

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

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

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

運用報告書(全体版)  
第15期

(決算日 2021年1月12日)

(作成対象期間 2020年1月11日~2021年1月12日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、内外の債券、リート(不動産投資信託)および株式に投資し、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

お問い合わせ先(コールセンター)

TEL 0120-106212

(営業日の9:00~17:00)

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

<3719>

<3720>

<3721>

## DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			合成指数		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	投資信託証券組入比率	不動産投資先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率						
11期末(2017年1月10日)	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
12期末(2018年1月10日)	15,563	0	4.9	16,490	7.1	17.5	-	49.7	29.7	-	2,765
13期末(2019年1月10日)	16,400	0	5.4	17,340	5.2	17.7	0.5	49.9	28.8	-	3,190
14期末(2020年1月10日)	15,715	0	△ 4.2	16,858	△ 2.8	16.8	-	50.7	29.0	-	3,597
15期末(2021年1月10日)	17,628	0	12.2	19,069	13.1	18.0	-	50.3	28.9	0.3	4,925
15期末(2021年1月12日)	17,702	0	0.4	19,048	△ 0.1	19.0	-	49.4	28.6	0.4	5,838

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

投資対象資産	指数	配分比率
海外債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	25%
国内債券	NOMURA-BPI総合指数	25%
海外リート	S&P先進国REIT指数 (除く日本)	15%
国内リート	東証REIT指数 (配当込み)	15%
海外株式	MSCIコクサイ指数 (グロス配当込み)	10%
国内株式	TOPIX (配当込み)	10%

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

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

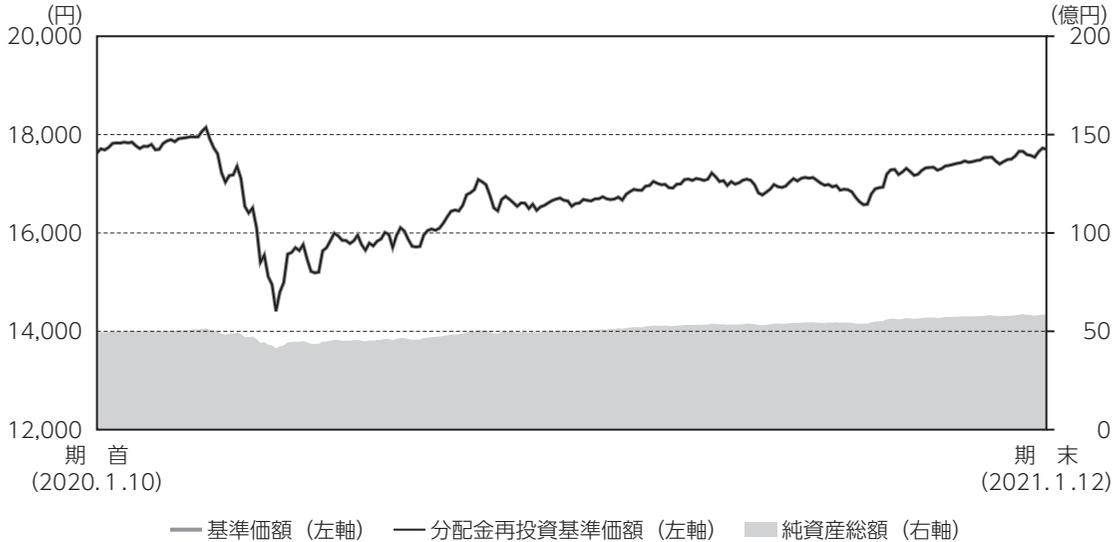
(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。

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



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：17,628円

期末：17,702円（分配金0円）

騰落率：0.4%（分配金込み）

#### ■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国債券インデックスマザーファンド	5.0%	24.4%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)	△0.7%	24.4%
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	△4.6%	14.7%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	△9.8%	15.0%
ダイワ北米好配当株マザーファンド	9.3%	7.7%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	0.3%	2.1%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	28.5%	0.4%
ダイワ好配当日本株マザーファンド	2.6%	10.4%

#### ■ 基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、海外の債券や内外の株式の価格上昇がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)

年 月 日	基 準 価 額		合 成 指 数		株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 組 入 比 率	投資信託 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率					
(期首)2020年 1 月10日	円 17,628	% -	19,069	% -	% 18.0	% -	% 50.3	% 28.9	% 0.3
1 月末	17,800	1.0	19,262	1.0	17.7	-	50.1	29.2	0.2
2 月末	17,228	△ 2.3	18,629	△ 2.3	16.6	-	52.7	27.4	0.6
3 月末	15,762	△10.6	16,845	△11.7	17.4	-	47.5	30.6	0.5
4 月末	16,010	△ 9.2	17,177	△ 9.9	18.1	-	47.6	30.3	0.4
5 月末	16,466	△ 6.6	17,663	△ 7.4	18.2	-	47.4	30.6	0.4
6 月末	16,531	△ 6.2	17,735	△ 7.0	17.6	-	49.1	29.2	0.4
7 月末	16,669	△ 5.4	17,838	△ 6.5	17.1	-	50.2	28.8	0.4
8 月末	17,093	△ 3.0	18,329	△ 3.9	17.9	-	49.4	29.1	0.4
9 月末	16,941	△ 3.9	18,175	△ 4.7	17.2	-	50.3	28.7	0.4
10月末	16,574	△ 6.0	17,776	△ 6.8	17.5	-	50.8	28.3	0.4
11月末	17,277	△ 2.0	18,667	△ 2.1	18.3	-	49.3	29.1	0.4
12月末	17,658	0.2	19,016	△ 0.3	18.2	-	49.1	29.2	0.4
(期末)2021年 1 月12日	17,702	0.4	19,048	△ 0.1	19.0	-	49.4	28.6	0.4

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2020.1.11～2021.1.12)

### ■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感染拡大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のリスクに対する市場心理の改善がなされ、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て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が、2021年に入り、米国の財政拡大観測の高まりなどから金利は上昇しました。

### ■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。

### ■海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

米国では、2020年2月下旬に新型コロナウイルスの感染拡大が嫌気され、大幅下落となりました。4月以降は、感染者増加ペースの鈍化による経済活動の再開や、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展などを受けて反発しました。欧州では、感染者増加が懸念されたイタリアやフランスを中心に下落しました。アジア・オセアニアでは、商業施設リートを中心に香港が下落しました。

### ■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2020年2月中旬までは、新型コロナウイルスの感染拡大により投資家が緩やかなリスク回避姿勢となる中で資金逃避先となり、上昇しました。2月下旬以降は、感染拡大による業績悪化懸念や投資家のリスク回避姿勢の強まりを受けて下落に転じました。3月中旬には、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。その後5月までは、感染状況に左右されて変動が大きい推移ながら、各国の金融・財政政策の発表や割安な水準に注目した買いなどにより反発しました。6月から11月までは、

新規感染者数と市場のリスク選好姿勢に応じて一進一退の動きで、おおむね横ばい圏での推移が続きました。夏以降に公募増資が再開されたことは需給面で上値を抑えました。12月以降は、公募増資が一段落したことや、9月に続いてF T S Eグローバル株式指数における国内リートの組入比率が引き上げられたことなどにより需給が改善し、上昇して当作成期末を迎えました。

## ■海外株式市況

### ・北米

北米株式市況は上昇しました。

北米株式市況は、当作成期首から2020年2月中旬にかけて堅調に推移した後、新型コロナウイルスの感染が中国以外の国々にまで拡大したことや原油価格が急落したことなどを受け、3月中旬にかけて下落基調となりました。8月にかけては、各国・地域の政府および中央銀行が大胆な支援策を講じたこと、各国が段階的に経済活動を再開する中で景気回復への期待が高まったことなどが支援材料となり、上昇しました。10月にかけては、これまでの株価上昇による高値警戒感に加え、欧州などで感染が再拡大したことなどを受けて下落しました。当作成期末にかけては、米国の大統領選挙で民主党のバイデン候補が勝利を確実にして米国政治を巡る不透明感が後退したとの見方や、新型コロナウイルスワクチンが早期に実用化されるとの観測などを背景に、上昇基調で推移しました。

米国ハイブリッド優先証券市況は上昇しました。

米国ハイブリッド優先証券市況は、当作成期首から2020年2月中旬にかけて緩やかな上昇基調で推移しました。3月中旬にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大や原油価格の急落などを受けて下落しました。その後は、当作成期末にかけて、F R B（米国連邦準備制度理事会）が無制限の量的緩和政策を含めた流動性供給策を実施したことで市場に落ち着きが見られたことや、低金利環境が継続する中で相対的に高い利回り資産への需要が高まったことなどが支援材料となり、上昇基調で推移しました。

### ・欧州

欧州株式市況は下落しました。

新型コロナウイルスの感染拡大を受け、2020年2月後半から3月中旬にかけての欧州株式市場は大幅に下落しました。その後、E C B（欧州中央銀行）による大規模な金融緩和策の実施や、欧州各国における段階的な経済活動の再開を受けた景気回復期待などから反発しました。4月以降は底堅い推移が続きましたが、8月後半ころより欧州域内で感染が再拡大したほか、9月に入り、米国のハイテク株中心に高値警戒感から売りが強まったこと、米国大統領選挙を控えて政治を巡る不透明感が高まったことなどから、10月末にかけて、欧州株式市場は一時弱含みしました。米国大統領選挙終了後は、政治リスクの後退や新型コロナウイルスのワクチン開発への期待から投資家のリスク回避姿勢が後退し、欧州株式市場は上昇に転じましたが、当作成期首の水準には届きませんでした。

## ・アジア・オセアニア

アジア・オセアニア株式市況は上昇しました。

アジア・オセアニア株式市況は、2020年1月下旬から3月にかけて、世界的に新型コロナウイルスが感染拡大していく中で世界経済減速懸念が強まり、大幅に下落しました。4月以降は、各国の金融緩和策および大規模な景気刺激策を好感して反発しました。その後も、米中対立懸念や感染再拡大が重しとなる局面もありましたが、新型コロナウイルスのワクチン開発への進展期待や経済正常化への期待により、上昇が続きました。11月に米国大統領選挙が終了すると投資家のリスク選好が強まり、12月には欧米を中心にワクチン接種が始まったことを受け、一段と上昇して当作成期末を迎えました。

## ■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、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、下落しました。2020年2月後半以降は、欧米に続いて国内においても感染拡大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や、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。10月に入ると、欧州において感染拡大が再び目立ち始め、行動制限措置の再導入および強化が行われたことが嫌気され、株価は下落しました。しかし11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通り当選確実となり、選挙に対する不確実性が後退したことや、欧米において複数の新型コロナウイルスのワクチンが承認されて接種が始まったことを好感し、株価は上昇しました。

## ■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（円高）しました。

対円為替相場は、当作成期首より、新型コロナウイルスの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。2020年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巡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。12月は、EU（欧州連合）と英国との通商交渉が合意に達したことなどから、ユーロや英ポンドが上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

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

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

… 3 ファンド合計で純資産総額の10% (\*)

\* 外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

### ■外国債券インデックスマザーファンド

今後も、ファンドの通貨の比率をベンチマーク (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。

### ■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 (NOMURA - 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・グローバル R E I T ・マザーファンド

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

### ■ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

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

### ■ダイワ北米好配当株マザーファンド

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

### ■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

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

### ■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

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

### ■ダイワ好配当日本株マザーファンド

世界的な景気指標に依然として回復は見られないものの、米中貿易合意などにより景気の底打ち・回復への期待は醸成されつつあります。国内株式市場は、2020年度の国内企業業績は増益に転じると予想されるなど、次期ベースでの株価指標面に割高感はなく、中期的には下値を徐々に切上げていく展開を想定します。個別銘柄の選別にあたりましては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、中長期的な業績の回復・成長が期待される銘柄や、配当政策・自社株買いなどの株主還元策を向上させる銘柄などに注目してまいります。

※C&S：コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

※アムンディ・アイルランド：アムンディ・アイルランド・リミテッド

## ポートフォリオについて

(2020.1.11~2021.1.12)

## ■当ファンド

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

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

\*外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分しました。

## ■外国債券インデックスマザーファンド

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

## ■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

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

## ■ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド

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

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

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

### ■ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

リートの組入比率につきましては、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本としており、おおむね95~98%台程度で推移させました。また、東証REIT指数先物への投資も行い、先物と合計で95~100%程度で推移させました。リート銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資しました。個別銘柄では、当作成期を通じて見ると、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト、三井不動産ロジパーク、大和ハウスリートなどを東証REIT指数と比較してオーバーウエートとし、日本アコモデーションファンド、日本プロロジスリート、日本ロジスティクスファンド等をアンダーウエートとしました。

### ■ダイワ北米好配当株マザーファンド

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、C&Sに運用の指図にかかる権限を委託しております。有価証券の組入比率は、株式を70~83%程度、ハイブリッド優先証券等を15~23%程度としました。普通株式については、企業のファンダメンタルズやキャッシュフローの成長性、配当利回りやバリュエーション等を考慮し、キャッシュフローを生み出し、魅力的な配当利回りを将来にわたって提供できると考える銘柄を中心としたポートフォリオとしました。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心としたポートフォリオとしました。

### ■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

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

### ■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

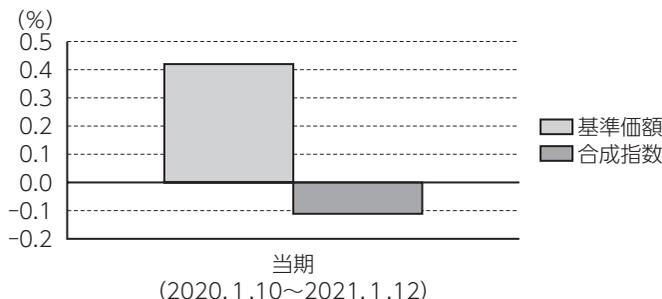
オーストラリアや中国（香港）、台湾、韓国を中心に、高い利益成長が見込まれた銘柄や予想配当利回りが高いと判断された銘柄などを組み入れました。国別では、今後も国内市場の拡大が期待される中国を比較的高位に組み入れました。セクターでは、高い利益成長見込みから一般消費財・サービスや、高い利回りが期待できる生活必需品、コミュニケーション・サービスなどを比較的高位に組み入れました。

### ■ダイワ好配当日本株マザーファンド

株式組入比率（株式先物を含む。）は、当作成期を通して90%程度以上で推移させました。業種構成は、電気機器、化学、その他製品などの比率を引き上げた一方、医薬品、情報・通信業、輸送用機器などの比率を引き下げました。個別銘柄では、業績見通しや配当利回りの水準などを総合的に勘案して、日立、富士フイルムHLDS、AGCなどを買い付けました。一方で、Zホールディングス、三菱商事、アステラス製薬などを売却しました。

## ベンチマークとの差異について

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



## 分配金について

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

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2020年1月11日 ～2021年1月12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)	8,459

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

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

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

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



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

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

\* 外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

### ■外国債券インデックスマザーファンド

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

### ■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

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

### ■ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド

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

### ■ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

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

### ■ダイワ北米好配当株マザーファンド

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

### ■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

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

### ■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

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

### ■ダイワ好配当日本株マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2020.1.11~2021.1.12)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	168円	0.995%	信託報酬=当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は16,839円です。
(投 信 会 社)	(84)	(0.498)	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)	(74)	(0.442)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(9)	(0.055)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	12	0.070	売買委託手数料=当作成期中の売買委託手数料/当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(2)	(0.011)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(ハイブリッド優先証券)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(10)	(0.058)	
有 価 証 券 取 引 税	2	0.011	有価証券取引税=当作成期中の有価証券取引税/当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.002)	
(ハイブリッド優先証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(2)	(0.009)	
そ の 他 費 用	6	0.037	その他費用=当作成期中のその他費用/当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.014)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.008)	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)	(2)	(0.015)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	187	1.113	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

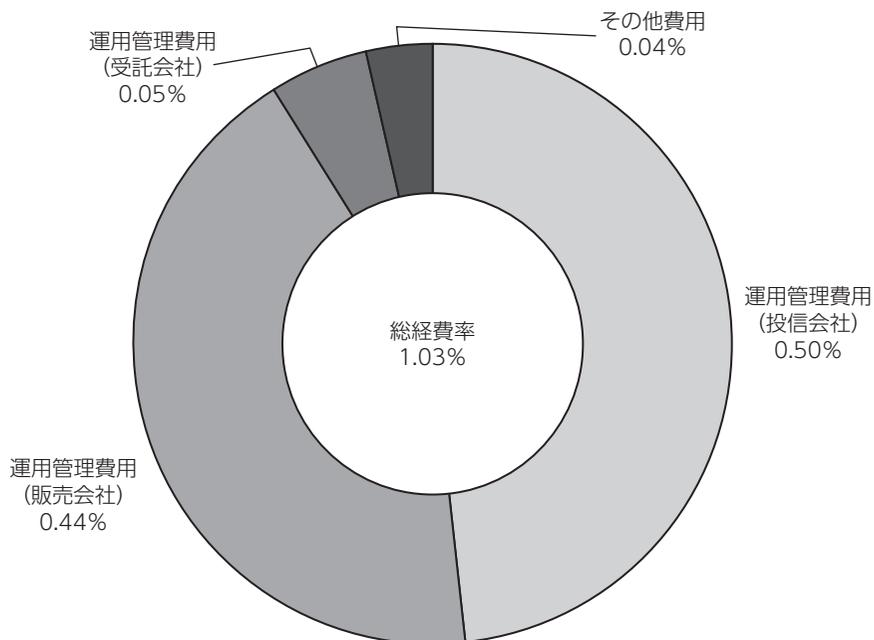
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

## 参考情報

## ■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.03%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

## ■売買および取引の状況

## 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	120,867	359,305	73,107	215,312
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (BPI)	345,674	447,190	181,783	235,798
ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド	89,944	195,408	29,305	75,971
ダイワ好配当日本株 マザーファンド	47,330	117,553	11,762	31,637
ダイワ北米好配当株 マザーファンド	22,495	61,145	6,848	20,996
ダイワ欧州好配当株 マザーファンド	18,345	26,110	11,870	18,881
ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド	1,428	2,526	2,592	5,413
ダイワJ-REIT アクティブ・マザーファンド	114,597	289,191	38,934	104,959

(注) 単位未満は切捨て。

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

項 目	当 期
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	8,686,609千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	14,330,547千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.60
	ダイワ北米好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	3,062,294千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,134,420千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.43
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	233,748千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,144,337千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.20
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	1,361,808千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	641,191千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.12

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■利害関係人との取引状況等

## (1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2020年1月11日から2021年1月12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						
公社債	百万円 9,319	百万円 172	% 1.8	百万円 4,238	百万円 100	% 2.4
コール・ローン	39,992	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合5.7%

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

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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2020年1月11日から2021年1月12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 3,838	百万円 957	% 24.9	百万円 4,848	百万円 1,213	% 25.0
コール・ローン	121,060	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合3.4%

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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
投資信託証券	百万円 94,399	百万円 28,244	% 29.9	百万円 98,494	百万円 27,541	% 28.0
不動産投信 指数先物取引	15,662	-	-	14,007	-	-
コール・ローン	723,702	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合0.9%

## (10) 利害関係人の発行する有価証券等

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

種 類	当 期		
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
その他有価証券	百万円 -	百万円 1,965	百万円 1,259

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

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

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

種 類	当 期	
	買	付 額
投資信託証券	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド 百万円 5,473	
公社債	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI) 百万円 100	

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

## (12) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	3,601千円
うち利害関係人への支払額 (B)	812千円
(B)/(A)	22.6%

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

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、大和証券オフィス投資法人、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	口 数	評 価 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 423,869	千口 471,628	千円 1,425,639	
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	937,929	1,101,820	1,421,899	
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	265,291	325,929	859,412	
ダイワ好配当日本株マザーファンド	168,401	203,970	604,485	
ダイワ北米好配当株マザーファンド	116,753	132,401	448,919	
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	64,007	70,482	123,922	
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	10,299	9,134	24,717	
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	223,340	299,003	878,681	

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2021年1月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックスマザーファンド	千円 1,425,639	% 24.3
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,421,899	24.2
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	859,412	14.6
ダイワ好配当日本株マザーファンド	604,485	10.3
ダイワ北米好配当株マザーファンド	448,919	7.6
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	123,922	2.1
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	24,717	0.4
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	878,681	15.0
コール・ローン等、その他	87,130	1.5
投資信託財産総額	5,874,808	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、1月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=104.23円、1カナダ・ドル=81.56円、1オーストラリア・ドル=80.34円、1香港ドル=13.44円、1シンガポール・ドル=78.36円、1ニュージーランド・ドル=74.76円、1台湾ドル=3.72円、1イギリス・ポンド=140.94円、1イスラエル・シェケル=32.85円、1スイス・フラン=117.09円、1デンマーク・クローネ=17.04円、1ノルウェー・クローネ=12.22円、1スウェーデン・クローネ=12.56円、1メキシコ・ペソ=5.20円、100韓国ウォン=9.50円、1オフショア人民元=16.10円、1マレーシア・リンギット=25.70円、1ポーランド・ズロチ=27.99円、1ユーロ=126.73円です。

(注3) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(212,973,631千円)の投資信託財産総額(214,168,531千円)に対する比率は、99.4%です。  
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(74,013,575千円)の投資信託財産総額(74,370,943千円)に対する比率は、99.5%です。  
ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(3,186,323千円)の投資信託財産総額(3,211,398千円)に対する比率は、99.2%です。  
ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(1,291,090千円)の投資信託財産総額(1,304,793千円)に対する比率は、98.9%です。  
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(761,332千円)の投資信託財産総額(765,672千円)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

2021年1月12日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>5,874,808,618円</b>
コール・ローン等	81,799,886
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,425,639,461
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド(B P I)(評価額)	1,421,899,694
ダイワ・グローバル R E I T・ マザーファンド(評価額)	859,412,081
ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額)	604,485,726
ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額)	448,919,552
ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額)	123,922,459
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド(評価額)	24,717,268
ダイワ J-R E I T アクティブ・ マザーファンド(評価額)	878,681,491
未収入金	5,331,000
<b>(B) 負債</b>	<b>36,058,044</b>
未払解約金	8,379,643
未払信託報酬	27,449,742
その他未払費用	228,659
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>5,838,750,574</b>
元本	3,298,446,758
次期繰越損益金	2,540,303,816
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>3,298,446,758口</b>
<b>1万口当り基準価額(C/D)</b>	<b>17,702円</b>

\* 期首における元本額は2,794,039,123円、当作成期間中における追加設定元本額は963,521,848円、同解約元本額は459,114,213円です。  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は17,702円です。

## ■損益の状況

当期 自2020年1月11日 至2021年1月12日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 21,274円</b>
受取利息	1,695
支払利息	△ 22,969
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>151,013,197</b>
売買益	197,835,277
売買損	△ 46,822,080
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 51,409,914</b>
<b>(D) 当期損益金(A + B + C)</b>	<b>99,582,009</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>695,181,391</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>1,745,540,416</b>
(配当等相当額)	( 1,995,605,114)
(売買損益相当額)	(△ 250,064,698)
<b>(G) 合計(D + E + F)</b>	<b>2,540,303,816</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>2,540,303,816</b>
追加信託差損益金	1,745,540,416
(配当等相当額)	( 1,995,605,114)
(売買損益相当額)	(△ 250,064,698)
分配準備積立金	794,784,674
繰越損益金	△ 21,274

(注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。  
(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。  
(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。  
(注4) 投資信託財産(親投資信託)の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用: 6,401,998円(未監査)

## ■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	99,590,309
(c) 収益調整金	1,995,605,114
(d) 分配準備積立金	695,194,365
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	2,790,389,788
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e - f)	2,790,389,788
(h) 受益権総口数	3,298,446,758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。

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

## DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			合成指数		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	投資信託証券組入比率	不動産投資先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率						
11期末(2017年1月10日)	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
12期末(2018年1月10日)	16,276	0	6.7	16,872	9.4	28.9	-	34.7	32.9	-	3,346
13期末(2019年1月10日)	17,554	0	7.9	18,170	7.7	29.4	0.8	34.4	31.9	-	3,894
14期末(2020年1月10日)	16,467	0	△ 6.2	17,381	△ 4.3	28.0	-	35.4	32.3	-	4,290
15期末(2021年1月10日)	18,888	0	14.7	20,196	16.2	29.9	-	34.8	32.1	0.3	5,783
15期末(2021年1月12日)	18,830	0	△ 0.3	20,272	0.4	31.3	-	34.0	31.5	0.5	6,484

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

投資対象資産	指数	配分比率
海外債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	16.7%
国内債券	NOMURA-BPI総合指数	16.7%
海外リート	S&P先進国REIT指数 (除く日本)	16.7%
国内リート	東証REIT指数 (配当込み)	16.7%
海外株式	MSCIコクサイ指数 (グロス配当込み)	16.7%
国内株式	TOPIX (配当込み)	16.7%

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

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

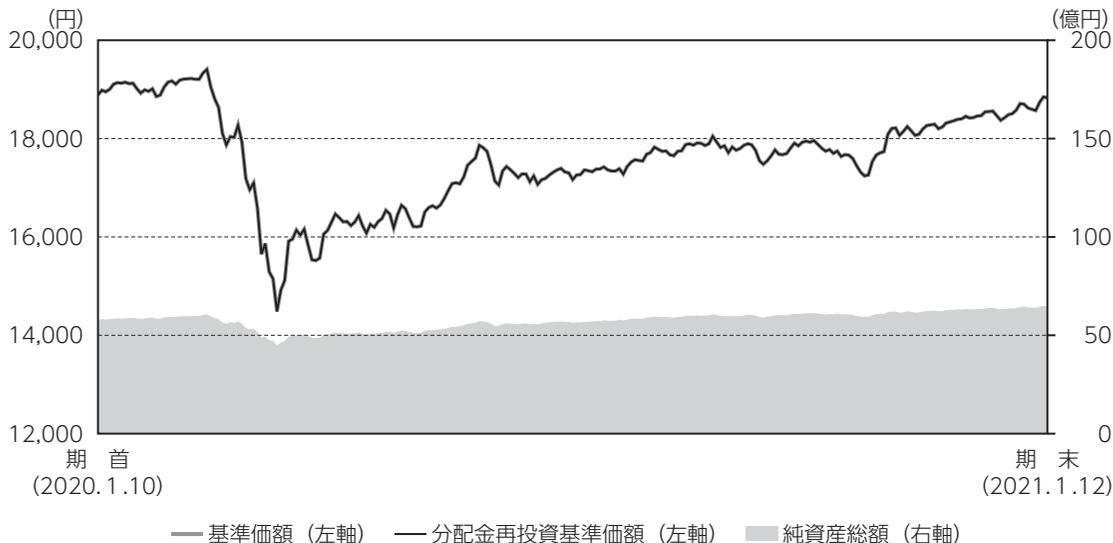
(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。

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



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：18,888円

期末：18,830円 (分配金0円)

騰落率：△0.3% (分配金込み)

#### ■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国債券インデックスマザーファンド	5.0%	16.3%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)	△0.7%	16.2%
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	△4.6%	16.1%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	△9.8%	16.6%
ダイワ北米好配当株マザーファンド	9.3%	12.7%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	0.3%	3.5%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	28.5%	0.7%
ダイワ好配当日本株マザーファンド	2.6%	17.1%

#### ■ 基準価額の主な変動要因

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

DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／6分散コース)

年 月 日	基 準 価 額		合 成 指 数 (参考指数)	指 数		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	公 社 債 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率		騰 落 率	騰 落 率					
(期首)2020年 1 月10日	円 18,888	% -	20,196	% -	% 29.9	% -	% 34.8	% 32.1	% 0.3	
1 月末	19,013	0.7	20,350	0.8	29.6	-	34.7	32.5	0.2	
2 月末	18,102	△ 4.2	19,340	△ 4.2	28.3	-	37.1	31.0	0.6	
3 月末	16,156	△14.5	17,111	△15.3	28.0	-	39.5	27.6	0.4	
4 月末	16,541	△12.4	17,643	△12.6	29.1	-	37.7	28.7	0.4	
5 月末	17,102	△ 9.5	18,281	△ 9.5	29.5	-	35.6	30.8	0.4	
6 月末	17,162	△ 9.1	18,357	△ 9.1	28.8	-	35.0	31.3	0.4	
7 月末	17,277	△ 8.5	18,438	△ 8.7	28.5	-	35.2	32.1	0.4	
8 月末	17,904	△ 5.2	19,181	△ 5.0	29.5	-	34.3	32.2	0.5	
9 月末	17,681	△ 6.4	18,959	△ 6.1	28.7	-	34.9	32.0	0.4	
10月末	17,242	△ 8.7	18,470	△ 8.5	29.2	-	35.4	31.6	0.4	
11月末	18,201	△ 3.6	19,707	△ 2.4	30.3	-	34.1	31.9	0.5	
12月末	18,700	△ 1.0	20,162	△ 0.2	29.9	-	34.1	32.1	0.4	
(期末)2021年 1 月12日	18,830	△ 0.3	20,272	0.4	31.3	-	34.0	31.5	0.5	

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2020.1.11~2021.1.12)

4～6ページをご参照ください。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

## ■当ファンド

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

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

\*外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

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

7～8ページをご参照ください。

## ポートフォリオについて

(2020.1.11~2021.1.12)

## ■当ファンド

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

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

\* 外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分しました。

## ■外国債券インデックスマザーファンド

## ■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

## ■ダイワ・グローバル R E I T・マザーファンド

## ■ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド

## ■ダイワ北米好配当株マザーファンド

## ■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

## ■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

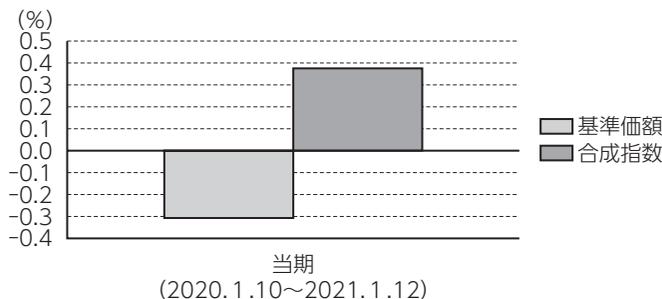
## ■ダイワ好配当日本株マザーファンド

9~10ページをご参照ください。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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



## 分配金について

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

### 分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2020年1月11日 ～2021年1月12日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配可能額	（円）	10,014

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

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

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

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



## 今後の運用方針

### 当ファンド

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

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

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

12～13ページをご参照ください。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2020.1.11~2021.1.12)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	205円	1.161%	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17,614円です。
（投 信 会 社）	(103)	(0.586)	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）	(92)	(0.520)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(10)	(0.055)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	14	0.080	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株 式）	(3)	(0.018)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.001)	
（投資信託証券）	(11)	(0.060)	
有 価 証 券 取 引 税	2	0.013	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)	(0.003)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(2)	(0.010)	
そ の 他 費 用	7	0.040	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(3)	(0.016)	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）	(3)	(0.016)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	228	1.294	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

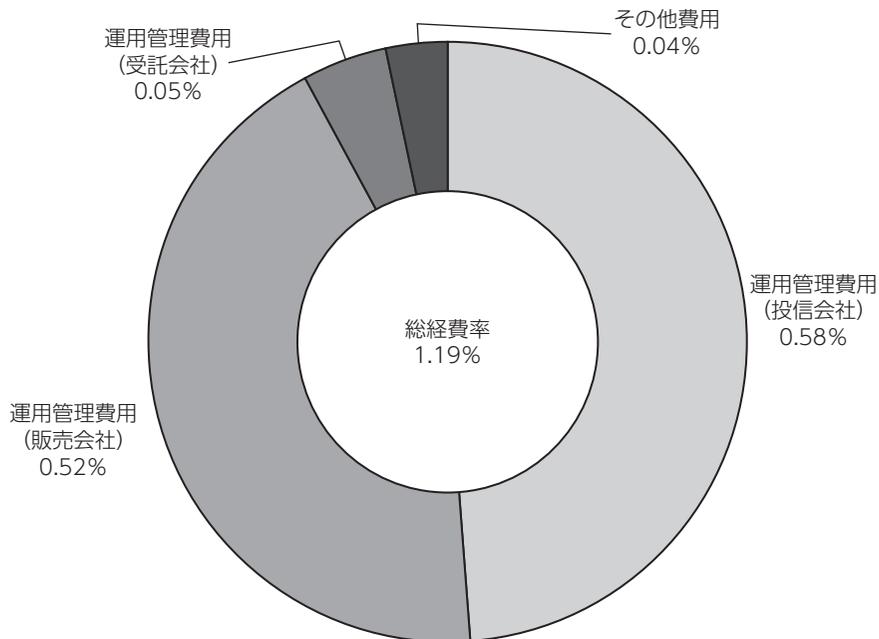
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

## 参考情報

## ■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.19%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

## ■売買および取引の状況

## 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	50,142	150,261	33,083	96,954
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (BPI)	152,299	196,956	69,300	90,137
ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド	91,321	206,900	40,412	104,500
ダイワ好配当日本株 マザーファンド	65,807	170,372	22,216	59,481
ダイワ北米好配当株 マザーファンド	34,447	100,567	19,999	61,825
ダイワ欧州好配当株 マザーファンド	20,649	31,785	17,015	27,259
ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド	1,555	3,083	4,869	10,164
ダイワJ-REIT アクティブ・マザーファンド	98,479	259,683	23,743	68,201

(注) 単位未満は切捨て。

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

項 目	当 期
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	8,686,609千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	14,330,547千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.60
	ダイワ北米好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	3,062,294千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,134,420千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	1.43
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	233,748千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,144,337千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.20
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	1,361,808千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	641,191千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	2.12

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■利害関係人との取引状況等

## (1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2020年1月11日から2021年1月12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						
公社債	百万円 9,319	百万円 172	% 1.8	百万円 4,238	百万円 100	% 2.4
コール・ローン	39,992	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合4.4%

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

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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2020年1月11日から2021年1月12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 3,838	百万円 957	% 24.9	百万円 4,848	百万円 1,213	% 25.0
コール・ローン	121,060	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合6.3%

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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

区 分	当 期		B/A	期		D/C
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B		売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	
投資信託証券	百万円 94,399	百万円 28,244	% 29.9	百万円 98,494	百万円 27,541	% 28.0
不動産投信 指数先物取引	15,662	-	-	14,007	-	-
コール・ローン	723,702	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合1.0%

## (10) 利害関係人の発行する有価証券等

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

種 類	当 期		
	ダイブJ-REITアクティブ・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
投資信託証券	百万円 -	百万円 1,965	百万円 1,259

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

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

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

種 類	当 期	
	買 付 額	期 額
	ダイブJ-REITアクティブ・マザーファンド	
投資信託証券	百万円 5,473	
	ダイブ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。

## (12) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	4,611千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1,023千円
(B)/(A)	22.2%

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

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、大和証券オフィス投資法人、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	口 数	評 価 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 331,858	千口 348,917	千口 1,054,709	
ダイブ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	732,725	815,724	1,052,692	
ダイブ・グローバルREIT・マザーファンド	345,957	396,866	1,046,456	
ダイブ好配当日本株マザーファンド	329,593	373,184	1,105,970	
ダイブ北米好配当株マザーファンド	227,747	242,195	821,186	
ダイブ欧州好配当株マザーファンド	125,547	129,181	227,127	
ダイブ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	20,069	16,756	45,340	
ダイブJ-REITアクティブ・マザーファンド	291,080	365,816	1,075,024	

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2021年1月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	率
外国債券インデックスマザーファンド	千円 1,054,709	% 16.2
ダイブ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,052,692	16.1
ダイブ・グローバルREIT・マザーファンド	1,046,456	16.0
ダイブ好配当日本株マザーファンド	1,105,970	16.9
ダイブ北米好配当株マザーファンド	821,186	12.6
ダイブ欧州好配当株マザーファンド	227,127	3.5
ダイブ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	45,340	0.7
ダイブJ-REITアクティブ・マザーファンド	1,075,024	16.5
コール・ローン等、その他	97,178	1.5
投資信託財産総額	6,525,686	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、1月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=104.23円、1カナダ・ドル=81.56円、1オーストラリア・ドル=80.34円、1香港ドル=13.44円、1シンガポール・ドル=78.36円、1ニュージーランド・ドル=74.76円、1台湾ドル=3.72円、1イギリス・ポンド=140.94円、1イスラエル・シケル=32.85円、1スイス・フラン=117.09円、1デンマーク・クローネ=17.04円、1ノルウェー・クローネ=12.22円、1スウェーデン・クローネ=12.56円、1メキシコ・ペソ=5.20円、100韓国ウォン=9.50円、1オフショア人民元=16.10円、1マレーシア・リンギット=25.70円、1ポーランド・ズロチ=27.99円、1ユーロ=126.73円です。

(注3) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(212,973,631千円)の投資信託財産総額(214,168,531千円)に対する比率は、99.4%です。  
ダイブ・グローバルREIT・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(74,013,575千円)の投資信託財産総額(74,370,943千円)に対する比率は、99.5%です。  
ダイブ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(3,186,323千円)の投資信託財産総額(3,211,398千円)に対する比率は、99.2%です。  
ダイブ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(1,291,090千円)の投資信託財産総額(1,304,793千円)に対する比率は、98.9%です。  
ダイブ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(761,332千円)の投資信託財産総額(765,672千円)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

2021年1月12日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>6,525,686,395円</b>
コール・ローン等	96,603,304
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,054,709,245
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド(B P I)(評価額)	1,052,692,673
ダイワ・グローバルREIT・ マザーファンド(評価額)	1,046,456,561
ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額)	1,105,970,882
ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額)	821,186,529
ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額)	227,127,045
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド(評価額)	45,340,517
ダイワJ-R E I Tアクティブ・ マザーファンド(評価額)	1,075,024,639
未収入金	575,000
<b>(B) 負債</b>	<b>40,885,678</b>
未払解約金	5,017,259
未払信託報酬	35,614,131
その他未払費用	254,288
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>6,484,800,717</b>
元本	3,443,846,915
次期繰越損益金	3,040,953,802
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>3,443,846,915口</b>
<b>1万口当り基準価額(C/D)</b>	<b>18,830円</b>

\*期首における元本額は3,061,995,528円、当作成期間中における追加設定元本額は998,812,762円、同解約元本額は616,961,375円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は18,830円です。

## ■損益の状況

当期 自2020年1月11日 至2021年1月12日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 24,442円</b>
受取利息	2,462
支払利息	△ 26,904
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>168,524,301</b>
売買益	256,375,484
売買損	△ 87,851,183
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 67,355,461</b>
<b>(D) 当期損益金(A + B + C)</b>	<b>101,144,398</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>850,497,928</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>2,089,311,476</b>
(配当等相当額)	( 2,497,179,344)
(売買損益相当額)	(△ 407,867,868)
<b>(G) 合計(D + E + F)</b>	<b>3,040,953,802</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>3,040,953,802</b>
追加信託差損益金	2,089,311,476
(配当等相当額)	( 2,497,179,344)
(売買損益相当額)	(△ 407,867,868)
分配準備積立金	951,666,768
繰越損益金	△ 24,442

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

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

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

(注4) 投資信託財産(親投資信託)の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用: 9,376,726円(未監査)

## ■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	101,146,091
(c) 収益調整金	2,497,179,344
(d) 分配準備積立金	850,520,677
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	3,448,846,112
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e - f)	3,448,846,112
(h) 受益権総口数	3,443,846,915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。

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

## DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			合成指数		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	投資信託証券組入比率	不動産投資先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率						
11期末(2017年1月10日)	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
12期末(2018年1月10日)	16,937	0	9.2	17,287	12.7	43.3	-	13.4	39.2	-	3,374
13期末(2019年1月10日)	18,809	0	11.1	19,164	10.9	43.8	1.2	13.0	38.1	-	4,081
14期末(2020年1月10日)	17,206	0	△ 8.5	17,971	△ 6.2	41.5	-	13.7	39.5	-	4,424
15期末(2021年1月10日)	20,384	0	18.5	21,668	20.6	44.8	-	13.1	38.5	0.4	6,327
15期末(2021年1月12日)	20,216	0	△ 0.8	21,740	0.3	46.5	-	12.4	37.6	0.6	7,237

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

投資対象資産	指数	配分比率
海外債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	5%
国内債券	NOMURA-BPI総合指数	5%
海外リート	S&P先進国REIT指数 (除く日本)	20%
国内リート	東証REIT指数 (配当込み)	20%
海外株式	MSCIコクサイ指数 (グロス配当込み)	25%
国内株式	TOPIX (配当込み)	25%

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

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

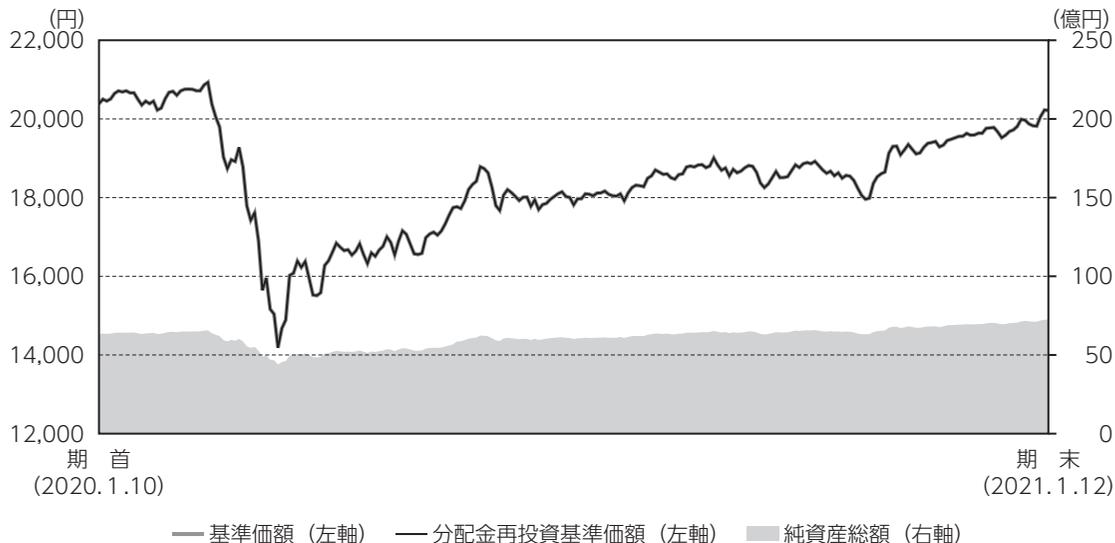
(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。

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



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：20,384円

期末：20,216円（分配金0円）

騰落率：△0.8%（分配金込み）

#### ■ 組入ファンドの当学期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国債券インデックスマザーファンド	5.0%	4.9%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)	△0.7%	4.8%
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	△4.6%	19.2%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	△9.8%	19.8%
ダイワ北米好配当株マザーファンド	9.3%	18.8%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	0.3%	5.2%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	28.5%	1.0%
ダイワ好配当日本株マザーファンド	2.6%	25.4%

#### ■ 基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		合 成 指 数 (参考指数)	指 数		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	公 社 債 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率		騰 落 率	騰 落 率					
(期首)2020年 1 月10日	円 20,384	% -	21,668	% -	% 44.8	% -	% 13.1	% 38.5	% 0.4	
1 月末	20,451	0.3	21,778	0.5	44.5	-	13.0	39.2	0.3	
2 月末	19,029	△ 6.6	20,195	△ 6.8	43.4	-	14.2	38.3	0.8	
3 月末	16,374	△19.7	17,265	△20.3	43.9	-	14.8	35.1	0.5	
4 月末	17,002	△16.6	18,063	△16.6	44.3	-	14.2	36.1	0.5	
5 月末	17,768	△12.8	18,912	△12.7	43.5	-	13.1	38.6	0.5	
6 月末	17,822	△12.6	18,989	△12.4	43.1	-	13.1	38.0	0.5	
7 月末	17,918	△12.1	19,041	△12.1	42.9	-	13.5	38.7	0.5	
8 月末	18,838	△ 7.6	20,136	△ 7.1	43.9	-	13.0	38.5	0.6	
9 月末	18,508	△ 9.2	19,807	△ 8.6	43.1	-	13.3	38.3	0.5	
10月末	17,959	△11.9	19,184	△11.5	44.1	-	13.3	38.3	0.5	
11月末	19,289	△ 5.4	20,910	△ 3.5	45.3	-	12.5	38.1	0.5	
12月末	19,969	△ 2.0	21,523	△ 0.7	44.7	-	12.5	38.4	0.5	
(期末)2021年 1 月12日	20,216	△ 0.8	21,740	0.3	46.5	-	12.4	37.6	0.6	

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2020.1.11~2021.1.12)

4~6ページをご参照ください。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

## ■当ファンド

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

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

\*外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分します。

## ■外国債券インデックスマザーファンド

## ■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

## ■ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

## ■ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

## ■ダイワ北米好配当株マザーファンド

## ■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

## ■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

## ■ダイワ好配当日本株マザーファンド

7~8ページをご参照ください。

## ポートフォリオについて

(2020.1.11~2021.1.12)

## ■当ファンド

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

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

\* 外国株式の3ファンドは、各地域の時価総額に応じて配分しました。

## ■外国債券インデックスマザーファンド

## ■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

## ■ダイワ・グローバル R E I T・マザーファンド

## ■ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド

## ■ダイワ北米好配当株マザーファンド

## ■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

## ■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

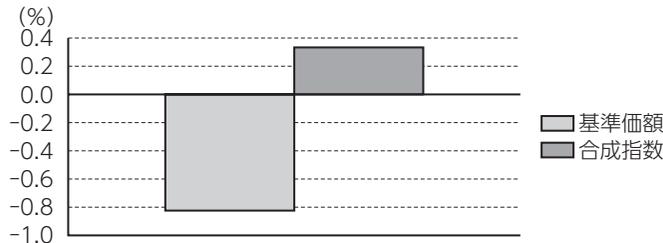
## ■ダイワ好配当日本株マザーファンド

9~10ページをご参照ください。

## ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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



当期  
(2020.1.10~2021.1.12)

## 分配金について

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

### 分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2020年1月11日 ～2021年1月12日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配可能額	（円）	12,175

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

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

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

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



## 今後の運用方針

### 当ファンド

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

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

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

12～13ページをご参照ください。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2020.1.11~2021.1.12)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	245円	1.327%	信託報酬=当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は18,456円です。
(投 信 会 社)	(125)	(0.675)	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)	(110)	(0.597)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(10)	(0.055)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	19	0.103	売買委託手数料=当作成期中の売買委託手数料/当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(5)	(0.028)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(ハイブリッド優先証券)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(13)	(0.073)	
有 価 証 券 取 引 税	3	0.016	有価証券取引税=当作成期中の有価証券取引税/当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0.004)	
(ハイブリッド優先証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(2)	(0.012)	
そ の 他 費 用	9	0.048	その他費用=当作成期中のその他費用/当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(4)	(0.020)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(2)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(4)	(0.020)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	276	1.494	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

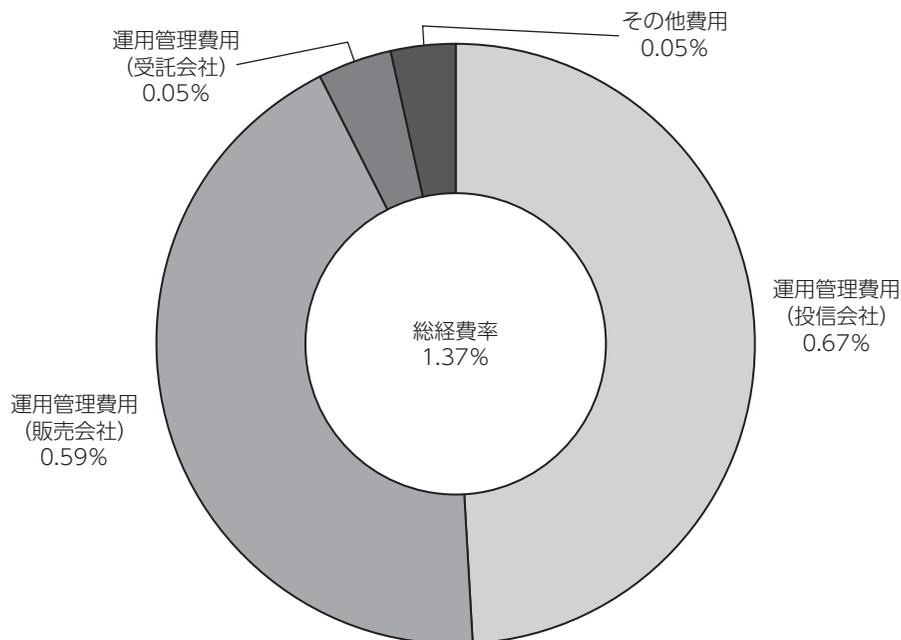
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

## 参考情報

## ■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.37%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

## ■売買および取引の状況

## 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	24,467	73,287	16,922	49,448
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (BPI)	68,163	88,112	36,665	47,758
ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド	119,507	272,242	46,957	122,886
ダイワ好配当日本株 マザーファンド	101,247	263,134	21,343	54,260
ダイワ北米好配当株 マザーファンド	54,317	161,423	26,347	78,777
ダイワ欧州好配当株 マザーファンド	32,080	50,126	23,504	37,943
ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド	1,594	3,233	7,159	14,623
ダイワJ-REIT アクティブ・マザーファンド	126,575	336,318	19,964	59,150

(注) 単位未満は切捨て。

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

項 目	当 期
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	8,686,609千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	14,330,547千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.60
	ダイワ北米好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	3,062,294千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,134,420千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.43
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	233,748千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,144,337千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.20
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	1,361,808千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	641,191千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.12

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■利害関係人との取引状況等

## (1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2020年1月11日から2021年1月12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						
公社債	百万円 9,319	百万円 172	% 1.8	百万円 4,238	百万円 100	% 2.4
コール・ローン	39,992	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合1.4%

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

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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2020年1月11日から2021年1月12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 3,838	百万円 957	% 24.9	百万円 4,848	百万円 1,213	% 25.0
コール・ローン	121,060	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合10.1%

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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
投資信託証券	百万円 94,399	百万円 28,244	% 29.9	百万円 98,494	百万円 27,541	% 28.0
不動産投信 指数先物取引	15,662	—	—	14,007	—	—
コール・ローン	723,702	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合1.4%

## (10) 利害関係人の発行する有価証券等

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
投資信託証券	百万円 —	百万円 1,965	百万円 1,259

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

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

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

種 類	当 期	
	買 付 額	期 額
投資信託証券	百万円 5,473	期 額 5,473
公社債	百万円 100	期 額 100

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## (12) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	6,348千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1,392千円
(B)/(A)	21.9%

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

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、大和証券オフィス投資法人、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	口 数	評 価 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 108,639	千口 116,184	千口 351,202	千円 351,202
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	240,167	271,665	350,583	350,583
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	454,017	526,567	1,388,453	1,388,453
ダイワ好配当日本株マザーファンド	540,450	620,355	1,838,484	1,838,484
ダイワ北米好配当株マザーファンド	373,896	401,865	1,362,566	1,362,566
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	206,228	214,804	377,669	377,669
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	33,139	27,574	74,613	74,613
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	380,661	487,272	1,431,947	1,431,947

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2021年1月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	率
外国債券インデックスマザーファンド	千円 351,202	% 4.8
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	350,583	4.8
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	1,388,453	19.0
ダイワ好配当日本株マザーファンド	1,838,484	25.2
ダイワ北米好配当株マザーファンド	1,362,566	18.7
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	377,669	5.2
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	74,613	1.0
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	1,431,947	19.6
コール・ローン等、その他	120,725	1.7
投資信託財産総額	7,296,246	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、1月12日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=104.23円、1カナダ・ドル=81.56円、1オーストラリア・ドル=80.34円、1香港ドル=13.44円、1シンガポール・ドル=78.36円、1ニュージーランド・ドル=74.76円、1台湾ドル=3.72円、1イギリス・ポンド=140.94円、1イスラエル・シケル=32.85円、1スイス・フラン=117.09円、1デンマーク・クローネ=17.04円、1ノルウェー・クローネ=12.22円、1スウェーデン・クローネ=12.56円、1メキシコ・ペソ=5.20円、100韓国ウォン=9.50円、1オフショア人民元=16.10円、1マレーシア・リンギット=25.70円、1ポーランド・ズロチ=27.99円、1ユーロ=126.73円です。

(注3) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(212,973,631千円)の投資信託財産総額(214,168,531千円)に対する比率は、99.4%です。  
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(74,013,575千円)の投資信託財産総額(74,370,943千円)に対する比率は、99.5%です。  
ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(3,186,323千円)の投資信託財産総額(3,211,398千円)に対する比率は、99.2%です。  
ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(1,291,090千円)の投資信託財産総額(1,304,793千円)に対する比率は、98.9%です。  
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(761,332千円)の投資信託財産総額(765,672千円)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

2021年1月12日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>7,296,246,159円</b>
コール・ローン等	109,605,453
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	351,202,530
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド(B P I)(評価額)	350,583,728
ダイワ・グローバルREIT・ マザーファンド(評価額)	1,388,453,365
ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額)	1,838,484,783
ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額)	1,362,566,001
ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額)	377,669,394
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド(評価額)	74,613,157
ダイワJ-R E I Tアクティブ・ マザーファンド(評価額)	1,431,947,748
未収入金	11,120,000
<b>(B) 負債</b>	<b>58,612,666</b>
未払解約金	14,385,268
未払信託報酬	43,952,785
その他未払費用	274,613
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>7,237,633,493</b>
元本	3,580,161,955
次期繰越損益金	3,657,471,538
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>3,580,161,955口</b>
<b>1万口当り基準価額(C/D)</b>	<b>20,216円</b>

\*期首における元本額は3,104,040,281円、当作成期間中における追加設定元本額は1,060,242,411円、同解約元本額は584,120,737円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は20,216円です。

## ■損益の状況

当期 自2020年1月11日 至2021年1月12日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 27,240円</b>
受取利息	2,379
支払利息	△ 29,619
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>229,000,277</b>
売買益	343,300,256
売買損	△ 114,299,979
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 82,168,944</b>
<b>(D) 当期損益金(A + B + C)</b>	<b>146,804,093</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>1,061,801,417</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>2,448,866,028</b>
(配当等相当額)	( 3,150,285,577)
(売買損益相当額)	(△ 701,419,549)
<b>(G) 合計(D + E + F)</b>	<b>3,657,471,538</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>3,657,471,538</b>
追加信託差損益金	2,448,866,028
(配当等相当額)	( 3,150,285,577)
(売買損益相当額)	(△ 701,419,549)
分配準備積立金	1,208,632,750
繰越損益金	△ 27,240

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

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

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

(注4) 投資信託財産(親投資信託)の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用: 13,605,054円(未監査)

## ■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	146,809,745
(c) 収益調整金	3,150,285,577
(d) 分配準備積立金	1,061,823,005
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	4,358,918,327
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e - f)	4,358,918,327
(h) 受益権総口数	3,580,161,955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。

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

# 外国債券インデックスマザーファンド

## <補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（2020年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年1月12日）現在における外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

## ■外国債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄 公 社 債

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.25% 2023/4/15	1,400,722	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.25% 2023/4/15	1,037,740
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.625% 2030/8/15	1,039,310	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	3.125% 2028/11/15	886,577
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)	2.25% 2021/4/30	869,839
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)	3% 2045/11/15	646,387
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.25% 2025/6/30	783,138	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2% 2024/5/31	573,867
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.875% 2030/11/15	706,262	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)	0.25% 2025/9/30	679,021	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)	2% 2050/2/15	664,353	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	3.25% 2021/10/25	535,670
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.125% 2040/8/15	621,782	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)	0.5% 2027/4/30	608,726	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2021/7/31	504,550

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

下記は、2021年1月12日現在における外国債券インデックスマザーファンド（70,827,785千円）の内容です。

### (1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

2021年1月12日現在									
区 分	額 面 金 額	評 価		組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
アメリカ	千アメリカ・ドル 809,399	千アメリカ・ドル 868,109	千円 90,483,016	% 42.3	% -	% 18.7	% 16.0	% 7.6	
カナダ	千カナダ・ドル 45,917	千カナダ・ドル 50,730	4,137,578	1.9	-	0.9	0.7	0.3	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 65,864	千オーストラリア・ドル 73,000	5,864,893	2.7	-	1.9	0.6	0.2	
シンガポール	千シンガポール・ドル 10,468	千シンガポール・ドル 11,875	930,597	0.4	-	0.3	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 77,466	千イギリス・ポンド 100,888	14,219,284	6.6	-	5.1	1.1	0.4	
イスラエル	千イスラエル・シケル 25,400	千イスラエル・シケル 29,232	960,275	0.4	-	0.2	0.2	0.1	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 48,511	千デンマーク・クローネ 63,344	1,079,395	0.5	-	0.4	0.1	0.0	
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 38,591	471,586	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 56,551	710,280	0.3	-	0.2	0.1	0.1	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 282,034	千メキシコ・ペソ 321,115	1,669,800	0.8	-	0.5	0.2	0.1	

2021年1月12日現在								
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
マレーシア	千マレーシア・リンギット 37,242	千マレーシア・リンギット 40,358	千円 1,037,209	% 0.5	% -	% 0.3	% 0.1	% 0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 43,429	千ポーランド・ズロチ 47,616	1,332,779	0.6	-	0.3	0.3	0.1
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 12,143	千ユーロ 14,151	1,793,460	0.8	-	0.6	0.2	0.1
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 27,005	千ユーロ 32,867	4,165,265	1.9	-	1.3	0.5	0.2
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 34,009	千ユーロ 42,764	5,419,517	2.5	-	1.9	0.4	0.1
ユーロ (フランス)	千ユーロ 146,537	千ユーロ 179,233	22,714,210	10.6	-	7.1	2.7	0.8
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 104,445	千ユーロ 126,719	16,059,101	7.5	-	4.8	2.1	0.6
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 83,379	千ユーロ 102,524	12,992,953	6.1	-	4.1	1.6	0.3
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 132,593	千ユーロ 159,380	20,198,308	9.4	-	6.0	2.6	0.9
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 9,364	千ユーロ 10,469	1,326,761	0.6	-	0.4	0.2	0.1
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 20,718	千ユーロ 25,594	3,243,547	1.5	-	1.0	0.4	0.1
ユーロ (小計)	570,193	693,704	87,913,125	41.1	-	27.2	10.7	3.1
合 計	-	-	210,809,825	98.5	-	56.1	30.3	12.1

(注1) 邦貨換算金額は、2021年1月12日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

## (2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

2021年1月12日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	% 千アメリカ・ドル 3,224	千アメリカ・ドル 3,290	千円 342,980	2022/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	2,459	2,512	261,855	2022/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	2,543	2,603	271,370	2022/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.6250	6,668	6,849	713,923	2022/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.0000	4,350	4,517	470,860	2023/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	1.7500	4,685	4,856	506,170	2023/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	4,568	4,841	504,651	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	5,021	5,385	561,280	2023/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.7500	5,229	5,637	587,551	2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	2.5000	4,912	5,278	550,135	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.2500	654	757	78,926	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.0000	855	1,091	113,748	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.1250	709	962	100,369	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.5000	700	938	97,784	2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.2500	738	981	102,311	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.2500	473	632	65,924	2029/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	6.2500	714	1,047	109,187	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国 債 証 券	5.3750	2,391	3,375	351,780	2031/02/15	

外国債券インデックスマザーファンド

2021年1月12日現在							
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,679	175,022	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	1,289	134,430	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	790	82,347	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	759	79,206	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	1,377	143,615	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,610	167,877	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,569	163,627	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,770	184,497	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,522	158,672	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	2,461	256,552	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,509	157,370	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	2,131	222,206	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,935	201,754	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	2,020	210,575	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	2,078	216,631	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,825	190,308	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	2,048	213,478	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,674	174,537	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,231	2,657	276,991	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	1,940	202,280	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	3,313	345,320	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	2,791	290,959	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	4,364	454,910	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	2,881	300,323	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	4,502	469,314	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	4,369	455,382	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	6,623	690,332	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	2,440	254,418	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	6,355	662,413	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,846	4,773	497,513	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,230	336,755	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,527	2,563	267,234	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	6,125	638,435	2025/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	2,925	304,958	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,809	3,878	404,285	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,947	307,213	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	6,217	648,010	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,835	3,524	367,332	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,667	277,990	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	1,326	1,358	141,555	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,903	302,645	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,179	4,299	448,130	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	6,151	641,146	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,373	4,109	428,360	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,514	262,087	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,541	264,860	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	6,338	660,680	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	659	821	85,590	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,637	274,909	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,287	6,506	678,176	2022/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,992	5,185	540,478	2022/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,366	4,610	480,556	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,644	275,669	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,648	4,165	434,143	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,962	3,046	317,531	2023/02/28

2021年1月12日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,623	3,730	388,833	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,729	3,943	411,022	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,139	222,951	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	3,908	407,424	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,586	269,572	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	3,088	321,923	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	5,672	591,243	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	3,794	395,477	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,855	297,635	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,474	257,949	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,585	269,459	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,716	595,833	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,599	270,977	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,500	1,832	191,045	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,626	273,744	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	600	610	63,681	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,650	276,248	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,140	2,343	244,224	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,065	319,564	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,633	274,483	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,545	4,433	462,068	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,069	319,981	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,434	253,774	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,550	4,823	502,734	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,961	308,690	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	7,065	736,434	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	2,504	261,079	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	3,067	319,725	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	3,172	330,644	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,067	319,675	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,607	584,481	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,071	320,116	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,542	264,983	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	6,470	674,429	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,977	310,364	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,194	332,964	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,450	4,132	430,724	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,200	3,276	341,560	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	2,113	220,298	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,574	268,350	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,500	2,666	277,957	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,583	269,265	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	6,035	629,066	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,500	4,194	437,164	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,753	391,194	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,420	356,466	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	3,009	313,685	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,659	381,389	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,650	6,401	667,199	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,473	362,016	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,823	294,328	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,963	308,859	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,800	4,765	496,732	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,900	3,049	317,897	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	3,171	330,580	2025/03/31

外国債券インデックスマザーファンド

2021年1月12日現在								
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,200	5,384	561,194	2048/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	7,429	774,403	2028/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,648	276,024	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	2,100	218,953	2025/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,930	409,645	2025/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,652	276,430	2023/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,650	276,290	2023/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	3,309	344,959	2025/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,850	4,102	427,553	2023/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	7,678	800,361	2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,220	5,298	552,285	2048/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,774	289,217	2025/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,842	400,465	2023/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,979	414,799	2025/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,795	291,395	2025/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,217	335,360	2023/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,800	291,862	2025/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,298	448,022	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,700	4,318	450,124	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,520	6,066	632,327	2048/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,346	348,793	2025/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	2,153	224,419	2023/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,500	3,866	403,021	2025/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,677	279,120	2023/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,072	320,225	2022/01/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	7,462	777,828	2029/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,078	320,848	2022/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	4,276	445,745	2024/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,764	288,177	2026/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	5,917	616,750	2049/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,751	286,794	2026/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,519	366,852	2024/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,592	374,421	2022/03/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,721	283,701	2026/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,700	3,798	395,936	2022/04/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,400	3,490	363,861	2022/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	5,726	596,860	2049/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	4,337	452,097	2029/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,728	388,630	2024/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	3,068	319,840	2026/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,580	373,195	2022/06/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,250	338,802	2026/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,677	383,271	2024/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	2,996	312,363	2026/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,000	4,097	427,030	2022/07/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,500	5,783	602,776	2024/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,677	279,099	2026/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,900	7,257	756,433	2029/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,500	3,575	372,710	2022/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	5,011	522,307	2049/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,920	304,381	2026/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	4,136	431,120	2024/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,068	319,784	2022/09/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,643	275,516	2026/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,131	326,345	2024/09/30	

2021年1月12日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,900	2,962	308,817	2022/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	1,044	108,830	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,171	330,544	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,850	6,212	647,519	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	5,031	524,437	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	2,114	220,363	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,133	326,635	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,085	321,592	2022/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,661	277,369	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,637	274,906	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,500	1,521	158,633	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	4,108	428,235	2023/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,700	1,769	184,388	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,500	2,533	264,045	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,250	2,307	240,497	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,600	3,738	389,678	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,200	3,359	350,186	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	5,574	580,999	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	200	202	21,085	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	307	32,102	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	5,360	558,678	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,200	1,208	125,999	2023/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,500	1,506	157,053	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	200	200	20,910	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,200	3,206	334,199	2023/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,592	166,037	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	7,800	7,477	779,327	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,496	364,418	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,696	281,088	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,200	3,200	333,546	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	5,700	5,625	586,357	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	4,803	500,646	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,561	475,424	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	500	499	52,108	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,449	359,588	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,978	310,466	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,500	5,510	574,359	2023/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,500	5,499	573,242	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	7,500	7,441	775,611	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,447	359,358	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	998	104,087	2023/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,371	351,391	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,499	364,732	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	800	798	83,243	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	10,000	9,553	995,802	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,878	508,444	2027/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	6,700	5,932	618,353	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	6,000	5,453	568,457	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,438	358,446	2027/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,999	312,627	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,996	208,059	2023/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	6,435	670,720	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,999	312,602	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,893	405,779	2027/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,467	361,441	2025/08/31

外国債券インデックスマザーファンド

2021年1月12日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,200	4,190	436,824	2023/10/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	3,003	313,068	2023/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	6,800	6,637	691,817	2030/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,499	364,702	2022/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,957	412,454	2025/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,000	3,920	408,610	2027/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,300	4,053	422,521	2050/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,700	3,513	366,245	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,999	312,602	2022/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,100	5,072	528,745	2025/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,937	514,635	2027/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	997	103,948	2023/12/15	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	250銘柄		809,399	868,109	90,483,016		
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	576	47,038	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,384	112,901	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,733	141,362	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,594	130,045	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	913	1,357	110,709	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,751	1,814	148,008	2022/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,461	2,117	172,724	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,291	105,355	2023/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,508	123,042	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,749	142,686	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,246	101,701	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	1,019	83,146	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,274	103,950	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,440	1,446	117,986	2022/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,750	1,774	144,738	2022/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,200	1,318	107,573	2028/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,300	4,443	362,449	2023/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,300	1,360	110,975	2023/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,560	2,917	237,966	2051/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,372	111,917	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,273	103,904	2024/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,458	118,964	2024/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	3,584	292,350	2030/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	700	724	59,069	2025/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,100	1,116	91,056	2022/02/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5	5	415	2022/05/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,894	236,076	2025/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,304	187,935	2022/08/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	701	57,194	2022/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	868	70,817	2030/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	500	493	40,237	2026/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	500	499	40,736	2024/04/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,502	122,540	2023/02/01	
通貨小計	銘 柄 数 金 額	33銘柄		45,917	50,730	4,137,578		
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル			
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,162	3,433	275,843	2022/07/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,568	4,004	321,742	2023/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,789	3,506	281,718	2027/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,473	3,772	303,061	2024/04/21	

外国債券インデックスマザーファンド

2021年1月12日現在								
区分	銘柄	種類	年 利率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	千オーストラリア・ドル 2,304	千オーストラリア・ドル 2,742	千円 220,310	2029/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,498	3,939	316,503	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,258	1,726	138,717	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,248	3,895	312,989	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,455	116,946	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,307	1,527	122,717	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	977	78,533	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,672	3,045	244,653	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,678	4,075	327,403	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	1,490	119,780	2047/03/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,800	3,214	258,215	2028/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,850	1,924	154,639	2022/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,600	2,998	240,893	2029/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,870	5,521	443,598	2030/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,390	1,592	127,953	2041/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	2,950	237,050	2031/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	900	905	72,744	2032/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,404	193,176	2024/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,500	3,477	279,412	2030/12/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,500	1,368	109,979	2051/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,888	151,753	2025/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,461	197,742	2031/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,700	2,698	216,811	2026/09/21	
通貨小計	銘柄数 金 額	27銘柄		65,864	73,000	5,864,893		
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 901	70,656	2027/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	788	824	64,645	2022/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	623	682	53,460	2024/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	809	951	74,568	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	509	39,885	2042/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	671	711	55,765	2023/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	720	56,423	2033/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	725	56,859	2029/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	568	44,546	2025/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	899	70,516	2046/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	487	38,181	2026/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	500	509	39,904	2022/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	650	748	58,638	2036/08/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	450	463	36,341	2023/02/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	620	48,623	2028/05/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	490	514	40,354	2024/02/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	414	32,500	2039/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	410	471	36,954	2050/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	150	150	11,769	2025/11/01	
通貨小計	銘柄数 金 額	19銘柄		10,468	11,875	930,597		
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	千イギリス・ポンド 1,621	千イギリス・ポンド 1,775	250,197	2025/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,682	2,740	386,191	2065/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,585	223,519	2026/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	2,320	2,342	330,110	2022/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,940	2,218	312,706	2047/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,350	2,729	384,659	2037/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,510	1,938	273,268	2057/07/22	

外国債券インデックスマザーファンド

2021年1月12日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
	United Kingdom Gilt		国債証券	1.2500	2,010	2,161	304,584	2027/07/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	0.7500	2,000	2,043	287,946	2023/07/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	1.6250	1,500	1,670	235,489	2028/10/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	1.6250	1,060	1,462	206,069	2071/10/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	1.0000	1,800	1,863	262,680	2024/04/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	1.7500	1,110	1,346	189,836	2049/01/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	1.6250	850	1,034	145,816	2054/10/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	0.8750	1,800	1,897	267,434	2029/10/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	0.6250	2,600	2,675	377,140	2025/06/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	1.2500	940	1,013	142,846	2041/10/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	0.1250	2,300	2,309	325,442	2023/01/31
	United Kingdom Gilt		国債証券	0.3750	2,300	2,310	325,698	2030/10/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	0.5000	750	668	94,155	2061/10/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	0.1250	1,500	1,507	212,460	2026/01/30
	United Kingdom Gilt		国債証券	0.1250	1,600	1,596	225,030	2028/01/31
	United Kingdom Gilt		国債証券	0.6250	1,100	1,020	143,798	2050/10/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	0.6250	1,300	1,294	182,481	2035/07/31
	United Kingdom Gilt		国債証券	0.1250	1,300	1,305	184,066	2024/01/31
	United Kingdom Gilt		国債証券	0.2500	300	295	41,687	2031/07/31
	United Kingdom Gilt		国債証券	6.0000	949	1,381	194,658	2028/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	1,840	2,626	370,112	2032/06/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	5.0000	1,472	1,781	251,132	2025/03/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	1,662	2,531	356,762	2036/03/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.7500	1,357	2,279	321,338	2038/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	1,908	3,855	543,355	2055/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	1,366	2,428	342,332	2046/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	1,232	1,584	223,341	2027/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.5000	2,416	4,189	590,527	2042/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.7500	1,830	2,622	369,609	2030/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	1,343	2,496	351,838	2049/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	1,446	2,325	327,786	2039/09/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.0000	1,382	1,447	204,034	2022/03/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.5000	1,260	1,916	270,166	2034/09/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.0000	1,074	2,208	311,315	2060/01/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	1,577	2,580	363,667	2040/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	3.7500	1,552	2,780	391,883	2052/07/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	1.7500	2,242	2,311	325,808	2022/09/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	3.2500	2,166	3,241	456,924	2044/01/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	2.2500	1,582	1,680	236,826	2023/09/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	3.5000	1,586	3,274	461,499	2068/07/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	2.7500	1,092	1,204	169,757	2024/09/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	3.5000	2,124	3,329	469,280	2045/01/22
通貨小計	銘 柄 数	49銘柄			77,466	100,888	14,219,284	
イスラエル					千イスラエル・シユケル	千イスラエル・シユケル		
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	6.2500	2,000	2,662	87,446	2026/10/30
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	5.5000	2,000	2,115	69,491	2022/01/31
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	4.2500	1,800	1,965	64,554	2023/03/31
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	5.5000	1,900	3,184	104,610	2042/01/31
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	3.7500	2,000	2,227	73,167	2024/03/31
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	1.7500	2,300	2,450	80,484	2025/08/31
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	2.0000	1,800	1,963	64,485	2027/03/31
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	1.2500	1,000	1,022	33,581	2022/11/30
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	3.7500	2,100	2,852	93,694	2047/03/31
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	2.2500	1,800	2,009	66,021	2028/09/28

2021年1月12日現在									
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価		償 還 年 月 日	
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	Israel Government Bond - Fixed		国 債 証 券	1.5000	1,500	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円	2023/11/30
	Israel Government Bond - Fixed		国 債 証 券	0.7500	1,000		1,556	51,146	2022/07/31
	Israel Government Bond - Fixed		国 債 証 券	1.0000	1,900		1,010	33,189	2020/03/31
	Israel Government Bond - Fixed		国 債 証 券	0.5000	600		1,916	62,959	2025/04/30
	Israel Government Bond - Fixed		国 債 証 券	1.5000	700		604	19,857	2037/05/31
	Israel Government Bond - Fixed		国 債 証 券	0.1500	1,000		691	22,730	2023/07/31
	Israel Government Bond - Fixed		国 債 証 券				1,000	32,853	
通貨小計	銘	柄	数						
	金		額						
			16						
					25,400		29,232	960,275	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.5000	13,662	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	441,343	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	4,846		25,900	87,654	2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	6,013		5,144	114,230	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	7,900		6,703	144,167	2027/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	9,590		8,460	177,200	2029/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.2500	4,300		10,399	74,459	2022/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.2500	2,200		4,369	40,340	2052/11/15
通貨小計	銘	柄	数						
	金		額						
			7						
					48,511		63,344	1,079,395	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.0000	8,204	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	104,173	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.0000	4,095		8,524	54,074	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	5,395		4,425	69,137	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	3,340		5,657	42,526	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	3,450		3,480	44,598	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.0000	3,500		3,649	46,224	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	3,850		3,782	50,181	2029/09/06
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.3750	4,800		4,106	60,669	2030/08/19
通貨小計	銘	柄	数						
	金		額						
			8						
					36,634		38,591	471,586	
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.5000	4,655	千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ	90,772	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.5000	8,465		7,227	112,014	2022/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	8,025		8,918	106,094	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.5000	7,595		8,447	107,062	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.0000	7,180		8,524	96,462	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.7500	4,550		7,680	60,694	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.7500	7,400		4,832	99,342	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.1250	3,000		7,909	37,836	2031/05/12
通貨小計	銘	柄	数						
	金		額						
			8						
					50,870		56,551	710,280	
メキシコ	Mexican Bonos		国 債 証 券	5.7500	23,290	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	126,465	2026/03/05
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.0000	19,300		24,320	115,505	2047/11/07
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.0000	23,800		22,212	138,586	2024/09/05
	Mexican Bonos		国 債 証 券	6.7500	7,200		26,651	39,360	2023/03/09
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.0000	30,033		7,569	171,809	2023/12/07
	Mexican Bonos		国 債 証 券	10.0000	23,919		33,040	148,962	2024/12/05
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.5000	27,968		28,646	165,230	2027/06/03
	Mexican Bonos		国 債 証 券	10.0000	8,874		31,775	63,607	2036/11/20
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.5000	29,544		12,232	186,296	2029/05/31
	Mexican Bonos		国 債 証 券	8.5000	16,894		35,826	106,831	2038/11/18
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.7500	15,015		20,544	90,821	2031/05/29
	Mexican Bonos		国 債 証 券	6.5000	28,599		17,465	153,371	2022/06/09
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.7500	19,654		29,494	115,000	2042/11/13
	Mexican Bonos		国 債 証 券	7.7500	7,944		22,115	47,952	2034/11/23
通貨小計	銘	柄	数						
	金		額						
			14						
					282,034		321,115	1,669,800	

外国債券インデックスマザーファンド

2021年1月12日現在								
区分	銘柄	種類	年 利率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
マレーシア	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	2027/05/31
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178		2,516	64,678	2030/04/15
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514		1,348	34,651	2026/04/15
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300		1,669	42,898	2026/04/15
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	875		1,466	37,690	2031/06/30
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731		897	23,062	2022/08/15
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001		791	20,330	2027/03/15
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427		1,034	26,596	2023/03/15
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,186		1,531	39,355	2033/04/15
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	600		1,285	33,032	2028/06/15
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057		698	17,962	2043/09/30
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737		1,133	29,122	2024/07/15
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161		1,877	48,243	2025/09/15
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220		1,199	30,838	2022/09/30
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,302		1,347	34,622	2035/05/31
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930		1,364	35,063	2023/08/17
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650		1,063	27,335	2046/03/15
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	100		703	18,067	2026/11/30
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	750		102	2,632	2022/03/10
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190		802	20,635	2024/09/30
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,050		1,292	33,217	2027/11/16
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200		1,233	31,688	2037/04/07
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	2,500		1,282	32,967	2025/03/14
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200		2,604	66,939	2023/04/20
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	600		1,364	35,065	2033/11/07
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650		708	18,201	2038/06/08
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,910		702	18,043	2026/07/15
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200		2,087	53,636	2029/08/15
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400		1,419	36,474	2048/07/06
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300		419	10,770	2024/06/14
MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750		1,372	35,260	2034/07/05	
MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	700		1,815	46,653	2040/05/22	
MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	500		725	18,650	2050/06/15	
MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券				498	12,817	2031/04/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	33銘柄		37,242	40,358	1,037,209		
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	2,309	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	70,932	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,377		2,534	135,559	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170		4,843	98,767	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,320		3,528	95,666	2022/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,850		3,417	113,176	2023/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,870		4,043	86,501	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840		3,090	154,300	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,400		5,512	102,310	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	-	1,600		3,655	44,772	2022/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	1,000		1,599	28,417	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	1,000		1,015	28,068	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827		1,002	32,111	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,625		1,147	81,469	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,650		2,910	115,688	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,591		4,133	145,033	2025/07/25
	通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		43,429	47,616	1,332,779	
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,031	千ユーロ	千ユーロ	163,848	2025/03/13

2021年1月12日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	IRISH TREASURY		国債証券	3.9000	624	686	87,059	2023/03/20
	IRISH TREASURY		国債証券	3.4000	607	685	86,921	2024/03/18
	IRISH TREASURY		国債証券	2.4000	961	1,209	153,335	2030/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	0.8000	516	524	66,528	2022/03/15
	IRISH TREASURY		国債証券	2.0000	781	1,114	141,206	2045/02/18
	IRISH TREASURY		国債証券	1.0000	1,073	1,164	147,550	2026/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	1.7000	550	701	88,926	2037/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	-	350	354	44,904	2022/10/18
	IRISH TREASURY		国債証券	0.9000	800	880	111,562	2028/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	1.3000	750	886	112,351	2033/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	1.3500	750	875	110,945	2031/03/18
	IRISH TREASURY		国債証券	1.1000	1,200	1,350	171,128	2029/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	1.5000	600	796	100,984	2050/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	0.4000	250	266	33,775	2035/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	0.2000	800	836	106,014	2027/05/15
	IRISH TREASURY		国債証券	0.2000	500	524	66,417	2030/10/18
国小計	銘柄数 金 額	17銘柄			12,143	14,151	1,793,460	
ユーロ (オランダ)					千ユーロ	千ユーロ		
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	7.5000	548	639	81,029	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	5.5000	1,139	1,635	207,327	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	1,685	2,870	363,727	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	3.7500	791	862	109,306	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	3.7500	1,479	2,733	346,394	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	1,438	1,502	190,425	2022/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	1,168	1,582	200,602	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	1,385	1,471	186,543	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,579	2,784	352,898	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	2.0000	1,514	1,660	210,451	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	1,791	1,869	236,880	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	1,638	1,745	221,170	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,200	1,208	153,134	2022/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	0.7500	2,200	2,400	304,177	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,400	1,430	181,327	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	0.7500	1,150	1,266	160,545	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	1,200	1,280	162,228	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	900	1,023	129,673	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	-	1,400	1,461	185,182	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	-	800	830	105,260	2027/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国債証券	-	600	607	76,979	2052/01/15
国小計	銘柄数 金 額	21銘柄			27,005	32,867	4,165,265	
ユーロ (ベルギー)					千ユーロ	千ユーロ		
	Belgium Government Bond		国債証券	0.8000	1,699	1,809	229,365	2025/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	1.0000	1,774	2,016	255,513	2031/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	1.9000	1,058	1,397	177,097	2038/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	1.0000	2,283	2,484	314,895	2026/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	1.6000	1,244	1,645	208,487	2047/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	2.1500	640	1,062	134,643	2066/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	0.2000	1,490	1,527	193,542	2023/10/22
	Belgium Government Bond		国債証券	0.8000	1,100	1,197	151,762	2027/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	0.5000	1,050	1,097	139,035	2024/10/22
	Belgium Government Bond		国債証券	2.2500	580	933	118,292	2057/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	1.4500	400	494	62,624	2037/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	0.8000	1,340	1,470	186,370	2028/06/22

外国債券インデックスマザーファンド

2021年1月12日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	Belgium Government Bond		国債証券	1.2500	350	412	52,308	2033/04/22
	Belgium Government Bond		国債証券	0.9000	1,500	1,668	211,446	2029/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	1.7000	600	823	104,312	2050/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	0.1000	1,220	1,271	161,172	2030/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	0.4000	660	693	87,830	2040/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	-	1,200	1,242	157,509	2027/10/22
	Belgium Government Bond		国債証券	5.5000	1,706	2,459	311,691	2028/03/28
	Belgium Government Bond		国債証券	5.0000	2,104	3,650	462,684	2035/03/28
	Belgium Government Bond		国債証券	4.0000	877	926	117,447	2022/03/28
	Belgium Government Bond		国債証券	4.2500	1,604	2,907	368,437	2041/03/28
	Belgium Government Bond		国債証券	4.5000	1,001	1,271	161,181	2026/03/28
	Belgium Government Bond		国債証券	4.2500	1,316	1,428	180,979	2022/09/28
	Belgium Government Bond		国債証券	4.0000	780	1,157	146,684	2032/03/28
	Belgium Government Bond		国債証券	2.2500	1,338	1,435	181,897	2023/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	3.7500	843	1,538	194,999	2045/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	2.6000	1,505	1,677	212,559	2024/06/22
	Belgium Government Bond		国債証券	3.0000	747	1,063	134,742	2034/06/22
国小計	銘 柄 数	29銘柄			34,009	42,764	5,419,517	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	8.5000	1,985	2,404	304,766	2023/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	6.0000	3,025	4,005	507,562	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.5000	3,323	4,992	632,713	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	5.7500	2,927	5,025	636,942	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7500	2,659	4,532	574,374	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	1,764	3,789	480,269	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	2,374	4,061	514,760	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.2500	4,097	4,667	591,466	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.5000	3,564	6,715	851,010	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.0000	1,717	3,900	494,326	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.5000	3,146	3,841	486,867	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.0000	3,630	3,801	481,720	2022/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	5,199	6,379	808,439	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	3,694	3,889	492,895	2022/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	2,588	4,439	562,566	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	3,347	3,540	448,741	2023/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	5,086	5,592	708,778	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	5,887	7,487	948,920	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	4,899	5,360	679,396	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	3,492	3,667	464,823	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	5,101	5,510	698,294	2025/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	4,920	5,842	740,395	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	3,787	4,013	508,635	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.2500	3,869	4,629	586,651	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	1,287	1,930	244,603	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	2,800	2,936	372,167	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	4,000	4,036	511,543	2022/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	2,570	3,373	427,564	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	3,400	3,740	474,056	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.0000	2,700	3,900	494,317	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	2,400	2,435	308,656	2023/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.7500	4,400	4,804	608,889	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.2500	3,950	4,677	592,740	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.7500	4,950	5,424	687,454	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	3,400	3,473	440,141	2024/03/25

2021年1月12日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	2022/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	1,400	1,410	178,727	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	2,750	3,631	460,256	2029/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	3,250	3,502	443,829	2025/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	3,130	3,214	407,339	2029/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	3,600	3,718	471,215	2023/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	2,400	2,434	308,525	2052/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.7500	1,870	2,062	261,434	2026/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	3,000	3,091	391,766	2040/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	1,200	1,284	162,776	2030/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	2,000	2,058	260,886	
国 小 計	銘 柄 数 額	45銘柄			146,537	179,233	22,714,210	
ユーロ (ドイツ)	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	6.2500	千ユーロ	千ユーロ		2024/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	6.5000	974	1,180	149,599	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	5.6250	1,167	1,727	218,939	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.7500	2,162	3,143	398,422	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	6.2500	950	1,346	170,657	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	6.2500	1,951	3,192	404,585	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	5.5000	3,448	5,597	709,325	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.7500	1,405	2,421	306,880	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.0000	3,571	6,132	777,110	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.2500	1,325	2,476	313,877	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.7500	1,439	2,898	367,376	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.2500	2,874	5,111	647,728	2022/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.0000	1,807	1,854	235,019	2022/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	2,222	2,302	291,804	2024/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.5000	2,808	4,653	589,756	2022/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	1,644	1,704	216,013	2023/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	1,410	1,476	187,159	2023/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	1,817	1,913	242,477	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.0000	1,599	1,714	217,221	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	1,561	1,683	213,319	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.5000	2,679	4,555	577,305	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	1,594	1,715	217,384	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.0000	4,042	4,299	544,877	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	2,194	2,307	292,395	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.0000	3,134	3,387	429,342	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	2,368	2,518	319,161	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	2,420	2,518	319,168	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.2500	4,200	4,448	563,770	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	2,300	2,483	314,771	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.2500	2,370	3,285	416,423	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	1,900	2,060	261,126	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.2500	4,400	4,705	596,265	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.2500	2,200	2,358	298,874	2029/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	3,000	3,154	399,830	2030/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	1,750	1,800	228,169	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	1,750	1,841	233,329	2035/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	1,900	1,993	252,640	2027/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	2,000	2,092	265,119	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	1,000	1,052	133,332	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	1,200	1,266	160,535	2022/03/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	300	302	38,314	2022/06/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	100	100	12,796	2022/09/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	100	101	12,821	

外国債券インデックスマザーファンド

2021年1月12日現在								
区分	銘柄	種類	年 利率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	千ユーロ	千ユーロ	千円	2022/12/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,160	1,160	1,169	148,265	2022/04/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	2,100	2,126	269,494	2022/10/07
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,730	5,730	5,826	738,442	2023/04/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,900	1,939	245,817	2023/10/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,920	1,966	249,222	2024/04/05
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,700	1,747	221,509	2024/10/18
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,400	2,475	313,741	2025/04/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,300	2,379	301,607	2025/10/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	103	13,121	2025/10/10
国小計	銘柄数 金 額	52銘柄			104,445	126,719	16,059,101	
ユーロ (スペイン)	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	千ユーロ	千ユーロ	502,461	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	2,045	2,227	282,282	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	2,052	2,430	308,005	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,192	2,464	312,377	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	2,733	3,074	389,622	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	1,952	2,924	370,588	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	1,550	2,805	355,513	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,030	2,030	2,225	282,054	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	2,080	2,080	2,106	266,925	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	1,900	2,117	268,323	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	2,200	2,200	2,773	351,443	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	2,050	2,285	289,634	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,600	1,600	1,629	206,460	2022/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	1,900	2,120	268,759	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,300	1,300	1,908	241,922	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	2,400	2,400	2,452	310,831	2023/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	1,900	2,125	269,423	2028/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,600	1,805	228,764	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,850	1,850	2,238	283,689	2035/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,300	2,361	299,238	2024/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,800	2,959	375,094	2029/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,360	1,360	1,423	180,337	2030/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,460	2,460	2,489	315,540	2023/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,500	1,527	193,596	2025/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,200	1,200	1,240	157,252	2050/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,400	2,564	325,053	2027/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,900	2,900	3,237	410,307	2030/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	900	900	997	126,363	2040/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	500	509	64,593	2026/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	1,979	3,247	411,588	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	2,254	2,254	3,584	454,302	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	2,158	2,158	3,899	494,209	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	1,682	1,956	247,970	2024/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,973	1,973	3,532	447,733	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,189	2,189	2,700	342,262	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	1,965	2,654	336,364	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	1,978	2,111	267,609	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	1,958	1,958	2,197	278,536	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	1,901	2,165	274,400	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	1,770	2,503	317,320	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,199	1,199	2,368	300,110	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	1,970	2,252	285,396	2024/04/30

2021年1月12日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	SPANISH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	2024/10/31
				2.7500	2,097	2,356	298,684	
国 小 計	銘 柄 数 額	43銘柄			83,379	102,524	12,992,953	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (イタリア)	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	9.0000	906	1,144	145,020	2023/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	7.2500	1,110	1,571	199,161	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	6.5000	2,392	3,402	431,256	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.5000	1,814	2,001	253,688	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.2500	1,509	2,138	270,994	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.3500	1,629	1,665	211,102	2022/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	2,487	2,661	337,309	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.6500	2,065	2,290	290,235	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.0000	1,891	2,080	263,608	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.4500	1,504	1,551	196,596	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.7000	1,610	2,090	264,880	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.9500	1,359	1,398	177,237	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.6000	1,786	1,937	245,488	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.2500	2,324	2,769	350,944	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.2500	1,068	1,140	144,587	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.6500	1,550	1,592	201,774	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.8000	968	1,296	164,345	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.4500	1,500	1,805	228,790	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.2000	1,510	1,705	216,164	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.8500	1,300	1,390	176,248	2024/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.2000	2,050	2,091	265,036	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.4500	1,850	2,724	345,326	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.0500	2,700	3,028	383,748	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.9000	1,700	1,734	219,872	2022/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.4500	1,600	1,700	215,493	2024/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.9500	1,300	1,697	215,172	2038/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.0000	2,100	2,357	298,758	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.9500	1,900	1,954	247,661	2023/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.4500	1,300	1,387	175,844	2025/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.8000	1,550	1,847	234,175	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.4500	2,200	2,367	300,003	2023/10/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.5000	1,550	1,741	220,684	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.3500	1,270	1,690	214,280	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.8500	1,250	1,974	250,225	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.0000	1,550	1,583	200,721	2022/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.0000	1,900	2,314	293,358	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	2,200	2,350	297,831	2024/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.1000	2,100	2,336	296,128	2026/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.1000	1,250	1,671	211,808	2040/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.3500	1,900	2,052	260,100	2030/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.0500	740	746	94,614	2023/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.3500	1,300	1,326	168,104	2025/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.8500	2,350	2,452	310,761	2027/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.4500	1,550	1,934	245,209	2050/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.4500	1,500	1,614	204,597	2036/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.6000	2,000	2,047	259,497	2023/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.8500	2,300	2,498	316,680	2025/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.9500	2,000	2,085	264,275	2030/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.6500	2,400	2,656	336,708	2030/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.3000	1,300	1,321	167,455	2023/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.9500	1,700	1,782	225,932	2027/09/15

外国債券インデックスマザーファンド

2021年1月12日現在								
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	819	103,899	2026/02/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	800	886	112,300	2041/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,300	1,342	170,172	2031/04/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	100	100	12,774	2024/01/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	800	850	107,809	2051/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,754	3,904	494,864	2029/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,393	556,781	2031/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,855	361,890	2033/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	3,535	448,035	2034/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	3,965	502,543	2037/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	3,394	430,139	2039/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,546	322,767	2023/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,569	325,688	2025/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	3,763	476,969	2040/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,547	322,877	2026/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,136	270,807	2022/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	1,817	230,293	2022/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,960	2,168	274,794	2022/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	3,214	407,368	2028/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,107	267,142	2023/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	3,097	392,591	2044/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,522	319,682	2024/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,516	318,979	2024/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,838	3,611	457,627	2030/03/01	
国小計	銘 柄 数 金 額	75銘柄			132,593	159,380	20,198,308	
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	685	86,915	2031/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	299	37,984	2025/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	861	109,150	2026/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	-	200	203	25,840	2023/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	488	61,852	2047/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	-	770	776	98,444	2022/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	858	108,838	2027/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	370	436	55,265	2034/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	539	68,403	2028/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	541	68,640	2029/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	-	200	205	26,016	2024/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	322	40,822	2036/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	422	53,485	2040/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	-	500	518	65,700	2030/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	809	102,646	2025/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	486	61,685	2028/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	312	324	41,111	2022/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	468	59,383	2023/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	643	81,503	2042/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	576	73,070	2024/04/15	
国小計	銘 柄 数 金 額	20銘柄			9,364	10,469	1,326,761	
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	1,497	189,738	2025/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,216	154,188	2026/10/20	
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	1,071	135,805	2047/02/20	
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	395	50,069	2086/11/02	
	Austria Government Bond	国債証券	-	900	915	116,021	2023/07/15	

2021年1月12日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.5000	1,280	1,369	173,614	2027/04/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	2.1000	540	1,169	148,249	2117/09/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	-	400	404	51,292	2022/09/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.7500	900	984	124,712	2028/02/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.5000	980	1,058	134,124	2029/02/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	-	800	819	103,809	2024/07/15
	Austria Government Bond	国 債 証 券	-	680	704	89,314	2030/02/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	-	1,000	1,015	128,728	2023/04/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.7500	700	825	104,575	2051/03/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	-	400	400	50,710	2040/10/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.8500	250	317	40,174	2120/06/30
	Austria Government Bond	国 債 証 券	6.2500	825	1,200	152,140	2027/07/15
	Austria Government Bond	国 債 証 券	4.1500	1,373	2,337	296,280	2037/03/15
	Austria Government Bond	国 債 証 券	4.8500	875	1,129	143,156	2026/03/15
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.6500	797	840	106,572	2022/04/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.4000	872	938	118,967	2022/11/22
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.8000	338	811	102,902	2062/01/26
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.1500	623	1,084	137,414	2044/06/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.7500	959	1,024	129,831	2023/10/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	2.4000	771	1,045	132,456	2034/05/23
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.6500	932	1,015	128,695	2024/10/21
国 小 計	銘 柄 数 金 額	26銘柄			20,718	25,594	3,243,547
通 貨 小 計	銘 柄 数 金 額	328銘柄			570,193	693,704	87,913,125
合 計	銘 柄 数 金 額	807銘柄					210,809,825

(注1) 邦貨換算金額は、2021年1月12日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

## ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

### <補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の決算日（2020年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年1月12日）現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の組入資産の内容等を掲載いたしました。

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

（2020年1月11日から2021年1月12日まで）

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
360	10年国債 0.1% 2030/9/20	293,159	130	5年国債 0.1% 2021/12/20	247,526
143	5年国債 0.1% 2025/3/20	283,024	128	5年国債 0.1% 2021/6/20	227,919
138	5年国債 0.1% 2023/12/20	282,325	129	5年国債 0.1% 2021/9/20	182,438
137	5年国債 0.1% 2023/9/20	272,248	406	2年国債 0.1% 2021/11/1	180,424
357	10年国債 0.1% 2029/12/20	249,628	403	2年国債 0.1% 2021/8/1	160,414
359	10年国債 0.1% 2030/6/20	241,516	408	2年国債 0.1% 2022/1/1	160,349
358	10年国債 0.1% 2030/3/20	237,383	357	10年国債 0.1% 2029/12/20	142,396
337	10年国債 0.3% 2024/12/20	214,135	319	10年国債 1.1% 2021/12/20	141,786
144	5年国債 0.1% 2025/6/20	201,764	127	5年国債 0.1% 2021/3/20	140,456
135	5年国債 0.1% 2023/3/20	171,019	331	10年国債 0.6% 2023/9/20	123,546

（注1）金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

（注2）単位未満は切捨て。

### ■組入資産明細表

下記は、2021年1月12日現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）（19,879,992千円）の内容です。

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

2021年1月12日現在								
区 分	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
国債証券	20,744,000	22,192,881	86.5	—	56.8	20.3	9.4	
地方債証券	1,500,000	1,557,570	6.1	—	2.9	2.4	0.8	
特殊債券(除く金融債券)	800,000	832,608	3.2	—	1.3	1.6	0.4	
普通社債券	900,000	927,958	3.6	—	2.0	1.6	—	
合 計	23,944,000	25,511,018	99.4	—	62.9	25.9	10.6	

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

（注2）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

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

2021年1月12日現在					
区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	409 2年国債	0.1000	40,000	40,094	2022/02/01
	131 5年国債	0.1000	190,000	190,494	2022/03/20
	321 10年国債	1.0000	65,000	65,860	2022/03/20
	322 10年国債	0.9000	140,000	141,688	2022/03/20
	55 20年国債	2.0000	41,000	42,029	2022/03/21
	413 2年国債	0.1000	120,000	120,390	2022/06/01
	132 5年国債	0.1000	190,000	190,611	2022/06/20
	323 10年国債	0.9000	70,000	71,024	2022/06/20
	324 10年国債	0.8000	80,000	81,056	2022/06/20
	56 20年国債	2.0000	12,000	12,365	2022/06/20
	57 20年国債	1.9000	24,000	24,695	2022/06/20
	414 2年国債	0.1000	170,000	170,584	2022/07/01
	415 2年国債	0.1000	100,000	100,364	2022/08/01
	416 2年国債	0.1000	20,000	20,076	2022/09/01
	133 5年国債	0.1000	230,000	230,892	2022/09/20
	325 10年国債	0.8000	160,000	162,484	2022/09/20
	58 20年国債	1.9000	35,000	36,196	2022/09/20
	417 2年国債	0.1000	130,000	130,513	2022/10/01
	418 2年国債	0.1000	160,000	160,678	2022/11/01
	419 2年国債	0.1000	130,000	130,562	2022/12/01
	134 5年国債	0.1000	170,000	170,756	2022/12/20
	326 10年国債	0.7000	20,000	20,317	2022/12/20
	327 10年国債	0.8000	90,000	91,604	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	3,000	3,106	2022/12/20
	135 5年国債	0.1000	400,000	401,968	2023/03/20
	328 10年国債	0.6000	60,000	60,944	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	40,000	40,979	2023/03/20
	136 5年国債	0.1000	300,000	301,683	2023/06/20
	329 10年国債	0.8000	200,000	204,514	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	16,000	16,361	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	30,000	31,409	2023/06/20
	137 5年国債	0.1000	410,000	412,537	2023/09/20
	330 10年国債	0.8000	81,000	83,007	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	10,000	10,195	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	35,000	36,904	2023/09/20
	138 5年国債	0.1000	400,000	402,708	2023/12/20
	332 10年国債	0.6000	65,000	66,378	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	42,000	44,498	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	30,000	31,695	2023/12/20
	139 5年国債	0.1000	320,000	322,297	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	83,000	84,907	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	19,000	20,225	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	25,000	26,851	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	12,000	12,850	2024/03/20
	140 5年国債	0.1000	190,000	191,472	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	320,000	327,939	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	18,000	19,563	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	17,000	18,359	2024/06/20
	141 5年国債	0.1000	270,000	272,246	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	210,000	214,817	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	53,000	57,354	2024/09/20

2021年1月12日現在					
区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
	142 5年国債	0.1000	40,000	40,355	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	260,000	264,316	2024/12/20
	143 5年国債	0.1000	280,000	282,646	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	80,000	81,747	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	14,000	15,302	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	25,000	27,116	2025/03/20
	144 5年国債	0.1000	200,000	202,004	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	115,000	117,691	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	17,000	18,526	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	14,000	15,319	2025/06/20
	145 5年国債	0.1000	120,000	121,214	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	190,000	194,653	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	65,000	71,475	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	28,000	30,921	2025/09/20
	341 10年国債	0.3000	15,000	15,305	2025/12/20
	342 10年国債	0.1000	60,000	60,640	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	31,000	34,551	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	6,000	6,749	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	35,000	39,191	2026/03/20
	343 10年国債	0.1000	180,000	182,016	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	33,000	37,326	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	15,000	16,884	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	50,000	50,571	2026/09/20
	345 10年国債	0.1000	320,000	323,817	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	45,000	50,894	2026/12/20
	346 10年国債	0.1000	40,000	40,484	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	18,000	20,338	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	45,000	51,124	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	235,000	237,888	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	30,000	34,639	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	23,000	26,259	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	240,000	242,983	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	25,000	28,840	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	34,000	38,994	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	250,000	253,225	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	53,000	61,077	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	230,000	232,990	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	35,000	40,748	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	18,000	21,216	2028/03/20
	351 10年国債	0.1000	220,000	222,877	2028/06/20
	102 20年国債	2.4000	10,000	11,845	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	21,000	24,718	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	64,000	74,376	2028/06/20
	352 10年国債	0.1000	255,000	258,248	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	38,000	44,336	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	16,000	18,791	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	240,000	243,060	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	20,000	23,434	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	68,000	78,593	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	210,000	212,587	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	60,000	69,610	2029/03/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

2021年1月12日現在					
区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
110	20年国債	2.1000	27,000	31,768	2029/03/20
355	10年国債	0.1000	125,000	126,480	2029/06/20
111	20年国債	2.2000	35,000	41,633	2029/06/20
112	20年国債	2.1000	40,000	47,242	2029/06/20
356	10年国債	0.1000	185,000	187,092	2029/09/20
113	20年国債	2.1000	70,000	82,982	2029/09/20
357	10年国債	0.1000	105,000	106,079	2029/12/20
114	20年国債	2.1000	45,000	53,514	2029/12/20
115	20年国債	2.2000	42,000	50,322	2029/12/20
2	30年国債	2.4000	9,000	10,976	2030/02/20
358	10年国債	0.1000	235,000	237,265	2030/03/20
116	20年国債	2.2000	27,000	32,468	2030/03/20
117	20年国債	2.1000	77,000	91,887	2030/03/20
3	30年国債	2.3000	4,000	4,860	2030/05/20
359	10年国債	0.1000	240,000	242,148	2030/06/20
118	20年国債	2.0000	13,000	15,445	2030/06/20
119	20年国債	1.8000	23,000	26,892	2030/06/20
120	20年国債	1.6000	75,000	86,278	2030/06/20
360	10年国債	0.1000	291,000	293,249	2030/09/20
4	30年国債	2.9000	8,000	10,265	2030/11/20
123	20年国債	2.1000	42,000	50,636	2030/12/20
124	20年国債	2.0000	100,000	119,571	2030/12/20
125	20年国債	2.2000	25,000	30,490	2031/03/20
126	20年国債	2.0000	21,000	25,186	2031/03/20
127	20年国債	1.9000	70,000	83,243	2031/03/20
5	30年国債	2.2000	8,000	9,780	2031/05/20
128	20年国債	1.9000	32,000	38,163	2031/06/20
129	20年国債	1.8000	95,000	112,312	2031/06/20
130	20年国債	1.8000	28,000	33,190	2031/09/20
131	20年国債	1.7000	70,000	82,231	2031/09/20
6	30年国債	2.4000	9,000	11,270	2031/11/20
132	20年国債	1.7000	25,000	29,437	2031/12/20
133	20年国債	1.8000	90,000	106,953	2031/12/20
134	20年国債	1.8000	15,000	17,868	2032/03/20
135	20年国債	1.7000	20,000	23,603	2032/03/20
136	20年国債	1.6000	80,000	93,526	2032/03/20
7	30年国債	2.3000	12,000	14,995	2032/05/20
137	20年国債	1.7000	18,000	21,291	2032/06/20
139	20年国債	1.6000	120,000	140,584	2032/06/20
140	20年国債	1.7000	20,000	23,709	2032/09/20
141	20年国債	1.7000	48,000	57,023	2032/12/20
142	20年国債	1.8000	140,000	167,969	2032/12/20
10	30年国債	1.1000	15,000	16,774	2033/03/20
143	20年国債	1.6000	48,000	56,562	2033/03/20
144	20年国債	1.5000	70,000	81,645	2033/03/20
11	30年国債	1.7000	9,000	10,735	2033/06/20
145	20年国債	1.7000	130,000	155,066	2033/06/20
12	30年国債	2.1000	11,000	13,695	2033/09/20
146	20年国債	1.7000	115,000	137,444	2033/09/20
13	30年国債	2.0000	11,000	13,590	2033/12/20
147	20年国債	1.6000	145,000	171,784	2033/12/20
14	30年国債	2.4000	22,000	28,397	2034/03/20
148	20年国債	1.5000	110,000	129,110	2034/03/20

2021年1月12日現在					
区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
15	30年国債	2.5000	21,000	27,479	2034/06/20
149	20年国債	1.5000	140,000	164,561	2034/06/20
16	30年国債	2.5000	26,000	34,124	2034/09/20
150	20年国債	1.4000	115,000	133,826	2034/09/20
17	30年国債	2.4000	17,000	22,145	2034/12/20
151	20年国債	1.2000	135,000	153,612	2034/12/20
18	30年国債	2.3000	20,000	25,845	2035/03/20
152	20年国債	1.2000	120,000	136,641	2035/03/20
19	30年国債	2.3000	15,000	19,432	2035/06/20
153	20年国債	1.3000	140,000	161,488	2035/06/20
20	30年国債	2.5000	16,000	21,234	2035/09/20
154	20年国債	1.2000	110,000	125,423	2035/09/20
21	30年国債	2.3000	16,000	20,827	2035/12/20
155	20年国債	1.0000	120,000	133,340	2035/12/20
22	30年国債	2.5000	17,000	22,677	2036/03/20
156	20年国債	0.4000	103,000	105,258	2036/03/20
23	30年国債	2.5000	16,000	21,412	2036/06/20
157	20年国債	0.2000	113,000	111,910	2036/06/20
24	30年国債	2.5000	15,000	20,124	2036/09/20
158	20年国債	0.5000	140,000	144,844	2036/09/20
25	30年国債	2.3000	17,000	22,340	2036/12/20
159	20年国債	0.6000	120,000	125,953	2036/12/20
26	30年国債	2.4000	32,000	42,633	2037/03/20
160	20年国債	0.7000	130,000	138,344	2037/03/20
161	20年国債	0.6000	80,000	83,824	2037/06/20
27	30年国債	2.5000	32,000	43,358	2037/09/20
162	20年国債	0.6000	100,000	104,683	2037/09/20
163	20年国債	0.6000	98,000	102,489	2037/12/20
28	30年国債	2.5000	34,000	46,296	2038/03/20
164	20年国債	0.5000	125,000	128,558	2038/03/20
165	20年国債	0.5000	95,000	97,581	2038/06/20
29	30年国債	2.4000	43,000	58,115	2038/09/20
166	20年国債	0.7000	115,000	121,905	2038/09/20
167	20年国債	0.5000	100,000	102,444	2038/12/20
30	30年国債	2.3000	56,000	74,985	2039/03/20
168	20年国債	0.4000	110,000	110,562	2039/03/20
169	20年国債	0.3000	80,000	78,829	2039/06/20
31	30年国債	2.2000	76,000	100,746	2039/09/20
170	20年国債	0.3000	85,000	83,594	2039/09/20
171	20年国債	0.3000	70,000	68,707	2039/12/20
32	30年国債	2.3000	45,000	60,717	2040/03/20
172	20年国債	0.4000	105,000	104,906	2040/03/20
173	20年国債	0.4000	105,000	104,811	2040/06/20
33	30年国債	2.0000	95,000	123,412	2040/09/20
174	20年国債	0.4000	110,000	109,699	2040/09/20
34	30年国債	2.2000	70,000	93,879	2041/03/20
35	30年国債	2.0000	92,000	120,235	2041/09/20
36	30年国債	2.0000	88,000	115,380	2042/03/20
37	30年国債	1.9000	100,000	129,543	2042/09/20
38	30年国債	1.8000	65,000	83,116	2043/03/20
39	30年国債	1.9000	58,000	75,443	2043/06/20
40	30年国債	1.8000	44,000	56,342	2043/09/20
41	30年国債	1.7000	45,000	56,752	2043/12/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

2021年1月12日現在						
区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日	
		%	千円	千円		
42	30年国債	1.7000	53,000	66,906	2044/03/20	
43	30年国債	1.7000	55,000	69,499	2044/06/20	
44	30年国債	1.7000	50,000	63,241	2044/09/20	
45	30年国債	1.5000	57,000	69,555	2044/12/20	
46	30年国債	1.5000	90,000	109,889	2045/03/20	
47	30年国債	1.6000	62,000	77,185	2045/06/20	
48	30年国債	1.4000	68,000	81,626	2045/09/20	
49	30年国債	1.4000	68,000	81,658	2045/12/20	
50	30年国債	0.8000	60,000	63,598	2046/03/20	
51	30年国債	0.3000	75,000	70,580	2046/06/20	
52	30年国債	0.5000	69,000	68,069	2046/09/20	
53	30年国債	0.6000	75,000	75,678	2046/12/20	
54	30年国債	0.8000	64,000	67,584	2047/03/20	
55	30年国債	0.8000	96,000	101,304	2047/06/20	
56	30年国債	0.8000	60,000	63,269	2047/09/20	
57	30年国債	0.8000	70,000	73,672	2047/12/20	
1	40年国債	2.4000	30,000	43,587	2048/03/20	
58	30年国債	0.8000	75,000	78,873	2048/03/20	
59	30年国債	0.7000	55,000	56,428	2048/06/20	
60	30年国債	0.9000	58,000	62,352	2048/09/20	
61	30年国債	0.7000	50,000	51,135	2048/12/20	
2	40年国債	2.2000	38,000	53,559	2049/03/20	
62	30年国債	0.5000	44,621	44,621	2049/03/20	
63	30年国債	0.4000	65,000	61,246	2049/06/20	
64	30年国債	0.4000	65,000	61,070	2049/09/20	
65	30年国債	0.4000	55,000	51,588	2049/12/20	
3	40年国債	2.2000	19,000	26,916	2050/03/20	
66	30年国債	0.4000	87,000	81,564	2050/03/20	
67	30年国債	0.6000	67,000	66,253	2050/06/20	
68	30年国債	0.6000	60,000	59,326	2050/09/20	
4	40年国債	2.2000	40,000	56,936	2051/03/20	
5	40年国債	2.0000	35,000	48,250	2052/03/20	
6	40年国債	1.9000	40,000	54,392	2053/03/20	
7	40年国債	1.7000	31,000	40,604	2054/03/20	
8	40年国債	1.4000	33,000	40,488	2055/03/20	
9	40年国債	0.4000	40,000	36,716	2056/03/20	
10	40年国債	0.9000	91,000	97,950	2057/03/20	
11	40年国債	0.8000	85,000	88,684	2058/03/20	
12	40年国債	0.5000	99,000	93,315	2059/03/20	
13	40年国債	0.5000	141,000	132,941	2060/03/20	
種別小計	銘柄数 金額	248銘柄				
			20,744,000	22,192,881		
地方債証券		0.8000	100,000	101,432	2022/11/25	
		0.7200	100,000	101,323	2022/12/22	
		0.7570	100,000	101,474	2023/01/31	
		0.6940	100,000	101,867	2023/11/22	
		0.5600	100,000	102,203	2025/04/16	
		0.4770	100,000	102,120	2025/10/29	
		1.6700	100,000	107,960	2025/11/21	
		0.3700	100,000	101,695	2025/12/19	
		0.2200	100,000	100,934	2026/02/26	
		0.0800	100,000	100,242	2026/03/19	

2021年1月12日現在						
区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日	
		%	千円	千円		
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	100,124	2026/06/19	
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,942	2027/03/25	
	29-6 千葉県公債	0.2450	100,000	101,168	2028/01/25	
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	117,819	2029/12/14	
	11 兵庫県公債20年	1.8400	100,000	116,261	2030/08/16	
種別小計	銘柄数 金額	15銘柄				
			1,500,000	1,557,570		
特殊債券 (除く金融債)		0.8920	100,000	101,167	2022/05/27	
		0.6050	100,000	101,346	2023/05/31	
		0.5350	100,000	101,827	2024/10/28	
		0.4500	100,000	101,794	2025/03/31	
		0.3810	100,000	101,803	2025/11/28	
		0.0750	100,000	99,983	2026/09/18	
		2.1000	100,000	116,913	2029/05/31	
		1.0270	100,000	107,770	2029/09/20	
種別小計	銘柄数 金額	8銘柄				
			800,000	832,608		
普通社債券		2.2600	100,000	107,015	2024/03/19	
		0.5240	100,000	101,746	2024/12/20	
		1.0020	100,000	103,772	2025/06/20	
		0.1900	100,000	100,304	2025/12/19	
		0.1050	100,000	99,880	2026/08/21	
		0.4700	100,000	101,136	2026/09/18	
		2.3050	100,000	112,871	2027/03/19	
		0.4800	100,000	99,489	2027/12/03	
		0.4890	100,000	101,742	2032/09/17	
種別小計	銘柄数 金額	9銘柄				
			900,000	927,958		
合計	銘柄数 金額	280銘柄				
			23,944,000	25,511,018		

(注) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の決算日（2020年9月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年1月12日）現在におけるダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの主要な売買銘柄  
投資信託証券

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

買		付			売		付		
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
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		244.013	2,165,551	8,874	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		156.969	2,357,192	15,016
LINK REIT (香港)		1,953.187	2,009,714	1,028	EQUINIX INC (アメリカ)		28.593	1,982,748	69,343
PUBLIC STORAGE (アメリカ)		70.686	1,583,136	22,396	KEPPEL DC REIT (シンガポール)		9,513.8	1,833,519	192
CYRUSONE INC (アメリカ)		198.334	1,547,884	7,804	SEGRO PLC (イギリス)		1,486.946	1,832,994	1,232
SEGRO PLC (イギリス)		1,476.169	1,517,658	1,028	LAND SECURITIES GROUP PLC (イギリス)		1,823.791	1,775,741	973
MIRVAC GROUP (オーストラリア)		7,582.775	1,340,289	176	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST (シンガポール)		7,874.535	1,769,130	224
LAND SECURITIES GROUP PLC (イギリス)		1,553.717	1,334,894	859	UDR INC (アメリカ)		387.738	1,681,122	4,335
COFINIMMO (ベルギー)		86.693	1,292,180	14,905	REALTY INCOME CORP (アメリカ)		225.78	1,606,410	7,114
TRITAX BIG BOX REIT PLC (イギリス)		5,952.904	1,265,732	212	PROLOGIS INC (アメリカ)		150.037	1,468,627	9,788
VENTAS INC (アメリカ)		392.378	1,264,936	3,223	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT (シンガポール)		6,466.36	1,422,576	219

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2021年1月12日現在におけるダイワ・グローバルREIT・マザーファンド（28,120,093千口）の内容です。

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

ファンド名	2021年1月12日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>不動産ファンド (アメリカ)</b>	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
SIMON PROPERTY GROUP INC	244.601	20,336	2,119,634	2.9
EQUITY RESIDENTIAL	60.777	3,528	367,734	0.5
EQUINIX INC	27.971	19,087	1,989,451	2.7
HOST HOTELS & RESORTS INC	689.339	9,905	1,032,481	1.4
CYRUSONE INC	198.334	13,694	1,427,425	1.9
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	234.015	6,201	646,371	0.9
PARK HOTELS & RESORTS INC	141.756	2,398	249,996	0.3
INVITATION HOMES INC	398.505	11,576	1,206,625	1.6
AMERICOLD REALTY TRUST	197.746	6,891	718,295	1.0
VICI PROPERTIES INC	612.57	15,522	1,617,912	2.2
APARTMENT INCOME REIT CO	130.104	4,800	500,391	0.7
VENTAS INC	357.776	16,529	1,722,843	2.3
WEYERHAEUSER CO	129.012	4,270	445,093	0.6
VEREIT INC	377.427	13,228	1,378,839	1.9
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	142.579	5,359	558,625	0.8
SUN COMMUNITIES INC	85.181	12,276	1,279,557	1.7
PROLOGIS INC	195.191	18,476	1,925,834	2.6
SITE CENTERS CORP	209.31	2,122	221,218	0.3

ファンド名	2021年1月12日現在			
	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	%
DUKE REALTY CORP	537.176	20,595	2,146,651	2.9
ESSEX PROPERTY TRUST INC	57.808	13,369	1,393,537	1.9
WELLTOWER INC	302.728	18,520	1,930,433	2.6
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	513.535	14,620	1,523,878	2.1
KILROY REALTY CORP	89.84	4,911	511,931	0.7
PUBLIC STORAGE	111.428	24,653	2,569,628	3.5
UDR INC	360.402	13,352	1,391,772	1.9
WP CAREY INC	101.915	6,764	705,021	1.0
AGREE REALTY CORP	51.679	3,321	346,190	0.5
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	149.531	5,259	548,146	0.7
DIGITAL REALTY TRUST INC	25.005	3,282	342,125	0.5
EXTRA SPACE STORAGE INC	110.391	12,292	1,281,199	1.7
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	302.493	6,306	657,376	0.9
アメリカ・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	7,146.125 31銘柄	333,457 34,756,225	<46.9%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	%
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	384.355	14,455	1,178,998	1.6
カナダ・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	384.355 1銘柄	14,455 1,178,998	<1.6%>

ファンド名	2021年1月12日現在			
	口数	評価額	比率	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(オーストラリア)</b>	千口	千ドル	千円	%
NATIONAL STORAGE REIT	6,252,486	11,754	944,370	1.3
MIRVAC GROUP	13,747,513	35,331	2,838,501	3.8
GOODMAN GROUP	2,140,727	38,704	3,109,507	4.2
CHARTER HALL GROUP	2,479,244	34,312	2,756,685	3.7
INGENIA COMMUNITIES GROUP	2,359.39	11,348	911,751	1.2
オーストラリア・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	26,979.36 5銘柄	131,451 10,560,815	<14.2%>
<b>(香港)</b>	千口	千香港ドル	千円	%
LINK REIT	2,728,792	190,742	2,563,580	3.5
香港ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	2,728,792 1銘柄	190,742 2,563,580	< 3.5%>
<b>(シンガポール)</b>	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT	4,931,141	13,511	1,058,747	1.4
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	5,452.1	8,014	628,023	0.8
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	11,313,632	25,568	2,003,571	2.7
KEPPEL REIT	8,281.8	9,441	739,816	1.0
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	4,649,977	18,041	1,413,764	1.9
シンガポール・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	34,628.65 5銘柄	74,577 5,843,923	< 7.9%>
<b>(ニュージーランド)</b>	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
GOODMAN PROPERTY TRUST	4,335,416	9,841	735,742	1.0
ニュージーランド・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	4,335,416 1銘柄	9,841 735,742	< 1.0%>
<b>(イギリス)</b>	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	6,719,572	5,227	736,809	1.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	1,592,875	10,482	1,477,433	2.0
SEGRO PLC	1,450,083	13,848	1,951,778	2.6
UNITE GROUP PLC/THE	211,682	2,098	295,808	0.4
DERWENT LONDON PLC	115,04	3,527	497,113	0.7
WORKSPACE GROUP PLC	330,933	2,427	342,116	0.5
SAFESTORE HOLDINGS PLC	628,741	5,114	720,881	1.0
BIG YELLOW GROUP PLC	237,024	2,555	360,118	0.5
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	1,159,246	2,677	377,417	0.5
TRITAX BIG BOX REIT PLC	2,447,617	4,075	574,370	0.8
イギリス・ポンド 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	14,892,813 10銘柄	52,035 7,333,847	< 9.9%>
<b>ユーロ (オランダ)</b>	千口	千ユーロ	千円	%
NSI NV	82,711	2,754	349,049	0.5
国小計	口数、金額 銘柄数<比率>	82,711 1銘柄	2,754 349,049	< 0.5%>
<b>ユーロ (ベルギー)</b>	千口	千ユーロ	千円	%
AEDIFICA	122,948	11,852	1,502,027	2.0
COFINIMMO	24,034	2,965	375,855	0.5
WAREHOUSES DE PAUW SCA	52,533	1,494	189,339	0.3
XIOR STUDENT HOUSING NV	71,563	3,542	448,924	0.6
国小計	口数、金額 銘柄数<比率>	271,078 4銘柄	19,854 2,516,146	< 3.4%>
<b>ユーロ (フランス)</b>	千口	千ユーロ	千円	%
ICADE	112,987	7,044	892,779	1.2
ARGAN	39,266	3,376	427,951	0.6
GECINA SA	45.52	5,621	712,440	1.0

ファンド名	2021年1月12日現在			
	口数	評価額	比率	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
KLEPIERRE	千口	千ユーロ	千円	%
COVIVIO	553,055	10,225	1,295,939	1.7
国小計	口数、金額 銘柄数<比率>	104,785 5銘柄	7,759 4,312,451	< 5.8%>
<b>ユーロ (ドイツ)</b>	千口	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	524,189	7,354	932,019	1.3
国小計	口数、金額 銘柄数<比率>	524,189 1銘柄	7,354 932,019	< 1.3%>
<b>ユーロ (スペイン)</b>	千口	千ユーロ	千円	%
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	324,884	2,473	313,528	0.4
国小計	口数、金額 銘柄数<比率>	324,884 1銘柄	2,473 313,528	< 0.4%>
ユーロ通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	2,058,475 12銘柄	66,465 8,423,195	<11.4%>
合計	口数、金額 銘柄数<比率>	93,153,986 66銘柄	- 71,396,328	<96.3%>

(注1) 邦貨換算金額は、2021年1月12日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 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。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の決算日（2020年11月10日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年1月12日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンドの主要な売買銘柄  
投資信託証券

（2020年1月11日から2021年1月12日まで）

買				売					
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
日本プロロジスリート		24.596	7,306,158	297,046	日本プライムリアルティ		17.053	5,723,947	335,656
日本プライムリアルティ		18.957	6,710,727	353,997	ＧＬＰ投資法人		38.733	5,403,075	139,495
日本ビルファンド		8.75	5,167,340	590,553	野村不動産マスターＦ		32.307	4,701,403	145,522
産業ファンド		24.222	3,875,986	160,019	大和ハウスリート投資法人		17.974	4,419,257	245,869
ユナイテッド・アーバン投資法人		30.435	3,730,717	122,579	ケネディクス・オフィス投資法人		6.687	4,038,585	603,945
野村不動産マスターＦ		28.208	3,576,896	126,804	日本プロロジスリート		10.644	3,459,565	325,024
ＧＬＰ投資法人		26.888	3,516,707	130,790	プレミアム投資法人		25.004	2,963,232	118,510
大和ハウスリート投資法人		12.135	3,124,574	257,484	積水ハウス・リート投資		42.821	2,956,073	69,033
ラサールロジポート投資		18.744	3,049,075	162,669	ＡＰＩ投資法人		6.383	2,858,367	447,809
ジャパンリアルエステイト		4.719	2,797,524	592,821	ジャパンリアルエステイト		4.947	2,836,329	573,343

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2021年1月12日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド（32,599,135千口）の内容です。

(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	2021年1月12日現在			
	口数	評価額	比率	率
	千口	千円		%
不動産投信				
エスコンジャパンリート	2.326	283,306		0.3
サンケイリアルエステート	4.56	466,944		0.5
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投	7.498	949,246		1.0
日本アコモデーションファンド投資法人	2.43	1,404,540		1.5
MCUBS MidCity投資法人	9.805	899,118		0.9
森ヒルズリート	10.137	1,499,262		1.6
産業ファンド	15.495	3,083,505		3.2
アドバンス・レジデンス	12.125	3,849,687		4.0
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	17.09	3,136,015		3.3
ＡＰＩ投資法人	1.544	660,060		0.7
ＧＬＰ投資法人	23.97	4,072,503		4.3
コンフォリア・レジデンシャル	2.509	737,395		0.8
日本プロロジスリート	17.205	5,686,252		5.9
On eリート投資法人	1.65	429,495		0.4

ファンド名	2021年1月12日現在			
	口数	評価額	比率	率
	千口	千円		%
イオンリート投資	13.983	1,869,527		2.0
ヒューリックリート投資法	10.558	1,590,034		1.7
日本リート投資法人	4.55	1,628,900		1.7
積水ハウス・リート投資	21.8	1,621,920		1.7
トーセイ・リート投資法人	1.902	215,116		0.2
ケネディクス商業リート	3.517	876,788		0.9
ヘルスケア&メディカル投資	4.759	628,188		0.7
野村不動産マスターＦ	36.12	5,403,552		5.6
ラサールロジポート投資	14.077	2,383,236		2.5
スターアジア不動産投	10.092	496,021		0.5
三井不ロジパーク	5.832	3,009,312		3.1
大江戸温泉リート	1.263	86,894		0.1
森トラスト・ホテルリート投	1.623	183,236		0.2
三菱地所物流ＲＥＩＴ	3.085	1,308,040		1.4

ファン ド 名	2021年1月12日現在		
	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
CREロジスティクスファンド	0.102	15,412	0.0
ザイマックス・リート	10.007	980,686	1.0
伊藤忠アドバンスロジ	0.783	104,608	0.1
日本ビルファンド	14.537	8,576,830	9.0
ジャパンリアルエステイト	10.543	6,199,284	6.5
日本リテールファンド	19.219	3,518,998	3.7
オリックス不動産投資	17.134	2,796,268	2.9
日本プライムリアルティ	4.114	1,396,703	1.5
プレミア投資法人	2.284	285,500	0.3
東急リアル・エステート	7.669	1,223,972	1.3
ユナイテッド・アーバン投資法人	27.095	3,462,741	3.6
森トラスト総合リート	3.304	433,815	0.5
インヴィンシブル投資法人	40.402	1,315,085	1.4
フロンティア不動産投資	1.962	780,876	0.8
福岡リート投資法人	1.171	178,226	0.2
ケネディクス・オフィス投資法人	2.493	1,685,268	1.8
いちごオフィスリート投資法人	8.522	639,150	0.7
大和証券オフィス投資法人	1.95	1,259,700	1.3
阪急阪神リート投資法人	7.784	975,335	1.0
大和ハウスリート投資法人	18.815	4,950,226	5.2
ジャパン・ホテル・リート投資法人	13.288	689,647	0.7
ジャパンエクセレント投資法人	14.781	1,835,800	1.9
合 計	口 数、金額 銘柄数<比率>	489,464 50銘柄	91,762,233 <95.8%>

(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) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘 柄 別	2021年1月12日現在	
	買 建 額	売 建 額
国内 東証REIT	百万円 2,797	百万円 -

(注) 単位未満は切捨て。

## ダイワ北米好配当株マザーファンド

### <補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の決算日（2020年10月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年1月12日）現在におけるダイワ北米好配当株マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

### ■ダイワ北米好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄

#### (1) 株 式

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

買				売			
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
FIRSTENERGY CORP (アメリカ)	42,568	138,717	3,258	TYSON FOODS INC-CL A (アメリカ)	16,399	121,573	7,413
TYSON FOODS INC-CL A (アメリカ)	14,667	98,847	6,739	APPLE INC (アメリカ)	6,414	82,496	12,861
MASTERCARD INC - A (アメリカ)	2,228	71,087	31,906	NEXTERA ENERGY INC (アメリカ)	6,677	79,447	11,898
CONCHO RESOURCES INC (アメリカ)	9,541	55,738	5,841	SALESFORCE.COM INC (アメリカ)	2,271	47,435	20,887
ADOBE INC (アメリカ)	1,17	51,664	44,157	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0,339	47,220	139,294
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A (アメリカ)	1,724	47,411	27,500	CVS HEALTH CORP (アメリカ)	5,595	45,633	8,156
HORMEL FOODS CORP (アメリカ)	9,024	45,849	5,080	AT&T INC (アメリカ)	15,063	44,774	2,972
SALESFORCE.COM INC (アメリカ)	2,271	45,072	19,847	HORMEL FOODS CORP (アメリカ)	9,024	44,473	4,928
MICRON TECHNOLOGY INC (アメリカ)	8,576	43,073	5,022	EOG RESOURCES INC (アメリカ)	8,982	42,950	4,781
VERIZON COMMUNICATIONS INC (アメリカ)	6,697	42,391	6,329	WALT DISNEY CO/THE (アメリカ)	2,504	38,834	15,509

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

#### (2) ハイブリッド優先証券

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

買				売			
銘柄	証券数	金額	平均単価	銘柄	証券数	金額	平均単価
	千証券	千円	円		千証券	千円	円
WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z (アメリカ)	8,561	23,366	2,729	STATE STREET CORP 5.9 D (アメリカ)	7.61	23,083	3,033
WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R (アメリカ)	5,611	16,305	2,905	MORGAN STANLEY 6.375 I (アメリカ)	5,661	16,669	2,944
PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P (アメリカ)	5.88	16,200	2,755	NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.65 N (アメリカ)	5.45	16,128	2,959
US BANCORP 6.5 F (アメリカ)	4,899	13,465	2,748	PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P (アメリカ)	5,155	14,570	2,826
BANK OF AMERICA CORP 5 LL (アメリカ)	4,412	12,892	2,922	SYNOVUS FINANCIAL CORP 5.875 E (アメリカ)	6.05	13,833	2,286
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R (アメリカ)	4,653	12,462	2,678	US BANCORP 6.5 F (アメリカ)	4,899	13,744	2,805
SEMPRA ENERGY 5.75 (アメリカ)	3,579	9,889	2,763	LEGG MASON INC 5.45 (アメリカ)	4,618	12,029	2,604
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 4.8 J (アメリカ)	3,668	9,788	2,668	WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R (アメリカ)	4,055	11,961	2,949
STATE STREET CORP 5.9 D (アメリカ)	3,104	9,304	2,997	AMERICAN FINANCIAL GROUP 5.875 (アメリカ)	4,175	11,761	2,817
CMS ENERGY CORP 5.875 (アメリカ)	3,361	9,007	2,679	DUKE ENERGY CORP 5.75 A (アメリカ)	3,425	10,641	3,106

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2021年1月12日現在におけるダイワ北米好配当株マザーファンド（946,303千口）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	2021年1月12日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ABBOTT LABORATORIES	25.84	286	29,852	ヘルスケア
ADOBE INC	10.02	475	49,528	情報技術
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8.33	235	24,582	素材
DOLLAR TREE INC	11.54	129	13,523	一般消費財・サービス
ALBEMARLE CORP	12.13	215	22,414	素材
DANAHER CORP	12.81	312	32,594	ヘルスケア
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	36.05	424	44,206	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	47.37	246	25,694	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	15.58	203	21,187	情報技術
APPLE INC	73.16	943	98,353	情報技術
BOEING CO/THE	12.52	258	26,985	資本財・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	127.59	733	76,414	コミュニケーション・サービス
JPMORGAN CHASE & CO	61	842	87,772	金融
CATERPILLAR INC	13.51	261	27,298	資本財・サービス
MORGAN STANLEY	48.59	369	38,520	金融
BROADCOM INC	12.89	574	59,888	情報技術
DEERE & CO	9.91	292	30,462	資本財・サービス
TELEFLEX INC	5.54	223	23,320	ヘルスケア
COLGATE-PALMOLIVE CO	27.29	224	23,364	生活必需品
ACTIVISION BLIZZARD INC	30.94	281	29,317	コミュニケーション・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9.02	195	20,401	ヘルスケア
AMAZON.COM INC	2.98	928	96,729	一般消費財・サービス
EXXON MOBIL CORP	53.96	252	26,343	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC	32.32	257	26,845	公益事業
GENERAL ELECTRIC CO	168.23	192	20,077	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	57.75	259	27,092	一般消費財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	12.64	371	38,711	金融
ALPHABET INC-CL A	1.31	230	23,980	コミュニケーション・サービス
FIRSTENERGY CORP	425.68	1,285	133,993	公益事業
HOME DEPOT INC	10.83	293	30,616	一般消費財・サービス
JOHNSON & JOHNSON	39.17	624	65,065	ヘルスケア
RENEWABLE ENERGY GROUP INC	45.79	393	40,964	エネルギー
MCDONALD'S CORP	14.23	304	31,774	一般消費財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	8.5	218	22,754	コミュニケーション・サービス
CONCHO RESOURCES INC	39.7	262	27,393	エネルギー
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11.38	197	20,602	情報技術
MERCK & CO. INC.	21.96	186	19,455	ヘルスケア
NIKE INC -CL B	12.57	184	19,266	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	15.15	385	40,167	資本財・サービス
NORTHROP GRUMMAN CORP	8.29	244	25,467	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	23.32	191	20,006	生活必需品
PFIZER INC	85.71	323	33,742	ヘルスケア
PROCTER & GAMBLE CO/THE	16.43	226	23,606	生活必需品
VIATRIS INC	10.63	19	2,046	ヘルスケア
TEXAS INSTRUMENTS INC	15.7	268	28,033	情報技術
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	25.77	417	43,475	資本財・サービス
ANTHEM INC	14.75	499	52,082	ヘルスケア

銘柄	2021年1月12日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円	
WALT DISNEY CO/THE	18.01	322	33,618	コミュニケーション・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	29.82	349	36,377	資本財・サービス
WALMART INC	8.94	131	13,724	生活必需品
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	17.24	713	74,354	情報技術
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14.35	285	29,798	金融
VISA INC-CLASS A SHARES	37.3	794	82,766	情報技術
NVIDIA CORP	3.3	179	18,740	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	27.41	436	45,533	金融
TYSON FOODS INC-CL A	35.74	231	24,127	生活必需品
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	7.98	409	42,698	ヘルスケア
MASTERCARD INC - A	22.28	775	80,860	情報技術
BANK OF AMERICA CORP	170.47	563	58,759	金融
EATON CORP PLC	26.71	339	35,345	資本財・サービス
ECOLAB INC	10.75	237	24,769	素材
INTEL CORP	63.58	327	34,155	情報技術
MICROSOFT CORP	58.32	1,268	132,205	情報技術
MEDTRONIC PLC	33.37	395	41,216	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	50.43	396	41,351	情報技術
COMCAST CORP-CLASS A	44.31	228	23,794	コミュニケーション・サービス
アメリカ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,466.69 66銘柄	25,138 <81.7%>	
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル	千円	
ENBRIDGE INC	72.22	306	25,015	エネルギー
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	72.22 1銘柄	306 < 0.8%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,538.91 67銘柄	2,645,193 <82.4%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2021年1月12日現在の時価を対顧客物電信売買相場  
の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで  
邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

銘柄	2021年1月12日現在		
	証券数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千証券	千アメリカ・ドル	千円
CHS INC 7.5 4	4.575	131	13,757
JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA	4.2	107	11,158
WELLS FARGO & COMPANY 5.7 W	2.929	74	7,720
FIRST REPUBLIC BANK 5.5 G	2.175	55	5,738
STATE STREET CORP 5.35 G	0.914	25	2,619
REINSURANCE GRP OF AMER 5.75	2.558	71	7,494
WELLS FARGO & COMPANY 5.5 X	4.55	116	12,169
ENTERGY LOUISIANA LLC 4.875 *	1.2	31	3,233
ARCH CAPITAL GROUP LTD 5.25 E	1.2	30	3,195
MORGAN STANLEY 5.85 K	1.433	39	4,155
AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	2.1	53	5,616
FIRST REPUBLIC BANK 5.125 H	2.582	67	7,064
VALLEY NATIONAL BANCORP 5.5 B	2.076	53	5,554
SOUTHERN CO 5.25	1.961	51	5,367
ENBRIDGE INC 6.375 B	0.497	13	1,373
BANK OF AMERICA CORP 6 GG	2.725	73	7,671
UNUM GROUP 6.25	3.35	87	9,162
RENAISSANCE HOLDINGS L 5.75 F	6.45	176	18,413
KKR & CO INC 6.5 B	0.75	19	2,027
KEYCORP 5.65 F	0.952	25	2,606
JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	4.088	110	11,530
NISOURCE INC 6.5 B	2.81	78	8,139
JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	2.45	67	7,022
CMS ENERGY CORP 5.875	3.224	87	9,076
AMERICAN INTL GROUP 5.85 A	5.825	158	16,532
DUKE ENERGY CORP 5.75 A	1.818	50	5,241
REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	1.746	49	5,154
ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.2 19-A	0.909	24	2,600
SPIRE INC 5.9 A	3.556	97	10,155
ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	2.1	59	6,172
VOYA FINANCIAL INC 5.35 B	0.638	17	1,842
TCF FINANCIAL 5.7 C*	0.4	10	1,090
ALLSTATE CORP 5.1 H	4.375	114	11,947
SEMPRA ENERGY 5.75	6.407	172	17,937
FIFTH THIRD BANCORP 6 A	1.923	51	5,325
BANK OF AMERICA CORP 5 LL	4.412	114	11,928
AEGON FUNDING CO LLC 5.1	6.414	164	17,187
SYNCHRONY FINANCIAL 5.625 A	6.734	176	18,354
FIRST REPUBLIC BANK 4.7 J	3.025	77	8,027
METLIFE INC 4.75 F	2.525	64	6,721
SOUTHERN CO 4.95 2020	8.035	209	21,866
WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	8.561	215	22,414
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 4.8 J	1.604	40	4,182

銘柄	2021年1月12日現在		
	証券数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千証券	千アメリカ・ドル	千円
DIME COMMUNITY BANCSHRS 5.5 A	2.375	59	6,205
ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	1.95	53	5,544
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	3.578	93	9,755
UNITED STATES CELLULAR C 6.25	2.56	66	6,942
SOUTHERN CO 4.2 C	2.625	66	6,916
BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	1.675	41	4,327
BRIGHTHOUSE FINANCIAL IN 5.375 C	1.7	43	4,520
US CELLULAR CORP 5.5	1.75	43	4,499
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 A	1.444	37	3,857
MORGAN STANLEY 6.875 F	2.589	71	7,491
ALLY FINANCIAL FR 2/15/40	1.963	51	5,348
WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R	1.556	43	4,578
PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P	1.9	50	5,267
MORGAN STANLEY 6.375 I	2.89	80	8,419
WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	7.76	203	21,231
合計	証券数、金額	171,071	4,523
	銘柄数<比率>	58銘柄	<14.7%>

(注1) 邦貨換算金額は、2021年1月12日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 外国投資信託証券

銘柄	2021年1月12日現在		
	□ 数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千□	千アメリカ・ドル	千円
UMH PROPERTIES INC 6.75 C	1.2	30	3,143
MONMOUTH REIT 6.125 C	2.875	72	7,506
SPIRIT REALTY CAPITAL IN 6 A	1.35	34	3,635
QTS REALTY TRUST INC 7.125 A	1.175	31	3,279
AMERICAN HOMES 4 RENT 6.25 H	1.363	36	3,757
TAUBMAN CENTERS INC 6.5 J	1	25	2,608
合計	□ 数、金額	8,963	229
	銘柄数<比率>	6銘柄	<0.7%>

(注1) 邦貨換算金額は、2021年1月12日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の決算日（2020年10月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年1月12日）現在におけるダイワ欧州好配当株マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ欧州好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄  
株 式

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

買		付			売		付		
銘柄	柄	株数	金額	平均単価	銘柄	柄	株数	金額	平均単価
		千株	千円	円			千株	千円	円
UNILEVER PLC (イギリス)		3.752	24,695	6,581	KONINKLIJKE DSM NV (オランダ)		1.537	25,720	16,734
TESCO PLC (イギリス)		71.252	22,507	315	ALSTOM (フランス)		4.76	25,346	5,324
AXA SA (フランス)		12.126	21,596	1,781	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC (イギリス)		5.047	18,877	3,740
M&G PLC (イギリス)		53.921	8,803	163	GIVAUDAN-REG (スイス)		0.03	13,111	437,038
NATIONAL GRID PLC (イギリス)		7.201	8,641	1,200	ABN AMRO BANK NV-CVA (オランダ)		7.197	6,726	934
VODAFONE GROUP PLC (イギリス)		38.881	6,176	158	KINGFISHER PLC (イギリス)		30.751	6,049	196
ELECTROLUX AB-SER B (スウェーデン)		2.486	5,940	2,389	ALCON INC (スイス)		0.877	5,657	6,450
NOKIA OYJ (フィンランド)		8.494	3,105	365	ENI SPA (イタリア)		5.33	5,175	971
ALSTOM (フランス)		0.613	2,749	4,484	ZURICH INSURANCE GROUP AG (スイス)		0.131	4,800	36,644
					KONINKLIJKE PHILIPS NV (オランダ)		0.779	4,244	5,448

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2021年1月12日現在におけるダイワ欧州好配当株マザーファンド（740,519千円）の内容です。

外国株式

銘柄	柄	2021年1月12日現在		業種等
		株数	価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	千イギリス・ポンド	千円	
UNILEVER PLC	37.52	165	23,352	生活必需品
PRUDENTIAL PLC	148.44	210	29,718	金融
AVIVA PLC	406.69	140	19,815	金融
GLAXOSMITHKLINE PLC	159	221	31,261	ヘルスケア
M&G PLC	687.65	135	19,049	金融
TESCO PLC	712.52	174	24,543	生活必需品
VODAFONE GROUP PLC	1,355.23	173	24,506	コミュニケーション・サービス
NATIONAL GRID PLC	178.73	156	22,106	公益事業
HSBC HOLDINGS PLC	434.04	177	24,971	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	117.61	171	24,240	エネルギー
イギリス・ポンド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,237.43 10銘柄	1,728 243,564 <18.7%>	
(スイス)	百株	千スイス・フラン	千円	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	13.13	410	48,097	ヘルスケア
NESTLE SA-REG	55.78	561	65,704	生活必需品
ZURICH INSURANCE GROUP AG	9.03	345	40,474	金融
NOVARTIS AG-REG	43.89	367	43,065	ヘルスケア

銘柄	柄	2021年1月12日現在		業種等
		株数	価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
GIVAUDAN-REG	百株	千スイス・フラン	千円	素材
	1.08	404	47,307	
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	122.91 5銘柄	2,089 <18.8%>	
(スウェーデン)	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ELECTROLUX AB-SER B	24.86	466	5,860	一般消費財・サービス
スウェーデン・クローネ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	24.86 1銘柄	466 <0.5%>	
ユーロ (オランダ)	百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	77.85	350	44,455	ヘルスケア
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	65.06	152	19,367	生活必需品
KONINKLIJKE DSM NV	22.61	324	41,117	素材
KONINKLIJKE KPN NV	879.29	233	29,629	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,044.81 4銘柄	1,061 <10.3%>	
ユーロ (フランス)	百株	千ユーロ	千円	
TOTAL SE	62.99	232	29,468	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	21.55	231	29,290	一般消費財・サービス

# ダイワ欧州好配当株マザーファンド

銘柄	株数	2021年1月12日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	44.43	563	71,396	資本財・サービス
BNP PARIBAS	39.9	179	22,744	金融
CAPGEMINI SE	18.83	232	29,423	情報技術
AXA SA	121.26	245	31,118	金融
SANOFI	38.93	308	39,093	ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	347.89 7銘柄	1,992 <19.4%>	252,534
ユーロ (ドイツ)	百株	千ユーロ	千円	
SIEMENS AG-REG	28	347	43,993	資本財・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	29.96	207	26,312	一般消費財・サービス
BASF SE	36.76	248	31,468	素材
ALLIANZ SE-REG	11.45	232	29,500	金融
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12.39	297	37,762	金融
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	211.45	321	40,704	コミュニケーション・サービス
DEUTSCHE POST AG-REG	68.23	279	35,408	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	398.24 7銘柄	1,934 <18.8%>	245,150
ユーロ (スペイン)	百株	千ユーロ	千円	
ENAGAS SA	101.15	183	23,266	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	101.15 1銘柄	183 < 1.8%>	23,266
ユーロ (イタリア)	百株	千ユーロ	千円	
INTESA SANPAOLO	1,005.55	195	24,757	金融
ENI SPA	129.35	116	14,717	エネルギー
ENEL SPA	481.53	430	54,604	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,616.43 3銘柄	742 < 7.2%>	94,079
ユーロ (フィンランド)	百株	千ユーロ	千円	
NOKIA OYJ	287.71	90	11,468	情報技術
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	287.71 1銘柄	90 < 0.9%>	11,468
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,796.23 23銘柄	6,005 <58.5%>	761,071
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	8,181.43 39銘柄	- <96.4%>	1,255,145

(注1) 邦貨換算金額は、2021年1月12日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の決算日（2020年10月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年1月12日）現在におけるダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄  
株 式

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

買		付			売		付		
銘柄	柄	株数	金額	平均単価	銘柄	柄	株数	金額	平均単価
		千株	千円	円			千株	千円	円
SK HYNIX INC (韓国)		3	28,114	9,371	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)		24	35,165	1,465
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR (香港)		5.7	22,676	3,978	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD (韓国)		5.65	34,249	6,061
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD (オーストラリア)		14.3	20,060	1,402	CSL LTD (オーストラリア)		1.3	27,467	21,129
BHP GROUP LTD (オーストラリア)		6.1	17,789	2,916	HYUNDAI MOTOR CO (韓国)		0.9	19,100	21,222
WILMAR INTERNATIONAL LTD (シンガポール)		47.3	15,026	317	WOOLWORTHS GROUP LTD (オーストラリア)		6.4	18,769	2,932
KB FINANCIAL GROUP INC (韓国)		3.8	14,407	3,791	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)		41	18,067	440
WESTPAC BANKING CORP (オーストラリア)		9.6	14,121	1,471	LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A (中国)		9.57	16,374	1,711
AIA GROUP LTD (香港)		12.2	13,983	1,146	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)		31	16,027	517
KWG GROUP HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)		86.5	13,650	157	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS (シンガポール)		80.6	14,747	182
NAVER CORP (韓国)		0.55	13,585	24,700	LG CHEM LTD (韓国)		0.24	14,528	60,533

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2021年1月12日現在におけるダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド（281,837千口）の内容です。

外国株式

銘柄	柄	2021年1月12日現在		業種等
		株数	評価額	
		株数	外貨建金額	邦貨換算金額
(オーストラリア)	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
BHP GROUP LTD	102	474	38,105	素材
SOUTH32 LTD	409	106	8,543	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	63	160	12,886	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	42	105	8,506	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	127	294	23,681	金融
WESTPAC BANKING CORP	121	245	19,724	金融
RIO TINTO LTD	7	85	6,883	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	37.5	319	25,656	金融
MACQUARIE GROUP LTD	20	280	22,496	金融
CSL LTD	6	165	13,301	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	53	272	21,881	一般消費財・サービス
JB HI-FI LTD	17	84	6,796	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,004.5 12銘柄	2,594	208,464 <27.3%>
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	37	1,665	22,387	金融

銘柄	柄	2021年1月12日現在		業種等
		株数	評価額	
		株数	外貨建金額	邦貨換算金額
		百株	千香港ドル	千円
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	820	496	6,678	金融
AIA GROUP LTD	154	1,522	20,459	金融
CHINA RESOURCES CEMENT	420	394	5,300	素材
SANDS CHINA LTD	260	832	11,182	一般消費財・サービス
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	280	468	6,299	金融
香港ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,971 6銘柄	5,380	72,307 <9.5%>
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	65	174	13,711	金融
VENTURE CORP LTD	40	80	6,303	情報技術
WILMAR INTERNATIONAL LTD	391	197	15,441	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>	496 3銘柄	452	35,456 <4.6%>
(台湾)	百株	千台湾ドル	千円	
MEDIATEK INC	100	8,510	31,657	情報技術
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	850	2,554	9,501	金融

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

銘柄	2021年1月12日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千台湾ドル	千円	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO.LT	1,410	2,812	10,464	金融
WIN SEMICONDUCTORS CORP	110	4,334	16,122	情報技術
POYA INTERNATIONAL CO.LTD	40	2,312	8,600	一般消費財・サービス
MERIDA INDUSTRY CO.LTD	50	1,227	4,566	一般消費財・サービス
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	330	19,272	71,691	情報技術
台湾ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,890 7銘柄	41,022 <20.0%>	
(韓国)	百株	千韓国ウォン	千円	
SK HYNIX INC	22	292,600	27,797	情報技術
HYUNDAI MOTOR CO	5	133,750	12,706	一般消費財・サービス
POSCO	2	56,800	5,396	素材
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	7	80,500	7,647	資本財・サービス
HYUNDAI MOBIS CO.LTD	3	105,750	10,046	一般消費財・サービス
KT&G CORP	8	65,520	6,224	生活必需品
NAVER CORP	4.5	139,050	13,209	コミュニケーション・サービス
KIWOOM SECURITIES CO.LTD	5	81,000	7,695	金融
LG CHEM LTD	1.6	159,680	15,169	素材
KB FINANCIAL GROUP INC	53	243,270	23,110	金融
SAMSUNG ELECTRONICS CO.LTD	81	737,100	70,024	情報技術
HANA FINANCIAL GROUP	41	154,570	14,684	金融
HANWHA SOLUTIONS CORP	14	79,520	7,554	素材
韓国ウォン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	247.1 13銘柄	2,329,110 <29.0%>	
(中国)	百株	千オフショア人民元	千円	
KWEICHOW MOUTAI CO.LTD-A	2.6	545	8,789	生活必需品
オフショア人民元 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2.6 1銘柄	545 <1.2%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	6,611.2 42銘柄	- <91.6%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2021年1月12日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の決算日（2020年10月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年1月12日）現在におけるダイワ好配当日本株マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ好配当日本株マザーファンドの主要な売買銘柄  
株 式

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

買					付					売					付				
銘柄	柄	株数	金額	平均単価	銘柄	柄	株数	金額	平均単価	銘柄	柄	株数	金額	平均単価	銘柄	柄	株数	金額	平均単価
		千株	千円	円			千株	千円	円			千株	千円	円			千株	千円	円
日立		88.5	292,077	3,300	Zホールディングス		786.4	474,833	603										
富士フィルムHLDGS		43.2	233,356	5,401	三菱商事		88.3	215,687	2,442										
AGC		66.6	226,113	3,395	アステラス製薬		100	175,643	1,756										
富士電機		58	203,441	3,507	MCJ		161.7	135,243	836										
パナソニック		122.1	151,908	1,244	三菱電機		75	116,441	1,552										
大日本印刷		67.9	150,103	2,210	SUMCO		70	114,404	1,634										
フジシールインターナショナル		52.1	106,774	2,049	パナソニック		122.1	107,193	877										
三井倉庫HOLD		57.6	106,415	1,847	ブリヂストン		30	104,365	3,478										
ディップ		48.8	99,396	2,036	日本電信電話		38	101,649	2,674										
日本曹達		32	98,624	3,082	電通グループ		37.5	98,384	2,623										

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2021年1月12日現在におけるダイワ好配当日本株マザーファンド（5,432,945千口）の内容です。

国内株式

銘柄	柄	2021年1月12日現在				銘柄	柄	2021年1月12日現在				銘柄	柄	2021年1月12日現在					
		株数	評価額	株数	評価額			株数	評価額	株数	評価額								
		千株	千円				千株	千円				千株	千円						
<b>鉱業 (0.3%)</b>					日本曹達		32	100,640		日本特殊陶業		32.6	60,799						
国際石油開発帝石		75	46,350		大阪ソーダ		22.3	61,548		ニチアス		53.5	134,285						
<b>建設業 (4.4%)</b>					信越化学		9.3	182,698		<b>鉄鋼 (0.3%)</b>									
ミライト・ホールディングス		15	26,535		四国化成		46.9	58,296		日本冶金工		25.1	45,456						
熊谷組		30	80,790		三菱瓦斯化学		52.8	125,875		<b>非鉄金属 (2.7%)</b>									
五洋建設		135	125,550		東京応化工業		11.5	89,470		大紀アルミニウム		53.7	42,637						
住友林業		39.2	84,946		旭有機材		58.4	90,111		三井金属		39.3	158,968						
大和ハウス		35.7	110,455		リケンテクノス		52.4	25,518		住友鉱山		27.5	138,517						
協和エクシオ		28	81,032		ダイキアクシス		28.5	33,658		アサヒHD		23.6	92,984						
九電工		31	102,300		第一工業製薬		49.5	218,047		<b>金属製品 (2.3%)</b>									
OSJB HD		310.4	87,222		三洋化成		6.2	34,906		川田テクノロジーズ		13.4	57,553						
<b>食料品 (1.4%)</b>					太陽ホールディングス		11	68,860		信和		55.8	39,060						
ブルボン		23.2	47,838		富士フィルムHLDGS		43.2	260,150		三和ホールディングス		96.5	118,019						
太陽化学		23	40,664		デクセリアルズ		151.2	205,632		日東精工		121.7	55,130						
日本たばこ産業		66.8	136,806		藤森工業		10.6	50,880		マルゼン		32.6	59,821						
<b>繊維製品 (1.1%)</b>					信越ポリマー		130.4	125,966		ファインシンター		19.5	29,659						
東洋紡		32.1	45,293		<b>医薬品 (4.0%)</b>					<b>機械 (6.5%)</b>									
富士紡ホールディングス		16.7	66,299		武田薬品		110	419,650		タクマ		58.9	123,690						
セーレン		42.3	69,372		大塚ホールディングス		50	220,100		DMG森精機		30	50,070						
<b>化学 (13.2%)</b>					<b>ゴム製品 (0.3%)</b>					ソディック		68.7	62,585						
旭化成		192.9	219,713		TOYO TIRE		29.5	47,495		技研製作所		21.2	90,524						
共和レザー		67.9	44,678		<b>ガラス・土石製品 (2.8%)</b>					クボタ		46.9	107,213						
クレハ		15	106,500		AGC		66.6	247,752		荏原実業		11.7	47,794						

ダイワ好配当日本株マザーファンド

銘柄	2021年1月12日現在		銘柄	2021年1月12日現在	
	株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円
三精テクノロジーズ	30	17,940	TOKAIホールディングス	194.7	199,372
ダイフク	11	146,960	三洋貿易	149.2	150,095
キトー	59.7	92,952	コメダホールディングス	32.8	60,876
日本トムソン	138.8	59,684	萩原電気HLDGS	18.2	47,702
IHI	79.9	164,753	ダイトロン	57.1	92,787
スター精密	42.5	68,340	伊藤忠	72.7	225,806
<b>電気機器 (12.2%)</b>			三井物産	119	233,240
日立	88.5	385,152	スターゼン	10.8	46,548
富士電機	58	242,730	稲畑産業	43	62,823
マブチモーター	22.4	96,432	日鉄物産	29.5	115,492
愛知電機	20	50,020	<b>小売業 (0.9%)</b>		
EIZO	13.3	48,013	バルグループHLDGS	68.6	82,663
TDK	11.5	188,600	コジマ	81.1	56,202
アドバンテスト	33.9	280,014	<b>銀行業 (5.8%)</b>		
村田製作所	24	242,640	三菱UFJフィナンシャルG	664.7	328,561
リコー	111.8	78,260	りそなホールディングス	150	58,200
東京エレクトロン	7.8	318,240	三井住友トラストHD	45.1	150,092
<b>輸送用機器 (5.8%)</b>			三井住友フィナンシャルG	99	344,520
豊田自動織機	13.9	117,594	セブン銀行	151.8	34,458
デンソー	25.4	154,051	<b>証券、商品先物取引業 (1.1%)</b>		
トヨタ自動車	52.2	411,962	SBIホールディングス	65	173,875
ミクニ	69.7	19,028	<b>保険業 (4.6%)</b>		
本田技研	77.6	224,108	SOMPホールディングス	20	85,200
<b>精密機器 (0.6%)</b>			MS&AD	55	179,575
ナカニシ	15.3	32,925	第一生命HLDGS	40	71,000
セイコーHD	41	56,416	東京海上HD	69.6	387,880
<b>その他製品 (3.0%)</b>			<b>その他金融業 (2.9%)</b>		
トランザクション	37.8	36,174	プレミアグループ	85.6	218,879
フジシールインターナショナル	52.1	105,189	オリックス	135	247,927
大日本印刷	67.9	128,398	<b>不動産業 (1.4%)</b>		
リンテック	23.6	55,790	ハウスドゥ	49.3	59,653
任天堂	2.3	153,065	三井不動産	17.5	36,303
<b>陸運業 (1.0%)</b>			東京建物	85	125,885
丸全昭和運輸	14.6	52,779	<b>サービス業 (2.6%)</b>		
センコーグループHLDGS	110.1	111,641	日本工営	7.9	22,396
<b>倉庫・運輸関連業 (0.9%)</b>			ディップ	33.7	89,439
三井倉庫HOLD	57.6	135,129	日本空調サービス	78.7	59,890
<b>情報・通信業 (8.1%)</b>			テクノプロ・ホールディング	8.7	79,431
日鉄ソリューションズ	17.5	56,350	ベルシステム24HLDGS	65.7	113,069
SRAホールディングス	7.8	20,326	日本管財	10.4	21,580
伊藤忠テクノソリューションズ	12.3	45,448	丹青社	35.7	29,059
アルゴグラフィックス	29.5	90,122			
日本ユニシス	12	49,140	合 計	株数、金額 銘柄数<比率>	千株 15,882,391 137銘柄 <98.6%>
日本電信電話	132	362,340			
KDDI	95	304,570			
ソフトバンク	149.2	201,793			
シーエーシー	29	44,051			
コナミホールディングス	18.2	111,202			
<b>卸売業 (9.8%)</b>					
エレマテック	22.8	23,962			
アルコニックス	66.3	98,588			
あいホールディングス	23.8	48,647			
ダイワポウHD	13.5	128,790			
レスターホールディングス	11.7	27,214			

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

# 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

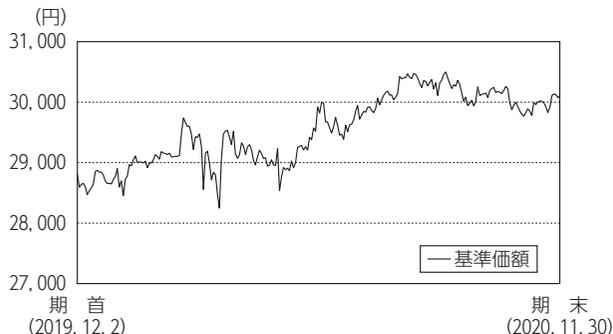
## 大和アセットマネジメント

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



《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。

○ 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。

年 月 日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率		
(期首) 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。

■ 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
外 国	アメリカ	千アメリカ・ドル 244, 186	千アメリカ・ドル 221, 904 ( —)
	カナダ	千カナダ・ドル 18, 392	千カナダ・ドル 9, 377 ( —)
	オーストラリア	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	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	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	千イスラエル・シケル 30, 447	千イスラエル・シケル 544 ( —)
	デンマーク	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	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	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	千メキシコ・ペソ 81, 550	千メキシコ・ペソ 32, 935 ( —)
	マレーシア	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	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	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)	千ユーロ 4, 308	千ユーロ 849 ( —)
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 7, 400	千ユーロ 2, 393 ( —)
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 10, 174	千ユーロ 3, 003 ( —)
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 50, 275	千ユーロ 21, 351 ( —)
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 49, 813	千ユーロ 15, 873 ( —)
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 29, 263	千ユーロ 10, 586 ( —)
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 43, 888	千ユーロ 22, 171 ( —)
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 2, 826	千ユーロ 626 ( —)
	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 6, 786	千ユーロ 2, 319 ( —)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	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		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 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				
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
区 分				%	%	%	%	%
アメリカ	千アメリカ・ドル 820,457	千アメリカ・ドル 897,323	千円 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・シユケル 25,400	千イスラエル・シユケル 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 率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ユ ー ロ	アイルランド	千ユーロ 11,943	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、価格情報会社よりデータを入手しています。

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ア メ リ カ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	千アメリカ・ドル 2,153	千アメリカ・ドル 2,191	千円 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

区 分	銘 柄	種 類	当 期		未			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	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	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	2,579	267,959	2044/11/15	
	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	

区 分	銘 柄	種 類	当 期		未			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	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		
					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

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	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

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	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		
				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル			
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	405	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		

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 金 額	28銘柄		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 金 額	18銘柄		10,378	11,857	921,200		

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	当 期		末			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千イギリス・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 金 額	48銘柄		78,966	104,078	14,420,010		

区 分		当 期				末		
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
イスラエル		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	千イスラエル・シユケル 2,000	千イスラエル・シユケル 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 金 額	16銘柄			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 金 額	8銘柄			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 金 額	8銘柄			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 金 額	8銘柄			50,870	56,926	695,644	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期				未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額			
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
				%	千メキシコ・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		

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		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,150	1,272	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 金 額	21銘柄			27,805	34,178	4,251,147	
ユーロ (ベルギー)		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,699	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 金 額	29銘柄			35,009	44,357	5,517,247	
ユーロ (フランス)		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	1,985	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			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
		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 金 額	45銘柄			148,837	183,176	22,783,533	
ユーロ (ドイツ)				千ユーロ	千ユーロ			
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,189	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

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千ユーロ	千円	
	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 金 額	51銘柄		107,345	130,943	16,286,782	
ユーロ (スペイン)				千ユーロ	千ユーロ		
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	3,984	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			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,367	294,410	2024/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,962	368,501	2029/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,360	1,424	177,171	2030/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,460	2,494	310,224	2023/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,529	190,279	2025/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,200	1,242	154,572	2050/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,569	319,554	2027/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,900	3,241	403,239	2030/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	900	996	123,938	2040/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	3,261	405,679	2032/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,854	2,954	367,519	2037/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	2,158	3,906	485,844	2040/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	1,969	245,000	2024/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	2,473	4,434	551,558	2041/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,189	2,717	338,058	2025/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,671	332,261	2026/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,126	264,536	2022/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	1,958	2,214	275,402	2023/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	2,179	271,029	2023/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,515	312,852	2028/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	2,566	319,167	2044/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,265	281,746	2024/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,367	294,515	2024/10/31	
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	2023/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,577	196,257	2026/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,414	424,642	2027/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	2,007	249,735	2024/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	2,126	264,508	2046/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,629	1,669	207,658	2022/04/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,666	331,635	2025/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	2,284	284,131	2032/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,891	2,083	259,169	2025/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,555	193,448	2022/09/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	2,077	258,454	2047/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,359	1,400	174,209	2023/03/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,786	1,938	241,155	2026/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	2,754	342,572	2036/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	1,141	141,922	2026/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	1,550	1,593	198,260	2023/10/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,358	1,368	170,230	2021/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	1,288	160,307	2067/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,798	223,716	2033/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,705	212,148	2027/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,394	173,441	2024/05/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	2,050	2,095	260,682	2022/04/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,850	2,710	337,117	2048/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,700	3,028	376,712	2027/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,700	1,738	216,264	2022/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,703	211,883	2024/11/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,686	209,823	2038/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	2,358	293,296	2028/02/01	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	当 期				未			償還年月日
	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	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)	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	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千ユーロ	千円	
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	204	25,396	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	496	61,731	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	770	777	96,759	2022/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	860	107,019	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	370	439	54,677	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	541	67,346	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	544	67,708	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	205	25,556	2024/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	324	40,409	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	427	53,167	2040/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	500	520	64,777	2030/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	813	101,216	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	489	60,843	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	312	325	40,480	2022/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	470	58,472	2023/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	651	81,044	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	578	71,937	2024/04/15
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)	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	1,373	1,502	186,894	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,220	151,765	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	1,090	135,652	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	409	50,950	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	—	900	917	114,077	2023/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,780	1,910	237,664	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	1,225	152,459	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	405	50,414	2022/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	900	987	122,878	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	980	1,063	132,311	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	800	820	102,093	2024/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	—	680	708	88,063	2030/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,000	1,017	126,528	2023/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	842	104,810	2051/03/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	404	50,317	2040/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,209	150,419	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,673	2,878	358,056	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,137	141,423	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	845	105,156	2022/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	943	117,371	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	831	103,397	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	1,102	137,079	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,028	127,899	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	1,054	131,133	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,019	126,773	2024/10/21
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。

# 外国債券インデックスマザーファンド

## ■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
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
<b>(A) 資産</b>	<b>221,017,451,889円</b>
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>(B) 負債</b>	<b>2,181,996,278</b>
未払金	2,110,180,468
未払解約金	71,815,810
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>218,835,455,611</b>
元本	72,688,498,430
次期繰越損益金	146,146,957,181
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>72,688,498,430口</b>
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3 0 V A (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5 0 V A (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3 0 V A (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5 0 V A (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-1'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3 0 819,754,500円、ダイワ・ライフ・バランス5 0

459,770,424円、ダイワ・ライフ・バランス7 0 279,428,323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3 0 3,047,233円、ダイワつみたてインデックスバランス5 0 977,653円、ダイワつみたてインデックスバランス7 0 951,206円、ダイワ世界バランスファンド4 0 V A174,483,363円、ダイワ世界バランスファンド6 0 V A131,594,279円、ダイワ・バランスファンド3 5 V A4,234,846,474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) 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2 5 33,396,711円、ダイワライフスタイル5 0 59,767,812円、ダイワライフスタイル7 5 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
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>4,034,330,893円</b>
受取利息	4,037,282,101
支払利息	△ 2,951,208
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>4,567,605,912</b>
売買益	11,533,587,280
売買損	△ 6,965,981,368
<b>(C) その他費用</b>	<b>△ 33,084,010</b>
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>8,568,852,795</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>124,346,492,561</b>
<b>(F) 解約差損益金</b>	<b>△ 13,361,915,838</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>26,593,527,663</b>
<b>(H) 合計(D+E+F+G)</b>	<b>146,146,957,181</b>
次期繰越損益金(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。

# ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

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（B P I）の運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

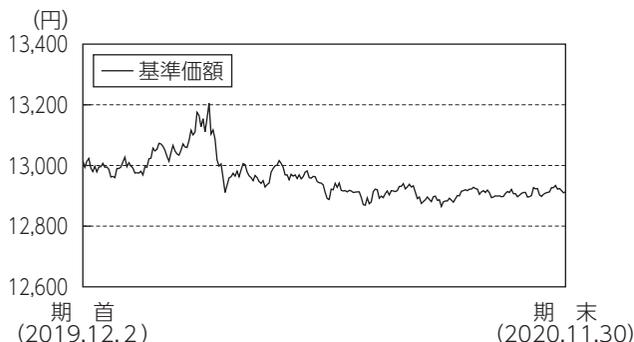
運用方針	投資成果をNOMURA-BPI総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総 合 指 数		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	%	騰 落 率	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、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、長期金利は低下しました。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)

国	内	債種	買付額		売付額	
			千円	千円	千円	千円
		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)

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			末		
	額面金額	評価額	組入比率	うち8B格以下 組入比率		
	千円	千円	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	19,067,000	20,457,090	85.4	%	%	%
地方債証券	1,500,000	1,559,084	6.5	—	3.5	2.6
特殊債券 (除く金融債券)	800,000	833,568	3.5	—	1.4	1.7
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

(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			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		

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド ( B P I )

区 分	当 期			未 期		
	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

区 分	当 期			未 期		
	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	1.6000	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)

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率	未		償 還 年 月 日
			額 面 金 額	評 価 額	
		%	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

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率	未		償 還 年 月 日
			額 面 金 額	評 価 額	
		%	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	2023/05/31
	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 パナソニック	0.4700	100,000	100,997	2026/09/18
	80 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	-----

(注) 単位未満は切捨て。

# ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

## ■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
<b>(A) 資産</b>	<b>24,162,518,080円</b>
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>(B) 負債</b>	<b>200,100,000</b>
未払金	200,000,000
未払解約金	100,000
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>23,962,418,080</b>
元本	18,557,007,274
次期繰越損益金	5,405,410,806
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>18,557,007,274口</b>
<b>1万口当り基準価額(C/D)</b>	<b>12,913円</b>

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

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

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

# ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

## 運用報告書 第31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・グローバルREIT・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

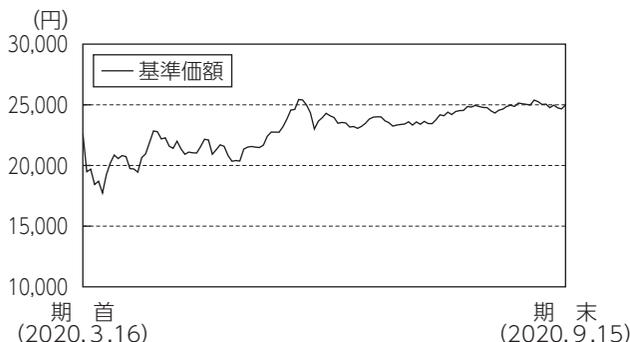
運用方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投資信託証券 組入制限	無制限

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		S&P先進国REIT指数 (除く日本、円換算)		投資信託証券 組入比率
	円	騰落率 (参考指数)	騰落率	%	
(期首)2020年3月16日	22,665	-	20,789	-	94.1
3月末	20,815	△ 8.2	18,592	△ 10.6	95.2
4月末	22,158	△ 2.2	19,853	△ 4.5	94.7
5月末	22,747	0.4	20,058	△ 3.5	95.9
6月末	23,220	2.4	20,295	△ 2.4	95.2
7月末	24,100	6.3	20,657	△ 0.6	95.3
8月末	25,084	10.7	21,332	2.6	96.0
(期末)2020年9月15日	24,997	10.3	21,232	2.1	96.2

- (注1) 騰落率は期首比。  
 (注2) S & P 先進国REIT指数 (除く日本、円換算) は、S & P 先進国REIT指数 (除く日本、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。S & P 先進国REIT指数 (除く日本、米ドルベース) の所有権およびその他の一切の権利は、S&P Dow Jones Indices LLCが有しています。S&P Dow Jones Indices LLCは、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。  
 (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。  
 (注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：22,665円 期末：24,997円 騰落率：10.3%

【基準価額の主な変動要因】

海外リート市況が総じて上昇したこと、ユーロやオーストラリア・ドルが対円で上昇 (円安) したことが主なプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は、総じて上昇しました。

海外リート市況は、米国では、ニューヨークなど大都市部の新型コロナウイルス感染拡大を受けて大きく下落しました。その後は、政府の大規模な景気支援策や迅速で大胆な金融緩和措置によって上昇に転じました。欧州は新型コロナウイルスの感染拡大を受けて複

数の主要都市がロックダウン (都市封鎖) されたことにより急落しました。ECB (欧州中央銀行) の金融緩和によって下げ止まり、各国の景気支援策やEU (欧州連合) の協調支援策によって反発したものの、新型コロナウイルスの感染再拡大などから反発は限定されました。アジア・オセアニアは、世界的なリート市況の急落とともに下落しましたが、欧米と比べて新型コロナウイルスの感染拡大が早期に収束傾向を示したことから、その後は緩やかに回復しました。

○為替相場

対円為替相場は、総じて上昇しました。

為替相場においては、米国を中心とした大規模な景気刺激策が好感されて円安に推移する局面もありましたが、新型コロナウイルス感染拡大への警戒や米国の金融緩和策の長期化観測などを受けて、円高基調となりました。当作成期首と比較して、米ドルは対円でほぼ横ばいとなり、ユーロやオーストラリア・ドルは対円で底堅く推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

※C & S：コーペン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

◆ポートフォリオについて

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

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

国・地域別配分では、大きなリスクを取らず各地域にバランス良く投資を行いました。米国では、世帯形成数の増加から恩恵を受ける住宅リートなどに注目しました。欧州では、安定したキャッシュフロー成長が見込まれるセクターである貸倉庫を保有するリートに、アジア・オセアニアでは、オーストラリアの産業施設リートなどに注目しました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (投資信託証券)	13円 (13)
有価証券取引税 (投資信託証券)	7 (7)
その他費用 (保管費用) (その他)	5 (5) (0)
合計	25

(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  
 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	
	口数	金額	口数	金額
外	千口 3,489.285 ( )	千アメリカ・ドル 118,048 ( )	千口 3,991.102 ( )	千アメリカ・ドル 126,307 ( )
	千口 — ( )	千カナダ・ドル — ( )	千口 297.876 ( )	千カナダ・ドル 8,994 ( )
国	千口 10,129.625 ( )	千オーストラリア・ドル 34,195 ( )	千口 6,326.744 ( )	千オーストラリア・ドル 25,855 ( )

■ 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			
銘柄	買付		平均単価	銘柄	売付		平均単価
	口数	金額			口数	金額	
SEGRO PLC (イギリス)	1,283.937	1,274,804	992	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	85.405	1,306,302	15,295
VENTAS INC (アメリカ)	392.378	1,264,936	3,223	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT (シンガポール)	5,782.96	1,250,413	216
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST (シンガポール)	9,012.9	1,142,103	126	LINK REIT (香港)	1,324.7	1,169,338	882
CYRUSONE INC (アメリカ)	125.479	1,011,493	8,061	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST (アメリカ)	417.352	1,039,688	2,491
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	148.856	987,423	6,633	UDR INC (アメリカ)	219.366	888,660	4,051
WP CAREY INC (アメリカ)	121.353	918,191	7,566	SEGRO PLC (イギリス)	719.302	853,224	1,186
COFINIMMO (ベルギー)	62.659	916,707	14,630	EXTRA SPACE STORAGE INC (アメリカ)	78.43	792,597	10,105
SUN COMMUNITIES INC (アメリカ)	60.886	859,337	14,113	EQUINIX INC (アメリカ)	11.208	742,829	66,276
COVIVIO (フランス)	110.568	804,779	7,278	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST (カナダ)	297.876	721,527	2,422
STOCKLAND (オーストラリア)	3,023.711	780,131	258	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN (アメリカ)	265.19	684,774	2,582

(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	千口 731.187 ( )	千香港ドル 48,050 ( )	千口 1,324.7 ( )	千香港ドル 84,430 ( )
	千口 21,363.5 ( )	千シンガポール・ドル 32,291 (△ 84)	千口 14,998.96 ( )	千シンガポール・ドル 38,630 ( )
ニュージーランド	千口 342.186 ( )	千ニュージーランド・ドル 753 ( )	千口 1,888.171 ( )	千ニュージーランド・ドル 4,153 ( )
イギリス	千口 3,728.541 ( 128.262)	千イギリス・ポンド 21,036 ( 96)	千口 9,527.875 ( )	千イギリス・ポンド 27,908 ( )
ユーロ (オランダ)	千口 45.377 ( 1.897)	千ユーロ 1,594 ( 71)	千口 10.051 ( )	千ユーロ 365 ( )
ユーロ (ベルギー)	千口 160.738 ( 7.035)	千ユーロ 14,655 ( 303)	千口 147.585 ( )	千ユーロ 6,484 ( )
ユーロ (フランス)	千口 400.785 ( )	千ユーロ 15,379 (△ 554)	千口 223.969 ( )	千ユーロ 7,689 ( )
ユーロ (ドイツ)	千口 370.492 ( )	千ユーロ 4,665 ( )	千口 107.604 ( )	千ユーロ 1,444 ( )
ユーロ (スペイン)	千口 — ( )	千ユーロ — ( )	千口 726 ( )	千ユーロ 5,248 ( )
ユーロ (ユーロ通貨計)	千口 977.392 ( 9.925)	千ユーロ 36,294 (△ 180)	千口 1,215.209 ( )	千ユーロ 21,232 ( )

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

■組入資産明細表

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

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	
<b>不動産ファンド</b>				
<b>(アメリカ)</b>	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
SIMON PROPERTY GROUP INC	252.463	17,116	1,809,950	2.4
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	207.435	7,774	822,092	1.1
EQUINIX INC	41,495	31,371	3,317,262	4.5
AMERICAN TOWER CORP	7,454	1,892	200,120	0.3
HOST HOTELS & RESORTS INC	602.619	7,183	759,553	1.0
CYRUSONE INC	125.479	9,595	1,014,615	1.4
HEALTHCARE TRUST OF AME-CLA	101.964	2,749	290,781	0.4
INVITATION HOMES INC	353.132	10,297	1,088,839	1.5
AMERICOLD REALTY TRUST	173.353	6,403	677,122	0.9
VICI PROPERTIES INC	639.094	15,855	1,676,605	2.3
STORE CAPITAL CORP	156.696	4,458	471,389	0.6
VENTAS INC	357.776	16,271	1,720,564	2.3
CROWN CASTLE INTL CORP	10.676	1,709	180,801	0.2
VEREIT INC	1,887.139	13,398	1,416,777	1.9
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	142.579	5,348	565,512	0.8
SUN COMMUNITIES INC	59.575	8,777	928,162	1.3
PROLOGIS INC	234.258	23,882	2,525,346	3.4
SITE CENTERS CORP	320.328	2,569	271,649	0.4
DUKE REALTY CORP	501.985	19,025	2,011,727	2.7
ESSEX PROPERTY TRUST INC	66.737	14,841	1,569,355	2.1
WELLTOWER INC	348.642	20,960	2,216,348	3.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	371.726	10,690	1,130,449	1.5
KILROY REALTY CORP	138.313	7,789	823,692	1.1
PUBLIC STORAGE	113.125	25,423	2,688,303	3.6
UDR INC	414.751	14,595	1,543,284	2.1
WP CAREY INC	121.353	8,384	886,553	1.2
AGREE REALTY CORP	51.679	3,558	376,233	0.5
DIGITAL REALTY TRUST INC	39.156	5,649	597,370	0.8
EXTRA SPACE STORAGE INC	113.989	12,690	1,341,882	1.8
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	375.568	6,895	729,122	1.0
アメリカ・ドル 通 貨 計	8,330.539 30銘柄	337,161	35,651,470	<<48.2%>
<b>(カナダ)</b>	千口	千カナダ・ドル	千円	%
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	384.355	14,666	1,176,292	1.6
カナダ・ドル 通 貨 計	384.355 1銘柄	14,666	1,176,292	<<1.6%>
<b>(オーストラリア)</b>	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
NATIONAL STORAGE REIT	6,490.724	12,105	931,132	1.3
MIRVAC GROUP	11,577.99	23,734	1,825,686	2.5
STOCKLAND	2,903.311	10,480	806,194	1.1
GOODMAN GROUP	2,466.876	44,379	3,413,640	4.6
CHARTER HALL GROUP	2,280.644	28,097	2,161,262	2.9
INGENIA COMMUNITIES GROUP	2,465.159	10,896	838,120	1.1
オーストラリア・ドル 通 貨 計	28,184.704 6銘柄	129,693	9,976,036	<<13.5%>
<b>(香港)</b>	千口	千香港ドル	千円	%
LINK REIT	2,637.892	167,769	2,288,381	3.1
香港・ドル 通 貨 計	2,637.892 1銘柄	167,769	2,288,381	<<3.1%>
<b>(シンガポール)</b>	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT	7,045.541	20,784	1,611,202	2.2
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	6,759.4	9,192	712,624	1.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	8,893.1	15,296	1,185,756	1.6
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	6,259.077	25,036	1,940,814	2.6
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	3,501.335	11,029	854,983	1.2
シンガポール・ドル 通 貨 計	32,458.453 5銘柄	81,338	6,305,381	<<8.5%>

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	
<b>(ニュージーランド)</b>	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
GOODMAN PROPERTY TRUST	5,760.653	13,508	956,147	1.3
ニュージーランド・ドル 通 貨 計	5,760.653 1銘柄	13,508	956,147	<<1.3%>
<b>(イギリス)</b>	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	6,692.506	5,320	722,370	1.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	1,346.502	7,323	994,328	1.3
SEGRO PLC	1,631.735	15,338	2,082,482	2.8
UNITE GROUP PLC/THE	415.03	3,982	540,665	0.7
DERWENT LONDON PLC	180.722	4,778	648,748	0.9
WORKSPACE GROUP PLC	168.339	911	123,761	0.2
SAFESTORE HOLDINGS PLC	570.099	4,529	614,961	0.8
BIG YELLOW GROUP PLC	231.121	2,426	329,482	0.4
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	2,201.667	5,041	684,527	0.9
イギリス・ポンド 通 貨 計	13,437.721 9銘柄	49,652	6,741,327	<<9.1%>
<b>ユーロ (オランダ)</b>	千口	千ユーロ	千円	%
NSI NV	82.711	2,419	303,597	0.4
国 小 計	82.711 1銘柄	2,419	303,597	<<0.4%>
<b>ユーロ (ベルギー)</b>	千口	千ユーロ	千円	%
AEDIFICA	106.112	10,887	1,366,221	1.8
COFINIMMO	61.923	7,752	972,893	1.3
WAREHOUSES DE PAUW SCA	223.971	6,595	827,725	1.1
XIOR STUDENT HOUSING NV	45.734	2,506	314,505	0.4
国 小 計	437.74 4銘柄	27,742	3,481,346	<<4.7%>
<b>ユーロ (フランス)</b>	千口	千ユーロ	千円	%
ARGAN	41.788	3,585	449,933	0.6
GECINA SA	71.229	7,949	997,539	1.3
KLEPIERRE	681.451	9,053	1,136,070	1.5
COVIVIO	111.561	6,274	852,587	1.2
国 小 計	906.029 4銘柄	27,381	3,436,130	<<4.6%>
<b>ユーロ (ドイツ)</b>	千口	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	561.006	7,006	879,304	1.2
国 小 計	561.006 1銘柄	7,006	879,304	<<1.2%>
ユーロ通貨計	1,987.486 10銘柄	64,549	8,100,378	<<11.0%>
合 計	93,181.803 63銘柄	-	71,195,418	<<96.2%>

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

(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。

■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	71,195,418	96.0
コール・ローン等、その他	2,989,133	4.0
投資信託財産総額	74,184,551	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、9月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.74円、1カナダ・ドル=80.20円、1オーストラリア・ドル=76.92円、1香港ドル=13.64円、1シンガポール・ドル=77.52円、1ニュージーランド・ドル=70.78円、1イギリス・ポンド=135.77円、1ユーロ=125.49円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(73,898,006千円)の投資信託財産総額(74,184,551千円)に対する比率は、99.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年9月15日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>74,713,201,186円</b>
コール・ローン等	2,643,310,060
投資信託証券(評価額)	71,195,418,093
未収入金	735,758,609
未収配当金	138,714,424
<b>(B) 負債</b>	<b>738,832,533</b>
未払金	587,448,120
未払解約金	151,382,000
その他未払費用	2,413
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>73,974,368,653</b>
元本	29,593,247,029
次期繰越損益金	44,381,121,624
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>29,593,247,029口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	24,997円

\* 期首における元本額は31,295,569,378円、当作成期間中における追加設定元本額は434,818,660円、同解約元本額は2,137,141,009円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ・グローバルREIT・オープン(毎月分配型)25,928,370,843円、ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)27,340,397円、安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)13,628,232円、インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)12,573,171円、成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)63,955,061円、6資産バランスファンド(分配型)129,717,242円、6資産バランスファンド(成長型)288,986,037円、りそな・ワールド・リート・ファンド1,278,650,681円、世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)39,723,864円、「しがぎん」SR1三資産バランス・オープン(奇数月分配型)3,187,040円、常陽3分法ファンド162,629,727円、ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)41,199,915円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)319,836,112円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)397,899,164円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)510,949,573円、ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(分配型)320,757,407円、ダイワ外国3資産バランス・ファンド(部分為替ヘッジあり)24,942,695円、ダイワ外国3資産バランス・ファンド(為替ヘッジなし)28,899,868円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,997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
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>1,120,397,080円</b>
受取配当金	1,121,262,099
受取利息	87,208
支払利息	△ 952,227
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>5,956,314,762</b>
売買益	12,057,612,440
売買損	△ 6,101,297,678
<b>(C) その他費用</b>	<b>△ 14,136,235</b>
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>7,062,575,607</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>39,635,515,493</b>
<b>(F) 解約差損益金</b>	<b>△ 2,795,770,816</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>478,801,340</b>
<b>(H) 合計(D+E+F+G)</b>	<b>44,381,121,624</b>
次期繰越損益金(H)	44,381,121,624

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

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

# ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

## 運用報告書 第30期（決算日 2020年11月10日）

（作成対象期間 2020年5月12日～2020年11月10日）

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

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

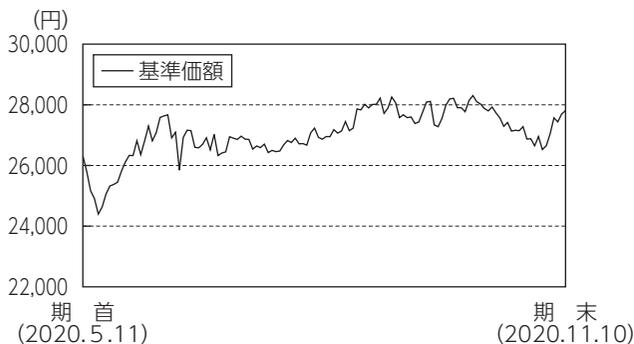
運用方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		東証REIT指数(配当込み)		投資信託	不動産投信
	円	騰落率	(参考指数)	騰落率	証券	指数先物
		%		%	組入比率	比率
(期首)2020年5月11日	26,322	-	3,532.59	-	%	%
5月末	26,813	1.9	3,586.37	1.5	94.5	2.8
6月末	26,410	0.3	3,525.99	△0.2	95.5	2.7
7月末	26,721	1.5	3,535.10	0.1	94.9	2.6
8月末	28,217	7.2	3,735.15	5.7	95.5	2.8
9月末	27,904	6.0	3,698.94	4.7	96.4	2.4
10月末	26,528	0.8	3,512.43	△0.6	96.8	2.4
(期末)2020年11月10日	27,807	5.6	3,678.15	4.1	96.5	2.3

(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：26,322円 期末：27,807円 騰落率：5.6%

【基準価額の主な変動要因】

新型コロナウイルスの感染拡大により発令した緊急事態宣言の解除や経済活動の回復などを背景にJリート市況が上昇したことにより、基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○Jリート（不動産投信）市況

Jリート市況は上昇しました。

Jリート市況は、当作成期首より一時下落したものの、2020年5月中旬以降は、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、上昇に転じました。6月中旬以降は、国内外での新規感染者数が再び増加し、緩やかに下落しました。7月はおおむね横ばい圏の推移でしたが、8月中旬以降は国内での新規感染者数が減少に転じ、先行きの不透明感が後退する中で上昇しました。9月前半は8月下旬の上昇の反動で調整しました。9月中旬にはFTSEグローバル株式指数への組み入れ前後でJリート市場は大きく変動しました。10月上旬に大型オフィス銘柄でのJリート市場で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。10月下旬は、欧州での新型コロナウイルス感染の再拡大や米国大統領選挙の不透明な状況による投資家のリスク回避の動きの中で、さらに下落幅が拡大しました。11月に入ると、米国大統領選挙で民主党のバイデン候補の当選が確実となったことから、投資家のリスク選好姿勢が強まり、上昇して当作成期末を迎えました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

リートの組入比率につきましては、通常の状態 で信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本としており、おおむね95~98%台程度で推移させました。また、東証REIT指数先物への投資も行い、先物と合計で95~100%程度で推移させました。リート銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資しました。個別銘柄では、当作成期を通じてみると、ケネディクス・レジデンシャル・ネット、三井不動産ロジパーク、アドバンス・レジデンスなどを東証REIT指数と比較してオーバーウェイトとし、日本アコモデーションファンド、日本ロジスティクスファンド、APIなどをアンダーウェイトとしました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当ファンドは、参考指数として東証REIT指数（配当込み）を用いています。当作成期における参考指数の騰落率は4.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は5.6%となりました。

投資口価格のパフォーマンスが参考指数を上回った三井不動産ロジパークをオーバーウェイトとしていたことや、投資口価格のパフォーマンスが参考指数を下回った日本アコモデーションファンド、日本ビルファンド、インベスコ・オフィス・Jリートをアンダーウェイトとしていたことなどがプラスに寄与しました。他方、投資口価格のパフォーマンスが参考指数を下回ったジャパンリアルエステイト、大和ハウスリート、ザイマックス・リートをオーバーウェイトとしていたことや、参考指数を上回った星野リゾート・リートをアンダーウェイトとしていたことなどが、マイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (先物・オプション) (投資信託証券)	33円 (0) (33)
有価証券取引税	-
その他費用 (その他)	0 (0)
合計	33

(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5月12日から2020年11月10日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内	281.77	40,950,787	259.311 (-)	39,282,267 (-)

(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5月12日から2020年11月10日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	百万円	百万円	百万円	百万円
不動産投信指数先物取引	4,515	4,859	-	-

(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5月12日から2020年11月10日まで)

当				期			
銘 柄	買 付			銘 柄	売 付		
	口 数	金 額	平均単価		口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
日本プライムリアルティ	8.973	2,794,313	311,413	ケネディクス・オフィス投資法人	4.403	2,651,160	602,125
日本ビルファンド	4.197	2,315,489	551,701	日本プライムリアルティ	7.935	2,620,325	330,223
産業ファンド	11.356	2,060,449	181,441	G L P 投資法人	15.045	2,312,665	153,716
大和ハウスリート投資法人	7.662	2,004,647	261,635	日本プロロジスリート	6.63	2,287,641	345,043
ラサールロジポート投資	9.502	1,680,406	176,847	野村不動産マスターF	11.763	1,638,577	139,299
日本リテールファンド	11.184	1,654,535	147,937	三井不ロジパーク	2.775	1,497,837	539,761
三井不ロジパーク	3.406	1,609,661	472,595	A P I 投資法人	3.732	1,459,378	391,044
G L P 投資法人	10.058	1,596,096	158,689	三菱地所物流 R E I T	3.588	1,428,492	398,130
平和不動産リート	14.403	1,546,515	107,374	ジャパン・ホテル・リート投資法人	26.839	1,304,113	48,590
日本リート投資法人	4.148	1,445,648	348,517	コンフォリア・レジデンシャル	4.156	1,273,132	306,336

(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		
	□ 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	1,545	175,203	0.2
サンケイリアルエステート	2,881	282,049	0.3
S O S I L A 物流リート投	6,739	889,548	1.0
日本アコモデーションファンド投資法人	0.81	475,470	0.5
MCUBS MidCity投資法人	9,598	808,151	0.9
森ヒルズリート	13,519	1,784,508	2.0
産業ファンド	20,801	3,671,376	4.2
アドバンス・レジデンス	13,202	4,020,009	4.6
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	18,641	3,237,941	3.7
GLP投資法人	21,837	3,358,530	3.9
コンフォリア・レジデンシャル	1,742	526,084	0.6
日本プロロジスリート	9,194	3,038,617	3.5
Oneリート投資法人	0,506	125,386	0.1
イオンリート投資	10,824	1,342,176	1.5
ヒューリックリート投資法	9,616	1,379,896	1.6
日本リート投資法人	3,137	1,123,046	1.3
インバスコ・オフィス・Jリート	22,964	323,562	0.4
積水ハウス・リート投資	22,893	1,719,264	2.0
トーセイ・リート投資法人	0,799	86,451	0.1
ケネディクス商業リート	5,257	1,128,677	1.3
ヘルスケア&メディカル投資	5,103	645,019	0.7
野村不動産マスターF	38,368	5,233,395	6.0
ラサールロジポート投資	9,132	1,474,818	1.7
スターアジア不動産投	11,248	530,905	0.6
三井不ロジパーク	7,14	3,523,590	4.0
森トラスト・ホテルリート投	2,532	298,776	0.3
三菱地所物流REIT	3,017	1,258,089	1.4
CREロジスティクスファンド	3,61	558,467	0.6
ザイマックス・リート	10,129	929,842	1.1
日本ビルファンド	11,597	6,668,275	7.6
ジャパンリアルエステイト	10,024	5,523,224	6.3
日本リテールファンド	20,378	3,452,033	4.0
オリックス不動産投資	15,517	2,478,064	2.8
日本プライムリアルティ	8,352	2,614,176	3.0
プレミアム投資法人	10,373	1,258,244	1.4
東急リアル・エステート	7,3	1,110,330	1.3
グローバル・ワン不動産投資法人	0,67	67,067	0.1
ユナイテッド・アーバン投資法人	20,305	2,570,613	2.9
森トラスト総合リート	0,925	122,840	0.1
インヴィンシブル投資法人	33,321	1,274,528	1.5
フロンティア不動産投資	1,712	647,136	0.7
平和不動産リート	8,67	1,032,597	1.2

ファンド名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.2	58,080	0.1
福岡リート投資法人	1,574	218,628	0.3
ケネディクス・オフィス投資法人	2,908	1,840,764	2.1
いちごオフィスリート投資法人	2,5	180,250	0.2
大和証券オフィス投資法人	1,95	1,228,500	1.4
阪急阪神リート投資法人	2,723	338,196	0.4
大和ハウスリート投資法人	20,378	4,982,421	5.7
ジャパン・ホテル・リート投資法人	18,445	1,064,276	1.2
ジャパンエクセレント投資法人	12,212	1,531,384	1.8
合 計	□ 数、金額	498,818	84,210,483
	銘柄数<比率>	51銘柄	<96.5%>

※エスコンジャパンリート、サンケイリアルエステート、S O S I L A 物流リート投、森ヒルズリート、産業ファンド、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、GLP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法人、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート、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、日本ビルファンド、日本プライムリアルティ、平和不動産リート、ケネディクス・オフィス投資法人、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項に規定されてい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	百万円	百万円
東証REIT	2,049	-

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託証券	84,210,483	96.0
コール・ローン等、その他	3,533,632	4.0
投資信託財産総額	87,744,116	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10日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>88,891,716,537円</b>
コール・ローン等	2,020,168,158
投資信託証券(評価額)	84,210,483,810
未収入金	668,963,471
未収配当金	839,221,098
差入委託証拠金	1,152,880,000
<b>(B) 負債</b>	<b>1,667,439,089</b>
未払金	498,170,089
未払解約金	21,669,000
差入委託証拠金代用有価証券	1,147,600,000
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>87,224,277,448</b>
元本	31,367,619,624
次期繰越損益金	55,856,657,824
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>31,367,619,624口</b>
1万口当り基準価額(C / D)	27,807円

\* 期首における元本額は32,038,794,221円、当作成期間中における追加設定元本額は1,183,297,665円、同解約元本額は1,854,472,262円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ・Ｊ－ＲＥＩＴファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用) 28,575,786,364円、安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 12,369,107円、インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 11,470,854円、成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 55,617,947円、6資産バランスファンド(分配型) 115,286,250円、6資産バランスファンド(成長型) 259,748,593円、世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型) 34,855,957円、【しがぎん】SRⅢ資産バランス・オープン(奇数月分配型) 1,348,135円、ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型) 36,220,996円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) 302,761,433円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース) 364,590,334円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース) 476,369,186円、DCダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブファンド328,853,672円、ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(成長型) 80,941,202円、ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(安定型) 26,056,410円、ライフハーモニー(ダイワ世界資産分散ファンド)(分配型) 126,655,615円、ダイワ・アクティブＪリート・ファンド(年4回決算型) 558,687,569円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は27,807円です。

■損益の状況

当期 自2020年5月12日 至2020年11月10日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>1,582,558,838円</b>
受取配当金	1,583,114,328
受取利息	10,335
その他収益金	114
支払利息	△ 565,939
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>2,869,968,912</b>
売買益	5,541,409,764
売買損	△ 2,671,440,852
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>69,909,790</b>
取引益	101,889,630
取引損	△ 31,979,840
<b>(D) その他費用</b>	<b>△ 19,597</b>
<b>(E) 当期損益金(A + B + C + D)</b>	<b>4,522,417,943</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>52,293,291,284</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△ 2,985,809,738</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>2,026,758,335</b>
<b>(I) 合計(E + F + G + H)</b>	<b>55,856,657,824</b>
次期繰越損益金(I)	<b>55,856,657,824</b>

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

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

# ダイワ北米好配当株マザーファンド

## 運用報告書 第30期（決算日 2020年10月15日）

（作成対象期間 2020年4月16日～2020年10月15日）

ダイワ北米好配当株マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

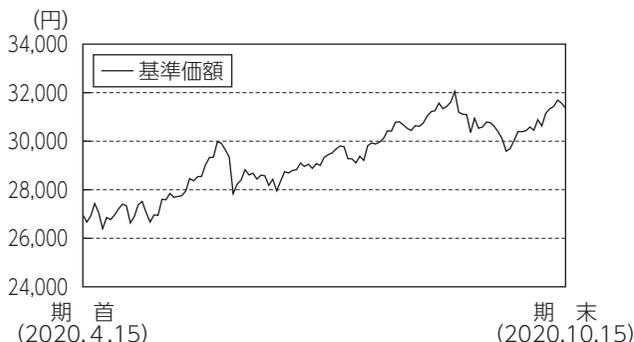
運用方針	北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券
株式組入制限	無制限

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		MSCIノースアメリカ指数 (配当込み、円換算)		株式組入 比率	ハイブリッド 優先証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率
	円	騰落率	(参考指数)	騰落率			
(期首)2020年4月15日	26,959	—	29,406	—	72.5	19.4	1.1
4月末	27,408	1.7	30,411	3.4	71.1	20.5	1.1
5月末	28,367	5.2	31,680	7.7	74.5	19.3	1.1
6月末	28,359	5.2	32,128	9.3	73.5	17.5	1.1
7月末	29,211	8.4	33,333	13.4	76.0	19.3	1.0
8月末	31,339	16.2	36,334	23.6	78.3	18.4	0.9
9月末	30,393	12.7	34,822	18.4	74.7	18.7	0.9
(期末)2020年10月15日	31,365	16.3	36,328	23.5	78.2	17.9	0.8

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：26,959円 期末：31,365円 騰落率：16.3%

【基準価額の主な変動要因】

当作成期は、北米株式市況や米国ハイブリッド優先証券市況が上昇したことが主なプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○北米株式市況

北米株式市況は、各国の大胆な景気刺激策への期待などを背景に上昇しました。

北米株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大による市場の混乱を抑えるために各国・地域の政府や中央銀行が大胆な支援策を講じたこと、各国が段階的に経済活動を再開する中で景気回復への期待が高まったことなどが支援材料になり、上昇基

調で推移しました。2020年9月に入ると、これまでの株価上昇による高値警戒感に加え、欧州などで新型コロナウイルスの感染が再拡大したことを受けていったん下落しましたが、当作成期末にかけて再び上昇しました。

○米国ハイブリッド優先証券市況

米国ハイブリッド優先証券市況は、中央銀行の支援策などを受けて上昇しました。

米国ハイブリッド優先証券市況は、当作成期首より、FRB (米国連邦準備制度理事会) が無制限の量的緩和政策を含めた各種の流動性供給策を実施したことで市場に落ち着きが見られたことや、経済活動の再開による景気回復期待などが要因となり、上昇基調で推移しました。また、低金利環境が継続する中で相対的に高い利回り資産への需要が高まったことも、支援材料になりました。

○為替相場

米ドル円為替相場は下落 (円高) しました。

米ドル円為替相場は、当作成期首から2020年6月上旬にかけて上昇しましたが、その後は、新型コロナウイルスの感染第2波への警戒感やFRB (米国連邦準備制度理事会) による金融緩和の長期化観測、株式市場の調整がリスク回避的な動きにつながったことなどから、下落しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

※C&S：コーペン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

◆ポートフォリオについて

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

有価証券の組入比率は、株式を70~79%程度、ハイブリッド優先証券等を18~23%程度としました。

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

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式) (ハイブリッド優先証券) (投資信託証券)	5円 (3) (2) (0)
有価証券取引税 (株式) (ハイブリッド優先証券) (投資信託証券)	0 (0) (0) (0)
その他費用 (保管費用) (その他)	3 (3) (0)
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。

(3) 投資信託証券

(2020年4月16日から2020年10月15日まで)

		買 付		売 付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額
外 国	アメリカ	千□ (-)	千アメリカ・ドル (-)	千□ (-)	千アメリカ・ドル (-)
				1.826	50

(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。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2020年4月16日から2020年10月15日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 1,306.32 ( 100.98)	千アメリカ・ドル 7,495 ( -)	百株 618.27	千アメリカ・ドル 5,895

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

(2020年4月16日から2020年10月15日まで)

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	アメリカ	千証券 61.69 ( -)	千アメリカ・ドル 1,582 ( -)	千証券 55.99 ( -)	千アメリカ・ドル 1,437 ( -)

(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。

# ダイワ北米好配当株マザーファンド

## ■主要な売買銘柄

### (1) 株 式

(2020年4月16日から2020年10月15日まで)

当				期			
買		付		売		付	
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
FIRSTENERGY CORP (アメリカ)	32,251	104,668	3,245	TYSON FOODS INC-CL A (アメリカ)	12,255	81,293	6,633
TYSON FOODS INC-CL A (アメリカ)	8,115	52,391	6,456	APPLE INC (アメリカ)	6.2	75,249	12,136
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A (アメリカ)	1,724	47,499	27,551	SALESFORCE.COM INC (アメリカ)	2,271	47,435	20,887
MICRON TECHNOLOGY INC (アメリカ)	8,576	43,345	5,054	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.291	39,289	135,014
MASTERCARD INC - A (アメリカ)	1,196	36,236	30,297	NEXTERA ENERGY INC (アメリカ)	1,325	38,853	29,323
VISA INC-CLASS A SHARES (アメリカ)	1.71	34,014	19,891	HORMEL FOODS CORP (アメリカ)	7.215	35,606	4,935
PFIZER INC (アメリカ)	8,571	32,896	3,838	HERSHEY CO/THE (アメリカ)	1,961	30,531	15,569
EVERGY INC (アメリカ)	4,566	29,979	6,565	PORTLAND GENERAL ELECTRIC CO (アメリカ)	7.268	28,261	3,888
NORFOLK SOUTHERN CORP (アメリカ)	1,261	28,652	22,721	AMERICAN EXPRESS CO (アメリカ)	2,896	27,959	9,654
GENERAL MOTORS CO (アメリカ)	8,148	26,291	3,226	PHILLIPS 66 (アメリカ)	3,756	25,775	6,862

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

### (2) ハイブリッド優先証券

(2020年4月16日から2020年10月15日まで)

当				期			
買		付		売		付	
銘柄	証券数	金額	平均単価	銘柄	証券数	金額	平均単価
WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R (アメリカ)	5,611	16,305	2,905	PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P (アメリカ)	5,155	14,570	2,826
US BANCORP 6.5 F (アメリカ)	4,899	13,465	2,748	SYNOVUS FINANCIAL CORP 5.875 E (アメリカ)	6.05	13,833	2,286
PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P (アメリカ)	4,569	12,644	2,767	NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.65 N (アメリカ)	4,112	12,195	2,965
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R (アメリカ)	4,653	12,480	2,682	LEGG MASON INC 5.45 (アメリカ)	4,618	12,029	2,604
SEMPRA ENERGY 5.75 (アメリカ)	3,579	9,889	2,763	AMERICAN FINANCIAL GROUP 5.875 (アメリカ)	4,175	11,761	2,817
CMS ENERGY CORP 5.875 (アメリカ)	3,361	9,007	2,679	US BANCORP 6.5 F (アメリカ)	3,906	11,027	2,823
CITIGROUP INC 7.125 J (アメリカ)	2,702	7,514	2,780	BANK OF AMERICA CORP 6 EE (アメリカ)	3,545	9,688	2,733
BANK OF AMERICA CORP 6 EE (アメリカ)	2,714	7,345	2,706	BANK OF AMERICA CORP 6 GG (アメリカ)	3.15	9,200	2,920
UNITED STATES CELLULAR C 6.25 (アメリカ)	2.56	7,049	2,753	REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C (アメリカ)	3,226	8,695	2,695
SOUTHERN CO 4.2 C (アメリカ)	2,625	6,909	2,632	KEYCORP 5.65 F (アメリカ)	2,885	8,202	2,843

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ABBOTT LABORATORIES	25.84	25.84	278	29,307	ヘルスケア
ADOBE INC	2.77	4.49	227	23,929	情報技術
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8.33	8.33	248	26,121	素材
DOLLAR TREE INC	11.54	11.54	109	11,559	一般消費・サービス
DANAHER CORP	12.81	12.81	290	30,547	ヘルスケア
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	36.05	36.05	368	38,822	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	37.2	37.2	181	19,128	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	15.73	-	-	-	情報技術
APPLE INC	31.53	64.12	777	81,794	情報技術
BOEING CO/THE	3.36	12.52	204	21,512	資本財・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	91.45	115.7	676	71,159	コミュニケーション・サービス
JPMORGAN CHASE & CO	42.55	64.85	649	68,411	金融
CATERPILLAR INC	10.33	15.21	248	26,194	資本財・サービス
CISCO SYSTEMS INC	33.84	33.84	134	14,208	情報技術
MORGAN STANLEY	27.76	55.13	279	29,392	金融
BROADCOM INC	12.89	12.89	490	51,599	情報技術
DEERE & CO	-	9.91	236	24,875	資本財・サービス
TELEFLEX INC	5.54	5.54	201	21,255	ヘルスケア
COLGATE-PALMOLIVE CO	27.29	27.29	217	22,940	生活必需品
ACTIVISION BLIZZARD INC	30.94	30.94	253	26,672	コミュニケーション・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9.02	9.02	173	18,311	ヘルスケア
AMAZON.COM INC	3.57	2.85	958	100,908	一般消費・サービス
EOG RESOURCES INC	-	58.79	221	23,280	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC	27.94	21.46	645	67,910	公益事業
GENERAL ELECTRIC CO	91.25	168.23	114	12,076	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	-	69.24	219	23,081	一般消費・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	7.19	14.87	314	33,062	金融
ALPHABET INC-CL A	4.22	1.31	204	21,558	コミュニケーション・サービス
FIRSTENERGY CORP	-	322.51	1,013	106,696	公益事業
HOME DEPOT INC	13.46	7.65	219	23,117	一般消費・サービス
HERSHEY CO/THE	19.61	-	-	-	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	45.51	39.17	580	61,062	ヘルスケア
MCDONALD'S CORP	9.81	14.23	323	34,094	一般消費・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	16.41	8.5	231	24,320	コミュニケーション・サービス
CONCHO RESOURCES INC	-	42.37	206	21,701	エネルギー
PHILLIPS 66	40.39	22.69	118	12,438	エネルギー
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11.38	11.38	189	19,994	情報技術
MERCK & CO. INC.	21.96	21.96	176	18,609	ヘルスケア
NIKE INC-CL B	14.89	12.57	160	16,890	一般消費・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	-	12.61	274	28,849	資本財・サービス
NORTHROP GRUMMAN CORP	8.29	8.29	261	27,477	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	23.32	23.32	184	19,369	生活必需品
PFIZER INC	-	85.71	315	33,254	ヘルスケア
PROCTER & GAMBLE CO/THE	16.43	16.43	236	24,910	生活必需品
ACCENTURE PLC-CL A	9.29	-	-	-	情報技術
CARRIER GLOBAL CORP	6.75	-	-	-	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	3.37	-	-	-	資本財・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AT&T INC	137.53	137.53	378	39,795	コミュニケーション・サービス
TEXAS INSTRUMENTS INC	15.7	15.7	239	25,246	情報技術
SALESFORCE.COM INC	22.71	-	-	-	情報技術
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	6.75	-	-	-	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	17.7	22.91	399	42,051	資本財・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	17.02	-	-	-	ヘルスケア
ANTHEM INC	14.75	14.75	431	45,388	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	18.01	18.01	227	23,998	コミュニケーション・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	23.19	29.82	341	35,964	資本財・サービス
WHIRLPOOL CORP	7.89	-	-	-	一般消費・サービス
WALMART INC	8.94	8.94	128	13,545	生活必需品
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	-	17.24	490	51,676	情報技術
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14.35	14.35	304	32,102	金融
VISA INC-CLASS A SHARES	20.2	37.3	754	79,387	情報技術
NVIDIA CORP	3.46	1.71	96	10,148	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	7.81	24.23	266	28,011	金融
TYSON FOODS INC-CL A	41.4	-	-	-	生活必需品
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	7.98	7.98	372	39,227	ヘルスケア
MASTERCARD INC - A	6.4	18.36	629	66,229	情報技術
BANK OF AMERICA CORP	114.01	188.32	444	46,820	金融
AMERICAN EXPRESS CO	20.28	-	-	-	金融
EATON CORP PLC	26.71	26.71	288	30,417	資本財・サービス
ECOLAB INC	5.75	10.75	216	22,779	素材
HORMEL FOODS CORP	90.24	18.09	90	9,564	生活必需品
INTEL CORP	49.62	63.58	340	35,837	情報技術
MICROSOFT CORP	51.99	58.32	1,288	135,580	情報技術
MEDTRONIC PLC	33.37	33.37	358	37,780	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	-	85.76	442	46,606	情報技術
COMCAST CORP-CLASS A	32.8	44.31	200	21,118	コミュニケーション・サービス
アメリカ・ドル 通貨計	株数、金額 総額<比率>	1,688.37 67銘柄	2,477.4 65銘柄	22,151 2,331,690	<77.6%>
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円
ENBRIDGE INC	49.79	49.79	192	15,418	エネルギー
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 総額<比率>	49.79 1銘柄	49.79 1銘柄	192 <0.5%>	15,418
ファンド合計	株数、金額 総額<比率>	1,738.16 68銘柄	2,527.19 66銘柄	- <78.2%>	2,347,109

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

銘柄	期首		当 期		期 末	
	証 券 数	証 券 数	外貨建金額	邦貨換算金額	評 価 額	評 価 額
(アメリカ)	千証券	千証券	千アメリカ・ドル	千円		
CHS INC 7.5 4	4.575	4.575	131	13,796		
JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA	4.2	4.2	107	11,348		
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.2 F	1.1	1.1	27	2,943		
WELLS FARGO & COMPANY 5.7 W	2.929	2.929	75	7,954		
FIRST REPUBLIC BANK 5.5 G	2.175	2.175	55	5,890		
STATE STREET CORP 5.35 G	1.732	0.914	26	2,761		
BANK OF AMERICA CORP 6 EE	0.831	—	—	—		
REINSURANCE GRP OF AMER 5.75	—	2.558	70	7,415		
WELLS FARGO & COMPANY 5.5 X	4.55	4.55	118	12,457		
LEGG MASON INC 5.45	3.35	—	—	—		
ENERGY LOUISIANA LLC 4.875 *	1.2	1.2	31	3,312		
ARCH CAPITAL GROUP LTD 5.25 E	1.2	1.2	30	3,246		
MORGAN STANLEY 5.85 K	2.589	2.589	73	7,695		
AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	2.1	2.1	54	5,716		
NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A	0.607	0.607	16	1,774		
FIRST REPUBLIC BANK 5.125 H	2.582	2.582	68	7,166		
VALLEY NATIONAL BANCORP 5.5 B	2.076	2.076	51	5,388		
SOUTHERN CO 5.25	1.961	1.961	52	5,523		
BERKLEY (WR) CORPORATION 5.7	0.824	—	—	—		
ENBRIDGE INC 6.375 B	0.916	0.497	12	1,336		
BANK OF AMERICA CORP 6 GG	5.875	2.725	75	7,936		
UNUM GROUP 6.25	3.35	3.35	88	9,270		
RENAISSANCE HOLDINGS L 5.75 F	6.45	6.45	174	18,412		
KKR & CO INC 6.5 B	0.75	0.75	19	2,102		
KEYCORP 5.65 F	2.724	0.952	25	2,690		
US BANCORP 5.5 K	—	2.313	63	6,714		
JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	1.85	4.088	114	12,035		
CMS ENERGY CORP 5.875	—	3.361	90	9,523		
NISOURCE INC 6.5 B	2.81	2.81	79	8,335		
JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	2.45	2.45	68	7,225		
CMS ENERGY CORP 5.875	3.224	3.224	88	9,295		
NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.65 N	5.45	1.338	37	3,918		
AMERICAN INTL GROUP 5.85 A	5.825	5.825	160	16,873		
AMERICAN FINANCIAL GROUP 5.875	4.175	—	—	—		
DUKE ENERGY CORP 5.75 A	1.818	1.818	51	5,404		
REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	4.972	1.746	48	5,136		
ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.2 19-A	0.909	0.909	25	2,679		
SPIRE INC 5.9 A	3.962	3.556	99	10,448		
ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	2.1	2.1	57	6,038		
VOYA FINANCIAL INC 5.35 B	3.14	3.14	88	9,275		
SYNOVUS FINANCIAL CORP 5.875 E	6.05	—	—	—		
TCF FINANCIAL 5.7 C*	0.4	0.4	10	1,104		
ALLSTATE CORP 5.1 H	4.375	4.375	119	12,590		
SEMPRA ENERGY 5.75	2.828	6.407	177	18,640		
FIFTH THIRD BANCORP 6 A	1.923	1.923	50	5,339		
BANK OF AMERICA CORP 5 LL	4.412	4.412	118	12,464		
AEGON FUNDING CO LLC 5.1	6.414	6.414	167	17,654		
SYNCHRONY FINANCIAL 5.625 A	5.97	5.97	152	16,068		
FIRST REPUBLIC BANK 4.7 J	3.025	3.025	81	8,574		
METLIFE INC 4.75 F	2.525	2.525	67	7,122		
SOUTHERN CO 4.95 2020	8.035	8.035	215	22,725		
WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	7.18	7.18	182	19,219		
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 4.8 J	2.064	—	—	—		
DIME COMMUNITY BANCBSRS 5.5 A	—	2.375	54	5,684		

銘柄	期首		当 期		期 末	
	証 券 数	証 券 数	外貨建金額	邦貨換算金額	評 価 額	評 価 額
(アメリカ)	千証券	千証券	千アメリカ・ドル	千円		
ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	131	1.95	53	5,663		
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	—	3.578	95	10,074		
UNITED STATES CELLULAR C 6.25	—	2.56	67	7,097		
SOUTHERN CO 4.2 C	—	2.625	66	6,974		
BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	—	1.675	42	4,458		
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 A	—	1.444	37	3,912		
MORGAN STANLEY 6.875 F	1.601	2.589	71	7,554		
ALLY FINANCIAL FR 2/15/40	1.963	1.963	50	5,308		
US BANCORP 6.5 F	—	0.993	26	2,816		
WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R	—	5.611	161	16,950		
PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P	2.486	1.9	51	5,443		
MORGAN STANLEY 6.375 I	8.551	6.406	177	18,671		
STATE STREET CORP 5.9 D	3.104	1.294	36	3,860		
WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	7.76	7.76	208	21,931		
CITIGROUP INC 7.125 J	—	2.702	77	8,134		
HARTFORD FINL SVCS GRP 7.875	—	0.888	24	2,605		
合 計	証 券 数、金額	証 券 数、金額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	評 価 額	評 価 額
	銘柄数<比率>	銘柄数	56銘柄	64銘柄	5,108	537,692
						<17.9%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 外国投資信託証券

銘柄	期首		当 期		期 末	
	口 数	口 数	外貨建金額	邦貨換算金額	評 価 額	評 価 額
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		
UMH PROPERTIES INC 6.75 C	1.2	1.2	30	3,207		
MONMOUTH REIT 6.125 C	2.875	2.875	71	7,532		
SPIRIT REALTY CAPITAL IN 6 A	1.35	1.35	35	3,754		
QTS REALTY TRUST INC 7.125 A	1.175	1.175	32	3,380		
AMERICAN HOMES 4 RENT 6.25 H	3.189	1.363	36	3,882		
TAUBMAN CENTERS INC 6.5 J	1	1	21	2,278		
合 計	口 数、金額	口 数、金額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	評 価 額	評 価 額
	銘柄数<比率>	銘柄数	6銘柄	6銘柄	228	24,034
						<0.8%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年10月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	2,347,109	77.6
ハイブリッド優先証券	537,692	17.8
投資信託証券	24,034	0.8
コール・ローン等、その他	114,987	3.8
投資信託財産総額	3,023,824	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、10月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.26円、1カナダ・ドル=80.02円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(2,945,505千円)の投資信託財産総額(3,023,824千円)に対する比率は、97.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年10月15日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>3,023,824,605円</b>
コール・ローン等	95,026,266
株式(評価額)	2,347,109,154
ハイブリッド優先証券(評価額)	537,692,467
投資信託証券(評価額)	24,034,993
未収入金	15,525,609
未収配当金	3,256,851
未収利息	1,179,265
<b>(B) 負債</b>	<b>20,905,700</b>
未払金	19,237,700
未払解約金	1,668,000
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>3,002,918,905</b>
元本	957,413,077
次期繰越損益金	2,045,505,828
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>957,413,077口</b>
1万口当り基準価額(C / D)	31,365円

\*期首における元本額は935,348,201円、当作成期間中における追加設定元本額は68,398,293円、同解約元本額は46,333,417円です。

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)7,145,177円、インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)6,746,181円、成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)121,830,806円、ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド(奇数月決算型)21,573,764円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)133,516,935円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)248,493,243円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)396,170,822円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は31,365円です。

■損益の状況

当期 自2020年4月16日 至2020年10月15日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>33,234,880円</b>
受取配当金	19,906,169
受取利息	13,239,283
その他収益金	100,235
支払利息	△ 10,807
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>384,973,159</b>
売買益	463,885,028
売買損	△ 78,911,869
<b>(C) その他費用</b>	<b>△ 324,135</b>
<b>(D) 当期損益金(A + B + C)</b>	<b>417,883,904</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>1,586,242,800</b>
<b>(F) 解約差損益金</b>	<b>△ 90,072,583</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>131,451,707</b>
<b>(H) 合計(D + E + F + G)</b>	<b>2,045,505,828</b>
次期繰越損益金(H)	2,045,505,828

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

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

# ダイワ欧州好配当株マザーファンド

## 運用報告書 第30期（決算日 2020年10月15日）

（作成対象期間 2020年4月16日～2020年10月15日）

ダイワ欧州好配当株マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

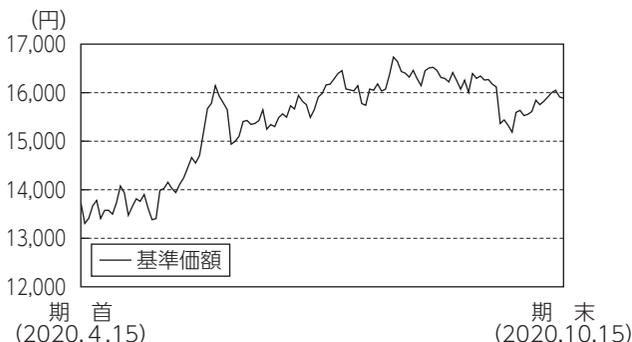
運用方針	欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
株式組入制限	無制限

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		MSCIヨーロッパ指数 (配当込み、円換算) (参考指数)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
	円	%	騰落率	騰落率	%	%
(期首)2020年 4月15日	13,732	-	15,560	-	95.0	-
4 月 末	14,076	2.5	15,986	2.7	96.0	-
5 月 末	14,663	6.8	16,810	8.0	95.8	-
6 月 末	15,486	12.8	17,331	11.4	97.3	-
7 月 末	15,775	14.9	17,725	13.9	97.5	-
8 月 末	16,314	18.8	18,376	18.1	97.4	-
9 月 末	15,636	13.9	17,849	14.7	96.7	-
(期末)2020年10月15日	15,883	15.7	18,217	17.1	94.5	-

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：13,732円 期末：15,883円 騰落率：15.7%

【基準価額の主な変動要因】

保有株式が値上がりしたことや、ユーロが対円で上昇 (円安) したことから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○欧州株式市況

欧州株式市場は上昇しました。

新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、2020年2月から3月にかけて欧州株式市場は大きく下落しましたが、その後のECB (欧州中央銀行) による金融緩和策の実施や、各国政府による景気刺激策などが好感されて3月後半には反発し、当作成期首以降もおおむね上昇基調が継続しました。当作成期中においては、米中関係の悪化や新型コロナウイルスの感染再拡大などが懸念材料となり下落する場面も見られたものの、外出制限の緩和による経済活動の再開やワクチン開発への期待などが相場を下支えしました。

○為替相場

ユーロは対円で上昇しました。

ユーロ円為替相場は、新型コロナウイルス感染拡大を受けたリスク回避姿勢の強まりやECB (欧州中央銀行) による金融緩和姿勢の強まりが円高ユーロ安材料となったものの、ドイツ連立政権が景気刺激策について合意したことやECBによる金融支援策の拡大、欧州復興基金をめぐる合意などを背景にユーロの買い戻しが進んだことから、当作成期首比では上昇となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

※アムンディ・アイルランド：アムンディ・アイルランド・リミテッド

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式)	0円 (0)
有価証券取引税 (株式)	0 (0)
その他費用 (保管費用) (その他)	5 (5) (0)
合計	6

(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

株式

(2020年4月16日から2020年10月15日まで)

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外	スイス	百株	千スイス・フラン	百株	千スイス・フラン
		( - )	( - )	13.18	235
	スウェーデン	百株	千スウェーデン・クローネ	百株	千スウェーデン・クローネ
		24.86 ( - )	503 ( - )	-	-
	ユーロ (オランダ)	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
		( 1.7 )	( - )	95.13	296
	ユーロ (フランス)	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
29.12 ( - )		43 ( - )	18.16	91	
ユーロ (ドイツ)	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ	
	( 14 )	(△ 13)	-	-	
ユーロ (フィンランド)	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ	
	84.94 ( - )	26 ( - )	-	-	
国 ユーロ (ユーロ 通貨計)	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ	
	114.06 ( 15.7 )	70 (△ 13)	113.29	388	

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

株式

(2020年4月16日から2020年10月15日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘柄	柄	株数	金額	平均単価	銘柄	柄	株数	金額	平均単価
ELECTROLUX AB-SER B (スウェーデン)		千株	千円	円	KONINKLIJKE DSM NV (オランダ)		千株	千円	円
		2.486	5,940	2,389			1.537	25,876	16,835
AXA SA (フランス)		2.912	5,029	1,727	GIVAUDAN-REG (スイス)		0.03	13,111	437,038
		8.494	3,105	365	ALSTOM (フランス)		1.583	8,417	5,317
NOKIA OYJ (フィンランド)					ABN AMRO BANK NV-CVA (オランダ)		7.197	6,726	934
					ALCON INC (スイス)		0.877	5,657	6,450
					ZURICH INSURANCE GROUP AG (スイス)		0.131	4,839	36,945
					KONINKLIJKE PHILIPS NV (オランダ)		0.779	4,244	5,448
					NESTLE SA-REG (スイス)		0.28	3,549	12,675
					SCHNEIDER ELECTRIC SE (フランス)		0.233	3,010	12,921

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表  
外国株式

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千円	千円		
PRUDENTIAL PLC	148.44	148.44	166	22,786	金融	
AVIVA PLC	406.69	406.69	116	16,003	金融	
GLAXOSMITHKLINE PLC	159	159	226	31,067	ヘルスケア	
M&G PLC	687.65	687.65	114	15,683	金融	
VODAFONE GROUP PLC	1,355.23	1,355.23	148	20,387	コミュニケーション・サービス	
NATIONAL GRID PLC	178.73	178.73	168	23,056	公益事業	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	50.47	50.47	134	18,441	生活必需品	
HSBC HOLDINGS PLC	434.04	434.04	128	17,644	金融	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	117.61	117.61	116	15,956	エネルギー	
イギリス・ポンド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,537.86 9銘柄	3,537.86 9銘柄	1,320 <15.2%>	181,027	
(スイス)	百株	百株	千円	千円		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	13.13	13.13	419	48,346	ヘルスケア	
NESTLE SA-REG	58.58	55.78	605	69,790	生活必需品	
ALCON INC	8.77	-	-	-	ヘルスケア	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	10.34	9.03	283	32,714	金融	
NOVARTIS AG-REG	43.89	43.89	350	40,403	ヘルスケア	
GIVAUDAN-REG	1.38	1.08	435	50,214	素材	
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	136.09 6銘柄	122.91 5銘柄	2,095 <20.2%>	241,470	
(スウェーデン)	百株	百株	千円	千円		
ELECTROLUX AB-SER B	-	24.86	519	6,187	一般消費・サービス	
スウェーデン・クロネ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	- -	24.86 1銘柄	519 < 0.5%>	6,187	
ユーロ(オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
KONINKLIJKE PHILIPS NV	83.94	77.85	320	39,632	ヘルスケア	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	65.06	65.06	161	19,925	生活必需品	
KONINKLIJKE DSM NV	37.98	22.61	332	41,121	素材	
KONINKLIJKE KPN NV	879.29	879.29	214	26,526	コミュニケーション・サービス	
ABN AMRO BANK NV-CVA	71.97	-	-	-	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,138.24 5銘柄	1,044.81 4銘柄	1,028 <10.7%>	127,205	
ユーロ(フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TOTAL SE	62.99	62.99	183	22,717	エネルギー	
MICHELIN (CGDE)	21.55	21.55	201	24,907	一般消費・サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	46.76	44.43	495	61,250	資本財・サービス	
BNP PARIBAS	39.9	39.9	129	16,057	金融	
CAPGEMINI SE	18.83	18.83	211	26,110	情報技術	
AXA SA	92.14	121.26	192	23,847	金融	
ALSTOM	47.6	31.77	132	16,352	資本財・サービス	
SANOFI	38.93	38.93	339	41,919	ヘルスケア	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	368.7 8銘柄	379.66 8銘柄	1,885 <19.5%>	233,162	
ユーロ(ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SIEMENS AG-REG	28	28	314	38,911	資本財・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	29.96	29.96	191	23,736	一般消費・サービス	
BASF SE	36.76	36.76	200	24,756	素材	
ALLIANZ SE-REG	11.45	11.45	191	23,644	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		
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	百株	百株	千ユーロ	千円	金融	
12.39	12.39	265	32,843			
SIEMENS ENERGY AG	-	14	30	3,778	資本財・サービス	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	211.45	211.45	306	37,842	コミュニケーション・サービス	
DEUTSCHE POST AG-REG	68.23	68.23	286	35,388	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	398.24 7銘柄	412.24 8銘柄	1,786 <18.5%>	220,904	
ユーロ(スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ENAGAS SA	101.15	101.15	199	24,699	公益事業	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	101.15 1銘柄	101.15 1銘柄	199 < 2.1%>	24,699	
ユーロ(イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
INTESA SANPAOLO	1,005.55	1,005.55	162	20,108	金融	
ENI SPA	182.65	182.65	122	15,125	エネルギー	
ENEL SPA	481.53	481.53	372	46,021	公益事業	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,669.73 3銘柄	1,669.73 3銘柄	657 < 6.8%>	81,256	
ユーロ(フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
NOKIA OYJ	202.77	287.71	99	12,327	情報技術	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	202.77 1銘柄	287.71 1銘柄	99 < 1.0%>	12,327	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,878.83 25銘柄	3,895.3 25銘柄	5,658 <58.6%>	699,556	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	7,552.78 40銘柄	7,580.93 40銘柄	- <94.5%>	1,128,241	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年10月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	1,128,241	94.5
コール・ローン等、その他	66,054	5.5
投資信託財産総額	1,194,295	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、10月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.26円、1イギリス・ポンド=137.06円、1スイス・フラン=115.23円、1デンマーク・クローネ=16.61円、1ノルウェー・クローネ=11.39円、1スウェーデン・クローネ=11.92円、1ユーロ=123.64円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(1,163,356千円)の投資信託財産総額(1,194,295千円)に対する比率は、97.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年10月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,194,295,525円
コール・ローン等	65,690,511
株式(評価額)	1,128,241,158
未収配当金	363,856
(B) 負債	-
(C) 純資産総額(A-B)	1,194,295,525
元本	751,917,656
次期繰越損益金	442,377,869
(D) 受益権総口数	751,917,656口
1万口当り基準価額(C/D)	15,883円

\* 期首における元本額は798,613,848円、当作成期間中における追加設定元本額は21,957,608円、同解約元本額は68,653,800円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)14,160,532円、インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)12,529,567円、成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)234,746,144円、ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド40,988,847円、ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)41,440,051円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)69,975,404円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)130,389,084円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)207,688,027円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は15,883円です。

■損益の状況

当期 自2020年4月16日 至2020年10月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	22,299,063円
受取配当金	22,349,615
受取利息	28
支払利息	△ 50,580
(B) 有価証券売買損益	149,074,487
売買益	180,129,016
売買損	△ 31,054,529
(C) その他費用	△ 397,737
(D) 当期損益金(A+B+C)	170,975,813
(E) 前期繰越損益金	298,006,864
(F) 解約差損益金	△ 37,890,200
(G) 追加信託差損益金	11,285,392
(H) 合計(D+E+F+G)	442,377,869
次期繰越損益金(H)	442,377,869

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

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

# ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

## 運用報告書 第30期（決算日 2020年10月15日）

（作成対象期間 2020年4月16日～2020年10月15日）

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

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

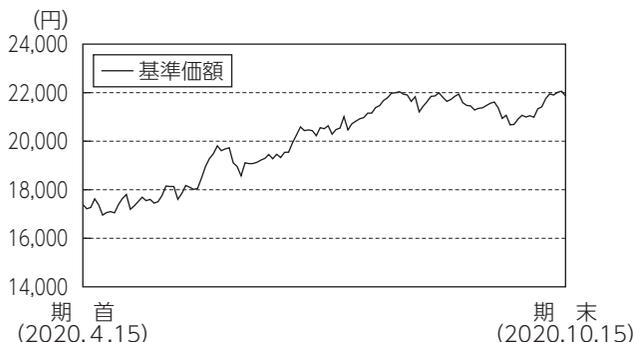
運用方針	アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
株式組入制限	無制限

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		MSCI パシフィック指数 (除く日本、配当込み、円換算)		株式 組入比率		投資信託 組入比率	
	円	騰落率 %	騰落率 %	騰落率 %	騰落率 %	騰落率 %	騰落率 %	
(期首)2020年4月15日	17,392	-	21,113	-	93.2	-	3.1	
4月末	17,637	1.4	21,008	△ 0.5	91.7	-	3.0	
5月末	18,014	3.6	21,762	3.1	94.3	-	3.5	
6月末	19,328	11.1	22,833	8.1	94.1	-	3.0	
7月末	20,972	20.6	23,232	10.0	94.8	-	1.0	
8月末	21,808	25.4	24,526	16.2	96.0	-	1.1	
9月末	21,065	21.1	23,400	10.8	95.9	-	1.2	
(期末)2020年10月15日	21,870	25.7	24,271	15.0	92.7	-	1.2	

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：17,392円 期末：21,870円 騰落率：25.7%

【基準価額の主な変動要因】

新型コロナウイルス感染拡大ペースの減速や経済活動再開などによりアジア・オセアニア株式市況が上昇したこと、投資家のリスク回避姿勢が弱まりアジア・オセアニア通貨が対円で上昇（円安）したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。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

○アジア・オセアニア株式市況

アジア・オセアニア株式市況は上昇しました。

アジア・オセアニア株式市況は、当作成期首から2020年8月にかけて、原油価格の急落や米中対立懸念を受けて下落する場面もありましたが、各国政府および中央銀行による景気刺激策や新型コロナ

ウイルス感染拡大ペースの減速、経済活動再開およびワクチン開発期待などが支援材料となり、大きく上昇しました。9月には米中関係の悪化や米国の追加経済対策に関する不透明感などから調整しましたが、当作成期末にかけては、堅調な中国経済指標などを好感し上昇しました。

○為替相場

アジア・オセアニア地域の通貨は円に対して上昇しました。

アジア・オセアニア地域の通貨は、当作成期首から2020年8月にかけて、各国政府および中央銀行による景気刺激策や感染拡大ペースの減速、経済活動再開などが支援材料となり、おおむね円安に推移しました。その後、9月から当作成期末にかけては、米中関係の悪化は嫌気されたものの、堅調な中国経済指標などを好感し、引き続き円安に推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

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

◆ポートフォリオについて

オーストラリアや中国（香港）、台湾、韓国を中心に、高い利益成長が見込まれた銘柄や予想配当利回りが高いと判断された銘柄などを組み入れました。国別では、各国の投資比率の分散に配慮しつつ、オーストラリアや中国（香港）を高位に組み入れました。セクター別では、金融や情報技術を高位に組み入れましたが、公益事業やエネルギーセクターについては控えめな投資スタンスとしました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

《今後の運用方針》

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

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

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	49円
(株式)	( 47)
(投資信託証券)	( 1)
有価証券取引税	17
(株式)	( 17)
(投資信託証券)	( 0)
その他費用	37
(保管費用)	( 29)
(その他)	( 9)
合 計	103

(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。

(2) 投資信託証券

(2020年4月16日から2020年10月15日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外	オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
		(-)	(-)	(-)	9.7 (-)
国	シンガポール	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
		(-)	(-)	(-)	36 (-)

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 買付(-)内は分割割当、合併等による増減分で、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。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2020年4月16日から2020年10月15日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	オーストラリア	百株	千オーストラリア・ドル	百株	千オーストラリア・ドル
		719 (-)	961 (-)	385	764
	香港	百株	千香港ドル	百株	千香港ドル
		4,029 (16.77)	6,782 (△ 39)	7,070	10,321
	シンガポール	百株	千シンガポール・ドル	百株	千シンガポール・ドル
263 (-)		235 (-)	1,124	356	
台湾	百株	千台湾ドル	百株	千台湾ドル	
	910 (-)	3,929 (△ 71)	500	13,527	
韓国	百株	千韓国ウォン	百株	千韓国ウォン	
	98.23 (-)	846,038 (-)	54.1	499,471	
国	中国	百株	千オフショア人民元	百株	千オフショア人民元
		(24.89)	(-)	1,087.58	2,364

(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。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

■主要な売買銘柄

株 式

(2020年4月16日から2020年10月15日まで)

当 期				期 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
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD (オーストラリア)	14.3	20,187	1,411	CSL LTD (オーストラリア)	1.3	27,467	21,129
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR (香港)	4.6	16,951	3,685	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	15	21,824	1,454
NAVER CORP (韓国)	0.55	13,585	24,700	SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)	41	18,125	442
BHP GROUP LTD (オーストラリア)	4.6	13,495	2,933	LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A (中国)	9.57	16,374	1,711
SANDS CHINA LTD (ケイマン諸島)	16.8	7,190	427	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)	31	16,027	517
KIWOOM SECURITIES CO LTD (韓国)	0.7	7,187	10,268	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS (シンガポール)	80.6	14,825	183
HYUNDAI MOTOR CO (韓国)	0.8	7,046	8,808	XINYI GLASS HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)	100	12,365	123
WEICHAI POWER CO LTD-H (中国)	32	6,915	216	CHINA MOBILE LTD (香港)	16	11,569	723
CHINA LIFE INSURANCE CO-H (中国)	28	6,855	244	LG CHEM LTD (韓国)	0.2	11,481	57,407
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H (中国)	32	6,825	213	WIWYNN CORP (台湾)	4	11,013	2,753

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	期 首		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	額	
(オーストラリア)	百株	百株	千円	千円	
BHP GROUP LTD	47	87	313	23,534	素材
SOUTH32 LTD	-	409	85	6,417	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	45	63	115	8,641	エネルギー
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	-	143	273	20,506	金融
WESTPAC BANKING CORP	38	25	46	3,509	金融
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	22.5	32.5	223	16,756	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD	48	56	217	16,325	生活必需品
TELSTRA CORP LTD	289	-	-	-	コミュニケーション・サービス
MACQUARIE GROUP LTD	22	17	223	16,743	金融
CSL LTD	19	6	181	13,617	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	49	60	287	21,564	一般消費・サービス
JB HI-FI LTD	24	39	205	15,396	一般消費・サービス
オーストラリア・ドル 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	603.5 10銘柄	937.5 11銘柄	2,171 163,014	<23.7%>
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	575	-	-	-	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	45	-	-	-	不動産
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	-	280	468	6,365	一般消費・サービス
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	-	41	1,529	20,767	金融
TENCENT HOLDINGS LTD	12	-	-	-	コミュニケーション・サービス
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	660	-	-	-	コミュニケーション・サービス
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	410	-	-	-	不動産
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	1,000	-	-	-	一般消費・サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	110	75	394	5,362	素材

銘柄	期 首		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	額	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	850	820	434	5,901	金融
CHINA MOBILE LTD	160	-	-	-	コミュニケーション・サービス
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY -H	1,200	-	-	-	資本財・サービス
AIA GROUP LTD	190	170	1,382	18,780	金融
CHINA RESOURCES CEMENT	-	420	433	5,886	素材
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	-	100	519	7,054	資本財・サービス
CHINA AOYUAN GROUP LTD	-	490	383	5,203	不動産
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	-	320	612	8,317	金融
KWG GROUP HOLDINGS LTD	865	755	821	11,155	不動産
SANDS CHINA LTD	140	260	711	9,656	一般消費・サービス
KWG GROUP RTS	-	16.77	184	2,500	不動産
CHINA MENGNIU DAIRY CO	180	-	-	-	生活必需品
WEICHAI POWER CO LTD-H	290	320	541	7,352	資本財・サービス
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	-	280	502	6,829	金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	-	245	440	5,982	金融
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	620	-	-	-	一般消費・サービス
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	310	-	-	-	不動産
香 港 ド ル 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	7,617 17銘柄	4,592.77 15銘柄	9,360 127,116	<18.5%>
(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	36	-	-	-	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	-	40	85	6,612	金融
CAPITALAND LTD	200	-	-	-	不動産
VENTURE CORP LTD	-	40	84	6,544	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	806	-	-	-	コミュニケーション・サービス

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	百株	百株	千円	千円	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>	株数、金額 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	千台湾ドル	千円	
WIWYNN CORP	40	—	—	—	情報技術
ACCTON TECHNOLOGY CORP	110	—	—	—	情報技術
MEDIATEK INC	130	120	8,268	30,260	情報技術
MEGA FINANCIAL HOLDING CO.LT	1,250	1,120	3,136	11,477	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO.LT	1,010	1,800	3,258	11,924	金融
POYA INTERNATIONAL CO.LTD	60	70	4,025	14,731	一般消費・サービス
MERIDA INDUSTRY CO.LTD	—	50	1,205	4,410	一般消費・サービス
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	530	380	17,442	63,837	情報技術
台湾ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	千韓国ウォン	千円	
SK HYNIX INC	8	—	—	—	情報技術
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3	—	—	—	金融
HYUNDAI MOTOR CO	6	13	231,400	21,288	一般消費・サービス
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	—	5	64,000	5,888	生活必需品
HYUNDAI MOBIS CO.LTD	—	3	69,450	6,389	一般消費・サービス
COSMAX INC	—	7.73	92,760	8,533	生活必需品
KT&G CORP	—	8	65,680	6,042	生活必需品
NAVER CORP	—	5.5	164,175	15,104	コミュニケーション・サービス
NCSOFT CORP	1.1	—	—	—	コミュニケーション・サービス
KIWOOM SECURITIES CO.LTD	—	7	68,740	6,324	金融
LG CHEM LTD	2	2	125,600	11,555	素材
KB FINANCIAL GROUP INC	30	38	147,250	13,547	金融
SAMSUNG ELECTRONICS CO.LTD	124	112	682,080	62,751	情報技術
HANA FINANCIAL GROUP	24	41	119,310	10,976	金融
韓国ウォン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国)	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	千オフショア人民元	千円	
KWEICHOW MOUTAI CO.LTD-A	6	6	1,037	16,266	生活必需品
LUZHOU LAOJIAO CO.LTD-A	95.7	—	—	—	生活必需品
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	82.99	—	—	—	情報技術
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	28	—	—	—	資本財・サービス
CHINA STATE CONSTRUCTION-A	856	—	—	—	資本財・サービス
オフショア人民元 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	株数、金額 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	

(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。

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円	
GOODMAN GROUP	15.4	5.7	109	8,225	
オーストラリア・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	口数、金額 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円	
CAPITALAND MALL TRUST	36	—	—	—	
シンガポール・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	口数、金額 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	
合計	口数、金額 銘柄数<比率>	口数、金額 銘柄数<比率>	外貨建金額	邦貨換算金額	

(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。

# ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

## ■投資信託財産の構成

2020年10月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 638,725	% 89.6
投資信託証券	8,225	1.2
コール・ローン等、その他	65,787	9.2
投資信託財産総額	712,738	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、10月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.26円、1オーストラリア・ドル=75.08円、1香港ドル=13.58円、1シンガポール・ドル=77.54円、1台湾ドル=3.66円、100韓国ウォン=9.20円、1オフショア人民元=15.68円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(683,386千円)の投資信託財産総額(712,738千円)に対する比率は、95.9%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年10月15日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>741,844,725円</b>
コール・ローン等	17,167,597
株式(評価額)	638,725,800
投資信託証券(評価額)	8,225,314
未収入金	76,910,498
未収配当金	815,516
<b>(B) 負債</b>	<b>53,120,182</b>
未払金	48,879,182
未払解約金	4,241,000
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>688,724,543</b>
元本	314,918,398
次期繰越損益金	373,806,145
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>314,918,398口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	21,870円

\* 期首における元本額は360,052,000円、当作成期間中における追加設定元本額は825,989円、同解約元本額は45,959,591円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)10,586,776円、インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)9,456,274円、成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)176,307,191円、ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド31,602,842円、ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)30,885,067円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)9,679,931円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)17,843,013円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)28,557,304円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は21,870円です。

## ■損益の状況

当期 自2020年4月16日 至2020年10月15日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>9,581,548円</b>
受取配当金	9,582,361
受取利息	361
支払利息	△ 1,174
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>147,352,589</b>
売買益	175,627,253
売買損	△ 28,274,664
<b>(C) その他費用</b>	<b>△ 1,278,036</b>
<b>(D) 当期損益金(A + B + C)</b>	<b>155,656,101</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>266,154,442</b>
<b>(F) 解約差損益金</b>	<b>△ 48,901,409</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>897,011</b>
<b>(H) 合計(D + E + F + G)</b>	<b>373,806,145</b>
<b>次期繰越損益金(H)</b>	<b>373,806,145</b>

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

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

# ダイワ好配当日本株マザーファンド

## 運用報告書 第31期 (決算日 2020年10月15日)

(作成対象期間 2020年4月16日～2020年10月15日)

ダイワ好配当日本株マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

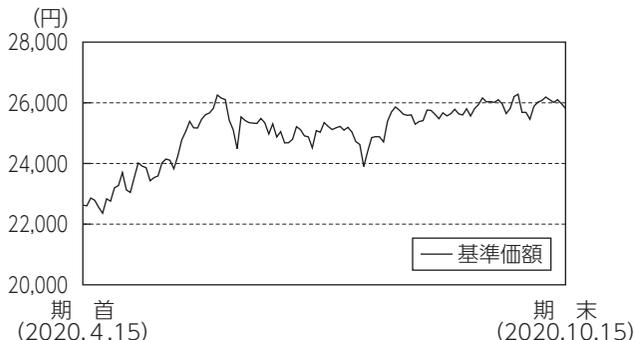
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）
株式組入制限	無制限

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		T O P I X		株 組 比	式 入 率	株 先 比	式 物 率	投資信託 証券 組入比率
	円	%	(参考指数)	%					
(期首)2020年4月15日	22,627	-	1,434.07	-	95.1	-	-	-	-
4月末	23,698	4.7	1,464.03	2.1	96.7	-	-	-	-
5月末	25,175	11.3	1,563.67	9.0	96.0	-	-	-	-
6月末	25,049	10.7	1,558.77	8.7	94.5	-	-	-	-
7月末	23,899	5.6	1,496.06	4.3	95.3	-	-	-	-
8月末	25,669	13.4	1,618.18	12.8	94.9	-	-	-	-
9月末	25,685	13.5	1,625.49	13.3	94.3	-	-	-	-
(期末)2020年10月15日	25,815	14.1	1,631.79	13.8	94.8	-	-	-	-

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：22,627円 期末：25,815円 騰落率：14.1%

【基準価額の主な変動要因】

新型コロナウイルスに対する金融・財政政策への期待などから国内株式市況が上昇したことがプラス要因となり、基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、主要国の中央銀行による緩和的な金融政策や、新型コロナウイルスの新規感染者数の増加ペースが緩やかになった欧米で経済活動の再開が進展したこと、国内でも2020年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、上昇しました。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。その後7月に、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、株価は7月下旬に下落したものの、8月に入ると、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。8月下旬に安倍首相が健康問題を理由に退任を表明した際には株価が一時下落する場面が見られたものの、後任の首相として菅官房長官が有力

との見方が早期に広がり、政策の継続性が保たれるとの安心感から、株価は直ぐに落ち着きを取り戻しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

新型コロナウイルス問題がいつ収束に向かうかは不透明な状況が続きますが、株式の需給要因などから企業の実態以上に株価が大幅に調整し、配当利回りが上昇した銘柄が多く見られます。中長期的には、そのような銘柄に対してより割安な水準で投資できる機会として捉え、調査・分析に努めてまいります。また、厳しい環境下でも配当政策を維持・向上させ、一定の配当利回り水準に位置し、自己株買いを実施するなどの株主還元策に取り組み企業においては、その裏付けとして競争力のあるビジネスモデルや安定した収益基盤、質の高い経営力を持つと考えられます。そのような観点からも、引き続き配当利回りが高い銘柄を中心に、株主還元姿勢や株価の割安性に注目し、投資することでパフォーマンスの向上をめざしてまいります。

◆ポートフォリオについて

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

株式組入比率は、90%以上を維持しました。

業種構成は、繊維製品、サービス業、電気機器などの組入比率を引き上げた一方、陸運業、医薬品、輸送用機器などの組入比率を引き下げました。当作成期末では、電気機器、化学、情報・通信業などを中心としたポートフォリオとしました。

個別銘柄では、業績見通しやバリュエーションの割安感、配当利回りの高さなどから日立、三菱瓦斯化学、三井倉庫H O L Dなどを買い付けました。一方で、業績見通しの相対感や配当利回りの水準、バリュエーションの割安感が薄れてきたことなどからパナソニック、西日本旅客鉄道、N T Tドコモなどを売却しました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

参考指数の騰落率を下回った陸運業をアンダーウエートとしていたことなどがプラス要因となりましたが、参考指数の騰落率を上回ったサービス業や電気機器をアンダーウエートとしていたことなどはマイナス要因となりました。

個別銘柄では、Zホールディングス、デクセリアルズ、プレミアグループなどはプラスに寄与しましたが、日本電信電話、K D D I、東京海上HDなどがマイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

先行きが不透明な相場環境にあって、高配当利回り株などの割安株の出遅れが続いてきましたが、株価の見直しの余地は大きいと考えます。米国の長期金利に下げ止まり感が出たことや、グローバル経済の回復期待から、その変動に影響を受けやすい割安株の見直しの気運は高まりつつあります。そうした割安感がある銘柄の中でも、既存事業の再構築や新たな事業展開などによって業績の回復が期待される銘柄に注目して、調査・選別を行ってまいります。また、中長期的に安定した収益基盤や財務基盤を有し、資本効率の改善や株主を重視する経営姿勢を背景にして、配当などの株主還元策の維持・向上を進める銘柄にも注目してまいります。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	7円 (7)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	7

(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

株 式

(2020年4月16日から2020年10月15日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 773.3 (-)	千円 1,366,853 (-)	千株 1,453.8	千円 1,921,504

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

株 式

(2020年4月16日から2020年10月15日まで)

当					期				
買			付		売			付	
銘	柄	株 数	金 額	平均単価	銘	柄	株 数	金 額	平均単価
		千株	千円	円			千株	千円	円
日立		69.6	217,975	3,131	パナソニック		122.1	107,193	877
三菱瓦斯化学		52.8	91,058	1,724	Zホールディングス		177	94,138	531
マブチモーター		22.4	90,959	4,060	ファナック		4.5	85,407	18,979
三井倉庫HOLD		48.4	88,769	1,834	タキロンシーアイ		121.5	84,432	694
リコー		111.8	86,106	770	西日本旅客鉄道		11.2	76,639	6,842
グンゼ		19.8	78,907	3,985	パーク24		35.3	71,551	2,026
伊藤忠		30.8	71,687	2,327	三菱商事		33.3	71,402	2,144
セーレン		42.3	62,373	1,474	ブリヂストン		20.7	67,545	3,263
日本曹達		19.4	60,427	3,114	荏原実業		22.7	67,213	2,960
スター精密		42.5	59,982	1,411	丸全昭和運輸		21.9	67,204	3,068

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表  
国内株式

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	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		
<b>鉱業 (0.3%)</b>							大塚ホールディングス	50	50	203,900			MC J	78.2	78.2	75,775				
国際石油開発帝石	75	75	41,047				<b>石油・石炭製品 (0.4%)</b>						テクノメディカ	1.7	1.7	2,861				
<b>建設業 (4.3%)</b>							出光興産	23.7	-	-			E I Z O	13.3	13.3	49,941				
ウエストホールディングス	1	1	3,095				ENEOSホールディングス	138.6	157	58,561			日本信号	-	1.1	1,080				
ミライト・ホールディングス	15	15	24,045				<b>ゴム製品 (0.3%)</b>						パナソニック	122.1	-	-				
大成建設	12.5	12.5	43,750				TOYO TIRE	-	29.5	48,468			TDK	11.5	11.5	142,830				
熊谷組	30	30	75,660				ブリヂストン	20.7	-	-			アドバンテスト	33.9	33.9	185,772				
五洋建設	135	135	89,640				<b>ガラス・土石製品 (1.3%)</b>						エスベック	35.4	-	-				
住友林業	50.5	39.2	68,012				日本特殊陶業	-	32.6	59,560			ウシオ電機	55.4	-	-				
大和ハウス	21.3	21.3	61,013				黒崎播磨	17.5	-	-			ファナック	4.5	-	-				
積水ハウス	55	45.9	82,528				ニチアス	59.5	53.5	129,791			村田製作所	24	24	174,024				
九電工	31	31	91,977				<b>鉄鋼 (0.6%)</b>						キャノン	28.5	-	-				
OSJBHD	310.4	310.4	74,806				日本冶金工	25.1	25.1	38,679			リコー	-	111.8	74,347				
<b>食料品 (1.6%)</b>							栗本鉄工所	32.2	23.1	42,896			東京エレクトロン	7.8	7.8	229,671				
ブルボン	23.2	23.2	44,845				<b>非鉄金属 (2.4%)</b>						<b>輸送用機器 (6.4%)</b>							
太陽化学	23	23	41,446				大紀アルミニウム	99.7	53.7	30,662			豊田自動織機	13.9	13.9	94,937				
日本たばこ産業	66.8	66.8	133,767				三井金属	39.3	39.3	98,171			デンソー	39.4	39.4	189,474				
<b>繊維製品 (1.9%)</b>							住友鉱山	27.5	27.5	89,072			日産自動車	50	-	-				
グンゼ	-	19.8	78,210				アサヒHD	34.8	34.8	123,888			トヨタ自動車	52.2	52.2	360,963				
東洋紡	73.9	71.8	105,689				<b>金属製品 (3.3%)</b>						三菱自動車工業	160	-	-				
富士紡ホールディングス	-	6.4	22,816				SUMCO	70	70	112,070			ミクニ	69.7	69.7	18,122				
セーレン	-	42.3	65,945				川田テクノロジーズ	13.4	13.4	60,970			アイシン精機	25.7	12.4	40,982				
<b>化学 (11.0%)</b>							信和	55.8	55.8	38,613			本田技研	77.6	77.6	196,134				
旭化成	192.9	192.9	175,326				三和ホールディングス	96.5	96.5	113,194			<b>精密機器 (0.7%)</b>							
共和レザー	67.9	67.9	40,536				日東精工	121.7	121.7	58,050			ナカニシ	15.3	15.3	29,605				
フレハ	15	15	68,400				東京製綱	49.4	-	-			セイコーHD	55.9	50	67,650				
日本曹達	-	19.4	55,581				マルゼン	32.6	32.6	58,517			<b>その他製品 (2.9%)</b>							
大阪ソーダ	22.3	22.3	56,753				ファインシンター	19.5	19.5	31,785			トランザクシオン	85	37.8	38,934				
信越化学	9.3	9.3	132,850				<b>機械 (5.4%)</b>						フジールインターナショナル	-	18.9	38,329				
日本化学工業	11.1	8.7	19,888				タクマ	55.8	58.9	96,949			大日本印刷	55.4	67.9	143,404				
四国化成	46.9	46.9	53,653				DMG森精機	30	30	44,850			リンテック	23.6	23.6	56,097				
三菱瓦斯化学	-	52.8	107,500				ソディック	68.7	68.7	51,937			任天堂	3	2.3	134,734				
東京応化工業	17.2	11.5	69,115				技研製作所	21.2	21.2	82,998			<b>陸運業 (0.8%)</b>							
タキロンシーアイ	121.5	-	-				荏原実業	39.8	17.1	55,147			西日本旅客鉄道	11.2	-	-				
旭有機材	58.4	58.4	77,847				三精テクノロジーズ	30	30	18,000			丸全昭和運輸	36.5	14.6	48,618				
リケンテクノス	52.4	52.4	21,641				北越工業	35.7	-	-			セコグループHLDS	45.2	72	69,120				
ダイキアクシス	81.1	59.5	53,609				ダイフク	11	11	123,860			九州旅客鉄道	17.3	-	-				
第一工業製薬	49.5	49.5	195,772				キトー	59.7	59.7	68,893			SGホールディングス	19.2	-	-				
三洋化成	6.2	6.2	30,008				JUKI	61.8	-	-			倉庫・運輸関連業 (0.6%)							
日本特殊塗料	18	-	-				日本トムソン	138.8	138.8	50,662			三井倉庫HOLD	-	48.4	89,878				
太陽ホールディングス	11	11	59,180				IHI	79.9	79.9	106,906			<b>情報・通信業 (10.8%)</b>							
デクセリアルズ	151.2	151.2	174,031				スター精密	-	42.5	60,987			SRAホールディングス	7.8	7.8	18,595				
藤森工業	10.6	10.6	44,573				<b>電気機器 (11.1%)</b>						Zホールディングス	755.2	578.2	442,901				
天馬	9.2	-	-				ブラザー工業	23.6	-	-			伊藤忠テクノソリューションズ	12.3	12.3	47,293				
信越ポリマー	130.4	130.4	119,837				日立	-	69.6	247,288			アルゴグラフィックス	14.9	29.5	97,940				
バルカー	6.7	-	-				三菱電機	75	75	103,612			日本ユニシス	12	12	41,640				
<b>医薬品 (5.1%)</b>							富士電機	43.5	43.5	137,460			コネクシオ	29.6	29.6	35,549				
武田薬品	110	110	394,570				明電舎	21.9	9.9	15,602			日本電信電話	160.9	160.9	361,703				
アステラス製薬	43.2	43.2	63,914				マブチモーター	-	22.4	94,864			KDDI	95	95	260,680				
沢井製薬	11.6	11.6	57,942				愛知電機	20	20	45,120			ソフトバンク	149.2	149.2	180,830				

銘柄	当 期 末			銘柄	当 期 末			銘柄	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	
NTTドコモ	21.8	-	-	J.フロントリテイリング	39.4	39.4	32,741	パーク24	35.3	-	-	
コナミホールディングス	11.2	11.2	50,344	コジマ	-	42.2	27,767	三井不動産	17.5	17.5	33,258	
<b>卸売業 (10.3%)</b>				<b>銀行業 (5.6%)</b>				東京建物	85	85	106,845	
エレマテック	22.8	22.8	21,705	三菱UFJフィナンシャルG	664.7	664.7	279,174	<b>サービス業 (2.1%)</b>				
アルコニックス	66.3	66.3	102,300	りそなホールディングス	150	150	53,175	日本工営	7.9	7.9	21,646	
ダイワボウHD	8	13.5	89,370	三井住友トラストHD	45.1	45.1	128,354	ディップ	-	30.1	64,323	
レスターホールディングス	32	11.7	25,915	三井住友フィナンシャルG	89.3	89.3	264,060	日本空調サービス	39.2	78.7	56,506	
TOKAIホールディングス	194.7	194.7	207,550	セブン銀行	275	275	69,025	ベルシステム24HLDGS	65.7	65.7	112,938	
三洋貿易	149.2	149.2	150,095	<b>証券、商品先物取引業 (1.2%)</b>				日本管財	10.4	10.4	21,403	
コメダホールディングス	32.8	32.8	61,237	SBIホールディングス	65	65	165,165	丹青社	35.7	35.7	26,025	
萩原電気HLDGS	18.2	18.2	39,712	<b>保険業 (4.5%)</b>				<b>合 計</b>	株数、金額	9,592.4	8,911.9	14,174.321
ダイトロン	57.1	57.1	85,250	SOMPOホールディングス	20	20	76,820	銘柄数<比率>	156銘柄	149銘柄	<94.8%>	
伊藤忠	41.9	72.7	192,582	MS & AD	55	55	159,527					
三井物産	119	119	216,937	第一生命HLDGS	40	40	63,720					
スターゼン	14.9	10.8	42,390	東京海上HD	69.6	69.6	337,212					
三菱商事	75	41.7	104,187	<b>その他金融業 (2.6%)</b>								
西KWI SMETTAC HD	18	18	33,534	プレミアグループ	86.9	85.6	179,674					
日鉄物産	29.5	29.5	88,264	オリックス	135	135	182,182					
<b>小売業 (1.0%)</b>				<b>不動産業 (1.4%)</b>								
パルグループHLDGS	68.6	68.6	75,254	ハウスドゥ	49.3	49.3	62,906					

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

■投資信託財産の構成

2020年10月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	14,174,321	94.7
コール・ローン等、その他	790,749	5.3
投資信託財産総額	14,965,071	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10月15日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>14,965,071,326円</b>
コール・ローン等	610,622,131
株式(評価額)	14,174,321,760
未収入金	2,391,535
未収配当金	177,735,900
<b>(B) 負債</b>	<b>15,311,060</b>
未払金	10,611,060
未払解約金	4,700,000
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>14,949,760,266</b>
元本	5,791,011,754
次期繰越損益金	9,158,748,512
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>5,791,011,754口</b>
<b>1万口当り基準価額(C/D)</b>	<b>25,815円</b>

\*期首における元本額は6,048,168,456円、当作成期間中における追加設定元本額は102,143,788円、同解約元本額は359,300,490円です。  
 \*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ好配当日本株投信(季節点描) 3,907,210,325円、ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株) 26,569,688円、安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 26,616,474円、インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 24,091,913円、成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 438,643,793円、ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド77,062,950円、ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型) 77,303,543円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) 206,208,929円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース) 385,576,784円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース) 621,727,355円です。  
 \*当期末の計算口数当りの純資産額は25,815円です。

■損益の状況

当期 自2020年4月16日 至2020年10月15日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>199,884,156円</b>
受取配当金	200,008,386
受取利息	2,238
その他収益金	1,538
支払利息	△ 128,006
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>1,709,422,949</b>
売買益	2,055,954,019
売買損	△ 346,531,070
<b>(C) その他費用</b>	<b>△ 5,251</b>
<b>(D) 当期損益金(A + B + C)</b>	<b>1,909,301,854</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>7,636,937,956</b>
<b>(F) 解約差損益金</b>	<b>△ 541,606,510</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>154,115,212</b>
<b>(H) 合計(D + E + F + G)</b>	<b>9,158,748,512</b>
<b>次期繰越損益金(H)</b>	<b>9,158,748,512</b>

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

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