法については前掲の「1 万口当りの費用の明細」の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

(2019年12月 3 日から2020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	244, 186 (—)	221, 904 (—)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 18, 392 (—)	千カナダ・ドル 9, 377 (—)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 31, 353 (—)	千オーストラリア・ドル 5, 400 (—)
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 3, 085 (—)	千シンガポール・ドル 1, 151 (—)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 26, 395 (—)	千イギリス・ポンド 11, 406 (—)
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シェケル 30, 447 (—)	千イスラエル・シェケル 544 (—)
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 16, 467 (—)	千デンマーク・クローネ 2, 271 (—)
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 10, 993 (—)	千ノルウェー・クローネ 7, 241 (—)
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローネ 14, 305 (—)	千スウェーデン・クローネ 11, 290 (—)
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 81, 550 (—)	千メキシコ・ペソ 32, 935 (—)
外 国	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 13, 203 (—)	千マレーシア・リンギット 5, 100 (—)

			買 付 額	売 付 額
外 国	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 7, 914 (—)	千南アフリカ・ランド 137, 657 (—)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 18, 643 (—)	千ポーランド・ズロチ 8, 566 (—)
	ユーロ (アイルランド)	国債証券	千ユーロ 4, 308 (—)	千ユーロ 849 (—)
	ユーロ (オランダ)	国債証券	千ユーロ 7, 400 (—)	千ユーロ 2, 393 (—)
	ユーロ (ベルギー)	国債証券	千ユーロ 10, 174 (—)	千ユーロ 3, 003 (—)
	ユーロ (フランス)	国債証券	千ユーロ 50, 275 (—)	千ユーロ 21, 351 (—)
	ユーロ (ドイツ)	国債証券	千ユーロ 49, 813 (—)	千ユーロ 15, 873 (—)
	ユーロ (スペイン)	国債証券	千ユーロ 29, 263 (—)	千ユーロ 10, 586 (—)
	ユーロ (イタリア)	国債証券	千ユーロ 43, 888 (—)	千ユーロ 22, 171 (—)
	ユーロ (フィンランド)	国債証券	千ユーロ 2, 826 (—)	千ユーロ 626 (—)
外 国	ユーロ (オーストリア)	国債証券	千ユーロ 6, 786 (—)	千ユーロ 2, 319 (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	国債証券	千ユーロ 204, 737 (—)	千ユーロ 79, 175 (—)

(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

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

当		期	
買		売	
付		付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2023/4/15	1,400,722	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2021/4/30	869,839
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.625% 2030/8/15	1,039,310	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2024/5/31	573,867
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.625% 2030/5/15	831,431	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2021/6/15	542,018
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.375% 2050/8/15	786,370	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2021/9/30	536,388
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2025/6/30	783,138	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 3.25% 2021/10/25	535,670
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2025/9/30	679,021	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2021/6/30	505,631
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2050/2/15	664,353	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2021/7/31	504,550
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.5% 2027/4/30	608,726	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.625% 2021/2/15	454,267
GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 2023/4/14	608,569	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3% 2045/11/15	445,066
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2040/8/15	601,899	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2020/12/31	441,566

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

■組入資産明細表

(1)外国(外貨建)公社債(通貨別)

作 成 期	当			期		未		
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちB B格 以下組入 比 率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
			千円	%	%	%	%	%
アメリカ	千アメリカ・ドル 820,457	千アメリカ・ドル 897,323	93,222,970	42.6	—	18.7	16.0	7.9
カナダ	千カナダ・ドル 48,203	千カナダ・ドル 54,207	4,333,924	2.0	—	0.9	0.7	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 67,164	千オーストラリア・ドル 75,437	5,801,880	2.7	—	1.8	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 10,378	千シンガポール・ドル 11,857	921,200	0.4	—	0.3	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 78,966	千イギリス・ポンド 104,078	14,420,010	6.6	—	5.1	1.1	0.4
イスラエル	千イスラエル・シェケル 25,400	千イスラエル・シェケル 29,484	924,033	0.4	—	0.2	0.2	0.0
デンマーク	千デンマーク・クローネ 56,061	千デンマーク・クローネ 71,697	1,198,067	0.5	—	0.4	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 36,634	千ノルウェー・クローネ 38,933	457,858	0.2	—	0.1	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 50,870	千スウェーデン・クローネ 56,926	695,644	0.3	—	0.2	0.1	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 307,034	千メキシコ・ペソ 342,802	1,779,145	0.8	—	0.4	0.2	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 39,094	千マレーシア・リンギット 42,024	1,072,884	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 45,329	千ポーランド・ズロチ 49,569	1,373,582	0.6	—	0.3	0.3	0.1

作 成 期		当 期				末			
区 分		額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちＢＢ格 以下組入 比	残存期間別組入比率		
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5 年以上	2 年以上	2 年未満
ユ ー ロ	アイルランド	千ユーロ 11, 943	千ユーロ 13, 978	千円 1, 738, 620	% 0. 8	% —	% 0. 6	% 0. 2	% 0. 1
	オランダ	千ユーロ 27, 805	千ユーロ 34, 178	4, 251, 147	1. 9	—	1. 3	0. 5	0. 2
	ベルギー	千ユーロ 35, 009	千ユーロ 44, 357	5, 517, 247	2. 5	—	2. 0	0. 4	0. 1
	フランス	千ユーロ 148, 837	千ユーロ 183, 176	22, 783, 533	10. 4	—	7. 0	2. 6	0. 7
	ドイツ	千ユーロ 107, 345	千ユーロ 130, 943	16, 286, 782	7. 4	—	4. 8	2. 1	0. 6
	スペイン	千ユーロ 86, 979	千ユーロ 106, 965	13, 304, 319	6. 1	—	4. 1	1. 6	0. 4
	イタリア	千ユーロ 139, 894	千ユーロ 167, 518	20, 835, 981	9. 5	—	6. 0	2. 5	1. 1
	フィンランド	千ユーロ 9, 664	千ユーロ 10, 842	1, 348, 586	0. 6	—	0. 4	0. 1	0. 1
	オーストリア	千ユーロ 21, 268	千ユーロ 26, 576	3, 305, 593	1. 5	—	1. 0	0. 4	0. 1
	小計	588, 744	718, 538	89, 371, 812	40. 8	—	27. 2	10. 3	3. 4
合 計		—	—	215, 573, 016	98. 5	—	56. 0	29. 8	12. 7

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

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

		当 期		末			
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 0000	2, 153	2, 191	227, 701	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 0000	3, 224	3, 297	342, 567	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 7500	2, 459	2, 516	261, 402	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 6250	2, 543	2, 606	270, 826	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 6250	6, 668	6, 858	712, 571	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 0000	4, 350	4, 526	470, 206	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1. 7500	4, 685	4, 865	505, 468	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 5000	4, 568	4, 854	504, 377	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 7500	5, 021	5, 398	560, 874	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 7500	5, 229	5, 654	587, 417	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2. 5000	4, 912	5, 296	550, 254	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8. 0000	2, 106	2, 265	235, 372	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6. 2500	654	761	79, 098	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6. 0000	855	1, 102	114, 494	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6. 1250	709	977	101, 589	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5. 5000	700	955	99, 317	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5. 2500	738	1, 000	103, 960	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5. 2500	473	645	67, 091	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6. 2500	714	1, 072	111, 398	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5. 3750	2, 391	3, 466	360, 101	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4. 5000	1, 176	1, 748	181, 685	2036/02/15

外国債券インデックスマザーファンド

当			期		末			償還年月日
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	1,346	139,836	2037/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	826	85,828	2038/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	795	82,622	2038/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	1,445	150,197	2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,687	175,364	2039/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,645	170,940	2039/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,856	192,901	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,597	166,008	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	2,586	268,750	2040/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,586	164,835	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	2,241	232,831	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	2,033	211,264	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	2,122	220,524	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	2,185	227,079	2041/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,924	199,927	2041/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	2,158	224,294	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,765	183,412	2042/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,231	2,805	291,424	2042/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	2,048	212,866	2042/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	3,496	363,204	2043/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	2,947	306,163	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	4,603	478,235	2043/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	3,036	315,441	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	4,747	493,255	2044/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	4,615	479,467	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	6,645	690,378	2024/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	2,579	267,959	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,163	2,200	228,628	2021/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	6,377	662,608	2024/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,846	5,047	524,423	2044/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,886	2,936	305,094	2021/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,238	336,440	2021/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,527	2,567	266,733	2022/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	6,152	639,150	2025/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	3,099	322,019	2045/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,809	3,885	403,690	2022/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,953	306,797	2022/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	6,250	649,372	2025/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,835	3,727	387,280	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,671	277,550	2022/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	1,326	1,360	141,309	2022/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,908	302,161	2022/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,179	4,307	447,550	2022/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	6,189	643,017	2025/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,373	4,351	452,095	2045/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,518	261,631	2022/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,544	264,358	2022/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	6,378	662,644	2025/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,159	2,846	295,757	2045/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,642	274,552	2022/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,287	6,518	677,186	2022/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,992	5,195	539,804	2022/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,366	4,643	482,390	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,649	275,249	2023/01/31	

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	2.5000	3,648	4,419	459,139	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,962	3,050	316,904	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,623	3,735	388,125	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,729	3,969	412,405	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,142	222,594	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	4,148	430,959	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,590	269,119	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	3,092	321,309	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	5,716	593,875	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	4,028	418,533	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,859	297,071	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,478	257,456	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,589	268,986	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,767	599,225	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	3,031	314,955	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,604	270,599	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,500	4,536	471,248	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,632	273,539	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,400	3,454	358,937	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,000	4,080	423,933	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,657	276,077	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	6,140	6,790	705,455	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,070	319,035	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,639	274,252	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,545	4,701	488,415	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,074	319,450	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,441	253,656	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,550	4,837	502,611	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,966	308,222	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	7,149	742,755	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	2,656	275,990	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	3,072	319,240	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	3,181	330,491	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,072	319,168	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,626	584,557	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,075	319,558	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,550	265,016	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	6,556	681,141	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,984	310,060	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,205	333,022	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,450	4,390	456,090	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,200	3,282	341,018	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	2,120	220,327	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,579	267,942	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,500	2,677	278,126	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,588	268,916	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	6,122	636,076	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,500	4,460	463,380	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,769	391,649	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,433	356,756	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	3,022	314,003	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,667	380,999	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,650	6,500	675,342	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,481	361,717	2023/02/28

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	
					千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,838	294,867	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,979	309,560	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,800	5,060	525,735	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,900	3,057	317,613	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	3,189	331,312	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,200	5,721	594,405	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	7,558	785,282	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,655	275,853	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	2,112	219,504	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,953	410,761	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,660	276,383	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,657	276,098	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	3,329	345,928	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,850	4,114	427,410	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	7,812	811,616	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,220	5,635	585,456	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,794	290,302	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,853	400,356	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	4,006	416,225	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,817	292,676	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,227	335,288	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,821	293,081	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,312	447,990	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,106	426,597	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	6,900	8,200	851,972	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,520	6,447	669,812	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,371	350,260	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	2,160	224,450	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,800	2,872	298,446	2021/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,500	3,895	404,747	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,686	279,082	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,079	319,910	2022/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	7,610	790,664	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,085	320,543	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	4,289	445,654	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,786	289,450	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	6,295	654,069	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,774	288,232	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,531	366,859	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,600	374,054	2022/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,743	285,027	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,700	3,806	395,486	2022/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,400	3,497	363,367	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	6,094	633,145	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	4,425	459,804	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,741	388,726	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	3,093	321,389	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,585	372,461	2022/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,276	340,399	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,688	383,213	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	3,021	313,933	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,000	4,102	426,256	2022/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,500	5,802	602,861	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,699	280,419	2026/07/31

当 期				未 評 価 額			償還年月日
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 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	1.6250	6,900	7,414	770,317	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,500	3,580	371,978	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	5,351	555,996	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,945	305,957	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	4,148	431,010	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,071	319,131	2022/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,665	276,931	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,141	326,349	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,900	2,966	308,141	2022/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	1,047	108,840	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,550	2,582	268,281	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,200	332,461	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,850	6,356	660,363	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	5,371	558,009	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,500	1,520	158,007	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	2,133	221,690	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,145	326,814	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,089	320,982	2022/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,687	279,243	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,648	275,165	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,500	1,524	158,354	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	4,114	427,424	2023/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	4,700	4,910	510,138	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,500	2,536	263,467	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,250	2,310	239,986	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,600	3,829	397,872	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,200	3,392	352,394	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	5,964	619,647	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	200	202	21,033	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	311	32,311	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	5,380	558,963	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,200	1,209	125,626	2023/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,500	1,512	157,112	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	200	200	20,841	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	13,200	13,227	1,374,186	2023/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,609	167,196	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	7,800	7,670	796,849	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,496	363,200	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,706	281,204	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,200	3,199	332,408	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	5,700	5,684	590,550	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	5,168	536,922	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,814	500,173	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	500	499	51,926	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,488	362,447	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,990	310,694	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,500	5,510	572,486	2023/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,500	5,497	571,149	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	7,500	7,470	776,128	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,486	362,222	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	998	103,747	2023/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,386	351,788	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,497	363,400	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	800	798	82,998	2023/08/15

外国債券インデックスマザーファンド

		当 期			末			
区 分		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
				%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	10,000	9,810	1,019,171	2030/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,936	512,832	2027/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	7,700	7,333	761,827	2050/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,800	5,570	578,736	2040/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,481	361,680	2027/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,997	311,461	2022/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,996	207,430	2023/09/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	6,468	672,009	2025/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,998	311,486	2022/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,942	409,551	2027/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,484	361,993	2025/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,200	4,191	435,500	2023/10/15
通貨小計	銘柄数	249銘柄						
	金 額				820,457	897,323	93,222,970	
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	405	622	49,753	2064/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	586	866	69,298	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,401	112,035	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,771	141,659	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,645	131,567	2037/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,363	2,111	168,839	2041/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,751	1,818	145,382	2022/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,461	2,219	177,428	2045/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,292	103,307	2023/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,512	120,956	2024/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,846	147,611	2048/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,252	100,136	2025/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	1,023	81,864	2026/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,279	102,324	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,440	1,445	115,606	2022/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,750	1,774	141,837	2022/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,200	1,328	106,242	2028/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,300	4,445	355,439	2023/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,300	1,362	108,908	2023/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,110	2,559	204,616	2051/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,386	110,858	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,276	102,058	2024/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,462	116,889	2024/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	3,630	290,256	2030/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	800	808	64,621	2021/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,600	1,660	132,756	2025/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,100	1,117	89,333	2022/02/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5	5	407	2022/05/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,902	232,079	2025/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,301	184,015	2022/08/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	700	55,987	2022/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	880	70,392	2030/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	500	494	39,573	2026/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	500	499	39,927	2024/04/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,500	119,948	2023/02/01
通貨小計	銘柄数	35銘柄						
	金 額				48,203	54,207	4,333,924	

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	
オーストラリア		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	千オーストラリア・ドル 3,162	千オーストラリア・ドル 3,453	千円 265,616	2022/07/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,568	4,026	309,715	2023/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,789	3,541	272,406	2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,473	3,783	290,977	2024/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,404	4,102	315,520	2029/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,498	3,960	304,575	2025/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,258	1,762	135,527	2033/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,248	3,928	302,165	2026/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,497	115,148	2037/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,307	1,568	120,618	2035/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	1,008	77,576	2039/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,672	3,075	236,569	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,678	4,117	316,698	2028/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	1,567	120,531	2047/03/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	800	816	62,820	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,800	3,249	249,881	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,850	1,928	148,339	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,600	3,039	233,782	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,870	5,605	431,086	2030/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	990	1,176	90,510	2041/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	3,000	230,750	2031/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	900	922	70,986	2032/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,406	185,086	2024/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,700	2,725	209,646	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,500	1,454	111,863	2051/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,500	2,494	191,882	2025/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,505	192,732	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,700	2,715	208,863	2026/09/21
通貨小計	銘柄数	28銘柄						
	金 額				67,164	75,437	5,801,880	
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 772	千シンガポール・ドル 905	70,346	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	788	827	64,288	2022/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	623	683	53,124	2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	809	958	74,430	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	512	39,777	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	671	713	55,429	2023/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	724	56,307	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	728	56,577	2029/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	568	44,190	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	908	70,608	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	488	37,939	2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	500	510	39,625	2022/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	650	751	58,345	2036/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	450	464	36,079	2023/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	623	48,446	2028/05/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	490	516	40,097	2024/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	418	32,487	2039/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	470	554	43,099	2050/03/01
通貨小計	銘柄数	18銘柄						
	金 額				10,378	11,857	921,200	

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	
			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,621	1,776	246,129	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,682	2,785	385,874	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,586	219,863	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	2,320	2,341	324,351	2022/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,940	2,247	311,454	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,750	3,212	445,098	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,510	1,969	272,931	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	2,010	2,163	299,692	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	2,000	2,042	282,985	2023/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	2,500	2,787	386,201	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,060	1,491	206,643	2071/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	2,600	2,692	372,992	2024/04/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,110	1,366	189,388	2049/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	1,051	145,731	2054/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	1,800	1,899	263,116	2029/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	2,600	2,674	370,532	2025/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	940	1,021	141,593	2041/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	2,300	2,306	319,550	2023/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	2,300	2,313	320,468	2030/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	650	590	81,783	2061/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,505	208,577	2026/01/30
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,000	997	138,175	2028/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	1,038	143,852	2050/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	900	898	124,524	2035/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,300	1,304	180,786	2024/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,386	192,137	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,840	2,635	365,215	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,788	247,797	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,662	2,547	353,006	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,257	2,127	294,792	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,908	3,915	542,535	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,666	3,001	415,799	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,589	220,228	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,416	4,231	586,291	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,830	2,635	365,086	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	2,530	350,607	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	2,345	325,034	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,382	1,453	201,314	2022/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,260	1,926	266,915	2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,574	3,287	455,481	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,604	360,841	2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	2,824	391,308	2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,313	320,522	2022/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,166	3,278	454,284	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,582	1,682	233,130	2023/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,586	3,330	461,456	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,092	1,206	167,187	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,124	3,368	466,731	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	48銘柄					
	金 額			78,966	104,078	14,420,010	

		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		
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	千イスラエル・シェケル 2,000	千イスラエル・シェケル 2,681	千円 84,053	2026/10/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	2,000	2,127	66,679	2022/01/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	4.2500	1,800	1,971	61,788	2023/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,900	3,254	101,990	2042/01/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,000	2,232	69,962	2024/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,450	76,788	2025/08/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,970	61,752	2027/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.2500	1,000	1,022	32,041	2022/11/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,100	2,940	92,144	2047/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,800	2,020	63,324	2028/09/28	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,500	1,557	48,802	2023/11/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.7500	1,000	1,010	31,667	2022/07/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	1,900	1,936	60,676	2030/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.5000	600	603	18,928	2025/04/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	700	706	22,146	2037/05/31	
Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.1500	1,000	998	31,286	2023/07/31		
通貨小計	銘柄数	16銘柄						
	金 額			25,400	29,484	924,033		
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 13,662	千デンマーク・クローネ 26,252	438,685	2039/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	7,550	7,812	130,545	2021/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,162	86,266	2023/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	6,735	112,544	2025/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	7,900	8,490	141,883	2027/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	9,590	10,450	174,628	2029/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,300	4,377	73,141	2022/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,416	40,372	2052/11/15	
	通貨小計	銘柄数	8銘柄					
	金 額			56,061	71,697	1,198,067		
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	千ノルウェー・クローネ 8,204	千ノルウェー・クローネ 8,555	100,617	2023/05/24	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,448	52,310	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	5,395	5,693	66,950	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,508	41,258	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,450	3,687	43,368	2027/02/17	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,828	45,026	2028/04/26	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	4,166	48,997	2029/09/06	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	4,800	5,045	59,329	2030/08/19	
	通貨小計	銘柄数	8銘柄					
	金 額			36,634	38,933	457,858		
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	千スウェーデン・クローネ 4,655	千スウェーデン・クローネ 7,308	89,314	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	8,962	109,521	2022/06/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	8,025	8,471	103,526	2023/11/13	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,595	8,570	104,735	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	7,723	94,377	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,550	4,869	59,510	2028/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	7,400	7,977	97,484	2029/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	3,000	3,041	37,172	2031/05/12	
	通貨小計	銘柄数	8銘柄					
	金 額			50,870	56,926	695,644		

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		
				%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円		
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	20,290	20,912	108,537	2026/03/05	
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	18,300	20,526	106,533	2047/11/07	
		Mexican Bonos	国債証券	7.2500	29,000	29,831	154,825	2021/12/09	
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	23,800	26,462	137,339	2024/09/05	
		Mexican Bonos	国債証券	6.7500	7,200	7,556	39,216	2023/03/09	
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	30,033	32,936	170,939	2023/12/07	
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	23,919	28,453	147,672	2024/12/05	
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	27,968	31,272	162,302	2027/06/03	
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	11,998	62,272	2036/11/20	
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,544	35,381	183,627	2029/05/31	
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	16,894	20,095	104,296	2038/11/18	
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	15,015	17,243	89,492	2031/05/29	
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	28,599	29,485	153,031	2022/06/09	
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	19,654	21,576	111,984	2042/11/13	
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,944	9,069	47,073	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄			307,034	342,802	1,779,145		
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,511	64,109	2027/05/31	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,336	34,124	2030/04/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,668	42,584	2026/04/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,449	37,002	2031/06/30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	875	900	22,998	2022/08/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	791	20,215	2027/03/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	1,036	26,472	2023/03/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,520	38,828	2033/04/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,186	1,271	32,462	2028/06/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	600	691	17,648	2043/09/30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,135	28,982	2024/07/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,877	47,926	2025/09/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161	1,203	30,731	2022/09/30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,349	34,454	2035/05/31	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,302	1,364	34,825	2023/08/17	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	1,030	26,304	2046/03/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650	702	17,942	2026/11/30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	352	358	9,163	2021/11/30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,600	1,645	41,999	2022/03/10	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	750	804	20,530	2024/09/30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,291	32,978	2027/11/16	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,050	1,229	31,393	2037/04/07	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,284	32,782	2025/03/14	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	2,500	2,611	66,665	2023/04/20	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,372	35,039	2033/11/07	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	600	710	18,126	2038/06/08	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	700	17,892	2026/07/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,910	2,065	52,744	2029/08/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,351	34,493	2048/07/06	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400	419	10,713	2024/06/14	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,354	34,577	2034/07/05	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,786	45,621	2040/05/22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	700	699	17,870	2050/06/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	500	496	12,675	2031/04/15		
通貨小計	銘柄数 金 額	34銘柄			39,094	42,024	1,072,884		

			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	
				%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	2,309	2,547	70,594	2022/09/23
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,377	4,835	133,989	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	3,520	97,541	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,320	3,424	94,895	2022/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,850	4,051	112,267	2023/01/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,870	3,101	85,931	2024/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840	5,517	152,892	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,400	3,666	101,594	2024/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	—	3,200	3,198	88,629	2022/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.7500	1,000	1,013	28,097	2025/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.2500	1,300	1,302	36,102	2030/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	1,154	31,978	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,625	2,924	81,030	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,650	4,125	114,320	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,591	5,186	143,717	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金 額			45,329	49,569	1,373,582		
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (アイルランド)		IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,031	1,300	161,763	2025/03/13
		IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	624	690	85,861	2023/03/20
		IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	689	85,701	2024/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	961	1,213	150,888	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.8000	516	525	65,409	2022/03/15
		IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	881	1,260	156,765	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,166	145,065	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	703	87,541	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	—	350	354	44,095	2022/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	881	109,582	2028/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	750	888	110,469	2033/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	450	526	65,474	2031/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	1,200	1,352	168,245	2029/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	600	798	99,341	2050/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	250	266	33,184	2035/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	836	104,018	2027/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	500	524	65,211	2030/10/18
国 小 計	銘柄数	17銘柄						
	金 額			11,943	13,978	1,738,620		
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (オランダ)		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	548	645	80,247	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,139	1,648	204,993	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,685	2,897	360,335	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	867	107,864	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,779	3,332	414,497	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,508	187,604	2022/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,593	198,247	2033/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,477	183,713	2023/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,579	2,830	352,104	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,666	207,246	2024/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,872	232,958	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,638	1,749	217,606	2026/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,209	150,476	2022/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,407	299,459	2027/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,432	178,227	2024/01/15

外国債券インデックスマザーファンド

区 分			銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	未 評 価 額		償還年月日			
							外 貨 建 金 額	邦貨換算金額				
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	千ユーロ 1,150	千ユーロ 1,272	千円 158,233	2028/07/15			
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,286	160,030	2029/07/15			
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	1,033	128,512	2040/01/15			
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,994	248,022	2030/07/15			
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	832	103,540	2027/01/15			
			NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	600	620	77,223	2052/01/15			
国 小 計	銘柄数	21銘柄										
	金 額					27,805	34,178	4,251,147				
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 1,815	225,803	2025/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	2,026	252,110	2031/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	1,412	175,646	2038/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	2,283	2,493	310,129	2026/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	1,667	207,454	2047/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	640	1,098	136,642	2066/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	1,490	1,529	190,279	2023/10/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,400	1,529	190,207	2027/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,099	136,799	2024/10/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	780	1,281	159,385	2057/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	400	498	62,057	2037/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,340	1,477	183,749	2028/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	850	1,012	125,900	2033/04/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,678	208,741	2029/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	600	835	103,921	2050/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,278	159,010	2030/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	660	698	86,924	2040/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,246	155,060	2027/10/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,478	308,236	2028/03/28			
			Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	2,104	3,686	458,506	2035/03/28			
			Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	877	932	115,934	2022/03/28			
			Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	2,937	365,392	2041/03/28			
			Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,280	159,208	2026/03/28			
			Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,436	178,729	2022/09/28			
			Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	1,167	145,273	2032/03/28			
			Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,441	179,263	2023/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	843	1,556	193,604	2045/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,684	209,578	2024/06/22			
			Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	1,074	133,693	2034/06/22			
			国 小 計	銘柄数	29銘柄							
				金 額					35,009	44,357	5,517,247	
			ユーロ（フランス）			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	千ユーロ 1,985	千ユーロ 2,428	302,072	2023/04/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000				3,025	4,033	501,630	2025/10/25			
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000				3,323	5,031	625,824	2029/04/25			
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500				2,927	5,073	631,083	2032/10/25			
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500				2,659	4,574	569,001	2035/04/25			
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000				1,764	3,853	479,249	2055/04/25			
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000				2,374	4,104	510,503	2038/10/25			
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500				4,097	4,696	584,188	2023/10/25			
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000				3,564	6,786	844,064	2041/04/25			
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000				1,717	3,983	495,413	2060/04/25			
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000				3,146	3,861	480,355	2026/04/25			
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000				3,630	3,819	475,094	2022/04/25			

区 分			当 期		未		償還年月日		
			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		
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	5,199	6,415	797,916	2027/10/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,694	3,905	485,731	2022/10/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,588	4,495	559,096	2045/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,554	442,114	2023/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	5,086	5,617	698,734	2024/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,887	7,540	937,943	2030/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,899	5,385	669,832	2024/11/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,679	457,615	2025/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	5,528	687,681	2025/11/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,920	5,882	731,677	2031/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,787	4,025	500,649	2026/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,869	4,674	581,470	2036/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,287	1,993	247,903	2066/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,800	3,996	497,122	2026/11/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	4,042	502,838	2022/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	3,408	423,979	2039/06/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,753	466,915	2027/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,000	4,401	547,515	2048/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,440	303,524	2023/03/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,400	4,827	600,439	2028/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	4,717	586,819	2034/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	5,453	678,326	2028/11/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,481	433,037	2024/03/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,412	175,629	2022/02/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,750	3,690	459,079	2050/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,250	5,685	707,213	2029/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,130	3,221	400,700	2025/03/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,800	2,907	361,626	2029/11/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,438	303,324	2023/02/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,870	2,098	261,022	2052/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,098	385,356	2026/02/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	1,083	134,730	2040/05/25
			FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,070	257,481	2030/11/25
国 小 計		銘柄数	45銘柄						
		金 額			148,837	183,176	22,783,533		
					千ユーロ	千ユーロ			
ユーロ (ドイツ)		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,189	147,999	2024/01/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,741	216,650	2027/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	3,167	393,998	2028/01/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,357	168,895	2028/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	3,219	400,477	2030/01/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,448	5,647	702,454	2031/01/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,405	2,446	304,271	2034/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,571	6,208	772,249	2037/01/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	2,510	312,279	2039/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,439	2,939	365,649	2040/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,874	5,185	644,983	2042/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,807	1,862	231,598	2022/01/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,311	287,535	2022/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	4,728	588,082	2044/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,710	212,721	2022/09/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,481	184,319	2023/02/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,920	238,837	2023/05/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,721	214,134	2023/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,690	210,281	2024/02/15	

外国債券インデックスマザーファンド

		当			期			末		
区 分		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価		額	償還年月日	
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			
				%	千ユーロ	千ユーロ		千円		
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,979	5,158		641,558	2046/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,722		214,213	2024/05/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,042	4,315		536,764	2024/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,315		287,985	2025/02/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,134	3,402		423,197	2025/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,368	2,528		314,527	2026/02/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,527		314,421	2026/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	6,200	6,595		820,409	2027/02/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,496		310,473	2027/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,370	3,358		417,721	2048/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	2,071		257,628	2028/02/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,400	4,730		588,350	2028/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,371		295,012	2029/02/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,174		394,849	2029/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,846		229,701	2050/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,852		230,435	2030/02/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,328		289,591	2035/05/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,101		261,329	2027/11/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	741		92,168	2030/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,273		158,369	2030/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	806		100,250	2021/12/10	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	302		37,664	2022/03/11	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101		12,579	2022/06/10	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101		12,606	2022/09/16	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,160	1,171		145,733	2022/04/08	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	2,129		264,927	2022/10/07	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,730	5,838		726,145	2023/04/14	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,943		241,792	2023/10/13	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,971		245,204	2024/04/05	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,752		217,956	2024/10/18	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,482		308,789	2025/04/11	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,387		296,999	2025/10/10	
国 小 計	銘柄数	51銘柄								
	金 額				107,345	130,943		16,286,782		
ユーロ (スペイン)		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	3,984		495,598	2029/01/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	2,234		277,974	2025/04/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	2,435		302,957	2030/07/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,474		307,789	2025/10/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	3,083		383,485	2026/04/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	2,927		364,165	2046/10/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	2,827		351,712	2066/07/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	3,030	3,329		414,181	2026/10/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	2,080	2,109		262,391	2022/04/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	2,123		264,070	2027/04/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	2,200	2,777		345,405	2033/07/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	2,290		284,877	2027/10/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,600	1,632		203,051	2022/10/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	2,124		264,243	2028/04/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,300	1,910		237,669	2048/10/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	2,400	2,458		305,804	2023/07/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	2,130		264,957	2028/07/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	1,700	1,709		212,655	2021/10/31	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,600	2,938		365,528	2029/04/30	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,050	2,482		308,733	2035/07/30	

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
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,367	294,410
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,962	368,501
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,360	1,424	177,171
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,460	2,494	310,224
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,529	190,279
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,200	1,242	154,572
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,569	319,554
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,900	3,241	403,239
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	900	996	123,938
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	3,261	405,679
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,854	2,954	367,519
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	2,158	3,906	485,844
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	1,969	245,000
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	2,473	4,434	551,558
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,189	2,717	338,058
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,671	332,261
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,126	264,536
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	1,958	2,214	275,402
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	2,179	271,029
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,515	312,852
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	2,566	319,167
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,265	281,746
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,367	294,515
国 小 計	銘柄数	43銘柄					
	金 額				86,979	106,965	13,304,319
					千ユーロ	千ユーロ	
ユーロ (イタリア)		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,906	2,428	302,008
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,577	196,257
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,414	424,642
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	2,007	249,735
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	2,126	264,508
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,629	1,669	207,658
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,666	331,635
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	2,284	284,131
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,891	2,083	259,169
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,555	193,448
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	2,077	258,454
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,359	1,400	174,209
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,786	1,938	241,155
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	2,754	342,572
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	1,141	141,922
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	1,550	1,593	198,260
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,358	1,368	170,230
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	1,288	160,307
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,798	223,716
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,705	212,148
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,394	173,441
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	2,050	2,095	260,682
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,850	2,710	337,117
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,700	3,028	376,712
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,700	1,738	216,264
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,703	211,883
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,686	209,823
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	2,358	293,296

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	0.9500	1,900	1,957	243,499	2023/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,389	172,850	2025/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,050	3,638	452,586	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	2,200	2,374	295,384	2023/10/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,744	217,032	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,684	209,461	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,250	1,967	244,680	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,550	1,587	197,423	2022/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	2,318	288,388	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,200	2,354	292,897	2024/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	2,100	2,339	290,930	2026/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	1,250	1,660	206,574	2040/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	2,050	255,003	2030/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	740	747	92,959	2023/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,300	1,327	165,063	2025/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,449	304,709	2027/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,800	2,235	278,108	2050/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,603	199,504	2036/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,000	2,049	254,946	2023/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,300	2,502	311,268	2025/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	2,081	258,946	2030/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,400	2,654	330,199	2030/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3000	1,300	1,322	164,499	2023/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,700	1,780	221,508	2027/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	819	101,984	2026/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,400	1,539	191,438	2041/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,300	1,339	166,638	2031/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	12,538	2024/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	800	845	105,110	2051/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,754	3,912	486,684	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,399	547,211	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,852	354,786	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	3,522	438,127	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	3,943	490,515	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	3,375	419,857	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,560	318,493	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,581	321,103	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	3,740	465,267	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,555	317,906	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,150	267,514	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	2,657	2,934	364,943	2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,960	2,183	271,612	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	3,222	400,773	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,119	263,590	2023/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	3,079	383,056	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,535	315,324	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,526	314,304	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,838	3,615	449,727	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,637	203,641	2021/12/15
国 小 計	銘柄数	77銘柄					
	金 額			139,894	167,518	20,835,981	
ユーロ (フィンランド)				千ユーロ	千ユーロ		
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	614	688	85,676	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	300	37,354	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	1,111	1,181	147,010	2026/04/15

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	—	200	204	25,396
		Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	496	61,731
		Finland Government Bond	国債証券	—	770	777	96,759
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	860	107,019
		Finland Government Bond	国債証券	1.1250	370	439	54,677
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	541	67,346
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	544	67,708
		Finland Government Bond	国債証券	—	200	205	25,556
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	324	40,409
		Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	427	53,167
		Finland Government Bond	国債証券	—	500	520	64,777
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	813	101,216
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	489	60,843
		Finland Government Bond	国債証券	1.6250	312	325	40,480
		Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	470	58,472
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	651	81,044
		Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	578	71,937
国 小 計	銘柄数	20銘柄					
	金 額				9,664	10,842	1,348,586
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	1,502	186,894
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,220	151,765
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	1,090	135,652
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	409	50,950
		Austria Government Bond	国債証券	—	900	917	114,077
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,780	1,910	237,664
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	1,225	152,459
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	405	50,414
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	900	987	122,878
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	980	1,063	132,311
		Austria Government Bond	国債証券	—	800	820	102,093
		Austria Government Bond	国債証券	—	680	708	88,063
		Austria Government Bond	国債証券	—	1,000	1,017	126,528
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	842	104,810
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	404	50,317
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,209	150,419
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,673	2,878	358,056
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,137	141,423
		Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	845	105,156
		Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	943	117,371
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	831	103,397
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	1,102	137,079
		Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,028	127,899
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	1,054	131,133
		Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,019	126,773
国 小 計	銘柄数	25銘柄					
	金 額				21,268	26,576	3,305,593
通貨小計	銘柄数	328銘柄					
	金 額				588,744	718,538	89,371,812
合 計	銘柄数	810銘柄					
	金 額						215,573,016

(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

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	215,573,016	98.5
コール・ローン等、その他	3,336,412	1.5
投資信託財産総額	218,909,428	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＝103.89円、1カナダ・ドル＝79.95円、1オーストラリア・ドル＝76.91円、1シンガポール・ドル＝77.69円、1イギリス・ポンド＝138.55円、1イスラエル・シェケル＝31.34円、1デンマーク・クローネ＝16.71円、1ノルウェー・クローネ＝11.76円、1スウェーデン・クローネ＝12.22円、1メキシコ・ペソ＝5.19円、1マレーシア・リンギット＝25.53円、1ポーランド・ズロチ＝27.71円、1ユーロ＝124.38円です。
- (注3) 当期末における外貨建純資産（217,489,673千円）の投資信託財産総額（218,909,428千円）に対する比率は、99.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	221,017,451,889円
コール・ローン等	2,032,950,395
公社債（評価額）	215,573,016,059
未収入金	2,130,088,310
未収利息	1,222,948,097
前払費用	58,449,028
(B)負債	2,181,996,278
未払金	2,110,180,468
未払解約金	71,815,810
(C)純資産総額（A－B）	218,835,455,611
元本	72,688,498,430
次期繰越増益金	146,146,957,181
(D)受益権総口数	72,688,498,430口
1万口当り基準価額（C／D）	30,106円

- *期首における元本額は66,118,107,712円、当作成期間中における追加設定元本額は13,500,674,811円、同解約元本額は6,930,284,093円です。
- *当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国債券インデックスV A601,675,980円、ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募）12,401,222円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募）102,686,952円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）29,631,947円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）339,511,943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）90,339,707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）462,489,583円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）1,814,096,236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）654,015,808円、D－I’s 外国債券インデックス1,055,376円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 957,155円、iFree 外国債券インデックス691,990,376円、iFree 8資産バランス989,492,660円、iFree 年金バランス49,115,601円、DCダイワ外国債券インデックス48,408,053,236円、ダイワ・ライフ・バランス30 819,754,500円、ダイワ・ライフ・バランス50

- 459,770,424円、ダイワ・ライフ・バランス70 279,428,323円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）459,816,979円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）336,784,366円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）108,589,082円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 8,547,742円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 19,902,336円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 4,844,467円、ダイワつみたてインデックス外国債券163,786,187円、ダイワつみたてインデックスバランス30 3,047,233円、ダイワつみたてインデックスバランス50 977,653円、ダイワつみたてインデックスバランス70 951,206円、ダイワ世界バランスファンド40VA174,483,363円、ダイワ世界バランスファンド60VA131,594,279円、ダイワ・バランスファンド35VA4,234,846,474円、ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）250,419,145円、ダイワ・インデックスセレクト 外国債券142,610,494円、ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド34,513,413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）4,864,458,623円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5,832,536,410円、ダイワライフスタイル2533,396,711円、ダイワライフスタイル50 59,767,812円、ダイワライフスタイル75 16,157,426円です。
- *当期末の計算口数当りの純資産額は30,106円です。

■損益の状況

当期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

項 目	当 期
(A)配当等収益	4,034,330,893円
受取利息	4,037,282,101
支払利息	△ 2,951,208
(B)有価証券売買損益	4,567,605,912
売買益	11,533,587,280
売買損	△ 6,965,981,368
(C)その他費用	△ 33,084,010
(D)当期損益金（A＋B＋C）	8,568,852,795
(E)前期繰越増益金	124,346,492,561
(F)解約差損益金	△ 13,361,915,838
(G)追加信託差損益金	26,593,527,663
(H)合計（D＋E＋F＋G）	146,146,957,181
次期繰越増益金（H）	146,146,957,181

- (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。