ダイワファンドラップ　インデックス・シリーズ

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

運用報告書（全体版）

第５期

（決算日　2021年６月15日）
（作成対象期間　2020年６月16日～2021年６月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ　インデックス・シリーズ」は、このたび、第５期の決算を行ないました。

ここに、当作成期の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

◇SUZ0464120210615◇

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

ダイワファンドラップ
ＴＯＰＩＸインデックス

運用報告書（全体版）
第５期
（決算日　2021年６月15日）
（作成対象期間　2020年６月16日～2021年６月15日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	投資成果を東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

<4641>

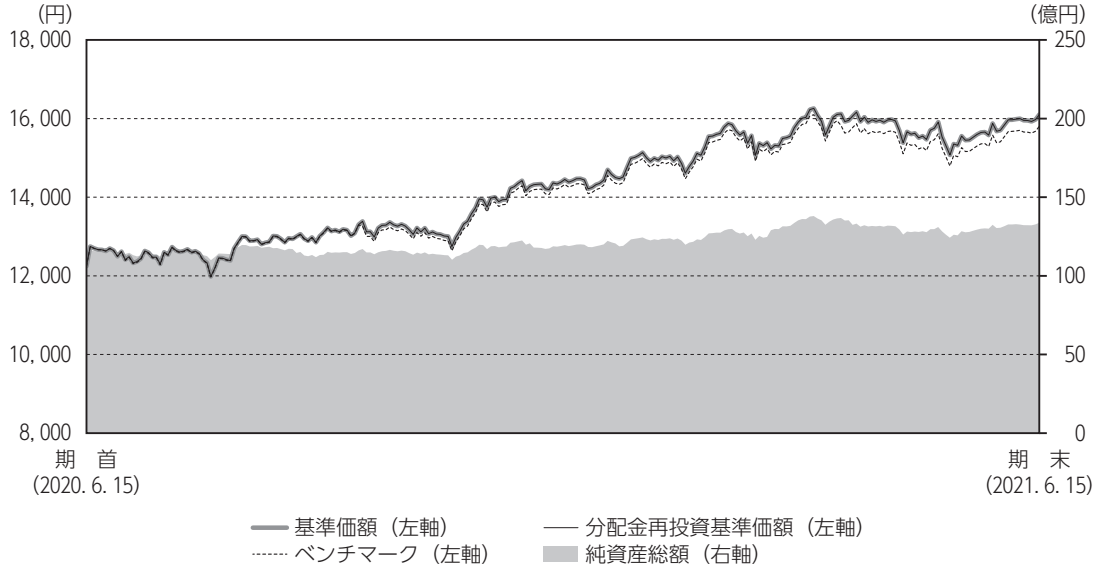
設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ＴＯＰＩＸ		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1期末(2017年6月15日)	11,964	0	19.6	1,588.09	17.7	98.8	1.2	4,959
2期末(2018年6月15日)	13,726	0	14.7	1,789.04	12.7	98.7	1.2	8,562
3期末(2019年6月17日)	12,045	0	△ 12.2	1,539.74	△ 13.9	98.5	1.5	8,839
4期末(2020年6月15日)	12,246	0	1.7	1,530.78	△ 0.6	98.2	1.6	11,171
5期末(2021年6月15日)	16,103	0	31.5	1,975.48	29.1	97.4	2.6	13,378

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

運用経過

基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期　首：12,246円
期　末：16,103円（分配金０円）
騰落率：31.5%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の受益証券を通じて、わが国の株式に投資した結果、株式市況が上昇したことを反映して、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。

年　月　日	基準価額	騰落率	ＴＯＰＩＸ（ベンチマーク）	騰落率	株式組入比率	株式先物比率
	円	%		%	%	%
(期首)2020年６月15日	12,246	—	1,530.78	—	98.2	1.6
６月末	12,488	2.0	1,558.77	1.8	97.8	2.1
７月末	11,983	△ 2.1	1,496.06	△ 2.3	98.7	1.2
８月末	12,959	5.8	1,618.18	5.7	99.1	0.8
９月末	13,121	7.1	1,625.49	6.2	98.5	1.4
10月末	12,747	4.1	1,579.33	3.2	97.9	2.0
11月末	14,166	15.7	1,754.92	14.6	97.9	1.8
12月末	14,583	19.1	1,804.68	17.9	98.8	1.1
2021年１月末	14,612	19.3	1,808.78	18.2	99.1	0.8
２月末	15,066	23.0	1,864.49	21.8	99.3	0.7
３月末	15,924	30.0	1,954.00	27.6	98.1	2.8
４月末	15,469	26.3	1,898.24	24.0	98.2	1.8
５月末	15,677	28.0	1,922.98	25.6	97.2	2.8
(期末)2021年６月15日	16,103	31.5	1,975.48	29.1	97.4	2.6

（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

（2020.6.16 ～ 2021.6.15）

■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、国内外の新型コロナウイルスの感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、横ばい圏で推移しました。2020年11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通りの当選確実となって選挙に対する不確実性が後退したことや、欧米において複数のワクチンが承認されて接種が始まったことが好感され、株価は上昇しました。2021年に入っても、１月は米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利し、大統領府および上下両院共に民主党が制したことで大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、３月には米国の追加経済対策が発表されたことで同国の景気回復期待が高まったことが好感され、株価は強含みで推移しました。４月からは、国内の感染状況が悪化して再び緊急事態宣言が発出されたことや、米国においてインフレ懸念が高まったことが嫌気されて株価は下落したものの、５月中旬以降は、インフレ懸念の一服や国内でワクチンの高齢者向け大規模接種が開始されたことが好感され、株価は反発しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて　（2020. 6. 16 ～ 2021. 6. 15）

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

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

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
トピックス・インデックス・マザーファンド	ＴＯＰＩＸ

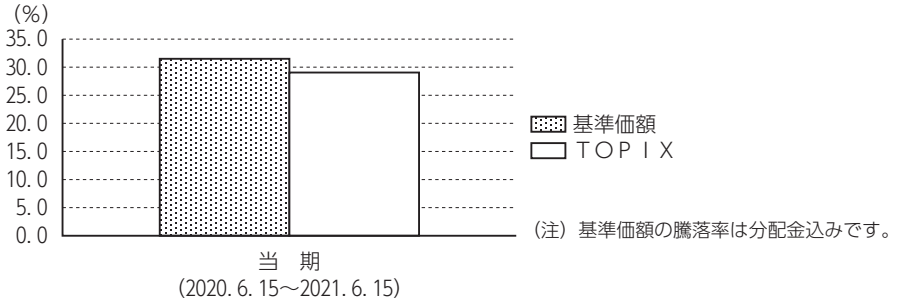
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は29. 1％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は31. 5％となりました。

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

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

＊ベンチマークはＴＯＰＩＸ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６月16日 ～2021年６月15日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**―**
対基準価額比率	（％）	―
当期の収益	（円）	―
当期の収益以外	（円）	―
翌期繰越分配対象額	（円）	6,102

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

今後の運用方針

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

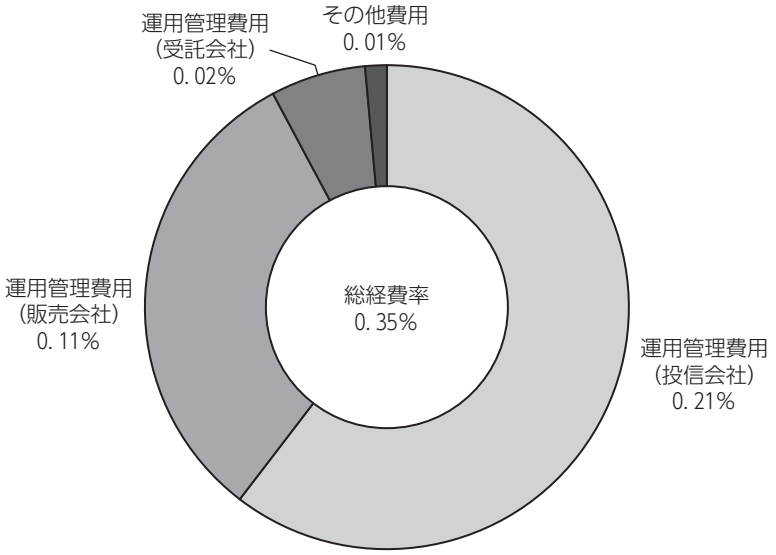
項　目	当　期 (2020. 6. 16～2021. 6. 15) 金　額	比　率	項　目　の　概　要
信　託　報　酬	49円	0. 341%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は14, 275円です。**
(投 信 会 社)	(30)	(0. 209)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(16)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0. 001	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株　　式)	(0)	(0. 000)	
(先物・オプション)	(0)	(0. 001)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ　の　他)	(0)	(0. 000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	50	0. 348	

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（１口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0. 35%です。



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

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	1,836,996	2,210,300	2,859,235	3,340,200

（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６月16日から2021年６月15日まで）

項目	当期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
（a）期中の株式売買金額	35,290,654千円
（b）期中の平均組入株式時価総額	158,416,177千円
（c）売買高比率　（a）／（b）	0.22

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

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	15,245	1,782	11.7	20,045	1,227	6.1
株式先物取引	32,313	5,215	16.1	30,592	4,074	13.3
コール・ローン	3,706,152	—	—	—	—	—

（注）平均保有割合7.5%
※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

種類	当期		
	トピックス・インデックス・マザーファンド		
	買付額	売付額	作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	18	35	327

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

種類	当期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
	買付額
	百万円
株式	66

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

(5) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

項目	当期
売買委託手数料総額（A）	170千円
うち利害関係人への支払額（B）	20千円
（B）／（A）	11.8%

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

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第１項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、大和証券グループ本社、マネーパートナーズグループ、サムティです。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	11,062,968	10,040,729	13,377,264

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年６月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	13,377,264	99.8
コール・ローン等、その他	23,051	0.2
投資信託財産総額	13,400,315	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年６月15日現在

項目	当期末
（A）資産	**13,400,315,578円**
コール・ローン等	23,051,434
トピックス・インデックス・マザーファンド（評価額）	13,377,264,144
（B）負債	**22,129,793**
未払解約金	61,998
未払信託報酬	21,717,604
その他未払費用	350,191
（C）純資産総額（A－B）	**13,378,185,785**
元本	8,307,899,565
次期繰越損益金	5,070,286,220
（D）受益権総口数	**8,307,899,565口**
１万口当り基準価額（C／D）	**16,103円**

＊期首における元本額は9,121,901,905円、当作成期間中における追加設定元本額は2,257,267,174円、同解約元本額は3,071,269,514円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は16,103円です。

■損益の状況

当期　自 2020年６月16日　至 2021年６月15日

項　　目	当　　期
（Ａ）配当等収益	△ **4, 246円**
受取利息	858
支払利息	△ 5, 104
（Ｂ）有価証券売買損益	**2, 779, 250, 728**
売買益	3, 295, 942, 981
売買損	△ 516, 692, 253
（Ｃ）信託報酬等	△ **42, 143, 070**
（Ｄ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	**2, 737, 103, 412**
（Ｅ）前期繰越損益金	△ **159, 465, 567**
（Ｆ）追加信託差損益金	**2, 492, 648, 375**
（配当等相当額）	(1, 091, 182, 361)
（売買損益相当額）	(1, 401, 466, 014)
（Ｇ）合計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	**5, 070, 286, 220**
次期繰越損益金（Ｇ）	**5, 070, 286, 220**
追加信託差損益金	2, 492, 648, 375
（配当等相当額）	(1, 091, 182, 361)
（売買損益相当額）	(1, 401, 466, 014)
分配準備積立金	2, 577, 642, 091
繰越損益金	△ 4, 246

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項　　目	当　　期
（ａ）経費控除後の配当等収益	0円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	2, 233, 509, 299
（ｃ）収益調整金	2, 492, 648, 375
（ｄ）分配準備積立金	344, 132, 792
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	5, 070, 290, 466
（ｆ）分配金	0
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	5, 070, 290, 466
（ｈ）受益権総口数	8, 307, 899, 565口

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワファンドラップ　ＴＯＰＩＸインデックス）が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（2020年９月23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６月15日）現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■トピックス・インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

株　　式

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

買付				売付			
銘　　柄	株　数	金　額	平均単価	銘　　柄	株　数	金　額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
キーエンス	9.8	523,352	53,403	ＮＴＴドコモ	478.3	1,860,953	3,890
東芝	129.6	489,574	3,777	トヨタ自動車	116.5	889,062	7,631
トヨタ自動車	47	351,100	7,470	エムスリー	62.9	569,290	9,050
ソニーグループ	32.4	304,865	9,409	日本電信電話	164.5	433,130	2,633
信越化学	17.3	296,807	17,156	ソフトバンクグループ	42	339,497	8,083
ソフトバンクグループ	39.5	292,784	7,412	ソニーグループ	33.8	332,039	9,823
ＫＤＤＩ	84	274,629	3,269	任天堂	5.3	329,577	62,184
エムスリー	34.3	246,257	7,179	第一三共	92	281,969	3,064
武田薬品	43.3	164,812	3,806	キーエンス	5.1	262,986	51,565
ＡＮＡホールディングス	69.4	159,790	2,302	ファナック	8.8	227,814	25,888

（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６月15日現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンド（136,188,256千口）の内容です。

(1) 国内株式

銘　　柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
水産・農林業（0.1%）		
極洋	3.1	9,141
日本水産	83.4	45,536
マルハニチロ	14	34,398
カネコ種苗	2.7	3,996
サカタのタネ	10.6	40,810
ホクト	7.9	15,294
ホクリヨウ	2.3	1,771
鉱業（0.2%）		
住石ホールディングス	21.6	2,764
日鉄鉱業	2.1	13,104
三井松島 HLDGS	3.6	3,556
ＩＮＰＥＸ	324.7	263,007
石油資源開発	11.9	23,764
K&O エナジーグループ	4.2	5,665
建設業（2.3%）		
ヒノキヤグループ	2.3	6,035
ショーボンドＨＤ	12.7	59,118
ミライト・ホールディングス	30.6	59,455
タマホーム	5.7	12,893
サンヨーホームズ	1.5	1,104
日本アクア	4.1	2,300
ファーストコーポレーション	3	2,271
ベステラ	1.8	2,934
キャンディル	1.7	962
スペースバリューHD	11.5	7,682
ダイセキ環境ソリューション	1.6	1,475
第一カッター興業	2.3	3,259
安藤・間	56.8	46,235
東急建設	27	20,169
コムシスホールディングス	31.5	100,957
ビーアールホールディングス	12.2	6,161
高松コンストラクション GP	5.4	11,016
東建コーポレーション	2.8	28,392
ソネック	1	970
ヤマウラ	4.1	3,677
オリエンタル白石	31.6	9,132
大成建設	63.5	229,870
大林組	203.5	189,051
清水建設	190.9	164,937
飛島建設	5.7	6,019
長谷工コーポレーション	66.8	100,934
松井建設	7.8	5,670
錢高組	0.9	3,825
鹿島建設	149.6	213,479

銘　　柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
不動テトラ	5.1	9,358
大末建設	2.5	2,565
鉄建建設	3.9	7,312
西松建設	15	50,550
三井住友建設	50.8	24,536
大豊建設	5	19,900
前田建設	50.8	49,987
佐田建設	5.1	2,509
ナカノフドー建設	4.9	1,950
奥村組	11.2	32,536
東鉄工業	8.4	19,639
イチケン	1.5	2,766
富士ピー・エス	2.4	1,360
淺沼組	2.5	11,275
戸田建設	84.1	64,252
熊谷組	9.7	27,402
北野建設	1.2	2,844
植木組	1.8	2,707
矢作建設	9.3	6,575
ピーエス三菱	6.4	4,096
日本ハウス HLDGS	13.8	4,857
大東建託	22.3	271,168
新日本建設	8.4	7,173
ＮＩＰＰＯ	16.9	53,488
東亜道路	1.3	5,934
前田道路	12.6	27,846
日本道路	2	16,020
東亜建設	5.7	14,090
日本国土開発	19.9	11,641
若築建設	3.5	4,959
東洋建設	23.2	13,386
五洋建設	87.4	69,745
世紀東急	9.9	8,622
福田組	2.4	11,760
住友林業	48.3	107,129
日本基礎技術	6.3	3,238
巴コーポレーション	8.4	3,192
大和ハウス	188.5	618,280
ライト工業	11.8	21,381
積水ハウス	221.2	490,511
日特建設	5.2	3,983
北陸電気工事	3.3	4,039
ユアテック	11.8	8,696
日本リーテック	4.4	7,480
四電工	1.1	3,619

銘　　柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
中電工	9.2	21,252
関電工	33.2	29,415
きんでん	40.9	75,787
東京エネシス	6.7	6,592
トーエネック	1.9	6,992
住友電設	5.7	13,303
日本電設工業	11	20,262
協和エクシオ	30.9	85,129
新日本空調	5.4	11,097
九電工	14.3	49,549
三機工業	15	21,180
日揮ホールディングス	68	71,400
中外炉工業	2.4	4,764
ヤマト	6.3	4,932
太平電業	4.5	12,028
高砂熱学	18.4	34,923
三晃金属	0.8	1,920
朝日工業社	1.4	4,158
明星工業	13.1	9,772
大氣社	9.8	33,663
ダイダン	4.5	11,862
日比谷総合設備	6.6	12,137
フィル・カンパニー	1.2	3,600
東洋エンジニア	9	6,435
レイズネクスト	10.5	12,043
食料品（3.4%）		
ニップン	19.5	30,829
日清製粉Ｇ本社	74.2	125,694
日東富士製粉	0.5	3,505
昭和産業	5.8	17,284
鳥越製粉	6.4	5,056
中部飼料	8.2	9,585
フィード・ワン	9.3	6,993
東洋精糖	1.5	1,807
日本甜菜糖	3.5	5,740
DM三井製糖ホールディ	5.1	9,557
塩水港精糖	10.3	2,327
日新製糖	3.1	5,369
森永製菓	15.4	52,822
中村屋	1.6	6,104
江崎グリコ	18.1	80,545
名糖産業	3.2	4,979
井村屋グループ	3.8	8,827
不二家	4.1	8,933
山崎製パン	49.2	78,080

銘　　柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
第一屋製パン	1.8	1,713
モロゾフ	1.1	5,973
亀田製菓	3.8	17,024
寿スピリッツ	6.3	48,447
カルビー	30	77,970
森永乳業	12.3	72,693
六甲バター	4.5	7,344
ヤクルト	45	298,800
明治ホールディングス	43.3	303,533
雪印メグミルク	15.7	34,618
プリマハム	9.5	28,737
日本ハム	25.1	111,569
林兼産業	2.8	1,730
丸大食品	6.4	10,880
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	6	20,910
柿安本店	2.2	5,636
伊藤ハム米久 HLDGS	42.6	29,947
サッポロホールディングス	22.6	52,658
アサヒグループホールディン	143.1	787,765
キリンＨＤ	277.6	640,145
宝ホールディングス	48.9	73,790
オエノンホールディングス	19.9	7,442
養命酒	2.3	4,250
コカ・コーラボトラーズJHD	50.2	91,464
サントリー食品インター	43.8	187,245
ダイドーグループ HD	3.8	19,114
伊藤園	19.9	134,524
キーコーヒー	6.9	14,531
ユニカフェ	2.5	2,495
ジャパンフーズ	1	1,211
日清オイリオグループ	8.5	26,265
不二製油グループ	16.2	45,262
かどや製油	0.7	2,807
Ｊ－オイルミルズ	6.2	11,873
キッコーマン	47.1	350,424
味の素	155.7	419,222
キユーピー	36.8	95,312
ハウス食品Ｇ本社	24.6	82,779
カゴメ	26.9	81,910
焼津水産化工	3.1	3,028
アリアケジャパン	6.1	42,273
ピエトロ	0.9	1,554
エバラ食品工業	1.7	4,403
やまみ	0.8	1,558
ニチレイ	31.3	92,272

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
東洋水産	33.9	150,007
イートアンドHLDGS	2.3	4,340
大冷	1.1	2,167
ヨシムラ・フード・HLDGS	4	3,136
日清食品ＨＤ	25.8	208,980
永谷園ホールディングス	3.5	7,679
一正蒲鉾	2.8	2,716
フジッコ	7.5	14,392
ロックフィールド	7.5	11,565
日本たばこ産業	350.6	772,021
ケンコーマヨネーズ	4	6,564
わらべや日洋HD	4.5	9,787
なとり	4.1	7,814
イフジ産業	1.5	1,389
ピックルスコーポレーション	1.7	5,482
北の達人コーポ	23.1	11,480
ユーグレナ	34.1	30,758
ミヨシ油脂	2.3	2,881
理研ビタミン	6.4	9,785
繊維製品（0.5%）		
片倉工業	8.6	13,192
グンゼ	4.6	21,505
東洋紡	25.1	34,236
ユニチカ	18.5	7,122
富士紡ホールディングス	3.2	13,136
倉敷紡績	5.6	10,948
シキボウ	3.7	3,478
日本毛織	19.8	19,859
ダイトウボウ	12.1	1,270
トーア紡コーポレーション	2.3	1,048
ダイドーリミテッド	7.6	1,345
帝国繊維	7.2	15,278
帝人	60	105,720
東レ	461.6	352,062
サカイオーベックス	1.7	5,066
住江織物	1.4	2,605
日本フエルト	3	1,365
イチカワ	0.8	1,087
日東製網	0.9	1,373
アツギ	4.9	3,042
ダイニック	2.5	1,910
セーレン	15.7	33,786
ソトー	1.8	1,436
東海染工	0.8	889
小松マテーレ	10.5	10,048
ワコールホールディングス	15.9	39,495
ホギメディカル	8.5	29,707
クラウディアHLDGS	2.1	627
ＴＳＩホールディングス	19.4	6,557
マツオカコーポレーション	2	3,434
ワールド	8.2	12,332
三陽商会	3.4	3,236
ナイガイ	3.2	1,232
オンワードホールディングス	39.2	14,112
ルックホールディングス	2.2	3,223
ゴールドウイン	10.7	71,048
デサント	10.9	27,250
キング	3.4	1,778
ヤマトインターナショナル	5.8	1,989
パルプ・紙（0.2%）		
特種東海製紙	3.9	17,062
王子ホールディングス	288	186,336
日本製紙	28.5	35,967
三菱製紙	7.8	2,847
北越コーポレーション	45.9	26,667
中越パルプ	2.3	2,810
巴川製紙	2.1	1,692
大王製紙	30.9	54,600
阿波製紙	1.6	675
レンゴー	65.9	62,011
トーモク	3.8	7,508
ザ・パック	4.8	13,372
化学（7.4%）		
クラレ	100.7	112,179
旭化成	422.5	528,336
共和レザー	3.3	2,366
昭和電工	48.5	174,115
住友化学	502.7	305,138
住友精化	3.1	11,113
日産化学	35.2	197,472
ラサ工業	2.2	4,208
クレハ	5.5	34,155
多木化学	2.5	13,275
テイカ	4.5	6,070
石原産業	11.6	12,388

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
片倉コープアグリ	1.6	1,940
日本曹達	8.9	30,660
東ソー	98.5	192,764
トクヤマ	19	43,833
セントラル硝子	11.8	24,874
東亞合成	38.5	45,545
大阪ソーダ	6.3	15,441
関東電化	14.8	14,977
デンカ	23.4	88,686
信越化学	118	2,262,650
日本カーバイド	2.2	2,855
堺化学	4.4	8,232
第一稀元素化学工	6.8	12,138
エア・ウォーター	65.4	116,412
日本酸素HLDGS	52.6	112,248
日本化学工業	1.9	5,567
東邦アセチレン	1.2	1,414
日本パーカライジング	31.5	34,461
高圧ガス	9.8	6,389
チタン工業	0.9	1,696
四国化成	8	10,224
戸田工業	1.4	3,178
ステラ ケミファ	3.5	10,867
保土谷化学	1.9	7,429
日本触媒	11.5	63,940
大日精化	5	11,770
カネカ	16.4	70,684
三菱瓦斯化学	64.1	159,673
三井化学	55.1	207,727
ＪＳＲ	64.4	211,232
東京応化工業	11	78,980
大阪有機化学	6	26,790
三菱ケミカルHLDGS	426.2	378,934
ＫＨネオケム	10.7	28,408
ダイセル	85.6	76,612
住友ベークライト	10.1	50,197
積水化学	134.6	252,778
日本ゼオン	57.8	89,416
アイカ工業	17.7	70,534
宇部興産	32.2	74,800
積水樹脂	10.2	21,715
タキロンシーアイ	13.8	8,004
旭有機材	3.6	4,856
ニチバン	3.2	5,616
リケンテクノス	15.1	8,969
大倉工業	3	7,191
積水化成品	7.9	4,826
群栄化学	1.4	3,416
タイガース ポリマー	2.2	976
ミライアル	1.9	2,648
ダイキアクシス	2.6	2,262
ダイキョーニシカワ	13.1	9,012
竹本容器	2.7	2,643
森六ホールディングス	3.3	7,368
日本化薬	39.2	40,964
カーリットホールディングス	6.3	4,649
日本精化	4.7	6,932
扶桑化学工業	5.1	20,808
トリケミカル	6.1	21,502
ＡＤＥＫＡ	29.4	59,035
日油	24.2	139,876
新日本理化	12.3	3,382
ハリマ化成グループ	4.7	4,248
花王	156	1,074,060
第一工業製薬	2.2	7,370
石原ケミカル	1.7	3,656
日華化学	2.3	2,854
ニイタカ	1.4	3,449
三洋化成	3.9	21,411
有機合成薬品	5.1	1,739
大日本塗料	7	5,887
日本ペイントHOLD	263.6	451,546
関西ペイント	71.8	211,163
神東塗料	5.8	1,142
中国塗料	15.6	14,383
日本特殊塗料	4.8	5,337
藤倉化成	8.2	4,305
太陽ホールディングス	4.8	25,584
ＤＩＣ	26.7	77,643
サカタインクス	13.6	14,552
東洋インキSCホールディン	13.1	27,287
Ｔ＆Ｋ ＴＯＫＡ	4.6	3,712
富士フイルムHLDGS	114.6	903,048
資生堂	129.6	1,057,536
ライオン	84.9	168,186

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
高砂香料	4.1	10,975
マンダム	13.6	29,376
ミルボン	8.8	58,080
ファンケル	24	87,600
コーセー	12.3	224,352
コタ	4.5	6,358
シーボン	0.7	1,368
ポーラ・オルビスHD	28	85,260
ノエビアホールディングス	5.4	28,890
アジュバンコスメジャパン	1.9	1,958
エステー	4.2	7,484
アグロカネショウ	2.5	3,485
コニシ	10.6	16,302
長谷川香料	11.1	25,530
星光ＰＭＣ	3.5	3,048
小林製薬	18.4	175,720
荒川化学工業	5	6,110
メック	4.6	13,248
日本高純度化学	1.9	5,276
タカラバイオ	17.1	50,940
ＪＣＵ	7.4	26,455
新田ゼラチン	4	2,568
ＯＡＴアグリオ	1.2	1,743
デクセリアルズ	18.7	41,140
アース製薬	5	33,550
北興化学	6.3	6,363
大成ラミック	2.4	6,576
クミアイ化学	26.9	25,447
日本農薬	11.5	6,049
アキレス	4.5	6,232
有沢製作所	9	8,208
日東電工	41.4	350,658
レック	7.8	9,188
三光合成	7.2	3,204
きもと	11.1	2,897
藤森工業	5.8	23,432
前澤化成工業	4.3	5,409
未来工業	2.3	3,988
ウェーブロックHLDGS	2.3	1,621
ジェイ エス ピー	4.2	6,862
エフピコ	12.2	51,484
天馬	4.9	11,970
信越ポリマー	9.6	10,252
東リ	14.7	3,601
ニフコ	24.1	96,159
バルカー	5.3	11,103
ユニ・チャーム	138.2	618,445
ショーエイコーポ	1.8	1,749
医薬品（5.3%）		
協和キリン	65.5	247,262
武田薬品	542.2	2,060,360
アステラス製薬	565	1,098,642
大日本住友製薬	48.3	110,220
塩野義製薬	82	478,634
わかもと製薬	8.2	2,640
日本新薬	18.5	160,025
ビオフエルミン製薬	1.3	4,036
中外製薬	203.8	928,309
科研製薬	11.2	53,256
エーザイ	71.8	818,879
ロート製薬	31	89,714
小野薬品	149.6	377,440
久光製薬	18.9	110,754
持田製薬	8.9	33,286
参天製薬	113.6	174,148
扶桑薬品	2.1	4,876
日本ケミファ	0.7	1,678
ツムラ	21.9	78,730
日医工	18.7	17,652
キッセイ薬品工業	11.4	25,410
生化学工業	11.4	12,745
栄研化学	11.6	25,125
日水製薬	2.3	2,244
鳥居薬品	4.1	10,422
ＪＣＲファーマ	18.5	65,860
東和薬品	9.3	24,207
富士製薬工業	4.5	5,319
ゼリア新薬工業	11.9	25,061
第一三共	512.2	1,341,964
キョーリン製薬ＨＤ	14.6	25,447
大幸薬品	8.3	8,773
ダイト	4.2	14,049
大塚ホールディングス	135.1	647,129
大正製薬ＨＤ	15.4	96,558
ペプチドリーム	33.7	177,262

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
あすか製薬ＨＤ	7.8	7,971
サワイグループHD	14.3	71,500
石油・石炭製品（0.4%）		
日本コークス工業	57.8	6,069
ニチレキ	7.7	10,140
ユシロ化学	3.4	4,059
ビーピー・カストロール	2.3	3,213
富士石油	16.9	4,732
ＭＯＲＥＳＣＯ	2.1	2,368
出光興産	72.1	196,760
ENEOSホールディングス	976.5	459,736
コスモエネルギーHLDGS	20.7	50,818
ゴム製品（0.7%）		
横浜ゴム	37.5	88,162
TOYO TIRE	34.4	80,152
ブリヂストン	173.1	864,980
住友ゴム	58.4	89,176
藤倉コンポジット	5.5	2,678
オカモト	3.9	16,633
フコク	2.8	2,699
ニッタ	6.8	18,645
住友理工	12.3	8,892
三ツ星ベルト	7.7	13,659
バンドー化学	11	9,713
ガラス・土石製品（0.8%）		
日東紡績	9.7	35,065
ＡＧＣ	59.9	289,017
日本板硝子	34.3	22,466
石塚硝子	1	1,936
日本山村硝子	2.4	2,251
日本電気硝子	24.1	64,202
オハラ	2.7	4,101
住友大阪セメント	11.6	35,264
太平洋セメント	38.5	94,517
日本ヒューム	5.6	4,043
日本コンクリート	14.6	4,934
三谷セキサン	3	12,315
アジアパイルＨＤ	9.6	4,704
東海カーボン	64	104,832
日本カーボン	3.7	16,261
東洋炭素	3.9	10,381
ノリタケ	3.6	15,498
ＴＯＴＯ	46.6	286,124
日本碍子	71.2	140,833
日本特殊陶業	49.7	84,191
ダントーホールディングス	5.7	1,573
ＭＡＲＵＷＡ	2.3	25,185
品川リフラクトリーズ	1.5	5,752
黒崎播磨	1.1	4,911
ヨータイ	4.7	5,376
イソライト	2.9	1,850
東京窯業	7.7	2,502
ニッカトー	2.9	2,041
フジミインコーポレーテッド	5.3	27,348
クニミネ工業	2.2	2,508
エーアンドエーマテリアル	0.9	921
ニチアス	16.5	46,447
ニチハ	9.1	26,708
鉄鋼（0.8%）		
日本製鉄	307.6	591,053
神戸製鋼所	118.6	87,408
中山製鋼所	8.4	3,578
合同製鐵	3.4	5,735
ＪＦＥホールディングス	186.4	250,148
東京製鐵	25.5	29,223
共英製鋼	7.2	10,656
大和工業	13.8	52,302
東京鐵鋼	2.7	4,287
大阪製鐵	3.3	3,771
淀川製鋼所	8.4	19,152
丸一鋼管	20.9	57,830
モリ工業	1.9	4,736
大同特殊鋼	10.6	59,678
日本高周波	2.3	970
日本冶金工	4.9	11,470
山陽特殊製鋼	7.7	12,343
愛知製鋼	3.5	11,077
日立金属	61.2	129,927
日本金属	1.7	1,676
大平洋金属	4.5	8,266
新日本電工	43.2	13,176
栗本鉄工所	2.9	4,857
虹技	0.8	936
日本鋳鉄管	0.7	920
三菱製鋼	5	4,485

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
日亜鋼業	8.8	2,613
日本精線	1	4,625
エンビプロＨＤ	3.1	3,955
シンニッタン	8.5	2,176
新家工業	1.6	2,620
非鉄金属（0.7%）		
大紀アルミニウム	9.8	11,583
日本軽金属ＨＤ	17.4	32,381
三井金属	17.4	54,636
東邦亜鉛	3.6	7,128
三菱マテリアル	42.3	94,878
住友鉱山	82.3	386,974
DOWAホールディングス	16.3	72,046
古河機金	10.3	13,235
エス・サイエンス	35.4	1,416
大阪チタニウム	6.7	5,594
東邦チタニウム	11.9	12,935
ＵＡＣＪ	9.7	26,956
ＣＫサンエツ	1.3	4,264
古河電工	20.1	57,365
住友電工	223.9	379,398
フジクラ	78.5	37,680
昭和電線HLDGS	6.3	10,684
東京特殊電線	0.7	1,764
タツタ電線	11.6	6,554
カナレ電気	0.9	1,629
平河ヒューテック	3.6	4,280
リョービ	7.7	12,474
アーレスティ	8.1	4,244
アサヒＨＤ	24.6	56,334
金属製品（0.6%）		
稲葉製作所	4.7	7,064
宮地エンジニアリングＧ	2.3	5,303
トーカロ	16.6	23,937
アルファＣＯ	2.2	2,488
ＳＵＭＣＯ	82.2	218,980
川田テクノロジーズ	1.3	4,686
RS TECHNOLOGIES	2.1	12,705
信和	3.5	2,520
東洋製罐グループHD	40.7	67,358
ホッカンホールディングス	3.1	4,374
コロナ	3.7	3,441
横河ブリッジHLDGS	11.2	23,284
駒井ハルテック	1.4	2,513
高田機工	0.6	1,628
三和ホールディングス	60.7	83,887
文化シヤッター	19	20,311
三協立山	8.2	6,601
アルインコ	4.1	4,001
東洋シヤッター	1.5	1,020
ＬＩＸＩＬ	88.8	259,740
日本フイルコン	4.2	2,091
ノーリツ	13.2	25,291
長府製作所	6.5	13,286
リンナイ	12.6	137,718
ダイニチ工業	3.8	3,021
日東精工	8.6	4,747
三洋工業	0.7	1,308
岡部	12.2	8,100
ジーテクト	7.9	12,458
東プレ	11.9	19,206
高周波熱錬	11.8	6,891
東京製綱	2.9	3,410
サンコール	5.4	2,451
モリテックスチル	5.4	2,813
パイオラックス	9.3	14,080
エイチワン	6.2	4,991
日本発条	63.4	58,645
中央発條	3.5	4,294
アドバネクス	0.9	1,191
立川ブラインド	2.9	3,819
三益半導体	4.9	14,009
機械（5.4%）		
日本ドライケミカル	1.6	2,835
日本製鋼所	19.7	58,725
三浦工業	27.9	138,523
タクマ	22.3	39,471
ツガミ	13.6	22,820
オークマ	7.5	41,775
芝浦機械	6.7	17,011
アマダ	94.4	107,710
アイダエンジニア	16.2	14,094
滝澤鉄工所	1.8	2,034
ＦＵＪＩ	25.8	66,564
牧野フライス	7.5	34,050

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
オーエスジー	31.4	59,503
ダイジェット	0.7	910
旭ダイヤモンド	16.3	8,541
DMG森精機	41.2	80,628
ソディツク	16	17,872
ディスコ	8.7	305,370
日東工器	3.2	5,846
日進工具	5.1	7,736
パンチ工業	5.4	3,472
冨士ダイス	2.8	1,808
豊和工業	3.8	3,104
ＯＫＫ	2.6	1,060
石川製作所	1.8	3,058
東洋機械金属	3.9	2,067
津田駒工業	1.2	1,078
エンシュウ	1.4	1,253
島精機製作所	9.3	18,711
オプトラン	8.1	20,622
NCホールディングス	2.1	2,198
イワキポンプ	4	4,060
フリュー	6.5	8,183
ヤマシンフィルタ	13.3	9,868
日阪製作所	8	6,528
やまびこ	12.5	15,437
平田機工	3	20,310
ペガサスミシン製造	6.3	3,080
マルマエ	2.7	6,385
タツモ	2.8	4,905
ナブテスコ	37.9	174,719
三井海洋開発	6.8	15,109
レオン自動機	6.3	8,971
ＳＭＣ	19.1	1,235,579
ホソカワミクロン	2.3	13,800
ユニオンツール	2.4	9,552
オイレス工業	8.9	13,892
日精エーエスビー	2.1	11,088
サトーホールディングス	8.5	22,329
技研製作所	5.7	26,277
日本エアーテック	2.3	3,132
カワタ	1.8	1,600
日精樹脂工業	5	6,650
オカダアイヨン	2.1	2,700
ワイエイシィホールディングス	2.8	3,133
小松製作所	295	897,390
住友重機械	37.2	119,412
日立建機	30.5	104,462
日工	10	6,980
巴工業	2.5	5,722
井関農機	6.2	9,014
ＴＯＷＡ	6.1	13,786
丸山製作所	1.3	2,354
北川鉄工所	2.7	4,557
ローツェ	2.9	30,131
タカキタ	2.2	1,421
クボタ	342.4	781,185
荏原実業	1.7	10,625
三菱化工機	2.2	5,922
月島機械	11.6	13,792
帝国電機製作所	4.5	5,724
東京機械	3.4	2,502
新東工業	14.6	11,329
渋谷工業	5.6	18,676
アイチ コーポレーション	11	9,394
小森コーポレーション	16.1	13,588
鶴見製作所	4.9	8,702
住友精密	0.9	2,250
日本ギア工業	2.4	770
酒井重工業	1.1	2,812
荏原製作所	27.1	144,985
石井鉄工所	0.9	2,763
酉島製作所	6.6	5,834
北越工業	6.7	7,537
ダイキン工業	83	1,697,765
オルガノ	2.2	13,442
トーヨーカネツ	2.5	6,245
栗田工業	35.3	186,737
椿本チエイン	9.1	28,801
大同工業	3	3,222
木村化工機	5.8	5,121
アネスト岩田	10.7	11,202
ダイフク	35.9	347,512
サムコ	1.7	5,610
加藤製作所	3.4	3,400
油研工業	0.9	1,560
タダノ	31.6	35,771

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
フジテック	22.8	58,162
ＣＫＤ	15.2	37,650
キトー	5.4	9,153
平和	18	34,794
理想科学工業	5	8,535
ＳＡＮＫＹＯ	15.7	43,991
日本金銭機械	6.6	3,814
マースグループHLDGS	3.8	6,121
フクシマガリレイ	4.5	19,980
オーイズミ	2.3	878
ダイコク電機	2.6	2,358
竹内製作所	11.2	31,315
アマノ	17.1	50,051
ＪＵＫＩ	9.2	7,544
サンデンホールディングス	9.1	3,330
蛇の目ミシン	6.2	4,712
マックス	8.7	14,572
グローリー	16.8	38,892
新晃工業	6.2	11,904
大和冷機工業	10.7	11,438
セガサミーホールディングス	59.5	89,785
日本ピストンリング	2.4	3,184
リケン	2.9	7,516
ＴＰＲ	8.5	12,792
ツバキ・ナカシマ	12.8	23,155
ホシザキ	20.5	203,975
大豊工業	5.6	5,734
日本精工	133.1	136,826
ＮＴＮ	151.2	46,720
ジェイテクト	62.1	75,327
不二越	5.9	25,311
日本トムソン	18.6	11,401
ＴＨＫ	40.6	133,168
ユーシン精機	4.3	3,526
前澤給装工業	4.7	4,949
イーグル工業	8.1	9,039
前澤工業	4.5	2,767
日本ピラー工業	6.8	15,612
キッツ	19.8	15,741
マキタ	85	431,800
日立造船	53	37,895
三菱重工業	102.2	345,742
ＩＨＩ	43.7	120,218
スター精密	10.3	18,766
電気機器（17.9%）		
日清紡ホールディングス	38.6	35,512
イビデン	31.4	180,236
コニカミノルタ	132.8	85,257
ブラザー工業	79.8	190,881
ミネベアミツミ	112	326,592
日立	313.2	1,910,520
東芝	129.1	606,770
三菱電機	650.5	1,131,219
富士電機	39.4	203,304
東洋電機製造	2.4	2,853
安川電機	70.1	368,025
シンフォニアテクノロジー	8.6	11,274
明電舎	11.1	25,452
オリジン	1.6	2,112
山洋電気	3.2	25,504
デンヨー	5.5	11,187
東芝テック	7.1	32,447
芝浦メカトロニクス	1.2	9,408
マブチモーター	18	78,210
日本電産	156.9	1,966,741
ユーエムシーエレクトロニクストレックス・セミコンダクター	3.9	2,917
	3.6	8,107
東光高岳	3.4	4,828
ダブル・スコープ	15.6	9,812
宮越ホールディングス	2.7	2,797
ダイヘン	7.3	35,587
ヤーマン	10.9	15,445
ＪＶＣケンウッド	57	13,452
ミマキエンジニアリング	6	4,434
Ｉ－ＰＥＸ	3	7,557
日新電機	15.3	20,716
大崎電気	13.2	8,223
オムロン	54.1	462,555
日東工業	9.6	17,299
ＩＤＥＣ	8.8	19,113
正興電機製作所	2.2	3,546
不二電機工業	1	1,280
ジーエス・ユアサ コーポ	23.5	69,748
サクサホールディングス	1.5	2,085
メルコホールディングス	2.3	11,316

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
テクノメディカ	1.4	2,282
ダイヤモンドエレクトリクHD	1.9	5,152
日本電気	82.9	460,095
富士通	58.6	1,139,477
沖電気	26.3	27,036
岩崎通信機	2.9	2,743
電気興業	3.1	6,993
サンケン電気	7.5	38,850
ナカヨ	1.1	1,648
アイホン	3.8	7,812
ルネサスエレクトロニクス	280.4	332,274
セイコーエプソン	80.8	167,821
ワコム	48	33,600
アルバック	12	66,480
アクセル	2.7	2,405
ＥＩＺＯ	5.5	27,142
ジャパンディスプレイ	61.7	2,468
日本信号	14.9	13,976
京三製作所	13.4	5,815
能美防災	8.5	17,272
ホーチキ	4.5	5,328
星和電機	3.4	1,829
エレコム	15.1	30,834
パナソニック	695	880,217
シャープ	86.8	167,003
アンリツ	39.6	83,556
富士通ゼネラル	20.1	57,023
ソニーグループ	408.4	4,498,526
ＴＤＫ	31.4	441,484
帝国通信工業	2.7	3,164
タムラ製作所	23.2	13,943
アルプスアルパイン	53.2	64,531
池上通信機	2.3	1,911
日本電波工業	6.5	7,085
鈴木	3	3,075
日本トリム	1.6	5,952
ローランドディー．ジー．	3.8	9,781
フオスター電機	6.6	6,586
ＳＭＫ	1.6	4,129
ヨコオ	5.1	11,959
ティアック	5.2	670
ホシデン	18	18,270
ヒロセ電機	10	163,500
日本航空電子	14.9	28,786
ＴＯＡ	7.4	6,593
マクセルホールディングス	12.9	16,279
古野電気	8.3	8,764
ユニデンホールディングス	1.8	4,793
スミダコーポレーション	5.5	6,539
アイコム	2.8	6,694
リオン	2.9	7,957
本多通信工業	4.4	2,178
横河電機	65.2	112,926
新電元工業	2.5	11,937
アズビル	44.3	199,350
東亜ディーケーケー	2.8	2,315
日本光電工業	27	87,345
チノー	1.8	2,678
共和電業	6.1	2,330
日本電子材料	2.8	5,661
堀場製作所	12.9	97,137
アドバンテスト	48.5	499,550
小野測器	2.5	1,390
エスペック	5.6	12,084
キーエンス	64	3,636,480
日置電機	3.2	18,816
シスメックス	50.9	598,329
日本マイクロニクス	11.4	18,616
メガチップス	6.5	21,125
OBARA GROUP	3.7	14,245
澤藤電機	0.8	1,698
原田工業	2.7	2,492
コーセル	7.9	9,021
イリソ電子工業	5.5	28,435
オプテックスグループ	10.8	20,692
千代田インテグレ	2.7	4,865
アイ・オー・データ	2.4	2,548
レーザーテック	28.7	612,171
スタンレー電気	45.2	151,194
岩崎電気	2.4	4,509
ウシオ電機	33.3	58,541
岡谷電機	4.6	1,651
ヘリオステクノＨ	6.2	2,170
エノモト	1.9	3,321
日本セラミック	6.6	19,516

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
遠藤照明	3.3	2,583
古河電池	4.8	7,569
双信電機	3.3	1,914
山一電機	4.3	7,451
図研	4.4	13,420
日本電子	12	74,640
カシオ	52.6	100,255
ファナック	57.2	1,553,838
日本シイエムケイ	13.9	6,213
エンプラス	3	12,150
大真空	2.3	9,936
ローム	27	274,860
浜松ホトニクス	46.7	318,027
三井ハイテック	6.4	34,688
新光電気工業	22	84,150
京セラ	99	707,256
太陽誘電	29	160,660
村田製作所	191.3	1,638,101
双葉電子工業	10.7	8,538
北陸電気工業	2.2	2,252
ニチコン	20.9	24,620
日本ケミコン	6.7	16,897
ＫＯＡ	9.1	15,197
市光工業	9.8	7,418
小糸製作所	39	274,170
ミツバ	12	10,500
SCREENホールディングス	11.3	123,283
キヤノン電子	5.9	10,277
キヤノン	323.7	849,065
リコー	166	224,100
象印マホービン	17.6	30,060
MUTOHホールディングス	0.9	1,426
東京エレクトロン	38.2	1,890,900
輸送用機器（8.0%）		
トヨタ紡織	18.7	42,262
芦森工業	1.2	1,300
ユニプレス	10.6	10,504
豊田自動織機	52.7	516,460
モリタホールディングス	10.2	16,513
三桜工業	9.2	11,444
デンソー	143.4	1,119,237
東海理化電機	16.8	29,652
三井E&SHD	21.7	11,284
川崎重工業	50.8	126,034
名村造船所	21.9	4,226
サノヤスホールディングス	9.8	1,450
日本車輌	2.2	4,873
三菱ロジスネクスト	8.8	9,477
近畿車輌	1	1,280
日産自動車	767.6	432,158
いすゞ自動車	187.5	292,687
トヨタ自動車	660.2	6,651,515
日野自動車	81.1	80,937
三菱自動車工業	240.2	74,702
エフテック	4.7	4,366
レシップホールディングス	2.9	1,835
GMB	1.5	1,564
ファルテック	1.4	1,072
武蔵精密工業	14.7	36,279
日産車体	9.3	6,900
新明和工業	18.2	18,054
極東開発工業	11.2	18,972
トピー工業	5.3	7,223
ティラド	2.1	5,875
タチエス	10	14,200
ＮＯＫ	31.3	42,192
フタバ産業	15.8	8,342
ＫＹＢ	7.4	29,008
大同メタル工業	13	8,242
プレス工業	31.2	10,826
ミクニ	7.9	2,409
太平洋工業	13.6	15,544
河西工業	9.4	3,844
アイシン	47.5	232,275
マツダ	204.1	204,712
今仙電機製作所	5.6	4,082
本田技研	512.6	1,858,687
スズキ	129.1	615,807
SUBARU	186.3	427,092
安永	3.2	4,028
ヤマハ発動機	92.2	299,650
ＴＢＫ	7.4	3,093
エクセディ	8.8	14,960
豊田合成	21.1	57,750
愛三工業	10.2	9,016

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
盟和産業	1.1	1,081
日本プラスト	5.1	3,692
ヨロズ	5.5	7,040
エフ・シー・シー	10.5	17,839
シマノ	24.5	602,577
テイ・エス テック	29.8	48,544
ジャムコ	4	4,664
精密機器（2.7%）		
テルモ	199.7	916,423
クリエートメディック	1.8	1,818
日機装	21.2	24,740
日本エム・ディ・エム	3.9	8,552
島津製作所	83.8	346,932
ＪＭＳ	5.9	5,038
クボテック	1.8	604
長野計器	5	5,810
ブイ・テクノロジー	3.1	18,197
東京計器	4.1	4,530
愛知時計	0.7	2,936
インターアクション	3.4	8,775
オーバル	6.6	1,881
東京精密	11	57,530
マニー	25.9	67,055
ニコン	99.3	119,160
トプコン	32.9	58,496
オリンパス	360.6	855,884
理研計器	5.8	16,298
タムロン	5.6	13,804
ＨＯＹＡ	128.3	1,819,294
シード	2.3	1,863
ノーリツ鋼機	6.1	13,816
エー・アンド・デイ	5.7	6,110
朝日インテック	68.7	186,657
シチズン時計	83.1	36,231
リズム	1.9	1,516
大研医器	4.8	2,692
メニコン	10.2	72,930
シンシア	1.3	833
松風	3.1	6,209
セイコーＨＤ	9.4	21,187
ニプロ	48.2	65,648
その他製品（2.4%）		
中本パックス	1.6	2,532
スノーピーク	4	12,760
パラマウントベッドHD	12.2	24,290
トランザクション	3.8	5,278
粧美堂	1.9	803
ニホンフラッシュ	5.7	7,130
前田工繊	7.3	24,272
永大産業	8.6	2,683
アートネイチャー	6.3	4,126
パンダイナムコHLDGS	53.9	438,746
アイフィスジャパン	1.8	1,278
共立印刷	8.2	1,164
ＳＨＯＥＩ	6.5	25,675
フランスベッドHLDGS	9.1	8,281
パイロットコーポレーション	10.9	38,749
萩原工業	3.6	5,173
トッパン・フォームズ	11.5	12,569
フジシールインターナショナル	13.5	32,076
タカラトミー	30	29,520
廣済堂	4.8	4,012
エステールホールディングス	4	2,592
タカノ	1.9	1,219
プロネクサス	5.3	5,501
ホクシン	6.7	1,132
ウッドワン	2.4	3,103
大建工業	4.4	9,090
凸版印刷	98.5	188,036
大日本印刷	78.1	190,720
共同印刷	2	5,372
ＮＩＳＳＨＡ	13.3	22,463
光村印刷	0.6	1,014
TAKARA & COMPANY	3.3	5,695
アシックス	57.7	147,596
ツツミ	2	4,746
小松ウオール工業	2.2	4,426
ヤマハ	38.8	253,752
河合楽器	2	7,470
クリナップ	6	3,132
ピジョン	42.1	138,930
オリバー	1.5	4,057
兼松サステック	0.5	901
キングジム	5.3	5,003
リンテック	13.8	33,699

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
イトーキ	12.8	4,915
任天堂	37.3	2,427,111
三菱鉛筆	10.4	14,809
タカラスタンダード	13.1	20,580
コクヨ	31.9	58,791
ナカバヤシ	5.8	3,468
グローブライド	3.3	13,431
オカムラ	23.3	34,693
美津濃	6.7	15,329
電気・ガス業（1.2%）		
東京電力ＨＤ	554.7	193,590
中部電力	199.3	273,638
関西電力	246.7	269,396
中国電力	95.6	98,850
北陸電力	60.1	37,983
東北電力	152	135,888
四国電力	53.7	40,919
九州電力	144.5	126,293
北海道電力	63.1	33,190
沖縄電力	13	18,590
電源開発	51.9	84,389
エフオン	4.4	4,246
イーレックス	9.9	19,027
レノバ	11.3	42,149
東京瓦斯	125.4	274,939
大阪瓦斯	117.8	254,094
東邦瓦斯	32.2	189,336
北海道瓦斯	3.5	5,512
広島ガス	11.6	4,326
西部ガスHLDGS	7.4	18,618
静岡ガス	18.7	19,242
メタウォーター	7.3	15,308
陸運業（3.5%）		
SBSホールディングス	5.1	16,855
東武鉄道	67.6	209,560
相鉄ホールディングス	21.9	49,406
東急	162.9	262,269
京浜急行	83.7	125,047
小田急電鉄	104.4	316,332
京王電鉄	36.4	262,808
京成電鉄	48.9	178,240
富士急行	9	48,870
新京成電鉄	1.8	3,884
東日本旅客鉄道	114.6	958,056
西日本旅客鉄道	58	400,374
東海旅客鉄道	54.2	975,600
西武ホールディングス	78.4	108,897
鴻池運輸	9.9	11,632
西日本鉄道	18	50,940
ハマキョウレックス	5	15,575
サカイ引越センター	3	16,980
近鉄グループHLDGS	61.5	255,532
阪急阪神HLDGS	81.9	303,439
南海電鉄	29.2	71,948
京阪ホールディングス	27.5	97,350
神戸電鉄	1.5	5,257
名古屋鉄道	51	113,322
山陽電鉄	4.4	8,536
日本通運	21.3	185,310
ヤマトホールディングス	86.4	261,792
山九	15.7	75,517
丸運	4.3	1,204
丸全昭和運輸	5.1	16,983
センコーグループHLDGS	34.3	35,431
トナミホールディングス	1.5	7,500
ニッコンホールディングス	20.7	48,831
日石輸送	0.6	1,550
福山通運	7.8	30,615
セイノーホールディングス	46	67,114
エスライン	1.3	1,168
神奈川中央交通	1.4	5,096
日立物流	13.6	52,768
丸和運輸機関	13.3	20,894
C&Fロジホールディングス	6.2	10,044
九州旅客鉄道	47.7	126,166
SGホールディングス	116.9	325,098
海運業（0.3%）		
日本郵船	51.8	280,756
商船三井	36.8	184,368
川崎汽船	19.2	67,968
NSユナイテッド海運	3.2	7,516
明治海運	6.8	3,250
飯野海運	29.3	13,360
共栄タンカー	1.2	1,075
乾汽船	4.1	4,907

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
空運業（0.5%）		
日本航空	150.9	394,150
ANAホールディングス	167	469,938
パスコ	1.2	1,894
倉庫・運輸関連業（0.2%）		
トランコム	1.9	15,732
日新	4.9	7,433
三菱倉庫	21.4	73,723
三井倉庫HOLD	6.7	15,912
住友倉庫	22.1	33,371
渋沢倉庫	3.3	7,071
東陽倉庫	9.6	3,100
日本トランスシティ	13.5	7,195
ケイヒン	1.1	1,512
中央倉庫	3.5	3,713
川西倉庫	1.1	1,267
安田倉庫	5	4,750
ファイズホールディングス	1.4	1,227
東洋埠頭	1.8	2,759
宇徳	4.5	2,295
上組	34.1	73,280
サンリツ	1.9	1,426
キムラユニティー	1.4	1,857
キユーソー流通システム	1.5	2,562
近鉄エクスプレス	11.8	28,036
東海運	4	1,244
エーアイテイー	3.9	3,884
内外トランスライン	2.4	4,632
日本コンセプト	2.1	3,448
情報・通信業（8.8%）		
NECネッツエスアイ	21.2	37,524
クロスキャット	1.8	1,794
システナ	23	45,218
デジタルアーツ	3.7	33,152
日鉄ソリューションズ	9.5	33,440
キューブシステム	3.7	3,855
エイジア	1.2	2,536
コア	2.6	3,710
ラクーンホールディングス	4.7	11,162
ソリトンシステムズ	3.3	5,616
ソフトクリエイトHD	2.6	5,954
ＴＩＳ	64	181,120
JNSホールディングス	3.1	1,866
電算システム	2.5	7,402
グリー	42.6	27,178
コーエーテクモＨＤ	17.2	91,676
三菱総合研究所	2.7	10,449
ボルテージ	3.1	1,528
電算	0.5	1,196
ＡＧＳ	3.1	2,638
ファインデックス	5.6	5,740
ブレインパッド	1.7	8,253
ＫＬａｂ	12	8,832
ポールトゥウィン・ピットクルー	8.8	10,093
イーブックイニシアティブ	1.3	4,264
ネクソン	162.1	418,704
アイスタイル	20.3	10,616
エムアップホールディングス	1.9	6,469
エイチーム	4.9	7,433
エニグモ	6.3	8,391
テクノスジャパン	5.3	3,291
ｅｎｉｓｈ	3.5	1,834
コロプラ	20.9	17,974
オルトプラス	4.9	2,116
ブロードリーフ	31.6	16,526
クロス・マーケティングG	3.1	2,222
デジタルハーツHLDGS	3.1	4,898
システム情報	5	4,920
メディアドゥ	2.7	12,946
じげん	16.2	7,095
ブイキューブ	3.6	9,608
エンカレッジ・テクノロジ	1.1	763
サイバーリンクス	2.3	3,843
ディー・エル・イー	4.3	1,367
フィックスターズ	6.8	6,065
CARTA HOLDINGS	2.8	4,830
オプティム	4.6	10,920
セレス	2.2	8,107
ＳＨＩＦＴ	3.3	54,747
ティーガイア	6.7	13,118
セック	0.9	2,385
日本アジアグループ	7.3	7,029
テクマトリックス	10.2	18,105
プロシップ	1.8	2,433
ガンホー・オンライン・エンター	15.4	36,544

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
GMOペイメントゲートウェイ	13.6	189,448
ザッパラス	4	2,352
システムリサーチ	1.9	3,917
インターネットイニシアティブ	17.3	56,398
さくらインターネット	7.5	4,807
ヴィンクス	1.9	1,932
GMOグローバルサインHD	1.6	8,240
SRAホールディングス	3.4	9,319
システムインテグレータ	1.8	1,166
朝日ネット	6	4,356
ｅＢＡＳＥ	7.9	6,920
アバント	7.2	11,772
アドソル日進	2.4	5,796
フリービット	4.4	3,625
コムチュア	6	14,274
サイバーコム	1.1	1,699
アステリア	4.8	4,065
アイル	3.7	5,572
マークラインズ	2.9	8,946
メディカル・データ・ビジ	7.5	16,327
ｇｕｍｉ	9.2	8,206
ショーケース	1.8	1,454
モバイルファクトリー	1.6	2,038
テラスカイ	2.1	5,758
デジタル・インフォメーション	3.2	6,758
PCIホールディングス	2.5	3,082
パイプドＨＤ	1.4	2,472
アイビーシー	1.2	1,204
ネオジャパン	1.3	2,074
ＰＲ ＴＩＭＥＳ	1.6	5,368
ラクス	19.5	44,694
ランドコンピュータ	1	1,133
ダブルスタンダード	0.9	4,653
オープンドア	4	9,880
マイネット	2.5	1,970
アカツキ	2.7	10,125
ベネフィットジャパン	0.7	1,437
UBICOMホールディングス	1.8	6,129
カナミックネットワーク	7	4,690
ノムラシステムコーポレーション	3.3	996
チェンジ	12	35,952
シンクロ・フード	5.2	2,074
オークネット	3.8	5,418
セグエグループ	1.8	2,120
エイトレッド	1.3	2,935
AOI TYO HOLDINGS	6.3	5,657
マクロミル	13	11,232
ビーグリー	1.6	2,364
オロ	2.2	8,184
ユーザーローカル	1	4,270
テモナ	1.9	2,122
ニーズウェル	1.4	852
サインポスト	1.6	1,478
ソルクシーズ	2.6	2,665
フェイス	2.3	1,851
プロトコーポレーション	7.9	9,487
ハイマックス	2	2,158
野村総合研究所	115.8	419,196
サイバネットシステム	4.6	3,795
ＣＥホールディングス	3.6	1,911
日本システム技術	1.2	1,929
インテージホールディングス	8	12,664
東邦システムサイエンス	1.2	1,105
ソースネクスト	31.1	9,920
インフォコム	5.9	18,408
ＨＥＲＯＺ	1.8	4,231
ラクスル	7	36,470
ＦＩＧ	6.8	1,972
システムサポート	1.9	2,692
イーソル	3.4	3,876
アルテリア・ネットワークス	7.5	12,502
東海ソフト	1	1,535
ヒト・コミュニケーションズHD	1.6	3,723
トビラシステムズ	0.8	1,143
Ｓａｎｓａｎ	5.7	53,580
フォーカスシステムズ	4.2	4,410
クレスコ	4.3	7,619
フジ・メディア・HD	66	84,216
オービック	20.1	427,527
ジャストシステム	9.1	57,512
ＴＤＣソフト	5.6	5,628
Ｚホールディングス	869.7	456,418
トレンドマイクロ	34	196,860
IDホールディングス	2.4	3,240
日本オラクル	12.9	129,516

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
アルファシステムズ	1.7	6,315
フューチャー	7.9	16,795
CAC HOLDINGS	4.1	5,945
ＳＢテクノロジー	2.6	8,021
トーセ	1.7	1,383
オービックビジネスＣ	6.5	41,665
伊藤忠テクノソリュー	29.1	98,503
アイティフォー	8.2	6,601
東計電算	0.9	4,360
エックスネット	1	1,021
大塚商会	34.5	203,895
サイボウズ	7.6	19,851
電通国際情報Ｓ	8	32,120
ＡＣＣＥＳＳ	7.8	6,895
デジタルガレージ	10.5	49,875
イーエムシステムズ	10.4	9,380
ウェザーニューズ	2	11,700
ＣＩＪ	4	3,384
ビジネスエンジニアリング	0.6	1,962
日本エンタープライズ	8	1,752
WOWOW	3.3	8,035
スカラ	5.8	4,756
インテリジェント ウェイブ	3.7	2,475
IMAGICA GROUP	5.4	2,592
ネットワンシステムズ	26.2	90,259
システムソフト	18.4	2,925
アルゴグラフィックス	5.1	16,396
マーベラス	10.3	8,209
エイベックス	11.4	17,487
日本ユニシス	22.2	71,373
兼松エレクトロニクス	3.4	12,478
TBSホールディングス	42.1	76,243
日本テレビHLDS	53	70,808
朝日放送グループHD	5.3	3,752
テレビ朝日ＨＤ	19.7	37,193
スカパーJSATHD	41.9	17,681
テレビ東京ＨＤ	4.5	9,751
日本ＢＳ放送	2	2,228
ビジョン	8.5	10,497
スマートバリュー	2.1	1,669
USEN―NEXT HLDGS	6.4	14,976
ワイヤレスゲート	3.1	1,438
コネクシオ	4.2	6,203
日本通信	58.7	13,031
クロップス	1.2	1,051
日本電信電話	748.1	2,165,001
ＫＤＤＩ	512.9	1,847,978
ソフトバンク	581.3	827,480
光通信	7.5	156,300
エムティーアイ	7.4	4,980
GMOインターネット	22.9	72,593
ファイバーゲート	2.4	3,676
アイドママーケティングコミュ	1.7	746
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	16.7	77,905
学研ホールディングス	9.3	12,936
ゼンリン	11.6	13,722
昭文社ホールディングス	3.2	1,510
インプレスホールディングス	8.2	1,681
アイネット	3	4,323
松竹	4.2	54,768
東宝	37.7	175,116
東映	2.1	44,541
ＮＴＴデータ	169.9	296,985
ピー・シー・エー	1	4,115
ビジネスＢ太田昭和	2.3	4,071
ＤＴＳ	13.2	35,389
スクウェア・エニックス・HD	27.3	153,972
シーイーシー	6.8	10,995
カプコン	55.1	182,381
アイ・エス・ビー	3.1	4,588
ジャステック	4.1	5,256
ＳＣＳＫ	14.7	93,198
日本システムウエア	1.9	4,385
アイネス	6.3	8,479
ＴＫＣ	10.7	35,898
富士ソフト	6.8	39,168
ＮＳＤ	20.3	37,088
コナミホールディングス	23.2	167,968
福井コンピュータHLDS	3	12,555
JBCCホールディングス	4.2	5,838
ミロク情報サービス	6.2	9,932
ソフトバンクグループ	507.6	4,082,119
卸売業（4.8%）		
ホウスイ	0.5	475
高千穂交易	2.4	2,654

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
オルバヘルスケアHLDGS	1.1	1,897
伊藤忠食品	1.6	8,432
エレマテック	5.1	6,558
ＪＡＬＵＸ	1.7	3,192
あらた	5	21,200
トーメンデバイス	0.8	3,160
東京エレクトロンデバイス	2.2	13,112
フィールズ	5.7	2,770
双日	354.2	123,615
アルフレッサホールディングス	66.8	113,827
横浜冷凍	17.4	15,677
神栄	1	1,383
ラサ商事	3.3	2,973
アルコニックス	6.8	10,064
神戸物産	44.3	136,444
ハイパー	1.3	725
あい ホールディングス	9.1	19,528
ディーブイエックス	2.1	2,100
ダイワボウＨＤ	29.5	54,280
マクニカ・富士エレHLDGS	15.2	39,489
ラクト・ジャパン	3	8,541
バイタルＫＳＫ HD	11.1	7,681
八洲電機	4.5	4,396
メディアスホールディングス	3.8	4,050
レスターホールディングス	6.5	12,454
ジューテックＨＤ	1.4	1,425
大光	3	2,070
OCHIホールディングス	1.9	2,449
TOKAIホールディングス	31.3	27,731
黒谷	2.3	2,104
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1.3	971
三洋貿易	6.4	8,697
ビューティガレージ	1.1	4,983
ウイン・パートナーズ	4.6	4,595
ミタチ産業	1.1	722
シップヘルスケアHD	22.8	57,843
明治電機工業	2.1	2,814
デリカフーズHLDGS	3.5	2,264
スターティアホールディングス	1.6	2,380
コメダホールディングス	14	28,728
ピーバンドットコム	1.1	907
アセンテック	1.8	2,518
富士興産	2.1	2,557
協栄産業	0.7	965
小野建	5.5	7,194
南陽	1.2	2,334
佐鳥電機	4	3,220
エコートレーディング	1.7	1,057
伯東	4.2	6,510
コンドーテック	4.8	4,804
中山福	4.1	1,935
ナガイレーベン	8.2	21,377
三菱食品	6.9	20,410
松田産業	5	10,910
第一興商	12.8	56,832
メディパルHD	64.1	139,032
ＳＰＫ	2.9	3,871
萩原電気HLDGS	2.4	5,872
アズワン	4.6	62,100
スズデン	2.2	3,220
尾家産業	2	2,520
シモジマ	4.1	4,432
ドウシシャ	6.1	10,217
小津産業	1.6	3,065
高速	3.5	5,155
たけびし	2.2	3,414
リックス	1.3	1,998
丸文	5.6	3,505
ハピネット	5.7	8,316
橋本総業HLDGS	1.4	4,249
日本ライフライン	20.7	28,773
タカショー	5	4,035
マルカ	2.1	5,178
ＩＤＯＭ	22	14,366
進和	3.8	8,086
エスケイジャパン	2.5	1,142
ダイトロン	2.7	5,454
シークス	8.1	13,259
田中商事	1.7	1,198
オーハシテクニカ	3.4	5,198
白銅	2.1	3,948
ダイコー通産	0.8	1,222
伊藤忠	448.4	1,480,616
丸紅	632.5	628,641
高島	1	1,820

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
長瀬産業	35	58,030
蝶理	4.2	7,123
豊田通商	64.1	348,063
三共生興	9.1	4,795
兼松	25.7	37,599
ツカモトコーポレーション	1.3	1,803
三井物産	516.8	1,345,747
日本紙パルプ	3.3	11,814
カメイ	8.1	9,339
東都水産	0.4	1,896
OUGホールディングス	1	2,834
スターゼン	5	10,710
山善	24.8	24,229
椿本興業	1.2	4,182
住友商事	403.2	618,508
内田洋行	2.8	13,902
三菱商事	390.1	1,190,585
第一実業	3	12,750
キヤノンマーケティングJPN	15.6	42,120
西華産業	3.2	5,872
佐藤商事	5.1	5,431
菱洋エレクトロ	4.9	12,754
東京産業	5.7	3,465
ユアサ商事	6.5	20,150
神鋼商事	1.4	3,414
トルク	3.9	971
阪和興業	12.9	42,570
正栄食品	4.2	16,464
カナデン	5.3	5,686
菱電商事	4.7	7,614
フルサト工業	3.1	5,921
岩谷産業	15.6	98,748
ナイス	2.5	5,187
ニチモウ	1	2,064
極東貿易	2	4,542
アステナホールディングス	9.9	6,573
三愛石油	15.5	18,879
稲畑産業	15.7	27,019
ＧＳＩクレオス	3.5	3,577
明和産業	5.9	2,778
クワザワホールディングス	2.5	1,540
ヤマエ久野	4.6	5,248
ワキタ	12.6	14,099
東邦ホールディングス	20.3	34,591
サンゲツ	17.2	26,797
ミツウロコグループ	9.8	12,063
シナネンホールディングス	2.5	7,340
伊藤忠エネクス	14.5	14,659
サンリオ	18.3	35,685
サンワ テクノス	4.2	4,947
リョーサン	6.8	13,919
新光商事	8.6	6,493
トーホー	3	5,118
三信電気	3.5	7,542
東陽テクニカ	6.9	7,659
モスフード サービス	9	27,585
加賀電子	5.8	17,835
ソーダニツカ	6.3	3,572
立花エレテック	4.6	6,812
フオーバル	2.2	1,841
ＰＡＬＴＡＣ	10.3	61,182
三谷産業	9.4	3,637
太平洋興発	2.6	1,669
西本WISMETTAC HD	1.5	4,216
ヤマシタヘルスケアHLDGS	0.8	1,516
国際紙パルプ商事	13.6	3,427
ヤマタネ	2.9	4,387
丸紅建材リース	0.5	908
日鉄物産	4.4	19,514
泉州電業	1.8	6,435
トラスコ中山	14.7	42,350
オートバックスセブン	23.4	34,585
モリト	4.5	2,758
加藤産業	9.2	30,728
北恵	1.8	1,749
イノテック	3.7	5,028
イエローハット	12	22,932
JKホールディングス	5.8	4,593
日伝	5.3	11,569
北沢産業	4.3	1,100
杉本商事	3.2	7,011
因幡電機産業	17.1	44,032
東テク	2.3	6,214
ミスミグループ本社	80.4	299,892
アルテック	6.3	2,192

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
タキヒヨー	2.1	3,859
蔵王産業	0.9	1,323
スズケン	27.3	95,686
ジェコス	4.5	3,973
グローセル	6.4	2,720
小売業（4.5%）		
ローソン	16.1	80,983
サンエー	4.7	20,210
カワチ薬品	4.6	10,474
エービーシー・マート	9.9	63,360
ハードオフコーポレーション	2.5	1,967
アスクル	11.2	20,518
ゲオホールディングス	8.5	10,200
アダストリア	8.8	17,547
ジーフット	3	1,242
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1	423
くら寿司	7.6	31,806
キャンドゥ	3.5	6,863
パルグループHLDGS	5.5	9,185
エディオン	27	28,404
サーラコーポレーション	13.2	7,827
ワッツ	3.3	3,065
ハローズ	2.6	7,064
フジオフードG本社	5.3	7,080
あみやき亭	1.3	3,796
ひらまつ	11.8	2,678
大黒天物産	2.1	17,136
ハニーズホールディングス	5	5,115
ファーマライズHD	1.5	1,167
アルペン	5.2	15,303
ハブ	2.1	1,701
クオールホールディングス	8.6	13,158
ジンズホールディングス	4.3	34,959
ビックカメラ	37.6	42,939
DCMホールディングス	39.5	41,475
ペッパーフードサービス	8.3	4,282
ＭｏｎｏｔａＲＯ	91.5	241,834
東京一番フーズ	1.6	947
DDホールディングス	3.2	1,894
きちりホールディングス	1.4	841
アークランドサービスHD	5.5	12,584
J. フロント リテイリング	76.7	85,597
ドトール・日レスＨＤ	10.1	17,291
マツモトキヨシHLDGS	26.6	131,537
ブロンコビリー	3.3	8,028
ＺＯＺＯ	37.8	140,238
トレジャー・ファクトリー	2	1,910
物語コーポレーション	3.5	25,130
ココカラファイン	5.7	47,310
三越伊勢丹ＨＤ	112.4	94,528
Ｈａｍｅｅ	1.8	3,024
ウエルシアＨＤ	34.1	122,419
クリエイトＳＤＨ	9.4	31,161
丸善CHI HD	5	2,055
ミサワ	1.8	1,292
ティーライフ	1.3	1,956
エー・ピーホールディングス	1.7	782
チムニー	2.1	2,984
シュッピン	4.6	4,945
オイシックス・ラ・大地	8.5	30,855
ネクステージ	11.6	19,801
ジョイフル本田	18.3	24,851
鳥貴族ホールディングス	2.2	4,232
ホットランド	4.6	6,513
すかいらーくHD	71.4	112,597
SFPホールディングス	2.9	4,338
綿半ホールディングス	4.9	6,095
ヨシックス	1.3	3,140
ユナイテッド・スーパーマーケ	18.4	20,424
ゴルフダイジェスト・オン	3.9	5,877
ＢＥＥＮＯＳ	3.4	12,291
あさひ	5	7,020
日本調剤	3.9	6,240
コスモス薬品	6.5	105,690
トーエル	3.1	2,507
オンリー	1.1	517
セブン＆アイ・HLDGS	251	1,256,506
クリエイト・レストランツ・ホール	34.7	30,536
ツルハホールディングス	14	198,240
サンマルクホールディングス	5	8,160
フェリシモ	1.6	2,252
トリドールホールディングス	15.8	28,645
TOKYO BASE	6	4,332
ウイルプラスHLDGS	1.2	1,460
JMホールディングス	4.9	10,343

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
サツドラホールディングス	0.9	1,862
アレンザホールディングス	4.6	5,777
串カツ田中HLDGS	1.8	3,389
バロックジャパン	4.6	3,657
クスリのアオキHLDGS	6.4	54,784
力の源HD	2.3	1,522
FOOD&LIFE COMPAN	37.7	183,976
メディカルシステムネットワーク	5.8	4,193
はるやまHLDGS	2.3	1,550
ノジマ	11.4	34,257
カッパ・クリエイト	8.9	13,065
ライトオン	4.6	3,215
良品計画	84.7	178,547
三城ホールディングス	7.9	2,133
アドヴァン	6.5	6,253
アルビス	1.9	4,309
コナカ	7.8	2,847
ハウス ローゼ	0.6	981
G—7ホールディングス	3.9	11,778
イオン北海道	8.6	9,055
コジマ	11.3	8,260
ヒマラヤ	2.2	2,208
コーナン商事	9.2	34,224
エコス	2.4	4,596
ワタミ	8.3	8,275
マルシェ	1.5	789
パンパシフィックHD	128.3	309,844
西松屋チェーン	14.4	21,628
ゼンショーホールディングス	34.2	95,041
幸楽苑ホールディングス	4.1	6,629
ハークスレイ	1	1,025
サイゼリヤ	9.5	25,127
ＶＴホールディングス	24.5	11,686
魚力	1.9	3,763
ポプラ	3.1	923
フジ・コーポレーション	3.4	4,413
ユナイテッドアローズ	7.4	16,590
ハイデイ日高	9.1	16,198
京都きもの友禅	4.3	1,221
コロワイド	21.2	42,400
ピーシーデポコーポ	7.4	3,396
壱番屋	4.4	21,296
トップカルチャー	2.5	857
ＰＬＡＮＴ	1.6	1,155
スギホールディングス	12.9	115,455
薬王堂ホールディングス	2.8	6,784
ヴィア・ホールディングス	7.6	1,702
スクロール	9.5	8,113
ヨンドシーホールディングス	6	11,592
木曽路	8.3	19,828
SRSホールディングス	8.2	6,740
千趣会	11.8	4,849
タカキユー	7.3	1,029
リテールパートナーズ	7.9	9,590
ケーヨー	11.9	9,020
上新電機	7.4	20,586
日本瓦斯	32.1	58,229
ロイヤルホールディングス	11.1	24,930
東天紅	0.5	554
いなげや	7.1	10,493
チヨダ	6.4	5,792
ライフコーポレーション	6	21,480
リンガーハット	7.9	18,312
ＭｒＭａｘＨＤ	8.8	5,676
テンアライド	5.3	1,817
AOKIホールディングス	13.3	9,389
オークワ	10	11,190
コメリ	9.9	26,155
青山商事	14.2	11,686
しまむら	7.4	71,780
はせがわ	3.3	986
高島屋	46.9	61,110
松屋	14.1	13,874
エイチ・ツー・オーリテイリング	30.5	28,731
近鉄百貨店	2.4	7,680
丸井グループ	54.6	117,499
アクシアル リテイリング	5.2	20,254
井筒屋	3.2	780
イオン	246.8	740,893
イズミ	13	54,795
平和堂	11.4	26,299
フジ	7.7	15,269
ヤオコー	7.3	47,158
ゼビオホールディングス	7.4	7,370
ケーズホールディングス	56.6	73,297

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
OLYMPICグループ	3.6	2,847
日産東京販売ＨＤ	8.9	2,153
シルバーライフ	1.4	3,381
一家ダイニングプロジ	1	617
GENKY DRUGSTORES	2.8	10,108
ナルミヤ・インターナショナル	1.4	1,624
ブックオフＧＨＤ	3.6	3,387
アインホールディングス	9.3	65,658
元気寿司	1.8	4,771
ヤマダホールディングス	212.4	110,023
アークランドサカモト	10.1	14,766
ニトリホールディングス	25.4	480,695
グルメ杵屋	4.1	4,013
愛眼	4.4	1,012
ケーユーホールディングス	3.4	3,264
吉野家ホールディングス	21	43,617
松屋フーズHLDGS	2.9	10,280
サガミホールディングス	8.7	8,987
関西スーパーマーケット	4.8	4,867
王将フードサービス	4.1	23,042
プレナス	7	14,175
ミニストップ	5.4	7,570
アークス	12.1	29,620
バローホールディングス	13	29,497
藤久	1.7	1,404
ベルク	3.1	17,515
大庄	3.1	3,431
ファーストリテイリング	8.6	722,916
サンドラッグ	24.3	88,087
サックスバーホールディング	5	3,175
ヤマザワ	1.1	1,883
やまや	1.2	2,746
ベルーナ	13.9	14,817
銀行業（5.0%）		
島根銀行	3	1,929
じもとホールディングス	4.3	2,829
めぶきフィナンシャルＧ	333.4	79,015
東京きらぼしFG	8.2	11,840
九州フィナンシャルＧ	130.5	51,678
ゆうちょ銀行	181.2	168,697
富山第一銀行	14.7	4,101
コンコルディア・フィナンシャル	389.8	161,767
西日本フィナンシャルHD	42.5	27,922
33ＦＧ	5.5	7,326
第四北越フィナンシャルＧ	10.4	24,887
ひろぎんHLDGS	95.7	54,931
新生銀行	52.8	83,054
あおぞら銀行	38.4	95,308
三菱UFJフィナンシャルＧ	4,395.5	2,675,980
りそなホールディングス	746.7	334,596
三井住友トラストHD	121.6	445,299
三井住友フィナンシャルＧ	444.2	1,741,264
千葉銀行	214.1	148,585
群馬銀行	130.5	46,588
武蔵野銀行	9.5	15,846
千葉興業銀行	16.5	4,339
筑波銀行	28.9	4,913
七十七銀行	20.2	25,431
青森銀行	4.9	10,211
秋田銀行	3.9	5,456
山形銀行	7	6,041
岩手銀行	4.2	7,345
東邦銀行	56.7	11,623
東北銀行	3.1	3,177
みちのく銀行	4.3	4,183
ふくおかフィナンシャルＧ	58.1	115,328
静岡銀行	156.6	140,470
十六銀行	8.2	15,899
スルガ銀行	63	21,105
八十二銀行	141.8	51,331
山梨中央銀行	7.4	6,127
大垣共立銀行	12.9	24,277
福井銀行	5.6	8,086
北國銀行	6	13,038
清水銀行	2.5	3,790
富山銀行	1.3	3,339
滋賀銀行	12.9	26,535
南都銀行	9.3	17,028
百五銀行	58.1	17,662
京都銀行	23.2	120,640
紀陽銀行	22.5	32,940
ほくほくフィナンシャルＧ	42.8	36,080
山陰合同銀行	39.7	21,398
中国銀行	54.8	46,744
鳥取銀行	2.2	2,464

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
伊予銀行	85.1	46,805
百十四銀行	6.5	9,516
四国銀行	9.3	6,510
阿波銀行	9.6	19,507
大分銀行	3.7	6,290
宮崎銀行	4	8,028
佐賀銀行	3.7	5,109
沖縄銀行	5.7	14,529
琉球銀行	13.5	9,841
セブン銀行	215.2	49,711
みずほフィナンシャルＧ	872.5	1,417,376
高知銀行	2.5	2,107
山口フィナンシャルＧ	79.9	51,455
長野銀行	2.3	2,543
名古屋銀行	5.1	13,178
北洋銀行	98.4	23,616
愛知銀行	2.2	6,166
中京銀行	2.6	3,803
大光銀行	2.2	3,077
愛媛銀行	8.9	7,173
トマト銀行	2.3	2,396
京葉銀行	25.5	10,480
栃木銀行	31.6	5,435
北日本銀行	1.9	3,269
東和銀行	12.2	6,453
福島銀行	7.7	1,771
大東銀行	3	1,818
トモニホールディングス	48.2	14,363
フィデアホール	62	7,440
池田泉州ＨＤ	73.9	11,824
証券、商品先物取引業（0.8%）		
ＦＰＧ	21.8	16,895
マーキュリアインベストメント	3.2	2,371
SBIホールディングス	79.3	214,189
日本アジア投資	6.1	1,708
ジャフコ グループ	10	73,000
大和証券Ｇ本社	479.5	305,921
野村ホールディングス	982.4	575,096
岡三証券グループ	53.1	22,673
丸三証券	19.2	12,076
東洋証券	21.5	3,612
東海東京ＨＤ	68	27,744
光世証券	1.8	1,141
水戸証券	17.8	5,375
いちよし証券	13.3	7,700
松井証券	31.7	26,120
マネックスＧ	58.3	47,223
極東証券	8.5	6,893
岩井コスモホールディング	7.1	11,842
藍澤證券	11.6	12,342
マネーパートナーズGP	9.1	2,256
スパークス・グループ	31.1	8,272
小林洋行	4.1	1,172
保険業（1.9%）		
かんぽ生命保険	79.8	167,899
SOMPOホールディングス	113.3	486,057
アニコム ホールディングス	18.6	17,465
ＭＳ＆ＡＤ	155.7	519,103
第一生命HLDGS	339.6	735,403
東京海上ＨＤ	211.8	1,093,947
T&Dホールディングス	192.4	279,172
アドバンスクリエイト	3.4	3,111
その他金融業（1.1%）		
全国保証	16.8	80,976
ジェイリース	2.5	2,895
イントラスト	2.1	1,558
日本モーゲージサービス	3.6	3,600
Ｃａｓａ	2.1	2,058
アルヒ	9.7	14,734
プレミアグループ	3.2	11,648
クレディセゾン	37.4	52,883
芙蓉総合リース	6.6	46,926
みずほリース	10	34,750
東京センチュリー	14.9	88,804
日本証券金融	28.2	24,336
アイフル	109.2	41,277
リコーリース	5	17,000
イオンフィナンシャルサービス	39.2	51,665
アコム	128.5	65,535
ジャックス	7.1	18,389
オリコ	174.5	27,047
オリックス	389.7	753,290
三菱HCキャピタル	223.1	134,306
九州リースサービス	3	2,016
日本取引所グループ	173.6	444,329

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
イー・ギャランティ	7.6	17,206
アサックス	3.9	2,714
NECキャピタルソリューション	2.6	5,595
不動産業（2.1%）		
いちご	72	26,856
日本駐車場開発	72.2	11,624
スター・マイカ・HLDGS	3.3	3,811
ADワークスグループ	12.6	2,091
ヒューリック	135.7	178,174
三栄建築設計	2.8	5,583
野村不動産HLDGS	39.3	115,384
三重交通グループHD	12.4	5,964
サムティ	9.4	18,959
日本商業開発	4.5	8,406
プレサンスコーポレーション	10.7	16,231
ハウスコム	1.2	1,542
日本管理センター	3.7	4,824
サンセイランディック	1.8	1,596
エストラスト	1.1	746
フージャースHD	10.4	7,664
オープンハウス	20.5	106,600
東急不動産ＨＤ	174.6	127,283
飯田ＧＨＤ	53.5	158,199
イーグランド	1.2	1,237
ビーロット	3.3	2,036
ファーストブラザーズ	1.2	1,219
ハウスドゥ	3.3	3,474
シーアールイー	1.8	2,770
プロパティエージェント	1.4	3,357
ケイアイスター不動産	2.1	10,542
アグレ都市デザイン	1.6	1,670
ジェイ・エス・ビー	1.2	4,482
テンポイノベーション	2.2	1,991
グロバルリンクマネジメント	1.3	1,162
パーク24	34.6	75,462
パラカ	1.6	2,609
三井不動産	292.7	804,339
三菱地所	421.6	814,742
平和不動産	11.1	47,119
東京建物	63.3	108,686
ダイビル	16.5	23,100
京阪神ビルディング	10.5	14,836
住友不動産	144.3	602,452
テーオーシー	12.1	8,506
東京楽天地	1	4,240
スターツコーポレーション	7.5	20,797
フジ住宅	7.7	4,897
空港施設	6.7	4,388
明和地所	3.2	1,984
ゴールドクレスト	5.8	10,399
エスリード	2.5	4,062
日神グループHLDGS	9.3	4,212
日本エスコン	12.5	9,850
タカラレーベン	27.4	9,453
ＡＶＡＮＴＩＡ	3.6	3,214
イオンモール	32.1	58,036
毎日コムネット	2.5	1,787
ファースト住建	2.7	3,261
ランド	359.9	3,958
カチタス	16	50,480
トーセイ	8.9	9,843
穴吹興産	1.8	3,799
サンフロンティア不動産	7.8	7,901
インテリックス	1.8	1,389
ランドビジネス	2.8	1,013
サンネクスタグループ	2.2	2,235
グランディハウス	5.2	2,199
日本空港ビルデング	22.3	123,988
サービス業（5.6%）		
明豊ファシリティワークス	3.1	2,690
日本工営	3.8	12,312
ＬＩＦＵＬＬ	22.5	8,122
ミクシィ	16.1	47,301
ジェイエイシーリクルートメント	4.4	7,818
日本Ｍ＆Ａセンター	102.3	285,723
メンバーズ	2.1	6,951
中広	1.1	405
ＵＴグループ	9.1	29,711
アイティメディア	2.5	4,637
タケエイ	7.2	9,676
Ｅ・Ｊホールディングス	3.5	3,986
夢真ビーネックスグループ	17	21,879
コシダカホールディングス	17	10,846
アルトナー	1.6	1,427
パソナグループ	6.8	14,953

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
ＣＤＳ	1.5	2,284
リンクアンドモチベーション	11.6	7,702
ＧＣＡ	8.1	8,343
エス・エム・エス	21.3	72,420
サニーサイドアップＧ	2	1,682
パーソルホールディングス	62.1	139,662
リニカル	3.6	2,901
クックパッド	21.7	5,555
エスクリ	2.5	1,222
アイ・ケイ・ケイ	3.1	2,092
学情	2.3	3,270
スタジオアリス	3.4	7,857
シミックホールディングス	3.2	5,065
エプコ	1.5	1,416
ＮＪＳ	1.5	3,127
綜合警備保障	24.5	127,890
カカクコム	46.2	156,618
アイロムグループ	2.4	5,061
セントケア・ホールディング	4.9	5,341
サイネックス	1.7	1,156
ルネサンス	4.2	5,464
ディップ	9.9	34,749
デジタルホールディングス	4.7	11,670
新日本科学	8	6,640
キャリアデザインセンター	1.5	1,627
ベネフィット・ワン	22.7	80,244
エムスリー	110.1	861,092
ツカダ・グローバルHOLD	4.9	2,087
ブラス	1.1	679
アウトソーシング	35.8	75,860
ウェルネット	6.3	3,294
ワールドホールディングス	2.2	6,611
ディー・エヌ・エー	26.8	61,988
博報堂ＤＹ HLDGS	86.4	155,260
ぐるなび	11	6,446
タカミヤ	7.5	3,990
ジャパンベストレスキューS	5	4,150
ファンコミュニケーションズ	16.4	6,314
ライク	1.8	3,774
ビジネス・ブレークスルー	3	1,302
エスプール	16.3	16,039
WDBホールディングス	2.9	8,108
手間いらず	0.9	5,895
ティア	3.6	1,702
ＣＤＧ	0.5	789
バリューコマース	4.5	15,300
インフォマート	63.1	63,983
JPホールディングス	18.3	5,178
エコナックホールディングス	13.5	1,242
EPSホールディングス	8.5	15,283
レッグス	1.7	4,981
プレステージ・インター	23.3	16,799
アミューズ	3.5	8,375
ドリームインキュベータ	2.1	2,016
クイック	3.8	4,674
ＴＡＣ	4	952
電通グループ	69.9	270,513
テイクアンドギヴニーズ	3.4	3,556
ぴあ	1.8	6,201
イオンファンタジー	2.4	5,563
シーティーエス	7.1	6,248
ネクシィーズグループ	2.2	2,048
ＨＵグループＨＤ	17.7	52,091
アルプス技研	5.5	10,983
サニックス	10.5	4,158
ダイオーズ	0.8	822
日本空調サービス	6.2	4,476
オリエンタルランド	66.2	1,081,708
ダスキン	14.4	36,892
明光ネットワークジャパン	8.1	4,803
ファルコホールディングス	2.9	4,895
秀英予備校	2	804
田谷	1.5	855
ラウンドワン	21.5	30,917
リゾートトラスト	28.7	51,918
ビー・エム・エル	8	29,320
りらいあコミュニケーショ	9.5	12,606
リソー教育	33.7	10,682
早稲田アカデミー	2.7	2,470
ユー・エス・エス	69.2	129,196
東京個別指導学院	5.7	3,505
サイバーエージェント	154.1	344,105
楽天グループ	291.4	382,608
クリーク・アンド・リバー社	3.4	5,222
テー・オー・ダブリュー	10.5	3,549

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
山田コンサルティングGP	3.6	4,226
セントラルスポーツ	2.3	5,888
フルキャストホールディングス	5.4	11,815
エン・ジャパン	11.1	43,345
リソルホールディングス	0.7	2,800
テクノプロ・ホールディング	12.4	97,340
アトラグループ	1.8	603
インターワークス	1.5	628
アイ・アールジャパンHD	2.6	36,244
ＫｅｅＰｅｒ技研	4.2	10,831
ファーストロジック	2	1,520
三機サービス	1.5	1,576
Ｇｕｎｏｓｙ	4.5	4,378
デザインワン・ジャパン	3.4	778
イー・ガーディアン	3.2	8,953
リブセンス	6.5	1,521
ジャパンマテリアル	18.8	25,361
ベクトル	7.9	7,576
ウチヤマホールディングス	3	1,209
チャームケアコーポレーション	5.1	6,074
キャリアリンク	2.2	5,167
ＩＢＪ	5.4	6,345
アサンテ	2.3	4,071
バリューＨＲ	2.6	4,542
M&Aキャピタルパートナー	5.2	24,700
ライドオンエクスプレスHD	2.6	3,936
ERIホールディングス	1.5	915
アビスト	1	2,910
シグマクシス	3.6	8,272
ウィルグループ	4.6	4,669
エスクローＡＪ	9.9	2,465
リクルートホールディングス	446.1	2,560,167
エラン	9	11,682
土木管理総合試験	3.1	1,181
ネットマーケティング	4.4	1,834
日本郵政	469.7	426,346
ベルシステム24HLDGS	10.4	18,397
鎌倉新書	6.6	7,055
ＳＭＮ	1.9	1,518
一蔵	0.9	403
グローバルキッズCOMP	1.3	1,306
エアトリ	4.2	12,402
アトラエ	4.4	9,301
ストライク	2.4	10,332
ソラスト	15.7	21,713
セラク	2.2	4,963
インソース	6.3	12,959
ベイカレントコンサルティング	4.1	153,545
ORCHESTRA HLDGS	1.6	4,787
アイモバイル	2.6	4,882
キャリアインデックス	3.2	2,758
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	2.7	3,005
船場	0.9	738
グレイステクノロジー	6.8	11,655
ジャパンエレベーターSHD	18.2	46,683
フルテック	0.9	1,224
グリーンズ	2.8	1,792
ツナググループHLDGS	1.2	476
GAMEWITH	1.8	1,117
ソウルドアウト	1.5	2,664
MS&CONSULTING	1.1	696
ミダック	1.4	9,520
日総工産	5	4,155
キュービーネットHLDGS	3	5,385
RPAホールディングス	7.4	5,505
スプリックス	2	2,728
マネジメントソリューションズ	3.2	7,299
プロレド・パートナーズ	1.1	2,823
AND FACTORY	1.2	855
ギークス	1.3	2,427
カーブスホールディングス	17.3	15,656
フォーラムエンジニアリング	4.4	4,298
LITALICO	2.7	14,472
アドバンテッジリスクマネ	3.2	3,305
リログループ	34.1	88,421
東祥	4	7,868
エイチ・アイ・エス	10	25,460
ラックランド	1.9	5,209
共立メンテナンス	10.4	41,756
イチネンホールディングス	6.2	7,663
建設技術研究所	4.1	10,233
スペース	3.9	3,580
長大	2.5	4,727
燦ホールディングス	2.7	3,240
スバル興業	0.4	3,216

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
東京テアトル	2.3	2,907
タナベ経営	1	1,457
ナガワ	2	16,340
東京都競馬	4.2	19,635
常磐興産	2.6	3,840
カナモト	10.8	28,360
西尾レントオール	5.7	18,781
アゴーラホスピタリティーG	52.2	1,409
トランス・コスモス	6	17,922
乃村工藝社	26.8	25,835
藤田観光	2.7	6,269
KNT−CTホールディングス	3.8	5,475
日本管財	6.5	15,262
トーカイ	6	14,688
白洋舎	0.7	1,633
セコム	61.2	537,642
セントラル警備保障	2.9	9,251
丹青社	11.7	10,764
メイテツク	7.6	47,880
応用地質	7.1	9,059
船井総研ホールディン	12.6	31,374
進学会ホールディングス	2.6	1,099
オオバ	4.1	3,083
いであ	1.5	2,692
学究社	1.9	2,565
ベネッセホールディングス	22.7	60,949
イオンディライト	7.6	25,992
ナック	2.7	2,481
ダイセキ	10.5	46,410
ステップ	2.2	3,480
	千株	千円
合計 株数、金額	68,936.3	176,669,720
合計 銘柄数<比率>	2,132銘柄	<97.4%>

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

(2) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別		2021年6月15日現在 買建額	売建額
		百万円	百万円
国内	ＴＯＰＩＸ	4,714	—

（注）単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入状況

区分	2021年6月15日現在 貸付	借入
	株	株
株式	3,352,800	—
	(30,900)	(—)

（注１）（　）内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
（注２）当ファンドに係る当作成期中の利害関係人のうち、大和証券へ30,900株を貸付けています。

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用報告書　第32期　（決算日　2020年９月23日）

（作成対象期間　2019年９月20日～2020年９月23日）

トピックス・インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

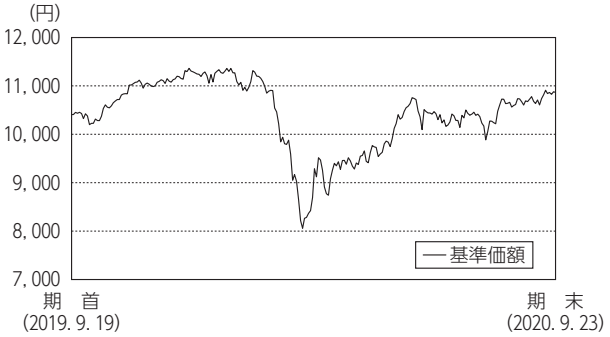
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		TOPIX		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2019年９月19日	10,406	—	1,615.66	—	99.7	0.2
９月末	10,324	△ 0.8	1,587.80	△ 1.7	98.5	1.6
10月末	10,840	4.2	1,667.01	3.2	98.9	2.0
11月末	11,051	6.2	1,699.36	5.2	98.3	1.9
12月末	11,211	7.7	1,721.36	6.5	98.5	1.5
2020年１月末	10,972	5.4	1,684.44	4.3	97.8	2.2
２月末	9,844	△ 5.4	1,510.87	△ 6.5	97.1	3.0
３月末	9,257	△11.0	1,403.04	△13.2	97.6	2.3
４月末	9,657	△ 7.2	1,464.03	△ 9.4	98.0	1.8
５月末	10,314	△ 0.9	1,563.67	△ 3.2	97.7	2.2
６月末	10,298	△ 1.0	1,558.77	△ 3.5	97.8	2.1
７月末	9,884	△ 5.0	1,496.06	△ 7.4	98.7	1.2
８月末	10,692	2.7	1,618.18	0.2	99.1	0.8
(期末)2020年９月23日	10,865	4.4	1,644.25	1.8	99.4	0.6

（注１）騰落率は期首比。
（注２）指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。
　　上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
（注３）株式先物比率は買建比率－売建比率です。
（注４）株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,406円　期末：10,865円　騰落率：4.4%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

・保有している株式の配当金について、ベンチマークが配当落ちしていることに対して、ファンドには配当金が計上されているため、ベンチマークとかい離しました。
・その他、ファンドで組み入れている現物株式ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、先物取引の影響、売買コスト等がかい離の要因として挙げられます。

《今後の運用方針》

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

■１万口当りの費用の明細

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

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

■売買および取引の状況
(1)株　　式

(2019年９月20日から2020年９月23日まで)

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

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

(2)先物取引の種類別取引状況

(2019年９月20日から2020年９月23日まで)

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

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

(3)新株予約権証券

(2019年９月20日から2020年９月23日まで)

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

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

■主要な売買銘柄
株　　式

(2019年９月20日から2020年９月23日まで)

当　期							
買　付				売　付			
銘　　柄	株　数	金　額	平均単価	銘　　柄	株　数	金　額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	129. 3	908, 611	7, 027	トヨタ自動車	71. 8455	521, 789	7, 262
ソニー	69	472, 389	6, 846	ソニー	64. 6	444, 591	6, 882
ＮＴＴドコモ	148. 9	440, 065	2, 955	キーエンス	7. 7	363, 514	47, 209
ソフトバンクグループ	89. 7	406, 405	4, 530	ＫＤＤＩ	97. 8	300, 687	3, 074
任天堂	9. 6	384, 932	40, 097	武田薬品	73. 5	295, 341	4, 018
三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	765. 7	370, 857	484	日本電信電話	68. 1	249, 300	3, 660
日本電信電話	114. 1	362, 502	3, 177	本田技研	81. 2	233, 730	2, 878
キーエンス	8. 3	358, 955	43, 247	ソフトバンクグループ	49. 4	231, 915	4, 694
武田薬品	90. 7	338, 265	3, 729	三菱ＵＦＪフィナンシャルＧ	443. 8	223, 249	503
日立	74. 9	284, 250	3, 795	ソフトバンク	140. 7	208, 345	1, 480

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
(1)国内株式

銘　　柄	期　首	当　期　末	
	株　数	株　数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業（0. 1%）			
極洋	2. 8	3. 3	9, 071
日本水産	84. 9	92. 4	42, 134
マルハニチロ	12. 3	13. 4	33, 057
カネコ種苗	2. 6	2. 8	4, 365
サカタのタネ	10. 1	11	40, 150
ホクト	7. 1	7. 1	15, 982
ホクリヨウ	1. 1	1. 6	1, 076
鉱業（0. 2%）			
住石ホールディングス	18. 5	18. 4	2, 281
日鉄鉱業	1. 9	2. 1	9, 996
三井松島 HLDGS	3. 6	3. 4	2, 594
国際石油開発帝石	340. 3	339. 1	196, 203
石油資源開発	12. 2	12. 1	20, 509
K&O エナジーグループ	4. 1	4. 5	6, 700
建設業（2. 5%）			
ヒノキヤグループ	2. 1	2. 3	4, 503
ショーボンドＨＤ	12. 1	14. 3	73, 502
ミライト・ホールディングス	23. 8	27. 4	44, 168
タマホーム	4. 1	5	6, 845
サンヨーホームズ	1. 2	0. 5	329
日本アクア	3. 4	3. 8	2, 553
ファーストコーポレーション	2. 6	3	2, 013
ベステラ	1. 6	1. 6	1, 920
キャンディル	—	1. 4	1, 090
スペースバリュー HD	10. 4	11. 1	5, 605
ダイセキ環境ソリューション	1. 6	1. 8	1, 285
第一カッター興業	1	1. 1	2, 483
明豊ファシリティワークス	—	2. 7	1, 873
安藤・間	54. 4	54. 9	41, 120
東急建設	24. 8	27. 1	12, 845
コムシスホールディングス	30. 1	32. 6	96, 039
ミサワホーム	6. 7	—	—
ビーアールホールディングス	9. 3	9. 9	7, 860
高松コンストラクション GP	5. 3	5. 7	12, 967
東建コーポレーション	2. 6	2. 8	21, 924
ソネック	0. 8	0. 9	807
ヤマウラ	3. 3	4	3, 504
大成建設	69. 7	70. 8	262, 668
大林組	209. 8	212. 7	211, 849
清水建設	214. 1	215. 5	175, 632
飛島建設	6	5. 9	6, 531
長谷工コーポレーション	87. 4	81. 8	119, 755
松井建設	7. 7	8. 3	5, 511
錢高組	0. 9	0. 9	4, 369
鹿島建設	164	166. 7	216, 376
不動テトラ	4. 8	5. 5	8, 382
大末建設	2. 5	2. 3	2, 116
鉄建建設	4. 3	4. 6	9, 788
西松建設	15. 1	16. 4	34, 751
三井住友建設	50. 5	51. 7	22, 386

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大豊建設	4.7	4.8	14,390
前田建設	49.1	53.5	42,372
佐田建設	4.5	4.5	2,007
ナカノフドー建設	5.4	5.7	2,274
奥村組	11.5	10	26,990
東鉄工業	8.4	9	25,551
イチケン	1.3	1.5	2,416
富士ピー・エス	2.9	3	1,941
淺沼組	2.4	2.4	10,068
戸田建設	81.3	87.6	62,283
熊谷組	10	9.9	27,096
青木あすなろ建設	3.6	—	—
北野建設	1.5	1.3	3,471
植木組	0.9	0.9	2,538
矢作建設	9.5	9.3	8,472
ピーエス三菱	7.4	7	4,333
日本ハウスHLDGS	13.4	14.2	3,961
大東建託	24.9	23.1	215,684
新日本建設	8.3	9	7,992
ＮＩＰＰＯ	18.5	17.4	50,460
東亜道路	1.3	1.3	4,732
前田道路	20.8	18.8	36,716
日本道路	1.9	2	15,740
東亜建設	6.1	6.7	11,195
日本国土開発	11.5	20.8	13,187
若築建設	3.5	3.7	4,602
東洋建設	25.7	23.9	9,894
五洋建設	83.3	84.8	58,088
世紀東急	10.2	10.2	8,160
福田組	2.3	2.5	13,625
住友林業	49.6	53.9	93,354
日本基礎技術	7.2	7.3	3,613
巴コーポレーション	8.7	9.2	3,578
大和ハウス	193.8	209.9	595,171
ライト工業	13.5	12.2	19,568
積水ハウス	214.2	229.3	442,434
日特建設	6	5.5	4,411
北陸電気工事	3.4	3.6	4,140
ユアテック	11.2	11.9	7,842
日本リーテック	—	4.5	13,405
四電工	1	1.1	2,508
中電工	9	8.2	19,097
関電工	31.8	29.8	25,955
きんでん	46.5	50.1	92,785
東京エネシス	7.2	7	5,369
トーエネック	2	2	7,070
住友電設	4.8	6	14,796
日本電設工業	11.9	11.6	25,554
協和エクシオ	27.4	32.2	88,228
新日本空調	5.6	5.6	12,381
九電工	13.8	14.9	46,115
三機工業	15.3	15.3	18,329
日揮ホールディングス	60.4	65.8	69,616
中外炉工業	2	2.3	3,686
ヤマト	6.3	6.8	4,692
太平電業	4.7	5.2	11,965
高砂熱学	17	17.7	26,974
三晃金属	0.8	0.8	1,743
朝日工業社	1.5	1.4	4,452
明星工業	12.7	13.8	11,426
大氣社	9.5	10.4	30,357
ダイダン	4.7	5.1	14,331
日比谷総合設備	6.3	6.9	12,275
東芝プラントシステム	15.2	—	—
フィル・カンパニー	—	1.2	2,336
ＯＳＪＢ ＨＤ	31	33.3	8,125
東洋エンジニア	8.3	8.7	3,027
レイズネクスト	12.5	11.2	14,459
食料品（3.7%）			
日本製粉	19.8	20.1	34,672
日清製粉Ｇ本社	70.8	77.3	131,873
日東富士製粉	0.4	0.5	3,250
昭和産業	5.7	6.3	21,829
鳥越製粉	5.6	6	6,360
中部飼料	7.6	8.4	14,968
フィード・ワン	42.1	45.7	8,820
東洋精糖	0.9	1.2	1,465
日本甜菜糖	3.6	3.5	6,485
三井製糖	4.9	6	11,544
塩水港精糖	6.6	6.9	1,593
日新製糖	2.9	3.3	6,270
森永製菓	15.8	16	66,160

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
中村屋	1.6	1.8	7,641
江崎グリコ	18.6	19	88,540
名糖産業	3	3.3	5,260
井村屋グループ	2.7	3.8	9,640
不二家	3.5	3.8	9,044
山崎製パン	47.1	51.2	93,440
第一屋製パン	1.1	1.3	1,293
モロゾフ	1.1	1.1	6,545
亀田製菓	3.9	3.9	20,982
寿スピリッツ	6.6	6.6	34,518
カルビー	28.6	31.2	107,328
森永乳業	12.6	12.6	68,292
六甲バター	4.2	4.5	8,217
ヤクルト	46.4	46.8	274,716
明治ホールディングス	44.4	45	364,500
雪印メグミルク	15.1	16.5	41,200
プリマハム	8.8	10.7	33,651
日本ハム	26	26.1	122,148
林兼産業	2	2.3	1,357
丸大食品	6.7	7.3	13,578
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	5.6	5.5	15,983
柿安本店	—	2.3	6,124
伊藤ハム米久HLDGS	40.3	44.2	33,592
サッポロホールディングス	21.4	23.3	44,736
アサヒグループホールディン	131.3	143.3	533,935
キリンＨＤ	265.9	288	565,776
宝ホールディングス	47	50.7	57,798
オエノンホールディングス	16.6	18	7,632
養命酒	1.9	2.1	3,912
コカ・コーラボトラーズJHD	44	48	84,528
サントリー食品インター	41.9	45.7	180,515
ダイドーグループHD	3.5	3.5	18,935
伊藤園	19	20.8	154,336
キーコーヒー	6.2	6.7	15,356
ユニカフェ	1.6	1.6	1,648
ジャパンフーズ	0.9	0.9	1,170
日清オイリオグループ	8	8.8	28,468
不二製油グループ	15.3	16.7	54,108
かどや製油	0.7	0.8	3,072
Ｊ－オイルミルズ	3.2	3.6	14,130
キッコーマン	41.4	49.1	284,780
味の素	138.5	150.4	326,969
キユーピー	34.9	38.1	80,352
ハウス食品Ｇ本社	23.4	25.6	93,952
カゴメ	23.8	26	93,730
焼津水産化工	3.1	3.2	3,158
アリアケジャパン	5.7	6.2	44,950
ピエトロ	0.8	0.8	1,372
エバラ食品工業	1.5	1.7	3,976
やまみ	0.3	0.6	1,323
ニチレイ	32.6	32.6	91,247
東洋水産	32.3	35.1	200,772
イートアンド	2.2	2.3	4,574
大冷	0.7	0.8	1,928
ヨシムラ・フード・HLDGS	1.7	3.8	3,564
日清食品ＨＤ	26.6	29	290,580
永谷園ホールディングス	3.4	3.4	7,986
一正蒲鉾	2.4	2.6	2,810
フジッコ	6.8	7.4	15,332
ロックフィールド	6.8	7.3	10,555
日本たばこ産業	361.9	364.8	713,366
ケンコーマヨネーズ	3.5	3.8	7,037
わらべや日洋HD	4.1	4.4	6,846
なとり	3.5	3.9	7,998
イフジ産業	1	1	945
ピックルスコーポレーション	1.5	1.5	4,327
北の達人コーポ	24.6	23.8	13,542
ユーグレナ	26.8	29.4	27,224
ミヨシ油脂	2.4	2.5	2,875
理研ビタミン	3	6.5	14,534
繊維製品（0.5%）			
片倉工業	8.9	9.2	11,628
グンゼ	4.1	4.9	20,310
東洋紡	26	26.4	43,876
ユニチカ	18.1	19.8	7,246
富士紡ホールディングス	3.2	3.2	11,888
倉敷紡績	5.8	6.6	13,391
シキボウ	3.2	4	3,940
日本毛織	20	21.4	21,143
ダイトウボウ	10.4	12.1	1,379
トーア紡コーポレーション	2.5	2.6	1,294
ダイドーリミテッド	7.2	9.7	1,940

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
帝国繊維	6.9	7.5	20,272
帝人	49.8	54.1	91,374
東レ	474.6	480.7	237,754
サカイオーベックス	1.5	1.7	3,578
住江織物	1.8	1.4	2,713
日本フエルト	3.5	3.5	1,725
イチカワ	0.9	0.9	1,249
日東製網	0.7	0.8	1,190
アツギ	5.1	5.3	2,883
ダイニック	2.5	2.4	1,958
セーレン	15.1	16.4	24,731
ソトー	2.4	2.4	2,342
東海染工	0.8	0.9	1,026
小松マテーレ	10	10.8	9,644
ワコールホールディングス	17.3	16.7	32,915
ホギメディカル	7.6	7.5	27,750
レナウン	17.9	—	—
クラウディアHLDGS	1.5	1.7	540
ＴＳＩホールディングス	22.6	22.1	7,160
マツオカコーポレーション	1.9	1.9	4,164
ワールド	8	9.5	13,471
三陽商会	3.2	3.5	2,093
ナイガイ	2.2	2.5	970
オンワードホールディングス	36.8	40.1	11,027
ルックホールディングス	2.1	2.1	1,789
ゴールドウイン	5.5	12	94,440
デサント	14.9	13	23,270
キング	3.3	3	1,764
ヤマトインターナショナル	3.7	5.7	2,052
パルプ・紙（0.2%）			
特種東海製紙	3.9	4.1	19,044
王子ホールディングス	275.2	277.1	136,887
日本製紙	29.4	29.3	38,646
三菱製紙	10	7.3	2,642
北越コーポレーション	40.5	39.9	14,523
中越パルプ	2.6	2.8	4,256
巴川製紙	2	2.1	1,942
大王製紙	29.9	29	40,310
阿波製紙	1.6	2	958
レンゴー	63	62.5	50,250
トーモク	3.7	4.1	6,929
ザ・パック	4.6	5	15,675
化学（7.4%）			
クラレ	96.3	104.8	112,869
旭化成	435.1	439.2	408,324
共和レザー	3.8	3.6	2,347
昭和電工	43.5	47.5	98,325
住友化学	481.2	488.4	178,266
住友精化	3	3	10,260
日産化学	37.1	36.8	199,456
ラサ工業	2.2	2.3	4,719
クレハ	5.7	5.7	27,388
多木化学	1.8	2.6	17,446
テイカ	5	4.9	7,026
石原産業	11.8	11.9	8,901
片倉コープアグリ	1.8	1.6	2,028
日本曹達	9.7	9.9	30,888
東ソー	94.5	102.5	179,887
トクヤマ	17.6	19.2	50,419
セントラル硝子	13.4	13.5	30,550
東亞合成	38.4	41.5	48,140
大阪ソーダ	6.8	6.7	17,641
関東電化	14.6	15.8	11,913
デンカ	24	24.2	78,892
信越化学	107.8	113.7	1,591,800
日本カーバイド	2.1	2.1	2,681
堺化学	4.1	4.3	8,793
第一稀元素化学工	6.6	7.1	5,360
エア・ウォーター	50.1	61.8	92,514
大陽日酸	50.4	63.7	106,570
日本化学工業	2.1	2.1	5,033
東邦アセチレン	0.9	0.8	1,008
日本パーカライジング	33.4	33.6	33,902
高圧ガス	9.7	10.6	9,094
チタン工業	0.8	0.9	1,528
四国化成	10.3	9.7	11,155
戸田工業	1.3	1.5	3,726
ステラ ケミファ	3.6	3.6	10,944
保土谷化学	2.1	2.5	12,125
日本触媒	10.3	10.2	58,956
大日精化	5.1	5.9	13,528
カネカ	15.8	17.2	51,531

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱瓦斯化学	62.1	61.8	122,858
三井化学	55.5	61.50004	161,806
ＪＳＲ	61.4	61.8	154,500
東京応化工業	10.5	11.4	61,104
大阪有機化学	5.6	6.1	17,037
三菱ケミカルHLDGS	408.7	442.5	289,041
ＫＨネオケム	10.8	11	27,071
ダイセル	90.2	86.7	70,313
住友ベークライト	10.6	10.5	30,922
積水化学	131.5	139.9	237,550
日本ゼオン	55.1	60.2	71,216
アイカ工業	18.4	19.9	75,520
宇部興産	30.8	33.4	63,059
積水樹脂	10.1	11.9	26,739
タキロンシーアイ	13.1	14	9,856
旭有機材	4.2	3.8	5,316
日立化成	28.3	—	—
ニチバン	3.2	3.5	6,121
リケンテクノス	16.7	16.6	6,839
大倉工業	2.9	3.1	4,839
積水化成品	9.1	8.9	5,366
群栄化学	1.6	1.4	3,710
タイガース ポリマー	3.1	3.4	1,472
ミライアル	1.8	2.3	2,688
ダイキアクシス	2.2	2.4	2,097
ダイキョーニシカワ	12.9	14.1	8,093
竹本容器	2.2	2.2	2,175
森六ホールディングス	3.3	3.6	6,595
日本化薬	37.9	41.4	41,565
カーリットホールディングス	6.5	6.9	3,677
日本精化	4.9	5.4	9,115
扶桑化学工業	6.2	6.7	24,388
トリケミカル	1.4	1.5	17,700
ＡＤＥＫＡ	30.1	30.5	48,708
日油	23	24.9	104,331
新日本理化	10.9	10.7	1,744
ハリマ化成グループ	5	5.5	6,044
花王	149.5	162	1,328,724
第一工業製薬	2.3	2.5	10,750
石原ケミカル	1.6	1.8	4,213
日華化学	2.1	2.2	2,065
ニイタカ	1	1.4	4,753
三洋化成	4.1	3.9	19,578
有機合成薬品	4.8	5.9	2,023
大日本塗料	6.9	7.5	7,710
日本ペイントHOLD	50.5	54.7	603,888
関西ペイント	68.8	74.5	196,680
神東塗料	5	6.8	1,169
中国塗料	20.1	18.8	19,401
日本特殊塗料	4.6	5	5,070
藤倉化成	8.2	8.9	5,028
太陽ホールディングス	5.1	4.9	27,391
ＤＩＣ	25.8	28.1	73,818
サカタインクス	13.4	14.6	15,023
東洋インキSCホールディン	12.9	13.9	27,494
Ｔ＆Ｋ ＴＯＫＡ	4.7	5.1	4,171
富士フイルムHLDGS	129.7	129.7	685,205
資生堂	124.1	134.5	835,245
ライオン	81.2	88	196,152
高砂香料	4.3	4.3	9,210
マンダム	14.1	15.3	28,029
ミルボン	8.3	9.1	52,598
ファンケル	27.8	27.5	91,437
コーセー	10.6	12.8	165,120
コタ	3.3	3.9	5,300
シーボン	0.8	0.8	1,565
ポーラ・オルビスHD	26.7	29.1	59,422
ノエビアホールディングス	6	5.8	30,624
アジュバンコスメジャパン	1.4	1.4	1,400
エステー	4.5	4.4	9,526
アグロカネショウ	2	2.7	4,533
コニシ	11	11.1	16,894
長谷川香料	8.3	11.7	24,382
星光ＰＭＣ	3.6	3.8	2,538
小林製薬	17.5	19	191,900
荒川化学工業	5.6	6.1	7,759
メック	4.3	4.6	8,740
日本高純度化学	1.7	1.8	4,914
タカラバイオ	16.4	17.8	52,332
ＪＣＵ	8.1	8.2	28,659
新田ゼラチン	4	4	2,896
ＯＡＴアグリオ	1	1.2	1,473
デクセリアルズ	16.2	17.6	20,380
アース製薬	4.7	4.8	37,680
北興化学	6.4	6.6	4,732
大成ラミック	2.1	2.2	6,263
クミアイ化学	25.9	28.1	30,348
日本農薬	11.2	12	6,132
アキレス	4.3	4.7	8,300
有沢製作所	9.9	10.7	10,336
日東電工	43.1	46.7	303,550
レック	6.7	7.2	12,168
三光合成	7.2	7.5	2,092
きもと	10.7	12.4	2,083
藤森工業	5.6	6.1	25,955
前澤化成工業	4.3	4.3	4,403
未来工業	3.4	3.5	7,290
ウェーブロックHLDGS	1.8	2.3	1,757
ジェイ エス ピー	3.7	4	6,320
エフピコ	6.9	7.5	64,050
天馬	4.2	4.5	8,050
信越ポリマー	11.2	12.2	10,931
東リ	15.6	16.8	4,586
ニフコ	25	25.1	71,258
バルカー	5.1	5.5	10,439
ユニ・チャーム	120.4	143.7	672,084
ショーエイコーポ	0.5	0.9	1,141
医薬品（6.5%）			
協和キリン	62.8	68	195,500
武田薬品	545.3	562.5	2,206,687
アステラス製薬	549.4	586.3	951,858
大日本住友製薬	46.3	50.2	69,426
塩野義製薬	79.8	85.1	490,941
田辺三菱製薬	65.4	—	—
わかもと製薬	7.5	8.5	2,405
あすか製薬	7.7	7.7	11,673
日本新薬	16.3	17.7	152,928
ビオフェルミン製薬	1.1	1.2	2,984
中外製薬	65.1	211.4	1,015,777
科研製薬	10.7	11.6	56,260
エーザイ	74.8	81	773,388
ロート製薬	32.1	34.7	125,440
小野薬品	147.5	155.3	521,808
久光製薬	18.5	17.9	97,376
持田製薬	9.4	9.3	37,432
参天製薬	116.3	126.1	267,458
扶桑薬品	2.2	2.4	6,960
日本ケミファ	0.8	0.9	2,302
ツムラ	19.4	21	68,985
日医工	16.5	19.2	23,347
キッセイ薬品工業	11	12	28,344
生化学工業	12.1	13.2	15,391
栄研化学	11	11.9	25,132
日水製薬	2.6	2.8	3,292
鳥居薬品	3.9	4.3	12,900
ＪＣＲファーマ	4.4	4.8	59,136
東和薬品	9	8.6	18,885
富士製薬工業	4.3	4.6	6,026
沢井製薬	12.8	13.9	78,535
ゼリア新薬工業	12.4	12.3	25,374
第一三共	178.7	193.5	1,888,947
キョーリン製薬ＨＤ	13.8	15	33,015
大幸薬品	2.8	8.3	19,828
ダイト	3.7	4.2	14,742
大塚ホールディングス	119	140.5	629,861
大正製薬ＨＤ	13.2	14.3	97,383
ペプチドリーム	31.6	34.4	149,640
石油・石炭製品（0.4%）			
日本コークス工業	52.6	56	3,416
ニチレキ	8	8	13,872
ユシロ化学	3.2	3.7	4,961
ビーピー・カストロール	2.2	2.4	2,844
富士石油	15.3	17.7	3,274
ＭＯＲＥＳＣＯ	2.3	2.3	2,217
出光興産	72.1	74.9	181,108
ENEOSホールディングス	1,033	1,014.5	406,814
コスモエネルギーHLDGS	18.1	19.7	31,382
ゴム製品（0.6%）			
横浜ゴム	36.1	39.4	60,715
TOYO TIRE	35.9	35.9	61,604
ブリヂストン	191.9	179.5	611,018
住友ゴム	56.1	61.2	58,507
藤倉コンポジット	5.5	6.2	2,256
オカモト	4.2	4.1	17,445
フコク	2.7	3	2,046
ニッタ	7	7.7	17,586
住友理工	12.1	13.3	7,368
三ツ星ベルト	8.2	9	15,219
バンドー化学	11.9	12	7,356
ガラス・土石製品（0.8%）			
日東紡績	9.3	10.1	45,399
ＡＧＣ	61.7	62.1	196,546
日本板硝子	30	32.3	13,113
石塚硝子	1.1	1.2	2,306
日本山村硝子	2.6	2.8	2,632
日本電気硝子	25.1	25.5	52,530
オハラ	2.5	2.7	3,369
住友大阪セメント	12.6	12.8	46,208
太平洋セメント	39.5	43	120,357
日本ヒューム	6.2	6.7	5,366
日本コンクリート	13.4	14.6	4,745
三谷セキサン	2.9	3.1	18,321
アジアパイルＨＤ	8.9	9.6	4,684
東海カーボン	65.4	66.3	75,117
日本カーボン	3.2	3.5	13,510
東洋炭素	3.7	4	7,200
ノリタケ	3.7	3.8	13,224
ＴＯＴＯ	48.1	48.3	232,564
日本碍子	76.3	81.6	119,788
日本特殊陶業	52.7	51.6	96,234
ダントーホールディングス	4.9	6.3	2,979
ＭＡＲＵＷＡ	2.2	2.6	24,206
品川リフラクトリーズ	1.6	1.7	4,217
黒崎播磨	1.2	1.3	3,854
ヨータイ	5.5	5.3	3,927
イソライト	3.2	3.4	1,577
東京窯業	8	8.4	2,788
ニッカトー	2.8	3	2,160
フジミインコーポレーテッド	5.6	6.1	22,753
クニミネ工業	2.8	2.8	3,021
エーアンドエーマテリアル	1.2	1.1	1,221
ニチアス	17.1	18.6	46,481
ニチハ	8.7	9.5	30,162
鉄鋼（0.6%）			
日本製鉄	286.9	299.9	310,396
神戸製鋼所	113.2	123.2	51,128
中山製鋼所	8.5	8.7	3,079
合同製鐵	3	3.6	7,527
ＪＦＥホールディングス	166.8	181.8	142,349
東京製鐵	33.1	32.6	23,635
共英製鋼	7	7.6	10,678
大和工業	13.1	14.2	37,843
東京鐵鋼	2.5	2.7	4,625
大阪製鐵	4.1	3.6	3,898
淀川製鋼所	8.3	8.9	16,438
丸一鋼管	21.9	21.7	61,736
モリ工業	1.9	2	5,126
大同特殊鋼	10.1	11.1	37,018
日本高周波	2.2	2.4	837
日本冶金工	51.2	5.5	8,926
山陽特殊製鋼	7.8	4.6	4,531
愛知製鋼	3.5	3.6	9,270
日立金属	66.5	72.1	118,532
日本金属	1.5	1.6	979
大平洋金属	4.2	4.5	7,533
新日本電工	40	43.6	9,635
栗本鉄工所	3.1	3.3	6,649
虹技	0.9	1	1,398
日本鋳鉄管	0.6	0.8	999
三菱製鋼	4.6	4.9	2,881
日亜鋼業	9	9.6	3,014
日本精線	0.9	1.1	3,784
エンビプロＨＤ	2.3	3	1,737
シンニッタン	9.6	10.4	2,360
新家工業	1.4	1.5	1,699
非鉄金属（0.7%）			
大紀アルミニウム	10.1	11	6,259
日本軽金属ＨＤ	168.1	170.7	30,043
三井金属	16.7	18.2	48,029
東邦亜鉛	3.4	3.4	6,891
三菱マテリアル	40.8	44.2	96,488
住友鉱山	84.6	85.5	297,796
DOWAホールディングス	14.4	17	54,485
古河機金	10.2	12	13,884
エス・サイエンス	27.6	37.6	1,729
大阪チタニウム	7.2	6.9	6,285

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東邦チタニウム	11.1	12	8,208
ＵＡＣＪ	9.4	10.2	18,961
ＣＫサンエツ	1.2	1.4	5,236
古河電工	17.8	20.9	53,065
住友電工	230.7	250.1	307,623
フジクラ	74.8	81.2	24,847
昭和電線 HLDGS	7.2	7.8	9,336
東京特殊電線	0.8	1	2,418
タツタ電線	12.2	13.3	8,485
カナレ電気	1.1	1.1	1,958
平河ヒューテック	2.6	3.3	3,333
リョービ	7.6	8.3	10,184
アーレステイ	7.6	8.6	2,881
アサヒＨＤ	11.6	11.8	42,598
金属製品（0.6%）			
稲葉製作所	3.5	3.7	5,076
宮地エンジニアリングＧ	1.9	2	3,350
トーカロ	16	18.7	20,570
アルファ CO	2.2	2.2	2,206
ＳＵＭＣＯ	74	80.1	117,106
川田テクノロジーズ	1.4	1.4	6,888
RS TECHNOLOGIES	1.7	1.9	6,574
信和	3.3	3.6	2,566
東洋製罐グループ HD	39.3	42.9	45,988
ホッカンホールディングス	3.1	3.7	5,472
コロナ	3.4	3.4	3,525
横河ブリッジ HLDGS	11.5	12.5	24,562
駒井ハルテック	1.2	1.2	1,878
高田機工	0.6	0.6	1,512
三和ホールディングス	63.8	63.4	74,558
文化シヤッター	18.2	19.8	16,394
三協立山	8.6	8.7	9,204
アルインコ	4.9	4.9	4,797
東洋シヤッター	1.5	1.7	1,324
ＬＩＸＩＬグループ	91.2	98.8	205,701
日本フイルコン	4.7	5	2,895
ノーリツ	12.8	14	20,678
長府製作所	6.3	6.8	14,558
リンナイ	11	13.1	131,917
ダイニチ工業	3.3	3.5	2,628
日東精工	8.5	9.2	4,462
三洋工業	0.8	0.8	1,574
岡部	12.5	13.7	10,946
ジーテクト	6.8	8.4	10,180
中国工業	1	—	—
東プレ	11.5	12.6	14,956
高周波熱錬	11.9	12.9	6,669
東京製綱	3.8	4.7	2,655
サンコール	3.5	4.9	2,200
モリテックスチル	4.8	5.4	1,598
パイオラックス	9.9	9.9	15,206
エイチワン	6.1	6.4	3,699
日本発条	61.6	72	48,816
中央発條	0.7	0.7	2,096
アドバネクス	0.8	0.9	1,480
立川ブラインド	2.7	3	4,005
三益半導体	5.4	5.3	13,515
機械（5.4%）			
日本ドライケミカル	1.7	1.7	2,660
日本製鋼所	18.8	20.4	36,393
三浦工業	26.7	28.9	137,853
タクマ	22.5	22.7	40,360
ツガミ	13.9	13.9	16,624
オークマ	7.9	7.9	40,764
芝浦機械	7	7.6	17,343
アマダ	92.7	83.3	85,299
アイダエンジニア	16.7	17.7	12,797
滝澤鉄工所	1.9	2	2,138
ＦＵＪＩ	24.7	29	60,929
牧野フライス	7.2	7.9	31,323
オーエスジー	28.5	31.2	52,135
ダイジェット	0.7	0.7	996
旭ダイヤモンド	16.2	17.6	9,028
DMG 森精機	39.1	42.6	64,965
ソディツク	14.5	15.4	11,550
ディスコ	8.4	9.1	233,688
日東工器	3.4	3.7	7,758
日進工具	1.8	2.6	5,933
パンチ工業	4.3	5.9	2,430
冨士ダイス	2.7	2.9	1,980
豊和工業	3.4	3.9	3,295
ＯＫＫ	2.5	2.7	1,055

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
石川製作所	1.5	1.7	3,150
東洋機械金属	4.4	4.6	1,913
津田駒工業	1.2	1.2	994
エンシュウ	1.6	1.5	1,408
島精機製作所	8.5	10.6	17,511
オプトラン	6.9	7.5	16,282
NC ホールディングス	2	2	1,250
イワキポンプ	2.6	4.2	3,960
フリュー	5	6.5	7,618
ヤマシンフィルタ	10.8	14.6	15,607
日阪製作所	7.6	8.4	7,266
やまびこ	12	13	16,146
平田機工	2.9	3.2	20,192
ペガサスミシン製造	5.8	6.6	1,980
マルマエ	2.5	2.7	2,648
タツモ	2.9	3.1	4,603
ナブテスコ	36.4	39.5	149,112
三井海洋開発	6.6	7.1	11,984
レオン自動機	6.1	6.6	7,253
ＳＭＣ	18.3	21.2	1,232,144
ヤマハモーターロボ HLDGS	4.7	—	—
ホソカワミクロン	2.2	2.4	13,848
ユニオンツール	2.3	2.5	7,800
オイレス工業	8.7	8.8	13,340
日精エーエスビー	2.1	2	8,280
サトーホールディングス	7.5	9.6	20,976
技研製作所	5.4	5.9	23,423
日本エアーテック	1.9	2.3	3,148
カワタ	1.7	1.9	1,749
日精樹脂工業	5.2	5.6	4,950
オカダアイヨン	2.1	2	2,042
ワイエイシイホールディングス	2.5	2.8	1,887
小松製作所	282.8	306.9	728,734
住友重機械	35.7	39	98,046
日立建機	25	27.3	100,600
日工	1.7	9.2	6,624
巴工業	2.7	2.7	5,305
井関農機	6.3	6.8	9,329
ＴＯＷＡ	5.4	6.8	7,969
丸山製作所	1.3	1.8	2,530
北川鉄工所	2.8	3	4,587
ローツェ	2.7	3	14,985
タカキタ	2.2	2.5	1,890
クボタ	334.7	359	660,201
荏原実業	1.6	1.7	5,064
三菱化工機	2.2	2.3	4,291
月島機械	12.4	12.6	16,972
帝国電機製作所	4.4	5.6	6,244
東京機械	2.4	3.1	892
新東工業	14.8	16.2	11,842
渋谷工業	5.4	5.9	21,210
アイチ コーポレーション	10.8	11.8	10,407
小森コーポレーション	15.8	17.3	12,888
鶴見製作所	4.9	5.1	9,154
住友精密	1	1	2,387
日本ギア工業	1.7	2.4	715
酒井重工業	1.2	1.2	2,880
荏原製作所	27.7	28.1	80,815
石井鉄工所	0.9	0.9	2,460
酉島製作所	6.4	6.8	5,650
北越工業	6.4	7	7,665
ダイキン工業	85.3	86.2	1,682,624
オルガノ	2.2	2.4	13,512
トーヨーカネツ	2.4	3	6,777
栗田工業	33.8	36.7	130,468
椿本チエイン	8.2	9.8	24,705
大同工業	3	3.2	1,955
木村化工機	5.2	5.7	2,473
アネスト岩田	9.7	10.6	8,882
ダイフク	34.4	34.7	352,552
サムコ	1.7	1.9	5,403
加藤製作所	3.2	3.7	4,184
油研工業	1	1.1	1,714
タダノ	30.2	32.8	27,552
フジテック	22.7	24.8	57,982
ＣＫＤ	17.4	18.7	30,686
キトー	4.7	5.2	6,323
平和	17.4	18.7	34,426
理想科学工業	5.5	6	8,622
ＳＡＮＫＹＯ	15.6	15	43,410
日本金銭機械	6.9	7.3	4,255
マースグループ HLDGS	4	4.2	7,614

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フクシマガリレイ	3.9	4.2	16,380
オーイズミ	2.6	2.8	1,097
ダイコク電機	2.9	3.1	3,369
竹内製作所	10.5	11.4	23,541
アマノ	17.9	17.8	43,823
ＪＵＫＩ	8.7	9.3	4,268
サンデンホールディングス	7.7	9	2,934
蛇の目ミシン	5.8	6	3,882
マックス	9.5	10.4	16,296
グローリー	17.4	17.5	41,982
新晃工業	5.8	6.3	9,519
大和冷機工業	9	9.8	9,163
セガサミーホールディングス	61.9	67.1	89,108
日本ピストンリング	2.3	2.4	2,496
リケン	2.9	3.1	7,967
ＴＰＲ	8.4	9.1	11,884
ツバキ・ナカシマ	12.8	13.8	11,095
ホシザキ	18.3	19.9	166,762
大豊工業	5.1	5.4	3,083
日本精工	128.4	128.4	107,984
ＮＴＮ	134.6	157.3	33,033
ジェイテクト	59.9	65.5	55,413
不二越	5.8	6.4	23,712
日本トムソン	18.6	19.9	7,800
ＴＨＫ	36.3	39.6	105,296
ユーシン精機	4.8	5.3	3,826
前澤給装工業	2.4	2.4	4,977
イーグル工業	7.7	8.5	6,936
前澤工業	4.2	4	1,904
日本ピラー工業	6.3	6.8	10,750
キッツ	25.4	27.7	17,063
マキタ	76	88.2	441,000
日立造船	49.6	53.6	24,012
三菱重工業	104.7	113.9	281,219
ＩＨＩ	48	49.1	71,980
スター精密	9.8	10.5	14,952
電気機器（15.3%）			
日清紡ホールディングス	41.7	42.4	31,248
イビデン	38.3	41.5	150,852
コニカミノルタ	136.7	148.9	44,967
ブラザー工業	81.5	83.1	140,937
ミネベアミツミ	115.9	125.9	254,443
日立	281.1	325	1,198,925
三菱電機	624.6	676.1	993,867
富士電機	40.5	41	139,400
東洋電機製造	2.5	2.4	2,784
安川電機	72.4	72.9	290,506
シンフォニア テクノロジー	8.7	8.8	9,952
明電舎	12.4	12.5	20,850
オリジン	1.7	1.8	2,419
山洋電気	3	3.3	16,269
デンヨー	5.7	5.8	14,436
東芝テック	7.8	8.5	38,292
芝浦メカトロニクス	1.1	1.2	3,780
マブチモーター	17.3	18.8	76,892
日本電産	75.2	162.7	1,576,237
ユーエムシーエレクトロニクス	3.4	4.2	1,465
トレックス・セミコンダクター	2.8	3.9	4,722
東光高岳	3.2	3.7	3,999
ダブル・スコープ	8.6	10.7	9,983
宮越ホールディングス	2.3	2.7	1,965
ダイヘン	6.8	7.5	32,137
ヤーマン	9.1	11.1	18,625
ＪＶＣケンウッド	47.8	55.1	8,430
ミマキエンジニアリング	5.6	6	2,616
Ｉ－ＰＥＸ	2.3	2.8	6,344
日新電機	14.6	16	17,552
大崎電気	12.4	13.3	8,126
オムロン	66.4	60.6	488,436
日東工業	10	10	20,860
ＩＤＥＣ	8.4	9.8	19,208
正興電機製作所	1.4	1.8	1,927
不二電機工業	0.7	1	1,321
ジーエス・ユアサ コーポ	22.5	22.7	41,858
サクサホールディングス	1.6	1.5	2,238
メルコホールディングス	2.6	2.3	5,708
テクノメディカ	1.4	1.5	2,766
ダイヤモンドエレクトリクHD	—	1.4	1,062
日本電気	80.9	82	484,620
富士通	60.2	65.2	937,576
沖電気	27.1	27.7	29,472
岩崎通信機	2.9	2.9	2,438

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
電気興業	3.3	3.3	8,844
サンケン電気	7.3	7.4	17,826
ナカヨ	1.2	1.3	1,898
アイホン	3.5	3.8	5,779
ルネサスエレクトロニクス	297.4	290.1	221,346
セイコーエプソン	77.6	84.4	104,571
ワコム	45.3	45.8	32,609
アルバック	12.5	12.5	48,187
アクセル	2.6	2.7	2,451
ＥＩＺＯ	5.7	5.3	21,094
ジャパンディスプレイ	61.7	61.7	3,640
日本信号	15.9	17.4	18,200
京三製作所	13.4	15.8	7,710
能美防災	8.2	9	20,448
ホーチキ	4	4.9	6,389
星和電機	3.3	3.5	2,124
エレコム	5.9	7.6	38,760
パナソニック	714.1	773.4	716,477
シャープ	62.1	78.8	103,779
アンリツ	40.2	43.6	98,318
富士通ゼネラル	19.1	18.5	55,500
ソニー	419.2	423.6	3,475,214
ＴＤＫ	32.7	32.7	381,282
帝国通信工業	2.7	3	3,690
タムラ製作所	24.1	22.7	12,189
アルプスアルパイン	65.1	60.3	92,078
池上通信機	2	2.1	1,785
日本電波工業	5.7	6.3	2,299
鈴木	3.3	3.3	2,303
日本トリム	1.2	0.9	3,384
ローランド ディー．ジー．	3.4	3.7	4,787
フオスター電機	7.1	7.1	8,165
ＳＭＫ	1.7	1.7	4,571
ヨコオ	4.5	4.4	11,932
ティアック	4.5	4.9	622
ホシデン	18.3	18.6	18,283
ヒロセ電機	8.9	10.4	139,984
日本航空電子	14.3	15.6	23,181
ＴＯＡ	6.7	7.3	6,059
マクセルホールディングス	13.5	14.6	15,943
古野電気	8	8.7	8,813
ユニデンホールディングス	1.8	1.9	2,998
スミダコーポレーション	4.8	5.2	3,790
アイコム	3.4	3.8	10,400
リオン	2.9	2.8	6,711
本多通信工業	5.3	5.8	2,917
船井電機	6.3	6.8	3,209
横河電機	62.5	62.5	104,812
新電元工業	2.2	2.4	4,663
アズビル	39.4	42.9	154,225
東亜ディーケーケー	3.1	3.3	3,026
日本光電工業	27.5	28	94,920
チノー	2.2	2.3	3,171
共和電業	6.5	6.9	3,070
日本電子材料	2.5	2.7	5,470
堀場製作所	12.4	13.5	74,655
アドバンテスト	42.6	50.5	263,610
小野測器	2.6	2.7	1,455
エスペック	5.5	6	11,118
キーエンス	30.7	61.3	2,838,803
日置電機	3.3	3.3	12,771
シスメックス	48.7	48.3	482,661
日本マイクロニクス	10.9	11.8	13,263
メガチップス	4.9	6.3	17,268
OBARA GROUP	3.2	4	14,800
澤藤電機	0.8	0.9	1,822
原田工業	2.5	3.2	2,921
コーセル	7.6	9	9,990
イリソ電子工業	5.7	5.7	24,225
オプテックスグループ	10.3	11.2	17,248
千代田インテグレ	2.9	2.9	4,787
アイ・オー・データ	2.3	2.3	2,472
レーザーテック	12.8	29.8	255,982
スタンレー電気	44.1	47.5	142,975
岩崎電気	2.4	2.6	3,926
ウシオ電機	36.3	37.6	49,707
岡谷電機	4.5	5.2	1,877
ヘリオステクノＨ	5.8	6.3	2,060
エノモト	1.7	2	2,114
日本セラミック	6.3	6.9	18,471
遠藤照明	3.2	3.3	2,194
古河電池	4.5	4.8	5,059

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
双信電機	3	3.3	1,428
山一電機	4.5	4.9	6,561
図研	4.1	4.4	12,826
日本電子	12.3	13.4	46,766
カシオ	55.4	60.3	100,881
ファナック	59.3	63.6	1,298,712
日本シイエムケイ	15.9	15.9	7,997
エンプラス	2.8	3.5	7,801
大真空	2.3	2.5	4,642
ローム	29.9	28.2	223,062
浜松ホトニクス	44.8	48.5	253,655
三井ハイテック	6.9	7.5	15,615
新光電気工業	21	22.9	40,304
京セラ	95.2	95	585,865
太陽誘電	27.8	30.2	98,603
村田製作所	196.6	198.6	1,353,856
双葉電子工業	9.9	10.8	10,292
北陸電気工業	2.3	2.7	2,632
ニチコン	19.7	23.1	19,011
日本ケミコン	4.4	5.1	7,282
ＫＯＡ	9.4	10.2	11,169
市光工業	9.4	10.2	4,661
小糸製作所	37.4	40.6	222,082
ミツバ	11.5	12.4	4,836
SCREEN ホールディングス	10.9	11.8	65,254
キヤノン電子	6.5	6.1	8,869
キヤノン	336.4	336.3	579,781
リコー	188.2	173.2	123,664
象印マホービン	18.3	18.4	31,960
MUTOH ホールディングス	0.9	1	1,508
東京エレクトロン	41.6	43	1,157,560
輸送用機器（7.0%）			
トヨタ紡織	21.8	19.8	29,403
芦森工業	1.3	1.3	1,147
ユニプレス	12.1	13.2	11,576
豊田自動織機	50.6	54.8	356,748
モリタホールディングス	10.9	12	23,808
三桜工業	8	8.6	5,056
デンソー	137.5	148.8	681,504
東海理化電機	16.3	18	28,530
三井 E&SHD	21.7	21.7	8,680
川崎重工業	48.7	53	78,599
名村造船所	18.9	22.2	3,663
サノヤスホールディングス	8.3	9.4	1,569
日本車輌	2.3	2.5	7,107
三菱ロジスネクスト	10.3	9	8,577
近畿車輌	1	1	1,357
日産自動車	736.8	799.9	297,562
いすゞ自動車	197.5	196.8	186,763
トヨタ自動車	695.9	754.3	5,341,198
日野自動車	78	85.1	55,995
三菱自動車工業	231.5	252.4	58,809
エフテック	4.4	4.8	2,404
レシップホールディングス	2.5	2.6	1,591
ＧＭＢ	1.2	1.5	972
ファルテック	1.1	1.4	869
武蔵精密工業	15.2	15.1	15,251
日産車体	12.2	13.3	11,890
新明和工業	26.1	18.3	16,817
極東開発工業	12.4	12.6	17,110
日信工業	11.4	13.3	29,845
トピー工業	5.2	5.6	6,580
ティラド	2.3	2.4	3,232
タチエス	10.3	11.1	10,545
ＮＯＫ	33.6	36.6	41,065
フタバ産業	17.4	18.9	10,017
ＫＹＢ	6.5	7.6	15,944
大同メタル工業	10.2	13.1	6,916
プレス工業	30.9	33.6	9,710
ミクニ	7.9	8.4	2,335
太平洋工業	13.1	14.3	14,085
ケーヒン	14.3	15	38,880
河西工業	7.7	9.2	3,192
アイシン精機	51.4	55.7	183,253
マツダ	196	200.4	126,252
今仙電機製作所	5.7	6.1	4,135
本田技研	526.8	532.4	1,352,029
スズキ	114.3	134.2	556,661
SUBARU	193.9	210.2	434,693
安永	3	3.3	3,857
ヤマハ発動機	81.4	88.9	139,839
ショーワ	14.7	15.4	35,312

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＴＢＫ	7.4	7.9	3,713
エクセディ	8.5	9.3	12,582
豊田合成	20.2	22	51,348
愛三工業	9.8	10.6	5,035
盟和産業	1	1	1,003
日本プラスト	4.9	5	2,105
ヨロズ	5.9	6.4	6,502
エフ・シー・シー	11.2	11.2	21,716
シマノ	23.4	25.3	540,155
テイ・エス テック	14.5	15.7	48,277
ジャムコ	3.1	3.3	2,240
精密機器（2.7%）			
テルモ	176.7	191.4	793,353
クリエートメディック	2.1	2.1	2,192
日機装	18.7	20.4	22,664
日本エム・ディ・エム	3.6	3.9	8,634
島津製作所	80.4	80.9	264,543
ＪＭＳ	5.7	5.7	5,118
クボテック	1.3	1.9	651
長野計器	4.9	5	4,420
ブイ・テクノロジー	2.9	3.2	13,776
東京計器	4	4.2	3,960
愛知時計	0.8	0.9	3,861
インターアクション	3.4	3.6	7,232
オーバル	6.1	6.4	1,529
東京精密	11.3	12.4	41,230
マニー	24.9	27	76,680
ニコン	108.8	104.1	74,639
トプコン	33.6	34.3	32,447
オリンパス	372.2	374.2	778,710
理研計器	5.5	6	17,346
タムロン	5	5.5	9,097
ＨＯＹＡ	125.7	134.1	1,568,299
シード	2.7	2.9	2,108
ノーリツ鋼機	4.9	4.6	7,732
エー・アンド・デイ	5.7	6.1	4,080
朝日インテック	53	76.6	236,311
シチズン時計	68.5	79.6	24,755
リズム時計	2.1	2.1	1,352
大研医器	5	5.1	2,866
メニコン	8.6	9.6	67,488
シンシア	0.7	0.9	366
松風	3	3	4,443
セイコーＨＤ	9.7	9.6	14,371
ニプロ	43.3	46.9	58,484
その他製品（2.8%）			
中本パックス	1.7	1.6	2,537
スノーピーク	2.8	3.5	6,636
パラマウントベッド HD	7.2	7.1	30,814
トランザクション	4	4.4	5,064
粧美堂	1.8	2	804
ニホンフラッシュ	2.7	6.3	8,820
前田工繊	6.9	7.5	20,115
永大産業	8.3	8.6	2,812
アートネイチャー	6.6	7.2	4,795
バンダイナムコ HLDGS	64.6	69.9	507,334
アイフィスジャパン	1.5	1.8	1,405
共立印刷	10.4	11.3	1,536
ＳＨＯＥＩ	3	6	21,330
フランスベッド HLDGS	8.8	9.2	8,040
パイロットコーポレーション	10.9	11.1	34,687
萩原工業	3.5	3.7	5,920
トッパン・フォームズ	13.4	14.6	14,278
フジシールインターナショナル	14	15.3	30,171
タカラトミー	26.2	30.5	27,694
廣済堂	5.8	4.9	3,371
エステールホールディングス	1.6	2	1,370
アーク	23.8	—	—
タカノ	2.5	2.6	1,682
プロネクサス	5.4	5.8	6,623
ホクシン	3.7	5.7	684
ウッドワン	2.1	2.4	3,129
大建工業	4.7	4.6	8,109
凸版印刷	92.8	95.9	152,097
大日本印刷	88	88.8	196,248
共同印刷	1.9	2.1	5,619
ＮＩＳＳＨＡ	12.9	13.9	18,334
光村印刷	0.5	0.6	989
TAKARA & COMPANY	3	3.3	7,477
アシックス	51.6	56.2	78,904
ツツミ	2	2.1	4,819
小松ウオール工業	1.9	1.9	3,515

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ヤマハ	37.2	40.3	205,530
河合楽器	1.9	2.1	5,833
クリナップ	5.8	6.3	3,263
ピジョン	37.7	41.2	191,580
オリバー	—	1.4	3,570
兼松サステック	0.4	0.4	643
キングジム	5.2	5.7	5,124
リンテック	14.8	16.1	40,121
イトーキ	11.7	14.4	5,241
任天堂	35.7	41.5	2,507,430
三菱鉛筆	10.3	11.3	15,390
タカラスタンダード	12.9	13.7	18,878
コクヨ	29.9	32.3	42,409
ナカバヤシ	6.1	6.6	4,375
グローブライド	3	3	9,555
オカムラ	21.8	23.5	17,883
美津濃	6.2	6.2	12,108
電気・ガス業（1.4%）			
東京電力ＨＤ	498.4	542	162,600
中部電力	191	205.8	277,109
関西電力	254.8	255.9	270,486
中国電力	86.3	97.1	131,279
北陸電力	61.4	62.2	48,578
東北電力	146.4	168.3	183,278
四国電力	56.3	61.1	50,163
九州電力	128.8	139.3	135,121
北海道電力	58.5	63.7	28,728
沖縄電力	11.6	13.2	22,440
電源開発	49.7	54	90,180
エフオン	3	3.7	2,390
イーレックス	10.9	9.7	10,456
レノバ	10.3	11.3	12,181
東京瓦斯	120.1	130.1	313,931
大阪瓦斯	121.1	131.5	273,914
東邦瓦斯	31	33.3	169,164
北海道瓦斯	3.3	3.6	5,677
広島ガス	12.8	13	4,836
西部瓦斯	7	7.6	20,474
静岡ガス	17.7	19.3	17,543
メタウォーター	3	3.3	14,998
陸運業（3.8%）			
SBS ホールディングス	5.4	5.1	10,980
東武鉄道	65.9	70.4	237,600
相鉄ホールディングス	21.5	21.6	63,504
東急	169.7	170.5	244,838
京浜急行	85.6	87.1	145,805
小田急電鉄	100.1	100.5	269,239
京王電鉄	34.9	35.1	231,309
京成電鉄	46.8	47.1	145,303
富士急行	8.5	9.3	36,688
新京成電鉄	1.6	1.7	4,301
東日本旅客鉄道	109.9	119	815,150
西日本旅客鉄道	55.6	60.4	342,468
東海旅客鉄道	55.9	56.2	904,258
西武ホールディングス	77.4	88.9	115,214
鴻池運輸	9.9	10.9	12,774
西日本鉄道	17.4	18.8	61,194
ハマキョウレックス	4.8	5.2	17,134
サカイ引越センター	3.3	3.6	18,216
近鉄グループ HLDGS	59.2	64.1	307,039
阪急阪神 HLDGS	78.9	85.4	303,597
南海電鉄	26.5	30.5	73,383
京阪ホールディングス	26.3	28.5	128,962
神戸電鉄	1.5	1.5	5,835
名古屋鉄道	48.6	52.4	156,571
山陽電鉄	4.6	4.7	10,711
日本通運	22.8	22.2	138,306
ヤマトホールディングス	103.8	112.3	303,883
山九	16.4	17.8	80,100
丸運	3.2	3.5	850
丸全昭和運輸	4.8	5.2	17,732
センコーグループ HLDGS	32.6	34.9	34,341
トナミホールディングス	1.4	1.5	9,210
ニッコンホールディングス	22.4	22.9	54,387
日石輸送	0.7	0.6	1,589
福山通運	7.6	8.2	43,214
セイノーホールディングス	44.3	47.9	76,448
エスライン	1.8	1.7	1,659
神奈川中央交通	1.5	1.5	6,322
日立物流	13	11.7	43,816
丸和運輸機関	3.1	6.8	27,676
C&F ロジホールディングス	6	6.5	11,433

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
九州旅客鉄道	49.6	56.3	130,672
SG ホールディングス	55.9	67.2	324,912
海運業（0.2%）			
日本郵船	49.5	53.7	101,224
商船三井	35.1	40.7	91,859
川崎汽船	18.3	19.8	25,047
NS ユナイテッド海運	3.3	3.6	5,198
明治海運	6.3	6.6	2,402
飯野海運	28.1	30.2	11,264
共栄タンカー	0.5	1.2	927
乾汽船	5.3	3.7	3,293
空運業（0.4%）			
日本航空	108.2	113.5	238,123
ANA ホールディングス	108	117.3	326,563
パスコ	1.1	1.3	1,820
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
トランコム	1.7	1.8	13,680
日新	5.1	5.6	9,066
三菱倉庫	20.5	20.4	62,118
三井倉庫 HOLD	7.3	7.4	14,326
住友倉庫	21.7	23	31,418
渋沢倉庫	3.2	3.5	8,155
東陽倉庫	10.7	11.3	3,966
日本トランスシティ	13	13.8	7,948
ケイヒン	1.1	0.9	1,255
中央倉庫	3.6	3.9	4,602
川西倉庫	1.2	1.1	1,257
安田倉庫	4.8	5.1	4,845
ファイズホールディングス	1.1	1.4	1,614
東洋埠頭	1.8	2	2,938
宇徳	5	5.5	2,722
上組	36.4	35.7	77,076
サンリツ	1.4	1.5	948
キムラユニティー	1.6	1.6	1,772
キユーソー流通システム	1.5	1.6	2,483
近鉄エクスプレス	11.2	13.7	30,277
東海運	3.4	3.6	1,076
エーアイテイー	3.8	4.5	4,824
内外トランスライン	2.1	2.1	2,608
日本コンセプト	1.9	2	2,958
情報・通信業（9.8%）			
NEC ネッツエスアイ	6.8	18.9	39,123
クロスキャット	1.6	1.8	2,606
システナ	21.9	23.7	45,551
デジタルアーツ	3.3	3.3	27,390
日鉄ソリューションズ	9.2	9.9	31,680
キューブシステム	3.3	3.5	4,721
エイジア	1.2	1.4	3,221
コア	2.6	2.8	3,911
ラクーンホールディングス	3	3.2	6,723
ソリトンシステムズ	2.7	3.1	6,590
ソフトクリエイト HD	2.7	2.9	7,911
ＴＩＳ	20.4	66.3	148,445
JNS ホールディングス	2.5	2.8	2,200
電算システム	2.3	2.5	9,087
グリー	42.5	40.9	19,386
コーエーテクモＨＤ	12.5	13.6	66,640
三菱総合研究所	2.6	2.9	12,948
ボルテージ	1.2	1.9	1,046
電算	0.7	0.7	1,649
ＡＧＳ	3.5	3.7	3,426
ファインデックス	5.2	5.7	7,717
ブレインパッド	1.2	1.7	7,539
ＫＬａｂ	11.8	12.6	11,793
ポールトゥウィン・ピットクル	8.2	8	7,664
イーブックイニシアティブ	1	0.9	2,952
ネクソン	173.9	167.2	448,096
アイスタイル	15.8	18.4	5,704
エムアップホールディングス	2.1	1.9	6,213
エイチーム	4.3	4.5	3,681
エニグモ	4.4	6.3	11,176
テクノスジャパン	5.2	5.3	5,146
ｅｎｉｓｈ	2.7	3.5	2,152
コロプラ	20.1	21.9	20,148
オルトプラス	4.1	4.6	2,451
ブロードリーフ	30.4	32.9	18,226
クロス・マーケティング G	2.6	3.2	1,190
デジタルハーツ HLDGS	2.8	3.7	3,992
システム情報	3.1	4.9	7,021
メディアドゥ	2.2	2.1	16,296
じげん	8.7	16.5	5,709
ブイキューブ	3.3	3.7	6,626

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エンカレッジ・テクノロジ	0.8	1.3	1,171
サイバーリンクス	0.9	1.2	2,826
ディー・エル・イー	4.3	4.3	1,913
フィックスターズ	6.5	7.1	7,533
CARTA HOLDINGS	3	3.1	3,822
オプティム	2.7	3.5	11,200
セレス	2	2.3	5,207
ＳＨＩＦＴ	—	2.7	41,175
ティーガイア	4.4	5.9	11,918
セック	1	1	3,185
日本アジアグループ	6.5	7.3	2,292
豆蔵ホールディングス	4.2	—	—
テクマトリックス	4.3	9.4	21,507
プロシップ	1.8	1.9	3,045
ガンホー・オンライン・エンター	14.8	16.1	37,657
GMO ペイメントゲートウェイ	10.1	14.1	152,985
ザッパラス	3	2.9	1,374
システムリサーチ	0.8	1.8	3,367
インターネットイニシアティブ	10	9.9	47,421
さくらインターネット	7.3	7	5,670
ヴィンクス	1.7	1.9	2,490
GMO グローバルサインHD	1.1	1.2	11,196
SRA ホールディングス	3.3	3.6	8,636
MINORI ソリューションズ	1.2	—	—
システムインテグレータ	1.7	2.3	1,676
朝日ネット	4.9	4.7	4,601
ｅＢＡＳＥ	3.7	8	10,992
アバント	2.2	6.3	6,652
アドソル日進	2.2	2.4	6,230
フリービット	3.7	3.7	3,378
コムチュア	3.4	7.5	20,325
サイバーコム	1.1	1.2	2,275
アステリア	4.1	4.4	3,603
アイル	1	3.7	5,646
マークラインズ	3.1	3.2	7,228
メディカル・データ・ビジ	4.7	5	10,260
ｇｕｍｉ	7.9	8.6	8,892
ショーケース	1.3	1.6	1,684
モバイルファクトリー	1.4	1.6	2,089
テラスカイ	1	2.4	11,808
デジタル・インフォメーション	2.7	2.9	3,888
PCI ホールディングス	1.3	2.8	3,628
パイプドＨＤ	1	0.9	1,699
アイビーシー	1.1	1.4	1,562
ネオジャパン	1.2	1.2	2,571
ＰＲ ＴＩＭＥＳ	0.5	1.2	3,012
ランドコンピュータ	0.9	1	1,071
ダブルスタンダード	0.5	0.9	4,527
オープンドア	3	3.4	4,804
マイネット	2	2.1	3,047
アカツキ	2.2	2.4	10,752
ベネフィットジャパン	0.4	0.5	956
UBICOM ホールディングス	1.1	1.6	3,648
LINE	14.1	20.4	109,344
カナミックネットワーク	3.7	6	4,860
ノムラシステムコーポレーション	1.4	3.6	1,544
チェンジ	1.2	4.6	52,486
シンクロ・フード	2.6	2.7	909
オークネット	3.4	3.6	4,752
セグエグループ	0.2	1.3	1,950
エイトレッド	0.7	1.1	2,538
AOI TYO HOLDINGS	6.2	6.7	2,793
マクロミル	10.9	13.5	10,827
ビーグリー	1.3	1.3	2,635
オロ	1.6	1.7	5,788
ユーザーローカル	—	0.6	2,643
テモナ	0.8	1.3	1,765
ニーズウェル	0.4	1	880
サインポスト	0.9	1.3	1,790
ソルクシーズ	2.6	3	3,438
フェイス	2.4	2.3	2,490
プロトコーポレーション	5.5	6	7,536
ハイマックス	0.7	0.8	1,908
野村総合研究所	116.9	94	301,740
サイバネットシステム	4.4	5.1	4,523
ＣＥホールディングス	1.8	4	2,704
日本システム技術	1	1.2	2,260
インテージホールディングス	7.7	8.4	7,946
東邦システムサイエンス	1.8	1.7	1,666
ソースネクスト	23.8	31.6	10,870
インフォコム	6.7	7.3	29,455
ＨＥＲＯＺ	—	0.9	3,415

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ラクスル	—	5.3	23,505
ＦＩＧ	6.4	7.7	2,094
システムサポート	—	1.4	2,499
イーソル	—	3.1	3,785
アルテリア・ネットワークス	6.8	7.4	13,423
東海ソフト	—	0.4	538
ヒト・コミュニケーションズHD	1.4	1.6	2,121
トビラシステムズ	—	0.8	1,659
フォーカスシステムズ	4.2	4.2	4,288
クレスコ	1.9	4	5,280
フジ・メディア・HD	63.6	64.4	67,620
オービック	21.3	23	431,020
ジャストシステム	8.7	10.8	79,920
ＴＤＣソフト	5.4	5.9	6,254
Ｚホールディングス	399.9	912.6	629,694
トレンドマイクロ	27.3	35.5	229,685
IDホールディングス	2.4	2.5	3,750
日本オラクル	12.4	13.4	172,458
アルファシステムズ	1.9	2.1	7,980
フューチャー	7.4	8	18,384
CAC HOLDINGS	4	4.4	6,384
ＳＢテクノロジー	2.6	2.4	8,724
トーセ	1.7	1.8	1,632
オービックビジネスＣ	6.3	6.8	41,344
伊藤忠テクノソリュー	27.9	30.1	122,657
アイティフォー	7.5	8.1	7,209
東計電算	0.9	1	4,800
エックスネット	1.1	1.1	1,105
大塚商会	33.2	35.9	198,527
サイボウズ	7.2	7.8	27,378
ソフトブレーン	3.6	4.1	3,558
電通国際情報Ｓ	3.8	4.1	26,445
ＡＣＣＥＳＳ	—	6.1	5,581
デジタルガレージ	12	12	41,520
イーエムシステムズ	5	9.3	8,184
ウェザーニューズ	2.1	2.3	14,513
ＣＩＪ	4.6	4.8	4,497
ビジネスエンジニアリング	0.6	0.8	3,040
日本エンタープライズ	6.1	7.3	2,219
WOWOW	2.9	3.2	8,963
スカラ	4.3	4.6	4,204
インテリジェント ウェイブ	2.3	3.7	3,156
IMAGICA GROUP	5.1	5.7	2,205
ネットワンシステムズ	21.7	25.3	122,325
システムソフト	14.5	22.4	2,396
アルゴグラフィックス	5.2	5.7	20,548
マーベラス	9.4	10	8,060
エイベックス	10.5	11.5	11,557
日本ユニシス	19.1	20.7	69,448
兼松エレクトロニクス	3.3	3.6	15,408
東京放送ＨＤ	40.7	40.2	73,164
日本テレビHLDS	56.3	55.1	65,183
朝日放送グループHD	6	6.4	4,755
テレビ朝日ＨＤ	16.9	18.3	30,725
スカパー JSATHD	40.5	43.9	19,755
テレビ東京ＨＤ	5	5.5	12,919
日本ＢＳ放送	2	2.1	2,354
ビジョン	1.9	6.1	4,928
スマートバリュー	1.8	1.8	1,996
USEN—NEXT HLDGS	2.3	2.6	3,169
ワイヤレスゲート	2.7	3.2	2,384
コネクシオ	4.4	3.8	4,601
日本通信	53.8	51.7	11,839
クロップス	1.1	1.3	1,004
日本電信電話	419.2	886.5	1,985,316
ＫＤＤＩ	502.4	483.8	1,332,627
ソフトバンク	649.9	607.9	772,336
光通信	7.2	6.8	165,036
ＮＴＴドコモ	388	474.3	1,282,981
エムティーアイ	6	6.4	5,395
GMOインターネット	24.2	24	65,424
ファイバーゲート	1.2	2.1	3,885
アイドママーケティングコミュ	1.3	2.1	928
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	17.9	18	50,076
学研ホールディングス	2.1	8.9	14,498
ゼンリン	12.3	13.3	15,135
昭文社ホールディングス	2.7	3.1	1,556
インプレスホールディングス	4.9	5.3	911
アイネット	3.5	3.4	5,650
松竹	4.1	4.4	67,540
東宝	40.3	39.2	169,344
東映	2.6	2.5	44,475

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＮＴＴデータ	163.2	176.7	250,030
ピー・シー・エー	0.8	1.1	5,280
ビジネスＢ太田昭和	1.1	2.2	3,031
ＤＴＳ	13.7	14.9	33,972
スクウェア・エニックス・HD	28.5	28.3	195,553
シーイーシー	6.6	7.1	11,707
カプコン	26.3	31.3	184,983
アイ・エス・ビー	1.2	1.4	3,701
ジャステック	3.6	4.2	6,178
ＳＣＳＫ	16.2	15.3	90,423
日本システムウエア	2	2.2	4,494
アイネス	7.8	6.5	11,050
ＴＫＣ	5.2	5.6	37,352
富士ソフト	7.9	7.1	37,062
ＮＳＤ	10.1	21.3	43,004
コナミホールディングス	25	24.2	106,238
福井コンピュータHLDS	2	2.6	8,138
JBCCホールディングス	4.8	4.5	7,915
ミロク情報サービス	6.1	5.9	13,233
ソフトバンクグループ	486.3	526.6	3,357,075
卸売業（4.8%）			
ホウスイ	0.5	0.5	456
高千穂交易	2.4	2.5	2,517
カワニシホールディングス	—	0.7	989
伊藤忠食品	1.5	1.7	9,265
エレマテック	5.7	6.3	6,192
ＪＡＬＵＸ	1.7	1.8	2,869
あらた	4.5	5.3	27,878
トーメンデバイス	0.9	1	4,100
東京エレクトロンデバイス	2.2	2.4	7,716
フィールズ	5.4	4.9	1,631
双日	340	368.1	91,656
アルフレッサホールディングス	68.3	73.9	174,477
横浜冷凍	17.3	17.5	16,240
神栄	0.8	1	658
ラサ商事	3.3	3.4	3,134
アルコニックス	6.5	7.1	11,026
神戸物産	10.6	23	127,650
ハイパー	—	0.9	505
あい ホールディングス	8.8	9.5	18,012
ディーブイエックス	2.4	2.3	2,295
ダイワボウＨＤ	5.6	5.7	37,563
マクニカ・富士エレHLDGS	17.1	15.9	31,179
ラクト・ジャパン	2.3	2.5	9,287
バイタルＫＳＫ HD	11.5	11.5	12,650
八洲電機	4.9	5.1	5,181
メディアスホールディングス	3.5	3.7	3,304
レスターホールディングス	6.8	7	15,295
ジューテックＨＤ	1.4	1.3	1,339
大光	2.6	2.8	1,954
OCHIホールディングス	1.8	1.9	3,100
TOKAIホールディングス	32.5	34.9	37,343
黒谷	1.4	1.6	814
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1.1	1.1	796
三洋貿易	3.1	6.7	6,787
ビューティガレージ	1	1.1	3,001
ウイン・パートナーズ	4	4.8	4,785
ミタチ産業	1.8	2	1,244
シップヘルスケアHD	12.8	10.7	55,640
明治電機工業	1.9	2	2,840
デリカフーズHLDGS	2.2	2.2	1,507
スターティアホールディングス	1.2	1.7	1,247
コメダホールディングス	14.3	14.6	28,236
ピーバンドットコム	—	0.6	582
アセンテック	—	1.4	3,176
富士興産	2.4	2.2	1,480
協栄産業	0.7	0.7	924
小野建	5.5	5.5	6,242
南陽	1.3	1.4	2,452
佐鳥電機	4.5	4.5	3,784
エコートレーディング	1.5	1.5	879
伯東	4.2	4.1	4,809
コンドーテック	4.7	5.2	6,708
中山福	3.5	3.7	1,794
ナガイレーベン	8.9	8.9	24,964
三菱食品	6.7	7.4	20,757
松田産業	4.5	4.9	7,428
第一興商	9.1	10	34,250
メディパルHD	66.3	71.5	151,866
ＳＰＫ	1.3	2.8	4,090
萩原電気HLDGS	2.3	2.5	5,480
アズワン	4.4	4.4	65,780

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スズデン	2.1	2.3	2,787
尾家産業	2	1.9	3,135
シモジマ	3.8	4.1	5,936
ドウシシャ	5.8	6.3	13,230
小津産業	1.4	1.5	2,757
高速	3.7	4	7,044
たけびし	2.1	2.4	3,674
リックス	1.4	1.5	2,473
丸文	5.4	5.6	2,788
ハピネット	5.1	5.5	7,243
橋本総業HLDGS	1.2	1.3	3,247
日本ライフライン	18.2	19.9	28,238
タカショー	3	3.9	2,577
エクセル	2.3	—	—
マルカ	2.2	2.3	4,908
ＩＤＯＭ	20.8	18	11,448
進和	3.6	4	8,696
エスケイジャパン	1.5	1.6	513
ダイトロン	2.6	2.8	4,239
シークス	7.8	8.5	10,506
田中商事	2.1	2.1	1,575
オーハシテクニカ	3.5	3.5	4,987
白銅	2	2.3	2,996
ダイコー通産	—	0.4	546
伊藤忠	430.1	465.8	1,286,306
丸紅	606.5	693.5	438,361
高島	1	1	1,909
長瀬産業	34.5	37.3	58,598
蝶理	3.9	4.3	6,957
豊田通商	68.7	74.5	226,107
三共生興	10.5	10	4,250
兼松	24.6	25	32,925
ツカモトコーポレーション	1.1	1.3	1,675
三井物産	506.7	577	1,089,087
日本紙パルプ	3.5	3.8	14,231
日立ハイテク	18.7	—	—
カメイ	8	8.6	9,546
東都水産	0.9	0.8	2,936
OUGホールディングス	1	1.1	3,126
スターゼン	2.3	2.5	10,250
山善	24	26.2	27,955
椿本興業	1.4	1.2	4,338
住友商事	363.8	420.5	552,957
内田洋行	2.6	2.7	13,932
三菱商事	431.6	436.9	1,145,333
第一実業	2.8	3.3	12,622
キヤノンマーケティングJPN	17.6	16.7	33,433
西華産業	3.5	3.7	5,246
佐藤商事	5.5	5.6	5,768
菱洋エレクトロ	6.2	6.8	19,788
東京産業	6.1	6	3,198
ユアサ商事	6.3	6.4	21,248
神鋼商事	1.4	1.6	2,780
トルク	3.7	3.9	1,189
阪和興業	10.7	12.5	27,950
正栄食品	4	4.3	19,113
カナデン	5.6	5.4	8,218
菱電商事	4.9	4.8	7,171
フルサト工業	3.4	3.4	4,947
岩谷産業	13.6	14.9	60,047
ナイス	2.5	2.5	3,715
昭光通商	2.1	2.3	1,389
ニチモウ	1	1	2,017
極東貿易	1.9	1.9	2,728
イワキ	8.1	8.7	4,454
三愛石油	16.5	16.5	16,252
稲畑産業	14.8	14.8	20,453
ＧＳＩクレオス	1.6	1.6	2,867
明和産業	5.7	6.3	3,068
クワザワ	2.2	2.1	1,104
ヤマエ久野	—	4.9	6,188
ワキタ	13.1	14.2	14,484
東邦ホールディングス	18.2	21.1	48,846
サンゲツ	18.1	18.3	30,268
ミツウロコグループ	8.2	9.8	12,602
シナネンホールディングス	2.5	2.8	8,778
伊藤忠エネクス	13.5	14.1	13,944
サンリオ	19	18.8	36,716
サンワ テクノス	3.7	4.7	4,385
リョーサン	6.8	7.4	15,688
新光商事	5.8	10.3	9,259
トーホー	2.8	3	5,985

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三信電気	4.2	3.6	7,110
東陽テクニカ	7.1	7.6	7,676
モスフード サービス	8.1	8.8	27,060
加賀電子	6.1	6.7	14,746
ソーダニッカ	6.4	6.8	3,774
立花エレテック	4.5	4.9	8,785
フオーバル	2.7	2.9	2,844
ＰＡＬＴＡＣ	11.1	10.7	59,920
三谷産業	7.2	8.7	3,497
太平洋興発	2.4	2.6	1,645
西本 WISMETTAC HD	1.1	1.2	2,268
ヤマシタヘルスケア HLDGS	0.5	0.7	1,055
国際紙パルプ商事	14.4	15.9	4,801
ヤマタネ	3.1	3.3	4,362
丸紅建材リース	0.6	0.7	1,220
日鉄物産	4.4	4.7	14,899
泉州電業	1.9	2	6,240
トラスコ中山	12.8	14	36,316
オートバックスセブン	24.5	24.6	34,759
モリト	4.5	4.9	3,537
加藤産業	9.6	9.7	35,744
北恵	1.2	1.6	1,769
イノテック	3.7	3.9	4,130
イエローハット	11.6	12.6	21,835
JK ホールディングス	5.6	6	4,812
日伝	5.1	6.1	14,249
北沢産業	4.6	5.2	1,466
杉本商事	3.3	3.5	6,751
因幡電機産業	8.7	19.1	51,608
東テク	2	2.2	5,440
ミスミグループ本社	77.1	83.6	255,398
アルテック	4.5	5.6	1,506
タキヒヨー	1.9	2	3,688
蔵王産業	1	1	1,482
スズケン	28	28.1	115,772
ジェコス	4.2	4.6	4,328
グローセル	5.6	6.7	2,747
小売業（5.0%）			
ローソン	15.6	16.9	85,683
サンエー	4.6	5.5	25,795
カワチ薬品	4.8	5.2	15,449
エービーシー・マート	9.6	10.4	56,160
ハードオフコーポレーション	2.4	2.5	1,657
アスクル	6.4	7	30,520
ゲオホールディングス	9.4	11.9	20,111
アダストリア	8.5	9.3	15,084
ジーフット	3.8	4.4	2,283
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	0.8	1	450
くら寿司	3.2	3.5	19,810
キャンドゥ	2.9	3.2	6,908
パルグループ HLDGS	3.1	6.9	7,776
エディオン	26.1	30.8	34,742
サーラコーポレーション	12.5	13.4	7,825
ワッツ	2.8	2.8	2,674
ハローズ	2.3	2.5	11,000
フジオフード G 本社	2.6	5.7	7,991
あみやき亭	1.3	1.4	4,197
ひらまつ	12.4	11.8	2,773
大黒天物産	1.5	1.6	9,344
ハニーズホールディングス	5.4	5.8	5,834
ファーマライズ HD	1.4	1.5	1,192
アルペン	4.7	5.1	10,072
ハブ	2	1.9	1,318
クオールホールディングス	9.1	9.8	12,259
ジンズホールディングス	3.3	3.6	30,420
ビックカメラ	36.5	39.8	44,814
DCM ホールディングス	33.2	37.3	56,882
ペッパーフードサービス	4.9	5.7	2,034
ＭｏｎｏｔａＲＯ	43.7	47.5	239,400
東京一番フーズ	1.6	1.5	877
DD ホールディングス	2.7	2.7	2,025
きちりホールディングス	1.6	1.7	1,089
アークランドサービス HD	4.5	4.9	10,353
J. フロント リテイリング	78.7	79.8	56,179
ドトール・日レスＨＤ	10.8	9.7	16,121
マツモトキヨシ HLDGS	25.4	27.5	104,225
ブロンコビリー	3.2	3.5	8,326
ＺＯＺＯ	66.5	45.9	133,385
トレジャー・ファクトリー	1.8	2	1,556
物語コーポレーション	1.5	1.8	17,802
ココカラファイン	6.9	6.9	46,023
三越伊勢丹ＨＤ	115.2	117.3	64,866
Ｈａｍｅｅ	1.9	2.4	5,608
ウエルシアＨＤ	16.3	39.6	180,576
クリエイトＳＤＨ	9.1	11.2	42,056
丸善 CHI HD	7.2	5.6	2,156
ミサワ	1.1	1.6	1,132
ティーライフ	0.8	0.9	1,146
エー・ピーカンパニー	1.1	1.5	655
チムニー	1.9	2	2,864
シュッピン	4.2	4.6	3,850
オイシックス・ラ・大地	—	6.6	21,615
ネクステージ	8.8	9.6	11,260
ジョイフル本田	18	19.6	33,084
鳥貴族	2	2.3	3,452
キリン堂ホールディングス	2.4	2.6	9,113
ホットランド	3.7	4.5	5,368
すかいらーく HD	69	74.9	114,597
SFP ホールディングス	2.6	3.8	5,380
綿半ホールディングス	2.3	2.5	8,112
ヨシックス	1	1.1	1,992
ユナイテッド・スーパーマーケ	17.8	19.3	24,684
ゴルフダイジェスト・オン	2.5	2.9	1,954
ＢＥＥＮＯＳ	2.2	3	5,253
あさひ	5.1	5	9,515
日本調剤	2.2	4.1	7,002
コスモス薬品	2.7	5.9	106,436
トーエル	3	3.2	2,640
オンリー	1	1.1	563
セブン＆アイ・HLDGS	257.8	260.5	876,061
クリエイト・レストランツ・ホール	16.6	36.1	22,887
ツルハホールディングス	13.4	14.5	220,255
サンマルクホールディングス	4.9	5.3	8,442
フェリシモ	1.4	1.4	1,506
トリドールホールディングス	7.6	16.6	25,962
TOKYO BASE	5.6	6	2,406
ウイルプラス HLDGS	0.9	1.1	640
JM ホールディングス	3.1	5.1	15,555
サツドラホールディングス	0.9	0.9	1,854
デファクトスタンダード	0.5	—	—
アレンザホールディングス	3.3	3.3	5,613
串カツ田中 HLDGS	0.9	1.3	2,341
バロックジャパン	5	4.6	2,907
クスリのアオキ HLDGS	6.1	6	54,420
力の源 HD	2.3	3	2,022
スシローグローバル HLDGS	6.8	36.7	100,044
ＬＩＸＩＬビバ	5.2	—	—
メディカルシステムネットワーク	6.6	6.4	2,944
はるやま HLDGS	2.9	3.1	2,306
ノジマ	10.9	12	34,620
カッパ・クリエイト	8.7	9.4	15,604
ライトオン	4.7	4.9	2,729
ジーンズメイト	1.9	2.7	588
良品計画	87.2	88.9	156,375
三城ホールディングス	7.7	6.9	1,987
アドヴァン	9.4	10.3	13,688
アルビス	2.3	2.5	6,912
コナカ	7.3	7.7	2,209
ハウス ローゼ	0.8	0.8	1,312
G―7ホールディングス	1.8	3.9	10,553
イオン北海道	6	8.5	7,165
コジマ	10.6	11.4	5,871
ヒマラヤ	2.2	2.2	2,074
コーナン商事	8.1	9.5	38,380
エコス	2.3	2.4	5,260
ワタミ	8.1	7.9	8,413
マルシェ	1.5	1.5	903
パンパシフィック HD	147.4	146.4	341,404
西松屋チェーン	13.6	14.7	19,992
ゼンショーホールディングス	29.9	32	82,304
幸楽苑ホールディングス	3.9	4.2	7,501
ハークスレイ	1.3	1.3	1,290
サイゼリヤ	10.2	10	21,620
ＶＴホールディングス	27.8	27.6	11,785
魚力	1.7	1.9	3,608
ポプラ	1.6	1.8	759
フジ・コーポレーション	1.6	1.8	4,140
ユナイテッドアローズ	7.1	7	11,032
ハイデイ日高	8.9	9.7	18,362
京都きもの友禅	4	3.9	889
コロワイド	20.5	22.3	44,087
ピーシーデポコーポ	8.2	8.8	5,825
壱番屋	4.3	4.7	26,508
トップカルチャー	2.2	2.4	974
ＰＬＡＮＴ	1.6	1.6	1,406
スギホールディングス	13.5	13.3	100,548
薬王堂ホールディングス	2.7	2.9	7,299
ヴィア・ホールディングス	7.6	8.1	2,770
スクロール	9.5	10.1	9,079
ヨンドシーホールディングス	6.8	6.8	12,478
ファミリーマート	68.8	53.2	124,488
木曽路	7.6	8.8	23,205
SRS ホールディングス	7.3	8.1	8,075
千趣会	11.2	12.2	5,124
タカキユー	4.8	6.1	841
リテールパートナーズ	—	8.9	16,251
ケーヨー	11.4	13.7	13,549
上新電機	7.3	7.9	19,726
日本瓦斯	9.7	10.6	47,912
ロイヤルホールディングス	10.8	11.7	22,581
東天紅	0.5	0.5	500
いなげや	6.9	8.2	16,596
島忠	13	12.5	42,250
チヨダ	6.5	7.1	6,830
ライフコーポレーション	4.7	5.1	24,709
リンガーハツト	7.6	8.3	21,920
ＭｒＭａｘＨＤ	8.4	9.2	8,445
テンアライド	5.6	5.9	2,460
AOKI ホールディングス	12.3	13.5	7,735
オークワ	8.8	10.5	15,519
コメリ	9.5	10.3	34,659
青山商事	10.8	13.8	7,921
しまむら	7.2	7.8	69,810
はせがわ	3.1	3.4	1,098
高島屋	48.3	48.9	40,440
松屋	12.4	13.5	10,138
エイチ・ツー・オーリテイリング	31.6	31.8	23,373
近鉄百貨店	2.3	2.6	8,398
パルコ	5.9	—	—
丸井グループ	52.1	61.2	120,380
アクシアル リテイリング	5.1	5.5	27,032
井筒屋	3.3	4	696
イオン	236.7	256.1	724,506
イズミ	12.5	13.7	52,471
平和堂	12.5	13.4	29,681
フジ	7.4	8.1	15,260
ヤオコー	7	7.6	60,420
ゼビオホールディングス	7.4	8	6,320
ケーズホールディングス	64	64.4	90,417
OLYMPIC グループ	3.6	3.4	3,515
日産東京販売ＨＤ	9	9.7	2,473
シルバーライフ	—	0.9	1,798
一家ダイニングプロジ	—	0.5	306
GENKY DRUGSTORES	3	2.9	10,802
ナルミヤ・インターナショナル	—	1.4	814
総合メディカルＨＤ	5.4	—	—
ブックオフＧＨＤ	3.2	3.9	3,584
アインホールディングス	8.3	8.2	59,286
元気寿司	1.7	1.7	4,285
ヤマダ電機	187.6	203.4	107,191
アークランドサカモト	10.4	10.5	23,436
ニトリホールディングス	26.6	28.8	624,240
グルメ杵屋	4.4	4.7	5,029
愛眼	5	5.4	1,258
ケーユーホールディングス	3.1	2.9	2,372
吉野家ホールディングス	21.5	22	44,858
松屋フーズ HLDGS	3	3.2	11,952
サガミホールディングス	8.3	8.9	12,922
関西スーパーマーケット	4.6	5.5	7,315
王将フードサービス	4.5	4.9	29,988
プレナス	6.9	7.2	13,017
ミニストップ	4.6	5	7,620
アークス	11.5	13.6	36,529
バローホールディングス	13.3	14.7	43,129
藤久	0.5	0.6	1,164
ベルク	3	3.3	25,113
大庄	3.3	3.5	4,445
ファーストリテイリング	8.2	8.9	575,118
サンドラッグ	23.2	25.1	101,027
サックスバーホールディング	5.2	5.5	3,129
ヤマザワ	1.3	1.4	2,520
やまや	1	1.3	3,000
ベルーナ	15.1	14.4	13,737
銀行業（4.9%）			
島根銀行	1.4	1.5	1,045
じもとホールディングス	42.1	45	5,355

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
めぶきフィナンシャルＧ	319.6	346	83,386
東京きらぼしFG	8.4	9	10,692
九州フィナンシャルＧ	101.2	146.2	71,491
ゆうちょ銀行	174.3	187.6	156,833
富山第一銀行	14.8	15.7	4,772
コンコルディア・フィナンシャル	386.4	380.6	147,292
西日本フィナンシャルHD	38.9	44.6	33,316
関西みらいFG	28.8	39.5	17,459
33ＦＧ	5.3	6.2	8,698
第四北越フィナンシャルＧ	10.7	11.7	26,442
新生銀行	45.3	49.1	65,843
あおぞら銀行	34.5	40	71,440
三菱UFJフィナンシャルＧ	4,240.3	4,562.2	2,006,911
りそなホールディングス	676	725.8	281,392
三井住友トラストHD	121.1	126	379,134
三井住友フィナンシャルＧ	434.1	461	1,417,114
千葉銀行	211.9	222.5	133,055
群馬銀行	123.3	128	46,336
武蔵野銀行	9.2	10	16,760
千葉興業銀行	17.1	18	4,716
筑波銀行	25.9	28.1	5,901
七十七銀行	19.3	22.7	37,500
青森銀行	4.8	5.2	13,150
秋田銀行	4	4.3	7,082
山形銀行	6.9	7.5	10,140
岩手銀行	4.3	4.4	11,242
東邦銀行	55.3	59.7	13,850
東北銀行	3.2	3.1	3,565
みちのく銀行	4	4.4	5,627
ふくおかフィナンシャルＧ	54.3	56.3	107,138
静岡銀行	152.5	162.2	121,650
十六銀行	8.3	8.4	17,035
スルガ銀行	60.5	63	24,759
八十二銀行	148.8	161	67,781
山梨中央銀行	7.5	7.8	6,614
大垣共立銀行	13	13.2	31,257
福井銀行	5.3	5.7	10,009
北國銀行	6.4	6.7	20,602
清水銀行	2.6	2.7	5,211
富山銀行	1.2	1.3	4,095
滋賀銀行	12.4	13.4	34,143
南都銀行	9.6	11.2	22,635
百五銀行	55.6	59.5	19,337
京都銀行	22.1	23.9	121,890
紀陽銀行	21.8	23.7	37,943
ほくほくフィナンシャルＧ	41.1	44.5	48,416
広島銀行	91	99	59,499
山陰合同銀行	36.6	39.9	22,942
中国銀行	53.1	57.5	58,880
鳥取銀行	2.1	2.2	2,763
伊予銀行	81.6	95.1	68,186
百十四銀行	6.6	7.1	12,865
四国銀行	8.8	10.2	7,690
阿波銀行	9.4	10.9	28,209
大分銀行	3.8	3.9	9,344
宮崎銀行	4.1	4.5	11,011
佐賀銀行	3.8	4	5,512
沖縄銀行	5.6	6.1	19,489
琉球銀行	14.2	15.5	14,337
セブン銀行	205.9	223	58,203
みずほフィナンシャルＧ	8,369.9	9,059.1	1,255,591
高知銀行	2.3	2.5	2,055
山口フィナンシャルＧ	76.8	83.5	59,285
長野銀行	2	2.1	2,971
名古屋銀行	5	5.1	12,591
北洋銀行	93.2	101.3	23,602
愛知銀行	2.2	2.4	7,860
中京銀行	2.5	2.7	5,526
大光銀行	2.1	2.2	3,187
愛媛銀行	8.6	9	10,683
トマト銀行	2.4	2.5	2,925
京葉銀行	26.1	28.5	14,250
栃木銀行	32.3	31.6	6,098
北日本銀行	1.9	2	3,934
東和銀行	10.9	11.7	8,903
福島銀行	5.4	7.3	1,832
大東銀行	3	3.3	2,260
トモニホールディングス	47.5	51.8	17,663
フィデアホール	60.4	64.4	7,470
池田泉州ＨＤ	65.9	76.9	14,226
証券、商品先物取引業（0.8%）			
ＦＰＧ	19.4	20.6	12,463

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
マーキュリアインベストメント	2.6	2.8	1,775
SBIホールディングス	73.4	74.6	204,478
日本アジア投資	5.2	6.3	1,493
ジャフコ	10.1	10.3	43,929
大和証券Ｇ本社	494.3	534.4	247,961
野村ホールディングス	1,084	1,174.1	586,462
岡三証券グループ	52.6	57.3	20,398
丸三証券	18.4	19.7	9,416
東洋証券	22.4	24.3	2,745
東海東京ＨＤ	71	76.9	21,532
光世証券	1.5	1.8	1,087
水戸証券	18	19.1	4,125
いちよし証券	12.3	12.2	5,990
松井証券	30.2	37.7	36,003
だいこう証券ビジ	2.5	—	—
マネックスＧ	56.9	50	13,200
極東証券	8.3	8.7	5,211
岩井コスモホールディング	6.2	6.3	8,019
藍澤證券	11	12	8,280
マネーパートナーズGP	7.3	6.6	1,405
スパークス・グループ	24.4	30.8	6,406
小林洋行	1.9	2.8	742
保険業（1.9%）			
かんぽ生命保険	21.9	23.5	39,973
SOMPOホールディングス	108.6	125.4	475,266
アニコム ホールディングス	5.1	5.5	23,320
ＭＳ＆ＡＤ	161	174.3	516,363
ＳＯＮＹ ＦＨ	50.6	—	—
第一生命HLDGS	348.6	377.8	575,200
東京海上ＨＤ	220.3	235.9	1,144,822
T&Dホールディングス	190.6	199.7	218,072
アドバンスクリエイト	1.4	1.6	3,659
その他金融業（1.2%）			
全国保証	17.4	18.9	75,033
ジェイリース	1.7	2.5	1,385
イントラスト	1.7	2.5	2,162
日本モーゲージサービス	1.1	2.8	3,180
Ｃａｓａ	2.8	2.3	2,831
アルヒ	5.6	10.7	18,981
プレミアグループ	3.5	3.6	7,617
クレディセゾン	43.2	47	52,734
芙蓉総合リース	7	7	49,420
みずほリース	11.6	10.2	28,141
東京センチュリー	12.4	13.4	77,854
日本証券金融	27.2	29.5	15,428
アイフル	94.3	102	28,050
リコーリース	4.8	5.2	14,840
イオンフィナンシャルサービス	39.4	41.1	39,086
アコム	124.1	133.9	61,058
ジャックス	6.8	7.4	13,009
オリコ	167.3	181.6	20,702
日立キャピタル	14.5	15.8	40,953
アプラスフィナンシャル	29.8	34.1	2,523
オリックス	410.8	413.9	572,423
三菱ＵＦＪリース	138.9	168.4	88,410
九州 リースサービス	3	2.9	1,856
日本取引所グループ	166.4	191.3	554,770
イー・ギャランティ	5.8	7.2	16,992
アサックス	2.6	3.5	2,660
NECキャピタルソリューション	2.5	2.7	5,105
不動産業（2.0%）			
いちご	78.5	85.5	26,248
日本駐車場開発	67.8	69.7	9,200
スター・マイカ・HLDGS	—	3.3	4,204
ADワークスグループ	—	14.9	2,339
ヒューリック	131.6	141.5	139,943
三栄建築設計	2.4	2.7	3,855
野村不動産HLDGS	41	40.5	84,159
三重交通グループHD	12.5	13.3	6,410
サムティ	8.7	9.5	14,449
エー・ディー・ワークス	191.5	—	—
日本商業開発	3.9	4.5	7,654
プレサンスコーポレーション	9.8	11.1	16,006
ユニゾホールディングス	9.4	—	—
ハウスコム	—	0.9	1,192
日本管理センター	4.1	3.9	5,073
サンセイランディック	1.8	2.5	1,837
エストラスト	0.9	1.4	932
フージャースHD	13.4	13.3	8,778
オープンハウス	8.9	19.5	71,955
東急不動産ＨＤ	165.8	181.9	86,220
飯田ＧＨＤ	51.3	55.5	120,157

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
イーグランド	0.9	1	795
ビーロット	1.4	3.4	2,410
ファーストブラザーズ	1.4	1.5	1,383
ハウスドゥ	3.4	3.5	3,899
シーアールイー	1.5	1.8	2,626
プロパティエージェント	0.8	1.1	1,499
ケイアイスター不動産	1.7	2.2	5,863
アグレ都市デザイン	1	1.7	1,064
ジェイ・エス・ビー	0.7	1.3	3,898
テンポイノベーション	0.7	1.7	1,269
グロバルリンクマネジメント	0.9	1.4	932
パーク24	33.1	36	67,428
パラカ	1.6	1.7	3,065
三井不動産	326.8	329	641,221
三菱地所	431.6	467.2	756,163
平和不動産	11.3	12.2	34,599
東京建物	67.4	66.1	85,930
ダイビル	18.2	17	20,706
京阪神ビルディング	10.8	10.5	17,713
住友不動産	138.5	149.9	469,486
テーオーシー	14.1	12.9	8,668
東京楽天地	0.9	1.2	5,382
スターツコーポレーション	8.3	9	20,871
フジ住宅	7.9	7.7	4,158
空港施設	7.2	6.8	3,141
明和地所	3.4	4.2	2,184
ゴールドクレスト	4.8	5	7,015
エスリード	2.3	2.7	3,680
日神グループHLDGS	8.9	10.3	4,356
日本エスコン	11.1	12.2	10,309
タカラレーベン	28.2	30.2	9,905
ＡＶＡＮＴＩＡ	3.5	3.8	3,040
イオンモール	30.9	33.4	49,999
毎日コムネット	1.3	2	1,622
ファースト住建	2.6	2.9	3,007
ランド	255.5	378.1	3,402
カチタス	6.9	16.6	47,907
トーセイ	8.5	9.4	8,939
穴吹興産	0.7	1.5	2,338
サンフロンティア不動産	8.5	9.5	8,236
インテリックス	1.8	2.8	1,338
ランドビジネス	2.6	2.6	988
サンネクスタグループ	1.6	1.9	1,922
グランディハウス	5.4	5.3	2,040
日本空港ビルデング	19.7	21.4	100,473
サービス業（5.7%）			
日本工営	4	4.4	12,821
ＬＩＦＵＬＬ	20.9	22.6	10,689
ミクシィ	—	12.4	33,033
ジェイエイシーリクルートメント	4	4.3	5,774
日本Ｍ＆Ａセンター	45.1	49.2	281,916
メンバーズ	2	1.9	3,361
中広	0.5	0.6	310
ＵＴグループ	—	10.2	34,833
アイティメディア	1.1	2.6	6,814
タケエイ	6.2	6.2	6,355
Ｅ・Ｊホールディングス	0.7	1.2	3,151
ビーネックスグループ	6.6	8.1	9,396
コシダカホールディングス	14.4	15.5	6,711
アルトナー	1.4	1.8	1,614
パソナグループ	7.3	7	10,927
ＣＤＳ	1.5	1.6	2,180
リンクアンドモチベーション	13.2	13.7	5,671
ＧＣＡ	7.1	7.8	5,171
エス・エム・エス	22	20.2	59,590
サニーサイドアップＧ	1.3	2.1	1,493
パーソルホールディングス	59.7	65.1	113,143
リニカル	3.4	3.2	2,726
クックパッド	19.1	22.4	8,512
エスクリ	1.6	2	760
アイ・ケイ・ケイ	2.9	3.1	1,940
学情	2.1	2.4	2,688
スタジオアリス	3	3.2	5,296
シミックホールディングス	3.3	3.6	4,975
エプコ	—	1.3	1,309
ＮＪＳ	1.3	1.4	2,696
綜合警備保障	23.7	25.9	133,385
カカクコム	44.7	48	128,544
アイロムグループ	2.3	2.4	5,064
セントケア・ホールディング	4.4	4	3,196
サイネックス	0.9	1.1	966
ルネサンス	3.3	3.5	3,405

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
ディップ	9.6	9.1	19,292
デジタルホールディングス	3.3	3.5	4,812
新日本科学	8.1	7.1	5,609
ツクイ	14.1	15.2	9,591
キャリアデザインセンター	1.5	1.7	1,761
ベネフィット・ワン	16.4	23.7	62,212
エムスリー	125.7	142.6	934,030
ツカダ・グローバルHOLD	3.8	4	1,220
ブラス	0.6	0.7	337
アウトソーシング	34.2	37.1	34,132
ウェルネット	5.7	6.6	3,801
ワールドホールディングス	1.9	2.3	4,652
ディー・エヌ・エー	32.2	27.5	51,700
博報堂ＤＹ HLDGS	82.9	90.5	130,410
ぐるなび	8.5	11.3	8,271
タカミヤ	6.3	6.7	3,805
ジャパンベストレスキューS	4	5	5,140
ファンコミュニケーションズ	16.5	18	8,604
ライク	2.4	2.3	4,229
ビジネス・ブレークスルー	2.5	3.2	1,222
エスプール	2.3	16.6	13,246
WDBホールディングス	2.7	3	9,210
手間いらず	—	0.4	2,212
ティア	3.5	3.6	1,602
ＣＤＧ	0.5	0.7	1,239
バリューコマース	3.4	3.6	12,798
インフォマート	32.7	65.6	63,566
JPホールディングス	17.1	20.2	6,443
エコナックホールディングス	10.8	13.5	1,309
EPSホールディングス	9	9	9,603
レッグス	1.5	1.7	1,878
プレステージ・インター	11.2	24.3	22,356
アミューズ	3.6	3.5	8,736
ドリームインキュベータ	1.8	1.9	2,882
クイック	3.7	3.9	4,761
ＴＡＣ	3.1	4.4	1,003
ケネディクス	56.8	56.8	30,558
電通グループ	61.5	67.1	214,720
テイクアンドギヴニーズ	2.3	2.4	1,552
ぴあ	1.7	1.8	6,255
イオンファンタジー	1.9	2.5	4,262
シーティーエス	6.7	7.3	6,920
ネクシィーズグループ	2.1	2.4	2,702
ＨＵグループＨＤ	16.7	18.2	52,179
アルプス技研	5.3	5.7	11,496
サニックス	10.6	11.4	2,964
ダイオーズ	1.4	1.2	1,252
日本空調サービス	6.8	6.8	5,066
オリエンタルランド	70.5	68.7	1,039,431
ダスキン	15.3	16.2	47,320
明光ネットワークジャパン	7.1	8.1	6,050
ファルコホールディングス	3.3	3.5	5,579
秀英予備校	1.4	1.4	641
田谷	1.2	1.2	705
ラウンドワン	18.5	18.1	15,004
リゾートトラスト	25.3	29.8	48,425
ビー・エム・エル	7.7	8.3	26,186
ワタベウェディング	1	1	396
りらいあコミュニケーショ	10.8	11.7	15,783
リソー教育	30.3	29.6	8,495
早稲田アカデミー	1.7	2.8	2,844
ユー・エス・エス	72.9	72.9	139,239
東京個別指導学院	2.1	2.3	1,271
サイバーエージェント	34.3	39.9	248,178
楽天	278.3	301.7	368,074
クリーク・アンド・リバー社	3.5	3.4	4,576
テー・オー・ダブリュー	5.2	10.4	3,421
山田コンサルティングGP	2.9	4.1	4,858
セントラルスポーツ	2.2	2.4	6,060
フルキャストホールディングス	6	6.2	10,558
エン・ジャパン	8.7	11.5	33,154
リソルホールディングス	0.7	0.7	2,646
テクノプロ・ホールディング	12	13	82,160
アトラ	1.2	1.7	448
インターワークス	1.1	1.6	548
アイ・アールジャパンHD	2.4	2.6	31,590
ＫｅｅＰｅｒ技研	2.2	2.4	7,392
ファーストロジック	1.4	1.4	1,054
三機サービス	1.3	1.3	1,440
Ｇｕｎｏｓｙ	4.2	4	3,796
デザインワン・ジャパン	1.2	1.5	412
イー・ガーディアン	3.1	3.2	10,240
リブセンス	3.3	4.5	1,296
ジャパンマテリアル	16.3	20	30,260
ベクトル	7.5	8.2	8,979
ウチヤマホールディングス	3	3.2	1,024
チャームケアコーポレーション	1.9	5.5	6,391
ライクキッズ	1.4	—	—
キャリアリンク	2.2	2.4	2,560
ＩＢＪ	4	4.5	4,972
アサンテ	2.4	2.7	4,422
Ｎ・フィールド	4	4.3	2,992
バリューＨＲ	1.2	2.6	4,173
M&Aキャピタルパートナー	2.1	5.3	22,313
ライドオンエクスプレスHD	2.5	2.5	6,362
ERIホールディングス	1.7	1.8	1,170
アビスト	0.9	0.9	2,911
シグマクシス	2.9	4.4	7,427
ウィルグループ	3.9	4.3	3,766
エスクローＡＪ	8.3	9	3,366
リクルートホールディングス	427.5	463.1	1,986,699
エラン	3.5	3.8	9,526
土木管理総合試験	2.6	2.9	1,107
ネットマーケティング	2.1	2.3	1,536
日本郵政	489.1	527	391,877
ベルシステム24HLDGS	10	10.9	19,184
鎌倉新書	4.4	4.9	4,640
ＳＭＮ	0.7	1.3	1,198
一蔵	0.7	0.7	256
LITALICO	1.4	2.2	6,168
グローバルキッズCOMP	0.9	1	888
エアトリ	2.7	3.3	4,890
アトラエ	1.5	1.9	5,523
ストライク	2.3	2.4	13,104
ソラスト	14.6	18	23,814
セラク	1.9	2.2	4,543
インソース	2.9	2.8	7,848
ベイカレントコンサルティング	4.2	3.9	50,622
ORCHESTRA HLDGS	1.2	1.6	3,636
アイモバイル	1.9	2.2	2,721
キャリアインデックス	2.1	2.8	1,624
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	2.4	2.2	1,830
船場	0.9	1.1	1,034
グレイステクノロジー	2.2	3	14,520
ジャパンエレベーターSHD	4.7	6.8	26,044
フルテック	0.8	0.9	1,235
グリーンズ	2.3	1.8	959
ツナググループHLDGS	0.7	0.9	416
GAMEWITH	—	1.7	1,110
ソウルドアウト	0.9	1.3	2,087
MS&CONSULTING	0.9	1	732
ミダック	—	0.8	1,846
日総工産	4	4.5	3,658
キュービーネットHLDGS	3.6	2.9	5,399
RPAホールディングス	2.5	4.8	4,185
スプリックス	2	2.2	1,909
マネジメントソリューションズ	—	2.8	4,600
プロレド・パートナーズ	—	0.9	4,581
AND FACTORY	—	0.5	521
ギークス	—	0.6	727
カーブスホールディングス	—	17.8	12,121
フォーラムエンジニアリング	—	3.3	2,877
アドバンテッジリスクマネ	2.3	3.3	2,537
リログループ	32.6	35.4	88,535
東祥	3.7	4	5,148
エイチ・アイ・エス	9.3	10.1	19,038
ラックランド	1.2	1.5	3,546
共立メンテナンス	9.1	10.8	43,686
イチネンホールディングス	6.2	7.2	9,223
建設技術研究所	4.1	4.4	9,103
スペース	3.9	4.1	3,538
長大	2.2	2.5	3,307
燦ホールディングス	1.3	2.8	3,413
スバル興業	0.4	0.4	3,200
東京テアトル	2.4	3.1	4,042
タナベ経営	1.2	1.1	1,662
ナガワ	1.7	2	15,820
よみうりランド	1.3	1.4	6,041
東京都競馬	3.9	4.2	22,218
常磐興産	2.4	2.6	3,991
カナモト	9.8	10.7	25,177
東京ドーム	22.4	26.4	20,882
西尾レントオール	6.1	6	13,986
アゴーラ・ホスピタリティーG	34.8	47.5	1,330
トランス・コスモス	6.6	6.2	17,918
乃村工藝社	27.9	27.8	21,962
藤田観光	2.6	2.9	4,776
KNT-CTホールディングス	3.2	3.9	4,356
日本管財	6.4	7.2	14,760
トーカイ	5.8	6.3	13,519
白洋舎	0.7	0.8	2,107
セコム	63.3	68.7	675,595
セントラル警備保障	2.9	3.1	10,850
丹青社	11.3	12.2	8,906
メイテック	7.4	8	43,440
応用地質	6.4	6.9	8,673
船井総研ホールディン	12.3	13.4	32,361
進学会ホールディングス	2.7	2.5	1,147
オオバ	4.7	4.8	3,883
いであ	1.1	1.5	2,976
学究社	2	1.8	2,030
ベネッセホールディングス	21.9	21.7	59,544
イオンディライト	7.4	8	23,448
ナック	3.8	3.9	3,853
ニチイ学館	8.5	6.2	10,310
ダイセキ	10	10.9	28,983
ステップ	2.2	2.4	3,837
	千株	千株	千円
合計 株数、金額	73,677.7	79,781.50004	155,810,906
合計 銘柄数<比率>	2,131銘柄	2,151銘柄	<99.4%>

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当期末 買建額	当期末 売建額
		百万円	百万円
国内	ＴＯＰＩＸ	912	—

（注）単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

項目	当期末	
	貸付	借入
株式	株 7,142,800 (67,500)	株 — (—)

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

■投資信託財産の構成

2020年９月23日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	155,810,906	90.5
コール・ローン等、その他	16,291,853	9.5
投資信託財産総額	172,102,760	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年９月23日現在

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

＊期首における元本額は139,218,477,453円、当作成期間中における追加設定元本額は38,212,962,099円、同解約元本額は33,157,622,329円です。
＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、トピックス・インデックスファンド3,314,021,528円、ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ6,818,474,579円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドＶＡ2　2,657,999円、ダイワ国内重視バランスファンド30ＶＡ（一般投資家私募）46,604,616円、ダイワ国内重視バランスファンド50ＶＡ（一般投資家私募）686,480,990円、ダイワ国際分散バランスファンド30ＶＡ（一般投資家私募）36,922,244円、ダイワ国際分散バランスファンド50ＶＡ（一般投資家私募）975,609,786円、日本株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）115,509,117円、Ｄ－Ｉ's　ＴＯＰＩＸインデックス50,828,888円、為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド12,744,127円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050　22,523,341円、iFree　ＴＯＰＩＸインデックス1,984,833,386円、iFree　8資産バランス2,612,918,610円、iFree 年金バランス111,316,445円、ＤＣダイワ日本株式インデックス65,911,437,637円、ダイワ・ライフ・バランス30　3,014,014,018円、ダイワ・ライフ・バランス50　3,718,178,204円、ダイワ・ライフ・バランス70　3,338,684,763円、年金ダイワ日本株式インデックス5,125,140,712円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020　12,676,182円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030　49,637,084円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040　35,161,355円、ダイワつみたてインデックス日本株式742,243,077円、ダイワつみたてインデックスバランス30　11,325,834円、ダイワつみたてインデックスバランス50　7,141,239円、ダイワつみたてインデックスバランス70　10,260,361円、ダイワ世界バランスファンド40ＶＡ146,259,723円、ダイワ世界バランスファンド60ＶＡ156,097,901円、ダイワ・バランスファンド35ＶＡ8,172,743,694円、ダイワ・バランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家専用）711,092,768円、ダイワ国内バランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家専用）105,455,426円、ダイワ国内バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家専用）194,955,500円、ダイワ・ノーロード　ＴＯＰＩＸファンド163,360,908円、ダイワファンドラップ　ＴＯＰＩＸインデックス10,589,328,266円、ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）8,840,247,711円、ダイワファンドラップオンライン　ＴＯＰＩＸインデックス2,003,637,126円、ダイワ・インデックスセレクトＴＯＰＩＸ1,325,135,081円、ダイワライフスタイル25　188,604,645円、ダイワライフスタイル50　670,194,395円、ダイワライフスタイル75　532,629,983円、ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）11,706,727,974円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は10,865円です。

■損益の状況

当期　自 2019年９月20日　至 2020年９月23日

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

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

ダイワファンドラップ
日経２２５インデックス

運用報告書（全体版）
第５期
（決算日　2021年６月15日）
（作成対象期間　2020年６月16日～2021年６月15日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

<4642>

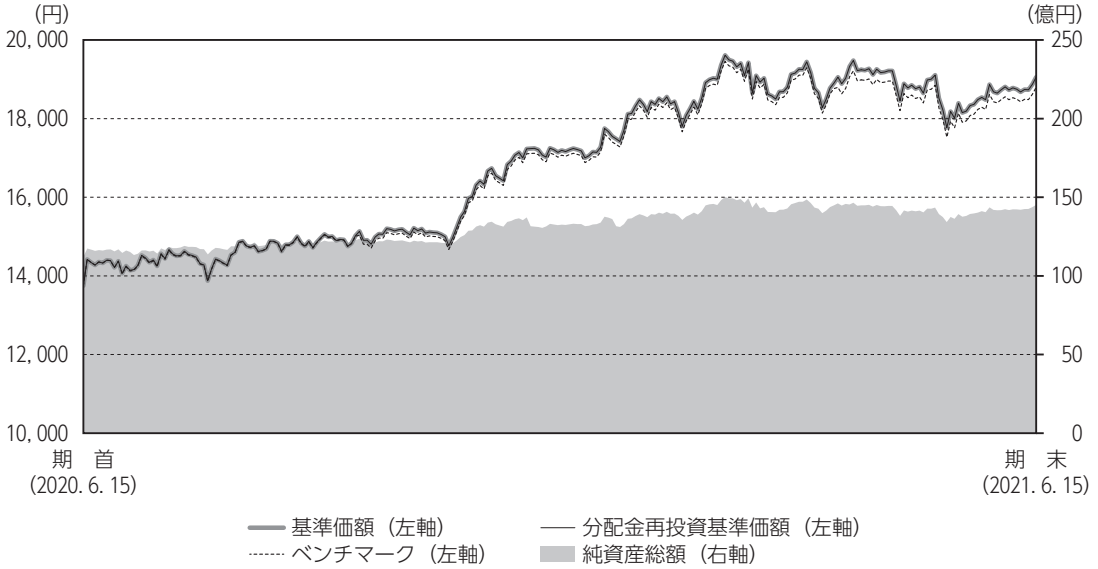
設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	基準価額 税込み分配金	基準価額 期中騰落率	日経平均株価 (ベンチマーク)	日経平均株価 期中騰落率	株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	円	円	%	円	%	%	%	百万円
1期末(2017年6月15日)	12,007	0	20.1	19,831.82	18.4	98.2	1.8	3,303
2期末(2018年6月15日)	14,057	0	17.1	22,851.75	15.2	98.3	1.7	6,623
3期末(2019年6月17日)	13,227	0	△ 5.9	21,124.00	△ 7.6	97.7	2.3	8,152
4期末(2020年6月15日)	13,749	0	3.9	21,530.95	1.9	98.1	1.9	11,210
5期末(2021年6月15日)	19,054	0	38.6	29,441.30	36.7	97.9	2.1	14,516

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

運用経過

基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期　首：13,749円
期　末：19,054円（分配金０円）
騰落率：38.6％（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

ベンチマークへの連動をめざした運用を行った結果、国内株式市況が上昇したことを受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年　月　日	基準価額	騰落率	日経平均株価（ベンチマーク）	騰落率	株式組入比率	株式先物比率
	円	%	円	%	%	%
(期首)2020年６月15日	13,749	—	21,530.95	—	98.1	1.9
６月末	14,251	3.7	22,288.14	3.5	98.1	1.9
７月末	13,877	0.9	21,710.00	0.8	98.9	1.1
８月末	14,792	7.6	23,139.76	7.5	98.3	1.7
９月末	14,906	8.4	23,185.12	7.7	98.0	2.0
10月末	14,769	7.4	22,977.13	6.7	98.0	1.9
11月末	17,003	23.7	26,433.62	22.8	98.5	1.4
12月末	17,670	28.5	27,444.17	27.5	98.7	1.3
2021年１月末	17,805	29.5	27,663.39	28.5	97.9	2.1
２月末	18,650	35.6	28,966.01	34.5	99.0	1.0
３月末	18,888	37.4	29,178.80	35.5	96.8	3.2
４月末	18,650	35.6	28,812.63	33.8	97.4	2.5
５月末	18,682	35.9	28,860.08	34.0	98.2	1.8
(期末)2021年６月15日	19,054	38.6	29,441.30	36.7	97.9	2.1

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2020.6.16～2021.6.15）

■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、国内外の新型コロナウイルスの感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、横ばい圏で推移しました。2020年11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通りの当選確実となって選挙に対する不確実性が後退したことや、欧米において複数のワクチンが承認されて接種が始まったことが好感され、株価は上昇しました。2021年に入っても、１月は米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利し、大統領府および上下両院共に民主党が制したことで大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、３月には米国の追加経済対策が発表されたことで同国の景気回復期待が高まったことが好感され、株価は強含みで推移しました。４月からは、国内の感染状況が悪化して再び緊急事態宣言が発出されたことや、米国においてインフレ懸念が高まったことが嫌気されて株価は下落したものの、５月中旬以降は、インフレ懸念の一服や国内でワクチンの高齢者向け大規模接種が開始されたことが好感され、株価は反発しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■ストックインデックス２２５・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

（2020. 6. 16 ～ 2021. 6. 15）

■当ファンド

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

■ストックインデックス２２５・マザーファンド

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

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

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

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

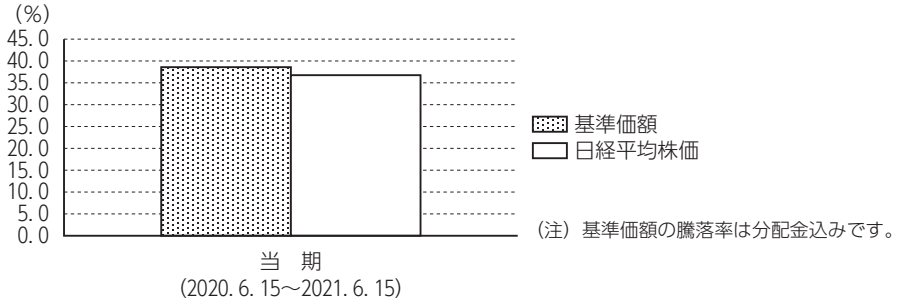
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は36. 7％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は38. 6％となりました。

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

また、ファンドから運用管理費用が控除されたことがマイナス要因となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



＊ベンチマークは日経平均株価です。

分配金について

当作成期は、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６月16日 ～2021年６月15日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**―**
対基準価額比率	（％）	―
当期の収益	（円）	―
当期の収益以外	（円）	―
翌期繰越分配対象額	（円）	9,054

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

今後の運用方針

■当ファンド

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

■ストックインデックス２２５・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

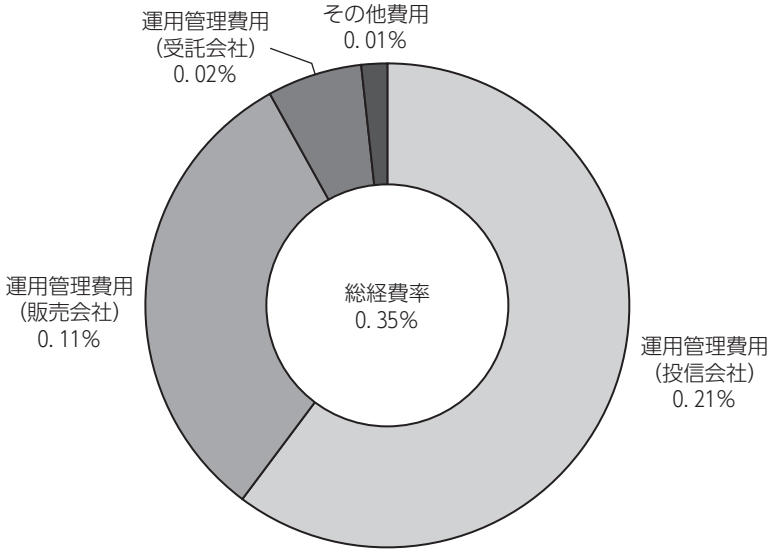
項　　目	当　期 (2020. 6. 16～2021. 6. 15) 金　額	比　率	項　目　の　概　要
信　託　報　酬	57円	0. 341%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は16, 859円です。**
(投 信 会 社)	(35)	(0. 209)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(19)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(4)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0. 001	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株　　式)	(0)	(0. 000)	
(先物･オプション)	(0)	(0. 001)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 006	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ　の　他)	(0)	(0. 000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	59	0. 348	

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（１口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0. 35%です。



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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2020年６月16日から2021年６月15日まで)

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ストックインデックス225・マザーファンド	699,953	2,342,200	980,645	3,283,200

(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６月16日から2021年６月15日まで)

項目	当期
	ストックインデックス225・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	42,505,416千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	168,774,002千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.25

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

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2020年６月16日から2021年６月15日まで)

決算期	当期					
区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	10,647	—	—	31,858	10,926	34.3
株式先物取引	56,607	2,497	4.4	56,678	4,259	7.5
コール・ローン	3,026,553	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合7.6%
※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2020年６月16日から2021年６月15日まで)

種類	当期		
	ストックインデックス225・マザーファンド		
	買付額	売付額	作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	6	19	146

(注１) 金額は受渡し代金。
(注２) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2020年６月16日から2021年６月15日まで)

種類	当期
	ストックインデックス225・マザーファンド
	買付額
	百万円
株式	294

(注１) 金額は受渡し代金。
(注２) 単位未満は切捨て。

(5) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2020年６月16日から2021年６月15日まで)

項目	当期
売買委託手数料総額 (A)	183千円
うち利害関係人への支払額 (B)	11千円
(B)／(A)	6.1%

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

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第１項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、大和証券グループ本社です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ストックインデックス225・マザーファンド	4,073,792	3,793,099	14,513,915

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年６月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ストックインデックス225・マザーファンド	14,513,915	99.8
コール・ローン等、その他	26,922	0.2
投資信託財産総額	14,540,838	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年６月15日現在

項目	当期末
(A) 資産	**14,540,838,416円**
コール・ローン等	26,922,803
ストックインデックス225・マザーファンド (評価額)	14,513,915,613
(B) 負債	**24,440,864**
未払解約金	52,309
未払信託報酬	24,001,523
その他未払費用	387,032
(C) 純資産総額 (A－B)	**14,516,397,552**
元本	7,618,451,322
次期繰越損益金	6,897,946,230
(D) 受益権総口数	**7,618,451,322口**
１万口当り基準価額 (C／D)	**19,054円**

＊期首における元本額は8,153,504,515円、当作成期間中における追加設定元本額は2,128,271,246円、同解約元本額は2,663,324,439円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は19,054円です。

■損益の状況

当期　自 2020年６月16日　至 2021年６月15日

項　　目	当　　期
（A）配当等収益	△ **8,097円**
受取利息	1,855
支払利息	△ 9,952
（B）有価証券売買損益	**3,541,478,619**
売買益	4,198,269,327
売買損	△ 656,790,708
（C）信託報酬等	△ **45,581,868**
（D）当期損益金（A＋B＋C）	**3,495,888,654**
（E）前期繰越損益金	**312,001,646**
（F）追加信託差損益金	**3,090,055,930**
（配当等相当額）	(1,198,075,046)
（売買損益相当額）	(1,891,980,884)
（G）合計（D＋E＋F）	**6,897,946,230**
次期繰越損益金（G）	**6,897,946,230**
追加信託差損益金	3,090,055,930
（配当等相当額）	(1,198,075,046)
（売買損益相当額）	(1,891,980,884)
分配準備積立金	3,807,898,397
繰越損益金	△ 8,097

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項　　目	当　　期
（a）経費控除後の配当等収益	0円
（b）経費控除後の有価証券売買等損益	3,468,797,324
（c）収益調整金	3,090,055,930
（d）分配準備積立金	339,101,073
（e）当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	6,897,954,327
（f）分配金	0
（g）翌期繰越分配対象額（e－f）	6,897,954,327
（h）受益権総口数	7,618,451,322口

【注記】

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

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワファンドラップ　日経２２５インデックス）が投資対象としている「ストックインデックス２２５・マザーファンド」の決算日（2020年９月23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６月15日）現在におけるストックインデックス２２５・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ストックインデックス２２５・マザーファンドの主要な売買銘柄

株　　式

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

買付				売付			
銘　　柄	株　数	金　額	平均単価	銘　　柄	株　数	金　額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ネクソン	516	1, 515, 509	2, 937	ファーストリテイリング	42	3, 211, 878	76, 473
ファーストリテイリング	10	868, 680	86, 868	ファミリーマート	1, 048	2, 397, 058	2, 287
日本取引所グループ	270	741, 155	2, 745	ソフトバンクグループ	252	1, 724, 436	6, 843
ソフトバンクグループ	60	526, 320	8, 772	東京エレクトロン	42	1, 317, 346	31, 365
東京エレクトロン	10	464, 900	46, 490	ファナック	42	960, 577	22, 870
シャープ	238	337, 734	1, 419	ダイキン工業	42	926, 149	22, 051
ソフトバンク	260	308, 559	1, 186	ＫＤＤＩ	252	783, 321	3, 108
ファナック	10	252, 070	25, 207	エムスリー	100. 8	771, 343	7, 652
ダイキン工業	10	212, 840	21, 284	テルモ	168	712, 969	4, 243
ＫＤＤＩ	60	212, 160	3, 536	信越化学	42	635, 774	15, 137

（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６月15日現在におけるストックインデックス２２５・マザーファンド（50, 206, 993千口）の内容です。

(1) 国内株式

銘　　柄	2021年６月15日現在	
	株　数	評 価 額
	千株	千円
水産・農林業（0. 1%）		
日本水産	230	125, 580
マルハニチロ	23	56, 511
鉱業（0. 0%）		
ＩＮＰＥＸ	92	74, 520
建設業（1. 6%）		
コムシスホールディングス	230	737, 150
大成建設	46	166, 520
大林組	230	213, 670
清水建設	230	198, 720
長谷工コーポレーション	46	69, 506
鹿島建設	115	164, 105
大和ハウス	230	754, 400
積水ハウス	230	510, 025
日揮ホールディングス	230	241, 500
食料品（3. 5%）		
日清製粉Ｇ本社	230	389, 620
明治ホールディングス	46	322, 460
日本ハム	115	511, 175
サッポロホールディングス	46	107, 180
アサヒグループホールディン	230	1, 266, 150
キリンＨＤ	230	530, 380
宝ホールディングス	230	347, 070
キッコーマン	230	1, 711, 200
味の素	230	619, 275
ニチレイ	115	339, 020
日本たばこ産業	230	506, 460
繊維製品（0. 2%）		
東洋紡	23	31, 372
ユニチカ	23	8, 855
帝人	46	81, 052
東レ	230	175, 421
パルプ・紙（0. 1%）		
王子ホールディングス	230	148, 810
日本製紙	23	29, 026
化学（7. 8%）		
クラレ	230	256, 220

銘　　柄	2021年６月15日現在	
	株　数	評 価 額
	千株	千円
旭化成	230	287, 615
昭和電工	23	82, 570
住友化学	230	139, 610
日産化学	230	1, 290, 300
東ソー	115	225, 055
トクヤマ	46	106, 122
デンカ	46	174, 340
信越化学	230	4, 410, 250
三井化学	46	173, 420
三菱ケミカル HLDGS	115	102, 246
宇部興産	23	53, 429
花王	230	1, 583, 550
ＤＩＣ	23	66, 884
富士フイルム HLDGS	230	1, 812, 400
資生堂	230	1, 876, 800
日東電工	230	1, 948, 100
医薬品（7. 7%）		
協和キリン	230	868, 250
武田薬品	230	874, 000
アステラス製薬	1, 150	2, 236, 175
大日本住友製薬	230	524, 860
塩野義製薬	230	1, 342, 510
中外製薬	690	3, 142, 950
エーザイ	230	2, 623, 150
第一三共	690	1, 807, 800
大塚ホールディングス	230	1, 101, 700
石油・石炭製品（0. 2%）		
出光興産	92	251, 068
ENEOS ホールディングス	230	108, 284
ゴム製品（0. 8%）		
横浜ゴム	115	270, 365
ブリヂストン	230	1, 149, 310
ガラス・土石製品（1. 1%）		
ＡＧＣ	46	221, 950
日本板硝子	23	15, 065
日本電気硝子	69	183, 816
住友大阪セメント	23	69, 920

銘　　柄	2021年６月15日現在	
	株　数	評 価 額
	千株	千円
太平洋セメント	23	56, 465
東海カーボン	230	376, 740
ＴＯＴＯ	115	706, 100
日本碍子	230	454, 940
鉄鋼（0. 1%）		
日本製鉄	23	44, 194
神戸製鋼所	23	16, 951
ＪＦＥホールディングス	23	30, 866
大平洋金属	23	42, 251
非鉄金属（0. 8%）		
日本軽金属ＨＤ	23	42, 803
三井金属	23	72, 220
東邦亜鉛	23	45, 540
三菱マテリアル	23	51, 589
住友鉱山	115	540, 730
DOWA ホールディングス	46	203, 320
古河電工	23	65, 642
住友電工	230	389, 735
フジクラ	230	110, 400
金属製品（0. 2%）		
ＳＵＭＣＯ	23	61, 272
東洋製罐グループ HD	230	380, 650
機械（4. 5%）		
日本製鋼所	46	137, 126
オークマ	46	256, 220
アマダ	230	262, 430
小松製作所	230	699, 660
住友重機械	46	147, 660
日立建機	230	787, 750
クボタ	230	524, 745
荏原製作所	46	246, 100
ダイキン工業	230	4, 704, 650
日本精工	230	236, 440
ＮＴＮ	230	71, 070
ジェイテクト	230	278, 990
日立造船	46	32, 890
三菱重工業	23	77, 809

銘柄	2021年６月15日現在 株数	評価額
	千株	千円
ＩＨＩ	23	63,273
電気機器（22.9%）		
日清紡ホールディングス	230	211,600
コニカミノルタ	230	147,660
ミネベアミツミ	230	670,680
日立	46	280,600
三菱電機	230	399,970
富士電機	46	237,360
安川電機	230	1,207,500
オムロン	230	1,966,500
ジーエス・ユアサ コーポ	46	136,528
日本電気	23	127,650
富士通	23	447,235
沖電気	23	23,644
セイコーエプソン	460	955,420
パナソニック	230	291,295
シャープ	230	442,520
ソニーグループ	230	2,533,450
ＴＤＫ	230	3,233,800
アルプスアルパイン	230	278,990
横河電機	230	398,360
アドバンテスト	460	4,738,000
カシオ	230	438,380
ファナック	230	6,247,950
京セラ	460	3,286,240
太陽誘電	230	1,274,200
SCREEN ホールディングス	46	501,860
キヤノン	345	904,935
リコー	230	310,500
東京エレクトロン	230	11,385,000
輸送用機器（4.7%）		
デンソー	230	1,795,150
三井 E&SHD	23	11,960
川崎重工業	23	57,063
日産自動車	230	129,490
いすゞ自動車	115	179,515
トヨタ自動車	230	2,317,250
日野自動車	230	229,540
三菱自動車工業	23	7,153
マツダ	46	46,138
本田技研	460	1,667,960
スズキ	230	1,097,100
SUBARU	230	527,275
ヤマハ発動機	230	747,500
精密機器（3.6%）		
テルモ	920	4,221,880
ニコン	230	276,000
オリンパス	920	2,183,620
シチズン時計	230	100,280
その他製品（2.1%）		
バンダイナムコ HLDGS	230	1,872,200
凸版印刷	115	219,535
大日本印刷	115	280,830
ヤマハ	230	1,504,200
電気・ガス業（0.1%）		
東京電力ＨＤ	23	8,027
中部電力	23	31,579
関西電力	23	25,116
東京瓦斯	46	100,855
大阪瓦斯	46	99,222
陸運業（1.6%）		
東武鉄道	46	142,600
東急	115	185,150
小田急電鉄	115	348,450
京王電鉄	46	332,120
京成電鉄	115	419,175
東日本旅客鉄道	23	192,280
西日本旅客鉄道	23	158,769
東海旅客鉄道	23	414,000
日本通運	23	200,100
ヤマトホールディングス	230	696,900
海運業（0.2%）		
日本郵船	23	124,660
商船三井	23	115,230
川崎汽船	23	81,420
空運業（0.0%）		
ANA ホールディングス	23	64,722
倉庫・運輸関連業（0.2%）		
三菱倉庫	115	396,175
情報・通信業（12.2%）		
ネクソン	460	1,188,180
Ｚホールディングス	92	48,281
トレンドマイクロ	230	1,331,700
スカパー JSATHD	23	9,706
日本電信電話	92	266,248
ＫＤＤＩ	1,380	4,972,140
ソフトバンク	230	327,405
東宝	23	106,835
ＮＴＴデータ	1,150	2,010,200
コナミホールディングス	230	1,665,200
ソフトバンクグループ	1,380	11,097,960
卸売業（2.1%）		
双日	23	8,027
伊藤忠	230	759,460
丸紅	230	228,597
豊田通商	230	1,248,900
三井物産	230	598,920
住友商事	230	352,820
三菱商事	230	701,960
小売業（11.8%）		
J. フロント リテイリング	115	128,340
三越伊勢丹ＨＤ	230	193,430
セブン＆アイ・HLDGS	230	1,151,380
高島屋	115	149,845
丸井グループ	230	494,960
イオン	230	690,460
ファーストリテイリング	230	19,333,800
銀行業（0.5%）		
コンコルディア・フィナンシャル	230	95,450
新生銀行	23	36,179
あおぞら銀行	23	57,086
三菱 UFJ フィナンシャル G	230	140,024
りそなホールディングス	23	10,306
三井住友トラスト HD	23	84,226
三井住友フィナンシャル G	23	90,160
千葉銀行	230	159,620
ふくおかフィナンシャル G	46	91,310
静岡銀行	230	206,310
みずほフィナンシャルG	23	37,363
証券、商品先物取引業（0.3%）		
大和証券Ｇ本社	230	146,740
野村ホールディングス	230	134,642
松井証券	230	189,520
保険業（0.6%）		
SOMPO ホールディングス	57.5	246,675
ＭＳ＆ＡＤ	69	230,046
第一生命 HLDGS	23	49,806
東京海上ＨＤ	115	593,975
T&D ホールディングス	46	66,746
その他金融業（0.5%）		
クレディセゾン	230	325,220
日本取引所グループ	230	588,685
不動産業（1.3%）		
東急不動産ＨＤ	230	167,670
三井不動産	230	632,040
三菱地所	230	444,475
東京建物	115	197,455
住友不動産	230	960,250
サービス業（6.5%）		
エムスリー	552	4,317,192
ディー・エヌ・エー	69	159,597
電通グループ	230	890,100
サイバーエージェント	184	410,872
楽天グループ	230	301,990
リクルートホールディングス	690	3,959,910
日本郵政	230	208,771
セコム	230	2,020,550
合計 株数、金額	千株 41,871.5	千円 188,037,771
合計 銘柄数＜比率＞	225銘柄	＜97.9%＞

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

(2) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別		2021年６月15日現在 買建額	売建額
		百万円	百万円
国内	日経平均	4,087	—

（注）単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入状況

区分	2021年６月15日現在 貸付	借入
	株	株
株式	32,000 (2,000)	— (—)

（注１）（　）内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
（注２）当ファンドに係る当作成期中の利害関係人のうち、大和証券へ2,000株を貸付けています。

ストックインデックス225・マザーファンド

運用報告書　第19期　（決算日　2020年9月23日）

（作成対象期間　2019年9月20日～2020年9月23日）

ストックインデックス225・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

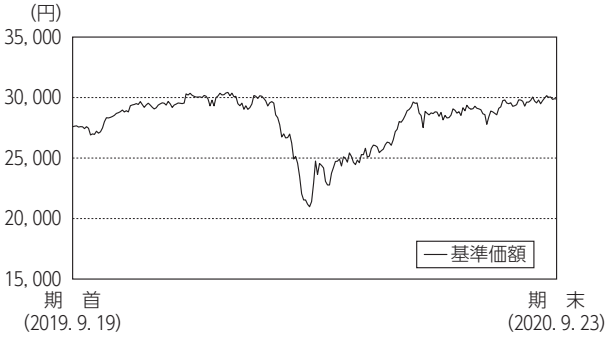
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額	騰落率	日経平均株価 (ベンチマーク)	騰落率	株式組入比率	株式先物比率
	円	%	円	%	%	%
(期首)2019年9月19日	27,592	—	22,044.45	—	98.3	0.9
9月末	27,431	△ 0.6	21,755.84	△ 1.3	98.3	1.7
10月末	28,913	4.8	22,927.04	4.0	97.4	2.6
11月末	29,379	6.5	23,293.91	5.7	97.6	2.4
12月末	29,887	8.3	23,656.62	7.3	98.5	1.5
2020年1月末	29,315	6.2	23,205.18	5.3	97.5	2.5
2月末	26,741	△ 3.1	21,142.96	△ 4.1	97.9	2.1
3月末	24,181	△12.4	18,917.01	△14.2	96.8	3.2
4月末	25,806	△ 6.5	20,193.69	△ 8.4	96.5	3.5
5月末	27,956	1.3	21,877.89	△ 0.8	97.7	2.3
6月末	28,522	3.4	22,288.14	1.1	98.1	1.9
7月末	27,782	0.7	21,710.00	△ 1.5	98.9	1.1
8月末	29,622	7.4	23,139.76	5.0	98.3	1.7
(期末)2020年9月23日	29,884	8.3	23,346.49	5.9	98.4	0.6

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：27,592円　期末：29,884円　騰落率：8.3%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は5.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は8.3%となりました。

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

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

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

■売買および取引の状況

(1)株　　式

(2019年9月20日から2020年9月23日まで)

	買　　付		売　　付	
	株　数	金　額	株　数	金　額
	千株	千円	千株	千円
国内	7,051.1 (572)	20,747,199 (—)	14,205.9	50,034,502

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

(2)先物取引の種類別取引状況

(2019年9月20日から2020年9月23日まで)

種　類　別		買　建		売　建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	株式先物取引	82,874	83,934	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株　　式

(2019年9月20日から2020年9月23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
エムスリー	768	2,011,957	2,619	ファーストリテイリング	78	5,164,228	66,208
ファーストリテイリング	34	1,657,160	48,740	ソフトバンクグループ	468	2,250,853	4,809
ソフトバンクグループ	204	860,886	4,220	東京エレクトロン	78	1,827,280	23,426
日本取引所グループ	260	715,460	2,751	ファナック	78	1,614,175	20,694
東京エレクトロン	34	702,570	20,663	ＫＤＤＩ	468	1,454,869	3,108
ＫＤＤＩ	204	624,558	3,061	ダイキン工業	78	1,251,613	16,046
ファナック	34	533,730	15,697	テルモ	312	1,187,709	3,806
ダイキン工業	34	464,200	13,652	京セラ	156	1,064,238	6,822
テルモ	136	459,552	3,379	信越化学	78	961,310	12,324
京セラ	68	425,972	6,264	リクルートホールディングス	234	874,168	3,735

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)国内株式

銘　柄	期　首	当　期　末	
	株　数	株　数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
日本水産	294	250	114,000
マルハニチロ	29.4	25	61,675
鉱業 (0.0%)			
国際石油開発帝石	117.6	100	57,860
建設業 (1.9%)			
コムシスホールディングス	294	250	736,500
大成建設	58.8	50	185,500
大林組	294	250	249,000
清水建設	294	250	203,750
長谷工コーポレーション	58.8	50	73,200
鹿島建設	147	125	162,250
大和ハウス	294	250	708,875
積水ハウス	294	250	482,375
日揮ホールディングス	294	250	264,500
食料品 (3.7%)			
日清製粉Ｇ本社	294	250	426,500
明治ホールディングス	58.8	50	405,000
日本ハム	147	125	585,000
サッポロホールディングス	58.8	50	96,000
アサヒグループホールディン	294	250	931,500
キリンＨＤ	294	250	491,125
宝ホールディングス	294	250	285,000
キッコーマン	294	250	1,450,000
味の素	294	250	543,500
ニチレイ	147	125	349,875
日本たばこ産業	294	250	488,875
繊維製品 (0.2%)			
東洋紡	29.4	25	41,550
ユニチカ	29.4	25	9,150
帝人	58.8	50	84,450
東レ	294	250	123,650
パルプ・紙 (0.1%)			
王子ホールディングス	294	250	123,500
日本製紙	29.4	25	32,975
化学 (8.1%)			
クラレ	294	250	269,250
旭化成	294	250	232,425
昭和電工	29.4	25	51,750
住友化学	294	250	91,250
日産化学	294	250	1,355,000
東ソー	147	125	219,375
トクヤマ	58.8	50	131,300
デンカ	58.8	50	163,000
信越化学	294	250	3,500,000
三井化学	58.8	50	131,550
三菱ケミカル HLDGS	147	125	81,650
宇部興産	29.4	25	47,200
日本化薬	294	250	251,000
花王	294	250	2,050,500
ＤＩＣ	29.4	25	65,675
富士フイルム HLDGS	294	250	1,320,750
資生堂	294	250	1,552,500
日東電工	294	250	1,625,000
医薬品 (9.3%)			
協和キリン	294	250	718,750
武田薬品	294	250	980,750
アステラス製薬	1,470	1,250	2,029,375
大日本住友製薬	294	250	345,750
塩野義製薬	294	250	1,442,250
中外製薬	294	750	3,603,750
エーザイ	294	250	2,387,000
第一三共	294	250	2,440,500
大塚ホールディングス	294	250	1,120,750
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	117.6	100	241,800
ENEOS ホールディングス	294	250	100,250
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	147	125	192,625
ブリヂストン	294	250	851,000
ガラス・土石製品 (1.1%)			
ＡＧＣ	58.8	50	158,250

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
日本板硝子	29.4	25	10,150
日本電気硝子	88.2	75	154,500
住友大阪セメント	29.4	25	90,250
太平洋セメント	29.4	25	69,975
東海カーボン	294	250	283,250
ＴＯＴＯ	147	125	601,875
日本碍子	294	250	367,000
鉄鋼（0.1%）			
日本製鉄	29.4	25	25,875
神戸製鋼所	29.4	25	10,375
ＪＦＥホールディングス	29.4	25	19,575
大平洋金属	29.4	25	41,850
非鉄金属（0.8%）			
日本軽金属ＨＤ	294	250	44,000
三井金属	29.4	25	65,975
東邦亜鉛	29.4	25	50,675
三菱マテリアル	29.4	25	54,575
住友鉱山	147	125	435,375
DOWA ホールディングス	58.8	50	160,250
古河電工	29.4	25	63,475
住友電工	294	250	307,500
フジクラ	294	250	76,500
金属製品（0.2%）			
ＳＵＭＣＯ	29.4	25	36,550
東洋製罐グループ HD	294	250	268,000
機械（5.1%）			
日本製鋼所	58.8	50	89,200
オークマ	58.8	50	258,000
アマダ	294	250	256,000
小松製作所	294	250	593,625
住友重機械	58.8	50	125,700
日立建機	294	250	921,250
クボタ	294	250	459,750
荏原製作所	58.8	50	143,800
ダイキン工業	294	250	4,880,000
日本精工	294	250	210,250
ＮＴＮ	294	250	52,500
ジェイテクト	294	250	211,500
日立造船	58.8	50	22,400
三菱重工業	29.4	25	61,725
ＩＨＩ	29.4	25	36,650
電気機器（19.4%）			
日清紡ホールディングス	294	250	184,250
コニカミノルタ	294	250	75,500
ミネベアミツミ	294	250	505,250
日立	58.8	50	184,450
三菱電機	294	250	367,500
富士電機	58.8	50	170,000
安川電機	294	250	996,250
オムロン	294	250	2,015,000
ジーエス・ユアサ コーポ	58.8	50	92,200
日本電気	29.4	25	147,750
富士通	29.4	25	359,500
沖電気	29.4	25	26,600
セイコーエプソン	588	500	619,500
パナソニック	294	250	231,600
ソニー	294	250	2,051,000
ＴＤＫ	294	250	2,915,000
アルプスアルパイン	294	250	381,750
横河電機	294	250	419,250
アドバンテスト	588	500	2,610,000
カシオ	294	250	418,250
ファナック	294	250	5,105,000
京セラ	588	500	3,083,500
太陽誘電	294	250	816,250
SCREEN ホールディングス	58.8	50	276,500
キヤノン	441	375	646,500
リコー	294	250	178,500
東京エレクトロン	294	250	6,730,000
輸送用機器（4.1%）			
デンソー	294	250	1,145,000
三井 E&SHD	29.4	25	10,000
川崎重工業	29.4	25	37,075
日産自動車	294	250	93,000
いすゞ自動車	147	125	118,625
トヨタ自動車	294	250	1,770,250
日野自動車	294	250	164,500
三菱自動車工業	29.4	25	5,825
マツダ	58.8	50	31,500
本田技研	588	500	1,269,750
スズキ	294	250	1,037,000
SUBARU	294	250	517,000
ヤマハ発動機	294	250	393,250
精密機器（4.0%）			
テルモ	1,176	1,000	4,145,000
ニコン	294	250	179,250
オリンパス	1,176	1,000	2,081,000
シチズン時計	294	250	77,750
その他製品（2.2%）			
バンダイナムコ HLDGS	294	250	1,814,500
凸版印刷	147	125	198,250
大日本印刷	147	125	276,250
ヤマハ	294	250	1,275,000
電気・ガス業（0.2%）			
東京電力ＨＤ	29.4	25	7,500
中部電力	29.4	25	33,662
関西電力	29.4	25	26,425
東京瓦斯	58.8	50	120,650
大阪瓦斯	58.8	50	104,150
陸運業（1.8%）			
東武鉄道	58.8	50	168,750
東急	147	125	179,500
小田急電鉄	147	125	334,875
京王電鉄	58.8	50	329,500
京成電鉄	147	125	385,625
東日本旅客鉄道	29.4	25	171,250
西日本旅客鉄道	29.4	25	141,750
東海旅客鉄道	29.4	25	402,250
日本通運	29.4	25	155,750
ヤマトホールディングス	294	250	676,500
海運業（0.1%）			
日本郵船	29.4	25	47,125
商船三井	29.4	25	56,425
川崎汽船	29.4	25	31,625
空運業（0.0%）			
ANA ホールディングス	29.4	25	69,600
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
三菱倉庫	147	125	380,625
情報・通信業（11.5%）			
Ｚホールディングス	117.6	100	69,000
トレンドマイクロ	294	250	1,617,500
スカパー JSATHD	29.4	25	11,250
日本電信電話	58.8	100	223,950
ＫＤＤＩ	1,764	1,500	4,131,750
ＮＴＴドコモ	29.4	25	67,625
東宝	29.4	25	108,000
ＮＴＴデータ	1,470	1,250	1,768,750
コナミホールディングス	294	250	1,097,500
ソフトバンクグループ	1,764	1,500	9,562,500
卸売業（1.9%）			
双日	29.4	25	6,225
伊藤忠	294	250	690,375
丸紅	294	250	158,025
豊田通商	294	250	758,750
三井物産	294	250	471,875
住友商事	294	250	328,750
三菱商事	294	250	655,375
小売業（12.8%）			
J. フロント リテイリング	147	125	88,000
三越伊勢丹ＨＤ	294	250	138,250
セブン＆アイ・HLDGS	294	250	840,750
ファミリーマート	1,176	1,000	2,340,000
高島屋	147	125	103,375
丸井グループ	294	250	491,750
イオン	294	250	707,250
ファーストリテイリング	294	250	16,155,000
銀行業（0.6%）			
コンコルディア・フィナンシャル	294	250	96,750
新生銀行	29.4	25	33,525
あおぞら銀行	29.4	25	44,650
三菱UFJフィナンシャルＧ	294	250	109,975
りそなホールディングス	29.4	25	9,692
三井住友トラスト HD	29.4	25	75,225
三井住友フィナンシャルＧ	29.4	25	76,850
千葉銀行	294	250	149,500
ふくおかフィナンシャルＧ	58.8	50	95,150
静岡銀行	294	250	187,500
みずほフィナンシャルＧ	294	250	34,650
証券、商品先物取引業（0.3%）			
大和証券Ｇ本社	294	250	116,000
野村ホールディングス	294	250	124,875
松井証券	294	250	238,750
保険業（0.7%）			
SOMPO ホールディングス	73.5	62.5	236,875
ＭＳ＆ＡＤ	88.2	75	222,187
ＳＯＮＹ ＦＨ	58.8	—	—
第一生命 HLDGS	29.4	25	38,062
東京海上ＨＤ	147	125	606,625
T&D ホールディングス	58.8	50	54,600
その他金融業（0.6%）			
クレディセゾン	294	250	280,500
日本取引所グループ	—	250	725,000
不動産業（1.2%）			
東急不動産ＨＤ	294	250	118,500
三井不動産	294	250	487,250
三菱地所	294	250	404,625
東京建物	147	125	162,500
住友不動産	294	250	783,000
サービス業（7.0%）			
エムスリー	—	600	3,930,000
ディー・エヌ・エー	88.2	75	141,000
電通グループ	294	250	800,000
サイバーエージェント	58.8	50	311,000
楽天	294	250	305,000
リクルートホールディングス	882	750	3,217,500
日本郵政	294	250	185,900
東京ドーム	147	—	—
セコム	294	250	2,458,500
	千株	千株	千円
合計 株数、金額	52,170.3	45,587.5	162,602,465
合計 銘柄数＜比率＞	225銘柄	225銘柄	＜98.4%＞

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当期末 買建額	当期末 売建額
		百万円	百万円
国内	日経平均	973	—

（注）単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

区　　分	当　期　末	
	貸　付	借　入
株式	株 3,503,000 (　329,800)	株 — (　—)

（注１）（　）内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
（注２）当ファンドに係る当作成期中の利害関係人のうち、大和証券へ329,800株を貸付けています。

■投資信託財産の構成

2020年９月23日現在

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　　率
	千円	%
株式	162,602,465	88.8
コール・ローン等、その他	20,512,356	11.2
投資信託財産総額	183,114,821	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年９月23日現在

項　　目	当　期　末
（Ａ）資産	**184,762,901,714円**
コール・ローン等	20,405,078,144
株式（評価額）	162,602,465,000
未収入金	10,549,540
未収配当金	82,173,000
未収利息	919,026
その他未収収益	13,263,244
差入委託証拠金	1,648,453,760
（Ｂ）負債	**19,437,541,983**
未払金	5,500
未払解約金	272,944,000
差入委託証拠金代用有価証券	1,663,600,000
受入担保金	17,500,847,238
その他未払費用	145,245
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）	**165,325,359,731**
元本	55,323,152,743
次期繰越損益金	110,002,206,988
（Ｄ）受益権総口数	**55,323,152,743口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）	**29,884円**

＊期首における元本額は65,724,660,910円、当作成期間中における追加設定元本額は14,915,798,201円、同解約元本額は25,317,306,368円です。
＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ストック　インデックス　ファンド２２５　24,213,438,635円、適格機関投資家専用・ダイワ・ストックインデックスファンド２２５ＶＡ470,511,110円、大和　ストックインデックス２２５　ファンド8,932,313,434円、Ｄ－Ｉ's　日経２２５インデックス143,681,268円、iFree 日経２２５インデックス3,817,779,748円、ＤＣ・ダイワ・ストックインデックス２２５（確定拠出年金専用ファンド）5,381,597,551円、ダイワ・ノーロード　日経２２５ファンド275,864,440円、ダイワファンドラップ日経２２５インデックス4,064,405,168円、ダイワ日経２２５インデックス（ダイワＳＭＡ専用）339,060,218円、ダイワ・インデックスセレクト日経２２５7,684,501,171円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は29,884円です。

■損益の状況

当期　自 2019年９月20日　至 2020年９月23日

項　　目	当　期
（Ａ）配当等収益	**3,290,213,097円**
受取配当金	3,223,751,006
受取利息	10,145,431
その他収益金	63,008,248
支払利息	△　6,691,588
（Ｂ）有価証券売買損益	**13,679,856,508**
売買益	23,464,223,273
売買損	△　9,784,366,765
（Ｃ）先物取引等損益	**437,395,470**
取引益	2,025,797,730
取引損	△　1,588,402,260
（Ｄ）その他費用	**△　411,456**
（Ｅ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ）	**17,407,053,619**
（Ｆ）前期繰越損益金	**115,620,622,802**
（Ｇ）解約差損益金	**△　47,641,566,232**
（Ｈ）追加信託差損益金	**24,616,096,799**
（Ｉ）合計（Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ）	**110,002,206,988**
次期繰越損益金（Ｉ）	**110,002,206,988**

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

ダイワファンドラップ
外国株式インデックス
（為替ヘッジあり）

運用報告書（全体版）
第５期

（決算日　2021年６月15日）

（作成対象期間　2020年６月16日～2021年６月15日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、外国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

<2731>

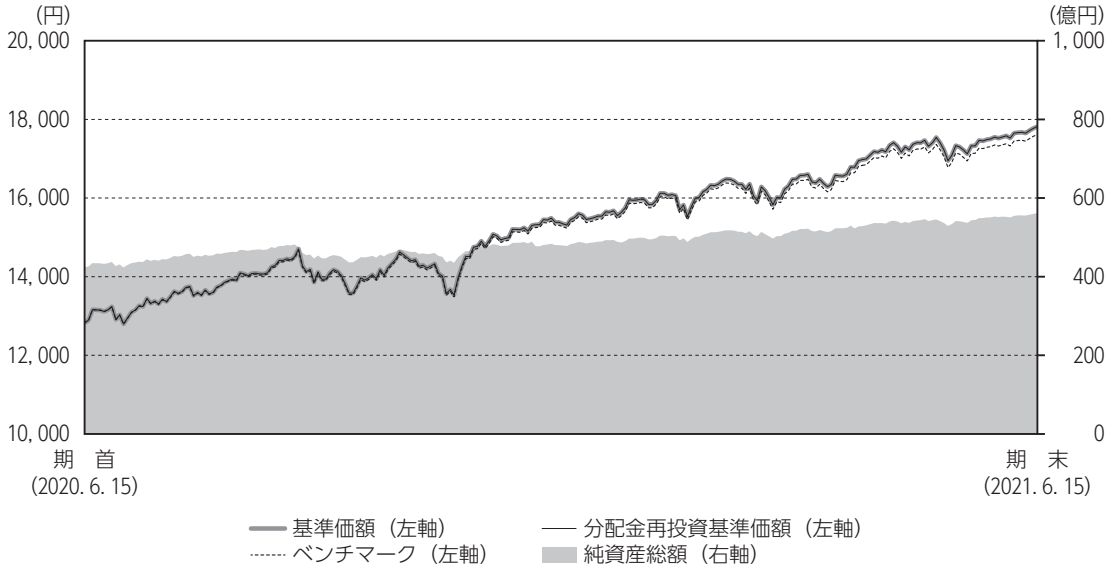
設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
1期末（2017年6月15日）	11,194	0	11.9	11,071	10.7	93.4	3.8	0.0	2.4	16,740
2期末（2018年6月15日）	12,400	0	10.8	12,054	8.9	95.8	3.4	—	2.3	31,820
3期末（2019年6月17日）	12,648	0	2.0	12,074	0.2	91.6	6.0	—	2.8	36,065
4期末（2020年6月15日）	12,825	0	1.4	12,067	△0.1	95.0	1.9	—	2.7	42,369
5期末（2021年6月15日）	17,819	0	38.9	16,570	37.3	94.2	3.7	—	2.4	56,165

（注1）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注2）ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）は、ＭＳＣＩ Ｉｎｃ．の承諾を得て、ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）をもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）は、ＭＳＣＩ 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）組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
（注6）株式組入比率は新株予約権証券を含みます。
（注7）株式先物比率は買建比率－売建比率です。

運用経過

基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期　首：12,825円
期　末：17,819円（分配金0円）
騰落率：38.9%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

マザーファンドの受益証券を通じてベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行った結果、新型コロナウイルスのワクチン開発および接種の進展などを背景に海外株式市況が上昇したことを受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年　月　日	基準価額		ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率				
	円	%		%	%	%	%	%
（期首）2020年６月15日	12,825	—	12,067	—	95.0	1.9	—	2.7
６月末	12,944	0.9	12,172	0.9	95.5	2.2	—	2.6
７月末	13,562	5.7	12,749	5.7	91.6	4.3	—	2.5
８月末	14,454	12.7	13,567	12.4	93.2	4.4	—	2.4
９月末	13,910	8.5	13,048	8.1	94.2	2.4	—	2.4
10月末	13,676	6.6	12,825	6.3	92.5	3.9	—	2.4
11月末	15,241	18.8	14,278	18.3	93.1	4.7	—	2.3
12月末	15,640	21.9	14,638	21.3	90.5	7.0	—	2.1
2021年１月末	15,823	23.4	14,804	22.7	91.0	6.3	—	2.2
２月末	16,049	25.1	14,999	24.3	94.5	4.9	—	2.2
３月末	16,558	29.1	15,448	28.0	97.4	3.3	—	2.3
４月末	17,467	36.2	16,280	34.9	94.2	2.9	—	2.3
５月末	17,547	36.8	16,324	35.3	94.8	3.7	—	2.3
（期末）2021年６月15日	17,819	38.9	16,570	37.3	94.2	3.7	—	2.4

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2020.6.16 ～ 2021.6.15）

■海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より、米国の新たな経済対策への期待などから上昇しました。2020年９月以降は、米国の景気回復に対して懐疑的な見方が広がったことなどを受け、上値の重い展開となりました。11月以降は、米国大統領選挙の結果に対する不透明感が解消されたことや新型コロナウイルスのワクチンへの開発進展期待を受け、上昇しました。2021年２月以降は、米国において新規感染者数の減少傾向が鮮明となったことに加え、ワクチン接種が着実に進んでいることが投資家心理を改善させ、上昇して当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

ポートフォリオについて

（2020. 6. 16 ～ 2021. 6. 15）

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

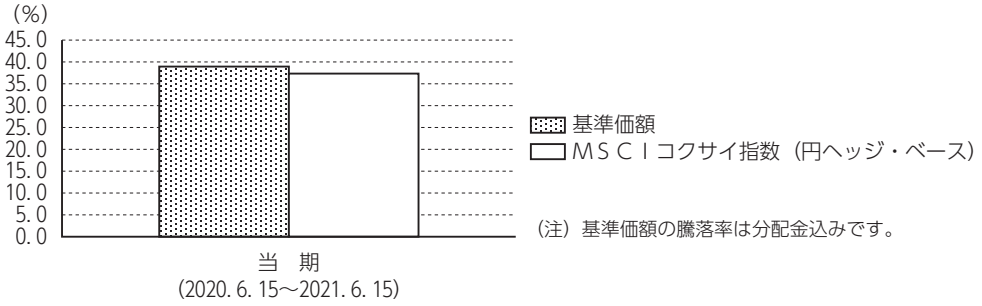
組入ファンド	ベンチマーク
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は37. 3％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は38. 9％となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



＊ベンチマークはＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）です。

分配金について

当作成期は、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６月16日 ～2021年６月15日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**―**
対基準価額比率	（％）	―
当期の収益	（円）	―
当期の収益以外	（円）	―
翌期繰越分配対象額	（円）	7,818

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

今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

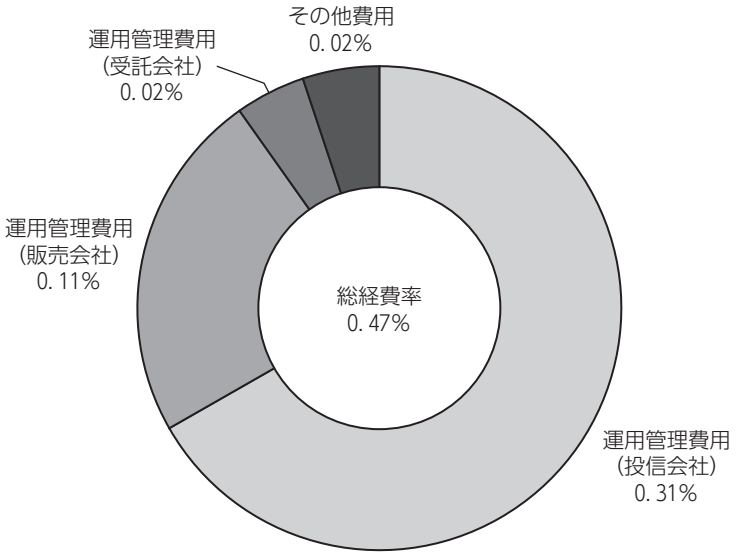
項　　目	当　期 (2020. 6. 16～2021. 6. 15) 金　額	比　率	項　目　の　概　要
信　託　報　酬	68円	0. 445%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は15, 335円です。**
（投 信 会 社）	(48)	(0. 313)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(17)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0. 004	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株　　式）	(0)	(0. 003)	
（新株予約権証券）	(0)	(0. 000)	
（先物･オプション）	(0)	(0. 002)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
有価証券取引税	0	0. 001	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株　　式）	(0)	(0. 001)	
（新株予約権証券）	(0)	(0. 000)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	4	0. 024	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(3)	(0. 018)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0. 004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ　の　他）	(0)	(0. 002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	73	0. 475	

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（１口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0. 47%です。



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

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	2,426,318	5,770,460	3,502,383	8,203,180

（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６月16日から2021年６月15日まで）

項目	当期
	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド
（a）期中の株式売買金額	9,872,104千円
（b）期中の平均組入株式時価総額	59,854,641千円
（c）売買高比率　（a）／（b）	0.16

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

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	21,439,177	20,363,112	56,157,391

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年６月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	56,157,391	99.7
コール・ローン等、その他	168,541	0.3
投資信託財産総額	56,325,933	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、６月15日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝110.11円、１カナダ・ドル＝90.68円、１オーストラリア・ドル＝84.91円、１香港・ドル＝14.19円、１シンガポール・ドル＝82.99円、１ニュージーランド・ドル＝78.64円、１イギリス・ポンド＝155.39円、１イスラエル・シュケル＝33.923円、１スイス・フラン＝122.43円、１デンマーク・クローネ＝17.95円、１ノルウェー・クローネ＝13.22円、１スウェーデン・クローネ＝13.22円、１ユーロ＝133.45円です。
（注３）外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（72,442,595千円）の投資信託財産総額（74,316,087千円）に対する比率は、97.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年６月15日現在

項目	当期末
（A）資産	**56,325,933,298円**
コール・ローン等	168,541,696
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（評価額）	56,157,391,602
（B）負債	**160,287,392**
未払解約金	43,752,850
未払信託報酬	115,439,577
その他未払費用	1,094,965
（C）純資産総額（A－B）	**56,165,645,906**
元本	31,520,778,793
次期繰越損益金	24,644,867,113
（D）受益権総口数	**31,520,778,793口**
１万口当り基準価額（C／D）	**17,819円**

＊期首における元本額は33,035,419,266円、当作成期間中における追加設定元本額は7,978,557,364円、同解約元本額は9,493,197,837円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は17,819円です。

■損益の状況

当期　自 2020年６月16日　至 2021年６月15日

項目	当期
（A）配当等収益	**△27,068円**
受取利息	4,318
支払利息	△31,386
（B）有価証券売買損益	**14,125,720,019**
売買益	16,124,972,354
売買損	△1,999,252,335
（C）信託報酬等	**△219,971,834**
（D）当期損益金（A＋B＋C）	**13,905,721,117**
（E）前期繰越損益金	**2,104,096,358**
（F）追加信託差損益金	**8,635,049,638**
（配当等相当額）	（4,246,418,171）
（売買損益相当額）	（4,388,631,467）
（G）合計（D＋E＋F）	**24,644,867,113**
次期繰越損益金（G）	**24,644,867,113**
追加信託差損益金	8,635,049,638
（配当等相当額）	（4,246,418,171）
（売買損益相当額）	（4,388,631,467）
分配準備積立金	16,009,844,543
繰越損益金	△27,068

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項目	当期
（a）経費控除後の配当等収益	0円
（b）経費控除後の有価証券売買等損益	13,905,717,834
（c）収益調整金	8,635,049,638
（d）分配準備積立金	2,104,126,709
（e）当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	24,644,894,181
（f）分配金	0
（g）翌期繰越分配対象額（e－f）	24,644,894,181
（h）受益権総口数	31,520,778,793口

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワファンドラップ　外国株式インデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の決算日（2021年１月12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６月15日）現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの主要な売買銘柄

株　　式

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
TESLA INC（アメリカ）	0.927	53,679	57,906	APPLE INC（アメリカ）	32.067	409,127	12,758
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A（アメリカ）	1.284	51,026	39,740	MICROSOFT CORP（アメリカ）	10.941	261,099	23,864
ALPHABET INC-CL A（アメリカ）	0.17	39,828	234,282	AMAZON.COM INC（アメリカ）	0.557	186,891	335,531
AMAZON.COM INC（アメリカ）	0.095	34,685	365,112	ALPHABET INC-CL C（アメリカ）	0.551	121,961	221,346
PLUG POWER INC（アメリカ）	6.251	33,488	5,357	ALPHABET INC-CL A（アメリカ）	0.559	103,601	185,333
UBER TECHNOLOGIES INC（アメリカ）	6.808	31,258	4,591	FACEBOOK INC-CLASS A（アメリカ）	3.262	98,221	30,110
WALMART INC（アメリカ）	2	31,105	15,552	TESLA INC（アメリカ）	1.385	85,161	61,488
CAESARS ENTERTAINMENT INC（アメリカ）	2.595	30,744	11,847	NESTLE SA-REG（スイス）	5.653	70,222	12,422
ETSY INC（アメリカ）	1.662	30,226	18,187	JOHNSON & JOHNSON（アメリカ）	3.653	60,693	16,614
SALESFORCE.COM INC（アメリカ）	1.021	29,453	28,847	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B（アメリカ）	2.076	53,033	25,545

（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６月15日現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（26,814,400千口）の内容です。

(1)外国株式

銘柄	2021年６月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
（アメリカ）				
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	12.95	208	22,951	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	12.2	448	49,374	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	22.71	337	37,153	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	15.94	139	15,362	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7.46	139	15,312	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	62	301	33,205	金融
ABBOTT LABORATORIES	215.45	2,380	262,093	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	39.5	138	15,205	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	19.43	336	37,070	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	47.29	256	28,196	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	69.05	471	51,936	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4.43	155	17,159	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	73.37	1,074	118,353	情報技術
QORVO INC	12.83	237	26,126	情報技術
AFLAC INC	84.71	469	51,701	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	12.48	171	18,894	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	18.35	158	17,457	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	56.84	3,165	348,575	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	28.72	151	16,662	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	16.07	542	59,740	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	15.27	217	23,989	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	26.02	778	85,699	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	83.91	1,872	206,194	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	17.71	133	14,711	金融
AUTOZONE INC	2.91	403	44,409	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	25.66	257	28,310	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	123.65	136	15,044	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	15.08	132	14,625	公益事業
CELANESE CORP	12.97	202	22,345	素材
DR HORTON INC	43.97	386	42,595	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	158	17,445	ヘルスケア
AUTODESK INC	26.84	752	82,903	情報技術
MOODY'S CORP	19.37	673	74,171	金融
DEVON ENERGY CORP	77.48	224	24,723	エネルギー
ALBEMARLE CORP	16.68	280	30,917	素材
ATMOS ENERGY CORP	16.54	167	18,412	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	36.14	211	23,307	公益事業
CITIGROUP INC	248.65	1,868	205,779	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	50.3	1,001	110,310	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	59.18	503	55,473	公益事業
ALLEGHANY CORP	1.46	102	11,232	金融

銘柄	2021年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DOMINO'S PIZZA INC	5.26	235	25,956	一般消費財・サービス
HESS CORP	21.12	187	20,620	エネルギー
DAVITA INC	10	121	13,384	ヘルスケア
DANAHER CORP	77.03	1,905	209,847	ヘルスケア
FORTIVE CORP	43.35	308	33,942	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	66.22	753	83,006	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	65.8	429	47,253	生活必需品
BUNGE LTD	18.38	151	16,720	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	42.21	578	63,720	情報技術
APPLE INC	2,010.93	26,238	2,889,133	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33.59	405	44,638	金融
BOEING CO/THE	63.53	1,557	171,482	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20.63	248	27,367	金融
BECTON DICKINSON AND CO	34.3	832	91,669	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	20	33	3,688	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	14	149	16,448	資本財・サービス
NISOURCE INC	40.26	104	11,539	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17.08	168	18,564	資本財・サービス
BOSTON BEER COMPANY INC-A	1.16	118	13,052	生活必需品
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	99.78	495	54,538	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	493.01	2,819	310,403	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	163.59	4,638	510,719	金融
ANSYS INC	10.38	351	38,688	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	171.23	970	106,884	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	81.93	783	86,252	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	272.84	1,835	202,155	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	366.29	5,771	635,514	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	26.58	512	56,377	金融
LKQ CORP	33	160	17,692	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5.47	82	9,036	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	36.65	277	30,553	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	31.47	412	45,379	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13.48	343	37,792	金融
DOLLAR GENERAL CORP	30.52	639	70,420	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	24.19	1,232	135,665	情報技術
CATERPILLAR INC	65.72	1,439	158,485	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	28.86	150	16,562	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	24.78	120	13,277	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	6.4	227	25,040	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	33.84	204	22,468	公益事業
MOSAIC CO/THE	52.09	172	19,002	素材
DELTA AIR LINES INC	16.5	75	8,339	資本財・サービス
CORNING INC	99.83	413	45,573	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	504.61	2,733	300,982	情報技術
MORGAN STANLEY	170.09	1,543	169,905	金融
ZILLOW GROUP INC - A	10.16	118	13,044	コミュニケーション・サービス
MSCI INC	10.06	493	54,361	金融
FAIR ISAAC CORP	3.98	201	22,157	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	4.5	150	16,530	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	27.8	205	22,648	情報技術
BROADCOM INC	48.76	2,320	255,471	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14.16	235	25,984	ヘルスケア
ARAMARK	31.73	119	13,150	一般消費財・サービス
DTE ENERGY COMPANY	22.81	315	34,755	公益事業
CENTENE CORP	68.44	470	51,832	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	13.58	155	17,159	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	55.32	260	28,689	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	22.32	322	35,503	金融
GARTNER INC	11.74	269	29,682	情報技術
SPLUNK INC	20.29	248	27,343	情報技術
DOMINION ENERGY INC	97.4	762	83,942	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	47.68	445	49,035	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	14	96	10,611	資本財・サービス
DEERE & CO	36.23	1,215	133,856	資本財・サービス
POOL CORP	4.38	188	20,784	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	35.67	685	75,492	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	8.92	143	15,770	情報技術
CABLE ONE INC	0.6	108	11,958	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	7.66	237	26,136	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	14.27	249	27,522	金融
VAIL RESORTS INC	5.53	178	19,654	一般消費財・サービス
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	8.94	110	12,122	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	108	11,913	金融
CONSOLIDATED EDISON INC	37.8	293	32,360	公益事業
COGNEX CORP	24.39	195	21,522	情報技術
TELEFLEX INC	5.63	222	24,530	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	9.79	161	17,744	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8.52	294	32,378	ヘルスケア

銘柄	2021年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BIO-RAD LABORATORIES-A	3	182	20,040	ヘルスケア
CATALENT INC	20	219	24,131	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17.57	533	58,793	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	8	194	21,459	ヘルスケア
IDEX CORP	11.56	255	28,108	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	97.15	810	89,225	生活必需品
ROLLINS INC	26.85	90	9,945	資本財・サービス
AMETEK INC	25.97	353	38,941	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	30.47	257	28,363	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	16.44	76	8,406	資本財・サービス
HEICO CORP	5.35	76	8,454	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	10.6	157	17,326	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	7.16	254	27,994	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4.8	157	17,335	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	34.22	371	40,889	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	5.09	222	24,494	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	52.63	2,019	222,392	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	11.28	127	14,071	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	7.49	380	41,913	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	17.5	159	17,527	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3.53	491	54,079	一般消費財・サービス
UGI CORP	20.85	98	10,801	公益事業
CUMMINS INC	17.63	437	48,228	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	93.22	924	101,802	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	17.92	303	33,405	情報技術
COSTAR GROUP INC	4.92	432	47,660	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	6.9	376	41,463	金融
AMERCO	0.7	37	4,168	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	12.39	309	34,124	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	5.56	796	87,707	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	136	15,052	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	38.01	488	53,826	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	2.5	51	5,694	情報技術
DEXCOM INC	11.88	485	53,513	ヘルスケア
NORDSON CORP	7.5	165	18,274	資本財・サービス
COPART INC	24.95	313	34,527	資本財・サービス
SEAGEN INC	15.45	241	26,588	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	9.63	583	64,233	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	6.98	466	51,410	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	5.07	227	25,086	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	12.03	119	13,195	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	24.57	227	25,041	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	278.51	524	57,776	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	32.61	677	74,636	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4.2	190	21,028	金融
T-MOBILE US INC	67.53	980	108,011	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	17.86	202	22,336	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	496.97	2,760	303,977	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	25.75	159	17,508	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.46	242	26,752	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	38.51	130	14,383	金融
CSX CORP	94.51	919	101,244	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11.66	302	33,359	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	15.63	264	29,109	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	8	83	9,147	一般消費財・サービス
AMAZON. COM INC	51.32	17,366	1,912,172	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	73.71	744	81,941	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	515.19	3,197	352,108	エネルギー
AES CORP	83.41	214	23,640	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	5.71	145	15,971	金融
EOG RESOURCES INC	76.55	649	71,527	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	19.14	225	24,868	情報技術
ABIOMED INC	5.55	168	18,508	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	19.89	236	26,002	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	36.83	531	58,555	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	475.97	707	77,932	一般消費財・サービス
NOVAVAX INC	9.75	202	22,299	ヘルスケア
DISCOVERY INC - A	15.21	46	5,161	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	22.19	277	30,544	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	67	7,384	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	5.95	94	10,418	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	45.54	131	14,461	コミュニケーション・サービス
FORTINET INC	15.95	369	40,650	情報技術
MARKEL CORP	1.77	213	23,462	金融
NEXTERA ENERGY INC	233.09	1,708	188,154	公益事業
MASIMO CORP	6.93	156	17,201	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	168.81	666	73,384	素材
INSULET CORP	7.69	218	24,043	ヘルスケア

銘柄	2021年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
US BANCORP	163.13	948	104,468	金融
UNITED RENTALS INC	7.66	232	25,554	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	6.59	126	13,912	情報技術
FASTENAL CO	67.16	354	38,993	資本財・サービス
FISERV INC	68.33	745	82,092	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	1,050.48	1,414	155,805	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	154.98	942	103,737	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	13.05	184	20,263	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	28.75	548	60,413	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	38.84	1,448	159,485	金融
ALPHABET INC-CL A	36	8,816	970,738	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	35.38	8,940	984,456	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	17.63	170	18,793	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	78.49	491	54,145	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	58.4	226	24,943	公益事業
GENUINE PARTS CO	17.7	225	24,870	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	44.17	485	53,426	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	81	320	35,265	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	24.78	550	60,622	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	102.3	241	26,583	エネルギー
HOME DEPOT INC	129.56	4,007	441,271	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	8.4	135	14,875	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	107.75	154	17,049	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5	109	12,101	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	17.25	301	33,176	生活必需品
HUMANA INC	15.69	651	71,717	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	33.62	684	75,359	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9.17	251	27,746	情報技術
HENRY SCHEIN INC	18.7	144	15,943	ヘルスケア
HP INC	174.43	512	56,447	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	141.15	221	24,432	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	13.95	63	7,013	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	27.62	125	13,776	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20.28	93	10,240	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	50.11	196	21,595	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	83.9	359	39,558	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	15.58	230	25,329	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	106.28	1,594	175,572	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	252	27,761	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	146	16,177	資本財・サービス
ZOETIS INC	56.14	1,036	114,099	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	29.08	531	58,471	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	24.84	220	24,293	エネルギー
ALLEGION PLC	11.1	153	16,904	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	51.08	142	15,652	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	34.31	417	45,961	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	49.12	140	15,419	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	13.93	189	20,875	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	317.05	5,243	577,312	ヘルスケア
PLUG POWER INC	62.51	191	21,041	資本財・サービス
ABBVIE INC	214.9	2,479	273,066	ヘルスケア
HOLOGIC INC	30.42	192	21,232	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	39.87	516	56,860	生活必需品
KROGER CO	100.13	384	42,337	生活必需品
KLA CORP	19.19	624	68,717	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	29.82	1,160	127,763	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	9.76	263	29,021	情報技術
L BRANDS INC	28.72	188	20,789	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	89.72	1,701	187,366	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	97.08	2,194	241,689	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	17.56	1,141	125,725	情報技術
LOEWS CORP	35.91	200	22,071	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	26.43	175	19,283	金融
MCDONALD'S CORP	90.35	2,141	235,758	一般消費財・サービス
3M CO	69.02	1,389	153,029	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	289.09	9,735	1,071,996	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	29.23	1,158	127,572	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7.67	266	29,331	素材
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	5.75	139	15,376	情報技術
PHILLIPS 66	51.07	466	51,419	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	56.59	238	26,307	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	29.92	266	29,386	生活必需品
METLIFE INC	90.65	573	63,192	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	86.17	463	51,046	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	5.93	216	23,826	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	12.03	75	8,319	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22.32	471	51,954	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.84	383	42,273	ヘルスケア

銘柄	2021年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BAKER HUGHES CO	84.46	208	23,007	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	14.6	411	45,286	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	306.58	2,313	254,700	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	66.57	542	59,776	素材
MASCO CORP	35.43	208	22,958	資本財・サービス
M & T BANK CORP	13.71	209	23,030	金融
MARSH & MCLENNAN COS	64.53	901	99,212	金融
BLACK KNIGHT INC	16.44	121	13,424	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	10.18	133	14,693	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	33.61	483	53,254	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	21.23	493	54,298	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	8.8	279	30,758	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	47.24	1,091	120,130	情報技術
TRANSUNION	22.93	244	26,960	資本財・サービス
VISTRA CORP	42.85	78	8,676	公益事業
NOVOCURE LTD	10.54	231	25,523	ヘルスケア
NETAPP INC	27.03	224	24,700	情報技術
NIKE INC -CL B	150.87	1,981	218,219	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	29.93	812	89,481	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	30.85	480	52,910	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17.49	225	24,845	金融
ALLY FINANCIAL INC	50.94	272	29,957	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	18.35	683	75,209	資本財・サービス
APTIV PLC	32.32	508	56,039	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	92.52	646	71,138	素材
MCKESSON CORP	18.5	356	39,296	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	32.57	339	37,343	情報技術
XYLEM INC	19.72	231	25,463	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	187.91	1,888	207,942	生活必需品
NUCOR CORP	36.92	379	41,754	素材
SUNRUN INC	15	69	7,622	資本財・サービス
WESTERN UNION CO	43.5	107	11,854	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	19.3	164	18,148	情報技術
NEWELL BRANDS INC	40.58	110	12,216	一般消費財・サービス
EVERGY INC	32.43	207	22,824	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	102.38	289	31,880	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	51	5,669	金融
OKTA INC	16.34	372	40,983	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	8.8	210	23,168	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	18.78	304	33,499	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	48.77	163	17,978	ヘルスケア
LINDE PLC	61.08	1,776	195,652	素材
WIX. COM LTD	7.85	223	24,628	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	61.84	192	21,217	金融
KKR & CO INC	64.89	358	39,504	金融
PAYCHEX INC	36.57	382	42,075	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9.16	487	53,700	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	220.86	1,061	116,925	生活必需品
P G & E CORP	155.15	165	18,193	公益事業
PFIZER INC	676.15	2,679	295,048	ヘルスケア
CIGNA CORP	43.18	1,034	113,914	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	32.76	336	37,060	情報技術
ALTICE USA INC- A	41.47	144	15,908	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	65.28	450	49,654	公益事業
STERIS PLC	8.97	177	19,592	ヘルスケア
FOX CORP - CLASS B	15.3	55	6,058	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	52.67	198	21,852	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	40.86	1,044	115,037	ヘルスケア
LYFT INC-A	36.49	213	23,468	資本財・サービス
DOW INC	87.18	583	64,277	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	15.08	127	14,017	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	23.63	864	95,206	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	15.38	456	50,281	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	151.86	770	84,894	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	22.03	357	39,328	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	296.51	4,000	440,463	生活必需品
EXELON CORP	118.82	559	61,635	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	26.52	481	53,043	ヘルスケア
TELADOC HEALTH INC	13.4	211	23,235	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	41.75	198	21,849	資本財・サービス
NVR INC	0.45	210	23,148	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	167.66	1,011	111,338	エネルギー
TWILIO INC - A	16.22	556	61,271	情報技術
DOCUSIGN INC	22.52	579	63,792	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	6.01	204	22,567	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	14.7	131	14,426	情報技術
PEPSICO INC	167.68	2,491	274,308	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4.09	57	6,291	情報技術

銘柄	2021年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DROPBOX INC-CLASS A	23.92	70	7,775	情報技術
MONGODB INC	7.91	274	30,193	情報技術
SNAP INC - A	116.75	742	81,721	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	85.3	374	41,288	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	43.55	454	50,072	金融
AMCOR PLC	174.57	212	23,354	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	23.36	545	60,067	情報技術
ROKU INC	12.92	471	51,905	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20.92	335	36,966	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	76.08	2,173	239,344	情報技術
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	58.76	263	29,044	情報技術
10X GENOMICS INC-CLASS A	8.18	156	17,218	ヘルスケア
PENTAIR PLC	15.75	105	11,602	資本財・サービス
QUALCOMM INC	136.14	1,869	205,832	情報技術
INVESCO LTD	37	106	11,721	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	8.19	162	17,908	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31.93	205	22,585	金融
DATADOG INC - CLASS A	25.36	246	27,155	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	60.73	417	45,919	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	12.57	176	19,395	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	11.97	632	69,690	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	26.67	292	32,197	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	5.01	1,154	127,157	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	41.1	489	53,953	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	9.98	138	15,259	素材
RESMED INC	16.6	384	42,350	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	18.12	232	25,546	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	14.99	135	14,967	資本財・サービス
MODERNA INC	32.91	682	75,159	ヘルスケア
HUBSPOT INC	5.64	303	33,364	情報技術
PERKINELMER INC	11.63	171	18,843	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	97.33	449	49,523	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	48.66	393	43,292	資本財・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	23	132	14,564	金融
AVANTOR INC	56	186	20,557	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	14.76	64	7,074	金融
DYNATRACE INC	23.39	131	14,463	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	5.4	324	35,768	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	108.25	229	25,245	金融
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	14.76	65	7,251	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	10.21	156	17,266	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	31.62	454	50,087	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	234.68	2,533	279,001	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A	31.74	355	39,174	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	7.34	155	17,087	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	49.85	292	32,209	公益事業
ETSY INC	16.62	283	31,165	一般消費財・サービス
TESLA INC	91.17	5,631	620,082	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3.63	88	9,760	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	79.44	226	24,885	情報技術
DRAFTKINGS INC - CL A	23.94	121	13,343	一般消費財・サービス
UNITY SOFTWARE INC	11.5	117	12,953	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	18.95	384	42,345	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	17.76	473	52,113	情報技術
CARVANA CO	7	195	21,480	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	8.56	64	7,075	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	29.34	280	30,897	情報技術
PPD INC	19.37	90	9,924	ヘルスケア
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	16.74	1,156	127,296	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	137.45	214	23,655	ヘルスケア
AIRBNB INC-CLASS A	6.74	100	11,073	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	38.49	337	37,168	不動産
TWITTER INC	89.65	545	60,047	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	123.74	789	86,913	公益事業
SYSCO CORP	61.6	489	53,855	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	29.58	453	49,914	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6	93	10,241	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	19.25	120	13,215	金融
STEEL DYNAMICS INC	23	145	15,987	素材
SCHLUMBERGER LTD	178.99	609	67,107	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	120	13,302	資本財・サービス
AT&T INC	865.85	2,518	277,340	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	17.58	100	11,087	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	44.52	170	18,784	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	25.95	276	30,465	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	30.57	836	92,149	素材
SEMPRA ENERGY	34.5	494	54,417	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	22.64	143	15,812	情報技術

銘柄	2021年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CLARIVATE PLC	47.21	124	13,681	資本財・サービス
OAK STREET HEALTH INC	16.54	94	10,417	ヘルスケア
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	72.16	180	19,863	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	26.06	246	27,162	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	110.39	2,100	231,261	情報技術
SALESFORCE.COM INC	109.6	2,699	297,187	情報技術
WESTROCK CO	26.18	144	15,932	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	83.22	550	60,624	資本財・サービス
TERADYNE INC	20.96	275	30,344	情報技術
UNION PACIFIC CORP	80.74	1,797	197,915	資本財・サービス
MARATHON PETROLEUM CORP	81.28	511	56,374	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	182.23	1,616	178,019	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	87.73	1,764	194,251	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	24.35	595	65,546	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	18	114	12,579	金融
AMEREN CORPORATION	28.61	245	27,041	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	113.54	4,532	499,025	ヘルスケア
VERISIGN INC	13.65	300	33,091	情報技術
VALERO ENERGY CORP	45.84	375	41,363	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	6.35	213	23,548	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	141	15,543	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9.92	155	17,080	ヘルスケア
ANTHEM INC	29.98	1,149	126,600	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	218.9	3,900	429,468	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	468.32	2,114	232,823	金融
WASTE MANAGEMENT INC	50.34	706	77,739	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	145.42	400	44,065	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	15.91	291	32,085	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	8.7	192	21,180	一般消費財・サービス
WALMART INC	189.5	2,663	293,290	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	24.92	392	43,230	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	11.45	143	15,753	一般消費財・サービス
WABTEC CORP	18.98	153	16,850	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	140.79	916	100,967	一般消費財・サービス
WATERS CORP	7.6	255	28,132	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5.55	283	31,161	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	86.95	473	52,111	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14.52	371	40,948	金融
WESTERN DIGITAL CORP	35.31	263	29,047	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	41.89	388	42,753	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	58.55	362	39,867	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	203.28	4,758	523,945	情報技術
PPL CORP	101.94	298	32,843	公益事業
PULTEGROUP INC	35.56	190	20,959	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	28.34	497	54,727	素材
NORTHERN TRUST CORP	22.6	263	28,983	金融
NVIDIA CORP	74.38	5,360	590,292	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	51.6	965	106,309	金融
TYSON FOODS INC-CL A	33.22	256	28,293	生活必需品
NETFLIX INC	53.69	2,683	295,525	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	47.61	2,238	246,426	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	30	111	12,248	公益事業
GLOBE LIFE INC	12.15	125	13,775	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	19.53	363	40,037	金融
TEXTRON INC	28.31	190	20,932	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	37.49	98	10,860	コミュニケーション・サービス
OMNICOM GROUP	25.46	210	23,147	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	231.85	1,915	210,920	情報技術
MASTERCARD INC - A	106.86	3,916	431,260	情報技術
ONEOK INC	45.66	253	27,873	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	110.62	164	18,087	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	12.69	589	64,873	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	36.01	425	46,811	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	14.13	263	29,055	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	22.06	131	14,515	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	936.07	3,871	426,300	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4.18	177	19,552	資本財・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16.49	136	14,976	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	81.72	1,338	147,399	金融
ANALOG DEVICES INC	44.29	746	82,144	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	146.31	1,193	131,378	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	100.84	515	56,738	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	19.4	337	37,132	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	21.47	188	20,791	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	11.31	241	26,595	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	65.6	464	51,133	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	71.75	698	76,934	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	26.4	660	72,690	金融

銘柄	2021年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AMGEN INC	69.99	1,688	185,875	ヘルスケア
EATON CORP PLC	50.56	738	81,280	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	21.81	515	56,764	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	107.42	1,493	164,444	情報技術
CME GROUP INC	42.9	929	102,362	金融
ECOLAB INC	30.31	646	71,167	素材
EQUIFAX INC	14.41	329	36,311	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	148.98	1,015	111,794	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	92.36	321	35,441	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	33.15	162	17,852	生活必需品
STATE STREET CORP	41.52	352	38,764	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	171.78	1,236	136,204	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	65.68	543	59,859	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	21.66	99	10,927	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	15.97	159	17,603	素材
CARDINAL HEALTH INC	33.19	193	21,316	ヘルスケア
FEDEX CORP	29.79	872	96,105	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	54.87	870	95,888	金融
FMC CORP	13.6	161	17,739	素材
CERNER CORP	41.33	333	36,720	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	21.05	311	34,250	素材
CITRIX SYSTEMS INC	14.12	170	18,759	情報技術
INTEL CORP	491.24	2,858	314,752	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	52.31	175	19,370	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	48.66	314	34,671	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	37.68	875	96,433	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	153	103	11,371	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	17.87	807	88,966	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	14.5	84	9,356	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	13.9	1,213	133,583	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	13.3	160	17,715	情報技術
SNAP-ON INC	5	117	12,951	資本財・サービス
CARMAX INC	19.9	235	25,877	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP	89.87	921	101,459	公益事業
TARGET CORP	60	1,398	153,980	一般消費財・サービス
DOVER CORP	17.13	257	28,356	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	5.88	267	29,445	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17.5	242	26,699	資本財・サービス
CINTAS CORP	11.62	410	45,198	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	55.67	208	22,968	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	15	125	13,779	生活必需品
CLOROX COMPANY	16.28	283	31,232	生活必需品
ENTERGY CORP	22.43	244	26,895	公益事業
MICROSOFT CORP	858.66	22,315	2,457,183	情報技術
INCYTE CORP	26.89	222	24,468	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	160.17	1,355	149,238	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	162.42	2,016	222,030	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	135.86	1,093	120,409	情報技術
BLACKROCK INC	18.32	1,606	176,865	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	56.36	146	16,122	公益事業
HASBRO INC	14.49	138	15,236	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	36.9	241	26,568	生活必需品
KEYCORP	117.82	253	27,931	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	11.76	343	37,857	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	173.19	1,104	121,647	生活必需品
COOPER COS INC/THE	6.47	243	26,825	ヘルスケア
CHUBB LTD	54.52	907	99,929	金融
ARROW ELECTRONICS INC	10	119	13,147	情報技術
ALLSTATE CORP	34.77	455	50,146	金融
EBAY INC	83.08	547	60,275	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	133.65	3,674	404,592	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	14.92	182	20,059	素材
XILINX INC	28.92	371	40,865	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	29.84	119	13,152	コミュニケーション・サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	27.83	843	92,917	生活必需品
TRIMBLE INC	29.38	231	25,488	情報技術
LENNAR CORP-A	33.94	312	34,396	一般消費財・サービス
LEAR CORP	6	112	12,379	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	73.91	688	75,783	金融
PACCAR INC	41.7	379	41,815	資本財・サービス
BIOGEN INC	19.48	791	87,114	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	10.24	606	66,790	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	142.74	1,605	176,738	一般消費財・サービス
PTC INC	12	165	18,189	情報技術
EVERSOURCE ENERGY	42.9	354	38,994	公益事業
INTUIT INC	31.48	1,501	165,330	情報技術
BORGWARNER INC	30.81	160	17,630	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	29.87	340	37,504	一般消費財・サービス

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
BALL CORP		38.6	313	34,477	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP		168.55	717	78,950	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC		36.77	546	60,144	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO		16.06	275	30,368	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		32.07	624	68,788	ヘルスケア
VF CORP		42.16	343	37,769	一般消費財・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B		72.02	307	33,806	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC		6.28	118	13,016	一般消費財・サービス
CARNIVAL CORP		99.86	287	31,612	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A		546.43	3,129	344,638	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		16	100	11,058	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		231	113	12,539	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	37,996.54	451,174	49,678,817	
	銘柄数<比率>	599銘柄		<67.2%>	
		百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)					
IMPERIAL OIL LTD		23	94	8,549	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		2.5	452	41,019	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN		37.21	307	27,870	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		63	365	33,163	素材
INTACT FINANCIAL CORP		17	285	25,847	金融
BCE INC		9	54	4,959	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP		22	406	36,862	素材
SUNCOR ENERGY INC		173.48	531	48,184	エネルギー
METRO INC/CN		30	175	15,900	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA		39.41	359	32,595	金融
BANK OF NOVA SCOTIA		150.75	1,218	110,508	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		57	822	74,626	金融
TORONTO-DOMINION BANK		218.2	1,896	172,002	金融
GREAT-WEST LIFECO INC		39	141	12,830	金融
ROYAL BANK OF CANADA		172.1	2,175	197,275	金融
TC ENERGY CORP		113.04	725	65,766	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		63.75	257	23,389	エネルギー
BARRICK GOLD CORP		218.48	614	55,690	素材
CAE INC		23	88	8,023	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP		22.84	273	24,756	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'		18	75	6,870	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD		10.34	88	8,033	素材
BALLARD POWER SYSTEMS INC		32.06	69	6,296	資本財・サービス
CCL INDUSTRIES INC - CL B		15.6	107	9,731	素材
HYDRO ONE LTD		48	147	13,410	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD		24.89	189	17,151	生活必需品
WSP GLOBAL INC		12	168	15,320	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD		9.74	104	9,495	資本財・サービス
PARKLAND CORP		28	111	10,143	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B		23	74	6,753	コミュニケーション・サービス
EMERA INC		27.31	156	14,219	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A		10	35	3,259	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B		43.06	269	24,427	コミュニケーション・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A		142.61	125	11,341	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD		29	249	22,655	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES		70	137	12,479	公益事業
B2GOLD CORP		164	97	8,848	素材
AIR CANADA		17	48	4,368	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP		147.57	139	12,605	素材
BANK OF MONTREAL		82	1,037	94,062	金融
POWER CORP OF CANADA		63	248	22,565	金融
SHOPIFY INC - CLASS A		12.95	2,053	186,224	情報技術
NUTRIEN LTD		69.06	534	48,476	素材
CANOPY GROWTH CORP		20	60	5,524	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD		31.93	166	15,114	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A		15.32	79	7,223	公益事業
CAMECO CORP		28	65	5,943	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP		4.22	87	7,977	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT		24.05	96	8,767	資本財・サービス
LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE		15.6	143	13,051	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG		10	85	7,783	情報技術
TELUS CORP		6	16	1,503	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B		44	123	11,167	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A		7.43	150	13,658	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES		152	692	62,755	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		3	166	15,118	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC		31	363	32,954	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD		9.01	107	9,729	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP		12.18	46	4,216	素材
BLACKBERRY LTD		64	109	9,906	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC		72.66	461	41,852	金融
ENBRIDGE INC		241.32	1,192	108,167	エネルギー

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	千カナダ・ドル	千円	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	159.13	958	86,882	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	221.84	545	49,466	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	43	164	14,918	ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	80.45	787	71,420	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	11	75	6,808	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	28	120	10,922	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	87.93	1,185	107,458	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	28	309	28,056	情報技術
ONEX CORPORATION	16	137	12,428	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	68	245	22,278	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	3	13	1,215	金融
TMX GROUP LTD	7.94	104	9,456	金融
OPEN TEXT CORP	32.1	194	17,639	情報技術
SAPUTO INC	29	106	9,651	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63	176	16,024	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	100.13	453	41,122	生活必需品
YAMANA GOLD INC	119	73	6,636	素材
FORTIS INC	62	351	31,860	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	13.55	97	8,884	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	66	84	7,630	素材
CENOVUS ENERGY INC	141	171	15,560	エネルギー
DOLLARAMA INC	35.29	195	17,734	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	8	36	3,309	公益事業
ALTAGAS LTD	47	118	10,752	公益事業
KEYERA CORP	22	76	6,940	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	48	96	8,770	エネルギー
カナダ・ドル通貨計 株数、金額	4,926.03	28,615	2,594,814	
銘柄数<比率>	88銘柄		<3.5%>	
	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
(オーストラリア)				
MEDIBANK PRIVATE LTD	228.24	70	5,949	金融
BHP GROUP LTD	365.48	1,789	151,906	素材
SOUTH32 LTD	563.87	166	14,124	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	105.76	249	21,210	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	205.54	477	40,524	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	373.41	988	83,894	金融
WESTPAC BANKING CORP	442.7	1,163	98,823	金融
SANTOS LTD	182.7	140	11,898	エネルギー
AUSNET SERVICES	285	51	4,392	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	351.9	994	84,410	金融
RIO TINTO LTD	41.69	520	44,227	素材
ORIGIN ENERGY LTD	209.68	101	8,617	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD	290.47	112	9,594	資本財・サービス
XERO LTD	14.26	191	16,234	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	9.53	29	2,538	エネルギー
COLES GROUP LTD	166.96	278	23,632	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	25.09	77	6,540	情報技術
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	81.83	94	7,990	素材
EVOLUTION MINING LTD	170.17	86	7,340	素材
AFTERPAY LTD	30	310	26,369	情報技術
REECE LTD	63.58	144	12,254	資本財・サービス
OIL SEARCH LTD	173.45	71	6,038	エネルギー
SEEK LTD	26	81	6,945	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	101.73	121	10,296	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	119.81	339	28,820	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	218.56	2,215	188,103	金融
AMPOL LTD	20	58	4,982	エネルギー
ORICA LTD	58.45	83	7,102	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	153.48	173	14,752	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD	139.06	596	50,666	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	173.52	86	7,381	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	30	36	3,112	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	63.73	30	2,548	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	351.14	125	10,673	コミュニケーション・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	67.33	299	25,463	素材
MACQUARIE GROUP LTD	42.77	648	55,040	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	61.63	250	21,298	一般消費財・サービス
CSL LTD	55.5	1,646	139,791	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	137.98	758	64,437	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	8.05	189	16,084	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	70.92	161	13,741	素材
SUNCORP GROUP LTD	145.04	162	13,817	金融
ASX LTD	22.6	167	14,204	金融
COMPUTERSHARE LTD	60.54	97	8,255	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	141	12,010	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	52.23	185	15,788	ヘルスケア
AGL ENERGY LTD	84.66	78	6,699	公益事業
BRAMBLES LTD	183.37	206	17,516	資本財・サービス

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
RAMSAY HEALTH CARE LTD		20.64	131	11,149	ヘルスケア
REA GROUP LTD		6.08	101	8,605	コミュニケーション・サービス
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD		15.51	77	6,600	金融
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		12.88	148	12,609	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	7,155.49	17,512	1,487,012	
	銘柄数<比率>	52銘柄		<2.0%>	
		百株	千香港・ドル	千円	
(香港)					
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		235	1,143	16,223	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		230	1,436	20,381	一般消費財・サービス
MTR CORP		165	716	10,161	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES		190	2,318	32,892	不動産
SINO LAND CO		340	423	6,011	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		375.52	2,245	31,865	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		80	462	6,555	不動産
CLP HOLDINGS LTD		170	1,337	18,972	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		205.65	787	11,176	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		1,720.27	2,119	30,073	公益事業
HANG SENG BANK LTD		80	1,273	18,072	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT		175	738	10,479	不動産
WH GROUP LTD		1,695	1,215	17,245	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		149	6,976	98,991	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD		370	731	10,374	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD		86	134	1,903	金融
XINYI GLASS HOLDINGS LTD		260	783	11,123	資本財・サービス
SJM HOLDINGS LTD		100	88	1,250	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		80	190	2,696	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD		285.52	1,500	21,290	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		55	264	3,753	公益事業
AIA GROUP LTD		1,500	14,340	203,484	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		200	904	12,827	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		192	504	7,151	生活必需品
ESR CAYMAN LTD		180	438	6,219	不動産
SANDS CHINA LTD		290	984	13,970	一般消費財・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU		610	946	13,433	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		190	2,673	37,934	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		450	1,246	17,687	金融
WYNN MACAU LTD		168	220	3,132	一般消費財・サービス
香港・ドル通貨計	株数、金額	10,826.96	49,142	697,339	
	銘柄数<比率>	30銘柄		<0.9%>	
		百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)					
UNITED OVERSEAS BANK LTD		129	335	27,813	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD		233	691	57,352	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD		177.5	91	7,556	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD		173	89	7,437	資本財・サービス
UOL GROUP LTD		30	22	1,839	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		52	39	3,271	不動産
CAPITALAND LTD		334	125	10,422	不動産
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		447	546	45,369	金融
GENTING SINGAPORE LTD		450	39	3,305	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD		32	60	5,045	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		1,284	299	24,828	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING		141	54	4,551	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD		168	179	14,932	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD		158	75	6,254	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額	3,808.5	2,650	219,980	
	銘柄数<比率>	14銘柄		<0.3%>	
		百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
(ニュージーランド)					
MERIDIAN ENERGY LTD		150	80	6,299	公益事業
MERCURY NZ LTD		32.94	21	1,665	公益事業
A2 MILK CO LTD		70	44	3,462	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD		168.6	80	6,364	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		132.89	98	7,764	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		92	267	21,075	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD		44.19	57	4,535	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額	690.62	650	51,166	
	銘柄数<比率>	7銘柄		<0.1%>	
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)					
BP PLC		2,510.81	829	128,907	エネルギー
UNILEVER PLC		316.3	1,358	211,098	生活必需品
BARCLAYS PLC		2,037.15	365	56,789	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		1,247.05	133	20,804	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC		314.21	466	72,505	金融
NATWEST GROUP PLC		508.36	104	16,201	金融
EVRAZ PLC		74.41	47	7,326	素材

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
JOHNSON MATTHEY PLC		17.58	54	8,408	素材
BAE SYSTEMS PLC		377.96	201	31,350	資本財・サービス
AVIVA PLC		510.81	212	33,091	金融
AVEVA GROUP PLC		11.4	40	6,263	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC		629.03	885	137,566	ヘルスケア
INFORMA PLC		162	85	13,341	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC		643.35	107	16,650	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC		144.99	91	14,193	コミュニケーション・サービス
DCC PLC		9.38	57	8,861	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC		62.34	118	18,342	一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		7.4	97	15,172	資本財・サービス
HALMA PLC		39.78	111	17,252	情報技術
ENTAIN PLC		88.05	159	24,785	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC		64.11	58	9,087	一般消費財・サービス
M&G PLC		259.64	63	9,852	金融
RELX PLC		242.03	462	71,814	資本財・サービス
DIAGEO PLC		278.8	957	148,791	生活必需品
RIO TINTO PLC		136.27	830	128,998	素材
STANDARD CHARTERED PLC		319.51	156	24,392	金融
TESCO PLC		867.91	201	31,254	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC		112.97	175	27,200	ヘルスケア
GLENCORE PLC		1,292.26	423	65,793	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC		32	52	8,137	金融
SMITHS GROUP PLC		40.8	65	10,156	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		168.79	49	7,737	金融
PEARSON PLC		82.71	70	10,937	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC		176.31	44	6,953	生活必需品
NEXT PLC		16.85	135	21,124	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC		322.36	53	8,380	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC		17.85	58	9,028	一般消費財・サービス
BUNZL PLC		31.59	72	11,216	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC		3,082.5	400	62,268	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		17.49	124	19,339	素材
KINGFISHER PLC		172.29	59	9,217	一般消費財・サービス
WPP PLC		130.21	130	20,273	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC		82.44	84	13,156	公益事業
SEVERN TRENT PLC		43	108	16,831	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC		222.42	109	16,938	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		84.24	553	85,949	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC		48.83	70	10,986	金融
SCHRODERS PLC		12.27	43	6,808	金融
SSE PLC		124.6	196	30,581	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		123.68	90	14,052	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC		156.59	1,307	203,127	ヘルスケア
FERGUSON PLC		27.24	262	40,728	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		682.32	188	29,358	金融
3I GROUP PLC		132.93	165	25,644	金融
ASHTEAD GROUP PLC		59.21	301	46,794	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE		115.48	77	11,994	情報技術
NATIONAL GRID PLC		451.05	414	64,481	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC		8,652.13	413	64,318	金融
IMPERIAL BRANDS PLC		108.06	173	26,992	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE		19.63	89	13,942	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		270.86	757	117,659	生活必需品
BHP GROUP PLC		269.34	579	90,067	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		49.64	113	17,679	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC		2,448.46	1,075	167,195	金融
ANGLO AMERICAN PLC		146.45	455	70,830	素材
MONDI PLC		59.21	115	17,987	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS		391.67	69	10,754	生活必需品
COMPASS GROUP PLC		219.92	354	55,019	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC		26.88	83	12,969	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC		1,027.57	197	30,633	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI		25.74	67	10,543	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC		51.36	113	17,709	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		7.92	39	6,200	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC		18.97	102	15,976	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		37.5	291	45,276	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		495.26	722	112,236	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		446.23	621	96,631	エネルギー
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		20.39	50	7,810	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC		15.7	48	7,587	金融
ANTOFAGASTA PLC		34.6	53	8,236	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		330.46	94	14,624	金融
EXPERIAN PLC		121.19	327	50,939	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額	35,239.05	21,160	3,288,127	
	銘柄数<比率>	82銘柄		<4.4%>	

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千イスラエル・シュケル	千円	
(イスラエル)					
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		120	197	6,708	金融
AZRIELI GROUP LTD		5.3	127	4,336	不動産
ICL GROUP LTD		110.96	265	8,999	素材
ELBIT SYSTEMS LTD		3	127	4,308	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM		151.6	411	13,962	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL		190.43	491	16,666	金融
NICE LTD		8	588	19,960	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		18.83	191	6,502	金融
イスラエル・シュケル通貨計	株数、金額	608.12	2,400	81,446	
	銘柄数<比率>	8銘柄		<0.1%>	
		百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)					
UBS GROUP AG-REG		425.54	621	76,142	金融
ROCHE HOLDING AG-BR		2.8	102	12,539	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		1.3	112	13,775	素材
ADECCO GROUP AG-REG		17.54	112	13,825	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		86.19	2,945	360,570	ヘルスケア
SIKA AG-REG		16.9	496	60,789	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.01	92	11,373	生活必需品
ABB LTD-REG		221.39	686	84,106	資本財・サービス
SWISS RE AG		36.66	310	38,060	金融
NESTLE SA-REG		342.47	3,897	477,231	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG		2.34	326	39,964	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		2.02	53	6,590	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		301.22	288	35,307	金融
JULIUS BAER GROUP LTD		26.84	165	20,215	金融
SGS SA-REG		0.65	183	22,417	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		4.67	120	14,808	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG		6.65	91	11,198	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG		7.93	119	14,616	情報技術
ALCON INC		58.53	373	45,746	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR		5	161	19,741	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		17.92	665	81,505	金融
BALOISE HOLDING AG - REG		6.11	90	11,018	金融
CLARIANT AG-REG		15.68	30	3,711	素材
NOVARTIS AG-REG		258.66	2,168	265,502	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.56	117	14,438	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG		60.87	700	85,776	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG		2.76	144	17,740	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		7.84	64	7,957	金融
GEBERIT AG-REG		4.56	305	37,382	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG		1.13	477	58,520	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG		1.11	155	19,073	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG		6.72	219	26,853	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		21.65	250	30,720	情報技術
LONZA GROUP AG-REG		9.13	606	74,288	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG		4.5	28	3,443	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD		65.87	372	45,612	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		3.81	174	21,331	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		6.4	204	24,979	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG		9.46	88	10,863	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.17	148	18,211	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額	2,071.56	18,279	2,237,952	
	銘柄数<比率>	40銘柄		<3.0%>	
		百株	千デンマーク・クローネ	千円	
(デンマーク)					
NOVO NORDISK A/S-B		213.44	11,019	197,807	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S		72.36	835	14,995	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A		0.39	686	12,327	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		127.85	2,867	51,474	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S		11.59	604	10,843	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B		12.32	1,402	25,166	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES		29.81	1,351	24,255	素材
COLOPLAST-B		15.19	1,502	26,971	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S		27.98	4,047	72,649	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS		1.43	428	7,687	資本財・サービス
DEMANT A/S		13.14	451	8,108	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		0.66	1,210	21,727	資本財・サービス
PANDORA A/S		16.37	1,386	24,894	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S		12.62	710	12,744	素材
GENMAB A/S		9.19	2,484	44,588	ヘルスケア
ORSTED A/S		22.46	1,949	35,002	公益事業
AMBU A/S-B		20.91	491	8,816	ヘルスケア
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額	607.71	33,429	600,061	
	銘柄数<比率>	17銘柄		<0.8%>	

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
(ノルウェー)					
NORSK HYDRO ASA		130.5	708	9,371	素材
DNB ASA		128.38	2,426	32,076	金融
ORKLA ASA		74.83	658	8,701	生活必需品
TELENOR ASA		87.46	1,259	16,655	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA		142.48	2,737	36,194	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		27.56	1,298	17,164	素材
MOWI ASA		46.77	1,073	14,189	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		20	380	5,035	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS		17	594	7,861	コミュニケーション・サービス
ADEVINTA ASA		45.82	742	9,812	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額	720.8	11,880	157,064	
	銘柄数<比率>	10銘柄		<0.2%>	
		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)					
ICA GRUPPEN AB		12.97	527	6,973	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS		384.64	4,208	55,639	情報技術
VOLVO AB-B SHS		188.73	4,261	56,337	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES		40	877	11,596	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B		26	614	8,122	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB		218.8	1,708	22,590	生活必需品
TELE2 AB-B SHS		70.26	818	10,816	コミュニケーション・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		217.79	2,370	31,339	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		154.82	1,463	19,345	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		108.21	1,672	22,110	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		103.52	2,171	28,711	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B		82.01	1,144	15,129	素材
SKANSKA AB-B SHS		37.09	906	11,983	資本財・サービス
SANDVIK AB		146.57	3,240	42,841	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS		219.28	4,293	56,760	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		85.75	4,409	58,290	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS		39.23	913	12,073	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS		25	332	4,398	資本財・サービス
TELIA CO AB		364.21	1,338	17,697	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB		48.4	1,447	19,131	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS		48.13	2,114	27,958	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		111.35	2,911	38,494	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		14	477	6,314	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		6.71	389	5,148	不動産
LUNDBERGS AB-B SHS		9.48	524	6,930	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		9.24	257	3,400	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		167.16	1,498	19,809	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB		19	585	7,733	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B		72.6	2,113	27,938	生活必需品
EMBRACER GROUP AB		35.45	862	11,397	コミュニケーション・サービス
BOLIDEN AB		31.71	1,098	14,525	素材
EPIROC AB-A		86.6	1,559	20,613	資本財・サービス
EPIROC AB-B		40.15	640	8,471	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		54	633	8,373	一般消費財・サービス
NORDEA BANK ABP		373.92	3,530	46,673	金融
EQT AB		19.6	633	8,371	金融
EVOLUTION AB		20.64	3,281	43,384	一般消費財・サービス
SINCH AB		6.4	958	12,665	情報技術
KINNEVIK AB - B		36.41	1,180	15,600	金融
HEXAGON AB-B SHS		270.76	3,343	44,206	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		13	421	5,569	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額	4,019.59	67,736	895,472	
	銘柄数<比率>	41銘柄		<1.2%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ(アイルランド)					
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		30.55	141	18,884	素材
KINGSPAN GROUP PLC		16	125	16,757	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		18.22	193	25,870	生活必需品
CRH PLC		92	393	52,485	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		17.85	285	38,041	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額	174.62	1,139	152,039	
	銘柄数<比率>	5銘柄		<0.2%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ(オランダ)					
QIAGEN N.V.		25.21	98	13,198	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		114.2	507	67,741	ヘルスケア
NN GROUP NV		31	125	16,771	金融
HEINEKEN NV		31.23	306	40,934	生活必需品
AEGON NV		179.67	67	8,979	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		138.93	344	45,970	生活必需品
AKZO NOBEL N.V.		25.04	266	35,571	素材
KONINKLIJKE DSM NV		22.3	338	45,204	素材
WOLTERS KLUWER		33	267	35,653	資本財・サービス

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
ING GROEP NV		456.01	511	68,217	金融
KONINKLIJKE KPN NV		376.07	100	13,429	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		48.51	2,802	373,983	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA		40.3	43	5,764	金融
ADYEN NV		2.15	415	55,420	情報技術
JUST EAT TAKEAWAY		14	103	13,804	一般消費財・サービス
PROSUS NV		59.99	511	68,280	一般消費財・サービス
ASM INTERNATIONAL NV		6.02	163	21,803	情報技術
VOPAK		6.3	25	3,350	エネルギー
RANDSTAD NV		20.2	130	17,414	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		12.85	107	14,310	生活必需品
STMICROELECTRONICS NV		85.75	270	36,120	情報技術
AIRBUS SE		74.02	831	111,028	資本財・サービス
ARGENX SE		5.16	135	18,137	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		85	94	12,642	生活必需品
EXOR NV		10.88	75	10,108	金融
CNH INDUSTRIAL NV		116.91	167	22,294	資本財・サービス
STELLANTIS NV		248.03	420	56,163	一般消費財・サービス
FERRARI NV		17.22	289	38,664	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額	2,285.95	9,523	1,270,963	
	銘柄数<比率>	28銘柄		<1.7%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ベルギー）					
UCB SA		19.21	160	21,390	ヘルスケア
KBC GROUP NV		30.11	204	27,331	金融
COLRUYT SA		3.5	18	2,422	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		11.39	107	14,330	金融
SOLVAY SA		8.73	98	13,083	素材
UMICORE		22.7	112	14,995	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		89.26	576	76,961	生活必需品
AGEAS		16.54	81	10,895	金融
PROXIMUS		22.69	39	5,259	コミュニケーション・サービス
ELIA GROUP SA/NV		7	65	8,734	公益事業
SOFINA		2.39	84	11,226	金融
国小計	株数、金額	233.52	1,548	206,630	
	銘柄数<比率>	11銘柄		<0.3%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ルクセンブルグ）					
AROUNDTOWN SA		160.64	113	15,164	不動産
ARCELORMITTAL		80.31	216	28,856	素材
INPOST SA		57.91	88	11,833	資本財・サービス
EUROFINS SCIENTIFIC		14.8	128	17,208	ヘルスケア
TENARIS SA		47	45	6,111	エネルギー
国小計	株数、金額	360.66	593	79,174	
	銘柄数<比率>	5銘柄		<0.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フランス）					
TOTALENERGIES SE		299.62	1,224	163,475	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		21.46	277	36,972	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		55.29	778	103,932	素材
KERING		8.88	660	88,166	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		63.38	824	110,039	資本財・サービス
BOUYGUES SA		27.21	91	12,160	資本財・サービス
BNP PARIBAS		134	756	100,945	金融
NATIXIS		76.74	30	4,098	金融
THALES SA		14.04	120	16,132	資本財・サービス
DANONE		75.51	449	59,936	生活必需品
CARREFOUR SA		80.22	137	18,407	生活必需品
SUEZ		29.5	59	7,901	公益事業
VIVENDI		89.3	260	34,785	コミュニケーション・サービス
L'OREAL		29.56	1,136	151,696	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		69.75	395	52,814	資本財・サービス
LEGRAND SA		34.59	304	40,621	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA		27.44	486	64,943	生活必需品
EURAZEO SE		5.6	41	5,500	金融
SOCIETE GENERALE SA		110.65	291	38,953	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		32.96	2,216	295,843	一般消費財・サービス
ACCOR SA		18.5	64	8,561	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		19.81	313	41,901	情報技術
VALEO SA		37.03	104	13,945	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		29.18	164	21,993	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA		32.27	84	11,257	資本財・サービス
EIFFAGE		9.45	85	11,468	資本財・サービス
SODEXO SA		12.48	101	13,530	一般消費財・サービス
IPSEN		2.76	25	3,359	ヘルスケア
ORPEA		5.24	56	7,552	ヘルスケア
AMUNDI SA		4.37	32	4,370	金融
TELEPERFORMANCE		7.01	225	30,029	資本財・サービス

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
UBISOFT ENTERTAINMENT		9.77	58	7,801	コミュニケーション・サービス
FAURECIA		10.41	47	6,320	一般消費財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		3.99	153	20,478	ヘルスケア
SEB SA		2.16	33	4,430	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA		32.15	477	63,712	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA		0.22	22	3,006	資本財・サービス
WORLDLINE SA		31.35	247	33,038	情報技術
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		8.78	43	5,776	一般消費財・サービス
AXA SA		243.18	546	72,936	金融
EDENRED		30.07	150	20,136	情報技術
RENAULT SA		25.54	94	12,554	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL		3.65	436	58,256	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU		2.53	41	5,601	生活必需品
ATOS SE		9.46	51	6,870	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SE		16.33	317	42,375	情報技術
WENDEL		2.01	23	3,130	金融
ORANGE		257.92	269	35,968	コミュニケーション・サービス
ALSTOM		29.61	134	17,963	資本財・サービス
CNP ASSURANCES		13.49	19	2,622	金融
SANOFI		133.26	1,184	158,077	ヘルスケア
VINCI SA		63.18	606	80,949	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		73.51	192	25,652	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		146.09	181	24,287	金融
BIOMERIEUX		4.57	41	5,603	ヘルスケア
ENGIE		210.99	259	34,655	公益事業
EDF		67.6	81	10,811	公益事業
SAFRAN SA		39.31	483	64,577	資本財・サービス
ILIAD SA		2.19	29	3,943	コミュニケーション・サービス
ARKEMA		8.38	90	12,122	素材
ADP		3.5	44	5,913	資本財・サービス
SCOR SE		15.35	42	5,731	金融
GETLINK SE		49.73	64	8,627	資本財・サービス
BOLLORE		73	32	4,274	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額	3,087.08	18,310	2,443,508	
	銘柄数<比率>	64銘柄		<3.3%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ドイツ）					
BAYER AG-REG		115.83	616	82,249	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		18	50	6,802	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		255.58	295	39,455	金融
COMMERZBANK AG		96.89	62	8,313	金融
VOLKSWAGEN AG		4.2	124	16,635	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		22.72	522	69,765	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG		90.95	1,234	164,751	資本財・サービス
E. ON SE		300.06	305	40,715	公益事業
UNIPER SE		20.66	63	8,461	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		37.29	353	47,170	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		13	44	5,898	資本財・サービス
CONTINENTAL AG		14.74	189	25,319	一般消費財・サービス
BASF SE		112.83	758	101,244	素材
ALLIANZ SE-REG		50.14	1,086	144,964	金融
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		21.41	198	26,537	生活必需品
RWE AG		75.26	233	31,225	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		17	18	2,422	資本財・サービス
BRENNTAG SE		21.21	161	21,551	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		48.35	218	29,138	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		9.59	33	4,422	コミュニケーション・サービス
SAP SE		122.83	1,472	196,568	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		17.04	398	53,188	金融
ZALANDO SE		20.25	193	25,796	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG		21.28	158	21,207	素材
KION GROUP AG		6	53	7,188	資本財・サービス
COVESTRO AG		19.45	104	13,917	素材
RATIONAL AG		0.74	52	6,966	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG		3.88	160	21,467	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		21.02	204	27,265	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE		15.03	167	22,293	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		5.6	86	11,519	ヘルスケア
BECHTLE AG		2.73	42	5,690	情報技術
NEMETSCHEK SE		11.39	70	9,408	情報技術
SCOUT24 AG		14.6	97	13,054	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		28.94	140	18,815	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG		5.49	56	7,520	資本財・サービス
HELLOFRESH SE		18.14	151	20,281	一般消費財・サービス
TEAMVIEWER AG		14.61	47	6,315	情報技術
SIEMENS ENERGY AG		47.32	120	16,058	資本財・サービス
BEIERSDORF AG		12.75	127	17,065	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE-PREF		7	30	4,007	素材

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
MERCK KGAA		16.92	260	34,806	ヘルスケア
ADIDAS AG		21.88	641	85,552	一般消費財・サービス
PUMA SE		12.95	120	16,116	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		13.11	105	14,048	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		368.6	655	87,498	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		25.61	176	23,574	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		99.26	783	104,539	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		164.97	564	75,325	情報技術
HANNOVER RUECK SE		6.44	91	12,255	金融
DEUTSCHE POST AG-REG		113.48	645	86,168	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		24.04	330	44,111	金融
LANXESS AG		15.29	92	12,385	素材
MTU AERO ENGINES AG		6.66	138	18,486	資本財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE		47.96	248	33,127	不動産
SYMRISE AG		16.56	186	24,839	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		62.4	14	1,886	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		9	71	9,566	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		62.49	335	44,731	不動産
LEG IMMOBILIEN SE		10.73	129	17,290	不動産
国小計	株数、金額	2,860.15	16,103	2,148,961	
	銘柄数<比率>	60銘柄		<2.9%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ポルトガル）					
JERONIMO MARTINS		29	46	6,145	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		275.76	126	16,924	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		71.83	70	9,466	エネルギー
国小計	株数、金額	376.59	243	32,536	
	銘柄数<比率>	3銘柄		<0.0%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（スペイン）					
TELEFONICA SA		570.39	234	31,299	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA		37.6	83	11,184	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		835.83	446	59,596	金融
IBERDROLA SA		720.39	779	104,019	公益事業
REPSOL SA		176.85	202	27,074	エネルギー
GRIFOLS SA		27.95	65	8,780	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		2,073.7	712	95,127	金融
AMADEUS IT GROUP SA		54	353	47,201	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA		39.78	86	11,604	公益事業
CAIXABANK SA		468.59	131	17,534	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		35.83	91	12,226	資本財・サービス
AENA SME SA		8.66	123	16,537	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA		71.6	373	49,877	コミュニケーション・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		124.17	394	52,677	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		32.93	85	11,394	資本財・サービス
ENAGAS SA		36.75	72	9,685	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		51.47	87	11,738	公益事業
FERROVIAL SA		60.55	153	20,475	資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA		43.83	85	11,347	公益事業
国小計	株数、金額	5,470.87	4,566	609,384	
	銘柄数<比率>	19銘柄		<0.8%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（イタリア）					
PRYSMIAN SPA		41.45	121	16,185	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		129.44	221	29,624	金融
MEDIOBANCA SPA		99.71	99	13,253	金融
UNICREDIT SPA		294.71	316	42,239	金融
TELECOM ITALIA SPA		1,085.03	48	6,515	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP		483.81	23	3,201	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO		1,910.98	468	62,479	金融
ATLANTIA SPA		60.27	94	12,655	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		77.27	92	12,389	金融
MONCLER SPA		24.35	139	18,561	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		12.85	61	8,181	ヘルスケア
ENI SPA		281.9	302	40,358	エネルギー
DIASORIN SPA		2.77	41	5,572	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		24.14	23	3,110	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA		35.53	62	8,295	情報技術
AMPLIFON SPA		17.5	71	9,540	ヘルスケア
ENEL SPA		983.37	796	106,323	公益事業
SNAM SPA		243	122	16,343	公益事業
TERNA SPA		199	130	17,389	公益事業
FINECOBANK SPA		59.72	83	11,097	金融
国小計	株数、金額	6,066.8	3,321	443,317	
	銘柄数<比率>	20銘柄		<0.6%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フィンランド）					
UPM-KYMMENE OYJ		65.25	212	28,299	素材
NOKIA OYJ		652.61	295	39,443	情報技術

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
WARTSILA OYJ ABP		41.16	50	6,690	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		88.53	133	17,821	素材
ELISA OYJ		17.34	87	11,690	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		68.09	264	35,310	金融
FORTUM OYJ		44	106	14,256	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		20.1	60	8,030	生活必需品
KONE OYJ-B		37.96	256	34,234	資本財・サービス
NESTE OYJ		57.78	320	42,717	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		17.63	66	8,923	ヘルスケア
国小計	株数、金額	1,110.45	1,854	247,419	
	銘柄数<比率>	11銘柄		<0.3%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オーストリア）					
VERBUND AG		12.16	92	12,405	公益事業
OMV AG		12.09	61	8,186	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		34.89	117	15,695	金融
VOESTALPINE AG		18	65	8,705	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		11	22	3,032	金融
国小計	株数、金額	88.14	359	48,025	
	銘柄数<比率>	5銘柄		<0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額	22,114.83	57,564	7,681,964	
	銘柄数<比率>	231銘柄		<10.4%>	
ファンド合計	株数、金額	130,785.8	—	69,671,218	
	銘柄数<比率>	1,219銘柄		<94.2%>	

（注1）邦貨換算金額は、2021年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
（注2）<　>内は純資産総額に対する評価額の比率。
（注3）評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄		2021年6月15日現在 口数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額
		千口	千アメリカ・ドル	千円
（アメリカ）				
AVALONBAY COMMUNITIES INC		1.679	359	39,602
SIMON PROPERTY GROUP INC		4.233	564	62,121
BOSTON PROPERTIES INC		1.468	182	20,048
VORNADO REALTY TRUST		2.128	106	11,732
SBA COMMUNICATIONS CORP		1.28	409	45,102
EQUITY RESIDENTIAL		4.406	356	39,253
EQUINIX INC		1.081	890	98,078
AMERICAN TOWER CORP		5.297	1,435	158,026
HOST HOTELS & RESORTS INC		6.701	118	13,037
INVITATION HOMES INC		6.976	263	29,042
VICI PROPERTIES INC		5.464	179	19,745
VENTAS INC		4.401	259	28,571
WEYERHAEUSER CO		8.683	299	33,013
AGNC INVESTMENT CORP		7.559	133	14,673
CROWN CASTLE INTL CORP		5.102	1,005	110,715
IRON MOUNTAIN INC		3.474	159	17,573
VEREIT INC		2.726	133	14,692
SUN COMMUNITIES INC		1.214	215	23,740
PROLOGIS INC		8.863	1,118	123,120
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		1.648	318	35,118
CAMDEN PROPERTY TRUST		1.177	159	17,520
DUKE REALTY CORP		4.971	246	27,094
ESSEX PROPERTY TRUST INC		0.771	243	26,775
WELLTOWER INC		4.901	398	43,824
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		6.434	227	25,008
MID-AMERICA APARTMENT COMM		1.714	294	32,383
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		1.95	149	16,429
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		15.632	145	16,007
REALTY INCOME CORP		4.587	323	35,658
PUBLIC STORAGE		1.857	547	60,244
REGENCY CENTERS CORP		1.939	129	14,270
UDR INC		2.629	131	14,508
WP CAREY INC		2.702	210	23,128
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		2.164	81	9,004
DIGITAL REALTY TRUST INC		3.415	554	61,040
EXTRA SPACE STORAGE INC		1.797	287	31,646
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		8.597	188	20,797
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額	151.62	12,826	1,412,355
	銘柄数<比率>	37銘柄		<1.9%>

銘柄		2021年6月15日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)				
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		1.6	91	8,280
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		1.4	30	2,765
カナダ・ドル通貨計	口数、金額	3	121	11,045
	銘柄数<比率>	2銘柄		<0.0%>
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)				
LENDLEASE GROUP		4.303	54	4,658
TRANSURBAN GROUP		33.406	478	40,618
SYDNEY AIRPORT		9.129	55	4,681
APA GROUP		14.243	134	11,428
SCENTRE GROUP		64.017	185	15,763
DEXUS		13.949	149	12,708
GPT GROUP		30.647	150	12,776
MIRVAC GROUP		61.117	181	15,412
STOCKLAND		18.729	89	7,617
GOODMAN GROUP		20.198	416	35,363
VICINITY CENTRES		50.371	84	7,163
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額	320.109	1,980	168,194
	銘柄数<比率>	11銘柄		<0.2%>
		千口	千香港・ドル	千円
(香港)				
LINK REIT		26	1,998	28,353
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		52	409	5,814
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		34	358	5,085
香港・ドル通貨計	口数、金額	112	2,766	39,252
	銘柄数<比率>	3銘柄		<0.1%>
		千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)				
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		30.5	90	7,517
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		51.66	111	9,217
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		46	92	7,711
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		37.6	80	6,708
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	165.76	375	31,155
	銘柄数<比率>	4銘柄		<0.0%>
		千口	千イギリス・ポンド	千円
(イギリス)				
LAND SECURITIES GROUP PLC		10.295	73	11,495
SEGRO PLC		13.286	145	22,627
BRITISH LAND CO PLC		14.58	75	11,663
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	38.161	294	45,786
	銘柄数<比率>	3銘柄		<0.1%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ(フランス)				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		1.751	140	18,721
GECINA SA		0.578	78	10,467
KLEPIERRE		2.394	59	7,974
COVIVIO		0.353	28	3,824
ユーロ通貨計	口数、金額	5.076	307	40,987
	銘柄数<比率>	4銘柄		<0.1%>
合計	口数、金額	795.726	—	1,748,776
	銘柄数<比率>	64銘柄		<2.4%>

(注1)邦貨換算金額は、2021年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2)< >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3)評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別残高(評価額)

銘柄別		2021年6月15日現在	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
外国	S&P500 EMINI FUT(アメリカ)	1,991	—
	S&P/TSX 60 IX FUT(カナダ)	109	—
	SPI 200 FUTURES(オーストラリア)	78	—
	FTSE 100 IDX FUT(イギリス)	144	—
	SWISS MKT IX FUTR(スイス)	87	—
	EURO STOXX 50(ドイツ)	325	—

(注1)外貨建の評価額は、2021年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2)単位未満は切捨て。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

運用報告書　第13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）

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

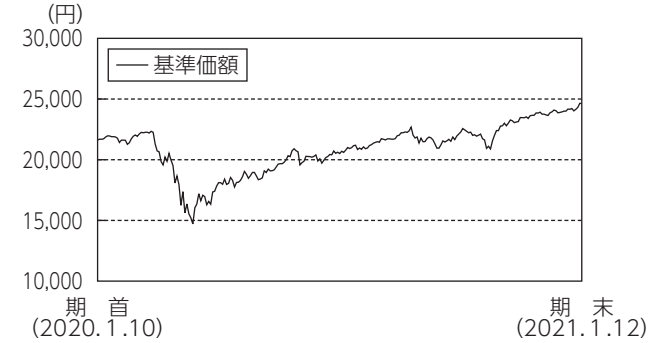
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）
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	騰落率	ＭＳＣＩコクサイ指数(円ヘッジ・ベース、指数化)(ベンチマーク)	騰落率	株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	円	%		%	%	%	%
(期首)2020年１月10日	21,621	－	16,543	－	91.8	6.0	2.7
１月末	21,603	△ 0.1	16,520	△ 0.1	90.5	6.7	2.7
２月末	19,854	△ 8.2	15,150	△ 8.4	92.0	5.9	2.9
３月末	17,076	△21.0	13,015	△21.3	90.3	7.5	2.6
４月末	19,038	△11.9	14,482	△12.5	94.6	2.1	2.7
５月末	19,676	△ 9.0	14,934	△ 9.7	95.6	2.3	2.7
６月末	19,946	△ 7.7	15,112	△ 8.6	95.5	2.2	2.6
７月末	20,907	△ 3.3	15,828	△ 4.3	91.6	4.3	2.5
８月末	22,290	3.1	16,844	1.8	93.3	4.4	2.4
９月末	21,459	△ 0.7	16,200	△ 2.1	94.2	2.4	2.4
10月末	21,107	△ 2.4	15,922	△ 3.7	92.6	3.9	2.4
11月末	23,531	8.8	17,727	7.2	93.1	4.7	2.3
12月末	24,156	11.7	18,174	9.9	90.5	7.0	2.1
(期末)2021年１月12日	24,628	13.9	18,522	12.0	91.1	7.9	2.0

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：21,621円　期末：24,628円　騰落率：13.9%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク（ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース））の動きに連動させることをめざして運用を行った結果、各国の大胆な景気刺激策や米国大統領選挙の不透明感が解消したことなどを好感し海外株式市況が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は上昇しました。

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は12.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は13.9%となりました。

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

《今後の運用方針》

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

■１万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	2円
(株式)	(1)
(新株予約権証券)	(0)
(先物・オプション)	(1)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	1
(株式)	(1)
(新株予約権証券)	(0)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	5
(保管費用)	(5)
(その他)	(1)
合計	8

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

■売買および取引の状況

(1) 株　式

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 7,711.2 (2,340.92)	千アメリカ・ドル 61,778 (△ 1,024)	百株 4,461.27	千アメリカ・ドル 29,941
	カナダ	百株 1,333.48 (△ 160.13)	千カナダ・ドル 5,452 (△ 118)	百株 643.62	千カナダ・ドル 1,756
	オーストラリア	百株 1,948.34 (60.04)	千オーストラリア・ドル 3,074 (4)	百株 1,905.2	千オーストラリア・ドル 1,535
	香港	百株 3,132 (△ 292.19)	千香港ドル 10,269 (−)	百株 2,053.8	千香港ドル 8,665
	シンガポール	百株 739 (315.95)	千シンガポール・ドル 523 (31)	百株 1,438.45	千シンガポール・ドル 431
	ニュージーランド	百株 188.72 (−)	千ニュージーランド・ドル 113 (−)	百株 466.2	千ニュージーランド・ドル 242
	イギリス	百株 6,371.46 (786.03)	千イギリス・ポンド 3,425 (849)	百株 3,412.39	千イギリス・ポンド 1,465
	イスラエル	百株 38.83 (7.49)	千イスラエル・シュケル 258 (△ 0)	百株 7.49	千イスラエル・シュケル 6
	スイス	百株 402.74 (0.06)	千スイス・フラン 3,225 (△ 49)	百株 182.57	千スイス・フラン 1,322
	デンマーク	百株 152.64 (−)	千デンマーク・クローネ 7,453 (−)	百株 82.05	千デンマーク・クローネ 4,257
	ノルウェー	百株 156.08 (−)	千ノルウェー・クローネ 2,169 (−)	百株 112.13	千ノルウェー・クローネ 1,290
	スウェーデン	百株 1,277.97 (62.41)	千スウェーデン・クローネ 18,822 (−)	百株 681.33	千スウェーデン・クローネ 8,348
	ユーロ (アイルランド)	百株 62.81 (8.02)	千ユーロ 264 (75)	百株 213.27	千ユーロ 128
	ユーロ (オランダ)	百株 1,066.23 (△ 229.06)	千ユーロ 1,937 (△ 37)	百株 406.43	千ユーロ 695
	ユーロ (ベルギー)	百株 51.87 (−)	千ユーロ 323 (−)	百株 29.11	千ユーロ 150
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 0.98 (13.32)	千ユーロ 65 (−)	百株 0.81	千ユーロ 53
	ユーロ (フランス)	百株 483.52 (29.61)	千ユーロ 2,581 (△ 0)	百株 249.8	千ユーロ 925
	ユーロ (ドイツ)	百株 652.44 (53.32)	千ユーロ 2,874 (△ 33)	百株 314.07	千ユーロ 918
	ユーロ (ポルトガル)	百株 − (275.76)	千ユーロ − (−)	百株 275.76	千ユーロ 2
	ユーロ (スペイン)	百株 1,131.64 (4,509.73)	千ユーロ 746 (99)	百株 6,434.87	千ユーロ 494
	ユーロ (イタリア)	百株 1,276.57 (−)	千ユーロ 793 (−)	百株 313.44	千ユーロ 292
	ユーロ (フィンランド)	百株 126.92 (−)	千ユーロ 406 (−)	百株 65.24	千ユーロ 240
	ユーロ (オーストリア)	百株 31.29 (−)	千ユーロ 54 (−)	百株 29.4	千ユーロ 67
	ユーロ (その他)	百株 − (−)	千ユーロ − (△ 927)	百株 −	千ユーロ −
	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 4,884.27 (4,660.7)	千ユーロ 10,047 (△ 823)	百株 8,332.2	千ユーロ 3,969

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

(2) 新株予約権証券

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

		買付		売付	
		証券数	金額	証券数	金額
外国	アメリカ	証券 − (1,279)	千アメリカ・ドル − (−)	証券 1,279 (−)	千アメリカ・ドル 6 (−)
	スイス	証券 − (13,420)	千スイス・フラン − (−)	証券 13,420 (−)	千スイス・フラン 2 (−)

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

(3) 投資信託証券

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口 35.979 (△11.575)	千アメリカ・ドル 2,180 (−)	千口 16.299 (−)	千アメリカ・ドル 795 (−)
	カナダ	千口 4.2 (−)	千カナダ・ドル 132 (−)	千口 8.2 (−)	千カナダ・ドル 141 (−)
	オーストラリア	千口 8.297 (1.772)	千オーストラリア・ドル 103 (−)	千口 8.131 (−)	千オーストラリア・ドル 93 (−)
	香港	千口 8 (−)	千香港ドル 538 (−)	千口 − (−)	千香港ドル − (−)
	シンガポール	千口 46 (△ 7.84)	千シンガポール・ドル 94 (△ 10)	千口 − (−)	千シンガポール・ドル − (−)
	ユーロ (フランス)	千口 − (−)	千ユーロ − (△ 2)	千口 0.406 (−)	千ユーロ 25 (−)

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2020年1月11日から2021年1月12日まで)

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 28,948	百万円 27,174	百万円 −	百万円 −

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株　式

(2020年1月11日から2021年1月12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
MICROSOFT CORP (アメリカ)	16.824	307,438	18,273	APPLE INC (アメリカ)	19.054	265,080	13,912
APPLE INC (アメリカ)	10.291	280,992	27,304	MICROSOFT CORP (アメリカ)	6.958	150,838	21,678
AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.942	227,384	241,384	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.337	111,876	331,976
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	5.14	104,840	20,397	NESTLE SA-REG (スイス)	4.845	59,157	12,209
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.715	101,233	141,585	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.352	56,311	159,974
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	5.681	88,689	15,611	TESLA INC (アメリカ)	0.967	54,926	56,801
NESTLE SA-REG (スイス)	7.355	85,300	11,597	FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	1.807	51,218	28,344
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	3.943	83,306	21,127	BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)	15.9	41,894	2,634
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.574	74,824	130,356	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	3.273	34,684	10,597
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A (アメリカ)	2.495	69,335	27,789	NOVO NORDISK A/S-B (デンマーク)	4.964	34,486	6,947

(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 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	11	12.95	200	20,922	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	11.98	12.2	445	46,388	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	22.71	22.71	340	35,541	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	15.94	15.94	145	15,183	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5.5	7.46	120	12,588	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	62	62	224	23,451	金融
ABBOTT LABORATORIES	201.07	223.7	2,479	258,437	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	39.5	39.5	111	11,614	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	15.96	19.43	384	40,072	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	32.29	47.29	266	27,804	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	31.88	41.67	565	58,929	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	–	1.87	73	7,649	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	70.48	77.66	1,056	110,133	情報技術
QORVO INC	11.79	12.83	234	24,439	情報技術
AFLAC INC	81.23	84.71	377	39,299	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	12.48	12.48	156	16,293	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	18.35	18.35	132	13,816	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	56.65	60.97	2,891	301,374	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	28.72	28.72	123	12,904	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	12.99	16.07	581	60,577	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	44.09	–	–	–	金融
GARMIN LTD	13.18	15.27	185	19,294	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24.48	28.19	798	83,190	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	79.24	88.26	1,838	191,677	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	17.71	17.71	117	12,251	金融
AUTOZONE INC	2.91	2.91	368	38,382	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	23.99	33.98	382	39,819	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	96.83	123.65	140	14,666	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	15.08	15.08	115	12,054	公益事業
CELANESE CORP	12.97	12.97	177	18,519	素材
DR HORTON INC	43.97	43.97	299	31,191	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	12.49	–	–	–	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	24.5	143	14,938	ヘルスケア
AUTODESK INC	25.81	26.84	853	88,908	情報技術
MOODY'S CORP	17.82	21.43	592	61,726	金融
DEVON ENERGY CORP	48.68	77.48	142	14,802	エネルギー
ALBEMARLE CORP	16.68	16.68	295	30,822	素材
ATMOS ENERGY CORP	16.54	16.54	145	15,113	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	22	36.14	175	18,288	公益事業
CITIGROUP INC	263.51	261.68	1,738	181,214	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	47.42	53.55	902	94,054	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	56.57	59.18	466	48,591	公益事業
ALLEGHANY CORP	2.03	1.46	91	9,560	金融
DOMINO'S PIZZA INC	5.26	5.26	205	21,411	一般消費財・サービス
HESS CORP	28.96	34.26	208	21,761	エネルギー
DAVITA INC	10	10	123	12,832	ヘルスケア
DANAHER CORP	70.15	80.31	1,960	204,345	ヘルスケア
FORTIVE CORP	30.44	43.35	308	32,121	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	59.49	71.72	843	87,947	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	40.93	–	–	–	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17.01	–	–	–	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	60.74	65.8	342	35,690	生活必需品
BUNGE LTD	18.38	18.38	128	13,356	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	38.44	42.21	550	57,400	情報技術
APPLE INC	507.77	2,156.06	27,808	2,898,517	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33.59	33.59	319	33,340	金融
BOEING CO/THE	60.58	67.41	1,393	145,293	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20.63	20.63	182	19,066	金融
BECTON DICKINSON AND CO	30.11	36.79	945	98,591	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	15	20	36	3,756	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	14	14	145	15,174	情報技術
CDK GLOBAL INC	11	–	–	–	情報技術
NISOURCE INC	40.26	40.26	88	9,181	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17.08	17.08	164	17,184	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	96.83	99.78	454	47,382	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	464.47	519.78	2,986	311,299	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	144.92	173.71	4,054	422,643	金融
ANSYS INC	9.89	10.38	387	40,390	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	137.39	171.23	872	90,914	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	77.86	81.93	513	53,534	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	262.66	286.15	1,859	193,775	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	362.64	382.84	5,285	550,866	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	27.59	30.13	468	48,796	金融
LKQ CORP	33	33	125	13,056	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5.47	5.47	91	9,533	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	36.65	36.65	283	29,505	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	36.14	36.14	486	50,736	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16.11	16.11	324	33,848	金融
DOLLAR GENERAL CORP	26.72	30.52	656	68,476	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	20.83	24.19	1,265	131,880	情報技術
CATERPILLAR INC	65.65	68.56	1,329	138,532	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	24.93	28.86	135	14,131	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	22.01	24.78	119	12,444	公益事業
CMS ENERGY CORP	33.84	33.84	193	20,150	公益事業
MOSAIC CO/THE	52.09	52.09	139	14,534	素材
DELTA AIR LINES INC	16.5	16.5	65	6,777	資本財・サービス
CORNING INC	83.99	99.83	374	39,061	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	483.58	534.5	2,424	252,704	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12.65	12.97	80	8,395	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	139.89	189.09	1,438	149,905	金融
ZILLOW GROUP INC - A	–	5.87	87	9,132	コミュニケーション・サービス
WABCO HOLDINGS INC	9.4	–	–	–	その他
MSCI INC	9.75	10.06	454	47,372	金融
FAIR ISAAC CORP	–	3.98	197	20,562	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	4.5	4.5	123	12,846	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	9.18	–	–	–	資本財・サービス
COTY INC-CL A	47.57	–	–	–	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	25.07	27.8	196	20,509	情報技術
BROADCOM INC	45.31	50.58	2,254	235,002	情報技術
ACUITY BRANDS INC	3.5	–	–	–	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14.16	14.16	221	23,116	ヘルスケア
ARAMARK	31.73	31.73	118	12,398	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	16.12	16.12	48	5,070	素材
DTE ENERGY COMPANY	19.33	27.39	323	33,681	公益事業
CENTENE CORP	51.13	77.79	534	55,686	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	13.58	13.58	135	14,126	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	55.32	55.32	220	22,965	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	22.32	22.32	264	27,558	金融
GARTNER INC	11.74	11.74	196	20,457	情報技術
SPLUNK INC	17.1	20.29	337	35,213	情報技術
DOMINION ENERGY INC	89.41	109.95	799	83,280	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	44.36	47.68	443	46,188	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	14	14	79	8,302	資本財・サービス
DEERE & CO	33.62	36.23	1,068	111,369	資本財・サービス
POOL CORP	–	1.74	67	6,986	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	33.87	38.66	778	81,102	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	8.33	8.92	126	13,155	情報技術
CABLE ONE INC	–	0.6	123	12,885	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	7	7.66	202	21,068	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	14.27	14.27	201	20,956	金融
VAIL RESORTS INC	3.9	5.53	155	16,245	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	14.61	–	–	–	金融
TARGA RESOURCES CORP	16.33	–	–	–	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	8.94	8.94	102	10,708	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	8.74	78	8,211	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4.05	–	–	–	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	36.48	46.02	316	32,967	公益事業
COGNEX CORP	24.39	24.39	209	21,788	情報技術
TELEFLEX INC	4.85	5.63	227	23,699	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8.06	9.79	145	15,116	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8.52	8.52	257	26,855	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	3	3	184	19,255	ヘルスケア
WELLCARE HEALTH PLANS INC	5	–	–	–	その他
CATALENT INC	–	20	230	24,056	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	15.7	17.57	505	52,718	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	–	8	193	20,162	ヘルスケア
IDEX CORP	7	11.56	241	25,130	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	91.32	104.86	861	89,775	生活必需品
ROLLINS INC	10.5	26.85	109	11,448	資本財・サービス
AMETEK INC	25.97	25.97	322	33,605	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	28.83	30.47	258	26,969	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10	16.44	70	7,318	資本財・サービス
HEICO CORP	5.35	5.35	73	7,675	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	10.6	10.6	131	13,736	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	–	2.64	68	7,176	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3.98	4.8	159	16,622	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	34.22	34.22	331	34,590	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	4.17	5.09	218	22,794	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	48.83	55.33	2,014	209,926	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	11.28	11.28	147	15,336	情報技術
GRUBHUB INC	10	–	–	–	一般消費財・サービス
EPAM SYSTEMS INC	5.49	7.49	256	26,764	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	17.5	17.5	154	16,093	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3.1	3.53	495	51,606	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	28	–	–	–	金融
UGI CORP	20.85	20.85	74	7,732	公益事業
CUMMINS INC	16.04	17.63	417	43,491	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	87.14	99.82	907	94,584	コミュニケーション・サービス
SABRE CORP	43.26	–	–	–	情報技術
CDW CORP/DE	17.92	17.92	239	24,963	情報技術
SIGNATURE BANK	7.69	–	–	–	金融
COSTAR GROUP INC	4.92	4.92	444	46,377	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	6.9	6.9	299	31,217	金融
AMERCO	0.7	0.7	33	3,461	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8.26	12.39	250	26,130	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	4.8	6.03	1,062	110,714	一般消費財・サービス
HANESBRANDS INC	29	–	–	–	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	8.37	138	14,392	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	28.81	38.01	430	44,839	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	2.5	2.5	61	6,397	情報技術
DEXCOM INC	11.72	11.88	440	45,894	ヘルスケア
NORDSON CORP	–	7.5	153	15,965	資本財・サービス
COPART INC	24.95	24.95	301	31,432	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	15.91	–	–	–	エネルギー
SEAGEN INC	15.45	15.45	276	28,831	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	9.63	9.63	536	55,912	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	5	6.98	427	44,591	資本財・サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	12.03	12.03	132	13,830	ヘルスケア

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	–	14.47	113	11,868	ヘルスケア
NIELSEN HOLDINGS PLC	43.47	–	–	–	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	225.94	278.51	410	42,788	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	31.38	32.61	558	58,247	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3.82	5.44	295	30,829	金融
CABOT OIL & GAS CORP	46.08	46.08	83	8,664	エネルギー
T-MOBILE US INC	42.03	72.44	962	100,367	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	17.86	17.86	255	26,655	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	454.42	514.9	2,584	269,413	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	25.75	25.75	129	13,457	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.46	19.46	182	19,060	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	12.5	–	–	–	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	38.51	38.51	99	10,335	金融
CSX CORP	81.51	94.51	907	94,557	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10.5	11.66	253	26,372	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	15.63	15.63	223	23,289	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	8	8	73	7,682	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	47.47	53.52	16,667	1,737,227	一般消費財・サービス
FLOWSERVE CORP	19.86	–	–	–	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	22.03	81.09	724	75,535	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	479.45	529.46	2,479	258,489	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	16.13	–	–	–	情報技術
AES CORP	83.41	83.41	212	22,134	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	5.71	5.71	135	14,120	金融
EOG RESOURCES INC	64.76	76.55	456	47,561	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	19.14	19.14	195	20,422	情報技術
ABIOMED INC	5.55	5.55	180	18,776	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	19.89	19.89	213	22,255	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	34.58	36.83	471	49,194	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	433.81	475.97	442	46,137	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	11	15.21	53	5,569	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	17.21	17.21	247	25,830	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	24.16	61	6,441	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	–	5.95	90	9,410	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	45.54	45.54	139	14,519	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	18.24	–	–	–	資本財・サービス
FORTINET INC	15.95	15.95	236	24,632	情報技術
MARKEL CORP	1.58	1.77	182	19,050	金融
NEXTERA ENERGY INC	51.64	243.24	1,938	202,037	公益事業
MASIMO CORP	–	6.93	193	20,219	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	150.25	197.64	599	62,459	素材
INSULET CORP	7.69	7.69	195	20,410	ヘルスケア
US BANCORP	165.2	180.05	888	92,594	金融
UNITED RENTALS INC	10.55	10.55	271	28,309	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	5.5	11.11	211	22,042	情報技術
FASTENAL CO	58.14	79.24	400	41,692	資本財・サービス
FISERV INC	64.56	73.39	844	88,006	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	988.88	1,169.58	1,339	139,581	資本財・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	21.49	–	–	–	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	136.43	165.43	744	77,609	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	7	–	–	–	コミュニケーション・サービス
ZENDESK INC	–	4.65	70	7,379	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	26.11	32.11	487	50,798	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	36.27	41.76	1,227	127,893	金融
ALPHABET INC-CL A	32.74	36.37	6,387	665,782	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	35.95	39.68	7,010	730,688	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	17.63	17.63	142	14,878	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	65.95	78.49	436	45,461	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	56.61	76.12	229	23,960	公益事業
GENUINE PARTS CO	17.7	17.7	186	19,391	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	42.11	44.17	387	40,352	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	81	81	254	26,492	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	24.09	27.79	509	53,148	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9.5	–	–	–	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	102.3	102.3	210	21,933	エネルギー
HOME DEPOT INC	124.15	135.34	3,670	382,610	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	8.4	8.4	115	12,065	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	95.84	166.84	245	25,615	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3.5	5	84	8,817	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	17.25	17.25	258	26,989	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	14	–	–	–	一般消費財・サービス
HUMANA INC	14.85	17.33	751	78,310	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	33.54	36.71	635	66,275	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9.17	9.17	352	36,694	情報技術
HENRY SCHEIN INC	18.7	18.7	135	14,107	ヘルスケア
HP INC	161.33	174.43	449	46,870	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	132.5	200.5	239	25,015	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	11	13.95	59	6,221	コミュニケーション・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	17.83	–	–	–	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	27.62	27.62	111	11,624	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20.28	20.28	87	9,129	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	50.11	50.11	181	18,891	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	77.25	83.9	275	28,726	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	–	15.58	314	32,750	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	96.54	110.82	1,424	148,519	情報技術

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	40.47	210	21,976	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	15	131	13,686	資本財・サービス
ZOETIS INC	51.45	60.03	1,016	105,986	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	25.48	32.74	498	51,955	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	24.84	24.84	166	17,364	エネルギー
ALLEGION PLC	11.1	11.1	133	13,921	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	15.72	–	–	–	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	51.08	51.08	128	13,368	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	26.65	34.31	356	37,116	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	49.12	49.12	116	12,190	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC	8.64	8.64	77	8,083	ヘルスケア
JM SMUCKER CO/THE	13.93	13.93	158	16,566	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	296.77	332.56	5,300	552,419	ヘルスケア
ABBVIE INC	166.54	223.87	2,440	254,386	ヘルスケア
HOLOGIC INC	30.42	30.42	238	24,896	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	39.32	44.29	582	60,681	生活必需品
KROGER CO	94.8	100.13	318	33,146	生活必需品
KLA CORP	19.19	19.19	554	57,827	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	29.5	31.47	1,062	110,763	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	9.36	9.76	263	27,504	情報技術
LOWE'S COS INC	85.96	94.68	1,574	164,132	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	98.52	109.21	2,030	211,654	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	17.24	17.56	906	94,530	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	5.87	–	–	–	不動産
LOEWS CORP	35.91	35.91	167	17,423	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	26.43	26.43	136	14,181	金融
MCDONALD'S CORP	86.07	94.58	2,026	211,189	一般消費財・サービス
3M CO	63.95	72.16	1,192	124,250	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	270.31	303.64	7,798	812,857	コミュニケーション・サービス
MANPOWERGROUP INC	6.5	–	–	–	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	26.18	29.23	933	97,248	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7.67	7.67	237	24,787	素材
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	–	5.75	202	21,099	情報技術
CONCHO RESOURCES INC	25.52	25.52	168	17,608	エネルギー
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	19	–	–	–	その他
PHILLIPS 66	50.6	51.07	369	38,469	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	45.61	–	–	–	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	56.59	56.59	174	18,161	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	24.29	–	–	–	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13.75	29.92	280	29,199	生活必需品
MYLAN NV	48.88	–	–	–	その他
METLIFE INC	86.35	90.65	447	46,675	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	86.17	86.17	432	45,123	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	5.93	5.93	179	18,725	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	24.19	24.19	107	11,207	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	17.71	22.32	387	40,407	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.84	2.84	353	36,854	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	84.46	84.46	191	19,939	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	14.6	14.6	383	39,959	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	285.53	318.87	2,710	282,504	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	83.2	91.81	771	80,363	素材
MASCO CORP	35.43	35.43	197	20,624	資本財・サービス
M & T BANK CORP	13.23	19.84	291	30,336	金融
MARSH & MCLENNAN COS	55.85	64.53	726	75,727	金融
BLACK KNIGHT INC	16.44	16.44	142	14,854	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	7.07	10.18	124	12,967	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	31.8	33.61	432	45,071	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	18.78	21.23	485	50,635	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	6	8.8	228	23,772	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	36.26	48.01	1,082	112,842	情報技術
TRANSUNION	20.29	22.93	214	22,339	資本財・サービス
VISTRA CORP	42.85	42.85	90	9,455	公益事業
CAPRI HOLDINGS LTD	11	–	–	–	一般消費財・サービス
BEIGENE LTD-ADR	3.5	–	–	–	ヘルスケア
NOVOCURE LTD	–	6.16	104	10,920	ヘルスケア
NETAPP INC	23	27.03	176	18,374	情報技術
NIKE INC -CL B	142.18	155.47	2,286	238,289	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	28.43	33.43	850	88,632	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26.26	34.92	516	53,798	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17.49	17.49	180	18,833	金融
ALLY FINANCIAL INC	50.94	50.94	190	19,899	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	17.72	20.25	596	62,209	資本財・サービス
APTIV PLC	26.8	32.32	468	48,873	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	91.73	104.13	645	67,237	素材
MCKESSON CORP	21.61	21.61	396	41,309	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	32.57	32.57	310	32,379	情報技術
XYLEM INC	19.72	19.72	209	21,791	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	171.14	196.39	1,616	168,486	生活必需品
NUCOR CORP	36.92	36.92	209	21,857	素材
SUNRUN INC	–	15	143	14,949	資本財・サービス
WESTERN UNION CO	36	68.11	153	16,029	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	19.3	19.3	156	16,338	情報技術
NEWELL BRANDS INC	40.58	40.58	93	9,757	一般消費財・サービス
EVERGY INC	32.43	32.43	170	17,725	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	102.38	102.38	205	21,427	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	2.69	69	7,209	金融
OKTA INC	10.1	13.76	347	36,170	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	–	8.8	301	31,422	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	13.5	8.84	136	14,182	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	48.77	48.77	153	16,032	ヘルスケア
LINDE PLC	57.96	61.08	1,634	170,319	素材

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
WIX.COM LTD	5	7.85	208	21,773	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	61.84	61.84	165	17,287	金融
KKR & CO INC	49.96	64.89	263	27,446	金融
PAYCHEX INC	33	46	418	43,630	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8.27	9.16	443	46,193	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	207.29	232.79	962	100,330	生活必需品
P G & E CORP	–	155.15	189	19,745	公益事業
PFIZER INC	623.73	702.37	2,652	276,506	ヘルスケア
CIGNA CORP	40.5	46.3	1,018	106,130	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	19.17	32.76	247	25,824	情報技術
ALTICE USA INC- A	10.38	41.47	149	15,560	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	53.81	65.28	420	43,818	公益事業
STERIS PLC	8.97	8.97	179	18,741	ヘルスケア
FOX CORP - CLASS B	15.3	15.3	45	4,736	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	52.67	52.67	159	16,650	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	37.38	44.82	1,083	112,982	ヘルスケア
DOW INC	88.15	96.64	568	59,288	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	–	15.08	97	10,160	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	–	23.26	785	81,874	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	12.39	18.39	522	54,440	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	16.48	116.86	637	66,492	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	22.03	22.03	289	30,176	エネルギー
POLARIS INC	9.89	–	–	–	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	278.25	310.59	4,281	446,258	生活必需品
EXELON CORP	98.59	118.82	497	51,841	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	26.52	26.52	415	43,259	ヘルスケア
TELADOC HEALTH INC	–	13.4	295	30,847	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	–	53.97	250	26,151	資本財・サービス
NVR INC	0.45	0.45	179	18,699	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	122.28	141.85	643	67,064	エネルギー
TWILIO INC - A	13.31	17.46	632	65,880	情報技術
DOCUSIGN INC	10.27	22.52	542	56,559	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	4.91	6.01	256	26,758	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	–	6.12	62	6,516	情報技術
MATCH GROUP INC	9.28	–	–	–	その他
PEPSICO INC	156.2	174.34	2,477	258,198	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4.09	4.09	63	6,572	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	23.92	23.92	55	5,821	情報技術
MONGODB INC	3.9	6.1	220	22,981	情報技術
SNAP INC - A	68.89	116.75	634	66,174	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	75.09	85.3	372	38,781	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42.88	53.88	435	45,365	金融
AMCOR PLC	174.57	174.57	201	20,997	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	–	19.1	443	46,234	情報技術
ROKU INC	9.39	14.88	599	62,523	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20.92	20.92	327	34,155	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	72.8	79.88	2,079	216,764	情報技術
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	–	58.76	247	25,766	情報技術
10X GENOMICS INC-CLASS A	–	4.21	70	7,350	ヘルスケア
PENTAIR PLC	15.75	15.75	89	9,326	資本財・サービス
QUALCOMM INC	134.03	142.14	2,218	231,280	情報技術
INVESCO LTD	37	37	70	7,304	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	8.19	8.19	140	14,599	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31.93	31.93	165	17,239	金融
DATADOG INC - CLASS A	–	18.25	190	19,830	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	–	60.8	435	45,437	コミュニケーション・サービス
RAYTHEON COMPANY	31.16	–	–	–	その他
AVALARA INC	–	12.57	198	20,734	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	9.25	13.27	667	69,560	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	26.67	26.67	255	26,616	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	4.86	5.01	1,112	115,993	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	41.29	48.88	590	61,580	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	8.44	9.98	145	15,169	素材
RESMED INC	13.83	19.83	436	45,533	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	18.12	18.12	224	23,349	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	14.99	14.99	94	9,855	資本財・サービス
MODERNA INC	–	33.62	394	41,090	ヘルスケア
RALPH LAUREN CORP	4	–	–	–	一般消費財・サービス
HUBSPOT INC	–	3.54	142	14,849	情報技術
PERKINELMER INC	11.63	11.63	185	19,304	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	–	97.33	404	42,171	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	–	48.66	322	33,656	資本財・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	–	23	109	11,377	金融
AVANTOR INC	–	56	170	17,796	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	–	31.23	101	10,614	金融
DYNATRACE INC	–	23.39	98	10,244	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	–	5.4	420	43,861	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	92.5	153.5	274	28,606	金融
IAC/INTERACTIVECORP	–	10.21	192	20,069	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	–	31.62	480	50,062	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	213.52	234.68	2,149	224,059	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A	–	25.9	394	41,125	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	–	12.94	257	26,799	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	38.64	49.85	307	32,042	公益事業
ETSY INC	–	13.29	243	25,355	一般消費財・サービス
TESLA INC	16.51	93.77	7,606	792,828	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	–	3.63	106	11,092	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	79.44	79.44	167	17,412	情報技術
DRAFTKINGS INC - CL A	–	12.2	65	6,815	一般消費財・サービス

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
STANLEY BLACK & DECKER INC	15.81	22	387	40,438	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	15.82	20.31	528	55,130	情報技術
CARVANA CO	–	6.88	188	19,657	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	–	8.56	83	8,667	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	–	20.3	155	16,186	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	18.17	18.26	1,170	122,022	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	–	137.45	253	26,460	ヘルスケア
CBRE GROUP INC - A	38.49	38.49	239	24,969	不動産
TWITTER INC	84.84	105.16	506	52,809	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	113.05	139.16	851	88,782	公益事業
SYSCO CORP	48.6	61.6	477	49,791	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	28.6	29.58	406	42,371	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	19.25	19.25	117	12,275	金融
STEEL DYNAMICS INC	23	23	92	9,591	素材
SCHLUMBERGER LTD	149.99	178.99	447	46,621	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	20.26	113	11,806	資本財・サービス
AT&T INC	818.15	897.21	2,590	269,981	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	17.58	17.58	83	8,692	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	36.27	44.52	160	16,728	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	8.34	10.19	748	78,058	素材
SEMPRA ENERGY	31.6	39.15	463	48,318	公益事業
TIFFANY & CO	10.86	–	–	–	その他
SEAGATE TECHNOLOGY	23.49	26.06	153	15,949	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	105.74	114.44	1,960	204,339	情報技術
SALESFORCE.COM INC	96.2	114.15	2,491	259,670	情報技術
WESTROCK CO	23.21	26.18	121	12,675	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	99.06	99.06	505	52,647	資本財・サービス
TERADYNE INC	20.96	20.96	284	29,645	情報技術
UNION PACIFIC CORP	80.49	85.02	1,847	192,607	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	102.44	–	–	–	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	70.61	81.28	354	36,928	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	90.33	190.09	1,326	138,295	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	80.87	87.73	1,419	148,006	資本財・サービス
UNUM GROUP	19	–	–	–	金融
SPRINT CORP	114.74	–	–	–	その他
IQVIA HOLDINGS INC	17.81	24.35	466	48,587	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	18	18	107	11,219	金融
AMEREN CORPORATION	28.61	28.61	214	22,377	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	107.26	119.3	4,303	448,579	ヘルスケア
VERISIGN INC	10.85	13.65	271	28,333	情報技術
VALERO ENERGY CORP	45.4	58.84	345	35,963	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	6.35	6.35	184	19,205	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	30.08	120	12,581	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9.92	9.92	134	13,970	ヘルスケア
ANTHEM INC	29.08	32.54	1,102	114,898	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	201.84	228.95	4,100	427,370	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	476.67	483.84	1,608	167,631	金融
WASTE MANAGEMENT INC	46.9	55.07	644	67,180	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	125.23	171.23	368	38,389	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	15.91	15.91	237	24,791	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	8.7	8.7	156	16,338	一般消費財・サービス
WALMART INC	158.96	178.52	2,629	274,064	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	9	–	–	–	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	23.65	24.92	396	41,298	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	11.45	11.45	123	12,892	一般消費財・サービス
XEROX HOLDINGS CORP	19.88	–	–	–	情報技術
WABTEC CORP	18.98	18.98	155	16,156	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	131.81	149.98	1,025	106,878	一般消費財・サービス
WATERS CORP	6.5	7.6	202	21,075	ヘルスケア
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	9.92	–	–	–	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	38.47	–	–	–	その他
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5.55	5.55	229	23,936	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	89.76	86.95	414	43,229	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	15.11	18.68	372	38,790	金融
WESTERN DIGITAL CORP	35.31	35.31	182	18,975	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	34.67	41.89	364	37,968	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	50.77	68.77	391	40,842	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	193.27	212.64	4,526	471,838	情報技術
PPL CORP	73.94	101.94	283	29,506	公益事業
PULTEGROUP INC	35.56	35.56	149	15,596	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	24.34	32.34	483	50,376	素材
NORTHERN TRUST CORP	20.62	22.6	221	23,058	金融
NVIDIA CORP	63.91	77.62	4,229	440,809	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	8.59	–	–	–	コミュニケーション・サービス
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	49.94	51.6	822	85,718	金融
HD SUPPLY HOLDINGS INC	24.82	–	–	–	その他
TYSON FOODS INC-CL A	32.11	33.22	215	22,426	生活必需品
NETFLIX INC	50.12	55.58	2,773	289,133	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	43.93	49.85	2,559	266,729	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	30	30	119	12,420	公益事業
GLOBE LIFE INC	12.15	12.15	115	12,076	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	18.56	19.53	319	33,308	金融
TEXTRON INC	22.1	28.31	137	14,337	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	79.99	37.49	69	7,291	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	24.52	24.52	77	8,083	公益事業
OMNICOM GROUP	25.46	25.46	162	16,904	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	261.18	257.94	1,625	169,456	情報技術
MASTERCARD INC - A	101.41	112.66	3,922	408,875	情報技術
ONEOK INC	45.66	45.66	188	19,621	エネルギー

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CENTURYLINK INC	97.47	110.62	116	12,152	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	12.69	12.69	556	58,003	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	32.71	41.58	447	46,662	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	11.91	14.13	291	30,418	コミュニケーション・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4	–	–	–	情報技術
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	17.75	33.74	167	17,471	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	62.74	–	–	–	その他
BANK OF AMERICA CORP	1,012.68	980.93	3,243	338,115	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4.18	4.18	155	16,215	資本財・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	21.27	29.08	236	24,623	ヘルスケア
NORDSTROM INC	8	–	–	–	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	72.62	88.35	1,069	111,480	金融
ANALOG DEVICES INC	39.3	48.3	764	79,693	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	114.47	146.31	1,422	148,305	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	34.8	–	–	–	その他
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	94.6	100.84	406	42,336	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22.83	22.83	369	38,560	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17.84	21.47	154	16,139	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	11.31	11.31	182	19,019	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	62.07	65.6	525	54,795	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	63.46	78.46	648	67,565	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	26.41	30.57	617	64,404	金融
AMGEN INC	66.7	73.75	1,752	182,619	ヘルスケア
TAPESTRY INC	25.5	–	–	–	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	48.03	50.56	641	66,906	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	17.84	21.81	494	51,575	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	102.64	119.64	1,171	122,156	情報技術
CME GROUP INC	41.37	45.88	912	95,134	金融
NOV INC	33.89	–	–	–	エネルギー
ECOLAB INC	29.12	33.15	732	76,381	素材
EQUIFAX INC	12.56	17.75	327	34,169	資本財・サービス
GAP INC/THE	28.2	–	–	–	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	144.04	158.31	989	103,145	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	–	45.94	144	15,016	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	33.15	33.15	147	15,351	生活必需品
STATE STREET CORP	39.48	41.52	324	33,816	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	128.07	187.78	1,131	117,923	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	51.75	65.68	541	56,457	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	13	21.66	99	10,391	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	11.45	15.97	159	16,652	素材
CARDINAL HEALTH INC	33.19	33.19	185	19,282	ヘルスケア
FEDEX CORP	28.93	31.93	783	81,640	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	51.81	54.87	599	62,515	金融
FMC CORP	11.42	13.6	162	16,921	素材
FLEX LTD	45	–	–	–	情報技術
CERNER CORP	41.33	41.33	326	33,980	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11.63	11.63	142	14,843	素材
CITRIX SYSTEMS INC	13.5	14.12	183	19,080	情報技術
INTEL CORP	497.06	534.49	2,754	287,128	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	52.31	52.31	127	13,314	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	48.66	48.66	244	25,485	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	35.91	40.4	840	87,616	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	153	153	90	9,472	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	16.54	17.87	665	69,377	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	14.5	14.5	67	7,012	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	12.38	15.22	1,238	129,075	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	17.9	13.3	178	18,563	情報技術
SNAP-ON INC	5	5	85	8,931	資本財・サービス
CARMAX INC	19.9	19.9	208	21,704	一般消費財・サービス
COMERICA INC	11.87	–	–	–	金融
INGREDION INC	5.3	–	–	–	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	82.01	89.87	802	83,639	公益事業
TARGET CORP	55.74	64.74	1,264	131,772	一般消費財・サービス
DOVER CORP	17.13	17.13	220	22,993	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	5.88	5.88	230	24,006	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17.5	17.5	197	20,613	資本財・サービス
CINTAS CORP	9.95	11.62	394	41,118	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	55.67	55.67	184	19,206	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	15	15	114	11,883	生活必需品
CLOROX COMPANY	12.78	16.28	315	32,873	生活必需品
ENTERGY CORP	21.14	22.43	211	22,067	公益事業
MICROSOFT CORP	809.83	908.49	19,758	2,059,454	情報技術
INCYTE CORP	19.93	26.89	250	26,155	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	147.72	160.17	1,218	126,995	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	148.77	169.39	2,007	209,217	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	129.91	146.66	1,153	120,257	情報技術
BLACKROCK INC	13.6	19.59	1,501	156,545	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	56.36	56.36	117	12,212	公益事業
HASBRO INC	14.49	14.49	140	14,627	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	26.2	36.9	219	22,834	生活必需品
KEYCORP	117.82	117.82	217	22,694	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	11.76	11.76	251	26,260	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	165.75	183.59	1,048	109,245	生活必需品
KOHLS CORP	16.5	–	–	–	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	5.72	6.47	232	24,253	ヘルスケア
APACHE CORP	36.73	–	–	–	エネルギー
CHUBB LTD	50.52	58.31	898	93,674	金融
ARROW ELECTRONICS INC	10	10	104	10,839	情報技術
ALLSTATE CORP	39.99	39.99	436	45,495	金融
EBAY INC	90.53	93.21	502	52,394	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	129.27	141.1	3,351	349,287	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	12.83	14.92	159	16,666	素材
XILINX INC	25.83	28.92	436	45,540	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	29.84	29.84	97	10,179	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA	19	–	–	–	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	23.4	27.83	718	74,870	生活必需品
TRIMBLE INC	22	29.38	214	22,379	情報技術
LENNAR CORP-A	33.94	33.94	257	26,843	一般消費財・サービス
LEAR CORP	6	6	98	10,236	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	39.17	–	–	–	その他
PROGRESSIVE CORP	64.74	73.91	702	73,253	金融
PACCAR INC	35.25	48.25	425	44,366	資本財・サービス
PVH CORP	6.18	–	–	–	一般消費財・サービス
BIOGEN INC	21.3	19.48	521	54,317	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	9.37	10.24	518	54,064	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	130.62	148.28	1,551	161,661	一般消費財・サービス
PTC INC	12	12	154	16,154	情報技術
PERRIGO CO PLC	19.29	19.29	86	8,967	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	34.23	42.9	382	39,889	公益事業
INTUIT INC	28.46	34.01	1,266	131,989	情報技術
BORGWARNER INC	30.81	30.81	123	12,903	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	23	29.87	330	34,489	一般消費財・サービス
BALL CORP	35.8	38.6	349	36,434	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	162.47	184.24	671	69,976	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	36.77	36.77	519	54,123	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	16.06	16.06	261	27,285	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28.56	32.07	752	78,432	ヘルスケア
VF CORP	38.82	42.16	367	38,265	一般消費財・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B	57.34	72.02	295	30,822	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	9.42	9.42	139	14,490	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10.03	10.03	176	18,373	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	49.92	49.92	100	10,479	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	510.46	574.77	2,961	308,647	コミュニケーション・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	21	21	54	5,664	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	22	36	207	21,643	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	56	–	–	–	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	231	231	101	10,593	不動産
アメリカ・ドル通貨計 株数、金額	33,749.8	39,340.65	422,959	44,085,043	
銘柄数<比率>	608銘柄	591銘柄		<65.1%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD	23	23	63	5,168	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2.5	2.5	405	33,100	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	24.38	–	–	–	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	21.21	37.21	300	24,530	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	42	63	343	28,024	素材
INTACT FINANCIAL CORP	17	17	243	19,834	金融
BCE INC	9	9	49	4,045	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	22	22	355	28,972	素材
SUNCOR ENERGY INC	172.12	218.12	510	41,628	エネルギー
METRO INC/CN	30	30	174	14,247	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	33	39.41	287	23,483	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	130	150.75	1,026	83,680	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	44	57	643	52,477	金融
TORONTO-DOMINION BANK	189	230.3	1,708	139,371	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	39	39	120	9,790	金融
ROYAL BANK OF CANADA	166	182.32	1,966	160,358	金融
TC ENERGY CORP	88	113.04	609	49,739	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	55.71	63.75	215	17,574	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	192	–	–	–	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	174	218.48	656	53,511	素材
CAE INC	23	23	79	6,486	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	18.33	22.84	232	18,971	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	18	18	64	5,232	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6	–	–	–	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	10	15.6	94	7,668	素材
HYDRO ONE LTD	48	48	139	11,360	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	24.89	24.89	160	13,087	生活必需品
WSP GLOBAL INC	12	12	147	12,006	資本財・サービス
PARKLAND CORP	28	28	124	10,157	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	23	23	73	6,023	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	25	27.31	142	11,640	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	10	31	2,564	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	39	56	341	27,838	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	29	29	257	20,965	素材
STARS GROUP INC/THE	35	–	–	–	その他
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	70	70	150	12,291	公益事業
B2GOLD CORP	–	164	110	8,988	素材
AIR CANADA	17	17	38	3,104	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	105.34	147.57	136	11,097	素材
BANK OF MONTREAL	66	82	818	66,792	金融
POWER CORP OF CANADA	31	63	188	15,358	金融
METHANEX CORP	6	–	–	–	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	10	14.44	2,169	176,942	情報技術
NUTRIEN LTD	60.27	80.27	526	42,953	素材
AURORA CANNABIS INC	70	–	–	–	ヘルスケア
CANOPY GROWTH CORP	20	20	80	6,547	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	34	–	–	–	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	22	31.93	165	13,502	素材
TOPICUS.COM INC	–	4.64	2	182	その他
CAMECO CORP	28	28	50	4,138	エネルギー

銘柄	期首 株数	当期末 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
FIRSTSERVICE CORP	–	4.22	74	6,053	不動産
TELUS CORP	3	6	15	1,302	コミュニケーション・サービス
POWER FINANCIAL CORP	20	–	–	–	その他
TECK RESOURCES LTD-CLS B	44	44	107	8,784	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	4	7.43	130	10,665	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	117	152	513	41,902	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3	3	141	11,532	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	31	31	295	24,105	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	9.01	9.01	88	7,198	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	–	43.08	188	15,361	素材
BLACKBERRY LTD	64	64	62	5,089	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	65	72.66	438	35,793	金融
ENBRIDGE INC	213	267	1,133	92,484	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	90	180	885	72,214	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	202	266	637	51,981	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	43	43	129	10,521	ヘルスケア
ENCANA CORP	152	–	–	–	その他
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	18	18	837	68,342	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	11	11	61	5,044	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	28	28	99	8,097	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	71	87.93	1,280	104,475	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	28	28	281	22,989	情報技術
HUSKY ENERGY INC	30.12	–	–	–	その他
ONEX CORPORATION	16	16	116	9,535	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	68	68	155	12,656	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	3	3	10	864	金融
TMX GROUP LTD	–	7.94	99	8,140	金融
OPEN TEXT CORP	27	45	254	20,754	情報技術
CI FINANCIAL CORP	20	20	32	2,681	金融
SAPUTO INC	29	29	107	8,786	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63	63	155	12,681	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	90	100.13	423	34,503	生活必需品
YAMANA GOLD INC	–	119	82	6,696	素材
FORTIS INC	42	62	316	25,774	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	–	13.55	114	9,312	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	66	66	75	6,147	素材
CENOVUS ENERGY INC	141	141	115	9,452	エネルギー
DOLLARAMA INC	27	35.29	190	15,545	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	8	8	29	2,415	公益事業
ALTAGAS LTD	47	47	88	7,241	公益事業
KEYERA CORP	22	22	53	4,388	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	48	48	63	5,144	エネルギー
カナダ・ドル通貨計 株数、金額	4,325.88	4,855.61	25,896	2,112,108	
カナダ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	85銘柄	82銘柄		< 3.1%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
MEDIBANK PRIVATE LTD	228.24	228.24	67	5,446	金融
BHP GROUP LTD	318.05	365.48	1,699	136,536	素材
SOUTH32 LTD	563.87	563.87	146	11,778	素材
ALUMINA LTD	362.17	–	–	–	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	95.76	156.53	398	32,017	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	205.54	205.54	518	41,629	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	36	–	–	–	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	297.31	421.03	977	78,509	金融
WESTPAC BANKING CORP	368.11	442.7	898	72,164	金融
SANTOS LTD	182.7	182.7	131	10,568	エネルギー
AUSNET SERVICES	285	285	51	4,121	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	307.72	351.9	839	67,427	金融
RIO TINTO LTD	41.69	41.69	510	40,996	素材
ORIGIN ENERGY LTD	209.68	209.68	107	8,608	エネルギー
AURIZON HOLDINGS LTD	290.47	290.47	111	8,984	資本財・サービス
XERO LTD	–	6.32	85	6,901	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	–	9.53	27	2,215	エネルギー
COLES GROUP LTD	166.96	166.96	308	24,815	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	–	25.09	69	5,591	情報技術
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	–	81.83	104	8,401	素材
EVOLUTION MINING LTD	–	170.17	80	6,452	素材
AFTERPAY LTD	–	30	341	27,473	情報技術
TPG TELECOM LTD	–	50	34	2,783	コミュニケーション・サービス
OIL SEARCH LTD	154.18	173.45	73	5,894	エネルギー
SEEK LTD	26	26	72	5,821	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	101.73	101.73	94	7,560	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	84.2	119.81	315	25,334	素材
INCITEC PIVOT LTD	204	–	–	–	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	188.45	218.56	1,861	149,533	金融
AMPOL LTD	20	20	55	4,487	エネルギー
ORICA LTD	58.45	58.45	89	7,161	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	153.48	153.48	129	10,444	金融
CIMIC GROUP LTD	10	10	25	2,014	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	140.56	169.8	677	54,444	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	26	26	33	2,711	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	173.52	173.52	69	5,604	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	30	30	30	2,453	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	–	63.73	31	2,513	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	351.14	351.14	105	8,463	コミュニケーション・サービス
AMP LTD	249.35	249.35	39	3,205	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	67.33	67.33	244	19,608	素材
MACQUARIE GROUP LTD	31.29	42.77	598	48,109	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	61.63	61.63	194	15,616	一般消費財・サービス
CSL LTD	54.73	55.5	1,531	123,042	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	157.53	137.98	709	56,967	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	8.05	8.05	147	11,828	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	70.92	70.92	130	10,512	素材
SUNCORP GROUP LTD	145.04	145.04	150	12,106	金融
BORAL LTD	86	–	–	–	素材
ASX LTD	22.6	22.6	163	13,147	金融
COMPUTERSHARE LTD	20.61	60.54	85	6,848	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	270.97	132	10,667	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	52.23	52.23	175	14,073	ヘルスケア
CHALLENGER LTD	63	–	–	–	金融
WORLEY LTD	71.87	–	–	–	エネルギー
AGL ENERGY LTD	84.66	84.66	103	8,318	公益事業
BRAMBLES LTD	183.37	183.37	194	15,586	資本財・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	8	–	–	–	一般消費財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20.64	20.64	124	9,982	ヘルスケア
REA GROUP LTD	6.08	6.08	88	7,125	コミュニケーション・サービス
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15.51	15.51	79	6,404	金融
オーストラリア・ドル通貨計 株数、金額	7,432.39	7,535.57	16,069	1,291,019	
オーストラリア・ドル通貨計 銘柄数<比率>	53銘柄	54銘柄		< 1.9%>	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	235	235	970	13,044	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	220	230	1,391	18,701	一般消費財・サービス
MTR CORP	165	165	726	9,757	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	190	190	2,052	27,578	不動産
SINO LAND CO	340	340	354	4,761	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	285.52	375.52	2,127	28,591	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	80	80	368	4,945	不動産
CLP HOLDINGS LTD	190	170	1,229	16,519	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	205.65	205.65	640	8,609	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,180.35	1,638.36	1,887	25,366	公益事業
HANG SENG BANK LTD	90	80	1,167	15,687	金融
WHEELOCK & CO LTD	160	–	–	–	その他
NEW WORLD DEVELOPMENT	580	175	637	8,561	不動産
WH GROUP LTD	915	1,695	1,135	15,263	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	139	149	6,707	90,155	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	370	370	764	10,268	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20	30	284	3,822	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	80	–	–	–	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	150	–	–	–	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	75	–	–	–	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	86	86	146	1,964	金融
SJM HOLDINGS LTD	100	100	83	1,126	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	80	80	188	2,532	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	305.52	285.52	1,134	15,253	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	55	230	3,097	公益事業
PCCW LTD	600	600	268	3,604	コミュニケーション・サービス
AIA GROUP LTD	1,478	1,594	15,756	211,769	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140	200	843	11,329	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	120	–	–	–	生活必需品
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	192	192	492	6,618	生活必需品
ESR CAYMAN LTD	–	180	488	6,568	不動産
SANDS CHINA LTD	238	290	928	12,472	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	190	190	2,204	29,621	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	390	450	1,127	15,150	金融
WYNN MACAU LTD	168	168	210	2,826	一般消費財・サービス
香港ドル通貨計 株数、金額	9,813.04	10,599.05	46,545	625,571	
香港ドル通貨計 銘柄数<比率>	34銘柄	30銘柄		< 0.9%>	
(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	129	179	425	33,368	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	211	233	627	49,150	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	71	177.5	76	5,980	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	173	173	97	7,645	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	166	30	23	1,828	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	52	37	2,929	不動産
CAPITALAND LTD	334	334	114	8,977	不動産
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	270	–	–	–	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	120	–	–	–	コミュニケーション・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9	–	–	–	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	348	447	473	37,128	金融
GENTING SINGAPORE LTD	450	450	38	3,032	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	32	32	64	5,042	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	924	1,284	321	25,153	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	141	55	4,342	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	40	–	–	–	資本財・サービス
SATS LTD	77	–	–	–	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	168	168	168	13,217	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	369	–	–	–	資本財・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	158	79	6,239	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計 株数、金額	4,242	3,858.5	2,603	204,037	
シンガポール・ドル通貨計 銘柄数<比率>	20銘柄	14銘柄		< 0.3%>	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	150	150	126	9,442	公益事業
MERCURY NZ LTD	217.05	32.94	23	1,743	公益事業
A2 MILK CO LTD	70	70	79	5,971	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	168.6	168.6	82	6,176	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81	132.89	105	7,868	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	145.26	–	–	–	素材

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	92	92	295	22,078	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	44.19	44.19	68	5,120	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル 通貨計 株数、金額	968.1	690.62	781	58,400	
通貨計 銘柄数<比率>	8銘柄	7銘柄		<0.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
TUI AG-DI	48.02	–	–	–	一般消費財・サービス
BP PLC	2,309.65	2,510.81	750	105,737	エネルギー
UNILEVER PLC	120.91	337.93	1,492	210,324	生活必需品
BARCLAYS PLC	1,801.73	2,413.6	364	51,434	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	177.45	768.95	81	11,460	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	324.28	–	–	–	一般消費財・サービス
PRUDENTIAL PLC	303.22	314.21	446	62,906	金融
NATWEST GROUP PLC	508.36	508.36	82	11,599	金融
EVRAZ PLC	74.41	74.41	37	5,310	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	17.58	17.58	46	6,556	素材
BAE SYSTEMS PLC	377.96	377.96	187	26,443	資本財・サービス
AVIVA PLC	443.49	510.81	176	24,888	金融
AVEVA GROUP PLC	11.4	11.4	39	5,625	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC	546.29	629.03	877	123,674	ヘルスケア
INFORMA PLC	162	162	88	12,452	コミュニケーション・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	42.04	–	–	–	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC	643.35	643.35	118	16,638	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	144.99	144.99	85	12,081	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	9.38	9.38	51	7,281	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	44.17	62.34	155	21,965	一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7.4	7.4	86	12,140	資本財・サービス
HALMA PLC	39.78	39.78	103	14,549	情報技術
ENTAIN PLC	88.05	88.05	126	17,845	一般消費財・サービス
NMC HEALTH PLC	9.75	–	–	–	その他
JD SPORTS FASHION PLC	64.11	64.11	56	7,980	一般消費財・サービス
M&G PLC	259.64	259.64	51	7,192	金融
RELX PLC	202.6	242.03	452	63,720	資本財・サービス
DIAGEO PLC	266.94	293.51	867	122,302	生活必需品
RIO TINTO PLC	125.42	145.2	899	126,757	素材
STANDARD CHARTERED PLC	297.45	319.51	161	22,822	金融
TESCO PLC	1,093.1	1,344.91	328	46,326	生活必需品
FRESNILLO PLC	–	39.07	46	6,492	素材
SMITH & NEPHEW PLC	112.97	112.97	178	25,108	ヘルスケア
GLENCORE PLC	1,235.14	1,292.26	349	49,275	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	32	52	7,342	金融
SMITHS GROUP PLC	40.8	40.8	63	8,950	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	109.63	168.79	57	8,040	金融
PEARSON PLC	82.71	82.71	55	7,891	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	176.31	176.31	41	5,876	生活必需品
NEXT PLC	11.59	16.85	128	18,058	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	322.36	53	7,591	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	17.85	17.85	54	7,615	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	31.59	31.59	78	11,055	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	3,034.98	3,591.29	460	64,939	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	17.49	17.49	115	16,323	素材
KINGFISHER PLC	172.29	172.29	48	6,786	一般消費財・サービス
WPP PLC	130.21	130.21	105	14,931	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	82.44	76	10,819	公益事業
SEVERN TRENT PLC	13	43	100	14,181	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	177.58	222.42	119	16,877	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	80.82	91.11	597	84,185	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	48.83	48.83	57	8,103	金融
SCHRODERS PLC	12.27	12.27	43	6,085	金融
SSE PLC	124.6	124.6	198	28,001	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	39.42	–	–	–	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	123.68	86	12,219	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	144.04	166.08	1,254	176,865	ヘルスケア
FERGUSON PLC	27.24	27.24	249	35,190	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	682.32	682.32	187	26,484	金融
3I GROUP PLC	132.93	132.93	153	21,676	金融
ASHTEAD GROUP PLC	59.21	59.21	216	30,459	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	97.25	115.48	67	9,443	情報技術
NATIONAL GRID PLC	357.13	451.05	395	55,789	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	7,349.13	8,652.13	312	44,100	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	125.86	125.86	85	12,033	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	102.29	137.85	222	31,299	生活必需品
CENTRICA PLC	680.02	–	–	–	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	19.63	19.63	91	12,828	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	255.03	286.95	797	112,410	生活必需品
BHP GROUP PLC	261.42	269.34	582	82,166	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	49.64	49.64	110	15,531	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	2,333.46	2,560.05	1,045	147,284	金融
ANGLO AMERICAN PLC	107.45	146.45	403	56,937	素材
MONDI PLC	59.21	59.21	109	15,450	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	391.67	391.67	71	10,115	生活必需品
CARNIVAL PLC	13.83	–	–	–	一般消費財・サービス
EASYJET PLC	16.44	–	–	–	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC	164.81	219.92	310	43,703	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	25.69	49.69	139	19,665	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	856.24	1,317.54	188	26,498	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	25.74	25.74	60	8,525	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	51.36	51.36	92	13,076	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	21.82	21.82	103	14,573	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	15.92	18.97	108	15,298	資本財・サービス
ITV PLC	275.87	–	–	–	コミュニケーション・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	34.41	37.5	345	48,645	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	477.42	495.26	724	102,078	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	428.67	482.46	679	95,700	エネルギー
MEGGITT PLC	99.25	–	–	–	資本財・サービス
G4S PLC	113.2	–	–	–	資本財・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	–	20.39	54	7,635	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	15.7	46	6,582	金融
ANTOFAGASTA PLC	34.6	34.6	53	7,561	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	330.46	330.46	98	13,888	金融
EXPERIAN PLC	93.19	121.19	343	48,389	資本財・サービス
イギリス・ポンド 通貨計 株数、金額	33,125.03	36,870.13	21,091	2,972,663	
通貨計 銘柄数<比率>	93銘柄	84銘柄		<4.4%>	
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シュケル	千円	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	120	120	158	5,199	金融
AZRIELI GROUP LTD	5.3	5.3	115	3,778	不動産
ICL GROUP LTD	110.96	110.96	196	6,451	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	3	3	124	4,099	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	151.6	151.6	350	11,508	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	190.43	190.43	379	12,467	金融
NICE LTD	8	8	692	22,745	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	–	38.83	306	10,062	金融
イスラエル・シュケル 通貨計 株数、金額	589.29	628.12	2,323	76,313	
通貨計 銘柄数<比率>	7銘柄	8銘柄		<0.1%>	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
DUFRY AG-REG	8.3	–	–	–	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	425.77	464.78	626	73,305	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1.3	1.3	111	13,014	素材
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	17.54	105	12,363	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	76.24	88.76	2,776	325,142	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	3.89	–	–	–	金融
SIKA AG-REG	11.4	16.9	431	50,558	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	0.01	87	10,221	生活必需品
ABB LTD-REG	206.23	221.39	591	69,265	資本財・サービス
SWISS RE AG	36.66	36.66	308	36,082	金融
NESTLE SA-REG	335.45	360.55	3,627	424,701	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2.34	2.34	245	28,796	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5.31	5.31	128	15,052	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	301.22	301.22	366	42,958	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	21.98	26.84	145	17,020	金融
SGS SA-REG	0.65	0.65	175	20,541	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1.53	4.67	113	13,276	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	6.65	6.65	90	10,554	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG	7.93	7.93	97	11,374	情報技術
ALCON INC	42.49	58.53	351	41,188	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	5	5	122	14,325	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	14.92	17.92	685	80,321	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	6.11	6.11	97	11,360	金融
CLARIANT AG-REG	15.68	15.68	30	3,535	素材
NOVARTIS AG-REG	234.62	278.51	2,333	273,277	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.2	0.56	115	13,546	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	54.28	67.1	561	65,760	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	2.76	2.76	131	15,398	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	–	7.84	75	8,794	金融
GEBERIT AG-REG	4.56	4.56	266	31,245	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	0.89	1.13	422	49,497	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1.11	1.11	110	12,945	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	5.63	6.72	150	17,656	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	–	21.65	196	23,012	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	8.55	9.13	540	63,265	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	4.5	21	2,477	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	47.7	65.87	341	39,936	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3.81	3.81	164	19,231	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4.95	6.4	127	14,916	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	9.46	81	9,559	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.17	0.17	143	16,859	生活必需品
スイス・フラン 通貨計 株数、金額	1,937.79	2,158.02	17,100	2,002,345	
通貨計 銘柄数<比率>	39銘柄	39銘柄		<3.0%>	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	210.28	236.71	10,190	173,643	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	72.36	72.36	770	13,137	金融
ISS A/S	13.2	–	–	–	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.3	0.39	521	8,878	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	5	5	106	1,814	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18.57	25.57	3,890	66,293	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S	–	11.59	536	9,138	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B	12.32	12.32	1,126	19,200	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	29.81	29.81	1,069	18,230	素材
COLOPLAST-B	15.19	15.19	1,367	23,300	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	27.98	27.98	2,816	47,987	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	–	1.43	351	5,989	資本財・サービス
DEMANT A/S	13.14	13.14	298	5,089	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.66	0.66	951	16,211	資本財・サービス
TRYG A/S	17	17	337	5,755	金融
PANDORA A/S	7.5	16.37	1,048	17,869	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	12.62	12.62	782	13,341	素材
GENMAB A/S	7.33	9.19	2,338	39,854	ヘルスケア
ORSTED A/S	22.76	28.37	3,673	62,603	公益事業
AMBU A/S-B	–	20.91	510	8,697	ヘルスケア
デンマーク・クローネ 通貨計 株数、金額	486.02	556.61	32,690	557,038	
通貨計 銘柄数<比率>	17銘柄	19銘柄		<0.8%>	

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORSK HYDRO ASA	130.5	130.5	536	6,557	素材
DNB ASA	85.45	128.38	2,134	26,089	金融
ORKLA ASA	137.84	74.83	639	7,814	生活必需品
TELENOR ASA	87.46	87.46	1,276	15,603	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	111.21	142.48	2,233	27,291	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	27.56	27.56	1,049	12,824	素材
MOWI ASA	46.77	46.77	885	10,819	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	20	386	4,716	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	17	17	510	6,232	コミュニケーション・サービス
AKER BP ASA	13.06	–	–	–	エネルギー
ADEVINTA ASA	–	45.82	621	7,592	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ 株数、金額	676.85	720.8	10,273	125,542	
通貨計 銘柄数<比率>	10銘柄	10銘柄		<0.2%>	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB	7	26	1,068	13,424	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	403.81	445.95	4,398	55,249	情報技術
VOLVO AB-B SHS	181.58	188.73	3,968	49,850	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	7.77	–	–	–	コミュニケーション・サービス
SKF AB-B SHARES	40	40	917	11,520	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	26	26	488	6,129	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	21.88	21.88	1,380	17,335	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	70.26	70.26	792	9,949	コミュニケーション・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	196.97	217.79	1,848	23,212	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	165.26	241.45	2,037	25,589	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	90.75	108.21	1,582	19,881	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	90.39	103.52	1,819	22,851	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	–	82.01	1,231	15,466	素材
SKANSKA AB-B SHS	37.09	37.09	839	10,542	資本財・サービス
SANDVIK AB	132.81	146.57	3,168	39,800	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	62.9	62.9	3,860	48,491	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	76.68	85.75	3,992	50,146	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	25	25	324	4,077	資本財・サービス
TELIA CO AB	364.21	364.21	1,243	15,612	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	48.4	48.4	1,117	14,036	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	38.11	48.13	1,954	24,549	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	108.82	144.49	3,076	38,636	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	–	29	818	10,286	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	–	19	768	9,650	不動産
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	9.48	417	5,248	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	–	9.24	176	2,222	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	–	41.79	1,185	14,890	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB	19	19	450	5,655	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	67.47	72.6	1,888	23,717	生活必需品
BOLIDEN AB	31.71	31.71	983	12,346	素材
EPIROC AB-A	69.82	121.82	1,985	24,939	資本財・サービス
EPIROC AB-B	25	40.15	601	7,549	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS	24	114	1,221	15,342	一般消費財・サービス
NORDEA BANK ABP	435.48	435.48	2,984	37,483	金融
EQT AB	–	38.45	817	10,262	金融
EVOLUTION GAMING GROUP	–	20.64	1,671	20,998	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B	36.41	36.41	1,534	19,273	金融
HEXAGON AB-B SHS	38.68	38.68	2,914	36,611	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13	13	352	4,431	金融
スウェーデン・クローネ 株数、金額	2,965.74	3,624.79	61,884	777,263	
通貨計 銘柄数<比率>	32銘柄	38銘柄		<1.1%>	
ユーロ (アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19.95	30.55	122	15,579	素材
AIB GROUP PLC	90	–	–	–	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC	102.34	–	–	–	金融
KINGSPAN GROUP PLC	16	16	105	13,372	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A	17.12	18.22	214	27,223	生活必需品
CRH PLC	80.12	105.17	394	50,020	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8.89	22.04	380	48,251	一般消費財・サービス
国小計 株数、金額	334.42	191.98	1,218	154,447	
銘柄数<比率>	7銘柄	5銘柄		<0.2%>	
ユーロ (オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
QIAGEN N.V.	25.21	25.21	108	13,737	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	93.09	114.2	514	65,213	ヘルスケア
NN GROUP NV	31	31	112	14,300	金融
HEINEKEN NV	29.1	37.11	340	43,126	生活必需品
AEGON NV	143.61	380.61	132	16,742	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	131.07	138.93	326	41,357	生活必需品
AKZO NOBEL N.V.	25.04	25.04	229	29,092	素材
KONINKLIJKE DSM NV	19.38	22.3	320	40,554	素材
WOLTERS KLUWER	30.97	33	231	29,375	資本財・サービス
ING GROEP NV	432.86	456.01	367	46,532	金融
KONINKLIJKE KPN NV	295.49	376.07	99	12,672	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV	46.53	53.27	2,210	280,095	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA	34.53	90.53	80	10,215	金融
ADYEN NV	1.5	2.15	375	47,532	情報技術
UNILEVER NV	166.82	–	–	–	その他
JUST EAT TAKEAWAY	–	14	140	17,813	一般消費財・サービス
PROSUS NV	54.94	59.99	523	66,324	一般消費財・サービス
VOPAK	6.3	6.3	26	3,338	エネルギー
RANDSTAD NV	20.2	20.2	110	14,043	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	11	12.85	100	12,775	生活必需品
ALTICE EUROPE NV	112.95	112.95	60	7,620	コミュニケーション・サービス
STMICROELECTRONICS NV	74.98	85.75	286	36,274	情報技術
AIRBUS SE	63.45	74.02	664	84,218	資本財・サービス

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千ユーロ	千円	
ARGENX SE	–	5.16	114	14,517	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	44.83	85	74	9,393	生活必需品
EXOR NV	10.88	10.88	71	9,100	金融
CNH INDUSTRIAL NV	116.91	116.91	129	16,356	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	107.87	169.37	243	30,865	一般消費財・サービス
FERRARI NV	14.78	17.22	309	39,226	一般消費財・サービス
国小計 株数、金額	2,145.29	2,576.03	8,304	1,052,417	
銘柄数<比率>	27銘柄	28銘柄		<1.6%>	
ユーロ (ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
GALAPAGOS NV	5.57	5.57	46	5,858	ヘルスケア
UCB SA	19.21	19.21	166	21,082	ヘルスケア
KBC GROUP NV	30.11	30.11	179	22,711	金融
COLRUYT SA	3.5	3.5	17	2,164	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	15.39	11.39	96	12,197	金融
SOLVAY SA	8.73	8.73	88	11,262	素材
UMICORE	16	22.7	100	12,758	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	83.47	98.76	559	70,852	生活必需品
AGEAS	16.54	16.54	75	9,612	金融
PROXIMUS	22.69	22.69	38	4,822	コミュニケーション・サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	4.62	–	–	–	コミュニケーション・サービス
ELIA GROUP SA/NV	–	7	69	8,791	公益事業
SOFINA	–	2.39	64	8,193	金融
国小計 株数、金額	225.83	248.59	1,501	190,307	
銘柄数<比率>	11銘柄	12銘柄		<0.3%>	
ユーロ (ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AROUNDTOWN SA	160.64	160.64	92	11,661	不動産
ARCELORMITTAL	80.31	80.31	161	20,513	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	1.31	14.8	109	13,834	ヘルスケア
SES	44.02	44.02	33	4,295	コミュニケーション・サービス
TENARIS SA	47	47	32	4,142	エネルギー
国小計 株数、金額	333.28	346.77	429	54,446	
銘柄数<比率>	5銘柄	5銘柄		<0.1%>	
ユーロ (フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA	8.45	–	–	–	コミュニケーション・サービス
TOTAL SE	255.19	307.62	1,135	143,911	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	18.61	21.46	230	29,167	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	52.1	61.19	833	105,617	素材
KERING	8.24	9.77	569	72,196	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	58.92	67.45	855	108,387	資本財・サービス
BOUYGUES SA	18.92	27.21	95	12,113	資本財・サービス
BNP PARIBAS	122.69	134	602	76,384	金融
PEUGEOT SA	64.97	64.97	141	17,891	一般消費財・サービス
NATIXIS	76.74	76.74	21	2,786	金融
THALES SA	14.04	14.04	105	13,380	資本財・サービス
DANONE	64.94	75.51	397	50,411	生活必需品
CARREFOUR SA	80.22	80.22	122	15,579	生活必需品
SUEZ	29.5	29.5	49	6,235	公益事業
VIVENDI	104.3	104.3	272	34,551	コミュニケーション・サービス
L'OREAL	27.41	32.05	977	123,922	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	58.49	69.75	299	37,947	資本財・サービス
LEGRAND SA	30.42	41.19	330	41,927	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	2	–	–	–	生活必需品
PERNOD RICARD SA	26.32	27.44	430	54,526	生活必需品
EURAZEO SE	5.6	5.6	32	4,070	金融
SOCIETE GENERALE SA	80.65	110.65	194	24,592	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	29.88	34.42	1,798	227,873	一般消費財・サービス
ACCOR SA	18.5	18.5	54	6,895	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	16.45	19.81	244	30,954	情報技術
VALEO SA	37.03	37.03	113	14,345	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	29.18	29.18	125	15,901	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA	32.27	32.27	74	9,401	資本財・サービス
EIFFAGE	7.5	9.45	74	9,484	資本財・サービス
SODEXO SA	12.48	12.48	93	11,842	一般消費財・サービス
IPSEN	2.76	2.76	19	2,429	ヘルスケア
INGENICO GROUP	4.99	–	–	–	その他
ORPEA	–	5.24	56	7,208	ヘルスケア
AMUNDI SA	4.37	4.37	30	3,815	金融
TELEPERFORMANCE	8.7	8.7	234	29,779	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	9.77	9.77	77	9,845	コミュニケーション・サービス
FAURECIA	5.6	5.6	21	2,724	一般消費財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3.99	3.99	118	14,957	ヘルスケア
SEB SA	1.97	1.97	29	3,787	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA	31.11	38.09	492	62,439	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA	0.22	0.22	19	2,459	資本財・サービス
WORLDLINE SA	13.3	31.35	234	29,717	情報技術
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	–	22.16	81	10,345	一般消費財・サービス
AXA SA	231.71	243.18	492	62,406	金融
EDENRED	30.07	30.07	142	18,101	情報技術
RENAULT SA	25.54	25.54	92	11,737	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	3.41	4.51	400	50,765	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	2.53	2.53	37	4,713	生活必需品
ATOS SE	9.46	9.46	62	7,977	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SE	15.15	16.33	271	34,436	情報技術
WENDEL	2.01	2.01	20	2,565	金融
ORANGE	257.92	257.92	259	32,898	コミュニケーション・サービス
ALSTOM	29.61	29.61	139	17,696	資本財・サービス
CNP ASSURANCES	13.49	13.49	18	2,309	金融
SANOFI	120.77	142.91	1,132	143,511	ヘルスケア
VINCI SA	55.31	69.25	571	72,384	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	73.51	73.51	159	20,215	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	146.09	146.09	153	19,485	金融
BIOMERIEUX	4.57	4.57	53	6,729	ヘルスケア
ENGIE	210.99	210.99	277	35,201	公益事業

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千ユーロ	千円	
EDF		67.6	67.6	90	11,492	公益事業
SAFRAN SA		35.87	43.81	510	64,681	資本財・サービス
ILIAD SA		2.19	2.19	36	4,573	コミュニケーション・サービス
ARKEMA		8.38	8.38	79	10,080	素材
ADP		3.5	3.5	33	4,231	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS		14	–	–	–	コミュニケーション・サービス
SCOR SE		32.89	32.89	91	11,537	金融
GETLINK SE		39.4	49.73	69	8,816	資本財・サービス
BOLLORE		73	73	24	3,095	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額	2,987.76	3,251.09	16,913	2,143,461	
	銘柄数<比率>	67銘柄	65銘柄		< 3.2%>	
ユーロ（ドイツ）		百株	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG		100.78	125.53	640	81,117	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		18	18	48	6,168	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		229.67	255.58	243	30,844	金融
COMMERZBANK AG		96.89	96.89	54	6,854	金融
VOLKSWAGEN AG		4.2	4.2	69	8,867	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		21.21	22.72	329	41,721	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG		82.21	94.65	1,173	148,713	資本財・サービス
E.ON SE		276.97	300.06	270	34,307	公益事業
UNIPER SE		13.8	20.66	63	8,006	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		29.21	37.29	258	32,749	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		13	13	37	4,784	資本財・サービス
CONTINENTAL AG		11.8	14.74	171	21,724	一般消費財・サービス
BASF SE		112.83	112.83	762	96,589	素材
ALLIANZ SE-REG		45.48	53.92	1,096	138,920	金融
THYSSENKRUPP AG		40.3	–	–	–	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		18.57	26.83	242	30,791	生活必需品
RWE AG		75.26	75.26	287	36,462	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		17	17	17	2,188	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		5.6	–	–	–	資本財・サービス
BRENNTAG AG		14.36	21.21	143	18,181	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		48.35	48.35	188	23,847	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		9.59	9.59	34	4,393	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG		1.66	1.66	13	1,699	資本財・サービス
SAP SE		104.71	130.66	1,385	175,586	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		17.04	17.04	409	51,935	金融
ZALANDO SE		20.25	20.25	192	24,379	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG		21.28	21.28	142	18,090	素材
KION GROUP AG		6	6	45	5,713	資本財・サービス
WIRECARD AG		13.67	–	–	–	情報技術
COVESTRO AG		19.45	19.45	104	13,246	素材
SARTORIUS AG-VORZUG		3.05	5.13	182	23,157	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		21.02	21.02	115	14,645	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE		10.56	19.79	261	33,193	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		5.6	5.6	63	8,047	ヘルスケア
METRO AG		15	–	–	–	生活必需品
BECHTLE AG		–	2.73	47	6,033	情報技術
NEMETSCHEK SE		–	11.39	66	8,379	情報技術
SCOUT24 AG		–	14.6	94	11,915	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		15	40.38	179	22,705	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG		5.49	5.49	62	7,976	資本財・サービス
HELLOFRESH SE		–	18.14	114	14,482	一般消費財・サービス
TEAMVIEWER AG		–	14.61	59	7,554	情報技術
SIEMENS ENERGY AG		–	47.32	157	19,969	資本財・サービス
BEIERSDORF AG		12.75	12.75	119	15,165	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE-PREF		7	7	32	4,077	素材
MERCK KGAA		16.92	16.92	245	31,070	ヘルスケア
ADIDAS AG		19.8	23.85	696	88,227	一般消費財・サービス
PUMA SE		12.95	12.95	113	14,425	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		13.11	13.11	103	13,092	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		363.69	418.6	635	80,581	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		22.71	25.61	176	22,420	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		98.52	110.27	630	79,864	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		130.44	164.97	553	70,141	情報技術
HANNOVER RUECK SE		6.44	6.44	86	10,903	金融
DEUTSCHE POST AG-REG		106.76	131.16	537	68,066	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		18.04	24.04	329	41,753	金融
LANXESS AG		15.29	15.29	96	12,226	素材
MTU AERO ENGINES AG		6.66	6.66	136	17,319	資本財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE		47.96	47.96	200	25,454	不動産
SYMRISE AG		14.36	16.56	176	22,413	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		62.4	62.4	14	1,893	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		9	9	48	6,130	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		57.63	71.86	413	52,364	不動産
LEG IMMOBILIEN AG		–	10.73	129	16,434	不動産
国小計	株数、金額	2,607.29	2,998.98	15,307	1,939,976	
	銘柄数<比率>	57銘柄	60銘柄		< 2.9%>	
ユーロ（ポルトガル）		百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS		29	29	42	5,433	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		275.76	275.76	152	19,388	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		71.83	71.83	66	8,391	エネルギー
国小計	株数、金額	376.59	376.59	262	33,213	
	銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		< 0.0%>	
ユーロ（スペイン）		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA		542.59	570.39	202	25,690	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA		21.5	37.6	84	10,688	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		711.85	951.66	404	51,268	金融
IBERDROLA SA		685.24	720.39	894	113,297	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		503.83	–	–	–	金融
BANKINTER SA		67	–	–	–	金融
REPSOL SA		176.85	176.85	152	19,355	エネルギー
GRIFOLS SA		30.04	51.14	120	15,314	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		1,775.93	2,073.7	582	73,846	金融
AMADEUS IT GROUP SA		50.48	54	303	38,487	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA		39.78	39.78	80	10,158	公益事業
MAPFRE SA		80.05	–	–	–	金融
CAIXABANK SA		468.59	468.59	107	13,634	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		35.83	35.83	100	12,773	資本財・サービス
AENA SME SA		8.66	8.66	120	15,244	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA		20.96	45.46	220	27,987	コミュニケーション・サービス
IBERDROLA SA - RTS		685.24	–	–	–	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		117.54	142.55	373	47,367	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		17.93	17.93	66	8,443	資本財・サービス
ENAGAS SA		36.75	36.75	66	8,453	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		40.56	51.47	83	10,615	公益事業
FERROVIAL SA		60.55	60.55	131	16,636	資本財・サービス
BANKIA SA		159.05	–	–	–	金融
国小計	株数、金額	6,336.8	5,543.3	4,097	519,261	
	銘柄数<比率>	23銘柄	18銘柄		< 0.8%>	
ユーロ（イタリア）		百株	百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA		41.45	41.45	126	16,042	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		117.33	159.85	230	29,211	金融
MEDIOBANCA SPA		99.71	99.71	74	9,464	金融
UNICREDIT SPA		294.71	294.71	236	30,013	金融
TELECOM ITALIA SPA		1,085.03	1,085.03	42	5,332	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP		483.81	483.81	20	2,638	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO		1,354.57	2,135.25	414	52,572	金融
ATLANTIA SPA		60.27	60.27	83	10,639	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		77.27	77.27	65	8,356	金融
MONCLER SPA		15.22	24.35	116	14,812	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		6.92	12.85	55	6,976	ヘルスケア
ENI SPA		286.21	360.61	323	41,029	エネルギー
PIRELLI & C SPA		56.51	–	–	–	一般消費財・サービス
DIASORIN SPA		–	2.77	44	5,599	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		–	24.14	23	2,921	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA		–	35.53	55	7,076	情報技術
AMPLIFON SPA		–	17.5	58	7,469	ヘルスケア
LEONARDO SPA		66.76	–	–	–	資本財・サービス
ENEL SPA		889.57	983.37	879	111,512	公益事業
SNAM SPA		243	243	112	14,301	公益事業
TERNA SPA		199	199	123	15,666	公益事業
FINECOBANK SPA		59.72	59.72	82	10,395	金融
国小計	株数、金額	5,437.06	6,400.19	3,172	402,030	
	銘柄数<比率>	18銘柄	20銘柄		< 0.6%>	
ユーロ（フィンランド）		百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ		65.25	65.25	204	25,898	素材
NOKIA OYJ		652.61	652.61	205	26,014	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		41.16	41.16	35	4,461	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		88.53	88.53	144	18,332	素材
NELES OYJ		11.08	–	–	–	資本財・サービス
ELISA OYJ		13	17.34	79	10,119	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		49.34	68.09	235	29,787	金融
FORTUM OYJ		44	44	93	11,860	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		–	51.25	109	13,821	生活必需品
KONE OYJ-B		38.6	45.43	302	38,366	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ		17.7	–	–	–	一般消費財・サービス
NESTE OYJ		48.49	57.78	355	45,033	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		17.63	17.63	65	8,360	ヘルスケア
国小計	株数、金額	1,087.39	1,149.07	1,831	232,057	
	銘柄数<比率>	12銘柄	11銘柄		< 0.3%>	
ユーロ（オーストリア）		百株	百株	千ユーロ	千円	
VERBUND AG		12.16	12.16	91	11,604	公益事業
OMV AG		12.09	12.09	44	5,598	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		27.5	34.89	90	11,522	金融
VOESTALPINE AG		18	18	55	6,987	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		11	11	19	2,442	金融
ANDRITZ AG		5.5	–	–	–	資本財・サービス
国小計	株数、金額	86.25	88.14	301	38,154	
	銘柄数<比率>	6銘柄	5銘柄		< 0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額	21,957.96	23,170.73	53,339	6,759,775	
	銘柄数<比率>	236銘柄	232銘柄		<10.0%>	
ファンド合計	株数、金額	122,269.89	134,609.2	–	61,647,123	
	銘柄数<比率>	1,242銘柄	1,208銘柄		<91.1%>	

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

(2) 外国投資信託証券

銘柄		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC		1.679	1.679	264	27,541
SIMON PROPERTY GROUP INC		3.433	4.233	351	36,681
BOSTON PROPERTIES INC		1.556	2.356	211	22,000
VORNADO REALTY TRUST		2.128	2.128	75	7,822
SBA COMMUNICATIONS CORP		1.28	1.501	390	40,733
EQUITY RESIDENTIAL		4.248	5.245	304	31,735
EQUINIX INC		0.944	1.081	737	76,886
AMERICAN TOWER CORP		4.869	5.555	1,193	124,438
HOST HOTELS & RESORTS INC		6.228	12.228	175	18,314
KIMCO REALTY CORP		3.3	−	−	−
INVITATION HOMES INC		6.081	6.976	202	21,122
VICI PROPERTIES INC		5.464	5.464	138	14,431
VENTAS INC		3.702	4.401	203	21,192
WEYERHAEUSER CO		7.435	8.683	287	29,956
AGNC INVESTMENT CORP		7.559	7.559	116	12,117
CROWN CASTLE INTL CORP		4.614	5.102	780	81,394
IRON MOUNTAIN INC		3.474	3.474	97	10,138
VEREIT INC		13.632	2.726	95	9,958
SUN COMMUNITIES INC		1.214	1.214	174	18,236
PROLOGIS INC		7.007	9.436	893	93,099
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		1.2	1.648	271	28,302
CAMDEN PROPERTY TRUST		1.177	1.177	113	11,778
DUKE REALTY CORP		4.971	4.971	190	19,865
ESSEX PROPERTY TRUST INC		0.771	0.771	178	18,585
FEDERAL REALTY INVS TRUST		0.974	−	−	−
WELLTOWER INC		4.572	4.901	299	31,252
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		6.434	6.434	183	19,092
LIBERTY PROPERTY TRUST		2.058	−	−	−
MID-AMERICA APARTMENT COMM		1.1	1.714	212	22,190
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		1.95	1.95	117	12,290
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		15.632	15.632	127	13,327
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		1.552	−	−	−
REALTY INCOME CORP		3.348	4.587	272	28,408
PUBLIC STORAGE		1.75	2.105	465	48,543
REGENCY CENTERS CORP		1.939	1.939	85	8,896
SL GREEN REALTY CORP		0.65	−	−	−
UDR INC		2.965	4.752	176	18,350
WP CAREY INC		1.6	2.702	179	18,691
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		2.164	2.164	76	7,932
DIGITAL REALTY TRUST INC		2.269	3.415	448	46,724
EXTRA SPACE STORAGE INC		1.072	1.797	200	20,856
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		4.197	8.597	179	18,682
アメリカ・ドル通貨計	口数・金額	154.192	162.297	10.472	1,091,576
	銘柄数<比率>	42銘柄	37銘柄		<1.6%>
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		2	−	−	−
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		1.6	1.6	79	6,476
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		2	−	−	−
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		1.4	1.4	23	1,955
カナダ・ドル通貨計	口数・金額	7	3	103	8,432
	銘柄数<比率>	4銘柄	2銘柄		<0.0%>
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
LENDLEASE GROUP		4.303	4.303	56	4,525
TRANSURBAN GROUP		31.468	33.406	436	35,104
SYDNEY AIRPORT		9.129	9.129	57	4,583
APA GROUP		14.243	14.243	139	11,225
SCENTRE GROUP		64.017	64.017	179	14,400
DEXUS		13.949	13.949	125	10,085
GPT GROUP		30.647	30.647	134	10,808
MIRVAC GROUP		61.117	61.117	157	12,619
STOCKLAND		18.729	18.729	77	6,214
GOODMAN GROUP		20.198	20.198	365	29,338
VICINITY CENTRES		50.371	50.371	78	6,272
オーストラリア・ドル通貨計	口数・金額	318.171	320.109	1,807	145,179
	銘柄数<比率>	11銘柄	11銘柄		<0.2%>
(香港)		千口	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT		24	32	2,236	30,062
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		52	52	400	5,381
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		34	34	335	4,510
香港ドル通貨計	口数・金額	110	118	2,972	39,954
	銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		<0.1%>
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		28	−	−	−
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		30.5	30.5	92	7,265
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		31.5	51.66	116	9,148
SUNTEC REIT		26	26	39	3,076
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		−	46	92	7,245
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		37.6	37.6	81	6,423
シンガポール・ドル通貨計	口数・金額	153.6	191.76	423	33,158
	銘柄数<比率>	5銘柄	5銘柄		<0.0%>
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC		10.295	10.295	67	9,548
SEGRO PLC		13.286	13.286	126	17,882
BRITISH LAND CO PLC		14.58	14.58	65	9,288
イギリス・ポンド通貨計	口数・金額	38.161	38.161	260	36,719
	銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		<0.1%>
ユーロ (フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		1.751	1.751	109	13,900
ICADE		0.406	−	−	−
GECINA SA		0.578	0.578	71	9,046
KLEPIERRE		2.394	2.394	44	5,609
COVIVIO		0.353	0.353	26	3,312
ユーロ通貨計	口数・金額	5.482	5.076	251	31,868
	銘柄数<比率>	5銘柄	4銘柄		<0.0%>
合計	口数・金額	786.606	838.403	−	1,386,889
	銘柄数<比率>	73銘柄	65銘柄		<2.0%>

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
外国		百万円	百万円
	S&P500 EMINI FUT（アメリカ）	3,814	−
	S&P/TSX 60 IX FUT（カナダ）	225	−
	SPI 200 FUTURES（オーストラリア）	186	−
	HANG SENG IDX FUT（香港）	37	−
	FTSE 100 IDX FUT（イギリス）	295	−
	SWISS MKT IX FUTR（スイス）	189	−
	EURO STOXX 50（ドイツ）	585	−

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

■投資信託財産の構成

2021年1月12日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	61,647,123	90.3
投資信託証券	1,386,889	2.0
コール・ローン等、その他	5,233,490	7.7
投資信託財産総額	68,267,503	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イギリス・ポンド＝140.94円、1イスラエル・シュケル＝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ユーロ＝126.73円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（64,274,219千円）の投資信託財産総額（68,267,503千円）に対する比率は、94.2%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
(A) 資産	**130,640,893,085円**
コール・ローン等	4,048,123,263
株式(評価額)	61,647,123,188
投資信託証券(評価額)	1,386,889,965
未収入金	62,511,377,805
未収配当金	58,301,845
差入委託証拠金	989,077,019
(B) 負債	**62,961,779,555**
未払金	62,960,069,555
未払解約金	1,710,000
(C) 純資産総額(A－B)	**67,679,113,530**
元本	27,480,973,178
次期繰越損益金	40,198,140,352
(D) 受益権総口数	**27,480,973,178口**
1万口当り基準価額(C／D)	**24,628円**

＊期首における元本額は24,932,860,048円、当作成期間中における追加設定元本額は11,073,895,044円、同解約元本額は8,525,781,914円です。
＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ　外国株式インデックス（為替ヘッジあり）20,166,452,741円、ダイワファンドラップオンライン　外国株式インデックス（為替ヘッジあり）1,352,817,336円、ｉＦｒｅｅ　外国株式インデックス（為替ヘッジあり）931,749,730円、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）5,029,953,371円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は24,628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
(A) 配当等収益	**987,064,309円**
受取配当金	986,536,948
受取利息	134,329
その他収益金	1,219,904
支払利息	△ 826,872
(B) 有価証券売買損益	**7,925,754,908**
売買益	16,493,607,249
売買損	△ 8,567,852,341
(C) 先物取引等損益	**372,892,882**
取引益	1,583,340,597
取引損	△ 1,210,447,715
(D) その他費用	**△ 13,887,514**
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	**9,271,824,585**
(F) 前期繰越損益金	**28,973,475,897**
(G) 解約差損益金	**△ 9,111,378,086**
(H) 追加信託差損益金	**11,064,217,956**
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	**40,198,140,352**
次期繰越損益金(I)	**40,198,140,352**

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

ダイワファンドラップ
外国株式インデックス
（為替ヘッジなし）

運用報告書（全体版）
第５期

（決算日　2021年６月15日）

（作成対象期間　2020年６月16日～2021年６月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、外国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、投資成果をＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

<2732>

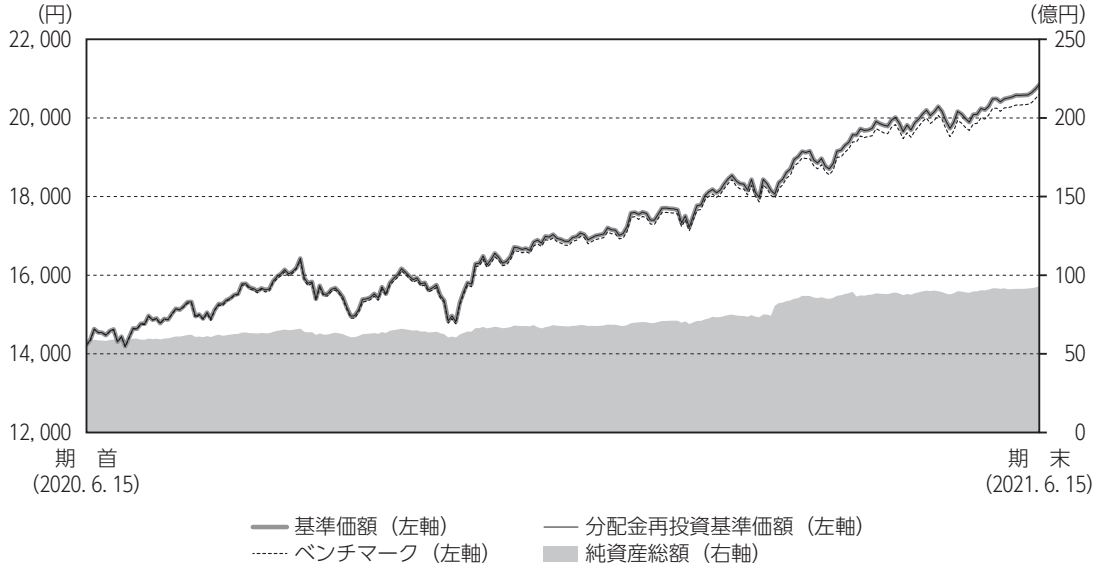
設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1期末（2017年6月15日）	12,232	0	22.3	12,081	20.8	96.0	1.4	2.6	1,719
2期末（2018年6月15日）	13,931	0	13.9	13,533	12.0	96.1	1.5	2.4	3,307
3期末（2019年6月17日）	14,011	0	0.6	13,342	△ 1.4	95.8	1.3	2.9	4,523
4期末（2020年6月15日）	14,231	0	1.6	13,353	0.1	96.5	0.6	2.7	5,717
5期末（2021年6月15日）	20,848	0	46.5	19,329	44.8	91.8	5.9	2.3	9,292

（注1）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注2）ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）は、ＭＳＣＩ Ｉｎｃ．の承諾を得て、ＭＳＣＩコクサイ指数（米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。ＭＳＣＩコクサイ指数（米ドルベース）は、ＭＳＣＩ 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）組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
（注6）株式組入比率は新株予約権証券を含みます。
（注7）株式先物比率は買建比率－売建比率です。

運用経過

基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期　首：14,231円
期　末：20,848円（分配金 0 円）
騰落率：46.5%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

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

年　月　日	基準価額		ＭＳＣＩコクサイ指数(円ベース)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
	円	%		%	%	%	%
(期首)2020年6月15日	14,231	—	13,353	—	96.5	0.6	2.7
6月末	14,420	1.3	13,519	1.2	96.3	1.3	2.6
7月末	14,897	4.7	13,934	4.4	92.7	4.8	2.5
8月末	16,033	12.7	14,999	12.3	92.9	4.9	2.3
9月末	15,399	8.2	14,391	7.8	91.9	5.9	2.3
10月末	14,963	5.1	13,977	4.7	92.7	4.9	2.3
11月末	16,682	17.2	15,573	16.6	93.3	4.7	2.3
12月末	17,158	20.6	16,004	19.9	94.5	3.3	2.2
2021年1月末	17,506	23.0	16,333	22.3	93.8	4.2	2.2
2月末	18,097	27.2	16,895	26.5	92.6	5.2	2.2
3月末	19,300	35.6	17,945	34.4	92.5	5.3	2.2
4月末	20,198	41.9	18,762	40.5	93.7	4.3	2.2
5月末	20,488	44.0	18,998	42.3	92.8	5.1	2.2
(期末)2021年6月15日	20,848	46.5	19,329	44.8	91.8	5.9	2.3

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2020.6.16～2021.6.15）

■海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より、米国の新たな経済対策への期待などから上昇しました。2020年9月以降は、米国の景気回復に対して懐疑的な見方が広がったことなどを受け、上値の重い展開となりました。11月以降は、米国大統領選挙の結果に対する不透明感が解消されたことや新型コロナウイルスのワクチンへの開発進展期待を受け、上昇しました。2021年2月以降は、米国において新規感染者数の減少傾向が鮮明となったことに加え、ワクチン接種が着実に進んでいることが投資家心理を改善させ、上昇して当作成期末を迎えました。

■為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると円安となりました。

対円為替相場は、当作成期首より、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。しかし2020年11月以降は、新型コロナウイルスのワクチン開発に進展があったことで市場のリスク選好姿勢が強まり、円安傾向となりました。2021年に入ると、米国において民主党が大統領府・議会上下両院を制したことから、株価が上昇するなど市場のリスク選好姿勢が強まり、円安となりました。3月には、米国での追加経済対策の成立や、経済指標の改善によって米国金利が上昇したことなどから米ドルが買い進められ、全般的に円安が進行しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

ポートフォリオについて

（2020. 6. 16 ～ 2021. 6. 15）

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

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

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

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

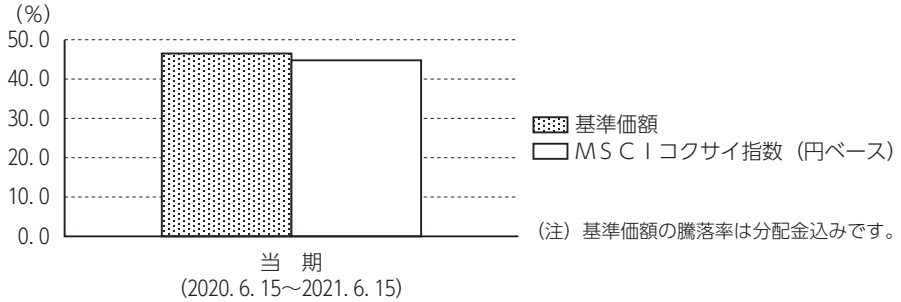
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は44. 8％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は46. 5％となりました。

当ファンドが、組み入れているマザーファンドには保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないことが、かい離要因となりました。

その他、マザーファンドで組み入れているポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、信託報酬、売買コスト等がかい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



＊ベンチマークはＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）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６月16日 ～2021年６月15日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**―**
対基準価額比率	（％）	―
当期の収益	（円）	―
当期の収益以外	（円）	―
翌期繰越分配対象額	（円）	10,848

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

今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

1万口当りの費用の明細

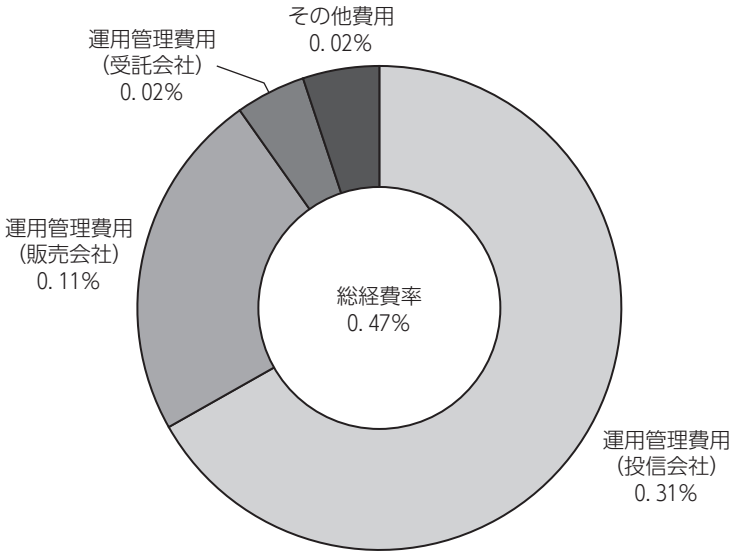
項　　目	当　期 (2020. 6. 16～2021. 6. 15) 金　額	比　率	項　目　の　概　要
信　託　報　酬	77円	0. 445%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は17, 212円です。**
(投 信 会 社)	(54)	(0. 314)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(19)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(4)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0. 004	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株　　式)	(0)	(0. 002)	
(新株予約権証券)	(0)	(0. 000)	
(先物･オプション)	(0)	(0. 001)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 000)	
有価証券取引税	1	0. 004	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)	
(新株予約権証券)	(0)	(0. 000)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	4	0. 024	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(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. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ　の　他)	(0)	(0. 003)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	82	0. 477	

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（１口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0. 47%です。



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

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックスマザーファンド	707,833	2,228,148	474,579	1,475,648

（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６月16日から2021年６月15日まで）

項目	当期
	外国株式インデックスマザーファンド
（a）期中の株式売買金額	20,298,170千円
（b）期中の平均組入株式時価総額	156,184,871千円
（c）売買高比率　（a）／（b）	0.12

（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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国株式インデックスマザーファンド	2,237,678	2,470,931	9,291,443

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年６月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
外国株式インデックスマザーファンド	9,291,443	99.8
コール・ローン等、その他	18,750	0.2
投資信託財産総額	9,310,194	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、６月15日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝110.11円、１カナダ・ドル＝90.68円、１オーストラリア・ドル＝84.91円、１香港・ドル＝14.19円、１シンガポール・ドル＝82.99円、１ニュージーランド・ドル＝78.64円、１イギリス・ポンド＝155.39円、１イスラエル・シュケル＝33.923円、１スイス・フラン＝122.43円、１デンマーク・クローネ＝17.95円、１ノルウェー・クローネ＝13.22円、１スウェーデン・クローネ＝13.22円、１ユーロ＝133.45円です。
（注３）外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（211,600,767千円）の投資信託財産総額（219,797,553千円）に対する比率は、96.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年６月15日現在

項目	当期末
（A）資産	**9,310,194,448円**
コール・ローン等	18,750,868
外国株式インデックスマザーファンド（評価額）	9,291,443,580
（B）負債	**18,132,269**
未払信託報酬	17,911,231
その他未払費用	221,038
（C）純資産総額（A－B）	**9,292,062,179**
元本	4,456,971,386
次期繰越損益金	4,835,090,793
（D）受益権総口数	**4,456,971,386口**
１万口当り基準価額（C／D）	**20,848円**

＊期首における元本額は4,017,999,045円、当作成期間中における追加設定元本額は1,622,654,198円、同解約元本額は1,183,681,857円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は20,848円です。

■損益の状況

当期　自 2020年６月16日　至 2021年６月15日

項目	当期
（A）配当等収益	**△ 3,148円**
受取利息	492
支払利息	△ 3,640
（B）有価証券売買損益	**2,510,069,970**
売買益	2,806,921,847
売買損	△ 296,851,877
（C）信託報酬等	**△ 32,387,606**
（D）当期損益金（A＋B＋C）	**2,477,679,216**
（E）前期繰越損益金	**160,547,148**
（F）追加信託差損益金	**2,196,864,429**
（配当等相当額）	(638,391,479)
（売買損益相当額）	(1,558,472,950)
（G）合計（D＋E＋F）	**4,835,090,793**
次期繰越損益金（G）	**4,835,090,793**
追加信託差損益金	2,196,864,429
（配当等相当額）	(638,391,479)
（売買損益相当額）	(1,558,472,950)
分配準備積立金	2,638,229,512
繰越損益金	△ 3,148

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項目	当期
（a）経費控除後の配当等収益	0円
（b）経費控除後の有価証券売買等損益	2,477,679,502
（c）収益調整金	2,196,864,429
（d）分配準備積立金	160,550,010
（e）当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	4,835,093,941
（f）分配金	0
（g）翌期繰越分配対象額（e－f）	4,835,093,941
（h）受益権総口数	4,456,971,386口

＜補足情報＞

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

■外国株式インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄

株　　式

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
MICROSOFT CORP（アメリカ）	20.7	529,631	25,586	APPLE INC（アメリカ）	9.4	115,811	12,320
AMAZON.COM INC（アメリカ）	1.44	502,549	348,992	STELLANTIS NV（オランダ）	33.359	54,116	1,622
APPLE INC（アメリカ）	34.9	491,083	14,071	NESTLE SA-REG（スイス）	3.6	42,658	11,849
FACEBOOK INC-CLASS A（アメリカ）	7.3	231,797	31,753	ORACLE CORP（アメリカ）	6.6	39,420	5,972
TESLA INC（アメリカ）	3.17	210,946	66,544	BEIGENE LTD-ADR（ケイマン諸島）	1.45	38,370	26,462
ALPHABET INC-CL A（アメリカ）	0.89	195,575	219,747	INGENICO GROUP（フランス）	1.97	32,329	16,410
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A（アメリカ）	3.77	142,542	37,809	ORGANON & CO（アメリカ）	8.782	27,355	3,114
WALMART INC（アメリカ）	9.25	141,738	15,323	MICROSOFT CORP（アメリカ）	1.2	26,585	22,154
SALESFORCE.COM INC（アメリカ）	5	132,653	26,530	OGE ENERGY CORP（アメリカ）	6.75	25,604	3,793
JOHNSON & JOHNSON（アメリカ）	7.2	124,537	17,296	AXALTA COATING SYSTEMS LTD（バミューダ）	7.25	25,567	3,526

（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６月15日現在における外国株式インデックスマザーファンド（58,443,353千口）の内容です。

(1)外国株式

銘柄	2021年６月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
（アメリカ）				
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	40.5	651	71,779	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	34.3	1,260	138,815	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	66	980	107,976	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	47.5	415	45,780	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	21.5	400	44,132	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	206	1,001	110,328	金融
ABBOTT LABORATORIES	614.16	6,785	747,122	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	132.33	462	50,939	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	55	952	104,933	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	121.5	657	72,443	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	211	1,441	158,706	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	15.3	538	59,265	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	215.62	3,158	347,819	情報技術
QORVO INC	38.5	712	78,400	情報技術
AFLAC INC	225.5	1,249	137,631	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	46	632	69,644	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	57.5	496	54,702	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	166.2	9,256	1,019,234	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	76.5	403	44,382	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	43.6	1,472	162,084	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	53.5	763	84,051	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	77.5	2,318	255,254	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	241.5	5,389	593,443	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	48.75	367	40,495	金融
AUTOZONE INC	7.9	1,094	120,562	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	83.21	833	91,805	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	395.5	437	48,121	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	38	334	36,854	公益事業
CELANESE CORP	39.5	618	68,054	素材
DR HORTON INC	121.66	1,070	117,857	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	75	485	53,406	ヘルスケア
AUTODESK INC	77.2	2,165	238,455	情報技術
MOODY'S CORP	58.2	2,023	222,858	金融
DEVON ENERGY CORP	224	649	71,478	エネルギー
ALBEMARLE CORP	41.3	695	76,553	素材
ATMOS ENERGY CORP	45.5	460	50,651	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	85	497	54,817	公益事業
CITIGROUP INC	722.73	5,432	598,121	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	146.5	2,917	321,283	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	174.5	1,485	163,570	公益事業
ALLEGHANY CORP	4.8	335	36,928	金融
DOMINO'S PIZZA INC	13.7	613	67,605	一般消費財・サービス
HESS CORP	98	868	95,681	エネルギー
DAVITA INC	27.5	334	36,808	ヘルスケア

銘柄	2021年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DANAHER CORP	222	5,492	604,779	ヘルスケア
FORTIVE CORP	113	803	88,478	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	197	2,242	246,937	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	196.5	1,281	141,114	生活必需品
BUNGE LTD	48	396	43,666	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	113.75	1,559	171,717	情報技術
APPLE INC	5,847	76,291	8,400,474	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	108	1,303	143,523	金融
BOEING CO/THE	192.1	4,709	518,523	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	53.65	646	71,172	金融
BECTON DICKINSON AND CO	99.39	2,412	265,628	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	76	127	14,017	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	46	490	54,044	資本財・サービス
NISOURCE INC	139	361	39,839	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	46.5	459	50,540	資本財・サービス
BOSTON BEER COMPANY INC-A	3.2	327	36,006	生活必需品
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	294.21	1,460	160,811	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,435.04	8,205	903,514	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	475.5	13,481	1,484,486	金融
ANSYS INC	30.8	1,042	114,798	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	469.17	2,659	292,862	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	240	2,294	252,662	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	779	5,241	577,184	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	1,058.7	16,681	1,836,847	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	80.5	1,550	170,744	金融
LKQ CORP	102.5	499	54,952	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	18.3	274	30,231	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	109.62	829	91,383	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	98.5	1,289	142,037	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	41.4	1,054	116,069	金融
DOLLAR GENERAL CORP	86.5	1,812	199,586	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	68.1	3,468	381,928	情報技術
CATERPILLAR INC	189.5	4,150	456,982	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	85.5	445	49,067	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	83	403	44,471	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	18	639	70,425	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	102	615	67,724	公益事業
MOSAIC CO/THE	128	424	46,693	素材
DELTA AIR LINES INC	57.5	263	29,060	資本財・サービス
CORNING INC	271	1,123	123,715	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,462.5	7,922	872,331	情報技術
MORGAN STANLEY	491.02	4,454	490,488	金融
ZILLOW GROUP INC - A	21	244	26,961	コミュニケーション・サービス
MSCI INC	29.3	1,437	158,330	金融
FAIR ISAAC CORP	10	505	55,671	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	12	400	44,080	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	82	606	66,805	情報技術
BROADCOM INC	141.82	6,748	743,046	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	41.5	691	76,156	ヘルスケア
ARAMARK	78	293	32,327	一般消費財・サービス
DTE ENERGY COMPANY	68.2	943	103,916	公益事業
CENTENE CORP	204.87	1,409	155,155	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	37	424	46,754	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	150	706	77,792	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	68.5	989	108,959	金融
GARTNER INC	31.5	723	79,642	情報技術
SPLUNK INC	57.1	698	76,950	情報技術
DOMINION ENERGY INC	276.41	2,163	238,218	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	139.5	1,302	143,465	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	46.5	320	35,246	資本財・サービス
DEERE & CO	104	3,489	384,241	資本財・サービス
POOL CORP	14.2	611	67,383	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	102.34	1,967	216,594	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	28.3	454	50,035	情報技術
CABLE ONE INC	2	362	39,861	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	22.8	706	77,795	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	39.5	691	76,183	金融
VAIL RESORTS INC	13.6	438	48,337	一般消費財・サービス
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	24.5	301	33,222	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	26.3	325	35,848	金融
CONSOLIDATED EDISON INC	121	940	103,588	公益事業
COGNEX CORP	62	496	54,710	情報技術
TELEFLEX INC	16	633	69,712	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	29	477	52,563	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	26.2	904	99,568	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	7.9	479	52,772	ヘルスケア
CATALENT INC	59.5	652	71,791	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	48.5	1,473	162,292	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	20	487	53,647	ヘルスケア
IDEX CORP	26.1	576	63,463	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	278	2,318	255,322	生活必需品

銘柄	2021年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ROLLINS INC	73.87	248	27,362	資本財・サービス
AMETEK INC	81.25	1,106	121,832	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	85	718	79,123	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	55.5	257	28,379	資本財・サービス
HEICO CORP	14	200	22,124	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	31	460	50,672	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	22.2	788	86,799	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	13.1	429	47,312	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	94.5	1,025	112,919	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	14	611	67,373	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	154.1	5,913	651,162	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	28	317	34,928	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	20	1,016	111,918	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	46	418	46,071	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	10	1,391	153,199	一般消費財・サービス
UGI CORP	70.5	331	36,523	公益事業
CUMMINS INC	50.5	1,254	138,146	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	271	2,687	295,951	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	51	863	95,072	情報技術
COSTAR GROUP INC	14.1	1,240	136,588	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	17.9	976	107,563	金融
AMERCO	3.4	183	20,248	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	35	875	96,396	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	15.8	2,263	249,240	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	26.2	427	47,118	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	97.66	1,256	138,298	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	13	268	29,609	情報技術
DEXCOM INC	34.2	1,399	154,053	ヘルスケア
NORDSON CORP	19.1	422	46,539	資本財・サービス
COPART INC	75.5	948	104,481	資本財・サービス
SEAGEN INC	47.5	742	81,743	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	26.6	1,611	177,425	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	17.8	1,190	131,103	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	14	629	69,272	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	33.5	333	36,746	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	74	684	75,419	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	716.81	1,350	148,700	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	95.5	1,985	218,575	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	13	591	65,088	金融
T-MOBILE US INC	218.77	3,177	349,913	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	54.5	619	68,159	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	1,419	7,882	867,947	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	69	426	46,915	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	58	724	79,733	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	103.5	351	38,656	金融
CSX CORP	261	2,539	279,598	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	34.6	899	98,990	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	49.25	833	91,723	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	29.5	306	33,733	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	149	50,419	5,551,709	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	219.4	2,215	243,900	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,467.05	9,105	1,002,659	エネルギー
AES CORP	235	604	66,604	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	13.5	342	37,761	金融
EOG RESOURCES INC	205	1,739	191,550	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	57.5	678	74,709	情報技術
ABIOMED INC	16.1	487	53,691	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	54.3	644	70,988	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	105.9	1,529	168,368	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1,373.23	2,041	224,843	一般消費財・サービス
NOVAVAX INC	26	540	59,464	ヘルスケア
DISCOVERY INC - A	52.9	163	17,952	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	59.5	743	81,900	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	56.37	156	17,230	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	8.5	135	14,884	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	103.89	299	32,991	コミュニケーション・サービス
FORTINET INC	48	1,111	122,333	情報技術
MARKEL CORP	4.8	577	63,627	金融
NEXTERA ENERGY INC	681.8	4,998	550,360	公益事業
MASIMO CORP	18	405	44,679	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	509.08	2,009	221,304	素材
INSULET CORP	23.4	664	73,161	ヘルスケア
US BANCORP	498.5	2,899	319,239	金融
UNITED RENTALS INC	25.7	778	85,738	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	21	402	44,333	情報技術
FASTENAL CO	202.5	1,067	117,573	資本財・サービス
FISERV INC	211.33	2,305	253,894	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	3,052.5	4,111	452,741	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	453	2,753	303,219	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	41.5	585	64,440	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	85.5	1,631	179,664	資本財・サービス

銘柄	2021年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	121	4, 512	496, 852	金融
ALPHABET INC-CL A	104. 5	25, 591	2, 817, 837	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	102. 37	25, 869	2, 848, 469	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	36. 5	353	38, 908	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	215	1, 346	148, 315	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	186. 68	724	79, 734	公益事業
GENUINE PARTS CO	51	650	71, 660	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	132. 84	1, 459	160, 677	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	251	992	109, 279	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	73. 8	1, 639	180, 546	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	312	736	81, 076	エネルギー
HOME DEPOT INC	374	11, 568	1, 273, 815	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	20. 5	329	36, 303	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	359	515	56, 803	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	14. 1	309	34, 125	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	51. 9	906	99, 818	生活必需品
HUMANA INC	45. 3	1, 880	207, 061	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	96	1, 954	215, 184	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	25. 8	708	78, 066	情報技術
HENRY SCHEIN INC	51	394	43, 481	ヘルスケア
HP INC	473	1, 390	153, 069	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	457	718	79, 103	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	59. 78	272	30, 055	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	70	317	34, 915	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	29. 5	135	14, 896	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	144	563	62, 059	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	236. 03	1, 010	111, 286	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	43. 4	640	70, 558	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	310. 5	4, 658	512, 939	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	132	822	90, 550	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	49	479	52, 847	資本財・サービス
ZOETIS INC	162. 5	2, 999	330, 266	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	82. 29	1, 502	165, 462	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	84. 5	750	82, 640	エネルギー
ALLEGION PLC	31	428	47, 210	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	129. 73	361	39, 753	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	92. 37	1, 123	123, 738	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	113	322	35, 473	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	38. 7	526	57, 995	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	912	15, 081	1, 660, 650	ヘルスケア
PLUG POWER INC	176	538	59, 242	資本財・サービス
ABBVIE INC	613. 72	7, 082	779, 835	ヘルスケア
HOLOGIC INC	91. 5	580	63, 865	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	116. 5	1, 508	166, 145	生活必需品
KROGER CO	264	1, 013	111, 625	生活必需品
KLA CORP	53. 1	1, 726	190, 145	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	88. 3	3, 435	378, 320	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	27. 8	750	82, 663	情報技術
L BRANDS INC	85	558	61, 528	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	249	4, 722	519, 998	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	291. 85	6, 598	726, 585	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	49. 2	3, 199	352, 261	情報技術
LOEWS CORP	83	463	51, 014	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	66. 49	440	48, 510	金融
MCDONALD'S CORP	259. 5	6, 149	677, 135	一般消費財・サービス
3M CO	201. 7	4, 061	447, 204	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	836	28, 153	3, 100, 033	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	84	3, 329	366, 612	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	22. 1	767	84, 515	素材
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	18. 2	442	48, 671	情報技術
PHILLIPS 66	154	1, 408	155, 054	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	160. 5	677	74, 613	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	87. 5	780	85, 940	生活必需品
METLIFE INC	261. 5	1, 655	182, 293	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	283	1, 522	167, 646	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	20. 2	737	81, 161	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	48	301	33, 196	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	59. 58	1, 259	138, 685	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	8	1, 081	119, 080	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	254. 73	630	69, 391	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	40. 1	1, 129	124, 382	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	878. 21	6, 626	729, 599	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	207. 51	1, 692	186, 332	素材
MASCO CORP	91	535	58, 967	資本財・サービス
M & T BANK CORP	44. 39	677	74, 568	金融
MARSH & MCLENNAN COS	178	2, 485	273, 668	金融
BLACK KNIGHT INC	56	415	45, 728	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	25	327	36, 083	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	97. 22	1, 398	154, 043	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	63. 5	1, 474	162, 409	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	25. 8	818	90, 179	一般消費財・サービス

銘柄	2021年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
SQUARE INC - A	137	3, 164	348, 389	情報技術
TRANSUNION	65	694	76, 424	資本財・サービス
VISTRA CORP	156. 5	287	31, 690	公益事業
NOVOCURE LTD	32. 5	714	78, 700	ヘルスケア
NETAPP INC	79	655	72, 190	情報技術
NIKE INC -CL B	441	5, 792	637, 864	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	86. 5	2, 348	258, 609	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	95	1, 479	162, 931	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	44	567	62, 503	金融
ALLY FINANCIAL INC	132	705	77, 628	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	55. 3	2, 058	226, 653	資本財・サービス
APTIV PLC	95	1, 495	164, 720	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	274. 61	1, 917	211, 147	素材
MCKESSON CORP	54. 5	1, 051	115, 765	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	94. 5	984	108, 351	情報技術
XYLEM INC	63. 7	747	82, 253	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	542	5, 447	599, 780	生活必需品
NUCOR CORP	106. 5	1, 093	120, 445	素材
SUNRUN INC	61	281	30, 997	資本財・サービス
WESTERN UNION CO	140. 46	347	38, 278	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	60	512	56, 420	情報技術
NEWELL BRANDS INC	134. 42	367	40, 465	一般消費財・サービス
EVERGY INC	77. 5	495	54, 546	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	329. 24	931	102, 522	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	9	172	18, 969	金融
OKTA INC	42. 8	974	107, 350	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	25. 5	609	67, 137	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	56	907	99, 891	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	150. 05	502	55, 315	ヘルスケア
LINDE PLC	178. 46	5, 191	571, 644	素材
WIX. COM LTD	20. 3	578	63, 688	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	133	414	45, 632	金融
KKR & CO INC	183	1, 011	111, 410	金融
PAYCHEX INC	114. 5	1, 196	131, 736	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	24. 8	1, 320	145, 389	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	647	3, 110	342, 527	生活必需品
P G & E CORP	523	556	61, 330	公益事業
PFIZER INC	1, 936. 13	7, 672	844, 861	ヘルスケア
CIGNA CORP	123. 6	2, 961	326, 072	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	93. 51	960	105, 785	情報技術
ALTICE USA INC- A	109	379	41, 814	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	190	1, 312	144, 521	公益事業
STERIS PLC	30. 3	601	66, 182	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	6	166	18, 304	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	54. 33	195	21, 512	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	115. 49	435	47, 916	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	115. 7	2, 958	325, 742	ヘルスケア
LYFT INC-A	92	537	59, 170	資本財・サービス
DOW INC	260. 68	1, 745	192, 198	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	35. 5	299	32, 998	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	72	2, 634	290, 090	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	45. 4	1, 347	148, 425	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	423. 5	2, 150	236, 748	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	72. 5	1, 175	129, 427	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	854. 67	11, 530	1, 269, 607	生活必需品
EXELON CORP	343. 72	1, 619	178, 297	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	78	1, 416	156, 011	ヘルスケア
TELADOC HEALTH INC	47. 5	748	82, 365	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	131. 58	625	68, 862	資本財・サービス
NVR INC	1. 2	560	61, 728	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	462. 52	2, 789	307, 147	エネルギー
TWILIO INC - A	56. 5	1, 938	213, 431	情報技術
DOCUSIGN INC	66	1, 697	186, 957	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	18. 1	617	67, 964	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	47. 5	423	46, 616	情報技術
PEPSICO INC	479	7, 116	783, 598	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	15	209	23, 073	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	105	309	34, 129	情報技術
MONGODB INC	19. 2	665	73, 289	情報技術
SNAP INC - A	330	2, 097	230, 989	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	262. 18	1, 152	126, 906	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	140	1, 461	160, 967	金融
AMCOR PLC	540	656	72, 243	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	63. 3	1, 478	162, 769	情報技術
ROKU INC	38. 5	1, 404	154, 672	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	64	1, 027	113, 090	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	220	6, 285	692, 109	情報技術
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	167	749	82, 545	情報技術
10X GENOMICS INC-CLASS A	26	497	54, 729	ヘルスケア
PENTAIR PLC	59. 25	396	43, 645	資本財・サービス
QUALCOMM INC	394. 5	5, 416	596, 452	情報技術

銘柄	2021年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
INVESCO LTD	130	374	41,182	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	23.5	466	51,386	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	96.5	619	68,258	金融
DATADOG INC - CLASS A	62	602	66,390	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	188	1,290	142,151	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	30.5	427	47,060	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	37	1,956	215,416	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	79	866	95,372	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	14	3,227	355,331	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	125.5	1,496	164,747	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	32.5	451	49,692	素材
RESMED INC	51.5	1,193	131,389	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	47.3	605	66,685	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	39	353	38,940	資本財・サービス
MODERNA INC	111.5	2,312	254,642	ヘルスケア
HUBSPOT INC	15	805	88,736	情報技術
PERKINELMER INC	39.3	578	63,676	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	290.87	1,344	147,999	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	145.68	1,177	129,609	資本財・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	58	333	36,728	金融
AVANTOR INC	184	613	67,547	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	57	248	27,320	金融
DYNATRACE INC	61	342	37,721	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	15	902	99,356	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	338.35	716	78,907	金融
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	59	263	28,987	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	26.8	411	45,323	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	90.2	1,297	142,880	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	668.18	7,214	794,370	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A	88.5	991	109,228	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	28.5	602	66,349	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	134.5	789	86,903	公益事業
ETSY INC	44.5	757	83,445	一般消費財・サービス
TESLA INC	266.7	16,473	1,813,929	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10	244	26,888	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	205.5	584	64,375	情報技術
DRAFTKINGS INC - CL A	62.5	316	34,836	一般消費財・サービス
UNITY SOFTWARE INC	21	214	23,654	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	56.72	1,151	126,744	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	53.6	1,428	157,279	情報技術
CARVANA CO	24.8	691	76,102	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	29	217	23,971	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	79.5	760	83,720	情報技術
PPD INC	44	204	22,543	ヘルスケア
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	47.85	3,304	363,866	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	433.21	677	74,556	ヘルスケア
AIRBNB INC-CLASS A	21.5	320	35,323	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	118	1,034	113,948	不動産
TWITTER INC	280.5	1,706	187,878	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	369.5	2,357	259,533	公益事業
SYSCO CORP	180	1,429	157,369	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	87.03	1,333	146,857	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	20	310	34,138	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	43	268	29,521	金融
STEEL DYNAMICS INC	72	454	50,048	素材
SCHLUMBERGER LTD	491.52	1,673	184,282	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	54	322	35,455	資本財・サービス
AT&T INC	2,477.91	7,208	793,699	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	50.5	289	31,850	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	146	559	61,603	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	75	799	88,049	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	89.7	2,455	270,389	素材
SEMPRA ENERGY	111.7	1,600	176,187	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	65	412	45,397	情報技術
CLARIVATE PLC	125	329	36,226	資本財・サービス
OAK STREET HEALTH INC	36	205	22,673	ヘルスケア
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	190	475	52,302	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	79.5	752	82,862	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	319	6,069	668,289	情報技術
SALESFORCE.COM INC	318.21	7,836	862,848	情報技術
WESTROCK CO	93.3	515	56,780	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	253.34	1,676	184,555	資本財・サービス
TERADYNE INC	57	749	82,520	情報技術
UNION PACIFIC CORP	228.3	5,082	559,624	資本財・サービス
MARATHON PETROLEUM CORP	229.38	1,444	159,094	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	528.79	4,691	516,572	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	250	5,027	553,550	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	67.44	1,648	181,538	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	43.5	276	30,400	金融
AMEREN CORPORATION	89	763	84,121	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	329.16	13,138	1,446,707	ヘルスケア

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
VERISIGN INC	35	770	84,850	情報技術
VALERO ENERGY CORP	143.92	1,179	129,866	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	18.9	636	70,088	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	98.88	464	51,095	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	26.5	414	45,627	ヘルスケア
ANTHEM INC	85	3,259	358,940	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	628.62	11,200	1,233,314	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,448.22	6,538	719,977	金融
WASTE MANAGEMENT INC	148.5	2,082	229,327	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	427.5	1,176	129,542	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	40.5	741	81,674	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	22.2	490	54,046	一般消費財・サービス
WALMART INC	544.5	7,653	842,726	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	73.5	1,157	127,506	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	37	462	50,905	一般消費財・サービス
WABTEC CORP	62.11	500	55,142	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	418	2,722	299,767	一般消費財・サービス
WATERS CORP	22.3	749	82,547	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	18.9	963	106,118	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	259	1,409	155,226	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	45.43	1,163	128,118	金融
WESTERN DIGITAL CORP	108	806	88,844	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	111.3	1,031	113,593	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	178.5	1,103	121,544	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	589	13,787	1,518,120	情報技術
PPL CORP	270	790	86,989	公益事業
PULTEGROUP INC	94.5	505	55,700	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	83.5	1,464	161,247	素材
NORTHERN TRUST CORP	70	815	89,771	金融
NVIDIA CORP	214.7	15,474	1,703,897	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	145.13	2,715	299,006	金融
TYSON FOODS INC-CL A	104.5	808	89,002	生活必需品
NETFLIX INC	153.7	7,683	846,009	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	136.7	6,425	707,551	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	86.5	320	35,316	公益事業
GLOBE LIFE INC	34.25	352	38,832	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	61.5	1,145	126,076	金融
TEXTRON INC	80	537	59,151	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	131.37	345	38,057	コミュニケーション・サービス
OMNICOM GROUP	76	627	69,097	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	663.33	5,480	603,450	情報技術
MASTERCARD INC - A	307.5	11,270	1,240,993	情報技術
ONEOK INC	157	870	95,840	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	329.52	489	53,880	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	36.2	1,680	185,061	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	103.5	1,221	134,545	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	40.5	756	83,280	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	65	388	42,771	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	2,693.01	11,138	1,226,437	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	16.4	696	76,712	資本財・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	64	527	58,123	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	238	3,898	429,283	金融
ANALOG DEVICES INC	126.49	2,130	234,600	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	424.5	3,461	381,178	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	304.22	1,554	171,173	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	56.8	987	108,717	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	81	712	78,441	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	29.3	625	68,899	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	183	1,295	142,642	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	210.5	2,049	225,708	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	78.2	1,955	215,316	金融
AMGEN INC	197.5	4,763	524,509	ヘルスケア
EATON CORP PLC	136.36	1,990	219,213	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	58.5	1,382	152,256	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	319	4,435	488,344	情報技術
CME GROUP INC	122.5	2,654	292,295	金融
ECOLAB INC	90.5	1,929	212,492	素材
EQUIFAX INC	43	984	108,354	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	439.5	2,995	329,800	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	247	860	94,782	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	105.5	516	56,816	生活必需品
STATE STREET CORP	124.63	1,056	116,357	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	520.9	3,751	413,022	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	175	1,448	159,491	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	70	320	35,316	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	47.5	475	52,359	素材
CARDINAL HEALTH INC	104	606	66,796	ヘルスケア
FEDEX CORP	88	2,578	283,897	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	157.04	2,492	274,436	金融
FMC CORP	44	521	57,391	素材
CERNER CORP	108.5	875	96,399	ヘルスケア

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	87.13	1,287	141,768	素材
CITRIX SYSTEMS INC	43.5	524	57,793	情報技術
INTEL CORP	1,412	8,216	904,710	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	134	450	49,620	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	126.5	818	90,134	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	110.5	2,568	282,801	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	346	233	25,716	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	50	2,260	248,925	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	54	316	34,843	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	40.3	3,517	387,294	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	40.5	489	53,946	情報技術
SNAP-ON INC	19.3	454	49,993	資本財・サービス
CARMAX INC	58	684	75,423	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP	269.28	2,760	304,005	公益事業
TARGET CORP	174	4,055	446,542	一般消費財・サービス
DOVER CORP	49.5	744	81,941	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	15.8	718	79,123	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	44.3	613	67,587	資本財・サービス
CINTAS CORP	33.3	1,176	129,528	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	173	648	71,376	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	50.5	421	46,391	生活必需品
CLOROX COMPANY	44.3	771	84,987	生活必需品
ENTERGY CORP	70.7	769	84,776	公益事業
MICROSOFT CORP	2,495	64,842	7,139,813	情報技術
INCYTE CORP	65.8	543	59,874	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	456.19	3,860	425,055	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	468.98	5,822	641,102	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	390.5	3,143	346,090	情報技術
BLACKROCK INC	53	4,646	511,673	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	195	506	55,782	公益事業
HASBRO INC	44	420	46,268	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	88	575	63,360	生活必需品
KEYCORP	340	732	80,602	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	32.5	950	104,623	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	488.11	3,113	342,844	生活必需品
COOPER COS INC/THE	17.7	666	73,385	ヘルスケア
CHUBB LTD	154.19	2,566	282,613	金融
ARROW ELECTRONICS INC	27	322	35,497	情報技術
ALLSTATE CORP	106.5	1,394	153,596	金融
EBAY INC	235.5	1,551	170,858	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	386	10,612	1,168,520	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	48	586	64,533	素材
XILINX INC	86.5	1,110	122,228	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	82	328	36,143	コミュニケーション・サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	80.7	2,446	269,437	生活必需品
TRIMBLE INC	85.5	673	74,176	情報技術
LENNAR CORP-A	97	892	98,304	一般消費財・サービス
LEAR CORP	21.5	402	44,359	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	205.5	1,913	210,708	金融
PACCAR INC	122.37	1,114	122,709	資本財・サービス
BIOGEN INC	53.7	2,180	240,146	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	30.3	1,794	197,631	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	410	4,610	507,656	一般消費財・サービス
PTC INC	38.2	525	57,902	情報技術
EVERSOURCE ENERGY	121.1	999	110,074	公益事業
INTUIT INC	95.5	4,555	501,558	情報技術
BORGWARNER INC	82	426	46,923	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	82.5	940	103,585	一般消費財・サービス
BALL CORP	115.34	935	103,023	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	488.97	2,080	229,037	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	99.7	1,481	163,077	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	47	807	88,873	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	91.5	1,782	196,262	ヘルスケア
VF CORP	118	960	105,710	一般消費財・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B	200.25	853	93,997	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	20.5	385	42,490	一般消費財・サービス
CARNIVAL CORP	289	830	91,487	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,586.9	9,089	1,000,873	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	79	495	54,601	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	403	198	21,876	不動産
アメリカ・ドル通貨計 株数、金額	110,146.88	1,309,497	144,188,719	
アメリカ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	600銘柄		<65.6%>	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)				
IMPERIAL OIL LTD	91	373	33,824	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	7	1,266	114,853	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	96.87	800	72,557	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	154	893	81,065	素材
INTACT FINANCIAL CORP	48.5	813	73,740	金融
BCE INC	49.3	299	27,167	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	67	1,238	112,264	素材

銘柄	2021年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
SUNCOR ENERGY INC	522.3	1,599	145,070	エネルギー
METRO INC/CN	86	502	45,582	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	116	1,058	95,942	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	421	3,403	308,617	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	155.5	2,245	203,586	金融
TORONTO-DOMINION BANK	628	5,459	495,040	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	98	355	32,240	金融
ROYAL BANK OF CANADA	492.5	6,225	564,545	金融
TC ENERGY CORP	327.5	2,101	190,540	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	188.29	761	69,081	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	608	1,709	154,980	素材
CAE INC	95	365	33,140	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	59.12	706	64,080	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	59	248	22,518	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	28	239	21,754	素材
BALLARD POWER SYSTEMS INC	78	168	15,320	資本財・サービス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	50.5	347	31,501	素材
HYDRO ONE LTD	113	348	31,570	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	59.6	452	41,069	生活必需品
NORTHLAND POWER INC	79	330	29,980	公益事業
WSP GLOBAL INC	39	549	49,790	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	28	301	27,297	資本財・サービス
PARKLAND CORP	51	203	18,475	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	60	194	17,617	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	83	476	43,216	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	48	172	15,643	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	122	763	69,209	コミュニケーション・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	225	197	17,893	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	82	706	64,059	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	201	395	35,833	公益事業
B2GOLD CORP	347	206	18,722	素材
AIR CANADA	55	155	14,134	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	432	406	36,901	素材
BANK OF MONTREAL	225	2,846	258,097	金融
POWER CORP OF CANADA	191	754	68,413	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	39	6,184	560,831	情報技術
NUTRIEN LTD	195.19	1,510	137,014	素材
CANOPY GROWTH CORP	74	225	20,439	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	88	459	41,654	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	42	218	19,804	公益事業
CAMECO CORP	140	327	29,719	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	14	291	26,465	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	65	261	23,694	資本財・サービス
LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	35	322	29,281	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	19	163	14,787	情報技術
TELUS CORP	108	298	27,069	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	161	450	40,863	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	20	405	36,767	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	405	1,843	167,210	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	9	500	45,356	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	96	1,125	102,051	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	25.37	302	27,397	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	70	267	24,235	素材
BLACKBERRY LTD	178	303	27,552	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	200.5	1,273	115,487	金融
ENBRIDGE INC	702	3,469	314,658	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	445.25	2,680	243,099	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	663	1,630	147,837	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	105	401	36,428	ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	234	2,290	207,735	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	37	252	22,902	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	70	301	27,307	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	246.5	3,322	301,246	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	79	872	79,159	情報技術
ONEX CORPORATION	26	222	20,195	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	160	578	52,420	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	31	138	12,562	金融
TMX GROUP LTD	19	249	22,628	金融
OPEN TEXT CORP	94	569	51,654	情報技術
SAPUTO INC	87	319	28,953	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	204	572	51,888	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	295	1,336	121,153	生活必需品
YAMANA GOLD INC	323	198	18,013	素材
FORTIS INC	158	895	81,193	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	38	274	24,916	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	221	281	25,551	素材
CENOVUS ENERGY INC	439	534	48,446	エネルギー
DOLLARAMA INC	102	565	51,259	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	29	132	11,996	公益事業
ALTAGAS LTD	91	229	20,819	公益事業
KEYERA CORP	74	257	23,345	エネルギー

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千カナダ・ドル	千円	
INTER PIPELINE LTD		143	288	26, 128	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額	14, 066. 79	82, 246	7, 458, 134	
	銘柄数<比率>	89 銘柄		<3. 4%>	
		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
(オーストラリア)					
MEDIBANK PRIVATE LTD		888	272	23, 147	金融
BHP GROUP LTD		1, 000	4, 895	415, 634	素材
SOUTH32 LTD		1, 601	472	40, 102	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		320. 5	757	64, 278	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD		565	1, 311	111, 395	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		1, 113. 5	2, 946	250, 172	金融
WESTPAC BANKING CORP		1, 245. 48	3, 274	278, 026	金融
SANTOS LTD		629	482	40, 964	エネルギー
AUSNET SERVICES		650	117	10, 017	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP		962. 5	2, 719	230, 875	金融
RIO TINTO LTD		127	1, 586	134, 729	素材
ORIGIN ENERGY LTD		590	285	24, 246	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD		600	233	19, 817	資本財・サービス
XERO LTD		45. 5	610	51, 800	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		34	106	9, 056	エネルギー
COLES GROUP LTD		450. 45	750	63, 758	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD		54	165	14, 076	情報技術
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		370	425	36, 129	素材
EVOLUTION MINING LTD		595	302	25, 664	素材
AFTERPAY LTD		73	755	64, 166	情報技術
REECE LTD		105	238	20, 238	資本財・サービス
OIL SEARCH LTD		642	263	22, 350	エネルギー
SEEK LTD		117	368	31, 253	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		235	280	23, 784	生活必需品
NEWCREST MINING LTD		270	764	64, 948	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		597. 5	6, 056	514, 237	金融
AMPOL LTD		79. 5	233	19, 805	エネルギー
ORICA LTD		131	187	15, 917	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		491. 5	556	47, 242	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD		431	1, 849	157, 034	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD		727. 63	364	30, 953	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD		134	163	13, 903	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD		305	143	12, 197	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD		1, 435	513	43, 620	コミュニケーション・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		149. 5	665	56, 539	素材
MACQUARIE GROUP LTD		116. 34	1, 763	149, 717	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD		193. 5	787	66, 870	一般消費財・サービス
CSL LTD		153. 5	4, 553	386, 631	ヘルスケア
WESFARMERS LTD		386	2, 123	180, 263	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD		22	517	43, 958	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD		163	371	31, 583	素材
SUNCORP GROUP LTD		436. 57	489	41, 591	金融
ASX LTD		67	495	42, 109	金融
COMPUTERSHARE LTD		182	292	24, 818	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		803. 36	419	35, 607	金融
SONIC HEALTHCARE LTD		151. 5	539	45, 795	ヘルスケア
AGL ENERGY LTD		215	200	17, 014	公益事業
BRAMBLES LTD		504	567	48, 143	資本財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD		61. 5	391	33, 222	ヘルスケア
REA GROUP LTD		18	300	25, 478	コミュニケーション・サービス
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD		44	220	18, 725	金融
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		22	253	21, 538	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	21, 303. 83	49, 407	4, 195, 158	
	銘柄数<比率>	52 銘柄		<1. 9%>	
		百株	千香港・ドル	千円	
(香港)					
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		525	2, 554	36, 243	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		830	5, 183	73, 551	一般消費財・サービス
MTR CORP		585	2, 538	36, 026	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES		495	6, 039	85, 693	不動産
SINO LAND CO		1, 260	1, 569	22, 277	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		1, 021. 69	6, 109	86, 696	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		185	1, 068	15, 160	不動産
CLP HOLDINGS LTD		620	4, 876	69, 194	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		555. 07	2, 125	30, 166	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		4, 224. 75	5, 204	73, 857	公益事業
HANG SENG BANK LTD		288	4, 584	65, 060	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT		585	2, 468	35, 030	不動産
WH GROUP LTD		3, 610	2, 588	36, 728	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		445	20, 834	295, 647	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD		780	1, 541	21, 870	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD		452. 4	705	10, 014	金融
XINYI GLASS HOLDINGS LTD		620	1, 869	26, 525	資本財・サービス
SJM HOLDINGS LTD		710	625	8, 875	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		382	907	12, 873	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD		911. 69	4, 790	67, 983	不動産

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千香港・ドル	千円	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		235	1,130	16,039	公益事業
AIA GROUP LTD		4,470	42,733	606,384	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		630	2,847	40,407	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		609	1,598	22,684	生活必需品
ESR CAYMAN LTD		750	1,826	25,914	不動産
SANDS CHINA LTD		868	2,946	41,815	一般消費財・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU		820	1,272	18,058	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		520	7,316	103,819	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		1,320	3,656	51,884	金融
WYNN MACAU LTD		540	709	10,068	一般消費財・サービス
香港・ドル通貨計	株数、金額	29,847.6	144,225	2,046,557	
	銘柄数<比率>	30銘柄		<0.9%>	
		百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)					
UNITED OVERSEAS BANK LTD		440	1,143	94,867	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD		674	1,999	165,903	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD		484.75	248	20,637	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD		563	291	24,202	資本財・サービス
UOL GROUP LTD		171	126	10,487	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		161	122	10,127	不動産
CAPITALAND LTD		1,024	385	31,953	不動産
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		1,259	1,539	127,784	金融
GENTING SINGAPORE LTD		2,090	184	15,350	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD		99	188	15,610	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		3,121.5	727	60,359	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING		565	219	18,239	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD		315	337	27,997	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD		744	354	29,452	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額	11,711.25	7,868	652,974	
	銘柄数<比率>	14銘柄		<0.3%>	
		百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
(ニュージーランド)					
MERIDIAN ENERGY LTD		475	253	19,947	公益事業
MERCURY NZ LTD		230	147	11,630	公益事業
A2 MILK CO LTD		262	164	12,959	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD		687.89	330	25,965	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		457	339	26,702	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		222	646	50,855	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD		165	215	16,933	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額	2,498.89	2,098	164,993	
	銘柄数<比率>	7銘柄		<0.1%>	
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)					
BP PLC		7,095	2,344	364,263	エネルギー
UNILEVER PLC		913.6	3,923	609,736	生活必需品
BARCLAYS PLC		6,063	1,087	169,018	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		2,795	300	46,628	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC		910	1,351	209,986	金融
NATWEST GROUP PLC		1,667.91	342	53,157	金融
EVRAZ PLC		174	110	17,131	素材
JOHNSON MATTHEY PLC		64.64	198	30,916	素材
BAE SYSTEMS PLC		1,125	600	93,315	資本財・サービス
AVIVA PLC		1,375.66	573	89,118	金融
AVEVA GROUP PLC		38	134	20,879	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC		1,755	2,469	383,811	ヘルスケア
INFORMA PLC		527	279	43,401	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC		1,656	275	42,857	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC		319	200	31,228	コミュニケーション・サービス
DCC PLC		34	206	32,122	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC		163	308	47,959	一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		26	343	53,309	資本財・サービス
HALMA PLC		129	360	55,946	情報技術
ENTAIN PLC		200	362	56,297	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC		172	156	24,380	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC		210	151	23,547	金融
M&G PLC		917	223	34,796	金融
RELX PLC		674.46	1,287	200,123	資本財・サービス
DIAGEO PLC		815	2,799	434,954	生活必需品
RIO TINTO PLC		391	2,381	370,134	素材
STANDARD CHARTERED PLC		918	451	70,082	金融
TESCO PLC		2,696.84	624	97,117	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC		306.5	474	73,798	ヘルスケア
GLENCORE PLC		3,482.25	1,140	177,293	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC		124.5	203	31,659	金融
SMITHS GROUP PLC		131.83	211	32,817	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		465.83	137	21,353	金融
PEARSON PLC		257.63	219	34,068	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC		595.25	151	23,475	生活必需品
NEXT PLC		46.5	375	58,296	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC		1,277	213	33,197	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC		68.61	223	34,702	一般消費財・サービス

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
BUNZL PLC		119.05	272	42,270	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC		9,351.83	1,215	188,913	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		47.11	335	52,092	素材
KINGFISHER PLC		737.11	253	39,435	一般消費財・サービス
WPP PLC		429	429	66,795	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC		228.27	234	36,428	公益事業
SEVERN TRENT PLC		85.83	216	33,596	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC		640	313	48,740	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		249	1,634	254,052	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC		179.5	259	40,388	金融
SCHRODERS PLC		41.5	148	23,028	金融
SSE PLC		363	573	89,094	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		340	248	38,631	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC		457	3,815	592,818	ヘルスケア
FERGUSON PLC		78.37	754	117,175	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		2,080	575	89,497	金融
3I GROUP PLC		331.91	412	64,030	金融
ASHTEAD GROUP PLC		156.5	795	123,684	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE		372.14	248	38,651	情報技術
NATIONAL GRID PLC		1,236.34	1,137	176,745	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC		24,684.65	1,180	183,502	金融
IMPERIAL BRANDS PLC		330	530	82,430	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE		41.5	189	29,476	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		783.6	2,190	340,390	生活必需品
BHP GROUP PLC		736.27	1,584	246,208	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		121.5	278	43,272	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC		7,086.5	3,114	483,909	金融
ANGLO AMERICAN PLC		453.83	1,412	219,495	素材
MONDI PLC		166	324	50,428	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS		805	142	22,103	生活必需品
COMPASS GROUP PLC		621.39	1,000	155,458	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC		112	347	54,038	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC		3,111	596	92,743	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI		71.5	188	29,286	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC		142.89	317	49,269	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		64.36	324	50,384	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC		55	298	46,321	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		113.99	885	137,629	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		1,429	2,084	323,841	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		1,292.18	1,800	279,823	エネルギー
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		57	140	21,833	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC		66	205	31,895	金融
ANTOFAGASTA PLC		141	216	33,566	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		778.62	221	34,457	金融
EXPERIAN PLC		319.54	864	134,312	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額	101,688.79	61,516	9,559,037	
	銘柄数<比率>	83銘柄		<4.3%>	
		百株	千イスラエル・シュケル	千円	
(イスラエル)					
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		401	660	22,417	金融
AZRIELI GROUP LTD		14	337	11,455	不動産
ICL GROUP LTD		281	671	22,791	素材
ELBIT SYSTEMS LTD		9.5	402	13,644	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM		441	1,197	40,616	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL		562	1,449	49,186	金融
NICE LTD		24	1,765	59,880	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		54	549	18,648	金融
イスラエル・シュケル通貨計	株数、金額	1,786.5	7,034	238,642	
	銘柄数<比率>	8銘柄		<0.1%>	
		百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)					
UBS GROUP AG-REG		1,246.5	1,821	223,038	金融
ROCHE HOLDING AG-BR		11	402	49,263	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		2.8	242	29,669	素材
ADECCO GROUP AG-REG		51.5	331	40,592	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		241.3	8,245	1,009,462	ヘルスケア
SIKA AG-REG		48.1	1,413	173,015	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.04	371	45,494	生活必需品
ABB LTD-REG		627	1,945	238,197	資本財・サービス
SWISS RE AG		104.5	886	108,492	金融
NESTLE SA-REG		989	11,256	1,378,169	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG		7.8	1,088	133,216	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		13.8	367	45,026	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		843.7	807	98,893	金融
JULIUS BAER GROUP LTD		74	455	55,736	金融
SGS SA-REG		2	563	68,977	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		6.9	178	21,879	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG		14.5	199	24,418	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG		23	346	42,393	情報技術
ALCON INC		172.8	1,103	135,059	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR		9.7	312	38,299	一般消費財・サービス

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千スイス・フラン	千円	
ZURICH INSURANCE GROUP AG		51.92	1,928	236,146	金融
BALOISE HOLDING AG - REG		15.7	231	28,313	金融
CLARIANT AG-REG		66.5	128	15,741	素材
NOVARTIS AG-REG		762.5	6,392	782,670	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG		1.2	252	30,940	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG		177.1	2,038	249,563	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG		8.7	456	55,919	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		10.1	83	10,250	金融
GEBERIT AG-REG		13	870	106,572	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG		3.1	1,311	160,542	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG		3.4	477	58,422	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG		19.22	627	76,805	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		60	695	85,137	情報技術
LONZA GROUP AG-REG		26	1,727	211,554	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG		15.2	95	11,630	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD		177.9	1,006	123,189	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		11.1	507	62,145	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		18	573	70,255	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG		25.1	235	28,824	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.34	297	36,422	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額	5,956.02	52,277	6,400,345	
	銘柄数<比率>	40銘柄		<2.9%>	
		百株	千デンマーク・クローネ	千円	
(デンマーク)					
NOVO NORDISK A/S-B		637	32,888	590,345	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S		260	3,001	53,880	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A		1.2	2,113	37,931	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		374.5	8,400	150,780	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S		45.5	2,371	42,567	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B		39	4,438	79,665	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES		78.5	3,558	63,873	素材
COLOPLAST-B		45	4,451	79,902	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S		76.6	11,080	198,889	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS		3	898	16,128	資本財・サービス
DEMANT A/S		38.75	1,332	23,913	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		2.2	4,034	72,424	資本財・サービス
TRYG A/S		132	2,006	36,014	金融
PANDORA A/S		38	3,219	57,787	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S		37.5	2,109	37,870	素材
GENMAB A/S		24.6	6,649	119,356	ヘルスケア
ORSTED A/S		70.5	6,120	109,868	公益事業
AMBU A/S-B		63	1,479	26,563	ヘルスケア
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額	1,966.85	100,153	1,797,764	
	銘柄数<比率>	18銘柄		<0.8%>	
		百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
(ノルウェー)					
NORSK HYDRO ASA		507	2,754	36,408	素材
DNB ASA		339.5	6,416	84,826	金融
ORKLA ASA		269.5	2,370	31,338	生活必需品
TELENOR ASA		254	3,658	48,370	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA		367.23	7,056	93,289	エネルギー
SCHIBSTED ASA-CL A		28	1,125	14,884	コミュニケーション・サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		66.6	3,137	41,478	素材
MOWI ASA		166	3,809	50,364	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		73.5	1,399	18,505	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS		36.5	1,276	16,878	コミュニケーション・サービス
ADEVINTA ASA		106	1,717	22,701	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額	2,213.83	34,723	459,045	
	銘柄数<比率>	11銘柄		<0.2%>	
		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)					
ICA GRUPPEN AB		35.2	1,431	18,925	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS		1,083.3	11,853	156,702	情報技術
VOLVO AB-B SHS		531.5	12,001	158,656	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES		133	2,916	38,558	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B		76	1,795	23,741	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB		613	4,787	63,291	生活必需品
TELE2 AB-B SHS		168	1,956	25,863	コミュニケーション・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		592	6,443	85,188	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		548.5	5,184	68,538	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		341	5,270	69,675	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		282	5,916	78,214	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B		229	3,195	42,247	素材
SKANSKA AB-B SHS		128.5	3,140	41,517	資本財・サービス
SANDVIK AB		420	9,286	122,763	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS		676	13,236	174,980	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		250	12,855	169,943	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS		80	1,862	24,620	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS		109.5	1,457	19,267	資本財・サービス
TELIA CO AB		1,002	3,682	48,687	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB		110	3,289	43,480	資本財・サービス

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ATLAS COPCO AB-B SHS		141	6,195	81,905	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		370.5	9,688	128,082	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		39	1,330	17,591	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		36	2,089	27,622	不動産
LUNDBERGS AB-B SHS		26	1,437	19,007	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		52	1,447	19,138	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		448	4,015	53,089	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB		75.5	2,324	30,731	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B		230	6,695	88,511	生活必需品
EMBRACER GROUP AB		100	2,432	32,151	コミュニケーション・サービス
BOLIDEN AB		104	3,603	47,639	素材
EPIROC AB-A		249.5	4,492	59,387	資本財・サービス
EPIROC AB-B		135	2,154	28,483	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		141.5	1,659	21,942	一般消費財・サービス
NORDEA BANK ABP		1,196	11,292	149,288	金融
EQT AB		91	2,940	38,869	金融
EVOLUTION AB		63.5	10,096	133,475	一般消費財・サービス
SINCH AB		18	2,694	35,622	情報技術
KINNEVIK AB - B		83	2,690	35,562	金融
HEXAGON AB-B SHS		714	8,817	116,572	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		57	1,847	24,422	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額	11,779	201,510	2,663,964	
	銘柄数<比率>	41銘柄		<1.2%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（アイルランド）					
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		86	398	53,160	素材
KINGSPAN GROUP PLC		54	423	56,555	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		53	563	75,255	生活必需品
CRH PLC		267	1,141	152,323	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		58.1	927	123,822	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額	518.1	3,455	461,115	
	銘柄数<比率>	5銘柄		<0.2%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オランダ）					
QIAGEN N.V.		76.98	301	40,300	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		314.1	1,396	186,319	ヘルスケア
NN GROUP NV		99	401	53,559	金融
HEINEKEN NV		88	864	115,345	生活必需品
AEGON NV		582.44	218	29,108	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		373.83	926	123,696	生活必需品
AKZO NOBEL N.V.		65.38	695	92,877	素材
KONINKLIJKE DSM NV		58.5	888	118,585	素材
WOLTERS KLUWER		93	752	100,478	資本財・サービス
ING GROEP NV		1,341.5	1,503	200,684	金融
KONINKLIJKE KPN NV		1,211.5	324	43,264	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		144.1	8,324	1,110,925	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA		130.5	139	18,665	金融
ADYEN NV		6.9	1,332	177,862	情報技術
JUST EAT TAKEAWAY		42.5	314	41,907	一般消費財・サービス
PROSUS NV		165	1,407	187,802	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV		26	81	10,929	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV		16	434	57,949	情報技術
VOPAK		23	91	12,231	エネルギー
RANDSTAD NV		40	258	34,483	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		39.5	329	43,988	生活必需品
STMICROELECTRONICS NV		236	744	99,411	情報技術
AIRBUS SE		202	2,270	302,995	資本財・サービス
ARGENX SE		15.2	400	53,429	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		195	217	29,002	生活必需品
EXOR NV		37.8	263	35,119	金融
CNH INDUSTRIAL NV		342	488	65,219	資本財・サービス
STELLANTIS NV		693	1,175	156,921	一般消費財・サービス
FERRARI NV		42.95	722	96,435	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額	6,701.68	27,272	3,639,501	
	銘柄数<比率>	29銘柄		<1.7%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ベルギー）					
UCB SA		45.3	377	50,441	ヘルスケア
KBC GROUP NV		86.5	588	78,518	金融
COLRUYT SA		16	82	11,073	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		38	358	47,810	金融
SOLVAY SA		24.5	275	36,716	素材
UMICORE		70	346	46,240	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		261.5	1,689	225,470	生活必需品
AGEAS		62.9	310	41,432	金融
PROXIMUS		49.5	85	11,474	コミュニケーション・サービス
ELIA GROUP SA/NV		10.5	98	13,101	公益事業
SOFINA		5.5	193	25,835	金融
国小計	株数、金額	670.2	4,407	588,115	
	銘柄数<比率>	11銘柄		<0.3%>	

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ルクセンブルグ）					
AROUNDTOWN SA		325	229	30, 680	不動産
ARCELORMITTAL		243	654	87, 313	素材
INPOST SA		70	107	14, 303	資本財・サービス
EUROFINS SCIENTIFIC		44	383	51, 160	ヘルスケア
TENARIS SA		157	152	20, 415	エネルギー
国小計	株数、金額	839	1, 527	203, 874	
	銘柄数＜比率＞	5銘柄		＜0. 1%＞	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フランス）					
TOTALENERGIES SE		859. 5	3, 514	468, 952	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		57	735	98, 201	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		163. 27	2, 299	306, 911	素材
KERING		25. 8	1, 919	256, 159	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		185. 5	2, 413	322, 062	資本財・サービス
BOUYGUES SA		82	274	36, 647	資本財・サービス
BNP PARIBAS		388	2, 190	292, 290	金融
NATIXIS		295. 5	118	15, 781	金融
THALES SA		35	301	40, 215	資本財・サービス
DANONE		227	1, 350	180, 183	生活必需品
CARREFOUR SA		212	364	48, 647	生活必需品
SUEZ		112. 25	225	30, 064	公益事業
VIVENDI		278. 91	814	108, 646	コミュニケーション・サービス
L'OREAL		86. 6	3, 330	444, 415	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		172	975	130, 237	資本財・サービス
LEGRAND SA		90. 67	797	106, 479	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA		70. 87	1, 256	167, 730	生活必需品
EURAZEO SE		12. 54	92	12, 316	金融
SOCIETE GENERALE SA		279. 5	737	98, 395	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		95. 7	6, 436	858, 988	一般消費財・サービス
ACCOR SA		61. 5	213	28, 462	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		54. 7	866	115, 700	情報技術
VALEO SA		77	217	28, 997	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		75	423	56, 529	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA		97	253	33, 837	資本財・サービス
EIFFAGE		27. 4	249	33, 252	資本財・サービス
SODEXO SA		29. 5	239	31, 982	一般消費財・サービス
IPSEN		11. 5	104	13, 999	ヘルスケア
ORPEA		18	194	25, 942	ヘルスケア
AMUNDI SA		19. 5	146	19, 504	金融
TELEPERFORMANCE		20	642	85, 674	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		30	179	23, 956	コミュニケーション・サービス
FAURECIA		38. 57	175	23, 419	一般消費財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		10	384	51, 324	ヘルスケア
SEB SA		9. 97	153	20, 449	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA		98. 5	1, 462	195, 200	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA		1	102	13, 665	資本財・サービス
WORLDLINE SA		80. 64	636	84, 982	情報技術
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		35	172	23, 026	一般消費財・サービス
AXA SA		667	1, 499	200, 052	金融
EDENRED		83	416	55, 581	情報技術
RENAULT SA		64	235	31, 460	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL		10. 9	1, 303	173, 970	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU		7. 5	124	16, 604	生活必需品
ATOS SE		32	174	23, 239	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SE		45	875	116, 772	情報技術
WENDEL		9. 3	108	14, 483	金融
ORANGE		676	706	94, 271	コミュニケーション・サービス
ALSTOM		97	440	58, 846	資本財・サービス
CNP ASSURANCES		58. 5	85	11, 370	金融
SANOFI		389. 75	3, 464	462, 335	ヘルスケア
VINCI SA		183. 5	1, 761	235, 110	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		183	478	63, 861	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		391	487	65, 004	金融
BIOMERIEUX		13. 4	123	16, 430	ヘルスケア
ENGIE		618. 23	760	101, 544	公益事業
EDF		202. 5	242	32, 387	公益事業
SAFRAN SA		119. 2	1, 467	195, 818	資本財・サービス
ILIAD SA		4. 9	66	8, 824	コミュニケーション・サービス
ARKEMA		22. 2	240	32, 114	素材
ADP		9. 1	115	15, 374	資本財・サービス
SCOR SE		55. 5	155	20, 723	金融
GETLINK SE		142	184	24, 634	資本財・サービス
BOLLORE		286	125	16, 747	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額	8, 894. 87	52, 609	7, 020, 802	
	銘柄数＜比率＞	64銘柄		＜3. 2%＞	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ドイツ）					
BAYER AG-REG		338. 7	1, 802	240, 506	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		70	198	26, 455	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		712. 5	824	109, 992	金融

銘柄	2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	千ユーロ	千円	
COMMERZBANK AG	329.35	211	28,260	金融
VOLKSWAGEN AG	11.1	329	43,964	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	63	1,449	193,453	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	263.5	3,576	477,317	資本財・サービス
E.ON SE	761	773	103,261	公益事業
UNIPER SE	66.5	204	27,235	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	112.5	1,066	142,309	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	50.5	171	22,913	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	37.1	477	63,729	一般消費財・サービス
BASF SE	316.7	2,129	284,180	素材
ALLIANZ SE-REG	141.9	3,074	410,260	金融
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	60.5	561	74,988	生活必需品
RWE AG	218	677	90,447	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	96.5	103	13,753	資本財・サービス
BRENNTAG SE	53.5	407	54,360	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	140.5	634	84,673	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	33.2	114	15,311	コミュニケーション・サービス
SAP SE	358.92	4,304	574,391	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	47.6	1,113	148,578	金融
ZALANDO SE	57.5	548	73,250	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	49	365	48,833	素材
KION GROUP AG	24	215	28,754	資本財・サービス
COVESTRO AG	67	359	47,942	素材
RATIONAL AG	1.9	134	17,885	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	12.1	501	66,947	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	53	515	68,748	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	54.5	605	80,839	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	14	215	28,799	ヘルスケア
BECHTLE AG	9.5	148	19,802	情報技術
NEMETSCHEK SE	20	123	16,521	情報技術
SCOUT24 AG	36	241	32,188	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	89.5	436	58,190	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	25	256	34,246	資本財・サービス
HELLOFRESH SE	57	477	63,728	一般消費財・サービス
TEAMVIEWER AG	53.5	173	23,125	情報技術
SIEMENS ENERGY AG	131.25	333	44,541	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	32.9	329	44,036	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE-PREF	23.5	100	13,453	素材
MERCK KGAA	44	678	90,513	ヘルスケア
ADIDAS AG	66.4	1,945	259,629	一般消費財・サービス
PUMA SE	33.1	308	41,194	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	34	273	36,434	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,149	2,043	272,750	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	72.2	498	66,462	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	295.5	2,332	311,216	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	443	1,515	202,273	情報技術
HANNOVER RUECK SE	20	285	38,059	金融
DEUTSCHE POST AG-REG	342	1,945	259,691	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	64.1	881	117,619	金融
LANXESS AG	28	169	22,681	素材
MTU AERO ENGINES AG	17.9	372	49,686	資本財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	114	590	78,744	不動産
SYMRISE AG	44	494	65,999	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	338	76	10,221	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	19.5	155	20,727	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	182	976	130,280	不動産
LEG IMMOBILIEN SE	23	277	37,062	不動産
国小計 株数、金額	8,423.92	46,110	6,153,429	
国小計 銘柄数<比率>	60銘柄		<2.8%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ポルトガル）				
JERONIMO MARTINS	85	134	18,013	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	921	423	56,525	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	167.5	165	22,075	エネルギー
国小計 株数、金額	1,173.5	723	96,613	
国小計 銘柄数<比率>	3銘柄		<0.0%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（スペイン）				
TELEFONICA SA	1,672.27	687	91,765	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA	103.5	230	30,787	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,257	1,205	160,929	金融
IBERDROLA SA	2,074.34	2,244	299,519	公益事業
REPSOL SA	494	566	75,628	エネルギー
GRIFOLS SA	98	230	30,785	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	5,997.5	2,061	275,125	金融
AMADEUS IT GROUP SA	150.5	985	131,551	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA	94	205	27,421	公益事業
CAIXABANK SA	1,505	422	56,316	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	88.76	226	30,287	資本財・サービス
AENA SME SA	26	372	49,651	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA	180.05	939	125,424	コミュニケーション・サービス

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		377	1,198	159,937	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		77	199	26,644	資本財・サービス
ENAGAS SA		79.5	157	20,953	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		139	237	31,701	公益事業
FERROVIAL SA		162.7	412	55,019	資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA		110	213	28,478	公益事業
国小計	株数、金額	15,686.12	12,798	1,707,929	
	銘柄数<比率>	19銘柄		<0.8%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（イタリア）					
PRYSMIAN SPA		88.5	258	34,557	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		372.43	638	85,236	金融
MEDIOBANCA SPA		206.65	205	27,467	金融
UNICREDIT SPA		739.56	794	105,997	金融
TELECOM ITALIA SPA		3,439.82	154	20,656	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP		2,039.5	101	13,496	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO		5,717.37	1,400	186,930	金融
ATLANTIA SPA		172.57	271	36,236	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		177	212	28,380	金融
MONCLER SPA		66	376	50,309	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		34.5	164	21,965	ヘルスケア
ENI SPA		878	941	125,699	エネルギー
DIASORIN SPA		8.5	128	17,099	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		112	108	14,429	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA		146.5	256	34,203	情報技術
AMPLIFON SPA		43	175	23,441	ヘルスケア
ENEL SPA		2,811.34	2,277	303,965	公益事業
SNAM SPA		701	353	47,148	公益事業
TERNA SPA		490	320	42,817	公益事業
FINECOBANK SPA		207	288	38,466	金融
国小計	株数、金額	18,451.24	9,430	1,258,506	
	銘柄数<比率>	20銘柄		<0.6%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フィンランド）					
UPM-KYMMENE OYJ		180.5	586	78,285	素材
NOKIA OYJ		1,913	866	115,620	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		147	179	23,893	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		197	297	39,657	素材
ELISA OYJ		46	232	31,012	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		173	672	89,715	金融
FORTUM OYJ		149.5	362	48,440	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		92	275	36,758	生活必需品
KONE OYJ-B		118	797	106,418	資本財・サービス
NESTE OYJ		147	814	108,679	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		36	136	18,222	ヘルスケア
国小計	株数、金額	3,199	5,220	696,704	
	銘柄数<比率>	11銘柄		<0.3%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オーストリア）					
VERBUND AG		22.5	172	22,955	公益事業
OMV AG		53	268	35,887	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		94.5	318	42,511	金融
VOESTALPINE AG		42.5	154	20,553	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		44	90	12,131	金融
国小計	株数、金額	256.5	1,004	134,039	
	銘柄数<比率>	5銘柄		<0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額	64,814.13	164,560	21,960,633	
	銘柄数<比率>	232銘柄		<10.0%>	
ファンド合計	株数、金額	379,780.36	—	201,785,972	
	銘柄数<比率>	1,225銘柄		<91.8%>	

（注1）邦貨換算金額は、2021年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
（注2）<　>内は純資産総額に対する評価額の比率。
（注3）評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄		2021年6月15日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
AVALONBAY COMMUNITIES INC		4.887	1,046	115,268
SIMON PROPERTY GROUP INC		11.557	1,540	169,604
BOSTON PROPERTIES INC		5.25	651	71,698
VORNADO REALTY TRUST		5.397	270	29,754
SBA COMMUNICATIONS CORP		3.8	1,216	133,897
EQUITY RESIDENTIAL		12.7	1,027	113,144
EQUINIX INC		3.148	2,593	285,616
AMERICAN TOWER CORP		15.45	4,186	460,922
HOST HOTELS & RESORTS INC		24.943	440	48,530
INVITATION HOMES INC		20	756	83,265
VICI PROPERTIES INC		18.9	620	68,301
VENTAS INC		13.25	781	86,020
WEYERHAEUSER CO		26.464	913	100,618
AGNC INVESTMENT CORP		18.1	319	35,136
CROWN CASTLE INTL CORP		14.75	2,906	320,082
IRON MOUNTAIN INC		10.26	471	51,899
VEREIT INC		8.15	398	43,927
SUN COMMUNITIES INC		3.72	660	72,746
PROLOGIS INC		25.252	3,185	350,787
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		4.65	899	99,089
CAMDEN PROPERTY TRUST		3.45	466	51,355
DUKE REALTY CORP		13.15	650	71,673
ESSEX PROPERTY TRUST INC		2.31	728	80,223
WELLTOWER INC		14.75	1,197	131,894
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		19	670	73,850
MID-AMERICA APARTMENT COMM		4.05	694	76,519
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		6.15	470	51,817
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		47.6	442	48,743
REALTY INCOME CORP		13.15	928	102,225
PUBLIC STORAGE		5.55	1,635	180,051
REGENCY CENTERS CORP		5.7	380	41,950
UDR INC		10.55	528	58,222
WP CAREY INC		6.05	470	51,787
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		8.3	313	34,536
DIGITAL REALTY TRUST INC		9.9	1,607	176,954
EXTRA SPACE STORAGE INC		4.65	743	81,891
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		20.35	447	49,229
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額	445.288	37,264	4,103,240
	銘柄数<比率>	37銘柄		<1.9%>
		千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)				
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		2.9	165	15,007
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		4.7	102	9,282
カナダ・ドル通貨計	口数、金額	7.6	267	24,290
	銘柄数<比率>	2銘柄		<0.0%>
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)				
LENDLEASE GROUP		23.5	299	25,441
TRANSURBAN GROUP		91.5	1,310	111,255
SYDNEY AIRPORT		42.5	256	21,796
APA GROUP		38.1	360	30,571
SCENTRE GROUP		170.922	495	42,087
DEXUS		36.15	387	32,935
GPT GROUP		63.16	310	26,331
MIRVAC GROUP		136.1	404	34,322
STOCKLAND		78	373	31,724
GOODMAN GROUP		55.3	1,140	96,821
VICINITY CENTRES		123.273	206	17,532
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額	858.505	5,544	470,820
	銘柄数<比率>	11銘柄		<0.2%>
		千口	千香港・ドル	千円
(香港)				
LINK REIT		79.5	6,109	86,694
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		92	724	10,287
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		138	1,454	20,639
香港・ドル通貨計	口数、金額	309.5	8,289	117,621
	銘柄数<比率>	3銘柄		<0.1%>
		千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)				
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		124.5	369	30,686
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		175.032	376	31,230
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		104.8	211	17,568
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		77.5	166	13,828
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	481.832	1,124	93,314
	銘柄数<比率>	4銘柄		<0.0%>

銘柄		2021年6月15日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千イギリス・ポンド	千円
（イギリス）				
LAND SECURITIES GROUP PLC		23.562	169	26,310
SEGRO PLC		40.6	444	69,144
BRITISH LAND CO PLC		29.55	152	23,638
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	93.712	766	119,093
	銘柄数＜比率＞	3銘柄		＜0.1%＞
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（フランス）				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		4.6	368	49,183
GECINA SA		1.6	217	28,974
KLEPIERRE		7.15	178	23,816
COVIVIO		1.75	142	18,958
ユーロ通貨計	口数、金額	15.1	906	120,932
	銘柄数＜比率＞	4銘柄		＜0.1%＞
ファンド合計	口数、金額	2,211.537	—	5,049,312
	銘柄数＜比率＞	64銘柄		＜2.3%＞

（注1）邦貨換算金額は、2021年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
（注2）＜　＞内は純資産総額に対する評価額の比率。
（注3）評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別		2021年6月15日現在	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
外国	S&P500 EMINI FUT（アメリカ）	9,065	—
	S&P/TSX 60 IX FUT（カナダ）	546	—
	SPI 200 FUTURES（オーストラリア）	452	—
	FTSE 100 IDX FUT（イギリス）	622	—
	SWISS MKT IX FUTR（スイス）	508	—
	EURO STOXX 50（ドイツ）	1,683	—

（注1）外貨建の評価額は、2021年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
（注2）単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書　第21期　（決算日　2020年11月30日）

（作成対象期間　2019年12月３日～2020年11月30日）

外国株式インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

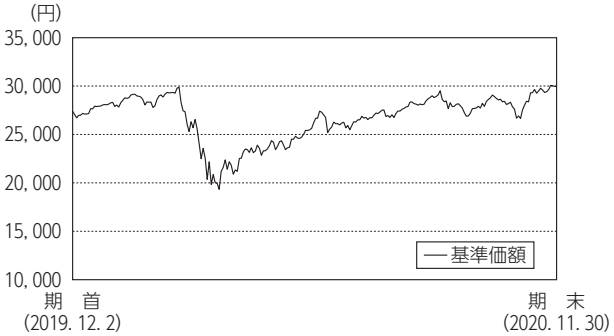
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



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

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：27,400円　期末：30,015円　騰落率：9.5%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は上昇しました。

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

○為替相場

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

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

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

《今後の運用方針》

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

■１万口当りの費用の明細

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

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

■売買および取引の状況

(1)株　　式

（2019年12月３日から2020年11月30日まで）

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
外国	アメリカ	百株 13,951.06 (5,785.26)	千アメリカ・ドル 120,851 (△ 1,850)	百株 3,579.94	千アメリカ・ドル 7,291
	カナダ	百株 2,300 (△ 531.9)	千カナダ・ドル 8,965 (△ 334)	百株 1,004.89	千カナダ・ドル 766
	オーストラリア	百株 3,173.5 (168.63)	千オーストラリア・ドル 5,992 (29)	百株 2,203.5	千オーストラリア・ドル 784
	香港	百株 4,988 (△1,164.65)	千香港・ドル 19,598 (—)	百株 1,808.76	千香港・ドル 5,917
	シンガポール	百株 2,172 (777.41)	千シンガポール・ドル 1,314 (78)	百株 2,279.36	千シンガポール・ドル 434
	ニュージーランド	百株 416 (—)	千ニュージーランド・ドル 336 (—)	百株 271	千ニュージーランド・ドル 95
	イギリス	百株 11,087 (2,157.85)	千イギリス・ポンド 6,541 (△ 2)	百株 5,181.43	千イギリス・ポンド 898
	イスラエル	百株 181 (17.64)	千イスラエル・シュケル 825 (—)	百株 17.64	千イスラエル・シュケル 17
	スイス	百株 749.8 (0.12)	千スイス・フラン 5,444 (△ 120)	百株 114.3	千スイス・フラン 248
	デンマーク	百株 332.9 (—)	千デンマーク・クローネ 13,986 (—)	百株 67.2	千デンマーク・クローネ 1,876
	ノルウェー	百株 327.5 (—)	千ノルウェー・クローネ 5,160 (—)	百株 58	千ノルウェー・クローネ 821
	スウェーデン	百株 2,038.7 (149.5)	千スウェーデン・クローネ 32,967 (—)	百株 492.5	千スウェーデン・クローネ 3,861
	ユーロ（アイルランド）	百株 52.3 (17.1)	千ユーロ 307 (148)	百株 504.6	千ユーロ 67
	ユーロ（オランダ）	百株 931.7 (△ 156.16)	千ユーロ 3,213 (△ 132)	百株 19	千ユーロ 73
	ユーロ（ベルギー）	百株 99.7 (—)	千ユーロ 704 (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ（ルクセンブルグ）	百株 130.2 (39.6)	千ユーロ 172 (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ（フランス）	百株 1,114.6 (63)	千ユーロ 5,332 (△ 1)	百株 147.7	千ユーロ 407
	ユーロ（ドイツ）	百株 1,178 (143.75)	千ユーロ 5,396 (△ 89)	百株 63.2	千ユーロ 114
	ユーロ（ポルトガル）	百株 164 (827)	千ユーロ 99 (—)	百株 827	千ユーロ 7
	ユーロ（スペイン）	百株 1,954.7 (11,894.41)	千ユーロ 1,400 (244)	百株 13,870.5	千ユーロ 382
	ユーロ（イタリア）	百株 2,307.5 (—)	千ユーロ 1,399 (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ（フィンランド）	百株 419 (—)	千ユーロ 479 (—)	百株 71	千ユーロ 180
	ユーロ（オーストリア）	百株 31.5 (—)	千ユーロ 65 (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ（ユーロ通貨計）	百株 8,383.2 (12,828.7)	千ユーロ 18,571 (168)	百株 15,503	千ユーロ 1,234

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

(2)新株予約権証券

（2019年12月３日から2020年11月30日まで）

		買付 証券数	買付 金額	売付 証券数	売付 金額
外国	アメリカ	証券 3,515	千アメリカ・ドル 54	証券 3,515 (—)	千アメリカ・ドル 16 (—)
	スイス	証券 34,320	千スイス・フラン 7	証券 — (—)	千スイス・フラン — (—)

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

(3)投資信託証券

（2019年12月３日から2020年11月30日まで）

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

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

(4)先物取引の種類別取引状況

（2019年12月３日から2020年11月30日まで）

種類別		買建 新規買付額	買建 決済額	売建 新規売付額	売建 決済額
外国	株式先物取引	百万円 51,901	百万円 52,708	百万円 —	百万円 —

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
株　　式

（2019年12月３日から2020年11月30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
MICROSOFT CORP（アメリカ）	30.95	593,011	19,160	BANK OF AMERICA CORP（アメリカ）	15.2	40,017	2,632
AMAZON.COM INC（アメリカ）	2.15	531,816	247,356	INGENICO GROUP（フランス）	1.97	32,329	16,410
APPLE INC（アメリカ）	18.5	428,420	23,157	POWER FINANCIAL CORP（カナダ）	8	23,323	2,915
FACEBOOK INC-CLASS A（アメリカ）	11.1	245,450	22,112	WHEELOCK & CO LTD（香港）	27	23,229	860
ALPHABET INC-CL A（アメリカ）	1.42	208,392	146,755	APPLE INC（アメリカ）	0.5	19,006	38,013
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B（アメリカ）	9.2	198,293	21,553	GRUBHUB INC（アメリカ）	3.1	18,947	6,111
JOHNSON & JOHNSON（アメリカ）	11.4	175,993	15,438	FLEX LTD（シンガポール）	17.25	18,027	1,045
ALPHABET INC-CL C（アメリカ）	1.14	165,289	144,990	POLARIS INC（アメリカ）	1.75	16,465	9,408
NVIDIA CORP（アメリカ）	3.8	139,808	36,791	SUN HUNG KAI PROPERTIES（香港）	10.5	15,103	1,438
SALESFORCE.COM INC（アメリカ）	6	136,527	22,754	MICROSOFT CORP（アメリカ）	0.7	14,844	21,205

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
(1)外国株式

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

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	158	184	928	96,439	生活必需品
BUNGE LTD	40	44.5	270	28,126	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	98.25	106.75	1,230	127,881	情報技術
APPLE INC	1,298	5,678	66,199	6,877,497	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	94	102	804	83,576	金融
BOEING CO/THE	149.9	175.6	3,801	394,962	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	44.65	51.65	401	41,752	金融
BECTON DICKINSON AND CO	76.49	94.19	2,156	224,046	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	67	67	123	12,870	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	38.5	43.5	444	46,222	情報技術
CDK GLOBAL INC	36	40	186	19,423	情報技術
NISOURCE INC	110.5	126	308	32,083	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	38.5	44.5	412	42,865	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	243.21	260.21	1,039	107,997	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,169.04	1,355.04	8,208	852,815	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	363.5	455.5	10,547	1,095,738	金融
ANSYS INC	24.5	27.8	918	95,427	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	215.5	444.17	2,154	223,802	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	190	222	1,343	139,603	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	668.5	740	4,665	484,719	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	910.7	997.7	12,094	1,256,458	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	69.5	77	1,121	116,497	金融
LKQ CORP	94	91.5	329	34,202	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	13.5	16.6	284	29,557	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	90.62	100.62	816	84,777	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	83	93	1,084	112,636	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	38.1	40.1	764	79,466	金融
DOLLAR GENERAL CORP	75	83.5	1,820	189,119	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	51.6	62.6	3,302	343,047	情報技術
CATERPILLAR INC	162	176.5	3,090	321,036	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	70	79.5	362	37,678	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	63	73	334	34,726	公益事業
CMS ENERGY CORP	82	93	576	59,883	公益事業
MOSAIC CO/THE	109.5	120.5	273	28,392	素材
DELTA AIR LINES INC	47.5	51.5	211	21,968	資本財・サービス
CORNING INC	232	246	912	94,790	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,210.5	1,382.5	5,903	613,291	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	37	42	214	22,309	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	356.5	459.02	2,930	304,437	金融
WABCO HOLDINGS INC	15.5	—	—	—	その他
MSCI INC	24.5	28.2	1,134	117,847	金融
FAIR ISAAC CORP	—	10	473	49,193	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	10	11	318	33,136	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	16	—	—	—	資本財・サービス
COTY INC-CL A	84.39	—	—	—	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	65	75	522	54,246	情報技術
BROADCOM INC	111.22	130.52	5,154	535,541	情報技術
ACUITY BRANDS INC	11.5	—	—	—	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	33.3	37.8	490	50,996	ヘルスケア
ARAMARK	70.5	72	260	27,062	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	60.5	72.5	209	21,775	素材
DTE ENERGY COMPANY	52.5	62.5	803	83,456	公益事業
CENTENE CORP	121.5	189.87	1,199	124,606	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	32	35	320	33,347	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	130.5	143	488	50,719	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	53.5	61.5	712	74,025	金融
GARTNER INC	27.2	29.2	445	46,277	情報技術
SPLUNK INC	45	51.8	1,056	109,798	情報技術
DOMINION ENERGY INC	226.41	276.41	2,184	226,973	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	117	128.5	1,081	112,339	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	41.5	42.5	242	25,202	資本財・サービス
DEERE & CO	87.5	96.5	2,527	262,614	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	81.84	98.84	1,947	202,320	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	25	28.3	402	41,772	情報技術
CABLE ONE INC	—	1.7	333	34,652	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	19	21.9	485	50,413	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	34.5	37	470	48,864	金融
VAIL RESORTS INC	11.2	13.6	384	39,938	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	41	46	201	20,903	金融
TARGA RESOURCES CORP	65.5	—	—	—	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	18	22.5	270	28,101	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	21.8	24.3	226	23,510	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	10.5	—	—	—	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	92	109	847	88,066	公益事業
COGNEX CORP	50.5	55	409	42,568	情報技術
TELEFLEX INC	13.3	15	556	57,822	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	26	28	378	39,354	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	22	24	667	69,305	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	6.5	7.1	379	39,467	ヘルスケア
WELLCARE HEALTH PLANS INC	15.2	—	—	—	その他
CATALENT INC	—	51.5	501	52,112	ヘルスケア

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	38	44.8	1,238	128,667	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	—	20	414	43,014	ヘルスケア
IDEX CORP	22.5	25.2	484	50,360	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	230.5	268	2,275	236,382	生活必需品
ROLLINS INC	43.25	49.25	280	29,179	資本財・サービス
AMETEK INC	65.25	74.25	889	92,388	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	73.5	82	707	73,493	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	36.5	43.5	179	18,632	資本財・サービス
HEICO CORP	12	14	177	18,480	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	25.5	31	328	34,080	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	11.5	12.4	400	41,577	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	75	88.5	777	80,780	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	11	13	553	57,549	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	124	144.4	5,608	582,651	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	24	26	319	33,145	情報技術
GRUBHUB INC	26	—	—	—	一般消費財・サービス
EPAM SYSTEMS INC	16.5	18	586	60,953	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	38	43.5	381	39,619	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6.9	8.8	1,142	118,646	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	69.5	—	—	—	金融
UGI CORP	52	70.5	261	27,216	公益事業
CUMMINS INC	43.5	48.5	1,110	115,400	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	215.5	253	1,976	205,384	コミュニケーション・サービス
SABRE CORP	76.5	—	—	—	情報技術
CDW CORP/DE	43.5	46.5	614	63,878	情報技術
SIGNATURE BANK	15	16.5	190	19,747	金融
COSTAR GROUP INC	9.9	13.1	1,158	120,360	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	14.9	17.1	604	62,851	金融
AMERCO	2.2	2.9	118	12,275	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	18.5	31.5	636	66,101	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	12.7	14.8	2,239	232,700	一般消費財・サービス
HANESBRANDS INC	110	—	—	—	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	23	25	394	40,984	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	81.66	90.16	941	97,797	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	10.2	11.7	238	24,738	情報技術
DEXCOM INC	27	30	954	99,176	ヘルスケア
NORDSON CORP	—	17.3	353	36,731	資本財・サービス
COPART INC	58.5	68.5	789	81,988	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	46.5	51.5	224	23,284	エネルギー
SEAGEN INC	32.5	39.5	668	69,401	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	22.7	25.1	1,193	123,993	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	13.3	17.1	1,011	105,088	資本財・サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	26	28	267	27,797	ヘルスケア
NIELSEN HOLDINGS PLC	99	111	180	18,727	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	575.81	673.81	993	103,253	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	79	90	1,377	143,103	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	11.5	12.2	651	67,668	金融
CABOT OIL & GAS CORP	120.5	124	220	22,891	エネルギー
T-MOBILE US INC	100	183.27	2,417	251,136	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	34.5	45.5	491	51,075	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	1,141.5	1,336	7,040	731,460	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	71	65	285	29,685	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	48.5	55.5	493	51,293	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	30.5	—	—	—	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	86.5	95	211	21,979	金融
CSX CORP	221.5	252.5	2,305	239,473	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	26.8	31.3	626	65,035	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	40.75	43.75	541	56,237	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	24	27.5	251	26,098	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	117.7	138.8	44,351	4,607,658	一般消費財・サービス
FLOWSERVE CORP	35.5	—	—	—	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	60	202.4	1,725	179,279	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,196.55	1,384.05	5,562	577,887	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	37.5	42	164	17,073	情報技術
AES CORP	201	219	460	47,870	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	12.4	13.5	315	32,741	金融
EOG RESOURCES INC	164	193	992	103,121	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	48.5	52	542	56,356	情報技術
ABIOMED INC	12.9	15.2	413	42,936	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	46.5	49.5	510	53,071	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	92.4	101.4	1,156	120,187	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1,109.23	1,263.23	1,148	119,294	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	46.9	46.9	128	13,389	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	37	48.5	573	59,551	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48.87	48.87	110	11,514	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	—	8.5	133	13,876	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	100.89	103.89	255	26,497	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	40	40	154	16,065	資本財・サービス
FORTINET INC	41.5	48	594	61,730	情報技術
MARKEL CORP	4.1	4.6	461	47,994	金融
NEXTERA ENERGY INC	135.5	640.8	4,814	500,160	公益事業

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MASIMO CORP	—	17	432	44,932	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	434.08	472.08	1,110	115,352	素材
INSULET CORP	17.5	22.2	558	58,000	ヘルスケア
US BANCORP	428	441.5	1,951	202,779	金融
UNITED RENTALS INC	23	23.5	547	56,862	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	17.5	19	312	32,480	情報技術
FASTENAL CO	163	186	903	93,873	資本財・サービス
FISERV INC	161.63	185.83	2,146	223,040	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	2,468.5	2,880.5	2,995	311,225	資本財・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	61	—	—	—	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	361	426	1,919	199,422	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	33	—	—	—	コミュニケーション・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	69	79.5	1,208	125,590	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	92.9	107.6	2,532	263,143	金融
ALPHABET INC-CL A	84	98.2	17,548	1,823,117	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	87.47	98.87	17,729	1,841,893	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	31.5	33.5	248	25,858	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	168.5	200.5	1,205	125,250	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	152.68	180.68	482	50,155	公益事業
GENUINE PARTS CO	43	48.5	477	49,560	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	106.34	125.84	1,165	121,034	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	207	230	604	62,795	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	64.1	71.6	1,392	144,656	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	30	—	—	—	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	248	276	484	50,350	エネルギー
HOME DEPOT INC	310	352	9,714	1,009,275	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	17.5	19	254	26,408	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	299	318	396	41,164	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	11.9	12.9	212	22,049	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	43.5	47.4	701	72,905	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	44.5	—	—	—	一般消費財・サービス
HUMANA INC	38.3	43.5	1,768	183,701	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	81.5	93	1,478	153,564	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	21	23.6	690	71,774	情報技術
HENRY SCHEIN INC	45	45	286	29,770	ヘルスケア
HP INC	426	473	1,053	109,434	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	394	419	470	48,840	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	48	59.78	252	26,227	コミュニケーション・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	47	—	—	—	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	60	65	276	28,760	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	25	29.5	124	12,890	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	119	132	435	45,295	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	198.53	217.53	714	74,215	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	250	291.5	3,624	376,580	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	107	122	618	64,247	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	40	43.5	369	38,417	資本財・サービス
ZOETIS INC	135.5	156	2,518	261,691	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	69.79	79.79	1,144	118,952	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	65.5	76.5	449	46,715	エネルギー
ALLEGION PLC	26.5	29	331	34,430	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	35	—	—	—	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	117.73	129.73	283	29,408	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	75.57	85.07	887	92,250	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	96.5	105	233	24,227	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC	22	24	333	34,695	ヘルスケア
JM SMUCKER CO/THE	34.2	36.7	427	44,418	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	748	862	12,412	1,289,565	ヘルスケア
ABBVIE INC	417.79	577.72	6,059	629,542	ヘルスケア
HOLOGIC INC	75.5	83.5	580	60,298	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	99.5	112.5	1,590	165,227	生活必需品
KROGER CO	229.5	255	826	85,913	生活必需品
KLA CORP	46.5	50.3	1,278	132,799	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	71.7	82.6	3,092	321,232	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	25.6	27.8	743	77,286	情報技術
LOWE'S COS INC	224.5	244.5	3,781	392,878	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	246.05	281.85	4,155	431,724	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	42.3	48.2	2,200	228,612	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	14.5	16.5	221	22,963	不動産
LOEWS CORP	79	83	360	37,431	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	57.99	62.49	307	31,915	金融
MCDONALD'S CORP	216	243	5,305	551,179	一般消費財・サービス
3M CO	162.5	188.5	3,334	346,408	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	676.5	787.5	21,877	2,272,857	コミュニケーション・サービス
MANPOWERGROUP INC	17.8	—	—	—	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	69.8	79	2,698	280,337	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	18.4	21.1	571	59,407	素材
CONCHO RESOURCES INC	58	62	384	39,948	エネルギー
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	66	—	—	—	その他
PHILLIPS 66	128.5	141.5	923	95,890	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	121	—	—	—	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	144.5	152.5	436	45,343	一般消費財・サービス

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DXC TECHNOLOGY CO	77.88	—	—	—	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	33.5	40.5	755	78,462	生活必需品
MYLAN NV	148.5	—	—	—	その他
METLIFE INC	235	255.5	1,212	125,950	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	181	217	978	101,696	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	15.1	18.7	509	52,951	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	48	48	220	22,899	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	47.78	56.58	981	101,961	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6.4	8	901	93,640	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	144.73	213.73	422	43,920	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	33.8	37.6	962	99,973	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	727.21	826.21	6,598	685,477	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	211.68	242.18	1,563	162,383	素材
MASCO CORP	86	87	471	49,024	資本財・サービス
M & T BANK CORP	35.69	42.89	518	53,906	金融
MARSH & MCLENNAN COS	144.5	168.5	1,926	200,192	金融
BLACK KNIGHT INC	44	50	452	47,025	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	23	25	284	29,535	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	78.72	91.22	1,170	121,635	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	48	56.8	1,271	132,098	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	18.5	21	547	56,872	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	101	118	2,507	260,528	情報技術
TRANSUNION	55	61.5	571	59,324	資本財・サービス
VISTRA CORP	100.5	142.5	279	29,001	公益事業
CAPRI HOLDINGS LTD	44.5	—	—	—	一般消費財・サービス
BEIGENE LTD-ADR	10.5	14.5	414	43,066	ヘルスケア
NETAPP INC	74.5	74.5	396	41,222	情報技術
NIKE INC -CL B	355.5	406	5,450	566,257	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	75	84.5	2,050	213,076	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	68	80	1,064	110,547	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	37.5	41.5	384	39,971	金融
ALLY FINANCIAL INC	114.5	125.5	384	39,988	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	44.5	52.2	1,597	165,961	資本財・サービス
APTIV PLC	72	87	1,060	110,142	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	231.61	264.61	1,547	160,763	素材
MCKESSON CORP	55.5	52.5	945	98,176	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	81	87	716	74,485	情報技術
XYLEM INC	51.5	58.7	570	59,239	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	440.5	510	3,870	402,147	生活必需品
NUCOR CORP	87	99	545	56,640	素材
SUNRUN INC	—	39	260	27,045	資本財・サービス
WESTERN UNION CO	129.46	129.46	291	30,288	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	53	57	453	47,077	情報技術
NEWELL BRANDS INC	122.92	125.42	264	27,453	一般消費財・サービス
EVERGY INC	68.5	74	412	42,875	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	257.24	302.24	500	51,997	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	7	8.2	185	19,302	金融
OKTA INC	30	38.6	911	94,655	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	—	21.8	712	74,045	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	31.5	36	568	59,081	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	107.05	133.55	418	43,454	ヘルスケア
LINDE PLC	152.96	171.96	4,426	459,896	素材
WIX. COM LTD	14.5	17.8	460	47,825	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	83	133	345	35,925	金融
KKR & CO INC	147	163	630	65,551	金融
PAYCHEX INC	93.5	107	999	103,792	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	22	24.1	1,067	110,953	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	528.5	611.5	2,468	256,465	生活必需品
P G & E CORP	—	355	451	46,949	公益事業
PFIZER INC	1,571.13	1,819.13	6,772	703,607	ヘルスケア
CIGNA CORP	106.8	121.6	2,584	268,451	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	45.51	78.51	548	56,948	情報技術
ALTICE USA INC- A	41	109	374	38,875	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	148.5	174.5	1,179	122,586	公益事業
STERIS PLC	25	28.5	546	56,756	ヘルスケア
FOX CORP - CLASS B	48.33	54.33	156	16,216	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	99.99	108.49	316	32,866	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	95	111.2	2,588	268,955	ヘルスケア
DOW INC	210.68	240.68	1,333	138,523	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	—	28	167	17,398	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	51.8	2,442	253,797	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	37.5	41.7	1,137	118,204	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	52	315	1,597	165,982	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	46.5	53.5	588	61,178	エネルギー
POLARIS INC	15.5	—	—	—	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	707.67	809.17	11,215	1,165,220	生活必需品
EXELON CORP	273.72	322.72	1,347	139,943	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	66	73.5	910	94,555	ヘルスケア
TELADOC HEALTH INC	—	23	451	46,941	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	—	113.58	508	52,863	資本財・サービス
NVR INC	1	1.1	453	47,085	一般消費財・サービス

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CONOCOPHILLIPS	319	355	1, 518	157, 776	エネルギー
TWILIO INC - A	31. 5	40. 5	1, 292	134, 241	情報技術
DOCUSIGN INC	29	57. 5	1, 304	135, 524	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	14	16. 1	670	69, 710	情報技術
MATCH GROUP INC	18	—	—	—	その他
PEPSICO INC	395. 5	454	6, 564	682, 021	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	11	13	147	15, 288	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	52	80	156	16, 240	情報技術
MONGODB INC	12. 5	16. 2	437	45, 444	情報技術
SNAP INC - A	208	295	1, 357	141, 070	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	215. 68	248. 18	953	99, 034	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	118	128	999	103, 843	金融
AMCOR PLC	479	522	599	62, 256	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	—	46. 5	701	72, 864	情報技術
ROKU INC	24	33. 5	922	95, 826	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	51. 5	60	922	95, 826	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	180. 8	208. 5	5, 215	541, 786	情報技術
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	—	126	512	53, 237	情報技術
PENTAIR PLC	47. 05	55. 05	292	30, 368	資本財・サービス
QUALCOMM INC	343. 5	364. 5	5, 242	544, 654	情報技術
INVESCO LTD	109. 5	120	204	21, 206	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	20. 5	23. 5	352	36, 604	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	83. 5	92	472	49, 127	金融
DATADOG INC - CLASS A	—	43. 5	419	43, 574	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	45	131	913	94, 886	コミュニケーション・サービス
RAYTHEON COMPANY	79. 2	—	—	—	その他
DISH NETWORK CORP-RTS	3. 49	—	—	—	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	—	25	422	43, 901	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	22	33. 2	1, 706	177, 303	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	67. 5	74	718	74, 602	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	12. 3	13. 5	2, 771	287, 890	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	107	118	1, 292	134, 285	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	26. 5	31	411	42, 759	素材
RESMED INC	41. 5	48. 5	1, 016	105, 630	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	38	43. 5	542	56, 399	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	33. 5	36	235	24, 501	資本財・サービス
MODERNA INC	—	88	1, 117	116, 134	ヘルスケア
RALPH LAUREN CORP	14. 5	14. 5	127	13, 253	一般消費財・サービス
PERKINELMER INC	31	37. 3	482	50, 089	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	—	266. 37	1, 007	104, 632	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	—	137. 18	923	95, 970	資本財・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	58	254	26, 434	金融
AVANTOR INC	—	155	408	42, 431	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	—	47	134	13, 979	金融
DYNATRACE INC	—	61	234	24, 347	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	—	13. 3	1, 161	120, 639	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	302. 35	321. 35	501	52, 147	金融
IAC/INTERACTIVECORP	—	25. 3	360	37, 449	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	—	81. 7	1, 140	118, 515	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	538. 18	610. 18	5, 571	578, 828	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A	—	65	708	73, 592	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	—	24	359	37, 335	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	103	123. 5	775	80, 562	公益事業
TESLA INC	37. 7	242. 7	14, 216	1, 476, 941	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	—	10	328	34, 157	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	184. 5	178. 5	323	33, 583	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	44. 22	50. 22	942	97, 934	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	43. 5	50. 4	1, 136	118, 031	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	44. 15	46. 85	3, 011	312, 866	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	—	386. 21	658	68, 410	ヘルスケア
CBRE GROUP INC - A	91. 5	108. 5	663	68, 906	不動産
TWITTER INC	211. 5	259. 5	1, 209	125, 604	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	293. 5	347. 5	2, 107	218, 957	公益事業
SYSCO CORP	137	160	1, 139	118, 417	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	73. 03	84. 03	1, 129	117, 364	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	39. 5	43	239	24, 842	金融
STEEL DYNAMICS INC	62	66	248	25, 815	素材
SCHLUMBERGER LTD	392. 02	460. 02	1, 006	104, 567	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	46	50. 5	255	26, 520	資本財・サービス
AT&T INC	2, 065. 91	2, 332. 91	6, 772	703, 588	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	40. 5	47	224	23, 305	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	123	129	369	38, 396	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	23. 3	26. 9	1, 979	205, 632	素材
SEMPRA ENERGY	79	96. 7	1, 261	131, 062	公益事業
TIFFANY & CO	32. 5	36. 5	480	49, 948	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	71	76. 5	447	46, 477	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	265	297. 5	4, 729	491, 394	情報技術
SALESFORCE. COM INC	234. 21	294. 21	7, 285	756, 892	情報技術
WESTROCK CO	71. 3	85. 3	375	39, 045	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	229. 84	244. 84	1, 125	116, 931	資本財・サービス
TERADYNE INC	50	55	601	62, 510	情報技術

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
UNION PACIFIC CORP	199.5	219.8	4,519	469,579	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	248	—	—	—	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	193.88	215.88	894	92,895	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	231.37	494.79	3,656	379,924	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	197	230.5	3,892	404,434	資本財・サービス
UNUM GROUP	59	—	—	—	金融
SPRINT CORP	231.65	—	—	—	その他
IQVIA HOLDINGS INC	48.94	62.44	1,054	109,505	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	43.5	43.5	258	26,812	金融
AMEREN CORPORATION	72	80.5	635	66,060	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	267.76	310.16	10,481	1,088,927	ヘルスケア
VERISIGN INC	30	33.7	675	70,203	情報技術
VALERO ENERGY CORP	117.42	131.42	744	77,304	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	16.1	17.6	495	51,432	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	81.88	86.88	317	32,998	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	25	25	330	34,312	ヘルスケア
ANTHEM INC	72.8	83	2,596	269,723	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	509.12	591.62	8,704	904,311	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,209.22	1,274.22	3,626	376,749	金融
WASTE MANAGEMENT INC	119.5	140	1,668	173,357	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	347	402	862	89,625	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	34.5	37	515	53,572	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	19	19.5	391	40,711	一般消費財・サービス
WALMART INC	405	464	7,034	730,787	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	29	—	—	—	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	58	67.5	1,012	105,202	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	29	30.5	308	32,073	一般消費財・サービス
XEROX HOLDINGS CORP	59.11	—	—	—	情報技術
WABTEC CORP	54.11	58.61	432	44,948	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	342.5	394	2,490	258,776	一般消費財・サービス
WATERS CORP	20.5	20.5	467	48,615	ヘルスケア
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	18	—	—	—	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	91.57	—	—	—	その他
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	16.5	17.6	663	68,933	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	220	247	963	100,077	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	37.23	41.73	874	90,846	金融
WESTERN DIGITAL CORP	84	97.5	447	46,442	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	90.8	104.8	1,003	104,238	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	146	168	997	103,586	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	489.5	552	11,647	1,210,027	情報技術
PPL CORP	211	248	721	75,001	公益事業
PULTEGROUP INC	75	89	394	41,016	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	67.5	78.5	1,160	120,519	素材
NORTHERN TRUST CORP	60	64	615	63,923	金融
NVIDIA CORP	163	201	10,662	1,107,679	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	23.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	127.43	138.43	1,935	201,038	金融
HD SUPPLY HOLDINGS INC	53	53	295	30,729	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	83	98	637	66,177	生活必需品
NETFLIX INC	123.2	144	7,075	735,082	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	113	129.2	5,857	608,580	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	79.5	79.5	258	26,850	公益事業
GLOBE LIFE INC	29.25	32.25	309	32,171	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	48.5	57	742	77,183	金融
TEXTRON INC	68.5	71.5	335	34,815	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	117.37	131.37	232	24,170	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	59.5	67.5	227	23,597	公益事業
OMNICOM GROUP	64	71.5	450	46,797	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	676.83	720.33	4,160	432,247	情報技術
MASTERCARD INC - A	255	292	9,900	1,028,598	情報技術
ONEOK INC	119	144	536	55,696	エネルギー
CENTURYLINK INC	294.52	311.52	325	33,852	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	30.2	34.2	1,432	148,801	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	89.5	98	1,050	109,122	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	30.5	37	652	67,810	コミュニケーション・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	13.3	—	—	—	情報技術
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	56.5	60.5	283	29,415	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	145.5	—	—	—	その他
BANK OF AMERICA CORP	2,554.01	2,556.01	7,409	769,811	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	10.5	12.1	467	48,553	資本財・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	52.5	58.5	470	48,863	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	—	—	—	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	200	226	2,725	283,134	金融
ANALOG DEVICES INC	106.49	121.99	1,680	174,578	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	291	383	3,339	346,927	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	83	—	—	—	その他
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	245.22	283.22	1,124	116,841	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	51.5	55	748	77,801	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	49.5	59	480	49,943	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	25	27.5	413	42,940	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	165	179	1,403	145,813	情報技術

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
EMERSON ELECTRIC CO	174	197	1, 539	159, 964	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	69. 7	76. 2	1, 574	163, 537	金融
AMGEN INC	173	192. 5	4, 327	449, 593	ヘルスケア
TAPESTRY INC	83. 5	—	—	—	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	121. 36	130. 86	1, 595	165, 723	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	46. 8	55. 8	1, 142	118, 729	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	272	302	2, 496	259, 343	情報技術
CME GROUP INC	101	118	2, 062	214, 250	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	116. 94	116. 94	153	15, 975	エネルギー
ECOLAB INC	75. 5	84. 5	1, 899	197, 354	素材
EQUIFAX INC	33. 5	40. 5	667	69, 315	資本財・サービス
GAP INC/THE	59. 5	—	—	—	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	359. 5	411. 5	2, 470	256, 632	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	—	115	353	36, 750	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	83. 5	96	453	47, 074	生活必需品
STATE STREET CORP	109. 43	117. 43	840	87, 338	金融
SUNTRUST BANKS INC	129. 48	—	—	—	その他
SCHWAB (CHARLES) CORP	340	502. 9	2, 499	259, 664	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	136	169	1, 283	133, 383	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	48. 5	60	293	30, 531	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	38. 5	45. 5	434	45, 171	素材
CARDINAL HEALTH INC	90	94. 5	508	52, 799	ヘルスケア
FEDEX CORP	69	82	2, 356	244, 844	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	135. 04	151. 04	1, 325	137, 709	金融
FMC CORP	39. 5	42	485	50, 471	素材
FLEX LTD	147. 5	—	—	—	情報技術
CERNER CORP	93. 5	100. 5	744	77, 367	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	30. 24	28. 24	318	33, 114	素材
CITRIX SYSTEMS INC	37	38	465	48, 337	情報技術
INTEL CORP	1, 266. 5	1, 386	6, 576	683, 239	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	115	124	282	29, 371	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	103. 5	116. 5	533	55, 468	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	94. 5	103	2, 185	227, 100	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	461	346	226	23, 544	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	40. 4	48. 5	1, 537	159, 740	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	44	50	222	23, 131	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	32. 1	38. 2	2, 787	289, 636	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	34. 5	40. 5	484	50, 372	情報技術
SNAP-ON INC	15. 5	16. 3	288	29, 973	資本財・サービス
CARMAX INC	49. 5	53. 5	510	53, 007	一般消費財・サービス
COMERICA INC	45	45	231	24, 071	金融
INGREDION INC	19	21. 5	171	17, 857	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	205. 28	241. 78	2, 287	237, 621	公益事業
TARGET CORP	144	162. 8	2, 926	304, 050	一般消費財・サービス
DOVER CORP	42. 5	48	594	61, 775	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	14	14. 9	617	64, 175	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	39. 5	42. 5	449	46, 740	資本財・サービス
CINTAS CORP	26. 2	29. 4	1, 061	110, 290	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	138	158	567	58, 994	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	41	47. 5	347	36, 117	生活必需品
CLOROX COMPANY	37. 5	40. 5	822	85, 451	生活必需品
ENTERGY CORP	54	66. 5	741	77, 038	公益事業
MICROSOFT CORP	2, 056. 5	2, 359	50, 772	5, 274, 781	情報技術
INCYTE CORP	53. 5	60	499	51, 893	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	367. 69	429. 69	2, 916	302, 975	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	379. 38	438. 98	5, 030	522, 594	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	312	366. 5	2, 354	244, 560	情報技術
BLACKROCK INC	32	50	3, 575	371, 463	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	149	158	380	39, 509	公益事業
HASBRO INC	36	44	406	42, 200	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	73	84	533	55, 397	生活必需品
KEYCORP	299	326	532	55, 306	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	30	31. 5	596	62, 014	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	406. 61	468. 11	2, 689	279, 439	生活必需品
KOHLS CORP	49. 5	—	—	—	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	14	17. 7	603	62, 651	ヘルスケア
APACHE CORP	106. 1	—	—	—	エネルギー
CHUBB LTD	129. 49	148. 69	2, 251	233, 904	金融
ARROW ELECTRONICS INC	24	27	251	26, 089	情報技術
ALLSTATE CORP	96	102. 5	1, 067	110, 895	金融
EBAY INC	233. 5	256. 5	1, 316	136, 809	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	315	365	7, 715	801, 587	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	41. 5	45. 5	454	47, 222	素材
XILINX INC	71. 5	80	1, 099	114, 270	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	64. 5	82	294	30, 591	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA	52	52	205	21, 317	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	61	74. 5	1, 832	190, 352	生活必需品
TRIMBLE INC	70. 5	82. 5	498	51, 811	情報技術
LENNAR CORP-A	81	90	699	72, 659	一般消費財・サービス
LEAR CORP	18	18	263	27, 414	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	70	—	—	—	その他

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
PROGRESSIVE CORP	168	193	1, 706	177, 308	金融
PACCAR INC	100. 37	114. 87	1, 007	104, 707	資本財・サービス
PVH CORP	20	—	—	—	一般消費財・サービス
BIOGEN INC	56. 1	56. 2	1, 370	142, 333	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	25. 2	27. 7	1, 258	130, 716	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	342. 5	383. 5	3, 783	393, 079	一般消費財・サービス
PTC INC	31. 5	37	401	41, 748	情報技術
PERRIGO CO PLC	38	42	201	20, 957	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	88. 8	109. 8	965	100, 302	公益事業
INTUIT INC	73. 4	85. 7	3, 035	315, 393	情報技術
BORGWARNER INC	63	82	323	33, 649	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	69	76	855	88, 928	一般消費財・サービス
BALL CORP	91. 84	105. 84	1, 019	105, 954	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	392. 97	470. 97	1, 582	164, 401	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	86. 5	95. 7	1, 188	123, 453	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	36. 5	43. 5	619	64, 321	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	72. 5	85. 5	1, 938	201, 377	ヘルスケア
VF CORP	95	109	934	97, 069	一般消費財・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B	100. 71	183. 75	644	66, 938	コミュニケーション・サービス
VIACOM INC-CLASS B	100. 71	—	—	—	その他
MOHAWK INDUSTRIES INC	17. 2	19	248	25, 769	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	26	30. 7	533	55, 464	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	118. 5	153	330	34, 301	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1, 281. 9	1, 490. 9	7, 715	801, 553	コミュニケーション・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	67	72	172	17, 877	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	67	75	396	41, 218	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	90	90	36	3, 824	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	353	403	170	17, 668	不動産
アメリカ・ドル通貨計 株数、金額	85, 908. 78	102, 065. 16	1, 043, 158	108, 373, 741	
アメリカ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	612 銘柄	591 銘柄		<66. 8%>	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)					
IMPERIAL OIL LTD	83	83	201	16, 078	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	6	7	1, 134	90, 681	情報技術
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	59. 96	—	—	—	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	71. 87	92. 87	705	56, 377	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	132	149	760	60, 765	素材
INTACT FINANCIAL CORP	40. 5	46. 5	668	53, 422	金融
BCE INC	45. 3	49. 3	281	22, 478	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	57	62	1, 050	83, 994	素材
SUNCOR ENERGY INC	444. 3	501. 3	1, 123	89, 816	エネルギー
METRO INC/CN	77	82	492	39, 374	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	95	110	808	64, 621	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	346	399	2, 589	206, 999	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	125. 5	146. 5	1, 628	130, 174	金融
TORONTO-DOMINION BANK	516	594	4, 211	336, 706	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	83	91	277	22, 197	金融
ROYAL BANK OF CANADA	405. 5	467. 5	5, 056	404, 265	金融
TC ENERGY CORP	261. 5	310. 5	1, 841	147, 233	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	146. 29	178. 29	607	48, 564	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	628	—	—	—	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	514	586	1, 725	137, 975	素材
CAE INC	79	79	264	21, 139	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	58. 12	57. 12	592	47, 357	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	53	53	188	15, 110	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	16	—	—	—	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	46. 5	46. 5	278	22, 302	素材
HYDRO ONE LTD	92	105	311	24, 907	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	54. 6	59. 6	383	30, 639	生活必需品
WSP GLOBAL INC	30	37	353	28, 291	資本財・サービス
PARKLAND CORP	44	44	174	13, 926	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	53	53	174	13, 962	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	72	77	419	33, 507	公益事業
SSR MINING INC	—	72	165	13, 233	素材
CANADIAN UTILITIES LTD-A	40	40	131	10, 492	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	106	116	706	56, 479	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	72	78	656	52, 501	素材
STARS GROUP INC/THE	63	—	—	—	その他
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	150	189	386	30, 885	公益事業
B2GOLD CORP	—	347	243	19, 503	素材
AIR CANADA	41	41	101	8, 148	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	379	403	375	30, 061	素材
BANK OF MONTREAL	180	211	2, 041	163, 245	金融
POWER CORP OF CANADA	94	181	537	42, 964	金融
METHANEX CORP	17	—	—	—	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	28	35	4, 700	375, 804	情報技術
NUTRIEN LTD	165. 19	188. 19	1, 210	96, 744	素材
AURORA CANNABIS INC	198	—	—	—	ヘルスケア
CANOPY GROWTH CORP	62	74	277	22, 186	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	55	55	59	4, 766	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	58	88	457	36, 599	素材

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
CAMECO CORP	106	128	169	13,539	エネルギー
TELUS CORP	54	108	272	21,793	コミュニケーション・サービス
POWER FINANCIAL CORP	80	—	—	—	その他
TECK RESOURCES LTD-CLS B	151	151	315	25,195	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	18	18	299	23,926	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	351	389	1,220	97,562	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	8	9	400	32,034	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	92	92	736	58,865	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	22.37	25.37	247	19,776	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	—	70	267	21,356	素材
BLACKBERRY LTD	160	160	127	10,220	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	174.5	192.5	1,139	91,080	金融
ENBRIDGE INC	571	665	2,772	221,652	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	239.5	434.25	2,314	185,013	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	560	638	1,430	114,360	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	95	105	265	21,255	ヘルスケア
ENCANA CORP	368	—	—	—	その他
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	39	45	1,898	151,753	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	33	33	192	15,426	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	63	63	220	17,593	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	204.5	233.5	3,305	264,306	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	73	79	771	61,695	情報技術
HUSKY ENERGY INC	93.58	—	—	—	エネルギー
ONEX CORPORATION	26	26	185	14,821	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	138	151	342	27,380	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	24	24	83	6,698	金融
TMX GROUP LTD	—	19	240	19,190	金融
OPEN TEXT CORP	81	87	506	40,474	情報技術
CI FINANCIAL CORP	70	70	122	9,765	金融
SAPUTO INC	71	80	288	23,031	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	193	193	348	27,836	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	256	283	1,216	97,291	生活必需品
YAMANA GOLD INC	—	323	215	17,198	素材
FORTIS INC	130	150	794	63,488	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	—	38	337	26,944	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	194	194	200	16,006	素材
CENOVUS ENERGY INC	314	314	218	17,472	エネルギー
DOLLARAMA INC	90	97	511	40,892	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	22	22	87	6,977	公益事業
ALTAGAS LTD	79	91	173	13,874	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC	48	—	—	—	不動産
KEYERA CORP	60	74	173	13,879	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	128	128	172	13,825	エネルギー
カナダ・ドル通貨計 株数、金額	11,924.58	12,687.79	64,939	5,191,951	
カナダ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	86銘柄	82銘柄		<3.2%>	
	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
(オーストラリア)					
MEDIBANK PRIVATE LTD	788	888	256	19,737	金融
BHP GROUP LTD	836.5	957.5	3,707	285,139	素材
SOUTH32 LTD	1,516	1,516	372	28,682	素材
ALUMINA LTD	693	—	—	—	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	266.5	305.5	694	53,406	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	425	565	1,049	80,694	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	133	—	—	—	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	794.5	1,024.5	2,389	183,748	金融
WESTPAC BANKING CORP	973.48	1,173.48	2,397	184,385	金融
SANTOS LTD	531	531	331	25,524	エネルギー
AUSNET SERVICES	500	650	120	9,298	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	798.5	924.5	2,134	164,177	金融
RIO TINTO LTD	105	122.5	1,249	96,099	素材
ORIGIN ENERGY LTD	535	535	277	21,355	エネルギー
AURIZON HOLDINGS LTD	600	600	258	19,842	資本財・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	34	34	99	7,664	エネルギー
COLES GROUP LTD	345.45	430.45	772	59,392	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	45	45	134	10,365	情報技術
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	—	250	321	24,707	素材
EVOLUTION MINING LTD	—	530	270	20,788	素材
AFTERPAY LTD	—	70	662	50,983	情報技術
TPG TELECOM LTD	—	120	93	7,171	コミュニケーション・サービス
OIL SEARCH LTD	384	642	234	18,022	エネルギー
SEEK LTD	96	107	278	21,445	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	205	235	216	16,682	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	234	260	704	54,170	素材
INCITEC PIVOT LTD	498	—	—	—	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	501.5	574.5	4,636	356,615	金融
AMPOL LTD	71.5	79.5	243	18,728	エネルギー
ORICA LTD	115	131	221	17,006	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	384.5	464.5	477	36,689	金融
CIMIC GROUP LTD	28	28	71	5,504	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	362	413	1,551	119,304	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	137	157	198	15,274	生活必需品

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
TABCORP HOLDINGS LTD	577	727.63	285	21,993	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	116	116	115	8,876	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	240	305	168	12,948	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	1,202	1,345	418	32,171	コミュニケーション・サービス
AMP LTD	1,020	1,020	177	13,649	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	133.5	142.5	556	42,764	素材
MACQUARIE GROUP LTD	91.84	110.84	1,523	117,206	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	174.5	184.5	612	47,082	一般消費財・サービス
CSL LTD	127.5	147.5	4,469	343,730	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	323	370	1,845	141,970	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	16.5	20.5	455	35,034	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	163	163	281	21,687	素材
SUNCORP GROUP LTD	382.57	412.57	419	32,301	金融
BORAL LTD	358	—	—	—	素材
ASX LTD	58	62.5	482	37,128	金融
COMPUTERSHARE LTD	139	159	225	17,376	情報技術
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	—	—	—	一般消費財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	709.36	709.36	377	29,024	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	132.5	143.5	477	36,707	ヘルスケア
CHALLENGER LTD	174	—	—	—	金融
WORLEY LTD	94	—	—	—	エネルギー
AGL ENERGY LTD	190	190	260	20,048	公益事業
BRAMBLES LTD	474	504	559	43,026	資本財・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	14	—	—	—	一般消費財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	42.5	57.5	366	28,161	ヘルスケア
TPG CORP LTD	87	—	—	—	コミュニケーション・サービス
REA GROUP LTD	16	16	226	17,396	コミュニケーション・サービス
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	38	38	231	17,821	金融
オーストラリア・ドル通貨計 株数、金額	20,170.2	21,308.83	40,966	3,150,719	
オーストラリア・ドル通貨計 銘柄数<比率>	58銘柄	53銘柄		<1.9%>	
	百株	百株	千香港・ドル	千円	
(香港)					
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	405	475	1,957	26,223	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	650	770	4,754	63,713	一般消費財・サービス
MTR CORP	455	525	2,249	30,144	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	455	445	4,685	62,790	不動産
SINO LAND CO	900	1,040	1,092	14,632	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	771.69	956.69	5,500	73,712	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	155	155	720	9,658	不動産
CLP HOLDINGS LTD	470	560	4,088	54,779	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	435.07	485.07	1,566	20,994	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	2,901.99	3,773.58	4,566	61,184	公益事業
HANG SENG BANK LTD	225	261	3,591	48,124	金融
WHEELOCK & CO LTD	240	—	—	—	その他
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,830	525	2,173	29,124	不動産
WH GROUP LTD	2,950	3,210	2,105	28,217	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	337	419	16,181	216,835	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	570	660	1,323	17,732	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	93	108	1,003	13,444	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	190	—	—	—	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	425	—	—	—	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	175	225	450	6,030	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	366.4	452.4	743	9,966	金融
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	—	260	902	12,089	ヘルスケア
SJM HOLDINGS LTD	580	580	528	7,080	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	326	382	899	12,054	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	741.69	911.69	3,988	53,447	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	200	200	801	10,733	公益事業
PCCW LTD	1,170	1,470	686	9,198	コミュニケーション・サービス
AIA GROUP LTD	3,730	4,194	37,116	497,366	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	360	570	2,146	28,757	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	220	—	—	—	生活必需品
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	344	609	1,689	22,645	生活必需品
SANDS CHINA LTD	720	824	2,727	36,547	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	410	470	4,756	63,735	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,075	1,255	3,162	42,378	金融
WYNN MACAU LTD	420	540	740	9,927	一般消費財・サービス
香港・ドル通貨計 株数、金額	25,296.84	27,311.43	118,901	1,593,274	
香港・ドル通貨計 銘柄数<比率>	34銘柄	31銘柄		<1.0%>	
	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)					
UNITED OVERSEAS BANK LTD	348	420	968	75,244	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	497	629	1,615	125,490	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	149.7	436.75	196	15,302	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	429	513	268	20,884	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	140	140	105	8,211	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	136	161	126	9,843	不動産
CAPITALAND LTD	775	829	260	20,223	不動産
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	693	913	83	6,525	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	514	—	—	—	コミュニケーション・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	27	27	56	4,405	一般消費財・サービス

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	937	1, 164	1, 181	91, 787	金融
GENTING SINGAPORE LTD	1, 700	2, 090	176	13, 720	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	86	86	164	12, 808	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2, 254. 5	2, 909. 5	704	54, 701	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	440	500	201	15, 615	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	288	—	—	—	資本財・サービス
SATS LTD	196	—	—	—	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	233	273	251	19, 555	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	648	—	—	—	資本財・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	589	659	282	21, 963	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計 株数、金額	11, 080. 2	11, 750. 25	6, 645	516, 283	
シンガポール・ドル通貨計 銘柄数＜比率＞	20 銘柄	16 銘柄		＜0. 3%＞	
	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
(ニュージーランド)					
MERIDIAN ENERGY LTD	345	415	256	18, 750	公益事業
MERCURY NZ LTD	230	230	138	10, 089	公益事業
A2 MILK CO LTD	214	262	384	28, 100	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	526. 89	620. 89	288	21, 107	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	294	389	297	21, 770	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	201	—	—	—	素材
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	187	204	692	50, 634	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	118	140	210	15, 353	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計 株数、金額	2, 115. 89	2, 260. 89	2, 267	165, 805	
ニュージーランド・ドル通貨計 銘柄数＜比率＞	8 銘柄	7 銘柄		＜0. 1%＞	
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)					
TUI AG-DI	137. 97	—	—	—	一般消費財・サービス
BP PLC	5, 750	6, 665	1, 752	242, 771	エネルギー
UNILEVER PLC	317. 6	384. 1	1, 761	244, 053	生活必需品
BARCLAYS PLC	4, 968	5, 688	793	109, 936	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	527	2, 795	300	41, 687	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	561	—	—	—	一般消費財・サービス
PRUDENTIAL PLC	757	849	1, 028	142, 566	金融
NATWEST GROUP PLC	1, 457. 91	1, 597. 91	256	35, 566	金融
EVRAZ PLC	150	150	58	8, 150	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	60. 64	60. 64	136	18, 895	素材
BAE SYSTEMS PLC	943	1, 065	536	74, 397	資本財・サービス
AVIVA PLC	1, 138. 66	1, 289. 66	417	57, 910	金融
AVEVA GROUP PLC	20	20	67	9, 352	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC	1, 410	1, 651	2, 284	316, 493	ヘルスケア
INFORMA PLC	362	499	269	37, 347	コミュニケーション・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	105. 4	—	—	—	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC	1, 455	1, 565	249	34, 541	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	283	319	174	24, 229	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	28	31. 5	179	24, 815	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	135	152	337	46, 710	一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	21	24. 5	265	36, 830	資本財・サービス
HALMA PLC	110	122. 5	271	37, 678	情報技術
GVC HOLDINGS PLC	167	191	199	27, 587	一般消費財・サービス
NMC HEALTH PLC	27	—	—	—	その他
JD SPORTS FASHION PLC	130	146	107	14, 831	一般消費財・サービス
M&G PLC	757	837	161	22, 433	金融
RELX PLC	555. 46	631. 46	1, 100	152, 405	資本財・サービス
DIAGEO PLC	675	769	2, 255	312, 496	生活必需品
RIO TINTO PLC	322. 5	370	1, 821	252, 344	素材
STANDARD CHARTERED PLC	821	868	402	55, 765	金融
TESCO PLC	2, 817	3, 207	730	101, 218	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	264. 5	290. 5	421	58, 461	ヘルスケア
GLENCORE PLC	3, 245. 25	3, 307. 25	706	97, 852	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	81. 5	102. 5	146	20, 357	金融
SMITHS GROUP PLC	113. 83	123. 83	181	25, 177	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	419. 83	419. 83	124	17, 281	金融
PEARSON PLC	235. 63	235. 63	153	21, 220	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	542. 25	542. 25	117	16, 265	生活必需品
NEXT PLC	42	44. 5	290	40, 186	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	932	1, 177	185	25, 635	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	38. 61	68. 61	216	30, 057	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	96. 05	112. 05	259	35, 954	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	7, 661. 83	8, 701. 83	1, 086	150, 584	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	36. 61	42. 61	253	35, 126	素材
KINGFISHER PLC	624. 11	682. 11	184	25, 601	一般消費財・サービス
WPP PLC	384	409	306	42, 466	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	206. 27	228. 27	205	28, 438	公益事業
SEVERN TRENT PLC	71. 33	78. 33	187	25, 916	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	540	612	300	41, 616	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	203	234. 5	1, 528	211, 704	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	151. 5	165. 5	168	23, 377	金融
SCHRODERS PLC	34. 5	41. 5	134	18, 594	金融
SSE PLC	300	339	467	64, 816	公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	79. 5	—	—	—	資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	310	340	213	29, 630	一般消費財・サービス

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ASTRAZENECA PLC	370.5	431.5	3,352	464,524	ヘルスケア
FERGUSON PLC	70.87	74.87	623	86,346	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,830	1,955	501	69,422	金融
3I GROUP PLC	293.91	313.91	337	46,797	金融
ASHTEAD GROUP PLC	136.5	146.5	461	63,937	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	323.14	351.14	214	29,667	情報技術
NATIONAL GRID PLC	981.34	1,144.34	999	138,539	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	20,814.65	22,964.65	856	118,663	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	317.6	317.6	214	29,675	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	288	304	429	59,514	生活必需品
CENTRICA PLC	1,761.6	—	—	—	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	36	41.5	194	26,937	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	650.1	753.6	2,017	279,508	生活必需品
BHP GROUP PLC	605.27	687.27	1,194	165,475	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	106	115	244	33,874	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	5,716.5	6,696.5	2,711	375,619	金融
ANGLO AMERICAN PLC	310.83	403.83	914	126,756	素材
MONDI PLC	142.5	156.5	264	36,633	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	663	734	134	18,671	生活必需品
CARNIVAL PLC	48.61	—	—	—	一般消費財・サービス
EASYJET PLC	40	—	—	—	資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC	464.89	589.39	835	115,793	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	93	106	285	39,594	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	2,461	2,901	351	48,754	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	58	65.5	142	19,810	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	121.89	132.89	228	31,696	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	51.36	56.36	269	37,270	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	48	52	286	39,639	資本財・サービス
ITV PLC	1,021	—	—	—	コミュニケーション・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	91.99	104.99	831	115,207	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,233	1,350	1,808	250,524	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,057.18	1,223.18	1,595	220,990	エネルギー
MEGGITT PLC	241	—	—	—	資本財・サービス
G4S PLC	435	—	—	—	資本財・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	57	150	20,785	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	55.5	61.5	175	24,258	金融
ANTOFAGASTA PLC	114	128	158	21,937	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	708.62	708.62	192	26,606	金融
EXPERIAN PLC	261.54	296.54	766	106,206	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計 株数、金額	87,608.13	95,671.55	49,505	6,858,983	
銘柄数<比率>	93銘柄	83銘柄		<4.2%>	
	百株	百株	千イスラエル・シュケル	千円	
(イスラエル)					
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	345	345	394	12,369	金融
AZRIELI GROUP LTD	10	14	281	8,832	不動産
ICL GROUP LTD	176	236	366	11,501	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	6	9.5	406	12,724	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	307	357	792	24,838	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	452	512	980	30,728	金融
NICE LTD	18.5	22	1,751	54,896	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	41	41	298	9,354	金融
イスラエル・シュケル通貨計 株数、金額	1,355.5	1,536.5	5,272	165,244	
銘柄数<比率>	8銘柄	8銘柄		<0.1%>	
	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)					
DUFRY AG-REG	12.5	—	—	—	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	1,104	1,200	1,579	181,560	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2.3	2.8	229	26,364	素材
ADECCO GROUP AG-REG	46.5	51.5	277	31,913	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	199.4	229.8	6,951	799,208	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	11	—	—	—	金融
SIKA AG-REG	38.4	47.1	1,086	124,871	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.03	0.03	246	28,282	生活必需品
ABB LTD-REG	538	601	1,451	166,869	資本財・サービス
SWISS RE AG	90	97.5	816	93,868	金融
NESTLE SA-REG	869	972	9,943	1,143,211	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	5.2	5.9	570	65,553	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	12.6	12.6	314	36,186	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	751.7	799.7	936	107,709	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	64	74	388	44,614	金融
SGS SA-REG	1.6	2	517	59,508	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	5.8	6.9	166	19,197	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	13	14.5	191	22,063	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG	19.7	21.2	244	28,054	情報技術
ALCON INC	124.3	161.3	932	107,225	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	8.5	9.7	222	25,582	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	44.72	48.62	1,810	208,109	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	13.9	15.7	249	28,681	金融
CLARIANT AG-REG	57	57	104	12,041	素材
NOVARTIS AG-REG	610.5	726	5,884	676,593	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.7	1	197	22,672	生活必需品

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	153.1	171.6	1,317	151,478	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	7.7	8.3	399	45,909	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	10.1	96	11,135	金融
GEBERIT AG-REG	11.3	11.9	646	74,317	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	2.6	3	1,092	125,650	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	2.9	3.4	352	40,477	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	16.9	18.22	407	46,859	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	—	55	430	49,549	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	22	24	1,324	152,257	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	15.2	15.2	67	7,762	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	142.9	172.9	831	95,555	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	10.4	10.4	425	48,915	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	16.7	18	364	41,927	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	23.3	25.1	205	23,605	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.34	0.34	262	30,196	生活必需品
スイス・フラン通貨計 株数、金額	5,069.69	5,705.31	43,537	5,005,544	
スイス・フラン通貨計 銘柄数<比率>	39銘柄	39銘柄		<3.1%>	
	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
(デンマーク)					
NOVO NORDISK A/S-B	506	595	24,945	416,837	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	184	227	2,360	39,448	金融
ISS A/S	44	—	—	—	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.95	1.05	1,209	20,212	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	17	23	446	7,454	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	56	68	8,391	140,216	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S	—	43	2,156	36,027	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B	30	36.5	3,430	57,319	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	64	72.5	2,604	43,528	素材
COLOPLAST-B	33.5	40.5	3,765	62,924	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	62.1	71.6	7,306	122,096	資本財・サービス
DEMANT A/S	34.25	34.25	749	12,516	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2	2.2	2,731	45,640	資本財・サービス
TRYG A/S	33	40	724	12,104	金融
PANDORA A/S	31.5	35	2,272	37,968	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	30.5	34.5	2,103	35,154	素材
GENMAB A/S	19.5	22.9	5,310	88,738	ヘルスケア
ORSTED A/S	55	66	7,434	124,237	公益事業
AMBU A/S-B	—	56	1,128	18,855	ヘルスケア
デンマーク・クローネ通貨計 株数、金額	1,203.3	1,469	79,071	1,321,281	
デンマーク・クローネ通貨計 銘柄数<比率>	17銘柄	18銘柄		<0.8%>	
	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
(ノルウェー)					
NORSK HYDRO ASA	417	417	1,521	17,889	素材
DNB ASA	281	331	5,413	63,662	金融
ORKLA ASA	219.5	244.5	2,103	24,739	生活必需品
TELENOR ASA	208	254	3,896	45,821	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	279.73	338.23	4,966	58,410	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	49.6	57.1	2,078	24,442	素材
MOWI ASA	128.5	141	2,582	30,369	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	55.5	73.5	1,411	16,595	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	31	31	1,060	12,467	コミュニケーション・サービス
AKER BP ASA	29	—	—	—	エネルギー
ADEVINTA ASA	—	81	1,173	13,802	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計 株数、金額	1,698.83	1,968.33	26,207	308,201	
ノルウェー・クローネ通貨計 銘柄数<比率>	10銘柄	10銘柄		<0.2%>	
	百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)					
ICA GRUPPEN AB	27	35.2	1,448	17,704	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	856.3	996.3	10,575	129,235	情報技術
VOLVO AB-B SHS	414	508.5	10,164	124,215	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	18	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SKF AB-B SHARES	105.5	133	2,859	34,943	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	66.5	76	1,559	19,057	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	49	56.5	3,909	47,777	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	156	168	1,861	22,746	コミュニケーション・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	482.5	574	5,361	65,513	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	465.5	528.5	4,662	56,974	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	266	318	4,970	60,745	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	235.5	282	5,150	62,941	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	—	207	2,878	35,173	素材
SKANSKA AB-B SHS	102.5	115.5	2,396	29,286	資本財・サービス
SANDVIK AB	331.5	384.5	7,543	92,186	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	127	156	9,282	113,426	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	184.5	229.5	10,091	123,313	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	95.5	109.5	1,564	19,121	資本財・サービス
TELIA CO AB	830	862	3,173	38,784	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	88	110	2,445	29,881	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	112.5	132.5	5,061	61,851	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	293.5	341.5	7,062	86,300	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS	22	26	1,165	14,240	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	—	52	1,144	13,979	資本財・サービス

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		—	104	2, 486	30, 386	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB		52. 5	63. 5	1, 365	16, 683	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B		168. 5	212	5, 802	70, 905	生活必需品
BOLIDEN AB		78	93	2, 780	33, 980	素材
EPIROC AB-A		206. 5	222. 5	3, 216	39, 302	資本財・サービス
EPIROC AB-B		116	135	1, 855	22, 675	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		114. 5	141. 5	1, 292	15, 793	一般消費財・サービス
NORDEA BANK ABP		897	1, 111	8, 280	101, 185	金融
EQT AB		—	81	1, 547	18, 910	金融
EVOLUTION GAMING GROUP		—	44	3, 036	37, 110	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B		73	83	3, 400	41, 554	金融
HEXAGON AB-B SHS		72	99	7, 054	86, 208	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		46	57	1, 505	18, 402	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額	7, 152. 8	8, 848. 5	149, 959	1, 832, 500	
	銘柄数<比率>	32 銘柄	36 銘柄		<1. 1%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（アイルランド）						
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		68	75. 5	268	33, 412	素材
AIB GROUP PLC		230	—	—	—	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC		274. 6	—	—	—	金融
KINGSPAN GROUP PLC		44	50	360	44, 776	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		45. 7	51. 5	599	74, 560	生活必需品
CRH PLC		231	253. 5	865	107, 676	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		22	49. 6	763	95, 006	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額	915. 3	480. 1	2, 857	355, 432	
	銘柄数<比率>	7 銘柄	5 銘柄		<0. 2%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オランダ）						
QIAGEN N. V.		64. 98	72. 98	296	36, 917	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		264. 26	302. 1	1, 305	162, 437	ヘルスケア
NN GROUP NV		90. 5	90. 5	311	38, 744	金融
HEINEKEN NV		76	85. 5	763	94, 902	生活必需品
AEGON NV		536. 44	582. 44	178	22, 153	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		336. 33	362. 33	862	107, 303	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.		65. 38	65. 38	586	72, 894	素材
KONINKLIJKE DSM NV		53	57	780	97, 128	素材
WOLTERS KLUWER		83	89	620	77, 223	資本財・サービス
ING GROEP NV		1, 110. 5	1, 262. 5	1, 062	132, 156	金融
KONINKLIJKE KPN NV		1, 009. 5	1, 146. 5	290	36, 192	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		120. 6	139. 3	5, 103	634, 742	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA		117	130. 5	123	15, 416	金融
ADYEN NV		3	6	969	120, 598	情報技術
UNILEVER NV		416	479. 5	2, 409	299, 751	生活必需品
JUST EAT TAKEAWAY		—	40	352	43, 871	一般消費財・サービス
PROSUS NV		145	161	1, 501	186, 714	一般消費財・サービス
VOPAK		19	23	105	13, 085	エネルギー
RANDSTAD NV		32	37	190	23, 663	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		34	37. 5	293	36, 521	生活必需品
ALTICE EUROPE NV		205	205	92	11, 474	コミュニケーション・サービス
STMICROELECTRONICS NV		199. 5	210. 5	699	86, 950	情報技術
AIRBUS SE		165. 5	194	1, 746	217, 167	資本財・サービス
ARGENX SE		—	14. 5	340	42, 382	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		162	195	186	23, 172	生活必需品
EXOR NV		32. 3	35. 3	207	25, 781	金融
CNH INDUSTRIAL NV		298	328	301	37, 508	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		323. 5	360	476	59, 221	一般消費財・サービス
FERRARI NV		34. 95	41. 45	740	92, 052	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額	5, 997. 24	6, 753. 78	22, 898	2, 848, 130	
	銘柄数<比率>	27 銘柄	29 銘柄		<1. 8%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ベルギー）						
GALAPAGOS NV		13	13. 9	146	18, 170	ヘルスケア
UCB SA		35. 5	41. 3	373	46, 509	ヘルスケア
KBC GROUP NV		74. 5	82. 5	492	61, 239	金融
COLRUYT SA		16	16	78	9, 787	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		22	36	298	37, 128	金融
SOLVAY SA		22	24. 5	236	29, 406	素材
UMICORE		58	63. 5	243	30, 257	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		216	249	1, 425	177, 306	生活必需品
AGEAS		52. 4	57. 9	242	30, 138	金融
PROXIMUS		41	49. 5	89	11, 079	コミュニケーション・サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		14. 5	14. 5	50	6, 323	コミュニケーション・サービス
ELIA GROUP SA/NV		—	10. 5	100	12, 472	公益事業
SOFINA		—	5. 5	144	17, 991	金融
国小計	株数、金額	564. 9	664. 6	3, 921	487, 811	
	銘柄数<比率>	11 銘柄	13 銘柄		<0. 3%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ルクセンブルグ）						
AROUNDTOWN SA		271	370	222	27, 612	不動産
ARCELORMITTAL		203	233	356	44, 322	素材
EUROFINS SCIENTIFIC		3. 2	44	297	36, 946	ヘルスケア

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千ユーロ	千円	
SES		110	110	86	10,808	コミュニケーション・サービス
TENARIS SA		133	133	89	11,090	エネルギー
国小計	株数、金額	720.2	890	1,051	130,780	
	銘柄数<比率>	5銘柄	5銘柄		<0.1%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フランス）						
JCDECAUX SA		19	27	48	6,007	コミュニケーション・サービス
TOTAL SE		679.5	810.5	3,055	380,053	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		50	57	617	76,745	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		134.77	155.77	2,151	267,564	素材
KERING		21.8	25	1,515	188,497	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		156.5	182	2,137	265,873	資本財・サービス
BOUYGUES SA		67	74	249	31,091	資本財・サービス
BNP PARIBAS		320.5	364.5	1,597	198,687	金融
PEUGEOT SA		175.5	191.5	382	47,613	一般消費財・サービス
NATIXIS		295.5	295.5	78	9,765	金融
THALES SA		32.3	35	279	34,765	資本財・サービス
DANONE		176	200	1,055	131,295	生活必需品
CARREFOUR SA		170	198	272	33,862	生活必需品
SUEZ		99.25	112.25	181	22,582	公益事業
VIVENDI		268.91	268.91	682	84,921	コミュニケーション・サービス
L'OREAL		71.7	82.3	2,545	316,614	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		145.5	168.5	679	84,460	資本財・サービス
LEGRAND SA		80.17	88.17	629	78,323	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		15.5	—	—	—	生活必需品
PERNOD RICARD SA		60.87	69.37	1,107	137,793	生活必需品
EURAZEO SE		12.54	12.54	65	8,110	金融
SOCIETE GENERALE SA		220.5	269.5	466	58,084	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		79.3	91	4,513	561,401	一般消費財・サービス
ACCOR SA		53.5	61.5	185	23,131	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		47.7	53.2	637	79,238	情報技術
VALEO SA		71.5	77	258	32,102	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		64	70.5	271	33,724	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA		88	97	208	25,987	資本財・サービス
EIFFAGE		23.4	27.4	230	28,688	資本財・サービス
SODEXO SA		27	27	197	24,582	一般消費財・サービス
IPSEN		11.5	11.5	92	11,442	ヘルスケア
INGENICO GROUP		18	—	—	—	その他
ORPEA		—	18	188	23,474	ヘルスケア
AMUNDI SA		17	19.5	132	16,456	金融
TELEPERFORMANCE		17.7	19.2	528	65,672	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		24.5	30	236	29,440	コミュニケーション・サービス
FAURECIA		22.5	22.5	96	11,955	一般消費財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		8	9	264	32,866	ヘルスケア
SEB SA		6.5	6.5	97	12,086	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA		83	92.5	1,118	139,154	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA		0.8	1	89	11,132	資本財・サービス
WORLDLINE SA		23.64	78.14	611	76,061	情報技術
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		—	30	105	13,119	一般消費財・サービス
AXA SA		553.5	638.5	1,259	156,704	金融
EDENRED		69	79.5	386	48,125	情報技術
RENAULT SA		58	58	197	24,610	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL		9	10.2	839	104,462	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU		6.3	7.5	112	13,936	生活必需品
ATOS SE		29.6	32	244	30,392	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SE		39.8	43.6	677	84,218	情報技術
WENDEL		7.8	7.8	73	9,100	金融
ORANGE		583	659	704	87,622	コミュニケーション・サービス
ALSTOM		44.5	63	284	35,410	資本財・サービス
CNP ASSURANCES		48.5	48.5	65	8,131	金融
SANOFI		318.75	370.75	3,159	392,936	ヘルスケア
VINCI SA		145.5	170	1,495	186,030	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		164.5	175	346	43,086	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		343	376	370	46,130	金融
BIOMERIEUX		11.5	13.4	159	19,883	ヘルスケア
ENGIE		521.23	602.23	753	93,781	公益事業
EDF		170.5	202.5	263	32,717	公益事業
SAFRAN SA		93.2	104.2	1,281	159,412	資本財・サービス
ILIAD SA		7.4	4.9	85	10,580	コミュニケーション・サービス
ARKEMA		19.2	22.2	216	26,916	素材
ADP		9.1	9.1	98	12,280	資本財・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS		47	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SCOR SE		49.5	49.5	143	17,867	金融
GETLINK SE		124	142	202	25,132	資本財・サービス
BOLLORE		241	286	93	11,582	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額	7,675.23	8,705.13	43,379	5,395,493	
	銘柄数<比率>	67銘柄	66銘柄		<3.3%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ドイツ）						
BAYER AG-REG		268.2	322.7	1,597	198,720	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		53	65	163	20,324	素材

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	593.5	639.5	606	75,436	金融
COMMERZBANK AG	281.35	329.35	177	22,088	金融
VOLKSWAGEN AG	8.9	10.1	162	20,212	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	52.7	61.2	893	111,075	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	217.5	250.5	2,822	351,079	資本財・サービス
E. ON SE	642	742	678	84,353	公益事業
UNIPER SE	59.5	66.5	187	23,374	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	98.5	110	803	100,000	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	45	50.5	145	18,089	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	31.7	35.9	419	52,221	一般消費財・サービス
BASF SE	261.7	301.2	1,834	228,226	素材
ALLIANZ SE-REG	120.4	134.7	2,668	331,963	金融
THYSSENKRUPP AG	114.5	114.5	63	7,923	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	52	58	521	64,825	生活必需品
RWE AG	162.5	212	739	91,947	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	66.5	96.5	97	12,086	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	11.8	11.8	55	6,889	資本財・サービス
BRENNTAG AG	47	50	319	39,714	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	122	135.5	515	64,161	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	33.2	33.2	111	13,841	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG	7.1	7.1	57	7,139	資本財・サービス
SAP SE	279.92	341.92	3,423	425,875	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	41.6	46.1	1,087	135,205	金融
ZALANDO SE	35.5	49.5	398	49,537	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	45	49	296	36,872	素材
KION GROUP AG	18.5	21	147	18,309	資本財・サービス
WIRECARD AG	34.7	—	—	—	情報技術
COVESTRO AG	52	56	265	33,050	素材
SARTORIUS AG-VORZUG	10.5	12.1	440	54,781	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	46.5	50	275	34,204	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	32	41.5	410	51,101	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	12.5	12.5	139	17,335	ヘルスケア
METRO AG	50	50	39	4,888	生活必需品
NEMETSCHEK SE	—	20	130	16,181	情報技術
SCOUT24 AG	—	36	226	28,231	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	45	86	329	41,011	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	14.5	23	247	30,804	資本財・サービス
TEAMVIEWER AG	—	44.5	176	21,896	情報技術
SIEMENS ENERGY AG	—	131.25	327	40,681	資本財・サービス
KION GROUP AG-RTS	—	21	—	—	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	30.9	32.9	312	38,834	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE-PREF	19.5	23.5	113	14,106	素材
MERCK KGAA	37.5	42.5	566	70,517	ヘルスケア
ADIDAS AG	51.2	61.7	1,673	208,125	一般消費財・サービス
PUMA SE	23.6	27.1	222	27,680	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	31	34	272	33,894	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	959.5	1,092.5	1,655	205,933	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	62.7	69.2	490	60,955	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	261	281	1,590	197,786	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	371.5	413	1,222	152,077	情報技術
HANNOVER RUECK SE	17.3	20	278	34,602	金融
DEUTSCHE POST AG-REG	292	324	1,314	163,533	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	56.4	62.6	857	106,709	金融
LANXESS AG	25	25	148	18,495	素材
MTU AERO ENGINES AG	15.3	17.1	349	43,473	資本財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	106	110	451	56,095	不動産
SYMRISE AG	39.2	42.2	444	55,296	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	263	338	80	10,064	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	15.5	19.5	108	13,461	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	153	170.5	964	119,945	不動産
LEG IMMOBILIEN AG	—	23	271	33,756	不動産
国小計 株数、金額	6,899.87	8,158.42	37,393	4,651,011	
国小計 銘柄数<比率>	57銘柄	62銘柄		<2.9%>	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ポルトガル）					
JERONIMO MARTINS	60	77	109	13,570	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	747	883	406	50,520	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	139.5	150.5	143	17,891	エネルギー
国小計 株数、金額	946.5	1,110.5	659	81,983	
国小計 銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		<0.1%>	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（スペイン）					
TELEFONICA SA	1,320.27	1,572.27	587	73,060	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA	92.5	103.5	251	31,269	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,910.12	2,205.12	872	108,557	金融
IBERDROLA SA	1,703.34	1,944.34	2,230	277,387	公益事業
BANCO DE SABADELL SA	1,601.09	—	—	—	金融
BANKINTER SA	183	215	89	11,161	金融
REPSOL SA	418	494	419	52,141	エネルギー
GRIFOLS SA	85	98	239	29,778	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	4,772.5	5,477.5	1,350	167,938	金融

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千ユーロ	千円	
AMADEUS IT GROUP SA		123.5	146	880	109,574	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA		94	94	187	23,278	公益事業
MAPFRE SA		306.5	306.5	48	6,019	金融
CAIXABANK SA		1,093	1,175	258	32,196	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		78.76	88.76	238	29,609	資本財・サービス
AENA SME SA		20	22.5	323	40,243	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA		58	104.55	537	66,892	コミュニケーション・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		323	360	1,018	126,628	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		66.5	77	222	27,639	資本財・サービス
ENAGAS SA		69	79.5	165	20,547	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		125.5	139	238	29,615	公益事業
FERROVIAL SA		142	162.7	384	47,778	資本財・サービス
BANKIA SA		301.05	—	—	—	金融
国小計	株数、金額	14,886.63	14,865.24	10,542	1,311,317	
	銘柄数<比率>	22銘柄	20銘柄		<0.8%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（イタリア）						
PRYSMIAN SPA		68.5	78.5	211	26,264	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		315.43	372.43	538	67,029	金融
MEDIOBANCA SPA		170.65	188.65	145	18,137	金融
UNICREDIT SPA		576.56	696.56	633	78,788	金融
TELECOM ITALIA SPA		2,629.82	2,629.82	105	13,123	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP		1,719.5	1,719.5	73	9,168	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO		4,262.37	5,507.37	1,070	133,206	金融
ATLANTIA SPA		146.57	172.57	263	32,775	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		160	160	140	17,512	金融
MONCLER SPA		51.5	63	258	32,135	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		30.5	34.5	156	19,443	ヘルスケア
ENI SPA		725	841	721	89,770	エネルギー
PIRELLI & C SPA		110	110	47	5,944	一般消費財・サービス
DIASORIN SPA		—	8.5	146	18,268	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		—	83	89	11,087	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA		—	120.5	191	23,815	情報技術
LEONARDO SPA		109.75	131.75	78	9,809	資本財・サービス
ENEL SPA		2,307.34	2,671.34	2,271	282,488	公益事業
SNAM SPA		616	666	313	38,941	公益事業
TERNA SPA		428	463	293	36,464	公益事業
FINECOBANK SPA		180	197	258	32,135	金融
国小計	株数、金額	14,607.49	16,914.99	8,010	996,312	
	銘柄数<比率>	18銘柄	21銘柄		<0.6%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フィンランド）						
UPM-KYMMENE OYJ		156	175.5	496	61,775	素材
NOKIA OYJ		1,585	1,864	637	79,244	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		120	147	118	14,722	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		170.5	188.5	273	34,007	素材
NELES OYJ		28	—	—	—	資本財・サービス
ELISA OYJ		41.5	46	208	25,986	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		125	153	551	68,565	金融
FORTUM OYJ		138.5	138.5	267	33,221	公益事業
KONE OYJ-B		99	112.5	783	97,417	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ		36.5	—	—	—	一般消費財・サービス
NESTE OYJ		120.5	139	799	99,410	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		27.5	32	127	15,916	ヘルスケア
国小計	株数、金額	2,648	2,996	4,263	530,268	
	銘柄数<比率>	12銘柄	10銘柄		<0.3%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オーストリア）						
VERBUND AG		20	20	118	14,676	公益事業
OMV AG		44.5	44.5	131	16,339	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		87	94.5	236	29,361	金融
VOESTALPINE AG		28.5	42.5	114	14,235	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		34	44	73	9,172	金融
ANDRITZ AG		21	21	73	9,126	資本財・サービス
国小計	株数、金額	235	266.5	746	92,911	
	銘柄数<比率>	6銘柄	6銘柄		<0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額	56,096.36	61,805.26	135,724	16,881,454	
	銘柄数<比率>	235銘柄	240銘柄		<10.4%>	
ファンド合計	株数、金額	316,681.1	354,388.8	—	151,364,986	
	銘柄数<比率>	1,252銘柄	1,214銘柄		<93.3%>	

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

(2)外国新株予約権証券

銘柄	当期末		
	証券数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	証券	千スイス・フラン	千円
(スイス)			
CIF -CW	34, 320	7	868

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

(3)外国投資信託証券

銘柄	期首	当期末		
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3. 867	4. 587	770	79, 997
SIMON PROPERTY GROUP INC	8. 887	10. 137	867	90, 095
BOSTON PROPERTIES INC	4. 25	4. 95	507	52, 675
VORNADO REALTY TRUST	5. 097	5. 397	217	22, 612
SBA COMMUNICATIONS CORP	3. 15	3. 65	1, 042	108, 348
EQUITY RESIDENTIAL	10. 7	12. 35	731	75, 956
EQUINIX INC	2. 288	2. 918	2, 044	212, 363
AMERICAN TOWER CORP	12. 45	14. 5	3, 394	352, 634
HOST HOTELS & RESORTS INC	21. 943	22. 243	325	33, 784
KIMCO REALTY CORP	12. 6	—	—	—
INVITATION HOMES INC	12. 7	17. 7	509	52, 885
VICI PROPERTIES INC	13. 5	15. 4	395	41, 085
VENTAS INC	10. 5	12. 2	584	60, 711
WEYERHAEUSER CO	21. 164	24. 114	692	71, 924
AGNC INVESTMENT CORP	15. 3	18. 1	281	29, 277
CROWN CASTLE INTL CORP	11. 75	13. 75	2, 298	238, 800
IRON MOUNTAIN INC	8. 21	9. 71	258	26, 853
VEREIT INC	29. 3	33. 5	245	25, 545
SUN COMMUNITIES INC	2. 75	3. 25	450	46, 800
PROLOGIS INC	17. 812	24. 402	2, 454	255, 033
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3. 07	4. 12	668	69, 400
CAMDEN PROPERTY TRUST	2. 9	3. 2	312	32, 493
DUKE REALTY CORP	10. 2	12. 15	466	48, 458
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1. 95	2. 17	542	56, 362
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2. 2	2. 36	208	21, 666
WELLTOWER INC	11. 45	13. 85	893	92, 865
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	14. 35	17. 65	527	54, 789
LIBERTY PROPERTY TRUST	4. 4	—	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3. 25	3. 75	465	48, 308
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4. 8	5. 8	340	35, 376
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	43. 7	45. 1	368	38, 233
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4. 55	5. 35	205	21, 337
REALTY INCOME CORP	8. 9	11. 2	690	71, 722
PUBLIC STORAGE	4. 37	5. 22	1, 148	119, 323
REGENCY CENTERS CORP	4. 95	5. 3	248	25, 818
SL GREEN REALTY CORP	2. 4	—	—	—
UDR INC	8. 1	9. 75	382	39, 727
WP CAREY INC	5. 1	5. 8	405	42, 113
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	6. 4	7. 6	272	28, 305
DIGITAL REALTY TRUST INC	6. 05	8. 9	1, 216	126, 423
EXTRA SPACE STORAGE INC	3. 75	4. 25	467	48, 568
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	13	17. 25	337	35, 071
アメリカ・ドル通貨計 口数、金額	398. 058	443. 628	28, 239	2, 933, 750
アメリカ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	42 銘柄	39 銘柄		<1. 8%>
	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)				
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	4. 8	74	5, 986
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2. 1	2. 1	50	4, 071
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2. 4	2. 4	123	9, 851
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3. 7	—	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4. 7	4. 7	85	6, 827
カナダ・ドル通貨計 口数、金額	12. 9	14	334	26, 736
カナダ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	4 銘柄	4 銘柄		<0. 0%>
	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)				
LENDLEASE GROUP	17	21. 5	305	23, 480
TRANSURBAN GROUP	76. 5	89. 5	1, 267	97, 469
SYDNEY AIRPORT	33. 3	42. 5	285	21, 965
APA GROUP	35. 8	38. 1	402	30, 972
SCENTRE GROUP	153. 922	159. 922	460	35, 422
DEXUS	33. 15	33. 15	325	25, 036
GPT GROUP	56. 16	63. 16	299	23, 025

銘柄		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
MIRVAC GROUP		111.6	126.1	329	25,312
STOCKLAND		72	78	360	27,715
GOODMAN GROUP		50.1	52.9	984	75,715
VICINITY CENTRES		99.273	123.273	205	15,833
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額	738.805	828.105	5,226	401,950
	銘柄数<比率>	11銘柄	11銘柄		<0.2%>
		千口	千口	千香港・ドル	千円
(香港)					
LINK REIT		62.5	70.5	4,829	64,711
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		75	92	716	9,603
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		107	122	1,263	16,936
香港・ドル通貨計	口数、金額	244.5	284.5	6,809	91,251
	銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		<0.1%>
		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)					
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		79.6	—	—	—
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		76	101	305	23,697
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		77.2	158.032	314	24,432
SUNTEC REIT		63	63	96	7,488
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		—	91.8	179	13,978
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		65.5	65.5	135	10,533
(非上場)					
ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS		—	3.737	—	—
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	361.3	483.069	1,031	80,129
	銘柄数<比率>	5銘柄	6銘柄		<0.0%>
		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
(イギリス)					
LAND SECURITIES GROUP PLC		21.662	21.662	144	19,961
SEGRO PLC		33.15	38.45	346	48,019
BRITISH LAND CO PLC		25.55	29.55	138	19,246
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	80.362	89.662	629	87,227
	銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		<0.1%>
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ(フランス)					
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		3.95	4.2	265	32,994
ICADE		0.95	0.95	56	7,077
GECINA SA		1.4	1.4	177	22,132
KLEPIERRE		6.25	6.25	121	15,065
COVIVIO		1.27	1.5	108	13,433
ユーロ通貨計	口数、金額	13.82	14.3	729	90,703
	銘柄数<比率>	5銘柄	5銘柄		<0.1%>
合計	口数、金額	1,849.745	2,157.264	—	3,711,750
	銘柄数<比率>	73銘柄	71銘柄		<2.3%>

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

(4)先物取引の銘柄別期末残高(評価額)

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

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

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	151,364,986	93.2
新株予約権証券	868	0.0
投資信託証券	3,711,750	2.3
コール・ローン等、その他	7,312,974	4.5
投資信託財産総額	162,390,580	100.0

(注1)評価額の単位未満は切捨て。
(注2)外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=103.89円、1カナダ・ドル=79.95円、1オーストラリア・ドル=76.91円、1香港・ドル=13.40円、1シンガポール・ドル=77.69円、1ニュージーランド・ドル=73.11円、1イギリス・ポンド=138.55円、1イスラエル・シュケル=31.34円、1スイス・フラン=114.97円、1デンマーク・クローネ=16.71円、1ノルウェー・クローネ=11.76円、1スウェーデン・クローネ=12.22円、1ユーロ=124.38円です。
(注3)当期末における外貨建純資産(158,608,000千円)の投資信託財産総額(162,390,580千円)に対する比率は、97.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

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

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

＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国株式インデックスＶＡ429, 418, 774円、ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）6, 511, 702円、ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）109, 450, 582円、ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）14, 001, 565円、ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）353, 394, 455円、外国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）22, 667, 766円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）535, 920, 559円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）2, 255, 476, 207円、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）662, 541, 353円、Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス11, 396, 584円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050　6, 026, 400円、iFree 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）2, 011, 620, 301円、iFree 8資産バランス1, 021, 183, 359円、iFree 年金バランス49, 879, 929円、ＤＣダイワ外国株式インデックス33, 018, 813, 032円、ダイワ・ライフ・バランス３０　579, 030, 840円、ダイワ・ライフ・バランス５０　976, 488, 397円、ダイワ・ライフ・バランス７０　722, 361, 053円、大和ＤＣ海外株式インデックスファンド1, 541, 641, 973円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020　2, 282, 168円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030　11, 422, 149円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040　7, 627, 380円、ダイワつみたてインデックス外国株式452, 466, 523円、ダイワつみたてインデックスバランス３０　2, 121, 988円、ダイワつみたてインデックスバランス５０　2, 068, 375円、ダイワつみたてインデックスバランス７０　2, 463, 419円、ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ161, 683, 743円、ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ284, 495, 474円、ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ2, 255, 482, 425円、ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）110, 264, 809円、ダイワバランスファンド2020-07（適格機関投資家専用）271, 255, 135円、ダイワ・インデックスセレクト 外国株式798, 778, 255円、ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド183, 907, 812円、ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）2, 325, 979, 029円、ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス2, 735, 745, 325円、ダイワライフスタイル２５　17, 629, 498円、ダイワライフスタイル５０　63, 519, 419円、ダイワライフスタイル７５　50, 437, 420円です。

＊当期末の計算口数当りの純資産額は30, 015円です。

■損益の状況

当期　自 2019年12月３日　至 2020年11月30日

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

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

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

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

運用報告書（全体版）
第５期
（決算日　2021年６月15日）
（作成対象期間　2020年６月16日～2021年６月15日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

<2730>

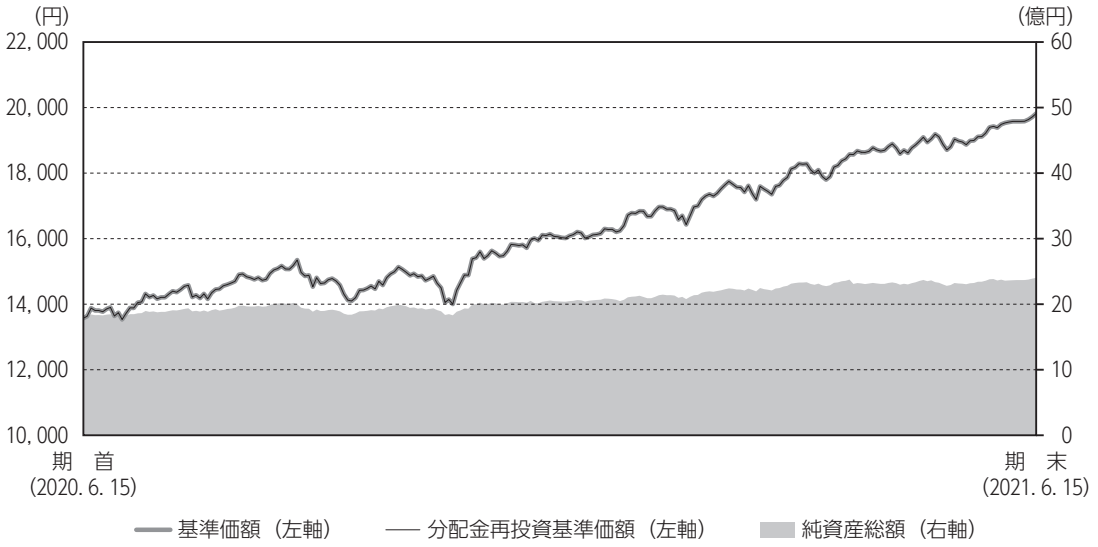
設定以来の運用実績

決算期	基準価額			株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
1期末(2017年6月15日)	12,158	0	21.6	94.7	1.1	3.0	826
2期末(2018年6月15日)	13,778	0	13.3	93.2	1.3	4.3	1,697
3期末(2019年6月17日)	13,793	0	0.1	93.8	1.3	4.0	1,747
4期末(2020年6月15日)	13,573	0	△ 1.6	93.5	0.7	4.8	1,800
5期末(2021年6月15日)	19,822	0	46.0	90.7	5.1	3.4	2,402

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

運用経過

基準価額等の推移について



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

■基準価額・騰落率

期　首：13,573円
期　末：19,822円（分配金0円）
騰落率：46.0%（分配金込み）

■組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国株式インデックスマザーファンド	47.2%	79.3%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	46.7%	19.9%

■基準価額の主な変動要因

海外の株式市場および為替相場の動きを反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年　月　日	基準価額		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率			
	円	%	%	%	%
(期首)2020年6月15日	13,573	—	93.5	0.7	4.8
6月末	13,719	1.1	93.1	1.3	4.8
7月末	14,161	4.3	90.9	4.4	3.9
8月末	15,072	11.0	92.2	4.5	2.6
9月末	14,431	6.3	91.8	5.5	1.9
10月末	14,143	4.2	92.4	4.4	2.4
11月末	15,811	16.5	92.7	4.3	2.5
12月末	16,279	19.9	93.3	3.3	2.6
2021年1月末	16,699	23.0	91.9	4.2	3.1
2月末	17,372	28.0	90.9	4.9	3.3
3月末	18,372	35.4	90.6	6.4	1.9
4月末	19,093	40.7	93.0	3.8	2.4
5月末	19,429	43.1	91.8	4.5	3.0
(期末)2021年6月15日	19,822	46.0	90.7	5.1	3.4

（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

（2020.6.16～2021.6.15）

■先進国株式市況

先進国株式市況は上昇しました。

先進国株式市況は、当作成期首より、米国の新たな経済対策への期待などから上昇しました。2020年9月以降は、米国の景気回復に対して懐疑的な見方が広がったことなどを受け、上値の重い展開となりました。11月以降は、米国大統領選挙の結果に対する不透明感が解消されたことや新型コロナウイルスのワクチンへの開発進展期待を受け、上昇しました。2021年2月以降は、米国において新規感染者数の減少傾向が鮮明となったことに加え、ワクチン接種が着実に進んでいることが投資家心理を改善させ、上昇して当作成期末を迎えました。

■先進国為替相場

先進国為替相場は当作成期を通して見ると円安となりました。

当作成期首より、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（円高）傾向となりました。しかし2020年11月以降は、新型コロナウイルスのワクチン開発に進展があったことで市場のリスク選好姿勢が強まり、円安傾向となりました。2021年に入ると、米国において民主党が大統領府・議会上下両院を制したことから、株価が上昇するなど市場のリスク選好姿勢が強まり、円安となりました。3月には、米国での追加経済対策の成立や、経済指標の改善によって米国金利が上昇したことなどから米ドルが買い進められ、全般的に円安が進行しました。

■新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

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

■新興国為替相場

新興国通貨の為替相場は、対円、対米ドルで上昇しました。

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

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて　（2020. 6. 16 ～ 2021. 6. 15）

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

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

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

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

株式組入比率（ＤＲ（預託証券）、ＥＴＦ（上場投資信託証券）、株価指数先物を含む。以下同じ。）は、FTSE RAFI　エマージング　インデックスのリバランス時や大量設定時を除き、当作成期を通じて原則として98％以上で運用を行いました。

ポートフォリオ構築にあたっては、FTSE RAFI　エマージング　インデックス採用銘柄の組入比率上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、ＤＲ等を組み入れることでベンチマークの動きに連動させるような運用を行いました。

また、効率性の観点からFTSE RAFI　エマージング　インデックスとの連動をめざすＥＴＦにも一部投資し、リバランス時には株価指数先物も利用しました。さらに、新興国株式の実質的な組入比率を引き上げるため、ＭＳＣＩエマージング先物取引をリバランス時以外でも組み入れています。

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

当作成期は、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６月16日 ～2021年６月15日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**―**
対基準価額比率	（％）	―
当期の収益	（円）	―
当期の収益以外	（円）	―
翌期繰越分配対象額	（円）	9,822

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

今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

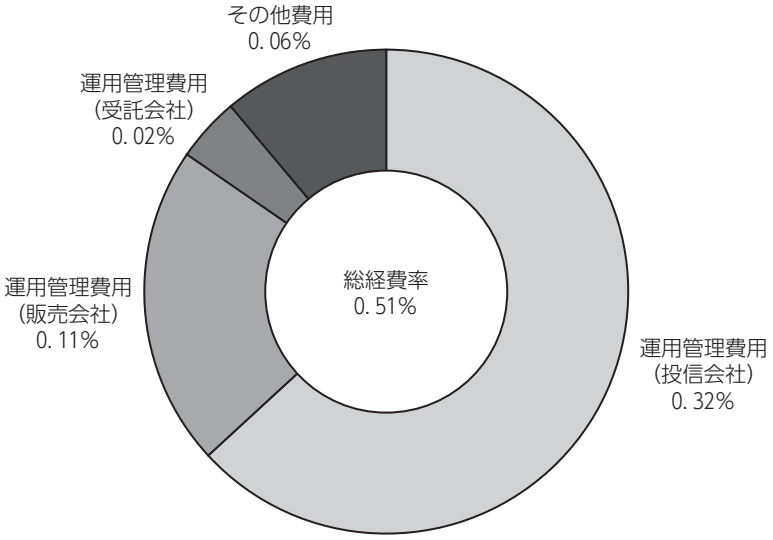
項　目	当　期（2020. 6. 16～2021. 6. 15）金　額	比　率	項　目　の　概　要
信　託　報　酬	75円	0. 456％	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は16, 327円です。**
（投信会社）	(53)	(0. 324)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販売会社）	(18)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(4)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	4	0. 025	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)	
（新株予約権証券）	(0)	(0. 000)	
（先物・オプション）	(0)	(0. 003)	
（投資信託証券）	(1)	(0. 004)	
有価証券取引税	2	0. 015	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）	(2)	(0. 015)	
（新株予約権証券）	(0)	(0. 000)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	9	0. 057	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）	(6)	(0. 038)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ　の　他）	(2)	(0. 014)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	90	0. 553	

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（１口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.51％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６月16日から2021年６月15日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	36,258	56,340	69,220	109,390
外国株式インデックスマザーファンド	61,601	190,160	109,368	349,270

（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６月16日から2021年６月15日まで）

項目	当期
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド
（a）期中の株式売買金額	9,721,323千円
（b）期中の平均組入株式時価総額	10,809,903千円
（c）売買高比率　（a）／（b）	0.89
	外国株式インデックスマザーファンド
（a）期中の株式売買金額	20,298,170千円
（b）期中の平均組入株式時価総額	156,184,871千円
（c）売買高比率　（a）／（b）	0.12

（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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	278,398	245,435	479,090
外国株式インデックスマザーファンド	554,243	506,476	1,904,505

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年６月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	479,090	19.9
外国株式インデックスマザーファンド	1,904,505	79.1
コール・ローン等、その他	24,088	1.0
投資信託財産総額	2,407,684	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、６月15日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝110.11円、１カナダ・ドル＝90.68円、１オーストラリア・ドル＝84.91円、１香港・ドル＝14.19円、１シンガポール・ドル＝82.99円、１ニュージーランド・ドル＝78.64円、１台湾・ドル＝3.987円、１イギリス・ポンド＝155.39円、１イスラエル・シュケル＝33.923円、１スイス・フラン＝122.43円、１トルコ・リラ＝13.009円、１デンマーク・クローネ＝17.95円、１ノルウェー・クローネ＝13.22円、１スウェーデン・クローネ＝13.22円、１メキシコ・ペソ＝5.517円、100チリ・ペソ＝15.327円、１サウジアラビア・リアル＝29.32円、１インド・ルピー＝1.51円、100インドネシア・ルピア＝0.78円、１ブラジル・レアル＝21.747円、１オフショア・人民元＝17.178円、１マレーシア・リンギット＝26.765円、１南アフリカ・ランド＝7.99円、１タイ・バーツ＝3.54円、１ユーロ＝133.45円です。
（注３）ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（16,290,239千円）の投資信託財産総額（16,370,537千円）に対する比率は、99.5％です。
外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（211,600,767千円）の投資信託財産総額（219,797,553千円）に対する比率は、96.3％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年６月15日現在

項　　目	当　期　末
（A）資産	**2, 407, 684, 258円**
コール・ローン等	24, 088, 606
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド（評価額）	479, 090, 265
外国株式インデックスマザーファンド（評価額）	1, 904, 505, 387
（B）負債	**5, 165, 835**
未払信託報酬	5, 104, 425
その他未払費用	61, 410
（C）純資産総額（A－B）	**2, 402, 518, 423**
元本	1, 212, 032, 415
次期繰越損益金	1, 190, 486, 008
（D）受益権総口数	**1, 212, 032, 415口**
１万口当り基準価額（C／D）	**19, 822円**

＊期首における元本額は1, 326, 765, 507円、当作成期間中における追加設定元本額は193, 724, 602円、同解約元本額は308, 457, 694円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は19, 822円です。

■損益の状況

当期　自 2020年６月16日　至 2021年６月15日

項　　目	当　　期
（A）配当等収益	△ **4, 892円**
受取利息	799
支払利息	△ 5, 691
（B）有価証券売買損益	**718, 031, 513**
売買益	804, 130, 026
売買損	△ 86, 098, 513
（C）信託報酬等	△ **9, 637, 158**
（D）当期損益金（A＋B＋C）	**708, 389, 463**
（E）前期繰越損益金	**47, 587, 748**
（F）追加信託差損益金	**434, 508, 797**
（配当等相当額）	(130, 258, 818)
（売買損益相当額）	(304, 249, 979)
（G）合計（D＋E＋F）	**1, 190, 486, 008**
次期繰越損益金（G）	**1, 190, 486, 008**
追加信託差損益金	434, 508, 797
（配当等相当額）	(130, 258, 818)
（売買損益相当額）	(304, 249, 979)
分配準備積立金	755, 982, 103
繰越損益金	△ 4, 892

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項　　目	当　　期
（a）経費控除後の配当等収益	0円
（b）経費控除後の有価証券売買等損益	678, 071, 762
（c）収益調整金	434, 508, 797
（d）分配準備積立金	77, 910, 341
（e）当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	1, 190, 490, 900
（f）分配金	0
（g）翌期繰越分配対象額（e－f）	1, 190, 490, 900
（h）受益権総口数	1, 212, 032, 415口

★「外国株式インデックスマザーファンド」の第21期にかかる運用状況については105～127ページをご参照ください。

＜補足情報＞
当ファンド（ダイワファンドラップ　外国株式インデックス　エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「外国株式インデックスマザーファンド」の決算日（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６月15日）現在における外国株式インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。86～104ページをご参照ください。

＜補足情報＞
当ファンド（ダイワファンドラップ　外国株式インデックス　エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の決算日（2020年７月６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６月15日）現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

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

(1)株　　式

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ALIBABA GROUP HOLDING LTD（ケイマン諸島）	95. 1	313, 294	3, 294	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC（台湾）	155	354, 624	2, 287
HON HAI PRECISION INDUSTRY（台湾）	549	241, 857	440	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR（ケイマン諸島）	8. 5	225, 640	26, 545
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC（台湾）	103	175, 474	1, 703	CHINA MOBILE LTD（香港）	282	177, 806	630
IND & COMM BK OF CHINA-H（中国）	2, 407	170, 280	70	BAIDU INC - SPON ADR（ケイマン諸島）	3	85, 509	28, 503
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF（ブラジル）	302. 4	160, 751	531	VALE SA（ブラジル）	46	83, 384	1, 812
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR（ブラジル）	313. 8	143, 431	457	CNOOC LTD（香港）	773	81, 115	104
CHINA CONSTRUCTION BANK-H（中国）	1, 635	131, 283	80	MEDIATEK INC（台湾）	22	75, 353	3, 425
PING AN INSURANCE GROUP CO-H（中国）	102. 5	130, 526	1, 273	UNITED MICROELECTRONICS CORP（台湾）	410	73, 223	178
PETROBRAS - PETROLEO BRAS（ブラジル）	285. 2	129, 148	452	CHINA CONSTRUCTION BANK-H（中国）	738	67, 886	91
BANCO BRADESCO SA-PREF（ブラジル）	239. 2	119, 232	498	BANK OF CHINA LTD-H（中国）	1, 371	56, 132	40

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

(2)投資信託証券

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M（アメリカ）	986. 2	2, 279, 940	2, 311	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M（アメリカ）	1, 086	2, 358, 154	2, 171
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA（メキシコ）	20. 2	1, 630	80	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA（メキシコ）	100. 4	12, 867	128
				GROWTHPOINT PROPERTIES LTD（南アフリカ）	76. 93	7, 549	98

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2021年６月15日現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド（8, 358, 825千口）の内容です。

(1)外国株式

銘柄	2021年６月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
JOYY INC-ADR	10	74	8, 163	コミュニケーション・サービス
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	52	50	5, 582	一般消費財・サービス
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	290	185	20, 433	エネルギー
BAIDU INC - SPON ADR	28	531	58, 526	コミュニケーション・サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	56	123	13, 547	一般消費財・サービス
CANADIAN SOLAR INC	23	92	10, 193	情報技術
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	34	107	11, 804	資本財・サービス
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	353. 5	336	37, 055	コミュニケーション・サービス
JD. COM INC-ADR	78	557	61, 348	一般消費財・サービス
NETEASE INC-ADR	30	342	37, 710	コミュニケーション・サービス
TRIP. COM GROUP LTD-ADR	93	345	38, 083	一般消費財・サービス
VTB BANK JSC -GDR-REG S	1, 912. 17	269	29, 645	金融
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	72. 9	274	30, 213	素材
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	96. 08	427	47, 046	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	360. 75	183	20, 258	エネルギー
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	169. 93	618	68, 126	素材
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	206. 94	316	34, 828	生活必需品
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	1, 569. 77	2, 728	300, 408	金融
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	24. 98	544	59, 906	エネルギー
LUKOIL PJSC-SPON ADR	202. 88	1, 829	201, 409	エネルギー
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	912. 99	677	74, 552	エネルギー
GAZPROM PJSC-SPON ADR	3, 923. 39	3, 022	332, 816	エネルギー
SEVERSTAL - GDR REG S	134. 6	319	35, 154	素材
TATNEFT PJSC - PREF	155. 09	109	12, 025	エネルギー
SISTEMA PJSFC	3, 192	145	15, 972	コミュニケーション・サービス
INTER RAO UES PJSC	27, 261	189	20, 902	公益事業

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
ALROSA PJSC		1,803.1	348	38,382	素材
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ		566.19	137	15,162	金融
AEROFLOT PJSC		1,649.1	165	18,211	資本財・サービス
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	45,261.36	15,052	1,657,472	
	銘柄数<比率>	29銘柄		<10.2%>	
		百株	千香港・ドル	千円	
(香港)					
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H		4,600	1,863	26,435	資本財・サービス
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING		620	727	10,328	資本財・サービス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT		780	1,719	24,405	一般消費財・サービス
JIANGXI COPPER CO LTD-H		510	862	12,244	素材
CHINA GAS HOLDINGS LTD		492	1,456	20,665	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H		20,798	8,797	124,837	エネルギー
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H		2,460	1,862	26,424	一般消費財・サービス
GOME RETAIL HOLDINGS LTD		3,540	442	6,279	一般消費財・サービス
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS		290	987	14,011	資本財・サービス
FOSUN INTERNATIONAL LTD		715	845	11,992	資本財・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD		215	12,814	181,830	コミュニケーション・サービス
AIR CHINA LTD-H		1,100	672	9,537	資本財・サービス
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD		605	1,294	18,371	不動産
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP		2,580	748	10,616	不動産
PETROCHINA CO LTD-H		20,520	7,325	103,950	エネルギー
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS		155	977	13,867	一般消費財・サービス
HUANENG POWER INTL INC-H		6,120	1,780	25,271	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H		355	1,524	21,635	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H		1,050	1,320	18,743	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H		47,080	29,472	418,208	金融
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD		1,242	1,694	24,039	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H		7,040	2,928	41,557	金融
GF SECURITIES CO LTD-H		500	525	7,449	金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H		484	550	7,815	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD		275	1,454	20,642	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H		4,750	2,560	36,329	金融
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H		760	395	5,607	資本財・サービス
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H		2,450	4,326	61,395	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT		1,091.2	1,359	19,293	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H		1,028	2,672	37,927	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD		1,100	4,004	56,816	不動産
YANZHOU COAL MINING CO-H		1,820	2,122	30,112	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL		1,285	1,066	15,134	ヘルスケア
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT		220	1,112	15,780	公益事業
BYD CO LTD-H		50	1,072	15,211	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H		25,230	7,089	100,601	金融
CHINA RESOURCES CEMENT		820	644	9,145	素材
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H		254	286	4,058	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H		358	991	14,071	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H		3,900	1,119	15,882	金融
CITIC LTD		2,150	1,889	26,816	資本財・サービス
CHINA HONGQIAO GROUP LTD		1,165	1,328	18,845	素材
IND & COMM BK OF CHINA-H		54,900	27,669	392,631	金融
CHINA TOWER CORP LTD-H		16,760	1,793	25,447	コミュニケーション・サービス
MEITUAN-CLASS B		52	1,597	22,667	一般消費財・サービス
SEAZEN GROUP LTD		1,240	961	13,636	不動産
ALIBABA GROUP HOLDING LTD		951	19,514	276,911	一般消費財・サービス
GUANGDONG INVESTMENT LTD		860	992	14,082	公益事業
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H		2,150	402	5,705	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-H		250	750	10,642	一般消費財・サービス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST		3,180	6,277	89,075	不動産
CGN POWER CO LTD-H		4,570	786	11,153	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H		1,940	15,694	222,706	金融
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD		1,040	3,026	42,944	不動産
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H		585	1,120	15,905	資本財・サービス
CHINA MINSHENG BANKING COR-H		7,335.8	2,978	42,262	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO		2,440	2,339	33,204	不動産
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD		60	950	13,486	一般消費財・サービス
CHINA VANKE CO LTD-H		899	2,278	32,338	不動産
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H		2,900	585	8,312	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H		960	675	9,590	一般消費財・サービス
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP		64	1,226	17,400	一般消費財・サービス
CHINA MENGNIU DAIRY CO		330	1,491	21,165	生活必需品
PICC PROPERTY & CASUALTY-H		3,600	2,689	38,159	金融
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H		415	1,016	14,427	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H		560	953	13,524	資本財・サービス
SUNNY OPTICAL TECH		37	708	10,049	情報技術
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H		2,920	1,314	18,645	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H		882	2,240	31,789	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H		606	1,052	14,928	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-H		1,950	3,065	43,498	金融
ENN ENERGY HOLDINGS LTD		132	1,948	27,646	公益事業
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS		660	726	10,301	素材
KUNLUN ENERGY CO LTD		2,020	1,401	19,892	公益事業

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千香港・ドル	千円	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H		620	713	10, 117	素材
CHINA STATE CONSTRUCTION INT		1, 280	762	10, 825	資本財・サービス
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H		2, 680	2, 653	37, 648	素材
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H		8, 521	4, 447	63, 116	金融
CHINA EVERGRANDE GROUP		1, 420	1, 593	22, 608	不動産
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H		1, 980	647	9, 187	金融
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD		3, 800	752	10, 676	情報技術
CHINA MERCHANTS BANK-H		1, 010	6, 908	98, 030	金融
BANK OF CHINA LTD-H		33, 500	9, 480	134, 528	金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H		440	893	12, 674	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H		2, 400	775	11, 000	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-H		1, 272	900	12, 779	金融
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE		940	686	9, 737	一般消費財・サービス
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD		580	2, 673	37, 941	不動産
香港・ドル通貨計	株数、金額	350, 249	262, 804	3, 729, 202	
	銘柄数<比率>	88 銘柄		<22. 9%>	
		百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)					
YANGZIJIANG SHIPBUILDING		1, 427	208	17, 290	資本財・サービス
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額	1, 427	208	17, 290	
	銘柄数<比率>	1 銘柄		<0. 1%>	
		百株	千台湾・ドル	千円	
(台湾)					
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO		220	3, 674	14, 650	情報技術
TAIWAN CEMENT		1, 481. 45	7, 614	30, 364	素材
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT		1, 160	13, 746	54, 814	情報技術
WALSIN TECHNOLOGY CORP		90	1, 863	7, 429	情報技術
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO		881. 12	6, 485	25, 860	生活必需品
FORMOSA PLASTICS CORP		806	8, 342	33, 265	素材
NAN YA PLASTICS CORP		621. 4	5, 288	21, 087	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE		593. 9	5, 095	20, 319	素材
CHINA STEEL CORP		3, 206. 86	11, 592	46, 228	素材
LITE-ON TECHNOLOGY CORP		676. 16	4, 428	17, 660	情報技術
DELTA ELECTRONICS INC		340	10, 081	40, 200	情報技術
YAGEO CORPORATION		80	3, 952	15, 759	情報技術
WINBOND ELECTRONICS CORP		750	2, 565	10, 228	情報技術
ACER INC		1, 730	5, 414	21, 592	情報技術
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD		670	4, 348	17, 339	情報技術
QUANTA COMPUTER INC		720	6, 192	24, 691	情報技術
AU OPTRONICS CORP		6, 680	15, 397	61, 400	情報技術
CHUNGHWA TELECOM CO LTD		834	9, 549	38, 079	コミュニケーション・サービス
MEDIATEK INC		160. 03	15, 682	62, 538	情報技術
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD		360	6, 462	25, 768	情報技術
EVA AIRWAYS CORP		1, 690	3, 413	13, 613	資本財・サービス
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD		1, 180	2, 885	11, 504	金融
FUBON FINANCIAL HOLDING CO		1, 884. 11	13, 904	55, 447	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO		1, 968. 38	10, 727	42, 778	金融
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL		4, 120	5, 150	20, 536	金融
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO		2, 065. 05	5, 327	21, 245	金融
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO		2, 553. 81	6, 512	25, 968	金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT		1, 769. 93	5, 823	23, 220	金融
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING		4, 243. 34	4, 069	16, 227	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT		2, 470. 28	5, 558	22, 164	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO		1, 467. 47	3, 257	12, 991	金融
LARGAN PRECISION CO LTD		20	6, 120	24, 404	情報技術
NOVATEK MICROELECTRONICS COR		80	4, 048	16, 142	情報技術
TAIWAN MOBILE CO LTD		340	3, 519	14, 032	コミュニケーション・サービス
WISTRON CORP		1, 331. 1	4, 013	16, 003	情報技術
INNOLUX CORP		6, 600	14, 091	56, 190	情報技術
PEGATRON CORP		1, 680	12, 146	48, 436	情報技術
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING		240	2, 436	9, 714	情報技術
CHAILEASE HOLDING CO LTD		264. 71	5, 479	21, 850	金融
POWERTECH TECHNOLOGY INC		324	3, 499	13, 953	情報技術
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP		360	3, 888	15, 504	エネルギー
COMPAL ELECTRONICS		1, 850	4, 190	16, 709	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC		2, 140	128, 828	513, 727	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY		9, 169. 02	104, 068	414, 993	情報技術
PRESIDENT CHAIN STORE CORP		130	3, 438	13, 711	生活必需品
ASUSTEK COMPUTER INC		317. 6	12, 164	48, 506	情報技術
UNITED MICROELECTRONICS CORP		2, 060	10, 670	42, 551	情報技術
台湾・ドル通貨計	株数、金額	74, 379. 72	537, 005	2, 141, 415	
	銘柄数<比率>	47 銘柄		<13. 1%>	
		百株	千トルコ・リラ	千円	
(トルコ)					
IS YATIRIM MENKUL DEGERLER A		324. 96	492	6, 404	金融
TURKIYE GARANTI BANKASI		2, 418. 41	2, 021	26, 302	金融
AKBANK T. A. S.		3, 342. 74	1, 831	23, 830	金融
TURKIYE IS BANKASI-C		2, 498. 56	1, 326	17, 260	金融
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		877. 6	1, 452	18, 895	コミュニケーション・サービス
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE		199. 9	2, 078	27, 046	エネルギー
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK		842. 22	1, 636	21, 289	素材

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千トルコ・リラ	千円	
HACI OMER SABANCI HOLDING		1,279.23	1,212	15,776	金融
TURKIYE HALK BANKASI		1,108.22	559	7,280	金融
YAPI VE KREDI BANKASI		2,377.87	535	6,960	金融
KOC HOLDING AS		807.81	1,551	20,188	資本財・サービス
TURK HAVA YOLLARI AO		1,294.89	1,893	24,628	資本財・サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		123.96	798	10,385	生活必需品
トルコ・リラ通貨計	株数、金額	17,496.37	17,391	226,247	
	銘柄数<比率>	13銘柄		<1.4%>	
		百株	千メキシコ・ペソ	千円	
(メキシコ)					
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B		88	2,000	11,036	資本財・サービス
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L		8,965	14,460	79,787	コミュニケーション・サービス
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO		758	4,301	23,734	コミュニケーション・サービス
CEMEX SAB-CPO		8,967.19	14,437	79,658	素材
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD		756	12,953	71,471	生活必需品
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B		574	5,334	29,431	素材
WALMART DE MEXICO SAB DE CV		1,593	10,341	57,061	生活必需品
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O		653	8,532	47,080	金融
メキシコ・ペソ通貨計	株数、金額	22,354.19	72,361	399,261	
	銘柄数<比率>	8銘柄		<2.4%>	
		百株	千チリ・ペソ	千円	
(チリ)					
CENCOSUD SA		461.15	68,250	10,461	生活必需品
BANCO SANTANDER CHILE		28,986.96	111,947	17,158	金融
ENEL AMERICAS SA		12,217.63	120,221	18,426	公益事業
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		14.72	49,861	7,642	素材
FALABELLA SA		215.93	68,816	10,547	一般消費財・サービス
BANCO DE CHILE		10,345.39	76,369	11,705	金融
チリ・ペソ通貨計	株数、金額	52,241.78	495,466	75,942	
	銘柄数<比率>	6銘柄		<0.5%>	
		百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
(サウジアラビア)					
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP		131.73	1,641	48,124	素材
SAUDI TELECOM CO		54.52	746	21,899	コミュニケーション・サービス
AL RAJHI BANK		241.62	2,730	80,052	金融
ETIHAD ETISALAT CO		176.9	589	17,271	コミュニケーション・サービス
ALINMA BANK		329.25	667	19,577	金融
THE SAUDI NATIONAL BANK		118.42	641	18,818	金融
SAUDI ARABIAN OIL CO		280.37	989	29,018	エネルギー
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO		285.25	494	14,485	素材
SAUDI ELECTRICITY CO		366.17	897	26,324	公益事業
サウジアラビア・リアル通貨計	株数、金額	1,984.23	9,398	275,573	
	銘柄数<比率>	9銘柄		<1.7%>	
		百株	千インド・ルピー	千円	
(インド)					
RELIANCE INDUSTRIES-PARTLY P		25.19	4,065	6,138	エネルギー
TATA STEEL LTD		348.72	40,618	61,334	素材
AXIS BANK LTD		431.9	31,798	48,015	金融
MARUTI SUZUKI INDIA LTD		19.5	13,996	21,135	一般消費財・サービス
TATA POWER CO LTD		794.37	9,802	14,801	公益事業
BANK OF BARODA		736.29	6,254	9,444	金融
HINDUSTAN UNILEVER LTD		52.23	12,350	18,648	生活必需品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP		664.96	19,842	29,962	エネルギー
STATE BANK OF INDIA		782.7	33,683	50,862	金融
NTPC LTD		2,405.22	28,429	42,928	公益事業
JSW STEEL LTD		317.64	23,160	34,972	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD		650.99	16,190	24,447	公益事業
INDIAN OIL CORP LTD		2,304.71	26,446	39,934	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD		686.05	33,184	50,108	エネルギー
JINDAL STEEL & POWER LTD		220.88	9,389	14,178	素材
ULTRATECH CEMENT LTD		10.97	7,326	11,062	素材
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE		53.46	7,896	11,923	金融
TECH MAHINDRA LTD		92.74	9,916	14,973	情報技術
YES BANK LTD		176.4	248	375	金融
TATA MOTORS LTD-A-DVR		282.02	4,678	7,064	一般消費財・サービス
REC LTD		530.6	8,404	12,691	金融
COAL INDIA LTD		1,440.5	22,954	34,661	エネルギー
INDIABULLS HOUSING FINANCE L		622.66	18,586	28,065	金融
GAIL INDIA LTD		691.94	11,289	17,046	公益事業
HINDALCO INDUSTRIES LTD		640.18	25,274	38,164	素材
GRASIM INDUSTRIES LTD		136.2	20,334	30,705	素材
WIPRO LTD		160.49	9,013	13,609	情報技術
TATA CONSULTANCY SVCS LTD		108.98	35,705	53,915	情報技術
INFOSYS LTD		487.24	71,224	107,549	情報技術
LARSEN & TOUBRO LTD		135.49	20,536	31,010	資本財・サービス
TATA MOTORS LTD		1,103.73	39,287	59,323	一般消費財・サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE		218.9	55,583	83,930	金融
ICICI BANK LTD		222.99	14,163	21,386	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD		526.81	118,263	178,578	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD		2,380.25	29,705	44,855	エネルギー
ITC LTD		804.34	16,673	25,177	生活必需品

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千インド・ルピー	千円	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD		234.85	18,962	28,634	一般消費財・サービス
HERO MOTOCORP LTD		29.67	8,858	13,376	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD		290.16	15,649	23,631	コミュニケーション・サービス
UPL LTD		137.76	11,497	17,361	素材
SUN PHARMACEUTICAL INDUS		147.6	9,993	15,090	ヘルスケア
HCL TECHNOLOGIES LTD		162.74	16,016	24,185	情報技術
VEDANTA LTD		1,329.16	36,405	54,972	素材
インド・ルピー通貨計	株数、金額	23,600.18	973,665	1,470,235	
	銘柄数<比率>	43銘柄		<9.0%>	
		百株	千インドネシア・ルピア	千円	
(インドネシア)					
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT		4,933	2,552,827	19,912	一般消費財・サービス
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK		1,013	828,127	6,459	素材
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK		18,061	6,158,801	48,038	コミュニケーション・サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER		4,250	2,358,750	18,398	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT		1,194	3,826,770	29,848	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT		5,474	3,434,935	26,792	金融
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT		8,570	998,405	7,787	公益事業
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER		13,452	5,851,620	45,642	金融
ADARO ENERGY TBK PT		12,895	1,708,587	13,326	エネルギー
インドネシア・ルピア通貨計	株数、金額	69,842	27,718,823	216,206	
	銘柄数<比率>	9銘柄		<1.3%>	
		百株	千ブラジル・レアル	千円	
(ブラジル)					
CIA PARANAENSE DE ENERGIA		164	100	2,182	公益事業
ENERGISA SA-UNITS		106	520	11,325	公益事業
RUMO SA		285	591	12,860	資本財・サービス
IRB BRASIL RESSEGUROS SA		1,765	1,074	23,375	金融
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT		46	544	11,850	金融
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA		755	2,012	43,756	一般消費財・サービス
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC		108	422	9,180	生活必需品
TIM SA		485.26	633	13,782	コミュニケーション・サービス
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR		4,438	12,759	277,475	エネルギー
BANCO BRADESCO SA-PREF		4,212.18	11,760	255,753	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF		4,857.36	15,854	344,786	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA		185	834	18,152	素材
VALE SA		948.9	10,790	234,669	素材
GERDAU SA-PREF		570	1,829	39,790	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS		3,673	10,747	233,719	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF		1,074.87	1,470	31,977	公益事業
ITAUSA SA		1,361	1,604	34,895	金融
BRASKEM SA-PREF A		261	1,470	31,984	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B		222	989	21,508	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.		1,543	5,496	119,525	金融
COSAN SA		644	1,635	35,572	エネルギー
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER		372	1,685	36,663	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB		792	506	11,023	公益事業
EMBRAER SA		712	1,500	32,624	資本財・サービス
METALURGICA GERDAU SA-PREF		949	1,371	29,821	素材
CCR SA		886	1,237	26,917	資本財・サービス
BRF SA		571	1,670	36,333	生活必需品
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP		260	1,022	22,243	公益事業
LOJAS RENNER S. A.		197.05	944	20,539	一般消費財・サービス
LOJAS AMERICANAS SA-PREF		147.84	335	7,288	一般消費財・サービス
JBS SA		965	2,846	61,908	生活必需品
SUZANO SA		122.45	715	15,567	素材
MARFRIG GLOBAL FOODS SA		379	722	15,709	生活必需品
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO		906	1,478	32,154	金融
CIELO SA		2,442.28	979	21,298	情報技術
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD		370	939	20,429	公益事業
SUL AMERICA SA - UNITS		188.18	634	13,791	金融
CIA ENERGETICA DE MINAS GER		186.54	315	6,872	公益事業
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT		332	1,494	32,511	金融
RAIA DROGASIL SA		235	637	13,864	生活必需品
TELEFONICA BRASIL S. A.		369	1,704	37,073	コミュニケーション・サービス
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA		732	1,477	32,124	エネルギー
ITAU UNIBANCO HOLDING SA		516	1,487	32,351	金融
LOJAS AMERICANAS SA		46.93	100	2,189	一般消費財・サービス
COGNA EDUCACAO		2,643	1,255	27,301	一般消費財・サービス
BANCO BRADESCO S. A.		1,267.65	3,023	65,748	金融
AMBEV SA		1,872	3,646	79,303	生活必需品
ブラジル・レアル通貨計	株数、金額	46,164.49	116,879	2,541,779	
	銘柄数<比率>	47銘柄		<15.6%>	
		百株	千オフショア・人民元	千円	
(中国)					
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A		737	1,588	27,296	金融
BANK OF BEIJING CO LTD -A		1,495	741	12,738	金融
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A		175	294	5,050	金融
PING AN INSURANCE GROUP CO-A		249	1,728	29,685	金融
IND & COMM BK OF CHINA-A		3,796	1,970	33,844	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A		93	199	3,423	ヘルスケア

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千オフショア・人民元	千円	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A		94	313	5,377	金融
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A		29	128	2,206	一般消費財・サービス
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A		3	653	11,228	生活必需品
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A		80	384	6,608	素材
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A		500	653	11,226	不動産
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A		1,733	1,762	30,276	金融
CITIC SECURITIES CO-A		148	369	6,340	金融
CHINA MERCHANTS BANK-A		388	2,185	37,545	金融
PING AN BANK CO LTD-A		464	1,084	18,628	金融
GF SECURITIES CO LTD-A		134	205	3,535	金融
CHINA STATE CONSTRUCTION -A		3,940	1,938	33,300	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-A		101	281	4,830	一般消費財・サービス
SAIC MOTOR CORP LTD-A		630	1,254	21,547	一般消費財・サービス
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A		337	130	2,234	素材
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A		421	263	4,534	資本財・サービス
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A		289	123	2,129	金融
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A		132	341	5,868	資本財・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A		903	272	4,684	資本財・サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A		704	383	6,591	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-A		68	167	2,874	素材
YANZHOU COAL MINING CO-A		81	120	2,077	エネルギー
CHINA CONSTRUCTION BANK-A		306	206	3,553	金融
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A		8,046	2,671	45,888	金融
BANK OF CHINA LTD-A		2,581	794	13,656	金融
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A		2,089	973	16,723	エネルギー
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A		3,315	1,617	27,790	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A		398	819	14,070	エネルギー
CHINA VANKE CO LTD -A		344	869	14,945	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A		153	497	8,544	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A		487	255	4,383	金融
CHINA MINSHENG BANKING-A		3,033	1,416	24,332	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A		2,530	968	16,645	金融
CGN POWER CO LTD-A		189	51	886	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-A		154	246	4,240	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A		229	272	4,689	金融
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A		1,850	984	16,907	資本財・サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A		915	733	12,606	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A		52	248	4,276	金融
HUAXIA BANK CO LTD-A		1,174	740	12,725	金融
AIR CHINA LTD-A		207	173	2,972	資本財・サービス
BYD CO LTD -A		7	158	2,729	一般消費財・サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A		71	85	1,467	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-A		98	168	2,895	資本財・サービス
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A		130	143	2,456	素材
HUANENG POWER INTL INC-A		665	276	4,752	公益事業
オフショア・人民元通貨計	株数、金額	46,747	34,917	599,830	
	銘柄数<比率>	51銘柄		<3.7%>	
		百株	千マレーシア・リンギット	千円	
(マレーシア)					
MALAYAN BANKING BHD		583	477	12,780	金融
GENTING BHD		878	453	12,126	一般消費財・サービス
PUBLIC BANK BERHAD		2,617	1,106	29,629	金融
CIMB GROUP HOLDINGS BHD		1,360	624	16,708	金融
TENAGA NASIONAL BHD		497	499	13,382	公益事業
マレーシア・リンギット通貨計	株数、金額	5,935	3,161	84,626	
	銘柄数<比率>	5銘柄		<0.5%>	
		百株	千南アフリカ・ランド	千円	
(南アフリカ)					
GOLD FIELDS LTD		241.42	3,482	27,826	素材
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD		15.03	2,519	20,133	金融
NEPI ROCKCASTLE PLC		151.07	1,476	11,798	不動産
MULTICHOICE GROUP LTD		118.08	1,488	11,895	コミュニケーション・サービス
OLD MUTUAL LTD		1,295.77	1,833	14,649	金融
VODACOM GROUP LTD		141.5	1,906	15,230	コミュニケーション・サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD		157.17	2,473	19,761	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD		139.46	2,439	19,489	金融
BIDVEST GROUP LTD		90.87	1,814	14,500	資本財・サービス
BID CORP LTD		68.49	2,072	16,560	生活必需品
STANDARD BANK GROUP LTD		320.36	4,399	35,154	金融
SASOL LTD		273.1	6,554	52,369	素材
DISCOVERY LTD		130.47	1,795	14,346	金融
SANLAM LTD		530.72	3,440	27,490	金融
FIRSTRAND LTD		1,215.28	6,907	55,192	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD		278.95	1,584	12,661	一般消費財・サービス
ABSA GROUP LTD		255.81	3,767	30,104	金融
NASPERS LTD-N SHS		26.73	7,992	63,858	一般消費財・サービス
MTN GROUP LTD		433.66	4,674	37,348	コミュニケーション・サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD		64.45	1,560	12,469	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT		119.7	1,973	15,769	ヘルスケア
ANGLOGOLD ASHANTI LTD		122.25	3,552	28,383	素材
MR PRICE GROUP LTD		79.44	1,759	14,062	一般消費財・サービス

銘柄		2021年6月15日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千南アフリカ・ランド	千円	
SIBANYE STILLWATER LTD		344.77	2,171	17,349	素材
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額	6,614.55	73,642	588,407	
	銘柄数<比率>	24銘柄		<3.6%>	
		百株	千タイ・バーツ	千円	
(タイ)					
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG		271	3,319	11,751	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR		458	19,510	69,068	素材
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN		385	4,985	17,649	金融
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR		1,139	3,730	13,204	一般消費財・サービス
KASIKORNBANK PCL-NVDR		169	2,197	7,777	金融
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR		1,641	17,312	61,286	金融
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR		31,683	3,738	13,234	金融
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR		917	3,874	13,715	素材
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR		412	7,189	25,450	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR		6,418	7,252	25,673	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR		3,723	5,770	20,428	エネルギー
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR		1,520	3,480	12,322	ヘルスケア
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR		670	8,040	28,461	エネルギー
IRPC PCL - NVDR		11,202	4,525	16,020	エネルギー
BANGCHAK CORP PCL-NVDR		1,048	2,751	9,738	エネルギー
PTT PCL-NVDR		10,368	43,027	152,316	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR		961	5,501	19,476	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR		1,447	9,079	32,142	生活必需品
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR		539	3,624	12,831	資本財・サービス
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR		187	2,300	8,142	金融
LAND & HOUSES PUB - NVDR		3,271	2,763	9,784	不動産
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR		2,294	6,251	22,129	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR		1,404	8,494	30,069	素材
タイ・バーツ通貨計	株数、金額	82,127	178,721	632,675	
	銘柄数<比率>	23銘柄		<3.9%>	
ファンド合計	株数、金額	846,423.87	—	14,656,168	
	銘柄数<比率>	403銘柄		<89.8%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2021年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄		2021年6月15日現在 口数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額
		千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M		487.2	11,829	1,302,514
合計	口数、金額	487.2	11,829	1,302,514
	銘柄数<比率>	1銘柄		<8.0%>

(注1) 邦貨換算金額は、2021年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別		2021年6月15日現在 買建額	売建額
		百万円	百万円
外国	MSCI EMGMKT（アメリカ）	350	—

(注1) 外貨建の評価額は、2021年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) 単位未満は切捨て。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

運用報告書　第10期　（決算日　2020年７月６日）

（作成対象期間　2019年７月６日～2020年７月６日）

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

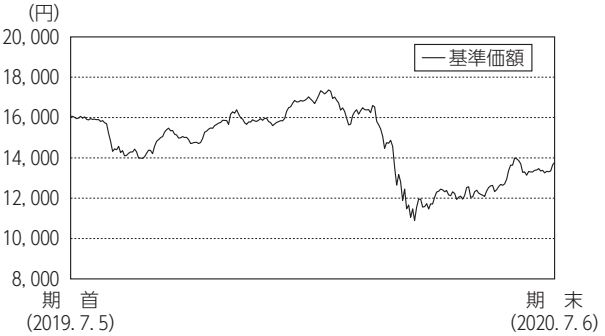
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
	円	%		%	%	%	%
(期首)2019年７月５日	16,061	—	18,098	—	87.4	1.3	10.7
７月末	15,746	△ 2.0	17,767	△ 1.8	85.5	1.4	12.7
８月末	14,232	△11.4	16,043	△11.4	97.2	1.5	1.0
９月末	15,011	△ 6.5	16,961	△ 6.3	95.3	1.1	3.4
10月末	15,854	△ 1.3	17,884	△ 1.2	93.5	1.0	5.3
11月末	15,963	△ 0.6	18,021	△ 0.4	92.4	1.1	6.3
12月末	17,024	6.0	19,247	6.3	90.9	1.4	7.2
2020年１月末	15,966	△ 0.6	18,019	△ 0.4	89.0	1.4	9.3
２月末	15,067	△ 6.2	17,092	△ 5.6	86.8	2.2	10.9
３月末	11,586	△27.9	13,113	△27.5	90.0	7.5	1.7
４月末	12,533	△22.0	14,146	△21.8	90.8	1.9	7.1
５月末	12,638	△21.3	14,332	△20.8	87.2	1.2	11.2
６月末	13,331	△17.0	15,103	△16.5	84.3	1.3	13.8
(期末)2020年７月６日	13,774	△14.2	15,645	△13.6	82.7	3.0	13.8

（注１）騰落率は期首比。
（注２）FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）は、FTSE International Limited の承諾を得て、FTSE RAFI エマージング インデックス（配当込み、米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE International Limited と Research Affiliates LLC に帰属します。また、FTSE International Limited は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
（注３）海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
（注４）指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
（注５）株式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：16,061円　期末：13,774円　騰落率：△14.2%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク（FTSE RAFI　エマージング　インデックス（円換算））への連動をめざした運用を行いました。新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を背景に新興国株式市況は下落し、基準価額も下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○新興国株式市況

新興国株式市況は下落しました。

新興国株式市況は、2019年７月下旬から、トランプ米国大統領が対中国でさらなる追加関税を決定するなど、米中貿易摩擦の激化と長期化が懸念材料となったことで、広く売られました。９月に入ると、米中次官級貿易協議等の動きを受けて米中通商協議の部分合意期待が高まったことや、ＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）の利下げが好感されて買われました。しかし2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大を嫌気したリスク回避の動きが広がり、新興国株式市況は上値が重い展開となりました。２月下旬から３月中旬にかけても、新型コロナウイルスの感染が欧米を中心に世界的に広がり各国で外出制限などが行われた結果、世界的な需要の減少が懸念されたことで急落しました。その後は、ＦＲＢなどの金融政策や各国政府の経済対策に対する期待が高まり、新興国株式市況は上昇に転じました。当作成期末にかけても、世界的に外出制限が緩和方向に進んだことで、経済的にも政治的にも安心感が広がったため、堅調に推移しました。

国別では、インドネシア株式市場は、ＥＵ（欧州連合）との包括的経済連携協定締結交渉が難航したことや、新型コロナウイルスによる景気悪化懸念が根強く軟調でした。米国の特恵関税制度の適用が一部廃止されたことや、観光への悪影響が続くタイ株式市場も下落しました。政府が新型コロナウイルス対策より経済政策を優先させようとしたブラジル株式市場も売られました。一方、中国株式市場は、金融緩和と政府の財政支出拡大に対する期待が高まったことから堅調でした。台湾株式市場も、ハイテク株がけん引する形となりました。

○為替相場

新興国為替相場は円高が進みました。

新興国為替相場は、当作成期首より、株価が上昇する局面で新興国通貨は対米ドルで上昇基調となりました。2020年２月以降、新型コロナウイルスの感染拡大とその後の世界的な景気悪化懸念によるリスク回避の動きを受けて新興国からの資金流出が進み、新興国通貨全体としては対米ドルで下落しました。通貨別では、原油価格の急落や新型コロナウイルス対策に関する政治的な混乱が悪材料となったブラジル・レアルは急落しました。経済政策に対する不信感が根強いトルコ・リラや、大手格付会社の格下げがあった南アフリカ・ランドも売られました。一方、新型コロナウイルスの問題も国内ではほぼ影響がなかった台湾ドルは堅調でした。

なお、当作成期を通じては、リスク回避の動きもあって円は対米ドルで上昇したことから、新興国通貨は対米ドル同様に対円でも新興国通貨安となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

また、保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行いません。

◆ポートフォリオについて

株式組入比率（ＤＲ（預託証券）、ＥＴＦ（上場投資信託証券）、株価指数先物を含む。）は、FTSE RAFI　エマージング　インデックスのリバランス時や大量設定時を除き、当作成期を通じて原則として98％以上で運用を行いました。

ポートフォリオ構築にあたっては、FTSE RAFI　エマージング　インデックス採用銘柄の組入比率上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、ＤＲ等を組み入れることでベンチマークの動きに連動させるような運用を行いました。

また、効率性の観点からFTSE RAFI　エマージング　インデックスとの連動をめざすＥＴＦにも一部投資し、リバランス時には株価指数先物も利用しました。さらに、新興国株式の実質的な組入比率を引き上げるため、ＭＳＣＩエマージング先物をリバランス時以外でも組み入れました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△13.6％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△14.2％となりました。

未収配当金部分等については株式（ＥＴＦ（上場投資信託証券）、株価指数先物を含む。）の組み入れができないため、当作成期を通じて、株式組入比率を基本的に98～99％台で推移させました。その結果、ベンチマークの変動に対するかい離が発生しました。

また、配当金に対する課税分や保管費用等のコストが、マイナス要因となりました。

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

《今後の運用方針》

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

■１万口当りの費用の明細

項　　目	当　　期
売買委託手数料	12円
（株式）	（　8）
（先物・オプション）	（　1）
（投資信託証券）	（　3）
有価証券取引税	4
（株式）	（　4）
（投資信託証券）	（　0）
その他費用	24
（保管費用）	（　20）
（その他）	（　4）
合　　計	40

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

■売買および取引の状況

(1)株　　式

（2019年７月６日から2020年７月６日まで）

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル
外国	アメリカ	44,547.97 (　—)	2,930 (　—)	1,136.7	475
		百株	千香港・ドル	百株	千香港・ドル
	香港	86,002 (　52)	50,727 (△　25)	17,933	6,395
		百株	千シンガポール・ドル	百株	千シンガポール・ドル
	シンガポール	410 (　—)	33 (　—)	—	—
		百株	千台湾・ドル	百株	千台湾・ドル
	台湾	27,870 (493.87)	80,389 (427)	11,272.81	37,818
		百株	千トルコ・リラ	百株	千トルコ・リラ
	トルコ	2,455.9 (34.4)	2,439 (　—)	1,210.6	315
		百株	千メキシコ・ペソ	百株	千メキシコ・ペソ
	メキシコ	5,897 (　—)	10,503 (　—)	3,569	5,692
		百株	千チリ・ペソ	百株	千チリ・ペソ
	チリ	23,476.1 (24.72)	189,429 (5,522)	964.52	92,167
		百株	千サウジアラビア・リアル	百株	千サウジアラビア・リアル
	サウジアラビア	1,677.3 (43.56)	5,499 (　—)	—	—
		百株	千インド・ルピー	百株	千インド・ルピー
	インド	15,305.7 (206.92)	103,454 (　—)	1,133.99	17,148
		百株	千インドネシア・ルピア	百株	千インドネシア・ルピア
	インドネシア	5,346 (　—)	3,199,571 (　—)	11,695	2,520,415
		百株	千ブラジル・レアル	百株	千ブラジル・レアル
	ブラジル	5,466 (302.25)	10,986 (　2)	1,932.55	2,839
		百株	千オフショア・人民元	百株	千オフショア・人民元
	中国	30,501 (　—)	21,085 (　—)	—	—
		百株	千マレーシア・リンギット	百株	千マレーシア・リンギット
	マレーシア	1,280 (　—)	1,033 (　—)	9,507	1,241
		百株	千南アフリカ・ランド	百株	千南アフリカ・ランド
	南アフリカ	3,893.1 (6.39)	21,251 (△　773)	1,660	8,284
		百株	千タイ・バーツ	百株	千タイ・バーツ
	タイ	14,486 (　—)	30,588 (　—)	27	513

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

(2)投資信託証券

（2019年７月６日から2020年７月６日まで）

		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
外国	アメリカ	1,176 (　—)	21,983 (　—)	850 (　—)	15,091 (　—)
		千口	千トルコ・リラ	千口	千トルコ・リラ
	トルコ	— (　—)	— (　—)	171.87 (　—)	185 (　—)
		千口	千メキシコ・ペソ	千口	千メキシコ・ペソ
	メキシコ	20.7 (　—)	544 (△　89)	8.2 (　—)	135 (　—)
		千口	千南アフリカ・ランド	千口	千南アフリカ・ランド
	南アフリカ	17.5 (　—)	401 (　—)	105 (　—)	175 (　—)

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

(3)先物取引の種類別取引状況

(2019年7月6日から2020年7月6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
		百万円	百万円	百万円	百万円
外国	株式先物取引	3,623	3,405	—	—

(注1)金額は受渡し代金。
(注2)単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1)株式

(2019年7月6日から2020年7月6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
GAZPROM PJSC-SPON ADR(ロシア)	139.33	77,537	556	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC(台湾)	46	44,150	959
CHINA MOBILE LTD(香港)	84.5	67,238	795	MEDIATEK INC(台湾)	10	11,865	1,186
CHINA CONSTRUCTION BANK-H(中国)	720	57,050	79	BANCO SANTANDER MEXICO SA IN(メキシコ)	82.3	10,875	132
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR(ケイマン諸島)	3	56,063	18,687	LUKOIL PJSC-SPON ADR(ロシア)	1.86	10,704	5,755
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC(台湾)	53	45,501	858	BHARTI AIRTEL LTD(インド)	17.48	10,302	589
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF(ブラジル)	76	45,174	594	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L(メキシコ)	146.4	9,628	65
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP(サウジアラビア)	21.46	42,673	1,988	BANK OF CHINA LTD-H(中国)	235	9,158	38
IND & COMM BK OF CHINA-H(中国)	589	39,341	66	CHINA RESOURCES BEER HOLDING(香港)	20	9,004	450
HON HAI PRECISION INDUSTRY(台湾)	149	37,051	248	NASPERS LTD-N SHS(南アフリカ)	0.64	8,316	12,993
PING AN INSURANCE GROUP CO-H(中国)	28	30,867	1,102	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR(ロシア)	3.76	8,271	2,199

(注1)金額は受渡し代金。
(注2)金額の単位未満は切捨て。

(2)投資信託証券

(2019年7月6日から2020年7月6日まで)

当期							
買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M(アメリカ)	1,176	2,374,104	2,018	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M(アメリカ)	850	1,620,498	1,906
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA(メキシコ)	20.7	2,874	138	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI(トルコ)	171.87	3,071	17
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD(南アフリカ)	17.5	2,789	159	REDEFINE PROPERTIES LTD(南アフリカ)	105	1,060	10
				FIBRA UNO ADMINISTRACION SA(メキシコ)	8.2	618	75

(注1)金額は受渡し代金。
(注2)金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国株式

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)					
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	164	337	163	17,598	エネルギー
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	34	64	1,431	154,051	一般消費財・サービス
BAIDU INC - SPON ADR	20	44	542	58,402	コミュニケーション・サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	88	80	163	17,637	一般消費財・サービス
CANADIAN SOLAR INC	—	28	56	6,040	情報技術
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	—	25	93	10,100	資本財・サービス
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	264.5	199.5	185	19,929	コミュニケーション・サービス
JD.COM INC-ADR	79	82	503	54,190	一般消費財・サービス
NETEASE INC-ADR	5	5	215	23,193	コミュニケーション・サービス
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	36	56	148	16,011	一般消費財・サービス
VTB BANK JSC -GDR-REG S	893.06	1,642.98	156	16,802	金融
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	18.3	45.6	91	9,827	素材
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	39.5	60.5	287	30,935	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	155.3	296	158	17,031	エネルギー
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	104.9	92.1	243	26,224	素材
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	187	249.7	336	36,180	生活必需品
RUSHYDRO PJSC-ADR	606.1	604.95	63	6,785	公益事業
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	704.5	811	954	102,756	金融
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	9.3	12.2	178	19,187	エネルギー
LUKOIL PJSC-SPON ADR	158.8	168.3	1,273	137,040	エネルギー
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	462.7	487	246	26,537	エネルギー
GAZPROM PJSC-SPON ADR	1,879.6	3,272.9	1,787	192,370	エネルギー
SEVERSTAL - GDR REG S	61.8	102.7	126	13,620	素材
TATNEFT PJSC - PREF	45.4	35.1	27	2,961	エネルギー
SISTEMA PJSFC	—	147	3	385	コミュニケーション・サービス
ROSSETI PJSC	—	29,890	65	7,037	公益事業
INTER RAO UES PJSC	—	10,160	71	7,749	公益事業
ALROSA PJSC	391.8	791.6	73	7,901	素材

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	328.09	362.29	59	6,395	金融
AEROFLOT PJSC	407	402.5	46	4,954	資本財・サービス
アメリカ・ドル通貨計 株数、金額	7,143.65	50,554.92	9,752	1,049,843	
アメリカ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	25銘柄	30銘柄		<11.4%>	
	百株	百株	千香港・ドル	千円	
(香港)					
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	950	1,410	908	12,612	資本財・サービス
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	1,650	2,770	1,157	16,082	資本財・サービス
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	240	400	377	5,239	資本財・サービス
KINGBOARD HOLDINGS LTD	160	—	—	—	情報技術
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	450	760	1,076	14,947	一般消費財・サービス
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	410	1,100	478	6,646	資本財・サービス
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	140	—	—	—	生活必需品
JIANGXI COPPER CO LTD-H	600	750	620	8,615	素材
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	—	1,400	446	6,203	公益事業
CHINA GAS HOLDINGS LTD	—	196	503	6,996	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	12,978	17,438	5,894	81,868	エネルギー
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	100	155	428	5,952	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	760	1,060	532	7,391	一般消費財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	560	980	502	6,983	資本財・サービス
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	135	135	468	6,506	資本財・サービス
FOSUN INTERNATIONAL LTD	610	930	941	13,072	資本財・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD	126	182	9,545	132,592	コミュニケーション・サービス
CHINA TELECOM CORP LTD-H	4,580	6,920	1,570	21,818	コミュニケーション・サービス
AIR CHINA LTD-H	420	600	289	4,016	資本財・サービス
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	2,100	3,320	1,470	20,428	コミュニケーション・サービス
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	410	470	1,628	22,620	不動産
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	1,500	1,500	915	12,709	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	600	580	538	7,476	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	6,860	12,580	3,396	47,178	エネルギー
CNOOC LTD	3,960	5,930	5,337	74,130	エネルギー
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	640	880	623	8,654	不動産
HUANENG POWER INTL INC-H	1,880	3,380	993	13,802	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	170	195	1,087	15,100	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	840	1,150	508	7,060	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	30,910	38,110	23,399	325,019	金融
CHINA MOBILE LTD	1,305	2,150	11,749	163,204	コミュニケーション・サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	330	656	906	12,592	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	3,420	5,380	1,926	26,752	金融
GF SECURITIES CO LTD-H	306	306	284	3,957	金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	—	284	404	5,625	金融
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	2,790	—	—	—	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	100	140	860	11,949	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,560	2,660	1,207	16,774	金融
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	—	700	252	3,500	資本財・サービス
HUADIAN POWER INTL CORP-H	—	1,420	313	4,358	公益事業
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1,120	1,705	2,264	31,450	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	220	312	461	6,405	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H	276	512	1,024	14,223	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	540	700	2,271	31,551	不動産
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	190	260	626	8,703	一般消費財・サービス
YANZHOU COAL MINING CO-H	580	1,000	632	8,778	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	—	430	639	8,887	ヘルスケア
BYD CO LTD-H	80	80	543	7,545	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	10,080	14,670	4,342	60,314	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	151	210	616	8,561	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,820	2,120	536	7,450	金融
CITIC LTD	1,220	880	682	9,485	資本財・サービス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	2,150	—	—	—	金融
IND & COMM BK OF CHINA-H	24,940	30,830	15,168	210,688	金融
CHINA TOWER CORP LTD-H	3,860	5,820	907	12,611	コミュニケーション・サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	—	916	1,306	18,143	情報技術
MEITUAN DIANPING-CLASS B	—	106	2,032	28,224	一般消費財・サービス
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	740	—	—	—	素材
GUANGDONG INVESTMENT LTD	300	420	567	7,887	公益事業
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	—	2,150	281	3,912	資本財・サービス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	780	1,220	3,117	43,296	不動産
CRRC CORP LTD - H	640	1,240	429	5,959	資本財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1,670	3,110	1,436	19,957	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-H	1,850	—	—	—	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	635	915	7,420	103,072	金融
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	210	290	1,112	15,447	不動産
BAIC MOTOR CORP LTD-H	680	—	—	—	一般消費財・サービス
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	2,670.8	3,845.8	1,969	27,350	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,240	2,200	2,283	31,719	不動産
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	80	70	488	6,791	一般消費財・サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	253	409	1,102	15,310	不動産
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	920	1,940	389	5,416	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	380	560	334	4,651	一般消費財・サービス
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	40	55	515	7,165	一般消費財・サービス
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2,020	2,020	1,426	19,808	金融

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千香港・ドル	千円	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	1,000	1,075	566	7,869	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	410	440	708	9,839	資本財・サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,880	2,680	420	5,844	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	478	646	1,463	20,323	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	244	349	474	6,592	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,240	1,210	2,132	29,613	金融
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	74	100	910	12,639	公益事業
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	380	620	459	6,381	素材
KUNLUN ENERGY CO LTD	680	1,400	712	9,898	公益事業
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	508	804	771	10,709	不動産
CHINA OILFIELD SERVICES-H	440	—	—	—	エネルギー
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,140	1,140	434	6,032	素材
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	460	—	—	—	資本財・サービス
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	1,940	2,300	2,014	27,985	素材
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	2,961	4,381	2,225	30,912	金融
CHINA EVERGRANDE GROUP	380	800	2,064	28,668	不動産
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	520	520	513	7,136	不動産
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	4,650	12,260	272	3,780	情報技術
CHINA MERCHANTS BANK-H	765	915	3,426	47,596	金融
BANK OF CHINA LTD-H	30,130	33,860	10,225	142,035	金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	305	335	586	8,152	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	1,140	1,600	491	6,822	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	696	680	503	6,989	金融
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	670	—	—	—	金融
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	290	300	1,159	16,105	不動産
香港・ドル通貨計 株数、金額	200,266.8	268,387.8	173,012	2,403,144	
香港・ドル通貨計 銘柄数<比率>	91銘柄	90銘柄		<26.1%>	
	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)					
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	477	887	83	6,477	資本財・サービス
シンガポール・ドル通貨計 株数、金額	477	887	83	6,477	
シンガポール・ドル通貨計 銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		<0.1%>	
	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
(台湾)					
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	160	200	2,310	8,408	情報技術
TAIWAN CEMENT	946	1,272.32	5,591	20,354	素材
ASIA CEMENT CORP	550	630	2,835	10,319	素材
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	—	940	6,758	24,601	情報技術
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	—	420	1,974	7,185	金融
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	661.12	821.12	6,010	21,878	生活必需品
FORMOSA PLASTICS CORP	576	496	4,181	15,219	素材
NAN YA PLASTICS CORP	481.4	441.4	2,904	10,572	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	503.9	433.9	3,184	11,592	素材
WALSIN LIHWA CORP	930	—	—	—	資本財・サービス
CHINA STEEL CORP	1,306.86	976.86	2,026	7,378	素材
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	—	30	2,166	7,884	一般消費財・サービス
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	656.16	586.16	2,746	9,996	情報技術
DELTA ELECTRONICS INC	340	470	7,966	28,998	情報技術
YAGEO CORPORATION	—	60	2,262	8,233	情報技術
ACER INC	930	—	—	—	情報技術
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	—	300	1,710	6,224	情報技術
INVENTEC CORP	670	—	—	—	情報技術
TATUNG CO LTD	550	—	—	—	一般消費財・サービス
QUANTA COMPUTER INC	590	850	6,290	22,895	情報技術
AU OPTRONICS CORP	2,720	7,450	7,062	25,707	情報技術
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	684	884	9,900	36,038	コミュニケーション・サービス
MEDIATEK INC	310.03	280.03	16,381	59,629	情報技術
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	170	230	5,267	19,171	情報技術
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	611.87	—	—	—	金融
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,134.11	1,234.11	5,281	19,226	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,456.93	1,548.38	6,309	22,967	金融
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,720	2,240	2,121	7,721	金融
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,363.34	1,440.27	4,047	14,731	金融
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,698.28	1,388.28	2,485	9,045	金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,559.93	1,589.93	5,016	18,259	金融
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,535.75	1,287.68	1,738	6,327	金融
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	3,556.77	4,193.34	3,631	13,218	金融
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	—	1,670	1,820	6,625	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	2,420.28	2,720.28	5,658	20,595	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	962.1	1,191.72	2,734	9,955	金融
LARGAN PRECISION CO LTD	10	10	4,325	15,743	情報技術
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	100	110	2,865	10,430	情報技術
TAIWAN MOBILE CO LTD	240	310	3,565	12,976	コミュニケーション・サービス
WISTRON CORP	621.1	1,291.1	4,802	17,482	情報技術
INNOLUX CORP	2,190	9,660	7,583	27,602	情報技術
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	230	310	2,151	7,831	コミュニケーション・サービス
PEGATRON CORP	470	630	4,164	15,158	情報技術
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	—	150	2,025	7,371	情報技術
CHAILEASE HOLDING CO LTD	142.2	214.71	2,726	9,925	金融
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	618	—	—	—	金融
POWERTECH TECHNOLOGY INC	214	194	2,240	8,156	情報技術

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千台湾・ドル	千円	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP		220	320	2,844	10,355	エネルギー
POU CHEN		374.4	—	—	—	一般消費財・サービス
COMPAL ELECTRONICS		—	1,070	2,118	7,711	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC		2,590	2,660	87,647	319,035	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY		2,189.02	3,679.02	31,382	114,230	情報技術
PRESIDENT CHAIN STORE CORP		80	80	2,368	8,619	生活必需品
ASUSTEK COMPUTER INC		107.6	137.6	2,979	10,843	情報技術
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP		750	690	1,994	7,258	資本財・サービス
UNITED MICROELECTRONICS CORP		4,380	4,580	7,534	27,424	情報技術
台湾・ドル通貨計	株数、金額	47,281.15	64,372.21	315,692	1,149,120	
	銘柄数<比率>	48銘柄	49銘柄		<12.5%>	
		百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
(トルコ)						
TURKIYE GARANTI BANKASI		945.5	1,060.2	871	13,673	金融
AKBANK T. A. S.		1,226.92	1,492.72	880	13,818	金融
TURKIYE IS BANKASI-C		995.1	1,271	683	10,728	金融
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		439.5	696.6	1,113	17,465	コミュニケーション・サービス
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE		44.1	90.9	788	12,372	エネルギー
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK		507.91	868.81	741	11,627	素材
HACI OMER SABANCI HOLDING		631.8	803.9	732	11,490	金融
TURKIYE HALK BANKASI		722	1,108.3	674	10,590	金融
YAPI VE KREDI BANKASI		1,075.6	—	—	—	金融
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D		795.1	961.2	493	7,736	金融
KOC HOLDING AS		361.15	399.15	696	10,928	資本財・サービス
TURK HAVA YOLLARI AO		356.2	567.8	676	10,619	資本財・サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		34.4	94.4	634	9,960	生活必需品
トルコ・リラ通貨計	株数、金額	8,135.28	9,414.98	8,987	141,012	
	銘柄数<比率>	13銘柄	12銘柄		<1.5%>	
		百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
(メキシコ)						
BANCO SANTANDER MEXICO SA IN		621	—	—	—	金融
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV		108	134	1,307	6,287	生活必需品
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L		7,641	7,766	11,602	55,807	コミュニケーション・サービス
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO		552	719	1,732	8,331	コミュニケーション・サービス
CEMEX SAB-CPO		7,073.19	10,067.19	6,473	31,136	素材
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD		309	430	6,108	29,382	生活必需品
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV		296.23	296.23	977	4,700	素材
ALFA S. A. B. -A		716	—	—	—	資本財・サービス
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B		735	648	3,509	16,881	素材
WALMART DE MEXICO SAB DE CV		804	956	5,407	26,008	生活必需品
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O		481	648	5,242	25,215	金融
メキシコ・ペソ通貨計	株数、金額	19,336.42	21,664.42	42,359	203,750	
	銘柄数<比率>	11銘柄	9銘柄		<2.2%>	
		百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
(チリ)						
ENEL CHILE SA		4,877.97	6,997.67	45,827	6,145	公益事業
ENEL AMERICAS SA-RTS		1,722.93	—	—	—	公益事業
LATAM AIRLINES GROUP SA		70	—	—	—	資本財・サービス
CENCOSUD SA		414.5	—	—	—	生活必需品
BANCO SANTANDER CHILE		9,830.9	21,058.8	74,864	10,039	金融
ENEL AMERICAS SA		5,285	8,533.63	110,937	14,876	公益事業
EMPRESAS CMPC SA		168.8	—	—	—	素材
FALABELLA SA		86.4	218	61,912	8,302	一般消費財・サービス
EMPRESAS COPEC SA		46.3	—	—	—	エネルギー
BANCO DE CHILE		3,966.92	12,197.92	93,728	12,569	金融
チリ・ペソ通貨計	株数、金額	26,469.72	49,006.02	387,269	51,932	
	銘柄数<比率>	10銘柄	5銘柄		<0.6%>	
		百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
(サウジアラビア)						
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP		—	214.6	1,916	55,076	素材
SAUDI TELECOM CO		—	75	742	21,339	コミュニケーション・サービス
AL RAJHI BANK		—	174	1,009	29,004	金融
SAMBA FINANCIAL GROUP		—	126.2	339	9,756	金融
RIYAD BANK		—	163.6	276	7,946	金融
ETIHAD ETISALAT CO		—	120.7	337	9,712	コミュニケーション・サービス
SAVOLA		—	71.2	320	9,208	生活必需品
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL		—	62.1	329	9,477	素材
ALINMA BANK		—	174.26	256	7,382	金融
NATIONAL COMMERCIAL BANK		—	130.5	486	13,970	金融
SAUDI ARABIAN OIL CO		—	98.8	324	9,313	エネルギー
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO		—	309.9	261	7,508	素材
サウジアラビア・リアル通貨計	株数、金額	—	1,720.86	6,600	189,696	
	銘柄数<比率>	—	12銘柄		<2.1%>	
		百株	百株	千インド・ルピー	千円	
(インド)						
TATA STEEL LTD		121.5	185.4	6,116	8,868	素材
AXIS BANK LTD		184.6	233.9	10,021	14,531	金融
MARUTI SUZUKI INDIA LTD		8.7	13.5	8,008	11,612	一般消費財・サービス
HINDUSTAN UNILEVER LTD		24.9	27.3	5,934	8,604	生活必需品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP		456.1	469.4	10,131	14,691	エネルギー
STATE BANK OF INDIA		527.8	554.7	10,245	14,855	金融

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
NTPC LTD	648.4	916	8,656	12,551	公益事業
POWER FINANCE CORPORATION	305.8	359.4	3,026	4,387	金融
JSW STEEL LTD	222.7	335.2	6,400	9,280	素材
INDIAN OIL CORP LTD	1,082.8	1,020.7	8,966	13,001	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	440.45	422.05	16,265	23,585	エネルギー
VODAFONE IDEA LTD	—	11,058.9	11,058	16,035	コミュニケーション・サービス
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	237.9	—	—	—	公益事業
JINDAL STEEL & POWER LTD	—	276.9	4,255	6,171	素材
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	30.5	30.5	2,122	3,078	金融
TECH MAHINDRA LTD	42.2	58.2	3,301	4,786	情報技術
YES BANK LTD	235.2	176.4	461	668	金融
TATA MOTORS LTD-A-DVR	318.2	318.2	1,318	1,912	一般消費財・サービス
REC LTD	331.1	383.6	4,154	6,023	金融
COAL INDIA LTD	375.7	725.1	9,806	14,220	エネルギー
BHARTI INFRATEL LTD	114.4	206.8	4,688	6,797	コミュニケーション・サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	79	217.4	5,023	7,283	金融
GAIL INDIA LTD	104.53	378.66	3,972	5,759	公益事業
HINDALCO INDUSTRIES LTD	374.5	528	7,729	11,208	素材
GRASIM INDUSTRIES LTD	81.2	106.8	6,708	9,727	素材
WIPRO LTD	136.53	204.23	4,591	6,657	情報技術
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	61.56	84.16	18,512	26,842	情報技術
INFOSYS LTD	362.4	472.4	36,029	52,243	情報技術
LARSEN & TOUBRO LTD	41.82	55.72	5,261	7,628	資本財・サービス
TATA MOTORS LTD	845.2	1,066.8	11,036	16,002	一般消費財・サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	124.7	147.9	27,882	40,429	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD	318.6	400.4	71,587	103,801	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	741.75	1,211.25	9,980	14,472	エネルギー
ITC LTD	236.4	432.9	8,984	13,028	生活必需品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	98.9	169.5	8,991	13,038	一般消費財・サービス
HERO MOTOCORP LTD	15.3	25.1	6,873	9,965	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD	386.22	211.42	12,293	17,824	コミュニケーション・サービス
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	108.4	152.4	7,267	10,537	ヘルスケア
HCL TECHNOLOGIES LTD	58.1	151.4	8,768	12,714	情報技術
VEDANTA LTD	860.5	1,334.6	14,206	20,599	素材
インド・ルピー通貨計 株数、金額	10,744.56	25,123.19	410,641	595,430	
インド・ルピー通貨計 銘柄数<比率>	38銘柄	39銘柄		<6.5%>	
	百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
(インドネシア)					
UNITED TRACTORS TBK PT	284	—	—	—	エネルギー
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,084	2,563	1,243,055	9,198	一般消費財・サービス
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	470	—	—	—	素材
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	770	—	—	—	生活必需品
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	7,956	9,272	2,892,864	21,407	コミュニケーション・サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,252	1,727	787,512	5,827	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	515	615	1,805,025	13,357	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	2,977	3,370	1,685,000	12,469	金融
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	3,015	—	—	—	公益事業
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	6,605	7,761	2,367,105	17,516	金融
ADARO ENERGY TBK PT	4,729	—	—	—	エネルギー
インドネシア・ルピア通貨計 株数、金額	31,657	25,308	10,780,561	79,776	
インドネシア・ルピア通貨計 銘柄数<比率>	11銘柄	6銘柄		<0.9%>	
	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
(ブラジル)					
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	12	6	35	723	公益事業
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	17	146	141	2,861	金融
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	46	36	286	5,796	金融
CIA DE SANEAMENTO DO PA-UNIT	16	—	—	—	公益事業
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	139	268	594	12,047	一般消費財・サービス
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	—	66	478	9,694	生活必需品
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	851	1,300	2,857	57,862	エネルギー
BANCO BRADESCO SA-PREF	781.6	1,437.26	3,068	62,138	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	1,073.36	1,833.36	4,858	98,382	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	228	246	263	5,335	素材
VALE SA	801.9	1,035.9	5,724	115,918	素材
GERDAU SA-PREF	332	367	576	11,675	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	641	821	1,847	37,406	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	390.97	413.97	460	9,330	公益事業
ITAUSA SA	375.41	—	—	—	金融
BRASKEM SA-PREF A	50	125	293	5,950	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	48	48	162	3,299	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	376	453	1,517	30,730	金融
COSAN SA	40	—	—	—	エネルギー
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	68	123	400	8,117	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	58	33	201	4,086	公益事業
EMBRAER SA	223	282	230	4,676	資本財・サービス
METALURGICA GERDAU SA-PREF	681	753	547	11,085	素材
CCR SA	242	252	372	7,552	資本財・サービス
BRF SA	241	197	397	8,054	生活必需品
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	76	68	393	7,970	公益事業
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	77	—	—	—	公益事業
TIM PARTICIPACOES SA	200.26	194.26	296	5,998	コミュニケーション・サービス

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF		117	153	747	15, 134	コミュニケーション・サービス
LOJAS RENNER S. A.		50. 05	50. 05	205	4, 155	一般消費財・サービス
LOJAS AMERICANAS SA-PREF		85	85. 84	266	5, 388	一般消費財・サービス
JBS SA		490	429	941	19, 068	生活必需品
SUZANO SA		42. 45	89. 45	333	6, 750	素材
BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B		70	—	—	—	金融
MARFRIG GLOBAL FOODS SA		—	197	243	4, 926	生活必需品
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA		79	—	—	—	公益事業
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO		150	141	796	16, 132	金融
BR MALLS PARTICIPACOES SA		141. 08	—	—	—	不動産
CIELO SA		347. 28	752. 28	361	7, 312	情報技術
HYPERA SA		53	—	—	—	ヘルスケア
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF		45	—	—	—	その他
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD		18	90	218	4, 417	公益事業
SUL AMERICA SA - UNITS		45	—	—	—	金融
CIA ENERGETICA DE MINAS GER		32	32	37	766	公益事業
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT		82	146	415	8, 408	金融
TELEFONICA BRASIL S. A.		—	10	48	990	コミュニケーション・サービス
KLABIN SA - UNIT		98	144	300	6, 085	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA		292	565	1, 041	21, 086	エネルギー
ITAU UNIBANCO HOLDING SA		—	199	488	9, 889	金融
LOJAS AMERICANAS SA		19	22. 93	60	1, 227	一般消費財・サービス
COGNA EDUCACAO		317	475	342	6, 925	一般消費財・サービス
BANCO BRADESCO S. A.		202. 65	382. 41	743	15, 046	金融
AMBEV SA		650	878	1, 241	25, 140	生活必需品
ブラジル・レアル通貨計	株数、金額	11, 511. 01	15, 346. 71	34, 841	705, 549	
	銘柄数＜比率＞	49 銘柄	43 銘柄		＜7. 6%＞	
		百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
(中国)						
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A		—	650	1, 103	16, 799	金融
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A		—	682	612	9, 327	資本財・サービス
PING AN INSURANCE GROUP CO-A		—	131	1, 021	15, 554	金融
IND & COMM BK OF CHINA-A		—	2, 318	1, 196	18, 216	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A		—	55	104	1, 592	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-A		—	60	198	3, 019	金融
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A		—	84	70	1, 077	一般消費財・サービス
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A		—	4	616	9, 392	生活必需品
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A		—	46	261	3, 977	素材
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A		—	996	1, 114	16, 974	金融
HUADIAN POWER INTL CORP-A		—	404	145	2, 221	公益事業
CITIC SECURITIES CO-A		—	110	315	4, 803	金融
CHINA MERCHANTS BANK-A		—	359	1, 318	20, 087	金融
PING AN BANK CO LTD-A		—	378	538	8, 203	金融
GF SECURITIES CO LTD-A		—	98	162	2, 471	金融
CHINA STATE CONSTRUCTION -A		—	2, 175	1, 104	16, 827	資本財・サービス
SAIC MOTOR CORP LTD-A		—	379	706	10, 765	一般消費財・サービス
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A		—	238	86	1, 319	素材
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A		—	291	157	2, 402	資本財・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A		—	845	228	3, 487	資本財・サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A		—	621	185	2, 827	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-A		—	96	139	2, 117	素材
YANZHOU COAL MINING CO-A		—	49	47	720	エネルギー
CHINA CONSTRUCTION BANK-A		—	303	202	3, 082	金融
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A		—	4, 834	1, 696	25, 841	金融
BANK OF CHINA LTD-A		—	2, 442	886	13, 500	金融
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A		—	1, 704	695	10, 588	エネルギー
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A		—	1, 733	927	14, 120	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A		—	263	417	6, 360	エネルギー
CHINA VANKE CO LTD -A		—	191	547	8, 334	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A		—	122	374	5, 704	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A		—	412	230	3, 507	金融
CHINA MINSHENG BANKING-A		—	1, 525	905	13, 796	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A		—	1, 551	623	9, 495	金融
CRRC CORP LTD-A		—	552	324	4, 943	資本財・サービス
CHINA UNITED NETWORK-A		—	913	463	7, 063	コミュニケーション・サービス
HUATAI SECURITIES CO LTD-A		—	90	198	3, 030	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A		—	123	182	2, 774	金融
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A		—	268	213	3, 257	資本財・サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A		—	815	392	5, 970	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A		—	35	176	2, 694	金融
HUAXIA BANK CO LTD-A		—	603	392	5, 978	金融
AIR CHINA LTD-A		—	148	103	1, 568	資本財・サービス
BYD CO LTD -A		—	18	142	2, 175	一般消費財・サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A		—	44	42	641	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-A		—	98	148	2, 265	資本財・サービス
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A		—	259	123	1, 873	素材
HUANENG POWER INTL INC-A		—	386	172	2, 627	公益事業
オフショア・人民元通貨計	株数、金額	—	30, 501	22, 021	335, 382	
	銘柄数＜比率＞	—	48 銘柄		＜3. 6%＞	

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
(マレーシア)						
MISC BHD		—	429	335	8,433	資本財・サービス
MALAYAN BANKING BHD		647	675	520	13,083	金融
GENTING BHD		450	—	—	—	一般消費財・サービス
PUBLIC BANK BERHAD		346	349	595	14,968	金融
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD		391	—	—	—	素材
GENTING MALAYSIA BHD		675	—	—	—	一般消費財・サービス
CIMB GROUP HOLDINGS BHD		737	691	255	6,427	金融
TENAGA NASIONAL BHD		441	347	408	10,258	公益事業
PETRONAS GAS BHD		103	—	—	—	公益事業
SAPURA ENERGY BHD		6,928	—	—	—	エネルギー
マレーシア・リンギット通貨計	株数、金額	10,718	2,491	2,115	53,172	
	銘柄数<比率>	9銘柄	5銘柄		<0.6%>	
		百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
(南アフリカ)						
GOLD FIELDS LTD		254.9	154.2	2,478	15,665	素材
NEPI ROCKCASTLE PLC		49	75	706	4,467	不動産
MULTICHOICE GROUP LTD		—	127.3	1,382	8,736	コミュニケーション・サービス
OLD MUTUAL LTD		690	1,695.4	2,137	13,511	金融
VODACOM GROUP LTD		162.5	171.2	2,168	13,703	コミュニケーション・サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD		100.9	227.2	2,442	15,435	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD		100.1	119	1,247	7,886	金融
BIDVEST GROUP LTD		54.3	88.7	1,303	8,240	資本財・サービス
BID CORP LTD		51.1	73.1	2,088	13,201	生活必需品
NETCARE LTD		329.3	566.9	805	5,091	ヘルスケア
STANDARD BANK GROUP LTD		302.9	364.2	3,796	23,995	金融
SASOL LTD		151.9	236.4	3,208	20,275	素材
REMGRO LTD		75.4	124.1	1,247	7,885	金融
DISCOVERY LTD		—	89.4	936	5,921	金融
EXXARO RESOURCES LTD		46	80.3	1,030	6,513	エネルギー
PICK N PAY STORES LTD		85.7	—	—	—	生活必需品
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD		96.4	210.2	709	4,482	一般消費財・サービス
SANLAM LTD		310.4	427.2	2,564	16,204	金融
TIGER BRANDS LTD		31.8	66.8	1,269	8,021	生活必需品
FIRSTRAND LTD		539	889.3	3,390	21,430	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD		276.8	399.6	1,376	8,700	一般消費財・サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD		43.3	78.4	517	3,270	一般消費財・サービス
ABSA GROUP LTD		251.3	254.6	2,136	13,500	金融
NASPERS LTD-N SHS		14.2	17.29	5,543	35,033	一般消費財・サービス
INVESTEC LTD		69.9	—	—	—	金融
MTN GROUP LTD		544.1	385.9	2,248	14,211	コミュニケーション・サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD		137.8	64.3	737	4,663	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT		70.3	132.8	1,913	12,091	ヘルスケア
ANGLOGOLD ASHANTI LTD		57.9	54.5	2,705	17,096	素材
BARLOWORLD LTD		60.7	—	—	—	資本財・サービス
SAPPI LIMITED		157.1	470.8	1,306	8,259	素材
TELKOM SA SOC LTD		108.3	350	1,236	7,814	コミュニケーション・サービス
MONDI LTD		21.7	—	—	—	その他
SPAR GROUP LIMITED/THE		47.3	77.7	1,372	8,675	生活必需品
MR PRICE GROUP LTD		31.9	59	843	5,332	一般消費財・サービス
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN		276.4	—	—	—	ヘルスケア
SIBANYE STILLWATER LTD		555.7	265	993	6,280	素材
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額	6,156.3	8,395.79	57,848	365,600	
	銘柄数<比率>	35銘柄	32銘柄		<4.0%>	
		百株	百株	千タイ・バーツ	千円	
(タイ)						
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG		102	208	2,236	7,736	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR		166	309	12,051	41,696	素材
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN		110	227	2,105	7,284	金融
KASIKORNBANK PCL-NVDR		78	116	1,073	3,712	金融
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR		571	1,068	7,849	27,160	金融
THANACHART CAPITAL PCL-NVDR		302	372	1,348	4,665	金融
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR		—	685	1,935	6,695	素材
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR		200	221	4,154	14,375	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR		1,790	2,994	3,143	10,877	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR		1,233	3,163	1,992	6,894	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR		299	384	3,657	12,655	エネルギー
IRPC PCL - NVDR		2,843	8,853	2,425	8,392	エネルギー
PTT PCL-NVDR		3,860	5,902	23,165	80,152	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR		347	706	3,282	11,358	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR		423	693	4,660	16,125	生活必需品
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR		1,034	1,316	4,178	14,456	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR		614	1,214	5,948	20,582	素材
タイ・バーツ通貨計	株数、金額	13,972	28,431	85,208	294,822	
	銘柄数<比率>	16銘柄	17銘柄		<3.2%>	
ファンド合計	株数、金額	393,868.89	601,604.9	—	7,624,712	
	銘柄数<比率>	357銘柄	398銘柄		<82.7%>	

(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) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2)外国投資信託証券

銘柄		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)					
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M		325	651	11,652	1,254,434
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額	325	651	11,652	1,254,434
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		<13.6%>
		千口	千口	千トルコ・リラ	千円
(トルコ)					
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI		171.87	—	—	—
トルコ・リラ通貨計	口数、金額	171.87	—	—	—
	銘柄数<比率>	1銘柄	—		<—>
		千口	千口	千メキシコ・ペソ	千円
(メキシコ)					
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		67.7	80.2	1,479	7,117
メキシコ・ペソ通貨計	口数、金額	67.7	80.2	1,479	7,117
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		<0.1%>
		千口	千口	南アフリカ・ランド	千円
(南アフリカ)					
REDEFINE PROPERTIES LTD		105	—	—	—
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		59.43	76.93	1,134	7,171
南アフリカ・ランド通貨計	口数、金額	164.43	76.93	1,134	7,171
	銘柄数<比率>	2銘柄	1銘柄		<0.1%>
合計	口数、金額	729	808.13	—	1,268,723
	銘柄数<比率>	5銘柄	3銘柄		<13.8%>

(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。

(3)先物取引の銘柄別残高(評価額)

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
外国	MSCI EMGMKT(アメリカ)	274	—

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

■投資信託財産の構成

2020年7月6日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	7,624,712	82.3
投資信託証券	1,268,723	13.7
コール・ローン等、その他	371,752	4.0
投資信託財産総額	9,265,188	100.0

(注1)評価額の単位未満は切捨て。
(注2)外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月6日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝107.65円、1香港・ドル＝13.89円、1シンガポール・ドル＝77.28円、1台湾・ドル＝3.64円、1トルコ・リラ＝15.69円、1メキシコ・ペソ＝4.81円、100チリ・ペソ＝13.41円、1サウジアラビア・リアル＝28.74円、1インド・ルピー＝1.45円、100インドネシア・ルピア＝0.74円、1ブラジル・レアル＝20.25円、1オフショア・人民元＝15.23円、1マレーシア・リンギット＝25.14円、1南アフリカ・ランド＝6.32円、1タイ・バーツ＝3.46円です。
(注3)当期末における外貨建純資産(9,069,699千円)の投資信託財産総額(9,265,188千円)に対する比率は、97.9%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年7月6日現在

項目	当期末
(A)資産	**9,409,616,832円**
コール・ローン等	227,238,424
株式(評価額)	7,624,712,594
投資信託証券(評価額)	1,268,723,409
未収入金	148,687,999
未収配当金	81,553,731
差入委託証拠金	58,700,675
(B)負債	**184,501,694**
未払金	145,304,445
未払解約金	39,191,000
その他未払費用	6,249
(C)純資産総額(A－B)	**9,225,115,138**
元本	6,697,704,657
次期繰越損益金	2,527,410,481
(D)受益権総口数	**6,697,704,657口**
1万口当り基準価額(C／D)	**13,774円**

＊期首における元本額は4,649,472,217円、当作成期間中における追加設定元本額は2,455,463,969円、同解約元本額は407,231,529円です。
＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、新興国株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)20,517,485円、ダイワファンドラップ　外国株式インデックス　エマージングプラス(為替ヘッジなし)272,574,554円、ダイワファンドラップオンライン　外国株式インデックス　エマージングプラス(為替ヘッジなし)306,201,274円、Ｄ－Ｉ's　新興国株式インデックス121,622,083円、ｉＦｒｅｅ　新興国株式インデックス2,442,811,336円、ｉＦｒｅｅ　8資産バランス1,927,698,988円、新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド(為替ヘッジなし／適格機関投資家専用)73,329,223円、ＤＣダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド1,048,944,143円、ダイワ・インデックスセレクト　新興国株式389,621,996円、ダイワ・ノーロード新興国株式ファンド94,383,575円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は13,774円です。

■損益の状況

当期　自 2019年7月6日　至 2020年7月6日

項　　目	当　　期
(A)配当等収益	**268, 989, 167円**
受取配当金	268, 421, 568
受取利息	437, 484
その他収益金	158, 308
支払利息	△ 28, 193
(B)有価証券売買損益	**△ 1, 280, 823, 504**
売買益	786, 166, 149
売買損	△ 2, 066, 989, 653
(C)先物取引等損益	**△ 31, 786, 515**
取引益	69, 042, 781
取引損	△ 100, 829, 296
(D)その他費用	**△ 13, 412, 497**
(E)当期損益金（A＋B＋C＋D）	**△ 1, 057, 033, 349**
(F)前期繰越損益金	**2, 818, 201, 270**
(G)解約差損益金	**△ 213, 374, 471**
(H)追加信託差損益金	**979, 617, 031**
(I)合計（E＋F＋G＋H）	**2, 527, 410, 481**
次期繰越損益金（I）	**2, 527, 410, 481**

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

【注記】

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

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

ダイワファンドラップ
日本債券インデックス

運用報告書（全体版）
第５期
（決算日　2021年６月15日）
（作成対象期間　2020年６月16日～2021年６月15日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

<4643>

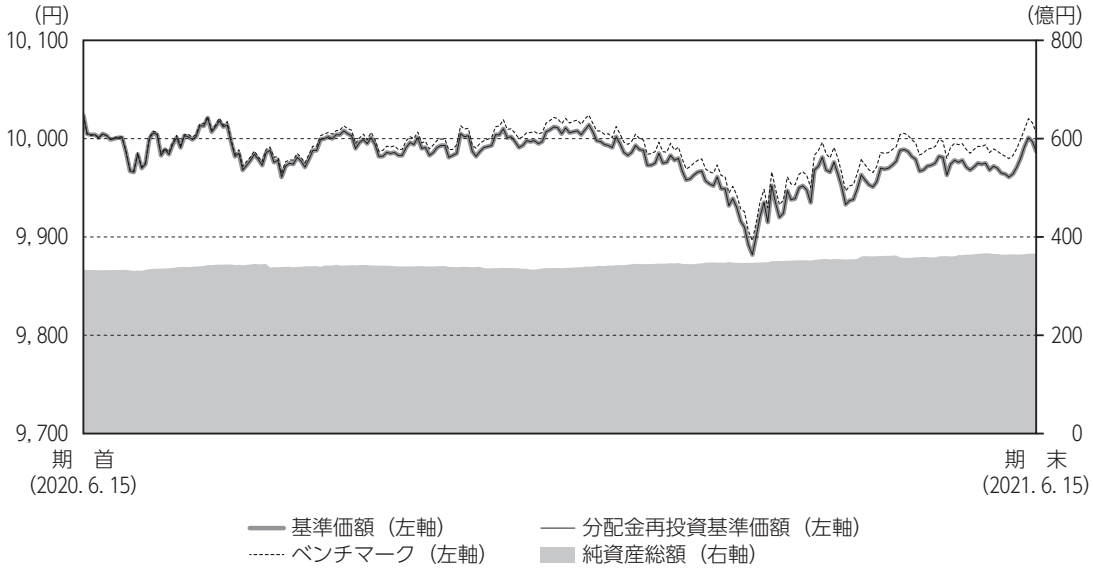
設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数		公社債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1期末(2017年6月15日)	9,858	0	△ 1.4	521.587	△ 1.3	99.4	—	14,248
2期末(2018年6月15日)	9,915	0	0.6	525.468	0.7	99.4	—	25,120
3期末(2019年6月17日)	10,149	0	2.4	538.684	2.5	99.4	—	27,372
4期末(2020年6月15日)	10,024	0	△ 1.2	532.954	△ 1.1	99.4	—	33,339
5期末(2021年6月15日)	9,987	0	△ 0.4	532.014	△ 0.2	99.3	—	36,597

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

運用経過

基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期　首：10,024円
期　末：　9,987円（分配金０円）
騰落率：△0.4%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

投資している債券の価格が下落したことにより、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年　月　日	基準価額		ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2020年６月15日	10,024	—	532.954	—	99.4	—
６月末	9,986	△ 0.4	531.018	△ 0.4	99.4	—
７月末	10,021	△ 0.0	532.880	△ 0.0	99.4	—
８月末	9,972	△ 0.5	530.432	△ 0.5	99.2	—
９月末	9,999	△ 0.2	531.917	△ 0.2	99.3	—
10月末	9,981	△ 0.4	531.087	△ 0.4	99.5	—
11月末	9,993	△ 0.3	531.781	△ 0.2	99.5	—
12月末	9,993	△ 0.3	531.946	△ 0.2	99.5	—
2021年１月末	9,967	△ 0.6	530.582	△ 0.4	99.5	—
２月末	9,882	△ 1.4	526.155	△ 1.3	99.2	—
３月末	9,951	△ 0.7	529.811	△ 0.6	99.3	—
４月末	9,968	△ 0.6	530.887	△ 0.4	99.3	—
５月末	9,972	△ 0.5	531.127	△ 0.3	99.0	—
(期末)2021年６月15日	9,987	△ 0.4	532.014	△ 0.2	99.3	—

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2020.6.16 ～ 2021.6.15）

■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、国内の長期金利はおおむねレンジ内で推移しました。2020年９月には、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が、2021年１月には、景気回復期待を背景に米国の金利が上昇したことなどから、国内の長期金利は上昇しました。その後も日銀が長期金利の変動許容幅を拡大するとの観測などから、金利はさらに上昇しました。３月には、日銀が金融政策の点検結果を公表し、長期金利の変動幅の明確化などを発表したことで不透明感が払しょくされ、国内金利は低下しました。３月末に日銀が国債買い入れオペの実施回数を削減したことで、４月の初めには金利が反発する局面もありましたが、その後は感染拡大や緊急事態宣言の延長に伴う景気悪化懸念が金利低下要因となりました。また当作成期末にかけては、米国債の金利低下に連動して金利が低下しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

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

ポートフォリオについて　（2020. 6. 16 ～ 2021. 6. 15）

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

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

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

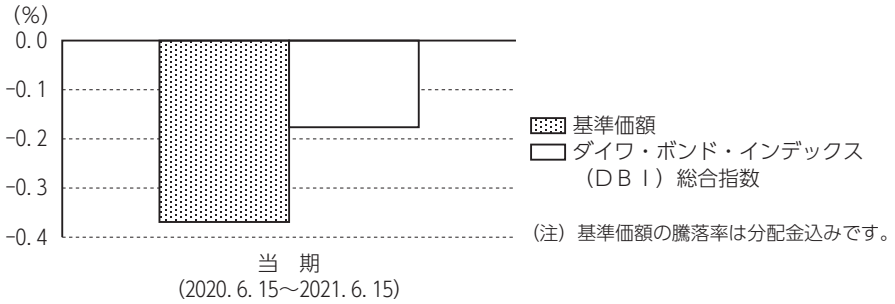
組入ファンド	ベンチマーク
日本債券インデックスマザーファンド	ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△0. 2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△0. 4%となりました。

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差異は0. 2%でした。差異の内訳は、運用管理費用等の要因によるベンチマークとの差異が0. 2%程度、「日本債券インデックスマザーファンド」におけるベンチマークとの差異が0. 0%程度となっており、信託報酬要因を除くと、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



＊ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数です。

分配金について

当作成期は、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６月16日 ～2021年６月15日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**―**
対基準価額比率	（％）	―
当期の収益	（円）	―
当期の収益以外	（円）	―
翌期繰越分配対象額	（円）	267

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

今後の運用方針

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

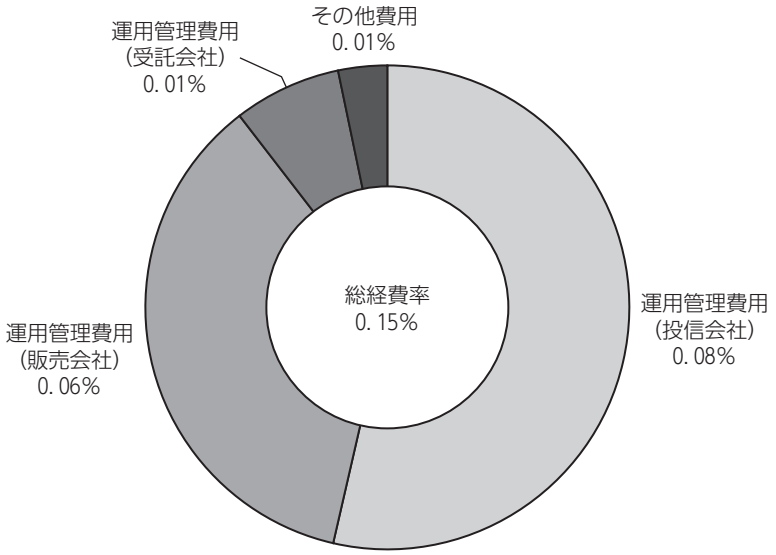
項　目	当　期 (2020. 6. 16～2021. 6. 15) 金　額	比　率	項　目　の　概　要
信　託　報　酬	15円	0. 148%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は9, 980円です。**
(投 信 会 社)	(8)	(0. 082)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(5)	(0. 055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(1)	(0. 011)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ　の　他)	(0)	(0. 000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	15	0. 154	

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（１口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0. 15%です。



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

■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６月16日から2021年６月15日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
日本債券インデックスマザーファンド	5,883,311	8,334,640	3,538,749	5,013,084

（注）単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	22,499	256	1.1	29,248	3,624	12.4
コール・ローン	110,815	—	—	—	—	—

（注）平均保有割合38.5%
※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 利害関係人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６月16日から2021年６月15日まで）

種類	当期
	日本債券インデックスマザーファンド
	買付額
	百万円
公社債	100

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

(4) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
日本債券インデックスマザーファンド	23,424,297	25,768,859	36,560,857

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年６月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
日本債券インデックスマザーファンド	36,560,857	99.8
コール・ローン等、その他	67,944	0.2
投資信託財産総額	36,628,802	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年６月15日現在

項目	当期末
（A）資産	**36,628,802,432円**
コール・ローン等	67,944,514
日本債券インデックスマザーファンド（評価額）	36,560,857,918
（B）負債	**31,465,371**
未払解約金	4,389,480
未払信託報酬	26,108,982
その他未払費用	966,909
（C）純資産総額（A－B）	**36,597,337,061**
元本	36,644,197,981
次期繰越損益金	△ 46,860,920
（D）受益権総口数	**36,644,197,981口**
１万口当り基準価額（C／D）	**9,987円**

＊期首における元本額は33,258,556,611円、当作成期間中における追加設定元本額は12,736,682,056円、同解約元本額は9,351,040,686円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は9,987円です。
＊当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は46,860,920円です。

■損益の状況

当期　自 2020年６月16日　至 2021年６月15日

項目	当期
（A）配当等収益	△ **21,560円**
受取利息	3,708
支払利息	△ 25,268
（B）有価証券売買損益	△ **31,391,712**
売買益	28,274,250
売買損	△ 59,665,962
（C）信託報酬等	△ **53,228,148**
（D）当期損益金（A＋B＋C）	△ **84,641,420**
（E）前期繰越損益金	**100,519,817**
（F）追加信託差損益金	△ **62,739,317**
（配当等相当額）	(582,239,657)
（売買損益相当額）	(△ 644,978,974)
（G）合計（D＋E＋F）	△ **46,860,920**
次期繰越損益金（G）	△ **46,860,920**
追加信託差損益金	△ 62,739,317
（配当等相当額）	(582,239,657)
（売買損益相当額）	(△ 644,978,974)
分配準備積立金	397,268,712
繰越損益金	△ 381,390,315

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項目	当期
（a）経費控除後の配当等収益	0円
（b）経費控除後の有価証券売買等損益	0
（c）収益調整金	582,239,657
（d）分配準備積立金	397,268,712
（e）当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	979,508,369
（f）分配金	0
（g）翌期繰越分配対象額（e－f）	979,508,369
（h）受益権総口数	36,644,197,981口

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワファンドラップ　日本債券インデックス）が投資対象としている「日本債券インデックスマザーファンド」の決算日（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６月15日）現在における日本債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■日本債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄

公　社　債

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
144 5年国債 0.1% 2025/6/20	1,298,118	410 2年国債 0.1% 2022/3/1	2,005,080
359 10年国債 0.1% 2030/6/20	1,217,734	142 5年国債 0.1% 2024/12/20	1,818,711
360 10年国債 0.1% 2030/9/20	1,016,345	135 5年国債 0.1% 2023/3/20	1,327,450
142 5年国債 0.1% 2024/12/20	908,043	131 5年国債 0.1% 2022/3/20	1,173,167
145 5年国債 0.1% 2025/9/20	878,506	409 2年国債 0.1% 2022/2/1	1,104,462
147 5年国債 0.005% 2026/3/20	822,044	341 10年国債 0.3% 2025/12/20	1,023,390
415 2年国債 0.1% 2022/8/1	753,600	132 5年国債 0.1% 2022/6/20	882,041
362 10年国債 0.1% 2031/3/20	695,426	117 20年国債 2.1% 2030/3/20	842,492
361 10年国債 0.1% 2030/12/20	630,890	130 5年国債 0.1% 2021/12/20	732,182
421 2年国債 0.1% 2023/2/1	602,557	347 10年国債 0.1% 2027/6/20	709,633

（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６月15日現在における日本債券インデックスマザーファンド（64,064,308千口）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）

作成期	2021年６月15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	75,743,000	81,001,185	89.1	—	59.1	22.8	7.3
地方債証券	3,600,000	3,815,467	4.2	—	2.1	1.2	0.9
特殊債券（除く金融債券）	2,700,000	2,788,134	3.1	—	1.4	0.7	1.0
金融債券	100,000	100,041	0.1	—	0.1	—	—
普通社債券	2,600,000	2,683,079	3.0	—	1.5	1.1	0.3
合計	84,743,000	90,387,908	99.4	—	64.1	25.8	9.5

（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）

2021年６月15日現在					
区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	415 2年国債	0.1000	750,000	751,942	2022/08/01
	133 5年国債	0.1000	550,000	551,529	2022/09/20
	325 10年国債	0.8000	310,000	313,605	2022/09/20
	58 20年国債	1.9000	200,000	205,110	2022/09/20
	417 2年国債	0.1000	100,000	100,304	2022/10/01
	134 5年国債	0.1000	950,000	953,230	2022/12/20
	326 10年国債	0.7000	30,000	30,372	2022/12/20
	327 10年国債	0.8000	450,000	456,268	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	46,240	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,230	2022/12/20
	421 2年国債	0.1000	600,000	602,298	2023/02/01
	135 5年国債	0.1000	1,550,000	1,556,277	2023/03/20
	328 10年国債	0.6000	350,000	354,473	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	101,983	2023/03/20
	423 2年国債	0.0050	100,000	100,251	2023/04/01
	424 2年国債	0.0050	500,000	501,315	2023/05/01
	136 5年国債	0.1000	950,000	954,398	2023/06/20
	329 10年国債	0.8000	500,000	509,375	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	96,770	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	135,044	2023/06/20
	137 5年国債	0.1000	800,000	804,264	2023/09/20
	330 10年国債	0.8000	612,000	624,986	2023/09/20

2021年6月15日現在					
区　　分	銘　　柄	年 利 率	額 面 金 額	評　価　額	償還年月日
		%	千円	千円	
	331 10年国債	0.6000	365,000	371,088	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	94,146	2023/09/20
	138 5年国債	0.1000	1,200,000	1,207,260	2023/12/20
	332 10年国債	0.6000	250,000	254,630	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	183,953	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	185,000	193,998	2023/12/20
	139 5年国債	0.1000	900,000	905,976	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	700,000	714,343	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	58,091	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	127,741	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	116,791	2024/03/20
	140 5年国債	0.1000	700,000	705,075	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	900,000	920,133	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	89,347	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	133,803	2024/06/20
	141 5年国債	0.1000	920,000	927,084	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	690,000	704,358	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	105,000	112,672	2024/09/20
	142 5年国債	0.1000	850,000	857,046	2024/12/20
	336 10年国債	0.5000	275,000	281,160	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	400,000	406,140	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	129,018	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	78,743	2024/12/20
	143 5年国債	0.1000	700,000	706,209	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	580,000	591,721	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	86,738	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	54,910	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	140,458	2025/03/20
	144 5年国債	0.1000	700,000	706,629	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	590,000	602,726	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	65,992	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	54,294	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	57,765	2025/06/20
	145 5年国債	0.1000	870,000	878,569	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	760,000	777,259	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	95,296	2025/09/20
	146 5年国債	0.1000	480,000	484,790	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	500,000	509,525	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	102,342	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	818,000	822,695	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	1,030,000	1,040,588	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	64,131	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	89,223	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	61,077	2026/03/20
	343 10年国債	0.1000	780,000	788,252	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	112,143	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	87,078	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	820,000	828,888	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	20,000	22,439	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	60,000	67,636	2026/09/20
	345 10年国債	0.1000	830,000	839,428	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	310,000	347,897	2026/12/20
	346 10年国債	0.1000	700,000	708,106	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	112,163	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	146,564	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	500,000	506,045	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	57,256	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	55,000	62,317	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	500,000	506,140	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	45,783	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	320,000	364,252	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	1,050,000	1,063,062	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	100,000	114,346	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	500,000	506,285	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	155,000	179,076	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	350,000	409,122	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	99,254	2028/04/20
	351 10年国債	0.1000	800,000	810,152	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	170,000	198,526	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	10,000	11,537	2028/06/20
	11 フイリピン共和国	0.9900	100,000	102,153	2028/08/15
	352 10年国債	0.1000	750,000	759,577	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	146,012	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	174,919	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	580,000	587,221	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	90,000	104,708	2028/12/20

2021年6月15日現在					
区　　分	銘　　柄	年 利 率	額 面 金 額	評　価　額	償還年月日
		%	千円	千円	
	108 20年国債	1.9000	300,000	344,502	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	600,000	607,242	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	55,000	63,378	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	260,000	303,659	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	690,000	698,038	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	200,000	236,098	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	150,000	175,867	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	510,000	515,487	2029/09/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	19,734	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	310,000	364,693	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	620,000	626,342	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	70,000	82,653	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	214,072	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	29,038	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	660,000	666,362	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	200,000	238,748	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	200,000	236,994	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	36,174	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	980,000	988,379	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	112,069	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	108,035	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	317,000	362,540	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	980,000	987,702	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	200,000	234,872	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	200,000	233,022	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	45,758	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	633,000	637,196	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	200,000	239,382	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	300,000	356,226	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	694,000	697,705	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	130,000	157,296	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	130,958	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	250,000	295,200	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	33,962	2031/05/20
	128 20年国債	1.9000	250,000	296,070	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	100,000	117,431	2031/06/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	164,847	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	175,092	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	29,805	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	40,000	46,803	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	430,000	507,627	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	130,000	153,851	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	107,897	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	180,000	209,183	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	68,224	2032/05/20
	138 20年国債	1.5000	100,000	115,373	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	370,000	430,913	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	400,000	471,540	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	32,189	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	49,333	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	200,000	236,284	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	240,000	286,272	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	50,113	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	246,178	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	240,000	278,563	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	47,454	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	420,000	498,275	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	74,222	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	280,000	332,861	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	92,097	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	300,000	353,643	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	105,097	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	380,000	443,942	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	50,000	64,912	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	402,000	470,356	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	250,000	325,762	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	180,000	208,580	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	130,000	168,181	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	330,000	374,154	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	102,701	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	380,000	431,170	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	73,413	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	430,000	494,461	2035/06/20
	154 20年国債	1.2000	550,000	625,399	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	77,714	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	350,000	388,391	2035/12/20

2021年6月15日現在					
区　　分	銘　　柄	年 利 率	額 面 金 額	評　価　額	償還年月日
		%	千円	千円	
	22 30年国債	2.5000	170,000	225,566	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	200,000	204,560	2036/03/20
	157 20年国債	0.2000	300,000	297,612	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	122,794	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	400,000	414,092	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	196,212	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	280,000	293,974	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	180,000	238,674	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	360,000	383,108	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	320,000	335,433	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	202,269	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	350,000	366,565	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	290,000	303,447	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	170,000	230,227	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	390,000	401,165	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	300,000	308,214	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	268,714	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	350,000	370,846	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	300,000	307,425	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	292,949	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	320,000	321,865	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	300,000	295,953	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	300,000	395,607	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	190,000	187,083	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	300,000	294,828	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	285,000	382,492	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	100,000	99,912	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	410,000	408,913	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	280,000	361,740	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	320,000	318,857	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	430,000	435,809	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	270,000	360,312	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	200,000	202,548	2041/03/20
	35 30年国債	2.0000	250,000	324,975	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	310,000	404,292	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	320,000	412,444	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	200,000	254,264	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	230,000	297,684	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	180,000	229,404	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	170,000	213,436	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	205,000	257,635	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	200,000	251,604	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	200,000	251,850	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	200,000	243,100	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	140,000	170,272	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	400,000	495,916	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	130,000	155,483	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	120,000	143,582	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	200,000	211,586	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	240,000	225,813	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	260,000	256,547	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	250,000	252,230	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	310,000	327,115	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	260,000	274,164	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	140,000	147,354	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	230,000	241,904	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	101,269	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	370,000	388,855	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	200,000	204,886	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	210,000	225,288	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	204,240	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	154,079	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	200,000	193,628	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	230,000	216,372	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	220,000	206,619	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	200,000	187,520	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	211,194	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	235,000	219,964	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	230,000	226,639	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	200,000	196,814	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	259,000	261,558	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	180,000	254,003	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	205,000	206,525	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	125,000	170,662	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	141,223	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	156,581	2054/03/20

2021年6月15日現在						
区分		銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
			%	千円	千円	
		8 40年国債	1.4000	230,000	278,525	2055/03/20
		9 40年国債	0.4000	220,000	199,872	2056/03/20
		10 40年国債	0.9000	275,000	292,402	2057/03/20
		11 40年国債	0.8000	320,000	329,836	2058/03/20
		12 40年国債	0.5000	430,000	400,725	2059/03/20
		13 40年国債	0.5000	430,000	399,517	2060/03/20
種別小計	銘柄数	256銘柄				
	金額			75,743,000	81,001,185	
地方債証券		24-6 北海道公債	0.8400	100,000	101,000	2022/08/31
		713 東京都公債	0.7700	100,000	100,968	2022/09/20
		24-5 京都府公債	0.8200	100,000	101,028	2022/09/20
		24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	101,068	2022/10/21
		117 共同発行地方	0.7200	100,000	101,079	2022/12/22
		24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	101,099	2022/12/22
		24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	101,225	2023/01/31
		24-4 福井県公債	0.4600	100,000	100,844	2023/04/26
		126 共同発行地方	0.8100	100,000	101,857	2023/09/25
		25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	203,419	2023/11/22
		131 共同発行地方	0.6600	100,000	101,789	2024/02/23
		26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	101,763	2024/11/25
		26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	101,653	2025/02/26
		3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	204,213	2025/04/16
		22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	107,397	2025/11/21
		27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	102,114	2025/11/27
		751 東京都公債	0.3700	100,000	101,683	2025/12/19
		222 神奈川県公債	0.0600	100,000	100,291	2026/06/19
		28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,988	2027/01/29
		168 共同発行地方	0.2100	100,000	101,154	2027/03/25
		420 大阪府公債	0.1700	200,000	201,663	2027/05/28
		29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	101,144	2027/06/23
		29-5 広島県公債	0.2450	100,000	101,492	2028/01/25
		20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	116,330	2028/05/26
		16 東京都20年	2.0100	100,000	114,889	2028/12/20
		21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	117,874	2029/06/20
		11 名古屋市20年	2.1300	100,000	117,483	2029/12/14
		23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	117,900	2031/08/19
		19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	116,276	2033/12/09
		16 千葉県20年	1.5550	100,000	116,676	2034/04/14
		31 神奈川県20年	1.0020	100,000	110,085	2035/12/20
		4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	131,082	2041/09/20
		4 埼玉県30年	1.3270	100,000	115,927	2045/12/20
種別小計	銘柄数	33銘柄				
	金額			3,600,000	3,815,467	
特殊債券（除く金融債券）		168 政保道路機構	0.8390	100,000	100,921	2022/07/29
		39政保地方公共団	0.8010	100,000	100,911	2022/08/15
		173 政保道路機構	0.8190	100,000	101,038	2022/09/30
		175 政保道路機構	0.7910	100,000	101,058	2022/10/31
		25 政保日本政策	0.8150	100,000	101,343	2023/02/24
		19 政保政策投資Ｃ	0.6680	100,000	101,120	2023/03/15
		186 政保道路機構	0.6680	100,000	101,120	2023/03/17
		48 地方公共団体	0.8130	100,000	101,567	2023/05/26
		190 政保道路機構	0.6050	100,000	101,137	2023/05/31
		51 地方公共団体	0.8410	100,000	101,856	2023/08/28
		65 地方公共団体	0.5350	100,000	101,791	2024/10/28
		236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,102	2025/01/31
		71 地方公共団体	0.4650	100,000	101,779	2025/04/28
		261 政保道路機構	0.3810	200,000	203,313	2025/11/28
		127 都市再生	0.0750	100,000	100,293	2026/09/18
		F143地方公共団体	1.3510	100,000	108,158	2027/08/25
		1 地方公共団15年	1.3340	100,000	108,511	2028/01/28
		86 政保道路機構	2.0000	100,000	115,918	2029/07/31
		47日本政策投資ＣＯ	1.0270	100,000	107,643	2029/09/20
		31 地方公共団20	1.7440	100,000	118,007	2033/09/28
		223 政保道路機構	1.4270	100,000	115,280	2034/07/31
		284 政保道路機構	0.1490	200,000	195,243	2036/07/31
		298 政保道路機構	0.5470	100,000	103,358	2036/12/26
		247 道路機構	0.3420	200,000	195,657	2040/03/19
種別小計	銘柄数	24銘柄				
	金額			2,700,000	2,788,134	
金融債券		19 利付商工債	0.1000	100,000	100,041	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄				
	金額			100,000	100,041	

2021年６月15日現在						
区分		銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
			%	千円	千円	
普通社債券		372 中国電力	1.2040	100,000	101,398	2022/08/25
		4 JX ホールデイングス	1.1450	100,000	101,658	2022/12/14
		30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	101,108	2022/12/14
		175 オリックス	1.0640	100,000	102,390	2023/11/24
		21 西日本高速道	0.7540	100,000	101,873	2023/12/20
		1 三菱 UFJFG 劣後	0.9400	100,000	101,751	2024/06/26
		482 九州電力	0.1700	100,000	100,421	2024/08/23
		5 野村不動産 HD	0.9240	100,000	102,825	2025/05/30
		11日本たばこ産業	0.5990	100,000	102,156	2025/07/15
		63 中日本高速道	0.5760	100,000	102,420	2025/11/13
		4 フアーストリテイリング	0.7490	100,000	102,978	2025/12/18
		14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	100,499	2025/12/19
		16 NTT フアイナンス	0.1800	100,000	100,368	2025/12/19
		20 成田国際空港	0.1050	100,000	100,203	2026/08/21
		17 パナソニツク	0.4700	100,000	101,431	2026/09/18
		509 関西電力	0.4700	100,000	101,740	2027/05/25
		12 アサヒグループ HD	0.3300	100,000	100,954	2027/06/11
		15 デンソー	0.2450	100,000	100,685	2027/06/18
		78 トヨタフアイナンス	0.2650	100,000	100,804	2027/07/23
		11 東京電力パワー	0.7900	100,000	102,341	2028/01/25
		41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	115,310	2029/01/29
		13 NTT フアイナンス	1.0900	100,000	106,932	2029/09/20
		7 凸版印刷	1.1040	100,000	107,182	2029/12/12
		332 北海道電力	0.9070	100,000	105,398	2036/04/25
		23 森ビル	0.9700	100,000	102,320	2038/05/17
		107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	115,925	2045/01/27
種別小計	銘柄数	26銘柄				
	金額			2,600,000	2,683,079	
合計	銘柄数	340銘柄				
	金額			84,743,000	90,387,908	

（注）単位未満は切捨て。

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書　第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）

日本債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

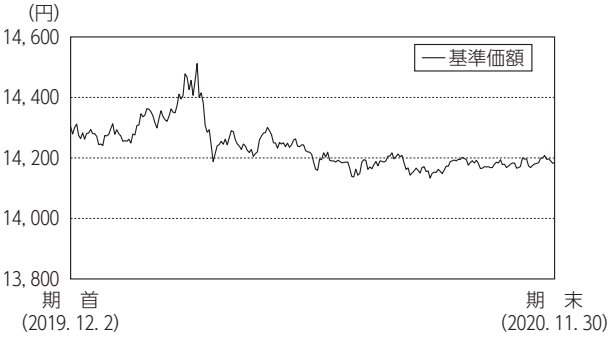
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数（ベンチマーク）		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首) 2019年12月２日	14,303	—	536.068	—	99.6	—
12月末	14,296	△ 0.0	535.929	△ 0.0	99.6	—
2020年１月末	14,361	0.4	538.313	0.4	99.3	—
２月末	14,478	1.2	542.689	1.2	99.4	—
３月末	14,243	△ 0.4	533.796	△ 0.4	99.5	—
４月末	14,290	△ 0.1	535.588	△ 0.1	99.5	—
５月末	14,224	△ 0.6	533.139	△ 0.5	99.5	—
６月末	14,166	△ 1.0	531.018	△ 0.9	99.5	—
７月末	14,217	△ 0.6	532.880	△ 0.6	99.5	—
８月末	14,149	△ 1.1	530.432	△ 1.1	99.3	—
９月末	14,190	△ 0.8	531.917	△ 0.8	99.4	—
10月末	14,166	△ 1.0	531.087	△ 0.9	99.6	—
(期末) 2020年11月30日	14,185	△ 0.8	531.781	△ 0.8	99.6	—

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：14,303円　期末：14,185円　騰落率：△0.8％

【基準価額の主な変動要因】

金利の上昇（債券価格は下落）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。

◆投資環境について

国内債券市場では、長期金利は上昇しました。

当作成期首より2019年末まで、米中通商協議の進展や英国総選挙の結果を受けて政治的な先行き不透明感が和らいだこと、また日銀の追加金融緩和観測が後退したことから、長期金利は上昇しました。しかし2020年１月後半から、中国での新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済への悪影響が警戒され、金利は低下しました。２月から３月上旬にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受け、世界経済の減速懸念が高まったことや市場のリスク回避姿勢が強まったことから、金利は一段と低下しました。３月中旬以降は、金融市場の混乱を受けて国債にも換金売りが広がったことや、日銀の利下げ観測が後退したことから、金利は急上昇しました。また、政府の経済対策に伴う国債増発懸念も金利上昇要因となりました。その後４月にかけて、日銀が上限を設けずに積極的な国債の買い入れを行う方針を示したことから、金利は上昇幅を縮小させました。６月以降は、景気回復期待の高まりや国債増発による需給悪化懸念などが金利上昇要因となる一方、感染再拡大などが金利低下要因となり、長期金利はおおむね横ばい圏で推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△0.8％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率も△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ほとんどなく、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。金利や信用スプレッドの変動に対する感応度を適切にコントロールしたことから、目立った超過損益は発生しませんでした。

《今後の運用方針》

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

■１万口当りの費用の明細

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

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

■売買および取引の状況
公　社　債

（2019年12月３日から2020年11月30日まで）

		買　付　額	売　付　額
		千円	千円
国内	国債証券	38,521,006	29,215,529 （　　—）
	地方債証券	108,903	202,178 （　　—）
	特殊債券	405,948	304,538 （　　—）
	社債券	199,976	302,796 （　　—）

（注１）金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。
（注２）（　）内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
（注３）社債券には新株予約権付社債券（転換社債券）は含まれておりません。
（注４）単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
公　社　債

（2019年12月３日から2020年11月30日まで）

当期			
買付		売付	
銘　柄	金　額	銘　柄	金　額
	千円		千円
142 5年国債 0.1% 2024/12/20	2,781,325	142 5年国債 0.1% 2024/12/20	2,344,108
135 5年国債 0.1% 2023/3/20	2,135,436	127 5年国債 0.1% 2021/3/20	1,585,150
410 2年国債 0.1% 2022/3/1	2,008,960	341 10年国債 0.3% 2025/12/20	1,536,095
357 10年国債 0.1% 2029/12/20	1,756,675	129 5年国債 0.1% 2021/9/20	1,344,375
341 10年国債 0.3% 2025/12/20	1,597,882	135 5年国債 0.1% 2023/3/20	1,307,939
144 5年国債 0.1% 2025/6/20	1,298,118	409 2年国債 0.1% 2022/2/1	1,054,347
359 10年国債 0.1% 2030/6/20	1,217,734	357 10年国債 0.1% 2029/12/20	1,021,935
409 2年国債 0.1% 2022/2/1	1,107,601	128 5年国債 0.1% 2021/6/20	1,003,540
358 10年国債 0.1% 2030/3/20	1,050,236	117 20年国債 2.1% 2030/3/20	842,492
134 5年国債 0.1% 2022/12/20	1,016,842	166 20年国債 0.7% 2038/9/20	745,500

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

■組入資産明細表
(1)国内（邦貨建）公社債（種類別、新株予約権付社債券（転換社債券）を除く）

作成期	当期末						
区　分	額面金額	評価額	組入比率	うち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	74,339,000	79,869,797	88.5	—	58.2	22.1	8.2
地方債証券	3,900,000	4,128,711	4.6	—	2.2	1.5	0.9
特殊債券（除く金融債券）	2,900,000	2,997,196	3.3	—	1.4	1.2	0.7
金融債券	100,000	99,942	0.1	—	0.1	—	—
普通社債券	2,700,000	2,777,936	3.1	—	1.7	1.0	0.3
合　計	83,939,000	89,873,584	99.6	—	63.6	25.8	10.1

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

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

当期末					
区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	407 2年国債	0.1000	100,000	100,230	2021/12/01
	319 10年国債	1.1000	100,000	101,279	2021/12/20
	53 20年国債	2.1000	66,000	67,539	2021/12/20
	54 20年国債	2.2000	65,000	66,584	2021/12/20
	408 2年国債	0.1000	150,000	150,382	2022/01/01
	409 2年国債	0.1000	50,000	50,137	2022/02/01
	410 2年国債	0.1000	2,000,000	2,006,360	2022/03/01
	131 5年国債	0.1000	1,170,000	1,173,346	2022/03/20
	321 10年国債	1.0000	175,000	177,548	2022/03/20
	322 10年国債	0.9000	130,000	131,723	2022/03/20
	55 20年国債	2.0000	140,000	143,868	2022/03/21
	413 2年国債	0.1000	60,000	60,225	2022/06/01
	132 5年国債	0.1000	880,000	883,071	2022/06/20
	323 10年国債	0.9000	380,000	386,049	2022/06/20
	415 2年国債	0.1000	750,000	753,067	2022/08/01
	133 5年国債	0.1000	550,000	552,381	2022/09/20
	325 10年国債	0.8000	310,000	315,208	2022/09/20
	58 20年国債	1.9000	200,000	207,336	2022/09/20
	417 2年国債	0.1000	100,000	100,450	2022/10/01
	134 5年国債	0.1000	870,000	874,289	2022/12/20
	326 10年国債	0.7000	30,000	30,512	2022/12/20
	327 10年国債	0.8000	450,000	458,608	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	46,694	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,314	2022/12/20
	135 5年国債	0.1000	1,700,000	1,709,401	2023/03/20
	328 10年国債	0.6000	350,000	355,890	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	102,617	2023/03/20
	136 5年国債	0.1000	950,000	955,709	2023/06/20
	329 10年国債	0.8000	500,000	511,900	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	97,273	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	136,437	2023/06/20
	137 5年国債	0.1000	700,000	704,725	2023/09/20
	330 10年国債	0.8000	612,000	628,095	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	365,000	372,544	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	95,152	2023/09/20
	138 5年国債	0.1000	900,000	907,029	2023/12/20
	332 10年国債	0.6000	250,000	255,630	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	185,913	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	185,000	195,970	2023/12/20
	139 5年国債	0.1000	850,000	856,757	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	700,000	717,045	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	58,708	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	129,283	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	118,145	2024/03/20
	140 5年国債	0.1000	900,000	907,704	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	900,000	923,436	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	90,489	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	135,388	2024/06/20
	141 5年国債	0.1000	920,000	928,436	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	690,000	706,608	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	105,000	113,926	2024/09/20
	142 5年国債	0.1000	430,000	434,115	2024/12/20
	336 10年国債	0.5000	275,000	282,056	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	400,000	407,004	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	130,384	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	79,614	2024/12/20
	143 5年国債	0.1000	650,000	656,461	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	580,000	593,287	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	87,692	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	55,463	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	141,937	2025/03/20
	144 5年国債	0.1000	1,085,000	1,095,915	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	590,000	604,036	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	66,622	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	54,837	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	58,369	2025/06/20
	340 10年国債	0.4000	760,000	778,711	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	96,259	2025/09/20
	341 10年国債	0.3000	500,000	510,280	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	103,388	2025/12/20
	342 10年国債	0.1000	1,080,000	1,091,502	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	64,797	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	90,227	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	61,738	2026/03/20

当		期		末	
区　　分	銘　　柄	年 利 率	額 面 金 額	評　価　額	償還年月日
		%	千円	千円	
	343 10年国債	0.1000	680,000	687,588	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	113,396	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	88,012	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	820,000	829,569	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	20,000	22,684	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	60,000	68,404	2026/09/20
	345 10年国債	0.1000	650,000	657,910	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	310,000	351,524	2026/12/20
	346 10年国債	0.1000	700,000	708,869	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	113,310	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	148,127	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	950,000	962,521	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	57,912	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	55,000	62,978	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	600,000	608,214	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	46,285	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	320,000	368,092	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	1,050,000	1,064,532	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	100,000	115,542	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	700,000	709,765	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	155,000	181,010	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	350,000	413,875	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	94,647	2028/04/20
	351 10年国債	0.1000	800,000	810,936	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	170,000	200,659	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	10,000	11,651	2028/06/20
	11 フイリピン共和国	0.9900	100,000	99,957	2028/08/15
	352 10年国債	0.1000	750,000	759,997	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	147,393	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	176,644	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	580,000	587,505	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	90,000	105,728	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	462,000	535,263	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	600,000	607,494	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	55,000	63,936	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	260,000	306,581	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	690,000	698,286	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	200,000	238,438	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	150,000	177,541	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	510,000	515,849	2029/09/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	19,978	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	310,000	368,276	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	720,000	727,502	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	70,000	83,419	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	216,138	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	29,338	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	580,000	585,660	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	200,000	241,026	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	200,000	239,164	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	36,531	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	1,128,000	1,137,678	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	113,037	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	108,883	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	280,000	322,478	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	120,000	120,879	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	200,000	236,670	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	160,000	187,771	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	46,270	2030/11/20
	123 20年国債	2.1000	200,000	241,368	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	300,000	359,049	2030/12/20
	125 20年国債	2.2000	130,000	158,798	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	132,112	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	165,000	196,475	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	34,285	2031/05/20
	128 20年国債	1.9000	250,000	298,540	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	100,000	118,366	2031/06/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	166,145	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	176,403	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	30,103	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	40,000	47,150	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	430,000	511,583	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	200,000	238,518	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	108,687	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	145,000	169,679	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	68,833	2032/05/20

当		期		末	
区　　分	銘　　柄	年 利 率	額 面 金 額	評　価　額	償還年月日
		%	千円	千円	
	138 20年国債	1.5000	100,000	116,118	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	370,000	433,869	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	400,000	474,656	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	32,412	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	49,597	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	200,000	237,824	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	240,000	288,242	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	50,314	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	247,667	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	240,000	280,140	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	47,755	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	380,000	453,674	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	74,837	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	280,000	334,936	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	92,820	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	300,000	355,686	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	105,986	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	280,000	328,854	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	50,000	65,517	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	402,000	473,129	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	250,000	328,777	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	200,000	233,018	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	130,000	169,669	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	400,000	455,604	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	103,569	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	300,000	341,940	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	73,976	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	400,000	461,884	2035/06/20
	154 20年国債	1.2000	550,000	627,715	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	78,239	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	400,000	444,808	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	170,000	227,366	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	200,000	204,570	2036/03/20
	157 20年国債	0.2000	100,000	99,103	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	123,750	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	400,000	414,256	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	197,455	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	280,000	293,988	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	180,000	240,417	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	360,000	383,565	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	250,000	262,237	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	203,929	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	350,000	366,793	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	290,000	303,864	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	170,000	232,267	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	390,000	401,832	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	520,000	535,106	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	271,208	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	250,000	265,552	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	300,000	307,902	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	295,809	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	320,000	322,473	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	300,000	296,610	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	300,000	399,672	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	265,000	261,737	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	300,000	295,998	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	285,000	386,514	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	175,000	175,628	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	410,000	410,742	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	200,000	261,112	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	30,000	30,027	2040/09/20
	34 30年国債	2.2000	270,000	363,976	2041/03/20
	35 30年国債	2.0000	300,000	394,074	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	350,000	461,265	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	200,000	260,422	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	200,000	257,060	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	230,000	300,738	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	200,000	257,434	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	170,000	215,279	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	205,000	259,858	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	200,000	253,774	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	200,000	254,022	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	200,000	245,310	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	140,000	171,820	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	400,000	500,588	2045/06/20

当期末						
区分		銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
			%	千円	千円	
		48 30年国債	1.4000	130,000	156,855	2045/09/20
		49 30年国債	1.4000	120,000	144,849	2045/12/20
		50 30年国債	0.8000	200,000	212,996	2046/03/20
		51 30年国債	0.3000	240,000	226,812	2046/06/20
		52 30年国債	0.5000	300,000	297,282	2046/09/20
		53 30年国債	0.6000	250,000	253,425	2046/12/20
		54 30年国債	0.8000	310,000	328,937	2047/03/20
		55 30年国債	0.8000	260,000	275,696	2047/06/20
		56 30年国債	0.8000	100,000	105,963	2047/09/20
		57 30年国債	0.8000	230,000	243,540	2047/12/20
		1 40年国債	2.4000	70,000	102,314	2048/03/20
		58 30年国債	0.8000	370,000	391,023	2048/03/20
		59 30年国債	0.7000	300,000	309,285	2048/06/20
		60 30年国債	0.9000	210,000	226,902	2048/09/20
		61 30年国債	0.7000	200,000	205,542	2048/12/20
		2 40年国債	2.2000	110,000	155,778	2049/03/20
		62 30年国債	0.5000	200,000	194,924	2049/03/20
		63 30年国債	0.4000	230,000	217,724	2049/06/20
		64 30年国債	0.4000	330,000	311,493	2049/09/20
		65 30年国債	0.4000	200,000	188,472	2049/12/20
		3 40年国債	2.2000	150,000	212,988	2050/03/20
		66 30年国債	0.4000	235,000	220,810	2050/03/20
		67 30年国債	0.6000	164,000	162,571	2050/06/20
		68 30年国債	0.6000	70,000	69,212	2050/09/20
		4 40年国債	2.2000	107,000	152,652	2051/03/20
		5 40年国債	2.0000	125,000	172,705	2052/03/20
		6 40年国債	1.9000	105,000	143,091	2053/03/20
		7 40年国債	1.7000	121,000	158,820	2054/03/20
		8 40年国債	1.4000	230,000	282,336	2055/03/20
		9 40年国債	0.4000	220,000	201,889	2056/03/20
		10 40年国債	0.9000	345,000	370,875	2057/03/20
		11 40年国債	0.8000	320,000	333,408	2058/03/20
		12 40年国債	0.5000	350,000	329,353	2059/03/20
		13 40年国債	0.5000	310,000	291,338	2060/03/20
種別小計	銘柄数	258銘柄				
	金額			74,339,000	79,869,797	
地方債証券		108 共同発行地方	1.0100	100,000	101,290	2022/03/25
		24-1 北海道公債	0.9900	100,000	101,347	2022/04/27
		24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	101,272	2022/06/20
		361 大阪府公債	0.9200	100,000	101,422	2022/06/28
		24-6 北海道公債	0.8400	100,000	101,433	2022/08/31
		713 東京都公債	0.7700	100,000	101,373	2022/09/20
		24-5 京都府公債	0.8200	100,000	101,453	2022/09/20
		24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	101,467	2022/10/21
		117 共同発行地方	0.7200	100,000	101,425	2022/12/22
		24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	101,446	2022/12/22
		24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	101,593	2023/01/31
		24-4 福井県公債	0.4600	100,000	101,053	2023/04/26
		126 共同発行地方	0.8100	100,000	102,240	2023/09/25
		25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	204,030	2023/11/22
		131 共同発行地方	0.6600	100,000	102,063	2024/02/23
		26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	101,959	2024/11/25
		26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	101,851	2025/02/26
		3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	204,676	2025/04/16
		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
		222 神奈川県公債	0.0600	100,000	100,121	2026/06/19
		28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,761	2027/01/29
		168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,962	2027/03/25
		420 大阪府公債	0.1700	200,000	201,266	2027/05/28
		29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,915	2027/06/23
		29-5 広島県公債	0.2450	100,000	101,267	2028/01/25
		20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	117,165	2028/05/26
		16 東京都20年	2.0100	100,000	115,381	2028/12/20
		21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	118,478	2029/06/20
		11 名古屋市20年	2.1300	100,000	118,098	2029/12/14
		23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	118,447	2031/08/19
		19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	116,738	2033/12/09
		16 千葉県20年	1.5550	100,000	116,983	2034/04/14
		31 神奈川県20年	1.0020	100,000	110,064	2035/12/20
		4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	132,043	2041/09/20
		4 埼玉県30年	1.3270	100,000	116,726	2045/12/20
種別小計	銘柄数	36銘柄				
	金額			3,900,000	4,128,711	

当期末						
区分		銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
			%	千円	千円	
特殊債券（除く金融債券）		33 地方公共団体	1.0350	100,000	101,238	2022/02/28
		25 日本政策金融	0.9970	100,000	101,390	2022/05/10
		168 政保道路機構	0.8390	100,000	101,372	2022/07/29
		39政保地方公共団	0.8010	100,000	101,342	2022/08/15
		173 政保道路機構	0.8190	100,000	101,471	2022/09/30
		175 政保道路機構	0.7910	100,000	101,474	2022/10/31
		25 政保日本政策	0.8150	100,000	101,759	2023/02/24
		19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	101,475	2023/03/15
		186 政保道路機構	0.6680	100,000	101,477	2023/03/17
		48 地方公共団体	0.8130	100,000	101,927	2023/05/26
		190 政保道路機構	0.6050	100,000	101,426	2023/05/31
		51 地方公共団体	0.8410	100,000	102,222	2023/08/28
		65 地方公共団体	0.5350	100,000	101,956	2024/10/28
		236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,321	2025/01/31
		71 地方公共団体	0.4650	100,000	101,900	2025/04/28
		261 政保道路機構	0.3810	200,000	203,702	2025/11/28
		127 都市再生	0.0750	100,000	100,023	2026/09/18
		F143地方公共団体	1.3510	100,000	108,469	2027/08/25
		1 地方公共団15年	1.3340	100,000	108,858	2028/01/28
		86 政保道路機構	2.0000	100,000	116,636	2029/07/31
		47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	107,903	2029/09/20
		31 地方公共団20	1.7440	100,000	118,583	2033/09/28
		223 政保道路機構	1.4270	100,000	115,813	2034/07/31
		284 政保道路機構	0.1490	200,000	194,686	2036/07/31
		298 政保道路機構	0.5470	100,000	103,190	2036/12/26
		247 道路機構	0.3420	200,000	195,574	2040/03/19
種別小計	銘柄数	26銘柄				
	金額			2,900,000	2,997,196	
金融債券		19 利付商工債	0.1000	100,000	99,942	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄				
	金額			100,000	99,942	
普通社債券		11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	100,715	2022/06/20
		11三菱 UFJ 信託 BK	1.3600	100,000	101,789	2022/06/27
		372 中国電力	1.2040	100,000	101,990	2022/08/25
		4 JX ホールデイングス	1.1450	100,000	102,104	2022/12/14
		30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	101,426	2022/12/14
		175 オリックス	1.0640	100,000	102,662	2023/11/24
		21 西日本高速道	0.7540	100,000	102,091	2023/12/20
		1 三菱 UFJFG 劣後	0.9400	100,000	101,696	2024/06/26
		482 九州電力	0.1700	100,000	100,278	2024/08/23
		5 野村不動産 HD	0.9240	100,000	102,723	2025/05/30
		11日本たばこ産業	0.5990	100,000	102,243	2025/07/15
		63 中日本高速道	0.5760	100,000	102,447	2025/11/13
		4 フアーストリテイリング	0.7490	100,000	102,949	2025/12/18
		14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	100,009	2025/12/19
		20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,909	2026/08/21
		17 パナソニツク	0.4700	100,000	100,997	2026/09/18
		509 関西電力	0.4700	100,000	100,869	2027/05/25
		12 アサヒグループ HD	0.3300	100,000	100,552	2027/06/11
		15 デンソー	0.2450	100,000	100,232	2027/06/18
		78 トヨタフアイナンス	0.2650	100,000	100,334	2027/07/23
		11 東京電力パワー	0.7900	100,000	101,026	2028/01/25
		41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	115,988	2029/01/29
		13 NTT フアイナンス	1.0900	100,000	106,475	2029/09/20
		7 凸版印刷	1.1040	100,000	106,929	2029/12/12
		332 北海道電力	0.9070	100,000	102,876	2036/04/25
		23 森ビル	0.9700	100,000	100,631	2038/05/17
		107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	115,983	2045/01/27
種別小計	銘柄数	27銘柄				
	金額			2,700,000	2,777,936	
合計	銘柄数	348銘柄				
	金額			83,939,000	89,873,584	

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　　率
	千円	%
公社債	89,873,584	99.3
コール・ローン等、その他	628,308	0.7
投資信託財産総額	90,501,893	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項　　目	当　期　末
(A)資産	**90,501,893,234円**
コール・ローン等	327,212,168
公社債（評価額）	89,873,584,460
未収入金	101,092,000
未収利息	196,593,327
前払費用	3,411,279
(B)負債	**242,747,138**
未払金	100,000,000
未払解約金	142,747,138
(C)純資産総額（A－B）	**90,259,146,096**
元本	63,632,169,674
次期繰越損益金	26,626,976,422
(D)受益権総口数	**63,632,169,674口**
１万口当り基準価額（C／D）	**14,185円**

＊期首における元本額は57,670,399,195円、当作成期間中における追加設定元本額は27,218,615,082円、同解約元本額は21,256,844,603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、ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）65,126,538円、ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）505,967,183円、ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）62,478,037円、ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）718,126,297円、ＤＣダイワ日本債券インデックス8,503,141,748円、ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ10,269,709,415円、ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）1,737,338,049円、ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）226,910,962円、ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）339,059,642円、ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド90,548,180円、ダイワファンドラップ 日本債券インデックス23,601,367,986円、ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）6,701,446,457円、ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス1,691,971,743円、ダイワ・インデックスセレクト日本債券1,058,268,870円、ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス6,961,101,317円、ダイワライフスタイル２５　459,018,956円、ダイワライフスタイル５０　504,172,138円、ダイワライフスタイル７５　136,416,156円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は14,185円です。

■損益の状況

当期　自 2019年12月３日　至 2020年11月30日

項　　目	当　　期
(A)配当等収益	**692,403,223円**
受取利息	692,615,699
支払利息	△ 212,476
(B)有価証券売買損益	**△ 1,455,887,100**
売買益	24,146,430
売買損	△ 1,480,033,530
(C)その他費用	**△ 2,730**
(D)当期損益金（A＋B＋C）	**△ 763,486,607**
(E)前期繰越損益金	**24,817,836,094**
(F)解約差損益金	**△ 8,973,370,224**
(G)追加信託差損益金	**11,545,997,159**
(H)合計（D＋E＋F＋G）	**26,626,976,422**
次期繰越損益金（H）	**26,626,976,422**

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

ダイワファンドラップ
外国債券インデックス
（為替ヘッジあり）

運用報告書（全体版）
第５期

（決算日　2021年６月15日）

（作成対象期間　2020年６月16日～2021年６月15日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

<2734>

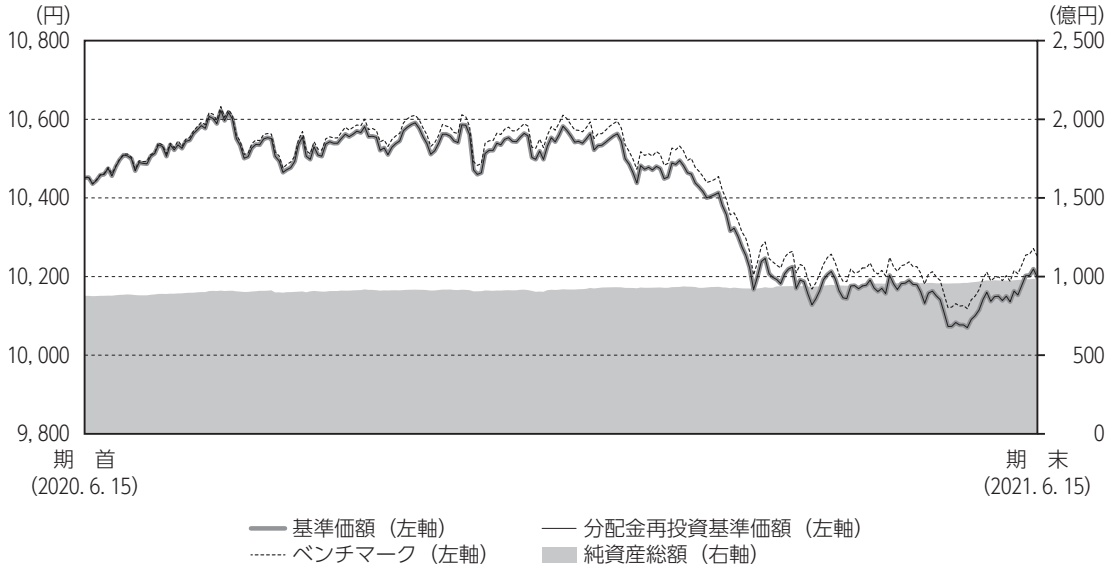
設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）		公社債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1期末（2017年6月15日）	9,710	0	△ 2.9	9,751	△ 2.5	93.8	4.0	33,745
2期末（2018年6月15日）	9,475	0	△ 2.4	9,567	△ 1.9	95.4	2.1	61,154
3期末（2019年6月17日）	9,905	0	4.5	10,050	5.1	97.3	1.4	72,847
4期末（2020年6月15日）	10,451	0	5.5	10,666	6.1	97.5	—	87,728
5期末（2021年6月15日）	10,198	0	△ 2.4	10,462	△ 1.9	98.5	—	98,409

（注1）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注2）FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
（注3）海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
（注4）指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
（注5）公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
（注6）公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。
（注7）債券先物比率は買建比率－売建比率です。

運用経過

基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期　首：10,451円
期　末：10,198円（分配金0円）
騰落率：△2.4%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

日本を除く先進国国債に投資した結果、各国の金利が上昇（債券価格は下落）したため、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年　月　日	基準価額		FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率		
	円	%		%	%	%
（期首）2020年6月15日	10,451	—	10,666	—	97.5	—
6月末	10,507	0.5	10,728	0.6	97.7	—
7月末	10,607	1.5	10,835	1.6	95.8	0.5
8月末	10,472	0.2	10,701	0.3	97.6	—
9月末	10,581	1.2	10,818	1.4	96.0	—
10月末	10,557	1.0	10,797	1.2	96.6	—
11月末	10,564	1.1	10,806	1.3	98.4	—
12月末	10,550	0.9	10,799	1.3	97.6	0.4
2021年1月末	10,482	0.3	10,736	0.7	97.7	0.4
2月末	10,167	△ 2.7	10,413	△ 2.4	98.9	—
3月末	10,146	△ 2.9	10,397	△ 2.5	99.4	—
4月末	10,132	△ 3.1	10,389	△ 2.6	97.4	—
5月末	10,149	△ 2.9	10,407	△ 2.4	98.7	—
（期末）2021年6月15日	10,198	△ 2.4	10,462	△ 1.9	98.5	—

（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

（2020.6.16～2021.6.15）

■海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると上昇しました。

当作成期首より、新型コロナウイルス感染再拡大への懸念が続いていたことなどから、金利は低位で推移しました。しかし2020年8月は、株価が上昇するなどリスク選好姿勢が改善し、金利は上昇しました。10月には、米国大統領・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両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、米国を中心に金利は上昇しました。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。また、米国で今後の金融緩和策の後退が市場で意識されたことも、さらなる金利上昇要因となりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

ポートフォリオについて

（2020.6.16～2021.6.15）

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

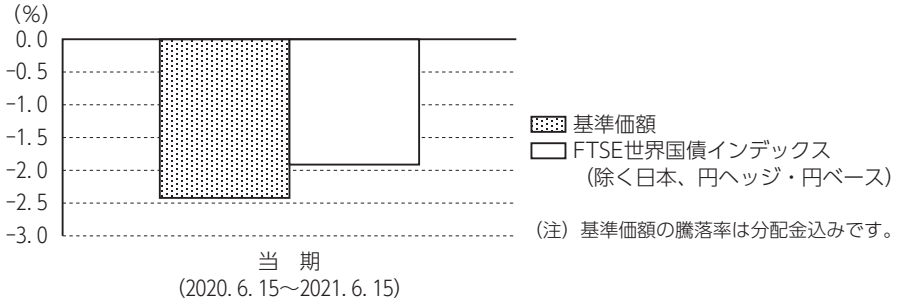
組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△1.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△2.4%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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

分配金について

当作成期は、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6月16日 ～2021年6月15日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**―**
対基準価額比率	（%）	―
当期の収益	（円）	―
当期の収益以外	（円）	―
翌期繰越分配対象額	（円）	858

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

今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

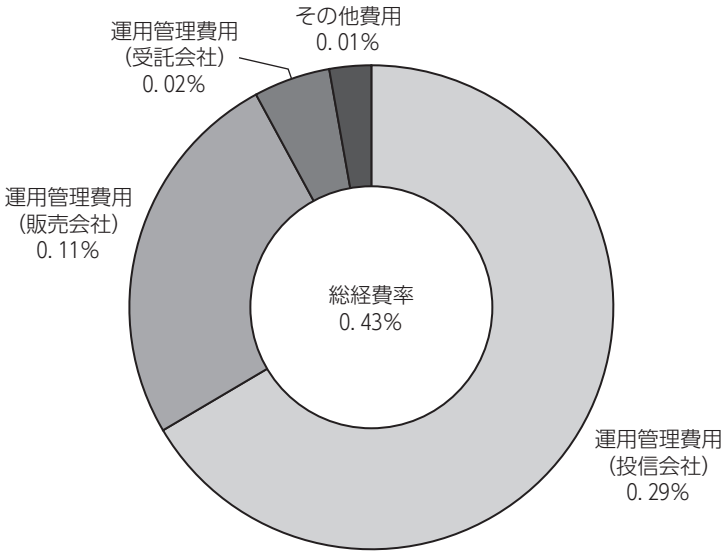
項　目	当　期 (2020. 6. 16～2021. 6. 15) 金　額	比　率	項　目　の　概　要
信　託　報　酬	43円	0. 418%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は10, 407円です。**
（投 信 会 社）	(30)	(0. 286)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(11)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(2)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0. 000	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（先物・オプション）	(0)	(0. 000)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 012	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(1)	(0. 008)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(0)	(0. 002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ　の　他）	(0)	(0. 001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	45	0. 430	

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（１口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0. 43%です。



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

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	19, 089, 250	20, 153, 822	7, 317, 004	7, 773, 244

（注）単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	82, 592, 446	94, 364, 692	98, 120, 406

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年６月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	98, 120, 406	99. 5
コール・ローン等、その他	520, 149	0. 5
投資信託財産総額	98, 640, 556	100. 0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、６月15日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝110. 11円、１カナダ・ドル＝90. 68円、１オーストラリア・ドル＝84. 91円、１シンガポール・ドル＝82. 99円、１イギリス・ポンド＝155. 39円、１イスラエル・シュケル＝33. 923円、１デンマーク・クローネ＝17. 95円、１ノルウェー・クローネ＝13. 22円、１スウェーデン・クローネ＝13. 22円、１メキシコ・ペソ＝5. 517円、１マレーシア・リンギット＝26. 765円、１南アフリカ・ランド＝7. 99円、１ポーランド・ズロチ＝29. 454円、１ユーロ＝133. 45円です。
（注３）外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（117, 429, 476千円）の投資信託財産総額（118, 882, 949千円）に対する比率は、98. 8% です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年６月15日現在

項目	当期末
（A）資産	**98, 640, 556, 667円**
コール・ローン等	520, 149, 779
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド（評価額）	98, 120, 406, 888
（B）負債	**230, 673, 933**
未払解約金	32, 857, 251
未払信託報酬	196, 707, 254
その他未払費用	1, 109, 428
（C）純資産総額（A－B）	**98, 409, 882, 734**
元本	96, 502, 550, 747
次期繰越損益金	1, 907, 331, 987
（D）受益権総口数	**96, 502, 550, 747口**
１万口当り基準価額（C／D）	**10, 198円**

＊期首における元本額は83, 945, 786, 338円、当作成期間中における追加設定元本額は31, 995, 491, 437円、同解約元本額は19, 438, 727, 028円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は10, 198円です。

■損益の状況

当期　自 2020年６月16日　至 2021年６月15日

項目	当期	
（A）配当等収益	△	**86, 516円**
受取利息		9, 516
支払利息	△	96, 032
（B）有価証券売買損益	△	**1, 836, 566, 674**
売買益		183, 210, 409
売買損	△	2, 019, 777, 083
（C）信託報酬等	△	**388, 450, 729**
（D）当期損益金（A＋B＋C）	△	**2, 225, 103, 919**
（E）前期繰越損益金		**4, 583, 769, 770**
（F）追加信託差損益金	△	**451, 333, 864**
（配当等相当額）	(	3, 703, 148, 135)
（売買損益相当額）	(△	4, 154, 481, 999)
（G）合計（D＋E＋F）		**1, 907, 331, 987**
次期繰越損益金（G）		**1, 907, 331, 987**
追加信託差損益金	△	451, 333, 864
（配当等相当額）	(	3, 703, 148, 135)
（売買損益相当額）	(△	4, 154, 481, 999)
分配準備積立金		4, 583, 852, 279
繰越損益金	△	2, 225, 186, 428

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項目	当期
（a）経費控除後の配当等収益	0円
（b）経費控除後の有価証券売買等損益	0
（c）収益調整金	3, 703, 148, 135
（d）分配準備積立金	4, 583, 852, 279
（e）当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	8, 287, 000, 414
（f）分配金	0
（g）翌期繰越分配対象額（e－f）	8, 287, 000, 414
（h）受益権総口数	96, 502, 550, 747口

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

運用報告書　第５期　（決算日　2021年６月15日）

（作成対象期間　2020年６月16日～2021年６月15日）

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

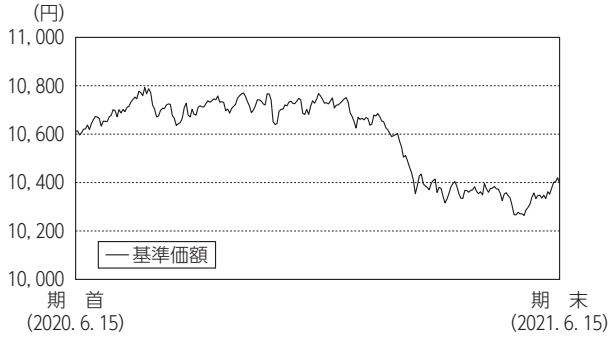
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額	騰落率	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）(ベンチマーク)	騰落率	公社債組入比率	債券先物比率
	円	%		%	%	%
(期首)2020年６月15日	10,612	—	10,666	—	97.6	—
６月末	10,671	0.6	10,728	0.6	97.8	—
７月末	10,777	1.6	10,835	1.6	95.9	0.5
８月末	10,643	0.3	10,701	0.3	97.7	—
９月末	10,758	1.4	10,818	1.4	96.1	—
10月末	10,737	1.2	10,797	1.2	96.7	—
11月末	10,748	1.3	10,806	1.3	98.5	—
12月末	10,737	1.2	10,799	1.3	97.7	0.4
2021年１月末	10,672	0.6	10,736	0.7	97.8	0.4
２月末	10,354	△ 2.4	10,413	△ 2.4	99.2	—
３月末	10,336	△ 2.6	10,397	△ 2.5	99.7	—
４月末	10,325	△ 2.7	10,389	△ 2.6	97.7	—
５月末	10,346	△ 2.5	10,407	△ 2.4	99.0	—
(期末)2021年６月15日	10,398	△ 2.0	10,462	△ 1.9	98.8	—

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,612円　期末：10,398円　騰落率：△2.0%

【基準価額の主な変動要因】

日本を除く先進国国債に投資した結果、各国の金利が上昇（債券価格は下落）したため、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると上昇しました。

当作成期首より、新型コロナウイルス感染再拡大への懸念が続いていたことなどから、金利は低位で推移しました。しかし2020年８月は、株価が上昇するなどリスク選好姿勢が改善し、金利は上昇しました。10月には、米国大統領・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両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、米国を中心に金利は上昇しました。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。また米国で今後の金融緩和策の後退が市場で意識されたこともさらなる金利上昇要因となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△1.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△2.0%となりました。

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

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

《今後の運用方針》

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

■１万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	0円
(先物・オプション)	(0)
有価証券取引税	—
その他費用	1
(保管費用)	(1)
(その他)	(0)
合計	1

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

■売買および取引の状況
(1)公　社　債

(2020年６月16日から2021年６月15日まで)

			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 190,822	千アメリカ・ドル 173,704 (　　—)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 11,299	千カナダ・ドル 11,250 (　　—)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 13,412	千オーストラリア・ドル 13,917 (　　—)
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 2,100	千シンガポール・ドル 916 (　　—)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 14,207	千イギリス・ポンド 15,188 (　　—)
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シュケル 1,387	千イスラエル・シュケル 735 (　　—)
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 5,320	千デンマーク・クローネ 2,389 (　　—)
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 1,955	千ノルウェー・クローネ — (　　—)
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローネ 10,743	千スウェーデン・クローネ 6,446 (　　—)
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 22,055	千メキシコ・ペソ 13,929 (　　—)
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 2,407	千マレーシア・リンギット 2,644 (　　—)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 7,552	千ポーランド・ズロチ 3,948 (　　—)
	ユーロ (アイルランド)	国債証券	千ユーロ 1,558	千ユーロ 333 (　　—)
	ユーロ (オランダ)	国債証券	千ユーロ 4,055	千ユーロ 3,433 (　　—)
	ユーロ (ベルギー)	国債証券	千ユーロ 3,982	千ユーロ 5,536 (　　—)
	ユーロ (フランス)	国債証券	千ユーロ 24,931	千ユーロ 26,924 (　　—)
	ユーロ (ドイツ)	国債証券	千ユーロ 20,776	千ユーロ 17,264 (　　—)
	ユーロ (スペイン)	国債証券	千ユーロ 15,471	千ユーロ 17,187 (　　—)
	ユーロ (イタリア)	国債証券	千ユーロ 21,313	千ユーロ 24,521 (　　—)
	ユーロ (フィンランド)	国債証券	千ユーロ 652	千ユーロ — (　　—)
	ユーロ (オーストリア)	国債証券	千ユーロ 3,031	千ユーロ 3,344 (　　—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	国債証券	千ユーロ 95,771	千ユーロ 98,545 (　　—)

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

(2)先物取引の種類別取引状況

(2020年６月16日から2021年６月15日まで)

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	債券先物取引	百万円 2,069	百万円 2,082	百万円 —	百万円 —

(注１) 金額は受渡し代金。
(注２) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
公　社　債

(2020年６月16日から2021年６月15日まで)

当期			
買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/9/30	2,415,555	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2021/9/30	3,346,760
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2022/11/15	2,119,062	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/2/28	2,515,522
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2027/8/15	1,592,972	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.125% 2021/6/30	2,236,982
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2040/5/15	1,165,225	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/9/30	1,571,039
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2025/11/15	927,282	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2021/11/15	1,469,245
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2025/1/31	923,086	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.875% 2022/1/31	882,586
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2023/11/15	839,250	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2024/5/15	739,151
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.875% 2030/11/15	714,211	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2023/11/15	737,558
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2026/2/15	681,068	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2025/11/15	576,444
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.625% 2027/11/30	679,880	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 1% 2025/8/15	540,164

(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	当期末							
区分	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	443,652	469,818	51,731,693	43.9	—	19.7	15.9	8.2
カナダ	千カナダ・ドル 24,437	千カナダ・ドル 26,507	2,403,686	2.0	—	0.9	0.5	0.6
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 27,307	千オーストラリア・ドル 29,496	2,504,506	2.1	—	1.4	0.5	0.2

作成期	当期末							
区分	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	%	%	%	%	%
シンガポール	5,952	6,486	538,334	0.5	—	0.3	0.1	0.1
	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド						
イギリス	39,617	49,472	7,687,562	6.5	—	5.0	1.1	0.5
	千イスラエル・シュケル	千イスラエル・シュケル						
イスラエル	12,400	13,792	467,886	0.4	—	0.3	—	0.1
	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ						
デンマーク	26,240	32,275	579,343	0.5	—	0.4	0.1	—
	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ						
ノルウェー	15,990	16,387	216,636	0.2	—	0.1	0.0	0.0
	千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ						
スウェーデン	29,970	32,254	426,403	0.4	—	0.2	0.1	0.1
	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ						
メキシコ	146,330	156,447	863,211	0.7	—	0.4	0.2	0.1
	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット						
マレーシア	19,880	20,748	555,350	0.5	—	0.3	0.1	0.0
	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ						
ポーランド	22,995	24,592	724,357	0.6	—	0.3	0.2	0.1
	千ユーロ	千ユーロ						
ユーロ（アイルランド）	6,488	7,481	998,424	0.8	—	0.6	0.2	0.1
	千ユーロ	千ユーロ						
ユーロ（オランダ）	14,220	17,037	2,273,693	1.9	—	1.4	0.3	0.2
	千ユーロ	千ユーロ						
ユーロ（ベルギー）	17,664	21,119	2,818,449	2.4	—	1.7	0.6	0.1
	千ユーロ	千ユーロ						
ユーロ（フランス）	75,446	89,387	11,928,750	10.1	—	6.4	2.9	0.8
	千ユーロ	千ユーロ						
ユーロ（ドイツ）	53,805	66,473	8,870,864	7.5	—	4.9	1.9	0.7
	千ユーロ	千ユーロ						
ユーロ（スペイン）	43,648	53,206	7,100,348	6.0	—	4.0	1.6	0.5
	千ユーロ	千ユーロ						
ユーロ（イタリア）	69,867	84,301	11,250,096	9.5	—	5.9	2.8	0.8
	千ユーロ	千ユーロ						
ユーロ（フィンランド）	5,450	5,879	784,555	0.7	—	0.4	0.2	0.1
	千ユーロ	千ユーロ						
ユーロ（オーストリア）	10,660	12,967	1,730,458	1.5	—	1.0	0.4	0.1
ユーロ（小計）	297,248	357,854	47,755,639	40.5	—	26.3	10.9	3.3
合計	—	—	116,454,613	98.8	—	55.6	29.9	13.3

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

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	34,000	34,727	3,823,856	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	11,000	11,339	1,248,539	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	15,520	15,993	1,761,028	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	11,310	11,876	1,307,748	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	13,905	14,754	1,624,613	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	15,000	16,000	1,761,765	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	9,580	10,195	1,122,628	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	3,300	3,734	411,181	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	7,450	9,800	1,079,097	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	800	1,038	114,328	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	2,700	3,474	382,582	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	1,400	1,975	217,525	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	1,130	1,534	168,914	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	830	1,023	112,717	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,410	1,934	212,964	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,390	1,966	216,569	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	2,270	3,279	361,059	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,170	2,546	280,406	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,500	5,087	560,216	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,100	1,393	153,420	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,532	3,268	359,909	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,000	1,270	139,942	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,200	3,919	431,532	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,940	4,642	511,194	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	7,810	8,295	913,396	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	10,300	10,929	1,203,417	2025/05/15

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	370	428	47,147	2045/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	14,820	15,673	1,725,774	2025/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	25,220	25,757	2,836,179	2022/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	13,800	14,757	1,624,987	2025/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,400	1,623	178,812	2045/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	12,000	12,497	1,376,075	2026/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	9,165	9,540	1,050,503	2026/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,070	1,136	125,088	2046/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,750	5,944	654,595	2026/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,000	5,133	565,255	2023/09/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,850	6,196	682,257	2026/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,330	2,649	291,712	2046/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,670	5,010	551,653	2027/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,500	4,073	448,491	2047/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,550	3,835	422,314	2027/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,250	2,621	288,662	2047/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	13,500	14,485	1,594,998	2027/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	12,200	12,877	1,417,951	2024/07/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,310	3,687	405,976	2047/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	7,000	7,334	807,620	2024/08/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	13,300	14,267	1,570,973	2025/01/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,698	297,101	2025/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,500	5,373	591,670	2048/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,300	7,013	772,302	2028/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,500	1,752	192,996	2048/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	6,300	7,136	785,850	2028/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	1,850	2,312	254,596	2048/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,000	4,389	483,365	2029/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,200	3,746	412,551	2049/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	2,288	252,030	2049/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,000	4,212	463,800	2026/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,100	2,122	233,732	2049/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,400	5,568	613,127	2029/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,909	320,409	2049/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,500	4,537	499,597	2030/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,393	263,564	2050/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,400	2,698	297,114	2050/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	11,800	9,981	1,099,011	2040/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,500	5,108	562,546	2030/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,800	1,475	162,474	2050/08/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	6,900	6,537	719,841	2030/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,800	3,320	365,622	2050/11/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,500	6,305	694,243	2027/11/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	2,300	2,242	246,929	2028/01/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,100	3,809	419,474	2051/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	4,900	4,738	521,788	2031/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	1,900	1,825	201,018	2041/02/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	5,026	553,451	2028/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,700	1,719	189,328	2031/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,000	1,040	114,560	2051/05/15
通貨小計	銘柄数	76銘柄						
	金額				443,652	469,818	51,731,693	
					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	860	1,042	94,501	2064/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	907	1,219	110,558	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,050	1,528	138,623	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	770	1,054	95,597	2041/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,500	1,536	139,353	2022/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	740	972	88,227	2045/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,038	4,130	374,576	2023/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	730	773	70,101	2024/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,100	1,292	117,167	2048/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,492	1,584	143,727	2025/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	820	845	76,677	2026/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	930	930	84,398	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	636	57,730	2028/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,400	2,459	223,046	2023/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	300	324	29,388	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,000	1,048	95,069	2024/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,442	130,806	2024/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,700	1,688	153,141	2030/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	890	80,768	2025/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,105	100,222	2030/12/01
通貨小計	銘柄数	20銘柄						
	金額				24,437	26,507	2,403,686	

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
オーストラリア		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,083	1,193	101,314	2023/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	889	1,090	92,558	2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,156	1,245	105,724	2024/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	320	370	31,469	2029/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,000	3,331	282,844	2025/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	359	473	40,204	2033/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,398	2,817	239,262	2026/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	725	906	77,010	2037/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	800	896	76,100	2035/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	684	805	68,414	2039/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,300	1,449	123,048	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,158	1,254	106,501	2028/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	575	649	55,190	2047/03/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,250	1,398	118,784	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,238	105,175	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,100	2,310	196,206	2030/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	510	557	47,327	2041/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,800	1,810	153,725	2031/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,200	1,166	99,056	2032/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,800	3,664	311,132	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,000	865	73,452	2051/06/21
通貨小計	銘柄数	21銘柄						
	金額				27,307	29,496	2,504,506	
					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	203	231	19,208	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	1,000	1,034	85,860	2022/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	150	161	13,434	2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	600	676	56,154	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	239	277	23,067	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	209	17,409	2023/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	420	500	41,513	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	400	427	35,503	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	330	390	32,398	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	200	213	17,678	2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	260	277	23,057	2036/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	800	880	73,064	2028/05/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	500	520	43,196	2024/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	300	327	27,204	2039/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	350	356	29,582	2050/03/01
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金額				5,952	6,486	538,334	
					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,350	1,451	225,474	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	960	1,394	216,632	2065/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,175	1,244	193,326	2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	250	251	39,050	2022/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	950	998	155,097	2047/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	720	784	121,880	2037/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,100	1,265	196,706	2057/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	350	367	57,031	2027/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	800	861	133,908	2028/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	597	714	110,985	2071/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	800	820	127,428	2024/04/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	800	889	138,242	2049/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	934	145,156	2054/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	600	609	94,722	2029/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	400	400	62,234	2041/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,200	1,201	186,665	2023/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	500	482	74,917	2030/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	250	194	30,293	2061/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,300	1,219	189,514	2035/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	500	470	73,138	2031/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	750	685	106,468	2046/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	513	715	111,250	2028/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,300	1,760	273,600	2032/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,275	1,503	233,576	2025/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	915	1,312	203,998	2036/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	950	1,494	232,289	2038/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	850	1,568	243,689	2055/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	770	1,270	197,376	2046/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,000	2,482	385,681	2027/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	911	1,474	229,081	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	907	1,240	192,789	2030/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	843	1,446	224,812	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,130	1,702	264,585	2039/09/07

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	300	430	66,900	2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	407	758	117,824	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,000	1,531	237,975	2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	700	1,149	178,555	2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,080	2,123	330,005	2022/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,175	1,637	254,389	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	2,490	2,611	405,744	2023/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	908	1,679	260,908	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,500	1,625	252,591	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	490	714	111,059	2045/01/22
通貨小計 銘柄数	43銘柄						
通貨小計 金額				39,617	49,472	7,687,562	
				千イスラエル・シュケル	千イスラエル・シュケル		
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	4.2500	3,500	3,757	127,473	2023/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,200	1,881	63,825	2042/01/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	4,000	4,288	145,487	2027/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	1,000	1,260	42,764	2047/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	1,700	1,668	56,590	2030/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,000	935	31,743	2037/05/31
通貨小計 銘柄数	6銘柄						
通貨小計 金額				12,400	13,792	467,886	
				千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	6,740	11,842	212,576	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,670	2,803	50,326	2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,330	4,756	85,380	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,200	5,460	98,024	2027/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,700	4,941	88,701	2029/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,476	26,507	2052/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	993	17,824	2031/11/15
通貨小計 銘柄数	7銘柄						
通貨小計 金額				26,240	32,275	579,343	
				千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,610	1,655	21,886	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,300	1,377	18,216	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	150	154	2,040	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,430	1,457	19,269	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,000	3,093	40,893	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	4,000	4,189	55,389	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	2,500	2,494	32,981	2030/08/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,000	1,963	25,958	2031/09/17
通貨小計 銘柄数	8銘柄						
通貨小計 金額				15,990	16,387	216,636	
				千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ		
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,520	3,688	48,757	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	6,950	7,206	95,273	2022/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,150	4,332	57,273	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,020	2,236	29,566	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,780	5,061	66,913	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,550	2,669	35,292	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,000	3,138	41,490	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	4,000	3,921	51,835	2031/05/12
通貨小計 銘柄数	8銘柄						
通貨小計 金額				29,970	32,254	426,403	
				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	9,200	9,100	50,210	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	11,450	12,242	67,549	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,900	29,834	164,613	2024/09/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	6,740	7,169	39,557	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,340	7,200	39,729	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	11,800	12,546	69,225	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	2,750	3,503	19,329	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,500	7,318	40,379	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	5,000	5,609	30,950	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,700	24,528	135,338	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	15,900	16,173	89,238	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	9,750	10,178	56,160	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,300	11,042	60,927	2034/11/23
通貨小計 銘柄数	13銘柄						
通貨小計 金額				146,330	156,447	863,211	
				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,760	1,921	51,436	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	500	532	14,257	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	1,250	1,325	35,468	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,000	1,013	27,124	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,500	1,571	42,058	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,150	1,217	32,574	2025/09/15

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,100	1,128	30,194	2022/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,600	1,658	44,398	2023/08/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	1,420	1,500	40,155	2046/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	2,000	2,108	56,425	2024/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,000	1,082	28,962	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	1,500	1,597	42,764	2026/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,200	1,261	33,758	2029/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,301	34,823	2034/07/05
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	700	663	17,752	2040/05/22
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	900	866	23,194	2050/06/15
通貨小計	銘柄数	16銘柄						
	金額				19,880	20,748	555,350	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,200	1,285	37,870	2022/09/23
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,640	2,813	82,871	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,815	1,938	57,108	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,108	91,567	2023/01/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,900	3,063	90,236	2024/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	2,300	2,508	73,885	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.2500	1,800	1,726	50,865	2030/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	600	789	23,251	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	710	770	22,704	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	1,800	1,959	57,719	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,230	4,626	136,275	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金額				22,995	24,592	724,357	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（アイルランド）		IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	688	841	112,267	2025/03/13
		IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	420	453	60,511	2023/03/20
		IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	300	332	44,437	2024/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	680	826	110,319	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	710	908	121,247	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	820	877	117,119	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	570	677	90,424	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	500	538	71,842	2028/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	150	168	22,514	2033/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	1,100	1,238	165,305	2031/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	300	328	43,787	2029/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	250	289	38,648	2050/05/15
国小計	銘柄数	12銘柄						
	金額				6,488	7,481	998,424	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オランダ）		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	580	809	108,040	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,200	1,928	257,314	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,170	1,253	167,287	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,080	1,853	247,314	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	500	515	68,854	2022/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	290	376	50,227	2033/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	750	788	105,280	2023/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	840	1,351	180,325	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	980	1,061	141,706	2024/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	690	714	95,404	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,170	1,232	164,536	2026/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,470	1,578	210,709	2027/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	407	54,366	2024/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	600	648	86,490	2028/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	729	97,404	2029/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	263	35,152	2040/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	750	762	101,806	2030/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	356	47,531	2052/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	404	53,938	2031/07/15
国小計	銘柄数	19銘柄						
	金額				14,220	17,037	2,273,693	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ベルギー）		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,170	1,235	164,814	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	610	749	99,996	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	595	639	85,366	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	764	900	120,128	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	570	794	106,067	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	400	408	54,461	2023/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	730	782	104,413	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	500	519	69,271	2024/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	310	430	57,481	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	700	807	107,697	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	580	624	83,317	2028/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	500	564	75,292	2033/04/22

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	700	759	101,397	2029/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	350	421	56,268	2050/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	900	913	121,953	2030/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	200	192	25,642	2040/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	800	817	109,042	2027/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	500	495	66,130	2031/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,000	1,402	187,152	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	750	1,229	164,064	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	815	1,367	182,471	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	700	870	116,177	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	730	776	103,651	2022/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	300	427	57,011	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,000	1,059	141,408	2023/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	390	647	86,351	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	800	879	117,314	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	300	405	54,102	2034/06/22
国小計	銘柄数	28銘柄						
	金額				17,664	21,119	2,818,449	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フランス）		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,415	4,402	587,524	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,000	3,271	436,611	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,210	3,549	473,690	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,232	2,323	310,013	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,065	1,691	225,797	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,200	1,339	178,801	2023/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,943	3,370	449,848	2041/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,000	1,968	262,673	2060/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,540	4,232	564,802	2026/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,410	4,087	545,417	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	195	202	27,063	2022/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	840	1,307	174,423	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,730	4,951	660,822	2023/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,000	3,255	434,439	2024/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,986	2,441	325,814	2030/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,360	3,632	484,779	2024/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,400	3,540	472,441	2025/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,650	3,031	404,552	2031/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,800	2,933	391,506	2026/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,350	1,513	201,969	2036/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,100	1,377	183,828	2066/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,570	1,625	216,987	2026/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	2,183	291,449	2039/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,513	202,004	2027/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,800	2,308	308,045	2048/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,820	242,994	2023/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,000	2,139	285,564	2028/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	2,017	269,210	2034/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,750	2,945	393,072	2028/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,237	298,601	2024/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,200	1,388	185,257	2050/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,100	3,256	434,619	2029/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,421	456,656	2029/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	700	664	88,703	2052/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	783	104,583	2040/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,195	292,999	2030/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	100	76	10,234	2072/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	400	381	50,944	2044/06/25
国小計	銘柄数	38銘柄						
	金額				75,446	89,387	11,928,750	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ドイツ）		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	455	654	87,343	2027/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	800	1,131	151,050	2028/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	800	1,103	147,275	2028/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	3,696	5,851	780,844	2030/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,660	2,609	348,196	2031/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	3,270	5,390	719,366	2034/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	990	1,612	215,181	2037/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	720	1,268	169,242	2039/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,810	3,426	457,258	2040/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	356	589	78,644	2042/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,542	1,581	211,070	2022/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,648	2,524	336,853	2044/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,150	1,192	159,151	2023/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,460	1,546	206,408	2023/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,800	4,053	540,883	2024/02/15

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,625	2,537	338,647	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	990	1,054	140,762	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,000	2,109	281,571	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,243	165,886	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,300	4,604	614,439	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	883	931	124,246	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,050	2,115	282,280	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	550	576	76,890	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,100	3,302	440,721	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,260	1,584	211,505	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	750	801	106,923	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,999	266,793	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,400	1,473	196,638	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,190	158,825	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	721	96,233	2030/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	308	41,154	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	369	49,373	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,816	242,395	2022/10/07
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,650	1,671	223,035	2023/04/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,016	135,715	2023/10/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	509	68,052	2024/04/05
国小計 銘柄数	36銘柄						
国小計 金額				53,805	66,473	8,870,864	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（スペイン）	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,420	2,061	275,173	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,100	2,264	302,263	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,410	1,624	216,746	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,565	2,849	380,246	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,000	1,110	148,141	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	589	799	106,640	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,530	2,375	316,976	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,649	1,786	238,387	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,100	1,208	161,248	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,320	1,593	212,640	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,670	1,833	244,630	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,150	2,358	314,693	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	550	724	96,692	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	500	552	73,689	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,200	1,376	183,659	2035/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,200	1,241	165,695	2029/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	1,022	136,388	2030/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,200	1,303	174,000	2030/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	500	509	68,041	2040/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	300	291	38,924	2031/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,480	2,330	310,941	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	900	1,348	179,890	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	900	1,514	202,130	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,243	2,064	275,445	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,000	1,318	175,935	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	3,810	4,181	558,002	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	2,188	2,447	326,627	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,300	1,789	238,798	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,090	1,978	264,026	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	2,700	3,035	405,098	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,084	2,312	308,568	2024/10/31
国小計 銘柄数	31銘柄						
国小計 金額				43,648	53,206	7,100,348	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（イタリア）	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,300	1,798	239,973	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,635	2,276	303,856	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,100	3,386	451,974	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,105	1,466	195,734	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	920	978	130,605	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,500	1,626	216,995	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	900	981	131,008	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	818	109,269	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,200	1,456	194,329	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,200	1,228	163,920	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,150	2,466	329,105	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	2,400	2,456	327,761	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,300	1,573	210,026	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,300	1,519	202,838	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,700	1,900	253,596	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	650	894	119,381	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,550	1,719	229,517	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	700	710	94,843	2022/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,500	2,775	370,403	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,400	1,643	219,351	2028/12/01

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,300	1,445	192,958	2025/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	500	642	85,714	2035/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	800	1,179	157,395	2049/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	400	479	63,948	2029/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	900	992	132,463	2026/07/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	500	531	70,982	2030/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,600	2,668	356,154	2030/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	600	632	84,399	2041/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,100	1,082	144,424	2031/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	250	250	33,402	2072/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	1,540	2,135	285,048	2029/11/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	1,988	2,989	398,948	2031/05/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,000	1,534	204,817	2033/02/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,650	2,446	326,543	2034/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	1,270	1,764	235,497	2037/02/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,640	2,600	346,990	2039/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	3,870	4,293	573,028	2023/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,400	2,858	381,517	2025/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,014	3,222	430,077	2040/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	3,250	3,939	525,728	2026/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	500	535	71,523	2022/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	3,170	3,428	457,590	2022/11/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,080	1,413	188,604	2028/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	725	1,170	156,253	2044/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,030	2,293	306,069	2024/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,110	2,379	317,500	2024/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,370	1,708	228,015	2030/03/01
国小計	銘柄数	47銘柄						
	金額				69,867	84,301	11,250,096	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フィンランド）		Finland Government Bond	国債証券	0.7500	690	744	99,368	2031/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.8750	800	849	113,387	2025/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	180	189	25,230	2026/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.3750	270	328	43,875	2047/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	200	211	28,211	2027/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.1250	150	168	22,480	2034/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	529	70,596	2028/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	316	42,300	2029/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	150	146	19,562	2036/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.2500	150	145	19,416	2040/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	200	174	23,302	2052/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	200	237	31,741	2025/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	120	146	19,537	2028/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	1.6250	980	1,008	134,569	2022/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	210	304	40,685	2042/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.0000	350	376	50,287	2024/04/15
国小計	銘柄数	16銘柄						
	金額				5,450	5,879	784,555	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オーストリア）		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	140	150	20,126	2025/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	490	522	69,706	2026/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	120	146	19,580	2047/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	280	365	48,727	2086/11/02
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,000	1,054	140,672	2027/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	150	246	32,914	2117/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	643	85,851	2028/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	700	738	98,584	2029/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	150	151	20,220	2030/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	616	82,294	2051/03/20
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	380	536	71,549	2027/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	700	1,121	149,618	2037/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	700	881	117,674	2026/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.4000	860	910	121,483	2022/11/22
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	370	768	102,489	2062/01/26
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	630	1,001	133,697	2044/06/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.7500	1,280	1,352	180,492	2023/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	630	811	108,285	2034/05/23
		Austria Government Bond	国債証券	1.6500	880	947	126,490	2024/10/21
国小計	銘柄数	19銘柄						
	金額				10,660	12,967	1,730,458	
通貨小計	銘柄数	246銘柄						
	金額				297,248	357,854	47,755,639	
合計	銘柄数	490銘柄						
	金額						116,454,613	

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

■投資信託財産の構成

2021年６月15日現在

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　　率
	千円	%
公社債	116, 454, 613	98. 0
コール・ローン等、その他	2, 428, 335	2. 0
投資信託財産総額	118, 882, 949	100. 0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、６月15日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝110. 11円、１カナダ・ドル＝90. 68円、１オーストラリア・ドル＝84. 91円、１シンガポール・ドル＝82. 99円、１イギリス・ポンド＝155. 39円、１イスラエル・シュケル＝33. 923円、１デンマーク・クローネ＝17. 95円、１ノルウェー・クローネ＝13. 22円、１スウェーデン・クローネ＝13. 22円、１メキシコ・ペソ＝5. 517円、１マレーシア・リンギット＝26. 765円、１南アフリカ・ランド＝7. 99円、１ポーランド・ズロチ＝29. 454円、１ユーロ＝133. 45円です。
（注３）当期末における外貨建純資産（117, 429, 476千円）の投資信託財産総額（118, 882, 949千円）に対する比率は、98. 8% です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年６月15日現在

項　　目	当　期　末
（Ａ）資産	**235, 859, 710, 597円**
コール・ローン等	1, 335, 120, 176
公社債（評価額）	116, 454, 613, 580
未収入金	117, 111, 558, 041
未収利息	691, 495, 343
前払費用	29, 810, 030
差入委託証拠金	237, 113, 427
（Ｂ）負債	**117, 941, 822, 997**
未払金	117, 920, 150, 415
未払解約金	21, 672, 582
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）	**117, 917, 887, 600**
元本	113, 403, 229, 819
次期繰越損益金	4, 514, 657, 781
（Ｄ）受益権総口数	**113, 403, 229, 819口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）	**10, 398円**

＊期首における元本額は107, 167, 679, 077円、当作成期間中における追加設定元本額は34, 627, 106, 696円、同解約元本額は28, 391, 555, 954円です。
＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）94, 364, 692, 141円、ダイワファンドラップオンライン外国債券インデックス（為替ヘッジあり）4, 709, 710, 877円、ダイワバランスファンド2020-07（適格機関投資家専用）3, 285, 353, 528円、ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）3, 199, 296, 043円、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）7, 844, 177, 230円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は10, 398円です。

■損益の状況

当期　自 2020年６月16日　至 2021年６月15日

項　　目		当　　期
（Ａ）配当等収益		**2, 495, 845, 058円**
受取利息		2, 497, 977, 180
支払利息	△	2, 132, 122
（Ｂ）有価証券売買損益	△	**4, 843, 569, 031**
売買益		15, 143, 958, 619
売買損	△	19, 987, 527, 650
（Ｃ）先物取引等損益	△	**1, 738, 460**
取引益		3, 702, 529
取引損	△	5, 440, 989
（Ｄ）その他費用	△	**10, 655, 033**
（Ｅ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ）	△	**2, 360, 117, 466**
（Ｆ）前期繰越損益金		**6, 558, 539, 080**
（Ｇ）解約差損益金	△	**1, 657, 611, 174**
（Ｈ）追加信託差損益金		**1, 973, 847, 341**
（Ｉ）合計（Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ）		**4, 514, 657, 781**
次期繰越損益金（Ｉ）		**4, 514, 657, 781**

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

ダイワファンドラップ
外国債券インデックス
（為替ヘッジなし）

運用報告書（全体版）
第５期
（決算日　2021年６月15日）
（作成対象期間　2020年６月16日～2021年６月15日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、外国の公社債に投資し、投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

<2735>

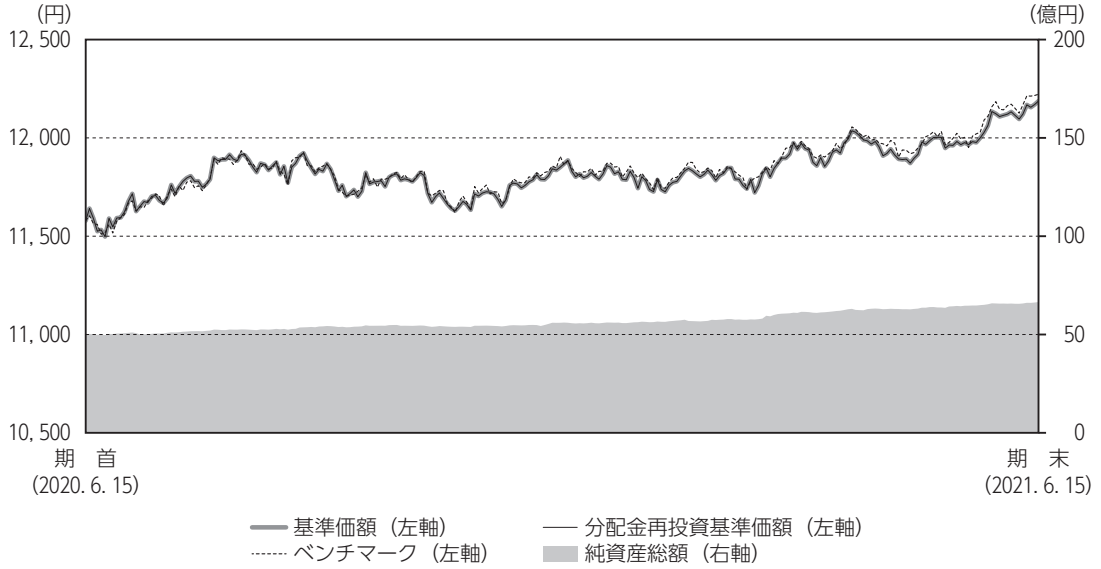
設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）		公社債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末（2017年 6 月15日）	10, 622	0	6. 2	10, 625	6. 3	98. 8	—	1, 404
2 期末（2018年 6 月15日）	10, 709	0	0. 8	10, 815	1. 8	98. 6	—	2, 405
3 期末（2019年 6 月17日）	10, 978	0	2. 5	11, 109	2. 7	98. 5	—	3, 676
4 期末（2020年 6 月15日）	11, 579	0	5. 5	11, 801	6. 2	98. 3	—	4, 949
5 期末（2021年 6 月15日）	12, 187	0	5. 3	12, 457	5. 6	98. 7	—	6, 651

（注 1 ）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注 2 ）FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10, 000として大和アセットマネジメントが計算したものです。FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営されている債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
（注 3 ）海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
（注 4 ）指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
（注 5 ）公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
（注 6 ）公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。
（注 7 ）債券先物比率は買建比率－売建比率です。

運用経過

基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期　首：11, 579円
期　末：12, 187円（分配金 0 円）
騰落率：5. 3%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

日本を除く先進国国債に投資した結果、債券市場で金利が上昇（債券価格は下落）したものの、為替相場で円安が進んだことなどから、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。

年　月　日	基準価額		FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率		
	円	%		%	%	%
（期首）2020年6月15日	11,579	—	11,801	—	98.3	—
6月末	11,677	0.8	11,892	0.8	98.1	—
7月末	11,789	1.8	12,022	1.9	97.9	—
8月末	11,772	1.7	11,986	1.6	98.3	—
9月末	11,823	2.1	12,040	2.0	98.0	—
10月末	11,642	0.5	11,874	0.6	98.0	—
11月末	11,758	1.5	11,999	1.7	98.4	—
12月末	11,851	2.3	12,100	2.5	98.4	—
2021年1月末	11,832	2.2	12,072	2.3	98.1	—
2月末	11,722	1.2	12,022	1.9	98.3	—
3月末	11,975	3.4	12,192	3.3	98.1	—
4月末	11,967	3.4	12,236	3.7	98.2	—
5月末	12,123	4.7	12,419	5.2	98.5	—
（期末）2021年6月15日	12,187	5.3	12,457	5.6	98.7	—

（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

（2020.6.16～2021.6.15）

■海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると上昇しました。

当作成期首より、新型コロナウイルス感染再拡大への懸念が続いていたことなどから、金利は低位で推移しました。しかし2020年8月は、株価が上昇するなどリスク選好姿勢が改善し、金利は上昇しました。10月には、米国大統領・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両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、米国を中心に金利は上昇しました。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。また、米国で今後の金融緩和策の後退が市場で意識されたことも、さらなる金利上昇要因となりました。

■為替相場

為替相場は当作成期を通して見ると円安となりました。

対円為替相場は、当作成期首より、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。2020年11月以降は、新型コロナウイルスのワクチン開発に進展があったことで、市場のリスク選好姿勢が強まり、投資対象通貨は上昇（円安）しました。2021年に入ると、米国において民主党が大統領府・議会上下両院を制したことから、株価が上昇するなど市場のリスク選好姿勢が強まり、円安となりました。3月には、米国での追加経済対策の成立や、経済指標の改善によって米国金利が上昇したことなどから米ドルが買い進められ、全般的に円安が進行しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

ポートフォリオについて

（2020. 6. 16 ～ 2021. 6. 15）

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れました。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

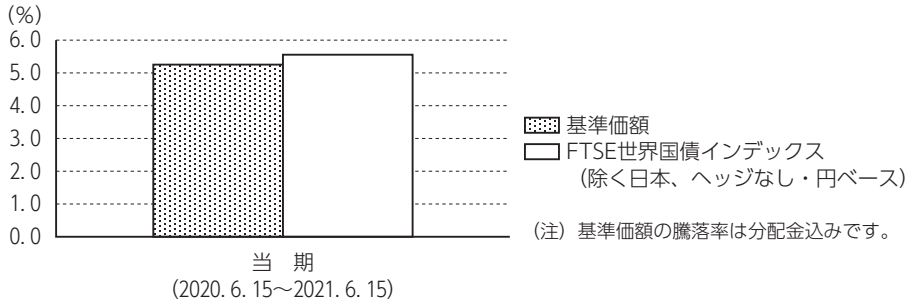
組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックスマザーファンド	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は5. 6％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は5. 3％となりました。

当作成期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0. 1％程度でした。ただし、これ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。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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

分配金について

当作成期は、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６月16日 ～2021年６月15日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**―**
対基準価額比率	（％）	―
当期の収益	（円）	―
当期の収益以外	（円）	―
翌期繰越分配対象額	（円）	2,186

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

今後の運用方針

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

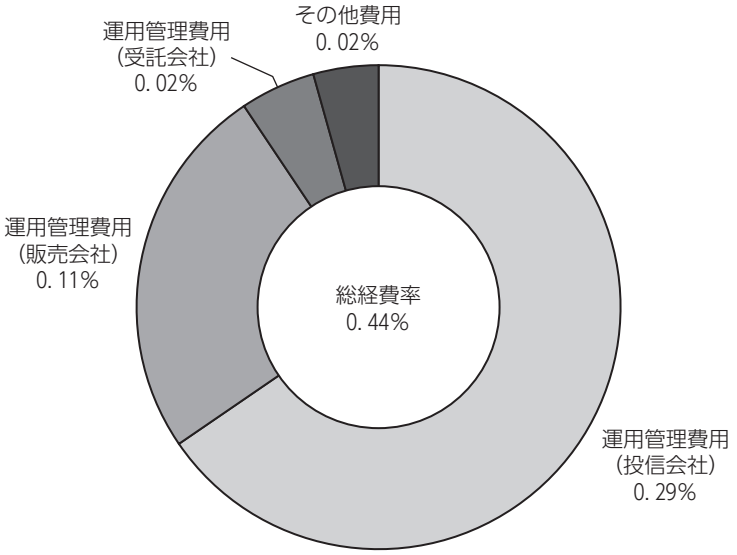
項　目	当　期 (2020. 6. 16～2021. 6. 15) 金　額	比　率	項　目　の　概　要
信託報酬	49円	0. 418%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は11, 831円です。**
（投信会社）	(34)	(0. 286)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販売会社）	(13)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	2	0. 019	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0. 010)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(1)	(0. 008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（その他）	(0)	(0. 000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　計	52	0. 437	

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（１口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0. 44%です。



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

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	617,909	1,872,983	168,982	511,545

（注）単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	1,671,366	2,120,293	6,631,853

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年６月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
外国債券インデックスマザーファンド	6,631,853	99.5
コール・ローン等、その他	34,249	0.5
投資信託財産総額	6,666,102	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、６月15日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝110.11円、１カナダ・ドル＝90.68円、１オーストラリア・ドル＝84.91円、１シンガポール・ドル＝82.99円、１イギリス・ポンド＝155.39円、１イスラエル・シュケル＝33.923円、１デンマーク・クローネ＝17.95円、１ノルウェー・クローネ＝13.22円、１スウェーデン・クローネ＝13.22円、１メキシコ・ペソ＝5.517円、１マレーシア・リンギット＝26.765円、１ポーランド・ズロチ＝29.454円、１ユーロ＝133.45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（225,038,830千円）の投資信託財産総額（225,766,855千円）に対する比率は、99.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年６月15日現在

項目	当期末
（A）資産	**6,666,102,833円**
コール・ローン等	34,249,021
外国債券インデックスマザーファンド（評価額）	6,631,853,812
（B）負債	**14,712,046**
未払解約金	1,868,031
未払信託報酬	12,595,511
その他未払費用	248,504
（C）純資産総額（A－B）	**6,651,390,787**
元本	5,457,959,297
次期繰越損益金	1,193,431,490
（D）受益権総口数	**5,457,959,297口**
１万口当り基準価額（C／D）	**12,187円**

＊期首における元本額は4,275,100,523円、当作成期間中における追加設定元本額は1,968,605,898円、同解約元本額は785,747,124円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は12,187円です。

■損益の状況

当期　自 2020年６月16日　至 2021年６月15日

項目	当期
（A）配当等収益	△ **4,659円**
受取利息	376
支払利息	△ 5,035
（B）有価証券売買損益	**308,029,458**
売買益	325,272,102
売買損	△ 17,242,644
（C）信託報酬等	△ **24,189,781**
（D）当期損益金（A＋B＋C）	**283,835,018**
（E）前期繰越損益金	**207,625,371**
（F）追加信託差損益金	**701,971,101**
（配当等相当額）	(190,854,530)
（売買損益相当額）	(511,116,571)
（G）合計（D＋E＋F）	**1,193,431,490**
次期繰越損益金（G）	**1,193,431,490**
追加信託差損益金	701,971,101
（配当等相当額）	(190,854,530)
（売買損益相当額）	(511,116,571)
分配準備積立金	491,465,048
繰越損益金	△ 4,659

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項目	当期
（a）経費控除後の配当等収益	0円
（b）経費控除後の有価証券売買等損益	283,836,013
（c）収益調整金	701,971,101
（d）分配準備積立金	207,629,035
（e）当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	1,193,436,149
（f）分配金	0
（g）翌期繰越分配対象額（e－f）	1,193,436,149
（h）受益権総口数	5,457,959,297口

＜補足情報＞

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

■外国債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄

公　社　債

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond（アメリカ）0.25% 2023/4/15	1,379,204	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）0.25% 2023/4/15	1,037,740
United States Treasury Note/Bond（アメリカ）1.125% 2031/2/15	1,124,989	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）3.125% 2028/11/15	575,884
United States Treasury Note/Bond（アメリカ）0.625% 2030/8/15	1,039,310	FRENCH GOVERNMENT BOND（フランス）2022/5/25	537,178
United States Treasury Note/Bond（アメリカ）0.875% 2030/11/15	1,019,561	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）1.5% 2021/9/30	536,388
United States Treasury Note/Bond（アメリカ）1.375% 2050/8/15	786,370	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% 2025/6/30	783,138	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）0.75% 2028/1/31	751,258	FRENCH GOVERNMENT BOND（フランス）3% 2022/4/25	502,618
United States Treasury Note/Bond（アメリカ）1.625% 2050/11/15	697,631	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2.25% 2027/2/15	457,380
United States Treasury Note/Bond（アメリカ）0.25% 2025/9/30	679,021	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2% 2021/12/31	426,726
United States Treasury Note/Bond（アメリカ）1.25% 2028/4/30	658,776	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）1.75% 2022/2/28	425,727

（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６月15日現在における外国債券インデックスマザーファンド（72,148,022千口）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

作成期		2021年６月15日現在							
区分		額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
			外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ		千アメリカ・ドル 863,815	千アメリカ・ドル 899,132	千円 99,003,442	% 43.9	% —	% 19.3	% 16.6	% 8.0
カナダ		千カナダ・ドル 48,322	千カナダ・ドル 51,059	4,630,119	2.1	—	0.9	0.6	0.6
オーストラリア		千オーストラリア・ドル 52,964	千オーストラリア・ドル 57,046	4,843,798	2.1	—	1.5	0.5	0.2
シンガポール		千シンガポール・ドル 10,368	千シンガポール・ドル 11,311	938,720	0.4	—	0.3	0.1	0.0
イギリス		千イギリス・ポンド 77,144	千イギリス・ポンド 95,030	14,766,733	6.5	—	4.9	1.1	0.5
イスラエル		千イスラエル・シュケル 26,200	千イスラエル・シュケル 29,168	989,495	0.4	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク		千デンマーク・クローネ 49,011	千デンマーク・クローネ 60,953	1,094,123	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ノルウェー		千ノルウェー・クローネ 41,134	千ノルウェー・クローネ 42,172	557,518	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン		千スウェーデン・クローネ 54,670	千スウェーデン・クローネ 59,685	789,045	0.3	—	0.2	0.1	0.1
メキシコ		千メキシコ・ペソ 302,034	千メキシコ・ペソ 323,909	1,787,203	0.8	—	0.4	0.3	0.1
マレーシア		千マレーシア・リンギット 38,542	千マレーシア・リンギット 40,136	1,074,289	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ポーランド		千ポーランド・ズロチ 44,409	千ポーランド・ズロチ 47,091	1,387,042	0.6	—	0.3	0.2	0.1
ユーロ	アイルランド	千ユーロ 12,377	千ユーロ 13,781	1,839,081	0.8	—	0.6	0.2	0.1
	オランダ	千ユーロ 28,025	千ユーロ 32,643	4,356,216	1.9	—	1.4	0.4	0.2
	ベルギー	千ユーロ 33,612	千ユーロ 40,364	5,386,624	2.4	—	1.8	0.5	0.1
	フランス	千ユーロ 146,837	千ユーロ 171,980	22,950,766	10.2	—	6.5	2.8	0.9
	ドイツ	千ユーロ 109,078	千ユーロ 128,424	17,138,212	7.6	—	4.7	1.9	1.0
	スペイン	千ユーロ 85,721	千ユーロ 101,212	13,506,742	6.0	—	4.0	1.6	0.4
	イタリア	千ユーロ 138,642	千ユーロ 161,413	21,540,574	9.5	—	5.9	2.8	0.9
	フィンランド	千ユーロ 9,844	千ユーロ 10,610	1,415,960	0.6	—	0.4	0.2	0.0
	オーストリア	千ユーロ 21,451	千ユーロ 24,962	3,331,211	1.5	—	0.9	0.4	0.1
	小計	585,587	685,390	91,465,390	40.5	—	26.2	10.7	3.6
合計		—	—	223,326,922	99.0	—	54.9	30.6	13.5

（注１）邦貨換算金額は、2021年６月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
（注２）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注３）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。
（注４）評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

2021年6月15日現在							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,588	285,061	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,668	6,810	749,925	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,484	493,740	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,827	531,599	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,568	4,796	528,186	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,327	586,636	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,577	614,151	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	5,227	575,610	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	740	81,488	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,063	117,047	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	932	102,695	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	908	100,037	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	949	104,572	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	1,007	110,937	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	3,245	357,411	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,596	175,771	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	1,221	134,465	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	744	82,024	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	715	78,829	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	1,293	142,458	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,512	166,567	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,474	162,317	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,659	182,757	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,429	157,363	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	2,310	254,389	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,412	155,502	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,994	219,665	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,811	199,457	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,887	207,836	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,939	213,506	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,699	187,149	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,904	209,723	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,557	171,476	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,231	2,471	272,159	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	1,804	198,688	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	3,085	339,715	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	2,598	286,083	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	4,071	448,266	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	2,686	295,802	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	4,202	462,788	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	4,074	448,658	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	6,556	721,989	2024/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	2,272	250,277	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	6,288	692,474	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,746	3,171	349,261	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	6,059	667,211	2025/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	2,719	299,395	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	6,141	676,250	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,835	3,280	361,252	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	1,326	1,349	148,560	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,881	317,242	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,079	3,145	346,375	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	6,073	668,766	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,373	3,824	421,075	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,497	275,012	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,524	277,995	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	6,245	687,675	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	659	764	84,169	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,620	288,514	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,287	6,459	711,298	2022/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,992	5,146	566,626	2022/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,866	5,067	557,998	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,628	289,425	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,148	3,342	367,992	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,962	3,031	333,751	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,623	3,711	408,634	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,729	8,045	885,907	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,127	234,220	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,823	2,997	330,022	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,570	283,090	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	3,074	338,482	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	5,583	614,750	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	3,524	388,060	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,843	313,100	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,462	271,190	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,571	283,192	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,613	618,113	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,583	284,477	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,500	1,705	187,797	2046/11/15

2021年6月15日現在							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,606	286,950	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,627	289,294	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,640	3,905	429,982	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,610	287,409	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,545	4,125	454,258	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,416	266,103	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,550	4,783	526,691	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	6,914	761,355	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	2,330	256,589	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	3,146	346,407	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,048	335,645	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,562	612,487	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,052	336,084	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,521	277,641	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	6,330	697,073	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,958	325,772	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,166	348,676	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,450	3,842	423,147	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,200	3,259	358,874	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	2,095	230,748	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,557	281,584	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,500	2,641	290,896	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,564	282,423	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,900	649,699	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,500	3,899	429,326	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,716	409,197	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,386	372,872	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	2,978	327,937	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,627	399,443	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,350	7,015	772,474	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,440	378,816	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,789	307,107	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,923	321,928	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,800	4,434	488,289	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,900	3,022	332,787	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	3,129	344,637	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,200	5,015	552,225	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	7,236	796,819	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,621	288,661	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	2,071	228,037	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,873	426,527	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,626	289,220	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,625	289,047	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	3,261	359,128	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,850	4,060	447,120	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	7,465	821,993	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,220	4,931	542,964	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,732	300,886	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,803	418,784	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,921	431,758	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,750	302,876	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,183	350,549	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,754	303,306	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,252	468,187	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,700	4,191	461,531	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,520	5,649	622,041	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,292	362,547	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	2,129	234,525	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,500	3,803	418,774	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,650	291,898	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	7,243	797,552	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	4,235	466,364	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,718	299,306	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	5,502	605,934	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,705	297,866	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,487	383,983	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,677	294,789	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	5,321	585,971	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	4,210	463,598	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,695	406,866	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	3,016	332,103	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,558	391,832	2022/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,196	351,930	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,650	401,925	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	2,948	324,660	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,000	4,072	448,411	2022/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,500	5,739	632,027	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,633	289,919	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,807	529,300	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,500	3,557	391,736	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	4,649	511,986	2049/08/15

2021年6月15日現在							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,877	316,869	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	4,112	452,825	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,052	336,110	2022/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,599	286,197	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,108	342,327	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,900	2,948	324,705	2022/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	1,036	114,126	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,118	343,374	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,850	6,032	664,221	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	4,676	514,943	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	2,078	228,898	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,110	342,443	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,067	337,798	2022/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,616	288,058	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,613	287,769	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	4,087	450,037	2023/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,700	1,754	193,137	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,250	2,296	252,875	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,000	5,041	555,108	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,200	3,304	363,803	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	5,170	569,299	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	303	33,387	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	5,318	585,632	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,200	4,226	465,403	2023/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,500	1,498	165,047	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,200	3,206	353,024	2023/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,570	172,967	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	7,800	7,269	800,481	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,498	385,188	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,682	295,391	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,400	2,336	257,221	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	4,444	489,364	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,229	465,682	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	500	500	55,084	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,399	374,289	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,962	326,250	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,500	5,509	606,664	2023/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,500	5,502	605,919	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	7,500	7,399	814,791	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,394	373,792	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	998	109,993	2023/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,350	368,915	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,501	385,593	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	800	798	87,974	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	10,000	9,289	1,022,811	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,804	529,040	2027/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	6,700	5,492	604,767	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	6,000	5,058	556,962	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,383	372,570	2027/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	3,001	330,481	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,996	219,865	2023/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	6,391	703,748	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	3,000	330,432	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,830	421,787	2027/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,445	379,361	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,200	4,191	461,555	2023/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	3,002	330,600	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	9,800	9,285	1,022,383	2030/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,500	385,489	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,928	432,573	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,000	3,853	424,315	2027/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,800	5,941	654,270	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,100	4,490	494,454	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	3,000	330,379	2022/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,100	5,031	554,036	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,850	534,033	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,992	329,464	2023/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,842	533,191	2027/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	1,000	985	108,504	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,700	1,700	187,192	2022/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,000	3,987	439,026	2024/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	7,000	6,825	751,523	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,900	5,482	603,634	2051/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	10,700	10,347	1,139,414	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,000	4,982	548,656	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,999	220,202	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,921	541,856	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,992	549,707	2028/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,700	4,515	497,256	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,000	2,967	326,729	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,999	220,175	2023/02/28

2021年6月15日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,998	220,021	2024/03/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,998	330,211	2023/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	5,026	553,451	2028/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,999	440,422	2026/03/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	3,000	3,006	331,036	2024/04/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,528	278,424	2031/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,100	5,090	560,482	2024/05/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,500	4,496	495,143	2026/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,400	3,398	374,183	2023/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	6,026	663,599	2028/04/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	600	624	68,736	2051/05/15
通貨小計	銘柄数	252銘柄						
	金額				863,815	899,132	99,003,442	
					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	490	44,503	2064/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,321	119,822	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,626	147,469	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,482	134,468	2037/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	913	1,250	113,351	2041/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,751	1,793	162,672	2022/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	961	1,263	114,577	2045/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,281	116,231	2023/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,487	134,922	2024/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,570	142,412	2048/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,228	111,359	2025/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	999	90,610	2026/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,240	112,530	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,750	1,766	160,200	2022/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	650	689	62,540	2028/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,300	4,406	399,625	2023/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,300	1,346	122,098	2023/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,360	3,389	307,390	2051/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,317	119,512	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,258	114,083	2024/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,442	130,806	2024/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	3,427	310,787	2030/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	700	715	64,916	2025/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,860	259,355	2025/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,300	208,653	2022/08/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	699	63,472	2022/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,565	141,982	2030/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,100	2,042	185,189	2026/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,191	108,055	2024/04/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,499	135,969	2023/02/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,100	1,098	99,608	2023/05/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	300	300	27,284	2026/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	600	602	54,612	2031/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	100	99	9,041	2023/08/01
通貨小計	銘柄数	34銘柄						
	金額				48,322	51,059	4,630,119	
					千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
オーストラリア		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,162	1,234	104,823	2022/07/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,268	2,498	212,170	2023/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,989	2,438	207,084	2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,973	2,125	180,445	2024/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,304	2,668	226,583	2029/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,498	2,773	235,515	2025/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,258	1,659	140,883	2033/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,748	3,229	274,184	2026/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,392	118,223	2037/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,307	1,464	124,329	2035/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	932	79,216	2039/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,672	2,978	252,911	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,178	1,275	108,340	2028/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	1,415	120,171	2047/03/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,800	2,014	171,050	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,850	1,909	162,146	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,900	2,130	180,911	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,370	3,708	314,864	2030/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,390	1,519	128,990	2041/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	2,856	242,545	2031/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,300	1,263	107,311	2032/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,400	203,839	2024/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,500	3,374	286,569	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,400	1,211	102,833	2051/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,878	159,486	2025/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,382	202,321	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,187	100,860	2026/09/21

2021年6月15日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,100	1,120	95,183	2032/11/21
通貨小計	銘柄数	28銘柄						
	金額				52,964	57,046	4,843,798	
					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	880	73,050	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	788	815	67,658	2022/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	623	672	55,797	2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	809	912	75,715	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	465	38,606	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	671	703	58,409	2023/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	676	56,141	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	700	58,118	2029/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	560	46,509	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	813	67,545	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	479	39,775	2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	750	801	66,512	2036/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	450	460	38,211	2023/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	605	50,231	2028/05/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	490	510	42,332	2024/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	382	31,739	2039/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	710	723	60,010	2050/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	150	148	12,353	2025/11/01
通貨小計	銘柄数	18銘柄						
	金額				10,368	11,311	938,720	
					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,621	1,742	270,735	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,682	2,442	379,558	2065/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,551	241,041	2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	2,320	2,332	362,390	2022/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,940	2,038	316,725	2047/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,350	2,560	397,805	2037/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,810	2,082	323,672	2057/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,410	1,478	229,754	2027/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	3,000	3,043	472,994	2023/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,500	1,615	251,079	2028/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	770	921	143,147	2071/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	1,800	1,845	286,714	2024/04/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,110	1,234	191,811	2049/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	934	145,156	2054/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	800	812	126,296	2029/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	2,600	2,644	410,866	2025/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,190	1,191	185,148	2041/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	2,300	2,302	357,775	2023/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	2,300	2,217	344,620	2030/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	750	584	90,881	2061/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,487	231,185	2026/01/30
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,600	1,557	242,023	2028/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	926	143,961	2050/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,300	1,219	189,514	2035/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,300	1,299	201,938	2024/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	600	564	87,765	2031/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	500	456	70,979	2046/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	100	99	15,514	2026/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	300	297	46,244	2051/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,324	205,802	2028/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,840	2,492	387,249	2032/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,735	269,666	2025/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,662	2,384	370,541	2036/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,357	2,135	331,807	2038/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,908	3,520	547,010	2055/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,366	2,253	350,150	2046/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,528	237,579	2027/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,416	3,909	607,530	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,830	2,501	388,764	2030/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	2,304	358,153	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	2,178	338,575	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,560	2,238	347,885	2034/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,174	2,187	339,868	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,415	375,286	2040/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	2,547	395,882	2052/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,289	355,707	2022/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,166	3,017	468,942	2044/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,582	1,658	257,786	2023/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,586	2,929	455,276	2068/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,092	1,183	183,886	2024/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,924	2,806	436,078	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	51銘柄						
	金額				77,144	95,030	14,766,733	

2021年6月15日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千イスラエル・シュケル	千イスラエル・シュケル	千円	
イスラエル		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	2,000	2,595	88,033	2026/10/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	4.2500	1,800	1,932	65,557	2023/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,900	2,979	101,056	2042/01/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,000	2,194	74,448	2024/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,422	82,176	2025/08/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,929	65,469	2027/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.2500	1,000	1,016	34,495	2022/11/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,400	3,025	102,635	2047/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,800	1,961	66,542	2028/09/28
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,500	1,547	52,502	2023/11/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.7500	1,000	1,007	34,180	2022/07/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	1,900	1,864	63,248	2030/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.5000	1,100	1,102	37,415	2025/04/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,700	1,590	53,964	2037/05/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.1500	2,000	1,997	67,767	2023/07/31
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金額				26,200	29,168	989,495	
					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
デンマーク		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	13,662	24,005	430,893	2039/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,088	91,341	2023/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	6,605	118,566	2025/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	7,900	8,296	148,922	2027/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	9,590	10,082	180,988	2029/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,300	4,348	78,049	2022/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,030	36,448	2052/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	496	8,912	2031/11/15
通貨小計	銘柄数	8銘柄						
	金額				49,011	60,953	1,094,123	
					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
ノルウェー		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	8,204	8,436	111,526	2023/05/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,340	57,381	2024/03/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	5,395	5,552	73,407	2025/03/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,340	4,423	58,481	2026/02/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,450	3,557	47,027	2027/02/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,666	48,465	2028/04/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	3,969	52,475	2029/09/06
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	4,800	4,790	63,324	2030/08/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,500	3,436	45,427	2031/09/17
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金額				41,134	42,172	557,518	
					千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ		
スウェーデン		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,655	6,812	90,066	2039/03/30
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	8,777	116,042	2022/06/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	8,025	8,377	110,751	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,595	8,409	111,167	2025/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	7,602	100,510	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,050	5,286	69,892	2028/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,300	2,756	36,437	2032/06/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	7,400	7,741	102,342	2029/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	4,000	3,921	51,835	2031/05/12
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金額				54,670	59,685	789,045	
					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	28,290	27,982	154,397	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	19,300	20,635	113,860	2047/11/07
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	23,800	25,450	140,423	2024/09/05
		Mexican Bonos	国債証券	6.7500	17,200	17,718	97,764	2023/03/09
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	30,033	31,946	176,265	2023/12/07
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	23,919	27,165	149,889	2024/12/05
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	27,968	29,736	164,076	2027/06/03
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	11,304	62,373	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,544	33,263	183,533	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	16,894	18,953	104,577	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	20,015	21,627	119,330	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	28,599	29,090	160,511	2022/06/09
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	19,654	20,517	113,207	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,944	8,516	46,991	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金額				302,034	323,909	1,787,203	
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,455	65,733	2027/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,286	34,427	2030/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,643	43,993	2026/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,384	37,069	2031/06/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	875	891	23,860	2022/08/15

区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
2021年6月15日現在								
				%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	774	20,742	2027/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	1,027	27,506	2023/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,446	38,706	2033/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,975	52,882	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	800	866	23,187	2043/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,116	29,890	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,838	49,202	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161	1,190	31,869	2022/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,271	34,031	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,302	1,349	36,129	2023/08/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	982	26,298	2046/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650	693	18,559	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	750	790	21,159	2024/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,259	33,701	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,250	1,352	36,203	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,265	33,864	2025/03/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,700	1,755	46,999	2023/04/20
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,301	34,836	2033/11/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	600	653	17,482	2038/06/08
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	692	18,531	2026/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,910	2,007	53,732	2029/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,288	34,490	2048/07/06
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400	414	11,085	2024/06/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,301	34,823	2034/07/05
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,658	44,381	2040/05/22
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	1,300	1,251	33,503	2050/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,000	949	25,404	2031/04/15
通貨小計	銘柄数	32銘柄						
	金額				38,542	40,136	1,074,289	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	2,309	2,474	72,869	2022/09/23
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,377	4,664	137,396	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	3,386	99,743	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,850	3,989	117,511	2023/01/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,870	3,031	89,303	2024/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840	5,278	155,480	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,400	3,579	105,439	2024/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	—	1,600	1,599	47,112	2022/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.7500	2,000	1,996	58,797	2025/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,878	84,776	2030/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	—	1,000	995	29,308	2023/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.2500	300	283	8,362	2026/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	1,088	32,048	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,625	2,850	83,944	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,650	3,973	117,042	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,591	5,021	147,905	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	16銘柄						
	金額				44,409	47,091	1,387,042	
					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	1,260	168,238	2025/03/13
		IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	624	673	89,902	2023/03/20
		IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	673	89,911	2024/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	961	1,168	155,906	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	781	999	133,371	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,148	153,255	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	653	87,251	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	—	350	352	47,092	2022/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	861	114,947	2028/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	750	843	112,572	2033/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	750	844	112,708	2031/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	950	1,039	138,660	2029/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	600	695	92,755	2050/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	350	351	46,856	2035/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	823	109,951	2027/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	500	506	67,625	2030/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	—	500	492	65,712	2031/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	400	392	52,363	2041/04/22
国小計	銘柄数	18銘柄						
	金額				12,377	13,781	1,839,081	
					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	620	82,758	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,139	1,589	212,170	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,555	2,498	333,436	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	847	113,097	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,479	2,537	338,683	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,483	198,026	2022/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,515	202,293	2033/01/15

2021年6月15日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,456	194,417	2023/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,579	2,540	338,968	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,640	218,921	2024/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,855	247,637	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,638	1,726	230,351	2026/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,363	315,347	2027/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,425	190,282	2024/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,458	194,604	2028/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,251	166,979	2029/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	948	126,549	2040/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,424	190,037	2030/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	821	109,610	2027/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	850	756	101,004	2052/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,010	134,845	2031/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	870	116,189	2038/01/15
国小計	銘柄数	22銘柄						
	金額				28,025	32,643	4,356,216	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ベルギー）		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,699	1,793	239,333	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	1,950	260,284	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	1,299	173,436	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,863	2,002	267,290	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	1,465	195,601	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	640	892	119,093	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	940	959	127,984	2023/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,100	1,178	157,334	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,090	145,469	2024/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	580	805	107,546	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	400	461	61,541	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,490	1,603	214,039	2028/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	650	733	97,880	2033/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,628	217,279	2029/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	600	722	96,461	2050/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,238	165,314	2030/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	660	634	84,619	2040/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,225	163,563	2027/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	500	495	66,130	2031/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	500	414	55,270	2071/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,392	319,282	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	2,104	3,448	460,255	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	2,691	359,122	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,244	166,133	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,400	186,856	2022/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	1,110	148,228	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,417	189,205	2023/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	843	1,398	186,651	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,653	220,697	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	1,009	134,714	2034/06/22
国小計	銘柄数	30銘柄						
	金額				33,612	40,364	5,386,624	
					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	2,325	310,346	2023/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	3,899	520,428	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	4,818	643,048	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,927	4,788	638,980	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	4,270	569,928	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,764	3,326	443,883	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	3,771	503,326	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	4,097	4,574	610,456	2023/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,864	6,703	894,602	2041/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,717	3,379	451,010	2060/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,646	4,359	581,714	2026/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	4,499	5,392	719,599	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,694	3,841	512,687	2022/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,588	4,026	537,390	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,047	4,236	565,401	2023/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	5,086	5,519	736,520	2024/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,087	6,253	834,549	2030/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,899	5,296	706,825	2024/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,636	485,225	2025/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	5,444	726,623	2025/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,920	5,628	751,094	2031/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,787	3,967	529,511	2026/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,869	4,337	578,828	2036/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,287	1,611	215,079	2066/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,800	3,935	525,193	2026/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	3,118	416,124	2039/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,676	490,581	2027/05/25

2021年6月15日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,850	3,654	487,738	2048/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,427	323,992	2023/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,400	4,707	628,241	2028/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	4,426	590,767	2034/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	5,301	707,531	2028/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,458	461,475	2024/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,950	3,412	455,425	2050/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,950	4,149	553,789	2029/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,130	3,194	426,273	2025/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	4,227	564,105	2029/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,426	323,822	2023/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,770	2,630	351,011	2052/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,064	409,001	2026/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	1,469	196,093	2040/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,500	3,492	466,136	2030/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	680	521	69,592	2072/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	13,562	2024/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	500	477	63,680	2044/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,777	237,152	2031/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	917	122,409	2027/02/25
国小計	銘柄数	47銘柄						
	金額				146,837	171,980	22,950,766	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ドイツ）		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,149	153,459	2024/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,678	224,021	2027/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	3,058	408,213	2028/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,310	174,889	2028/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	3,088	412,182	2030/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,448	5,419	723,241	2031/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,305	3,799	507,076	2034/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,571	5,816	776,175	2037/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	2,333	311,452	2039/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,739	3,292	439,321	2040/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,774	4,592	612,805	2042/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,279	304,149	2022/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	4,300	573,959	2044/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,688	225,310	2022/09/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,462	195,134	2023/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,894	252,791	2023/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,693	226,059	2023/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,664	222,189	2024/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	4,183	558,298	2046/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,698	226,641	2024/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,042	4,264	569,055	2024/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,291	305,844	2025/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,134	3,355	447,826	2025/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,368	2,496	333,200	2026/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,497	333,228	2026/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,200	4,399	587,163	2027/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,450	326,987	2027/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,370	2,981	397,831	2048/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	2,029	270,872	2028/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,100	3,261	435,294	2028/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,315	309,003	2029/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,094	412,908	2029/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,050	1,876	250,455	2050/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,802	240,583	2030/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,903	253,963	2035/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,065	275,614	2027/11/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,541	205,773	2030/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,239	165,437	2030/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	922	123,102	2031/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	99	13,241	2036/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,031	137,632	2028/11/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,017	135,778	2050/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	13,434	2022/06/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	13,458	2022/09/16
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	13,481	2022/12/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,011	135,022	2023/03/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,013	135,284	2023/06/16
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	2,119	282,795	2022/10/07
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,730	5,803	774,540	2023/04/14
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,932	257,860	2023/10/13
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,958	261,322	2024/04/05
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,739	232,178	2024/10/18
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,462	328,652	2025/04/11
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,366	315,765	2025/10/10

2021年6月15日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	103	13, 745	2025/10/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2, 200	2, 266	302, 494	2026/04/10
国小計	銘柄数	56銘柄						
	金額				109, 078	128, 424	17, 138, 212	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（スペイン）		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6. 0000	2, 652	3, 850	513, 915	2029/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 6000	2, 045	2, 205	294, 347	2025/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 9500	2, 052	2, 363	315, 435	2030/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 1500	2, 192	2, 435	324, 951	2025/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 9500	2, 733	3, 033	404, 870	2026/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 9000	1, 952	2, 648	353, 417	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 4500	1, 550	2, 406	321, 120	2066/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 3000	2, 630	2, 849	380, 206	2026/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	1, 900	2, 087	278, 520	2027/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 3500	1, 750	2, 112	281, 910	2033/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4500	2, 050	2, 250	300, 295	2027/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 4500	1, 600	1, 622	216, 577	2022/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4000	2, 400	2, 632	351, 286	2028/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7000	1, 300	1, 712	228, 545	2048/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 3500	2, 400	2, 446	326, 506	2023/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4000	1, 900	2, 087	278, 585	2028/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4500	1, 600	1, 766	235, 805	2029/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 8500	1, 850	2, 121	283, 142	2035/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 2500	2, 300	2, 352	313, 874	2024/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 6000	2, 800	2, 897	386, 622	2029/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 5000	1, 360	1, 389	185, 488	2030/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2, 460	2, 485	331, 730	2023/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2, 500	2, 537	338, 666	2025/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 0000	1, 300	1, 179	157, 416	2050/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 8000	2, 400	2, 533	338, 042	2027/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2500	2, 900	3, 150	420, 500	2030/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2000	1, 300	1, 325	176, 907	2040/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	506	67, 631	2026/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 1000	2, 200	2, 138	285, 442	2031/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	304	40, 570	2024/05/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4500	650	579	77, 360	2071/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	500	66, 788	2028/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 8500	400	395	52, 730	2037/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 7500	2, 179	3, 430	457, 798	2032/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 2000	2, 254	3, 375	450, 526	2037/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 9000	2, 158	3, 631	484, 664	2040/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 8000	1, 682	1, 918	256, 056	2024/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 7000	1, 973	3, 276	437, 212	2041/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 6500	2, 189	2, 648	353, 382	2025/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 9000	1, 965	2, 590	345, 712	2026/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 4000	1, 958	2, 148	286, 763	2023/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 4000	1, 901	2, 126	283, 783	2023/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 1500	1, 770	2, 436	325, 133	2028/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 1500	1, 199	2, 176	290, 429	2044/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 8000	1, 970	2, 214	295, 571	2024/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	2, 097	2, 326	310, 493	2024/10/31
国小計	銘柄数	46銘柄						
	金額				85, 721	101, 212	13, 506, 742	
					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, 107	147, 799	2023/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7. 2500	1, 110	1, 535	204, 900	2026/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6. 5000	2, 392	3, 331	444, 541	2027/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 5000	1, 814	1, 981	264, 477	2024/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 2500	1, 509	2, 002	267, 296	2046/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 5000	2, 487	2, 645	353, 061	2025/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 6500	2, 065	2, 238	298, 730	2032/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0000	1, 891	2, 062	275, 262	2025/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4500	1, 504	1, 539	205, 427	2022/09/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7000	1, 610	1, 953	260, 725	2047/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 9500	1, 359	1, 391	185, 640	2023/03/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 6000	1, 786	1, 922	256, 603	2026/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2500	2, 324	2, 665	355, 740	2036/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 2500	1, 068	1, 133	151, 289	2026/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 6500	1, 550	1, 586	211, 679	2023/10/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 8000	968	1, 171	156, 388	2067/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 4500	1, 500	1, 753	234, 044	2033/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 2000	1, 510	1, 687	225, 253	2027/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 8500	1, 300	1, 380	184, 189	2024/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 4500	1, 850	2, 546	339, 776	2048/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0500	2, 700	2, 995	399, 805	2027/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 9000	1, 700	1, 725	230, 333	2022/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4500	1, 600	1, 689	225, 470	2024/11/15

2021年6月15日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,623	216,641	2038/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	2,331	311,139	2028/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,944	259,447	2023/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,379	184,076	2025/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,550	1,819	242,853	2028/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	2,200	2,341	312,497	2023/10/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,723	230,066	2025/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,631	217,715	2035/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,250	1,842	245,930	2049/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,550	1,574	210,123	2022/07/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	2,276	303,756	2029/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,200	2,332	311,308	2024/07/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	2,100	2,316	309,082	2026/07/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	1,250	1,594	212,837	2040/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	2,021	269,734	2030/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	740	745	99,515	2023/01/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,300	1,323	176,614	2025/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,440	325,631	2027/01/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,550	1,796	239,756	2050/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,556	207,709	2036/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,000	2,039	272,211	2023/06/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,300	2,478	330,802	2025/07/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	2,052	273,964	2030/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,400	2,609	348,272	2030/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3000	1,300	1,318	175,924	2023/08/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,700	1,771	236,447	2027/09/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,738	232,055	2026/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,300	1,370	182,865	2041/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	2,300	2,337	311,984	2031/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,108	147,906	2024/01/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	900	885	118,108	2051/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	700	670	89,542	2037/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,888	252,048	2028/03/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,000	1,967	262,589	2031/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	700	688	91,829	2045/04/30
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,098	146,548	2026/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,510	201,592	2024/04/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	13,425	2022/11/29
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	460	460	61,461	2072/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	300	301	40,297	2028/07/15
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,754	3,819	509,755	2029/11/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,284	571,731	2031/05/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,770	369,695	2033/02/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	3,407	454,785	2034/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	3,807	508,082	2037/02/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	3,240	432,468	2039/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,497	333,304	2023/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,522	336,689	2025/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	3,589	478,979	2040/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,509	334,848	2026/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	1,776	237,027	2022/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,960	2,120	282,926	2022/11/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	3,153	420,867	2028/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,069	276,126	2023/05/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	2,927	390,740	2044/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,478	330,796	2024/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,481	331,193	2024/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,318	2,890	385,795	2030/03/01
国小計	銘柄数	81銘柄						
	金額				138,642	161,413	21,540,574	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フィンランド）		Finland Government Bond	国債証券	0.7500	364	392	52,420	2031/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	296	39,543	2025/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	851	113,676	2026/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	—	700	710	94,843	2023/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	438	58,500	2047/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	845	112,847	2027/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.1250	670	752	100,412	2034/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	529	70,596	2028/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	528	70,500	2029/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	—	200	204	27,244	2024/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	302	40,429	2036/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	387	51,777	2040/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	—	500	503	67,246	2030/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	349	46,605	2052/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	300	303	40,514	2031/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	793	105,858	2025/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	474	63,334	2028/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	1.6250	312	321	42,842	2022/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	463	61,906	2023/04/15

2021年６月15日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	590	78,852	2042/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	569	76,006	2024/04/15
国小計	銘柄数	21銘柄						
	金額				9,844	10,610	1,415,960	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オーストリア）		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	1,373	1,479	197,382	2025/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,200	160,182	2026/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	958	127,925	2047/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	312	41,766	2086/11/02
		Austria Government Bond	国債証券	—	900	912	121,727	2023/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,349	180,060	2027/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	887	118,492	2117/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	403	53,820	2022/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	900	964	128,776	2028/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	980	1,034	138,018	2029/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	800	815	108,772	2024/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	—	980	989	132,107	2030/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	1,000	1,012	135,063	2023/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	719	96,010	2051/03/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	366	48,854	2040/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.8500	300	273	36,544	2120/06/30
		Austria Government Bond	国債証券	—	700	701	93,617	2031/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	480	490	65,462	2025/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,164	155,337	2027/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,373	2,199	293,465	2037/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,102	147,093	2026/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	923	123,178	2022/11/22
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	701	93,625	2062/01/26
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	990	132,211	2044/06/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,013	135,228	2023/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	993	132,521	2034/05/23
		Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,003	133,964	2024/10/21
国小計	銘柄数	27銘柄						
	金額				21,451	24,962	3,331,211	
通貨小計	銘柄数	348銘柄						
	金額				585,587	685,390	91,465,390	
合計	銘柄数	834銘柄						
	金額						223,326,922	

（注１）邦貨換算金額は、2021年６月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
（注２）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書　第21期　（決算日　2020年11月30日）

（作成対象期間　2019年12月３日～2020年11月30日）

外国債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

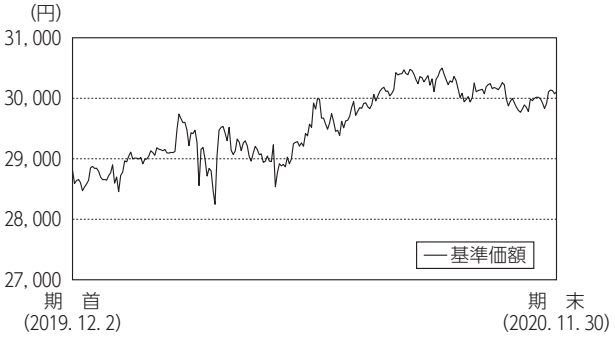
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年　月　日	基準価額		FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首) 2019年12月２日	28,807	—	29,079	—	98.4	—
12月末	28,900	0.3	29,177	0.3	98.2	—
2020年１月末	29,132	1.1	29,333	0.9	98.3	—
２月末	29,474	2.3	29,916	2.9	98.2	—
３月末	29,517	2.5	29,656	2.0	98.3	—
４月末	28,953	0.5	29,181	0.3	98.2	—
５月末	29,377	2.0	29,685	2.1	97.9	—
６月末	29,845	3.6	30,164	3.7	98.2	—
７月末	30,143	4.6	30,493	4.9	98.0	—
８月末	30,109	4.5	30,401	4.5	98.3	—
９月末	30,250	5.0	30,538	5.0	98.1	—
10月末	29,799	3.4	30,116	3.6	98.1	—
(期末) 2020年11月30日	30,106	4.5	30,435	4.7	98.5	—

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：28,807円　期末：30,106円　騰落率：4.5%

【基準価額の主な変動要因】

日本を除く先進国国債に主に投資した結果、為替市場で米ドルなどが下落（円高）したものの債券市場で金利が低下（債券価格は上昇）したため、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると低下しました。

当作成期首より、新型コロナウイルスによる世界経済の減速懸念の高まりから、金利は大きく低下しました。その後は、各国で段階的に経済活動が再開されたことやワクチン開発への期待から金利は一時的に上昇しましたが、感染再拡大への懸念が高まると金利は再び低下しました。2020年８月には、株価が上昇するなどリスクに対する市場心理が改善し、金利は上昇しました。10月には、米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年に入ってからは、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。

■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	5
(保管費用)	(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しております項目の概要をご参照ください。
（注２）項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況
公　社　債

(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	国債証券	千アメリカ・ドル 244,186	千アメリカ・ドル 221,904 (—)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 18,392	千カナダ・ドル 9,377 (—)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 31,353	千オーストラリア・ドル 5,400 (—)
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 3,085	千シンガポール・ドル 1,151 (—)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 26,395	千イギリス・ポンド 11,406 (—)
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シュケル 30,447	千イスラエル・シュケル 544 (—)
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 16,467	千デンマーク・クローネ 2,271 (—)
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 10,993	千ノルウェー・クローネ 7,241 (—)
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローネ 14,305	千スウェーデン・クローネ 11,290 (—)
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 81,550	千メキシコ・ペソ 32,935 (—)
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 13,203	千マレーシア・リンギット 5,100 (—)
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 7,914	千南アフリカ・ランド 137,657 (—)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 18,643	千ポーランド・ズロチ 8,566 (—)
	ユーロ (アイルランド)	国債証券	千ユーロ 4,308	千ユーロ 849 (—)
	ユーロ (オランダ)	国債証券	千ユーロ 7,400	千ユーロ 2,393 (—)
	ユーロ (ベルギー)	国債証券	千ユーロ 10,174	千ユーロ 3,003 (—)
	ユーロ (フランス)	国債証券	千ユーロ 50,275	千ユーロ 21,351 (—)
	ユーロ (ドイツ)	国債証券	千ユーロ 49,813	千ユーロ 15,873 (—)
	ユーロ (スペイン)	国債証券	千ユーロ 29,263	千ユーロ 10,586 (—)
	ユーロ (イタリア)	国債証券	千ユーロ 43,888	千ユーロ 22,171 (—)
	ユーロ (フィンランド)	国債証券	千ユーロ 2,826	千ユーロ 626 (—)
	ユーロ (オーストリア)	国債証券	千ユーロ 6,786	千ユーロ 2,319 (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	国債証券	千ユーロ 204,737	千ユーロ 79,175 (—)

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

■主要な売買銘柄
公　社　債

(2019年12月３日から2020年11月30日まで)

当期 買付 銘柄	金額	当期 売付 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		当期末							
区分		額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
			外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
		千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ		820,457	897,323	93,222,970	42.6	—	18.7	16.0	7.9
		千カナダ・ドル	千カナダ・ドル						
カナダ		48,203	54,207	4,333,924	2.0	—	0.9	0.7	0.4
		千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル						
オーストラリア		67,164	75,437	5,801,880	2.7	—	1.8	0.6	0.2
		千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル						
シンガポール		10,378	11,857	921,200	0.4	—	0.3	0.1	0.0
		千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド						
イギリス		78,966	104,078	14,420,010	6.6	—	5.1	1.1	0.4
		千イスラエル・シュケル	千イスラエル・シュケル						
イスラエル		25,400	29,484	924,033	0.4	—	0.2	0.2	0.0
		千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ						
デンマーク		56,061	71,697	1,198,067	0.5	—	0.4	0.1	0.1
		千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ						
ノルウェー		36,634	38,933	457,858	0.2	—	0.1	0.1	—
		千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ						
スウェーデン		50,870	56,926	695,644	0.3	—	0.2	0.1	0.1
		千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ						
メキシコ		307,034	342,802	1,779,145	0.8	—	0.4	0.2	0.1
		千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット						
マレーシア		39,094	42,024	1,072,884	0.5	—	0.3	0.1	0.0
		千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ						
ポーランド		45,329	49,569	1,373,582	0.6	—	0.3	0.3	0.1
		千ユーロ	千ユーロ						
ユーロ	アイルランド	11,943	13,978	1,738,620	0.8	—	0.6	0.2	0.1
		千ユーロ	千ユーロ						
	オランダ	27,805	34,178	4,251,147	1.9	—	1.3	0.5	0.2
		千ユーロ	千ユーロ						
	ベルギー	35,009	44,357	5,517,247	2.5	—	2.0	0.4	0.1
		千ユーロ	千ユーロ						
	フランス	148,837	183,176	22,783,533	10.4	—	7.0	2.6	0.7
		千ユーロ	千ユーロ						
	ドイツ	107,345	130,943	16,286,782	7.4	—	4.8	2.1	0.6
		千ユーロ	千ユーロ						
	スペイン	86,979	106,965	13,304,319	6.1	—	4.1	1.6	0.4
		千ユーロ	千ユーロ						
	イタリア	139,894	167,518	20,835,981	9.5	—	6.0	2.5	1.1
		千ユーロ	千ユーロ						
	フィンランド	9,664	10,842	1,348,586	0.6	—	0.4	0.1	0.1
		千ユーロ	千ユーロ						
	オーストリア	21,268	26,576	3,305,593	1.5	—	1.0	0.4	0.1
	小計	588,744	718,538	89,371,812	40.8	—	27.2	10.3	3.4
合計		—	—	215,573,016	98.5	—	56.0	29.8	12.7

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

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,191	227,701	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,297	342,567	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,516	261,402	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,606	270,826	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,668	6,858	712,571	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,526	470,206	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,865	505,468	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,568	4,854	504,377	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,398	560,874	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,654	587,417	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	5,296	550,254	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.0000	2,106	2,265	235,372	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	761	79,098	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,102	114,494	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	977	101,589	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	955	99,317	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	1,000	103,960	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	473	645	67,091	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	1,072	111,398	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	3,466	360,101	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,748	181,685	2036/02/15

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

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	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
	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	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,900	7,414	770,317	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,500	3,580	371,978	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	5,351	555,996	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,945	305,957	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	4,148	431,010	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,071	319,131	2022/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,665	276,931	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,141	326,349	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,900	2,966	308,141	2022/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	1,047	108,840	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,550	2,582	268,281	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,200	332,461	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,850	6,356	660,363	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	5,371	558,009	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,500	1,520	158,007	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	2,133	221,690	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,145	326,814	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,089	320,982	2022/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,687	279,243	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,648	275,165	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,500	1,524	158,354	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	4,114	427,424	2023/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	4,700	4,910	510,138	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,500	2,536	263,467	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,250	2,310	239,986	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,600	3,829	397,872	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,200	3,392	352,394	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	5,964	619,647	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	200	202	21,033	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	311	32,311	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	5,380	558,963	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,200	1,209	125,626	2023/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,500	1,512	157,112	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	200	200	20,841	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	13,200	13,227	1,374,186	2023/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,609	167,196	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	7,800	7,670	796,849	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,496	363,200	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,706	281,204	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,200	3,199	332,408	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	5,700	5,684	590,550	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	5,168	536,922	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,814	500,173	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	500	499	51,926	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,488	362,447	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,990	310,694	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,500	5,510	572,486	2023/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,500	5,497	571,149	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	7,500	7,470	776,128	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,486	362,222	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	998	103,747	2023/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,386	351,788	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,497	363,400	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	800	798	82,998	2023/08/15
	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						
通貨小計 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

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,252	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	
					千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
オーストラリア		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,162	3,453	265,616	2022/07/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,568	4,026	309,715	2023/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,789	3,541	272,406	2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,473	3,783	290,977	2024/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,404	4,102	315,520	2029/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,498	3,960	304,575	2025/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,258	1,762	135,527	2033/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,248	3,928	302,165	2026/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,497	115,148	2037/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,307	1,568	120,618	2035/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	1,008	77,576	2039/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,672	3,075	236,569	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,678	4,117	316,698	2028/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	1,567	120,531	2047/03/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	800	816	62,820	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,800	3,249	249,881	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,850	1,928	148,339	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,600	3,039	233,782	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,870	5,605	431,086	2030/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	990	1,176	90,510	2041/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	3,000	230,750	2031/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	900	922	70,986	2032/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,406	185,086	2024/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,700	2,725	209,646	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,500	1,454	111,863	2051/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,500	2,494	191,882	2025/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,505	192,732	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,700	2,715	208,863	2026/09/21
通貨小計	銘柄数	28銘柄						
	金額				67,164	75,437	5,801,880	
					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	905	70,346	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	788	827	64,288	2022/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	623	683	53,124	2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	809	958	74,430	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	512	39,777	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	671	713	55,429	2023/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	724	56,307	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	728	56,577	2029/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	568	44,190	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	908	70,608	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	488	37,939	2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	500	510	39,625	2022/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	650	751	58,345	2036/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	450	464	36,079	2023/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	623	48,446	2028/05/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	490	516	40,097	2024/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	418	32,487	2039/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	470	554	43,099	2050/03/01
通貨小計	銘柄数	18銘柄						
	金額				10,378	11,857	921,200	

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,621	1,776	246,129	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,682	2,785	385,874	2065/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,586	219,863	2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	2,320	2,341	324,351	2022/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,940	2,247	311,454	2047/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,750	3,212	445,098	2037/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,510	1,969	272,931	2057/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	2,010	2,163	299,692	2027/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	2,000	2,042	282,985	2023/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	2,500	2,787	386,201	2028/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,060	1,491	206,643	2071/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	2,600	2,692	372,992	2024/04/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,110	1,366	189,388	2049/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	1,051	145,731	2054/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	1,800	1,899	263,116	2029/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	2,600	2,674	370,532	2025/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	940	1,021	141,593	2041/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	2,300	2,306	319,550	2023/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	2,300	2,313	320,468	2030/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	650	590	81,783	2061/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,505	208,577	2026/01/30
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,000	997	138,175	2028/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	1,038	143,852	2050/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	900	898	124,524	2035/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,300	1,304	180,786	2024/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,386	192,137	2028/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,840	2,635	365,215	2032/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,788	247,797	2025/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,662	2,547	353,006	2036/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,257	2,127	294,792	2038/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,908	3,915	542,535	2055/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,666	3,001	415,799	2046/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,589	220,228	2027/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,416	4,231	586,291	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,830	2,635	365,086	2030/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	2,530	350,607	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	2,345	325,034	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,382	1,453	201,314	2022/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,260	1,926	266,915	2034/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,574	3,287	455,481	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,604	360,841	2040/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	2,824	391,308	2052/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,313	320,522	2022/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,166	3,278	454,284	2044/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,582	1,682	233,130	2023/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,586	3,330	461,456	2068/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,092	1,206	167,187	2024/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,124	3,368	466,731	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	48銘柄						
	金額				78,966	104,078	14,420,010	
					千イスラエル・シュケル	千イスラエル・シュケル		
イスラエル		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	2,000	2,681	84,053	2026/10/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	2,000	2,127	66,679	2022/01/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	4.2500	1,800	1,971	61,788	2023/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,900	3,254	101,990	2042/01/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,000	2,232	69,962	2024/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,450	76,788	2025/08/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,970	61,752	2027/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.2500	1,000	1,022	32,041	2022/11/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,100	2,940	92,144	2047/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,800	2,020	63,324	2028/09/28
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,500	1,557	48,802	2023/11/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.7500	1,000	1,010	31,667	2022/07/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	1,900	1,936	60,676	2030/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.5000	600	603	18,928	2025/04/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	700	706	22,146	2037/05/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.1500	1,000	998	31,286	2023/07/31
通貨小計	銘柄数	16銘柄						
	金額				25,400	29,484	924,033	
					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
デンマーク		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	13,662	26,252	438,685	2039/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	7,550	7,812	130,545	2021/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,162	86,266	2023/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	6,735	112,544	2025/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	7,900	8,490	141,883	2027/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	9,590	10,450	174,628	2029/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,300	4,377	73,141	2022/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,416	40,372	2052/11/15
通貨小計	銘柄数	8銘柄						
	金額				56,061	71,697	1,198,067	

区分		当期末 銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
ノルウェー		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	8,204	8,555	100,617	2023/05/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,448	52,310	2024/03/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	5,395	5,693	66,950	2025/03/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,508	41,258	2026/02/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,450	3,687	43,368	2027/02/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,828	45,026	2028/04/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	4,166	48,997	2029/09/06
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	4,800	5,045	59,329	2030/08/19
通貨小計	銘柄数	8銘柄						
	金額				36,634	38,933	457,858	
					千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ		
スウェーデン		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,655	7,308	89,314	2039/03/30
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	8,962	109,521	2022/06/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	8,025	8,471	103,526	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,595	8,570	104,735	2025/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	7,723	94,377	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,550	4,869	59,510	2028/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	7,400	7,977	97,484	2029/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	3,000	3,041	37,172	2031/05/12
通貨小計	銘柄数	8銘柄						
	金額				50,870	56,926	695,644	
					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
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	15銘柄						
	金額				307,034	342,802	1,779,145	
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
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	34銘柄						
	金額				39,094	42,024	1,072,884	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	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

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
		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
		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	21銘柄						
	金額				27,805	34,178	4,251,147	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ベルギー）		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,699	1,815	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

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	877	932	115,934	2022/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	2,937	365,392	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,280	159,208	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,436	178,729	2022/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	1,167	145,273	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,441	179,263	2023/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	843	1,556	193,604	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,684	209,578	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	1,074	133,693	2034/06/22
国小計	銘柄数	29銘柄						
	金額				35,009	44,357	5,517,247	
					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	2,428	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
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	5,199	6,415	797,916	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,694	3,905	485,731	2022/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,588	4,495	559,096	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,554	442,114	2023/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	5,086	5,617	698,734	2024/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,887	7,540	937,943	2030/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,899	5,385	669,832	2024/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,679	457,615	2025/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	5,528	687,681	2025/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,920	5,882	731,677	2031/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,787	4,025	500,649	2026/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,869	4,674	581,470	2036/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,287	1,993	247,903	2066/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,800	3,996	497,122	2026/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	4,042	502,838	2022/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	3,408	423,979	2039/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,753	466,915	2027/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,000	4,401	547,515	2048/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,440	303,524	2023/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,400	4,827	600,439	2028/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	4,717	586,819	2034/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	5,453	678,326	2028/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,481	433,037	2024/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,412	175,629	2022/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,750	3,690	459,079	2050/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,250	5,685	707,213	2029/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,130	3,221	400,700	2025/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,800	2,907	361,626	2029/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,438	303,324	2023/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,870	2,098	261,022	2052/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,098	385,356	2026/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	1,083	134,730	2040/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,070	257,481	2030/11/25
国小計	銘柄数	45銘柄						
	金額				148,837	183,176	22,783,533	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ドイツ）		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,189	147,999	2024/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,741	216,650	2027/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	3,167	393,998	2028/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,357	168,895	2028/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	3,219	400,477	2030/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,448	5,647	702,454	2031/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,405	2,446	304,271	2034/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,571	6,208	772,249	2037/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	2,510	312,279	2039/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,439	2,939	365,649	2040/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,874	5,185	644,983	2042/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,807	1,862	231,598	2022/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,311	287,535	2022/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	4,728	588,082	2044/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,710	212,721	2022/09/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,481	184,319	2023/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,920	238,837	2023/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,721	214,134	2023/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,690	210,281	2024/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,979	5,158	641,558	2046/08/15

区分		当期末 銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,722	214,213	2024/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,042	4,315	536,764	2024/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,315	287,985	2025/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,134	3,402	423,197	2025/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,368	2,528	314,527	2026/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,527	314,421	2026/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	6,200	6,595	820,409	2027/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,496	310,473	2027/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,370	3,358	417,721	2048/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	2,071	257,628	2028/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,400	4,730	588,350	2028/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,371	295,012	2029/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,174	394,849	2029/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,846	229,701	2050/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,852	230,435	2030/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,328	289,591	2035/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,101	261,329	2027/11/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	741	92,168	2030/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,273	158,369	2030/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	806	100,250	2021/12/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	302	37,664	2022/03/11
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	12,579	2022/06/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	12,606	2022/09/16
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,160	1,171	145,733	2022/04/08
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	2,129	264,927	2022/10/07
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,730	5,838	726,145	2023/04/14
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,943	241,792	2023/10/13
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,971	245,204	2024/04/05
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,752	217,956	2024/10/18
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,482	308,789	2025/04/11
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,387	296,999	2025/10/10
国小計	銘柄数	51銘柄						
	金額				107,345	130,943	16,286,782	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（スペイン）		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	3,984	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
		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	

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
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
	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						
国小計 金額				139,894	167,518	20,835,981	

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
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
		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	
					千ユーロ	千ユーロ		
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。

■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	当期末 比率
	千円	%
公社債	215,573,016	98.5
コール・ローン等、その他	3,336,412	1.5
投資信託財産総額	218,909,428	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝103.89円、１カナダ・ドル＝79.95円、１オーストラリア・ドル＝76.91円、１シンガポール・ドル＝77.69円、１イギリス・ポンド＝138.55円、１イスラエル・シュケル＝31.34円、１デンマーク・クローネ＝16.71円、１ノルウェー・クローネ＝11.76円、１スウェーデン・クローネ＝12.22円、１メキシコ・ペソ＝5.19円、１マレーシア・リンギット＝25.53円、１ポーランド・ズロチ＝27.71円、１ユーロ＝124.38円です。
（注３）当期末における外貨建純資産（217,489,673千円）の投資信託財産総額（218,909,428千円）に対する比率は、99.4％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

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

＊期首における元本額は66, 118, 107, 712円、当作成期間中における追加設定元本額は13, 500, 674, 811円、同解約元本額は6, 930, 284, 093円です。

＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国債券インデックスＶＡ601, 675, 980円、ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）12, 401, 222円、ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）102, 686, 952円、ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）29, 631, 947円、ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）339, 511, 943円、外国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）90, 339, 707円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）462, 489, 583円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）1, 814, 096, 236円、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）654, 015, 808円、Ｄ－Ｉ's 外国債券インデックス1, 055, 376円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050　957, 155円、iFree 外国債券インデックス691, 990, 376円、iFree 8資産バランス989, 492, 660円、iFree 年金バランス49, 115, 601円、ＤＣダイワ外国債券インデックス48, 408, 053, 236円、ダイワ・ライフ・バランス３０　819, 754, 500円、ダイワ・ライフ・バランス５０　459, 770, 424円、ダイワ・ライフ・バランス７０　279, 428, 323円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）459, 816, 979円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）336, 784, 366円、ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）108, 589, 082円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020　8, 547, 742円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030　19, 902, 336円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040　4, 844, 467円、ダイワつみたてインデックス外国債券163, 786, 187円、ダイワつみたてインデックスバランス３０　3, 047, 233円、ダイワつみたてインデックスバランス５０　977, 653円、ダイワつみたてインデックスバランス７０　951, 206円、ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ174, 483, 363円、ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ131, 594, 279円、ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ4, 234, 846, 474円、ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）250, 419, 145円、ダイワ・インデックスセレクト 外国債券142, 610, 494円、ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド34, 513, 413円、ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）4, 864, 458, 623円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5, 832, 536, 410円、ダイワライフスタイル２５　33, 396, 711円、ダイワライフスタイル５０　59, 767, 812円、ダイワライフスタイル７５　16, 157, 426円です。

＊当期末の計算口数当りの純資産額は30, 106円です。

■損益の状況

当期　自 2019年12月３日　至 2020年11月30日

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

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

運用報告書（全体版）
第５期

（決算日　2021年６月15日）
（作成対象期間　2020年６月16日～2021年６月15日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

<2733>

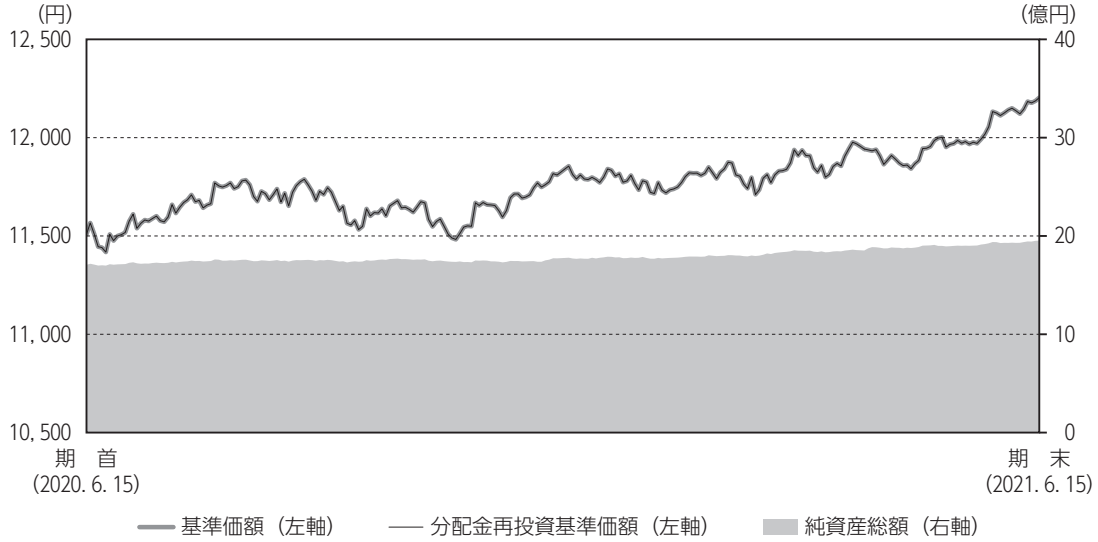
設定以来の運用実績

決　算　期	基準価額			公社債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率			
	円	円	%	%	%	百万円
1期末(2017年6月15日)	10,747	0	7.5	98.3	—	599
2期末(2018年6月15日)	10,746	0	△ 0.0	98.1	—	1,195
3期末(2019年6月17日)	11,026	0	2.6	98.0	—	1,344
4期末(2020年6月15日)	11,508	0	4.4	97.8	—	1,706
5期末(2021年6月15日)	12,204	0	6.0	98.3	—	1,952

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

運用経過

基準価額等の推移について



＊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：11,508円
期　末：12,204円（分配金0円）
騰落率：6.0%（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	5.7%	79.8%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	9.7%	19.9%

■基準価額の主な変動要因

主に海外の債券に投資した結果、債券市場で金利が上昇（債券価格は下落）したものの、為替相場で円安が進んだことなどから、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。

年　月　日	基準価額		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率		
	円	%	%	%
(期首)2020年6月15日	11,508	—	97.8	—
6月末	11,575	0.6	97.5	—
7月末	11,664	1.4	97.3	—
8月末	11,653	1.3	97.7	—
9月末	11,638	1.1	97.6	—
10月末	11,490	△ 0.2	97.6	—
11月末	11,698	1.7	98.0	—
12月末	11,834	2.8	97.9	—
2021年1月末	11,802	2.6	97.7	—
2月末	11,711	1.8	97.8	—
3月末	11,906	3.5	97.8	—
4月末	11,946	3.8	97.8	—
5月末	12,125	5.4	98.0	—
(期末)2021年6月15日	12,204	6.0	98.3	—

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2020.6.16～2021.6.15）

■海外債券市況

海外の債券市場では、当作成期を通して見ると金利は上昇しました。

先進国の金利は、新型コロナウイルス感染再拡大への懸念が続いていたことなどから、金利は低位で推移しました。しかし2020年8月は、株価が上昇するなどリスク選好姿勢が改善し、金利は上昇しました。10月には、米国大統領・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両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、米国を中心に金利は上昇しました。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。また、米国で今後の金融緩和策の後退が市場で意識されたことも、さらなる金利上昇要因となりました。

新興国においても、米国の金利が上昇したことや一部の国で利上げが行われたことなどから、先進国と同様に金利は上昇しました。

■為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると円安となりました。

先進国の対円為替相場は、当作成期首より、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。2020年11月以降は、新型コロナウイルスのワクチン開発に進展があったことで、市場のリスク選好姿勢が強まり、投資対象通貨は上昇（円安）しました。2021年に入ると、米国において民主党が大統領府・議会上下両院を制したことから、株価が上昇するなど市場のリスク選好姿勢が強まり、円安となりました。3月には、米国での追加経済対策の成立や、経済指標の改善によって米国金利が上昇したことなどから米ドルが買い進められ、全般的に円安が進行しました。

新興国では、市場のリスク選好姿勢が改善したことなどから、多くの通貨は対円で上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

（2020. 6. 16 ～ 2021. 6. 15）

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が少額であったため、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６月16日 ～2021年６月15日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**―**
対基準価額比率	（％）	―
当期の収益	（円）	―
当期の収益以外	（円）	―
翌期繰越分配対象額	（円）	2,203

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

今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

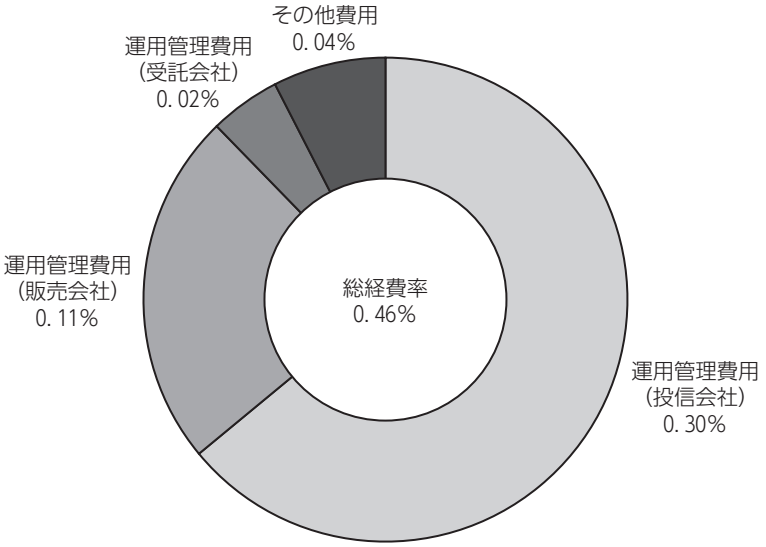
項　　目	当　期 (2020. 6. 16～2021. 6. 15) 金　額	比　率	項　目　の　概　要
信　託　報　酬	50円	0. 429%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は11, 767円です。**
（投 信 会 社）	(35)	(0. 297)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(13)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	4	0. 035	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(3)	(0. 026)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0. 008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ　の　他）	(0)	(0. 001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	55	0. 464	

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（１口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0. 46%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６月16日から2021年６月15日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	46,934	64,890	36,796	51,103
外国債券インデックスマザーファンド	71,887	218,466	34,862	105,751

（注）単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	252,653	262,791	388,695
外国債券インデックスマザーファンド	461,248	498,273	1,558,500

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年６月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	388,695	19.9
外国債券インデックスマザーファンド	1,558,500	79.6
コール・ローン等、その他	9,705	0.5
投資信託財産総額	1,956,901	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、６月15日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝110.11円、１カナダ・ドル＝90.68円、１オーストラリア・ドル＝84.91円、１シンガポール・ドル＝82.99円、１イギリス・ポンド＝155.39円、１イスラエル・シュケル＝33.923円、１トルコ・リラ＝13.009円、１デンマーク・クローネ＝17.95円、１ノルウェー・クローネ＝13.22円、１スウェーデン・クローネ＝13.22円、１メキシコ・ペソ＝5.517円、１フィリピン・ペソ＝2.298円、１アルゼンチン・ペソ＝1.155円、100チリ・ペソ＝15.327円、100コロンビア・ペソ＝3.013円、100インドネシア・ルピア＝0.78円、１ブラジル・レアル＝21.747円、１チェコ・コルナ＝5.246円、１ルーマニア・レイ＝27.106円、１オフショア・人民元＝17.178円、１ロシア・ルーブル＝1.53円、１マレーシア・リンギット＝26.765円、１南アフリカ・ランド＝7.99円、１タイ・バーツ＝3.54円、１ペルー・ソル＝28.262円、１ポーランド・ズロチ＝29.454円、100ハンガリー・フォリント＝38.118円、１ウルグアイ・ペソ＝2.526円、１ドミニカ・ペソ＝1.929円、１ユーロ＝133.45円です。
（注３）ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（20,783,953千円）の投資信託財産総額（21,083,625千円）に対する比率は、98.6％です。
外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（225,038,830千円）の投資信託財産総額（225,766,855千円）に対する比率は、99.7％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年６月15日現在

項目	当期末
（Ａ）資産	**1,956,901,540円**
コール・ローン等	9,705,264
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（評価額）	388,695,485
外国債券インデックスマザーファンド（評価額）	1,558,500,791
（Ｂ）負債	**4,015,200**
未払信託報酬	3,939,523
その他未払費用	75,677
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）	**1,952,886,340**
元本	1,600,235,730
次期繰越損益金	352,650,610
（Ｄ）受益権総口数	**1,600,235,730口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）	**12,204円**

＊期首における元本額は1,483,316,344円、当作成期間中における追加設定元本額は288,268,635円、同解約元本額は171,349,249円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は12,204円です。

■損益の状況

当期　自 2020年６月16日　至 2021年６月15日

項目	当期
（Ａ）配当等収益	**△ 1,156円**
受取利息	66
支払利息	△ 1,222
（Ｂ）有価証券売買損益	**111,012,743**
売買益	115,418,104
売買損	△ 4,405,361
（Ｃ）信託報酬等	**△ 7,836,156**
（Ｄ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	**103,175,431**
（Ｅ）前期繰越損益金	**65,765,627**
（Ｆ）追加信託差損益金	**183,709,552**
（配当等相当額）	（54,670,277）
（売買損益相当額）	（129,039,275）
（Ｇ）合計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	**352,650,610**
次期繰越損益金（Ｇ）	**352,650,610**
追加信託差損益金	183,709,552
（配当等相当額）	（54,670,277）
（売買損益相当額）	（129,039,275）
分配準備積立金	168,942,214
繰越損益金	△ 1,156

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項目	当期
（ａ）経費控除後の配当等収益	0円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	103,175,398
（ｃ）収益調整金	183,709,552
（ｄ）分配準備積立金	65,766,816
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	352,651,766
（ｆ）分配金	0
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	352,651,766
（ｈ）受益権総口数	1,600,235,730口

★「外国債券インデックスマザーファンド」の第21期にかかる運用状況については212～226ページをご参照ください。

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワファンドラップ　外国債券インデックス　エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（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６月15日）現在における外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。199～211ページをご参照ください。

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワファンドラップ　外国債券インデックス　エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の決算日（2020年７月６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６月15日）現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

公　社　債

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
Brazil Letras do Tesouro Nacional（ブラジル）2024/1/1	343, 289	Brazil Letras do Tesouro Nacional（ブラジル）2022/1/1	134, 458
China Government Bond（中国）2. 68% 2030/5/21	187, 394	Poland Government Bond（ポーランド）1. 75% 2021/7/25	121, 128
China Government Bond（中国）2. 36% 2023/7/2	176, 741	Brazil Letras do Tesouro Nacional（ブラジル）2021/7/1	119, 473
China Government Bond（中国）2. 85% 2027/6/4	131, 886	Thailand Government Bond（タイ）3. 65% 2021/12/17	108, 962
Mexican Bonos（メキシコ）6. 75% 2023/3/9	123, 869	China Government Bond（中国）2. 36% 2023/7/2	85, 852
China Government Bond（中国）3. 27% 2030/11/19	121, 166	Russian Federal Bond - OFZ（ロシア）7% 2021/12/15	70, 878
China Government Bond（中国）1. 99% 2025/4/9	117, 797	Indonesia Treasury Bond（インドネシア）8. 25% 2021/7/15	68, 573
China Government Bond（中国）3. 02% 2025/10/22	110, 931	Mexican Bonos（メキシコ）7. 25% 2021/12/9	53, 367
Poland Government Bond（ポーランド）1. 25% 2030/10/25	109, 534	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F（ブラジル）10% 2023/1/1	52, 643
China Government Bond（中国）3. 81% 2050/9/14	99, 534	Poland Government Bond（ポーランド）5. 75% 2021/10/25	50, 962

（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６月15日現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（14, 218, 438千口）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区分	2021年６月15日現在							
	額面金額	評価額		組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
			千円	%	%	%	%	%
トルコ	千トルコ・リラ 31, 510	千トルコ・リラ 25, 858	336, 402	1. 6	1. 6	0. 6	0. 4	0. 6
メキシコ	千メキシコ・ペソ 326, 900	千メキシコ・ペソ 349, 780	1, 929, 948	9. 2	—	4. 7	3. 1	1. 5
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10, 000	千フィリピン・ペソ 11, 992	27, 568	0. 1	—	0. 1	—	—
チリ	千チリ・ペソ 2, 790, 000	千チリ・ペソ 2, 930, 014	449, 097	2. 1	—	1. 1	0. 9	0. 2
コロンビア	千コロンビア・ペソ 29, 620, 000	千コロンビア・ペソ 30, 405, 738	916, 368	4. 4	—	2. 9	0. 9	0. 5
インドネシア	千インドネシア・ルピア 240, 389, 000	千インドネシア・ルピア 259, 741, 690	2, 025, 985	9. 6	—	6. 8	2. 0	0. 8
ブラジル	千ブラジル・レアル 88, 250	千ブラジル・レアル 82, 831	1, 801, 339	8. 6	—	1. 8	4. 8	1. 9
チェコ	千チェコ・コルナ 160, 800	千チェコ・コルナ 163, 695	858, 878	4. 1	—	3. 0	0. 9	0. 2
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 19, 370	千ルーマニア・レイ 20, 745	562, 335	2. 7	—	1. 0	1. 1	0. 6
中国	千オフショア・人民元 118, 450	千オフショア・人民元 118, 358	2, 033, 242	9. 7	—	5. 1	4. 5	—
ロシア	千ロシア・ルーブル 1, 000, 330	千ロシア・ルーブル 1, 012, 533	1, 549, 175	7. 4	—	4. 8	1. 9	0. 7
マレーシア	千マレーシア・リンギット 53, 130	千マレーシア・リンギット 55, 110	1, 475, 086	7. 0	—	4. 1	2. 2	0. 8
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 226, 090	千南アフリカ・ランド 208, 336	1, 664, 608	7. 9	—	7. 5	—	0. 5
タイ	千タイ・バーツ 479, 560	千タイ・バーツ 513, 638	1, 818, 281	8. 6	—	5. 2	2. 7	0. 7
ペルー	千ペルー・ソル 14, 250	千ペルー・ソル 15, 518	438, 595	2. 1	—	2. 0	0. 1	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 52, 570	千ポーランド・ズロチ 55, 455	1, 633, 391	7. 8	—	3. 6	2. 5	1. 7
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 2, 002, 800	千ハンガリー・フォリント 2, 100, 596	800, 711	3. 8	—	1. 8	1. 5	0. 5
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 9, 800	千ウルグアイ・ペソ 10, 053	25, 402	0. 1	—	0. 1	—	—
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 11, 000	千ドミニカ・ペソ 12, 388	23, 899	0. 1	0. 1	—	0. 1	—
合計	—	—	20, 370, 318	96. 9	1. 7	56. 1	29. 6	11. 2

（注１）邦貨換算金額は、2021年６月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
（注２）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注３）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。
（注４）評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

2021年6月15日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千トルコ・リラ	千トルコ・リラ	千円	
トルコ		Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	790	712	9,275	2022/09/14
		Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	2,780	2,361	30,721	2023/03/08
		Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	576	7,500	2024/03/20
		Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	1,630	1,303	16,962	2024/07/24
		Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	2,690	1,994	25,951	2025/03/12
		Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	2,570	2,002	26,054	2026/02/11
		Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,400	2,293	29,843	2022/03/02
		Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,264	29,463	2027/02/24
		Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	1,900	1,762	22,934	2022/08/17
		Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	2,500	1,841	23,956	2027/08/11
		Turkey Government Bond	国債証券	12.2000	1,400	1,301	16,926	2023/01/18
		Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	2,000	1,604	20,874	2028/03/08
		Turkey Government Bond	国債証券	16.2000	1,400	1,369	17,810	2023/06/14
		Turkey Government Bond	国債証券	12.6000	1,500	1,266	16,469	2025/10/01
		Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	4,300	3,202	41,659	2030/11/13
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金額				31,510	25,858	336,402	
					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	34,400	34,026	187,744	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	20,500	21,919	120,940	2047/11/07
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	22,000	23,525	129,802	2024/09/05
		Mexican Bonos	国債証券	6.7500	23,000	23,693	130,730	2023/03/09
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,250	28,985	159,932	2023/12/07
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	26,550	30,153	166,377	2024/12/05
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	30,230	32,142	177,346	2027/06/03
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	9,413	51,942	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	30,730	34,598	190,901	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	20,400	22,886	126,279	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,450	24,258	133,847	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	31,450	31,990	176,513	2022/06/09
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	20,120	21,004	115,892	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,430	11,181	61,696	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金額				326,900	349,780	1,929,948	
					千フィリピン・ペソ	千フィリピン・ペソ		
フィリピン		Philippine Government International Bond	国債証券	6.2500	10,000	11,992	27,568	2036/01/14
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金額				10,000	11,992	27,568	
					千チリ・ペソ	千チリ・ペソ		
チリ		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	500,000	534,505	81,926	2026/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	570,000	590,976	90,581	2035/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	410,000	467,383	71,638	2043/01/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	410,000	426,834	65,423	2030/09/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.0000	250,000	260,997	40,004	2023/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	650,000	649,317	99,524	2025/03/01
通貨小計	銘柄数	6銘柄						
	金額				2,790,000	2,930,014	449,097	
					千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ		
コロンビア		Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	90,000	108,428	3,267	2027/06/28
		Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	45,984	1,385	2023/03/21
		Colombian TES	国債証券	7.0000	3,635,000	3,770,331	113,630	2022/05/04
		Colombian TES	国債証券	10.0000	3,050,000	3,531,137	106,421	2024/07/24
		Colombian TES	国債証券	6.0000	4,290,000	4,162,801	125,458	2028/04/28
		Colombian TES	国債証券	7.5000	3,710,000	3,973,410	119,750	2026/08/26
		Colombian TES	国債証券	7.7500	2,700,000	2,836,134	85,475	2030/09/18
		Colombian TES	国債証券	7.0000	3,000,000	2,967,090	89,422	2032/06/30
		Colombian TES	国債証券	6.2500	2,700,000	2,782,890	83,870	2025/11/26
		Colombian TES	国債証券	7.2500	3,400,000	3,373,854	101,681	2034/10/18
		Colombian TES	国債証券	5.7500	1,900,000	1,834,032	55,274	2027/11/03
		Colombian TES	国債証券	7.2500	1,100,000	1,019,645	30,730	2050/10/26
通貨小計	銘柄数	12銘柄						
	金額				29,620,000	30,405,738	916,368	
					千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア		
インドネシア		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	8,250,000	9,236,040	72,041	2036/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	6,000,000	7,013,280	54,703	2031/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	5,867,235	45,764	2032/08/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,660,547	59,752	2038/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	10,953,300	85,435	2024/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	7,200,000	8,164,584	63,683	2039/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	12,000,000	13,534,920	105,572	2029/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	14,300,000	15,010,424	117,081	2030/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	16,000,000	16,777,120	130,861	2025/06/15

区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
2021年6月15日現在								
				%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円	
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	9,300,000	9,853,908	76,860	2035/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	10,000,000	10,515,100	82,017	2040/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	8,000,000	8,062,000	62,883	2026/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	10,300,000	10,416,184	81,246	2031/02/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	2,300,000	2,290,455	17,865	2036/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	3,600,000	4,342,176	33,868	2025/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	2,180,000	2,791,795	21,776	2030/08/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,608,253	28,144	2031/07/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,824,000	14,496,249	113,070	2026/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,341,232	41,661	2032/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	10,330,000	11,011,780	85,891	2027/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	11,060,000	11,408,168	88,983	2022/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	10,910,000	11,170,749	87,131	2023/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	11,450,000	11,553,622	90,118	2028/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	7,075,000	7,117,945	55,519	2033/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,520,000	14,124,813	110,173	2034/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	13,150,000	14,413,189	112,422	2024/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	11,120,000	13,006,619	101,451	2029/03/15
通貨小計	銘柄数	27銘柄						
	金額				240,389,000	259,741,690	2,025,985	
ブラジル					千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル		
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	12,210	12,700	276,194	2023/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,690	11,309	245,942	2025/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	9,150	9,704	211,035	2027/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	5,300	5,613	122,080	2029/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	2,400	2,519	54,785	2031/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	6,100	5,714	124,268	2022/07/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	12,700	10,929	237,675	2023/07/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	25,700	21,183	460,677	2024/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	4,000	3,158	68,679	2024/07/01
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金額				88,250	82,831	1,801,339	
チェコ					千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ		
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	12,600	13,351	70,051	2028/08/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	8,600	9,748	51,146	2024/05/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	8,700	9,186	48,198	2022/09/12
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	16,100	16,731	87,784	2025/09/17
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	17,900	17,459	91,607	2026/06/26
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	16,000	15,057	79,005	2030/05/15
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	9,900	9,751	51,166	2023/10/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	15,500	14,421	75,669	2027/02/10
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	12,000	13,002	68,219	2029/07/23
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	17,000	17,447	91,541	2033/10/13
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	13,000	12,445	65,299	2031/03/13
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	6,000	5,277	27,687	2029/11/29
		Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	7,500	9,815	51,499	2036/12/04
通貨小計	銘柄数	13銘柄						
	金額				160,800	163,695	858,878	
ルーマニア					千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ		
		Romania Government Bond	国債証券	5.8500	1,430	1,525	41,355	2023/04/26
		Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,240	33,614	2025/02/24
		Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,100	2,458	66,629	2027/07/26
		Romania Government Bond	国債証券	3.5000	1,090	1,113	30,182	2022/12/19
		Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,600	1,641	44,487	2024/04/29
		Romania Government Bond	国債証券	3.4000	1,700	1,719	46,607	2022/03/08
		Romania Government Bond	国債証券	4.2500	1,500	1,561	42,315	2023/06/28
		Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,926	79,321	2029/02/12
		Romania Government Bond	国債証券	4.8500	1,600	1,758	47,676	2026/04/22
		Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,400	1,421	38,527	2031/09/24
		Romania Government Bond	国債証券	4.5000	900	955	25,892	2024/06/17
		Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,500	1,566	42,458	2025/07/28
		Romania Government Bond	国債証券	4.1500	800	858	23,266	2028/01/26
通貨小計	銘柄数	13銘柄						
	金額				19,370	20,745	562,335	
中国					千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		
		China Government Bond	国債証券	3.2900	3,900	3,952	67,906	2023/10/18
		China Government Bond	国債証券	3.2200	5,700	5,763	99,001	2025/12/06
		China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,849	83,307	2028/11/22
		China Government Bond	国債証券	3.1900	6,700	6,773	116,355	2024/04/11
		China Government Bond	国債証券	3.2900	8,200	8,295	142,506	2029/05/23
		China Government Bond	国債証券	3.2500	6,800	6,885	118,278	2026/06/06
		China Government Bond	国債証券	3.1200	7,000	7,028	120,734	2026/12/05
		China Government Bond	国債証券	3.1300	7,000	6,991	120,100	2029/11/21
		China Government Bond	国債証券	2.9400	4,500	4,508	77,450	2024/10/17

2021年6月15日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
		China Government Bond	国債証券	2.8500	8,600	8,486	145,788	2027/06/04
		China Government Bond	国債証券	2.6800	9,400	9,024	155,028	2030/05/21
		China Government Bond	国債証券	1.9900	8,000	7,715	132,535	2025/04/09
		China Government Bond	国債証券	2.3600	6,150	6,099	104,786	2023/07/02
		China Government Bond	国債証券	2.8800	4,900	4,909	84,335	2023/11/05
		China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,006	120,355	2025/10/22
		China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,056	86,864	2027/12/03
		China Government Bond	国債証券	3.2700	7,300	7,386	126,895	2030/11/19
		China Government Bond	国債証券	3.0300	1,700	1,703	29,265	2026/03/11
		China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	5,922	101,745	2050/09/14
通貨小計	銘柄数	19銘柄						
	金額				118,450	118,358	2,033,242	
					千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル		
ロシア		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	46,760	49,776	76,158	2027/02/03
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	32,910	33,438	51,160	2022/07/20
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	14,400	14,559	22,276	2023/01/25
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	46,160	46,767	71,554	2028/01/19
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	33,800	34,247	52,399	2023/08/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	31,000	34,180	52,296	2031/09/17
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	51,600	54,009	82,634	2026/09/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	51,000	51,897	79,402	2022/12/07
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	46,100	48,275	73,862	2033/03/23
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	48,600	49,415	75,604	2024/10/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	38,000	38,125	58,331	2024/02/28
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.2500	45,000	45,500	69,616	2034/05/10
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.9000	51,000	50,920	77,908	2029/05/23
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.9500	51,000	53,630	82,054	2026/10/07
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	55,000	56,372	86,250	2024/07/17
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1500	59,000	60,006	91,810	2025/11/12
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6500	65,000	67,879	103,855	2030/04/10
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	38,000	40,178	61,472	2039/03/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.0000	58,000	55,615	85,091	2027/10/06
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	4.5000	20,000	18,475	28,267	2025/07/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.1000	53,000	48,192	73,735	2035/07/18
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	5.7000	65,000	61,068	93,434	2028/05/17
通貨小計	銘柄数	22銘柄						
	金額				1,000,330	1,012,533	1,549,175	
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.9480	3,400	3,461	92,638	2022/04/14
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,933	51,760	2027/07/26
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0940	2,000	2,094	56,057	2023/11/30
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	1,700	1,843	49,348	2028/10/31
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	1,600	1,704	45,635	2029/07/09
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.6550	1,700	1,773	47,481	2024/10/15
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	2,200	2,305	61,715	2026/03/31
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	1,500	1,520	40,707	2030/10/15
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4220	1,100	1,128	30,216	2027/09/30
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4470	900	841	22,513	2036/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	1,750	1,811	48,475	2027/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	2,350	2,461	65,892	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,838	49,204	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	2,950	3,121	83,561	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,400	1,451	38,848	2023/08/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	2,000	2,133	57,105	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	1,200	1,210	32,387	2021/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	3,020	3,183	85,202	2024/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	2,520	2,666	71,367	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	2,600	2,813	75,302	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,446	38,705	2023/04/20
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	2,000	2,130	57,019	2026/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,150	2,259	60,484	2029/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	1,100	1,138	30,484	2024/06/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	2,350	2,351	62,949	2034/07/05
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,800	1,705	45,650	2040/05/22
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	1,900	1,829	48,966	2050/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,000	949	25,404	2031/04/15
通貨小計	銘柄数	28銘柄						
	金額				53,130	55,110	1,475,086	
					千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
南アフリカ		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	34,550	39,797	317,984	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	11,220	8,065	64,441	2036/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	12,580	8,553	68,339	2041/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	12,440	10,843	86,643	2031/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	11,380	11,881	94,936	2023/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	29,520	25,326	202,360	2048/02/28

2021年6月15日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	20,900	18,128	144,847	2037/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	26,900	25,844	206,499	2030/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	16,600	14,232	113,717	2044/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	19,600	18,188	145,323	2032/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	16,600	15,226	121,661	2035/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	13,800	12,246	97,853	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	12銘柄						
	金額				226,090	208,336	1,664,608	
					千タイ・バーツ	千タイ・バーツ		
タイ		Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	26,050	32,444	114,852	2029/06/22
		Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	23,300	24,741	87,585	2023/06/16
		Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	26,610	30,120	106,626	2025/12/12
		Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	22,700	26,494	93,791	2031/06/20
		Thailand Government Bond	国債証券	1.8750	17,200	17,447	61,764	2022/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	23,600	27,024	95,667	2036/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	29,400	31,046	109,905	2026/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	24,000	24,564	86,959	2022/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	29,000	34,213	121,114	2032/06/25
		Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	24,900	25,982	91,978	2046/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.4000	24,500	25,624	90,711	2023/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	26,500	29,097	103,003	2028/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	31,500	35,429	125,421	2038/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1.4500	30,000	30,809	109,066	2024/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	27,500	27,438	97,131	2029/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	15,500	14,625	51,775	2035/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	0.9500	28,000	28,211	99,868	2025/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	0.7500	20,900	20,998	74,334	2024/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1.5850	12,400	11,659	41,273	2035/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	9,000	9,168	32,457	2031/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	7,000	6,494	22,990	2042/06/17
通貨小計	銘柄数	21銘柄						
	金額				479,560	513,638	1,818,281	
					千ペルー・ソル	千ペルー・ソル		
ペルー		Peru Government Bond	国債証券	5.7000	730	817	23,101	2024/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.3500	1,970	2,225	62,894	2028/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.1500	1,850	1,961	55,444	2032/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	5.9400	1,900	2,097	59,277	2029/02/12
		Peru Government Bond	国債証券	5.4000	1,250	1,205	34,068	2034/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	5.3500	1,000	892	25,210	2040/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	8.2000	1,565	1,946	55,018	2026/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.9000	2,065	2,200	62,178	2037/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.9500	1,920	2,172	61,402	2031/08/12
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金額				14,250	15,518	438,595	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	3,610	3,867	113,927	2022/09/23
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,990	6,383	188,029	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,140	4,422	130,264	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,200	3,264	96,162	2022/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,500	4,663	137,351	2023/01/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,500	5,810	171,138	2024/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	5,450	5,944	175,075	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,100	3,263	96,135	2024/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.7500	2,000	1,996	58,797	2025/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,900	3,741	110,209	2030/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.2500	600	567	16,725	2026/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,530	2,746	80,906	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,500	4,899	144,299	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	3,550	3,882	114,368	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金額				52,570	55,455	1,633,391	
					千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント		
ハンガリー		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	98,500	102,469	39,059	2024/06/26
		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	170,000	178,704	68,118	2027/10/27
		Hungary Government Bond	国債証券	1.7500	140,000	141,715	54,019	2022/10/26
		Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000	134,832	51,395	2026/12/22
		Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	88,000	114,417	43,614	2028/10/22
		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	145,000	151,626	57,797	2030/08/21
		Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	160,000	164,176	62,581	2024/10/24
		Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	202,000	214,968	81,942	2031/10/22
		Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	40,000	40,259	15,346	2023/08/23
		Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	130,000	125,027	47,658	2025/11/26
		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	75,000	72,885	27,782	2038/10/27
		Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	95,000	93,073	35,477	2026/04/22

2021年６月15日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント	千円	
		Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	50,000	48,944	18,656	2029/05/23
		Hungary Government Bond	国債証券	2.2500	80,000	75,666	28,842	2033/04/20
		Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	131,800	146,522	55,851	2023/11/24
		Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	125,000	132,831	50,633	2022/06/24
		Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	142,500	162,478	61,934	2025/06/24
通貨小計	銘柄数	17銘柄						
	金額				2,002,800	2,100,596	800,711	
					千ウルグアイ・ペソ	千ウルグアイ・ペソ		
ウルグアイ		Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	2,800	2,902	7,333	2028/03/15
		Uruguay Government International Bond	国債証券	8.2500	7,000	7,151	18,069	2031/05/21
通貨小計	銘柄数	2銘柄						
	金額				9,800	10,053	25,402	
					千ドミニカ・ペソ	千ドミニカ・ペソ		
ドミニカ共和国		Dominican Republic International Bond	国債証券	9.7500	11,000	12,388	23,899	2026/06/05
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金額				11,000	12,388	23,899	
合計	銘柄数	255銘柄						
	金額						20,370,318	

（注１）邦貨換算金額は、2021年６月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
（注２）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

運用報告書　第10期　（決算日　2020年７月６日）

（作成対象期間　2019年７月６日～2020年７月６日）

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

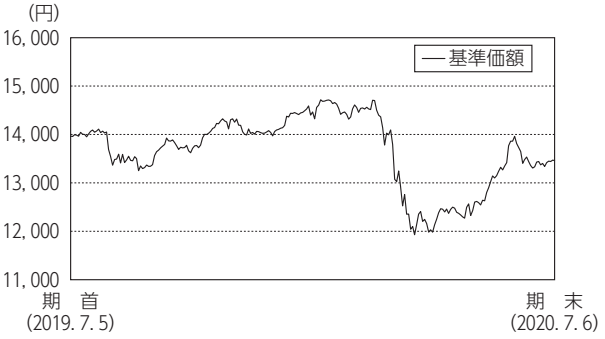
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をＪＰモルガン　ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ　グローバル・ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	新興国通貨建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10％以下

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年　月　日	基準価額	騰落率	ＪＰモルガン　ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ　グローバル　ダイバーシファイド（円換算）（ベンチマーク）	騰落率	公社債組入比率
	円	%		%	%
(期首)2019年７月５日	13,964	―	14,926	―	96.8
７月末	14,031	0.5	14,981	0.4	96.3
８月末	13,369	△ 4.3	14,277	△ 4.3	96.1
９月末	13,729	△ 1.7	14,700	△ 1.5	96.4
10月末	14,259	2.1	15,209	1.9	96.9
11月末	14,052	0.6	15,006	0.5	95.9
12月末	14,591	4.5	15,590	4.5	95.9
2020年１月末	14,416	3.2	15,416	3.3	95.9
２月末	14,137	1.2	15,142	1.4	95.8
３月末	12,246	△ 12.3	13,096	△ 12.3	96.5
４月末	12,495	△ 10.5	13,352	△ 10.5	94.4
５月末	13,268	△ 5.0	14,228	△ 4.7	94.9
６月末	13,419	△ 3.9	14,372	△ 3.7	95.3
(期末)2020年７月６日	13,460	△ 3.6	14,417	△ 3.4	95.5

（注１）騰落率は期首比。
（注２）ＪＰモルガン　ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ　グローバル　ダイバーシファイド（円換算）は、ＪＰモルガン　ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ　グローバル　ダイバーシファイド（米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。ＪＰモルガン　ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ　グローバル　ダイバーシファイド（米ドルベース）は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.
（注３）海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
（注４）指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
（注５）公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。

《運用経過》

【基準価額・騰落率】
期首：13,964円　期末：13,460円　騰落率：△3.6％

【基準価額の主な変動要因】
投資対象国の債券価格の多くが上昇（金利は低下）したことや投資している債券からの利息収入はプラス要因となったものの、投資対象通貨のほぼすべての対円為替レートが下落（円高）したことがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○新興国債券市況

新興国債券の価格は、多くの国で上昇しました。

新興国債券の価格は、2019年８月には米中貿易摩擦への懸念の高まりにより一時下落する局面もありましたが、９月以降は、米中貿易摩擦などへの懸念が和らいだことなどから上昇しました。しかし2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染が世界的に拡大したことから経済の減速懸念が高まり、２月後半には金融市場が急激にリスク回避的な動きとなりました。先進国の金利が低下する一方で、現金化ニーズや新興国からの資金流出懸念などから、新興国の債券価格は下落しました。その後、欧米主要国の金融当局が相次いで金融緩和や流動性供給策を実施し、多くの新興国も追随したことから、金融市場は落ち着きを見せ、金利は低下しました。個別国では、従来より構造問題を抱え新型コロナウイルスによる打撃からの経済回復が相対的に遅いとみられる南アフリカや、債務再編を宣言したアルゼンチンなどの債券価格が下落しました。

○為替相場

新興国為替市場は、多くの通貨が対円で下落しました。

新興国通貨の対円為替相場は、2019年８月には米中の貿易摩擦への懸念や世界的な景気減速懸念などから一時下落しました。９月以降は、米中通商交渉や英国のＥＵ（欧州連合）離脱交渉の進展期待が高まる中で新興国通貨は上昇しました。2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染が世界的に拡大したことから経済の減速懸念が高まり、２月後半には金融市場がリスク回避的な動きとなりました。それを受けて３月には現金化ニーズや新興国からの資金流出懸念などから、新興国通貨は大きく売られました。その後は、各国の金融緩和や流動性供給策を受けて、下落幅を縮小させました。個別国では、新型コロナウイルスの感染拡大が止まらないブラジル・レアル、原油価格下落の影響を受けたロシア・ルーブル、ロシアからのミサイル防衛システム購入をめぐって対米関係が悪化し、新型コロナウイルスの影響で経常赤字拡大が懸念されるトルコ・リラ、感染拡大が止まらない米国への経済依存度が高く、利下げ続きのメキシコ・ペソ、構造問題を抱え新型コロナウイルスによる打撃からの経済回復が遅いとみられる南アフリカ・ランドなどが相対的に大きく下落しました。

◆前作成期における「今後の運用方針」

今後も、新興国通貨建ての債券に投資し、ファンドの通貨比率をベンチマーク（ＪＰモルガン　ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ　グローバル　ダイバーシファイド（円換算））に極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△3.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△3.6%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、税金、売買に伴う費用などが主な要因です。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用	17
(保管費用)	(16)
(その他)	(1)
合計	17

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

■売買および取引の状況

公社債

(2019年7月6日から2020年7月6日まで)

			買付額	売付額
外国	トルコ	国債証券	千トルコ・リラ 1,730	千トルコ・リラ 3,361 (—)
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 92,403	千メキシコ・ペソ 27,655 (—)
	フィリピン	国債証券	千フィリピン・ペソ 12,265	千フィリピン・ペソ 15,103 (—)
	アルゼンチン	国債証券	千アルゼンチン・ペソ —	千アルゼンチン・ペソ 4,771 (—)
	チリ	国債証券	千チリ・ペソ 510,255	千チリ・ペソ 712,114 (—)
	コロンビア	国債証券	千コロンビア・ペソ 6,185,347	千コロンビア・ペソ 1,571,030 (—)
	インドネシア	国債証券	千インドネシア・ルピア 52,116,249	千インドネシア・ルピア 29,824,871 (—)
	ブラジル	国債証券	千ブラジル・レアル 35,832	千ブラジル・レアル 14,958 (—)
	チェコ	国債証券	千チェコ・コルナ 52,476	千チェコ・コルナ 6,668 (—)
	ルーマニア	国債証券	千ルーマニア・レイ 6,942	千ルーマニア・レイ 2,100 (—)
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 41,697	千オフショア・人民元 — (—)
	ロシア	国債証券	千ロシア・ルーブル 333,692	千ロシア・ルーブル 86,479 (—)
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 15,446	千マレーシア・リンギット 4,599 (—)
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 65,095	千南アフリカ・ランド 12,380 (—)
	タイ	国債証券	千タイ・バーツ 130,705	千タイ・バーツ 49,563 (—)
	ペルー	国債証券	千ペルー・ソル 5,002	千ペルー・ソル 1,468 (—)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 17,138	千ポーランド・ズロチ 12,617 (—)
	ハンガリー	国債証券	千ハンガリー・フォリント 333,526	千ハンガリー・フォリント 167,397 (—)
	ドミニカ	国債証券	千ドミニカ・ペソ 11,415	千ドミニカ・ペソ — (—)

(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7月6日から2020年7月6日まで)

当期			
買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2023/7/1	212,045	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2021/1/1	135,600
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	165,800	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2021/7/1	119,296
Poland Government Bond (ポーランド) 2.75% 2029/10/25	149,071	Poland Government Bond (ポーランド) 1.75% 2021/7/25	117,035
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8% 2030/1/31	131,069	Mexican Bonos (メキシコ) 6.5% 2021/6/10	103,640
Mexican Bonos (メキシコ) 8.5% 2029/5/31	127,068	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.25% 2021/7/15	70,478
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2025/1/1	119,234	Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2026/7/25	67,713
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2029/1/1	113,201	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	65,576
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	107,487	Poland Government Bond (ポーランド) 2% 2021/4/25	58,527
Czech Republic Government Bond (チェコ) 2% 2033/10/13	101,786	BONOS TESORERIA PESOS (チリ) 4.5% 2021/3/1	55,623
Russian Federal Bond - OFZ (ロシア) 7.65% 2030/4/10	94,252	Poland Government Bond (ポーランド) 5.25% 2020/10/25	51,162

(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	当期末							
区分	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千トルコ・リラ	千トルコ・リラ	千円	%	%	%	%	%
トルコ	28,580	28,123	441,257	2.8	2.8	0.9	1.3	0.6
	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ						
メキシコ	275,400	311,333	1,497,514	9.4	—	5.7	2.4	1.3
	千フィリピン・ペソ	千フィリピン・ペソ						
フィリピン	10,000	12,342	26,782	0.2	—	0.2	—	—
	千チリ・ペソ	千チリ・ペソ						
チリ	2,190,000	2,719,102	364,631	2.3	—	2.1	0.2	—
	千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ						
コロンビア	27,720,000	30,534,012	900,753	5.7	—	4.0	0.8	0.9
	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア						
インドネシア	185,839,000	192,457,049	1,424,182	8.9	—	6.4	2.1	0.5
	千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル						
ブラジル	68,150	71,034	1,438,452	9.0	—	2.0	5.5	1.6
	千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ						
チェコ	150,500	162,413	737,355	4.6	—	3.5	0.9	0.2
	千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ						
ルーマニア	16,570	17,200	431,213	2.7	—	1.2	1.1	0.4
	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元						
中国	40,700	41,219	627,778	3.9	—	2.7	1.3	—
	千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル						
ロシア	821,630	896,691	1,362,970	8.6	—	5.1	2.6	0.8
	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット						
マレーシア	38,580	41,407	1,040,981	6.5	—	4.2	1.6	0.7
	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド						
南アフリカ	205,190	177,883	1,124,223	7.1	—	6.5	0.6	—
	千タイ・バーツ	千タイ・バーツ						
タイ	363,860	411,245	1,422,911	8.9	—	5.9	2.0	1.1
	千ペルー・ソル	千ペルー・ソル						
ペルー	15,050	17,558	533,778	3.4	—	3.2	0.2	—
	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ						
ポーランド	41,440	45,533	1,236,688	7.8	—	4.1	2.7	0.9
	千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント						
ハンガリー	1,459,800	1,621,001	555,030	3.5	—	1.4	1.6	0.5
	千ウルグアイ・ペソ	千ウルグアイ・ペソ						
ウルグアイ	8,100	7,851	19,786	0.1	—	0.0	—	0.1
	千ドミニカ・ペソ	千ドミニカ・ペソ						
ドミニカ共和国	11,000	9,927	18,167	0.1	0.1	0.1	—	—
合計	—	—	15,204,460	95.5	2.9	59.0	26.8	9.6

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

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	
				%	千トルコ・リラ	千トルコ・リラ	千円	
トルコ		Turkey Government Bond	国債証券	9.5000	1,660	1,657	26,002	2022/01/12
		Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	790	770	12,083	2022/09/14
		Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	2,780	2,575	40,401	2023/03/08
		Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	683	10,717	2024/03/20
		Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	1,630	1,552	24,365	2024/07/24
		Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	2,690	2,430	38,128	2025/03/12
		Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	2,570	2,487	39,024	2026/02/11
		Turkey Government Bond	国債証券	9.2000	2,010	2,000	31,382	2021/09/22
		Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,400	2,460	38,597	2022/03/02
		Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,859	44,866	2027/02/24
		Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	1,900	1,930	30,284	2022/08/17
		Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	1,700	1,608	25,241	2027/08/11
		Turkey Government Bond	国債証券	12.2000	1,400	1,455	22,836	2023/01/18
		Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	2,000	2,057	32,282	2028/03/08
		Turkey Government Bond	国債証券	16.2000	1,400	1,596	25,043	2023/06/14
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金額				28,580	28,123	441,257	
					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	18,900	19,522	93,905	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	17,500	19,907	95,754	2047/11/07
		Mexican Bonos	国債証券	7.2500	10,000	10,355	49,808	2021/12/09
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	22,000	24,724	118,923	2024/09/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	22,750	25,148	120,962	2023/12/07

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	24,150	29,159	140,258	2024/12/05
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	30,230	33,925	163,182	2027/06/03
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	10,066	48,420	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	30,730	36,703	176,545	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	14,100	16,997	81,758	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	17,950	20,514	98,676	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	6.5000	31,450	32,523	156,439	2022/06/09
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	17,820	19,841	95,437	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,430	11,942	57,442	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金額				275,400	311,333	1,497,514	
					千フィリピン・ペソ	千フィリピン・ペソ		
フィリピン		Philippine Government International Bond	国債証券	6.2500	10,000	12,342	26,782	2036/01/14
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金額				10,000	12,342	26,782	
					千チリ・ペソ	千チリ・ペソ		
チリ		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	550,000	643,791	86,332	2026/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	570,000	706,537	94,746	2035/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	410,000	601,412	80,649	2043/01/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	410,000	493,422	66,167	2030/09/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.0000	250,000	273,937	36,735	2023/03/01
通貨小計	銘柄数	5銘柄						
	金額				2,190,000	2,719,102	364,631	
					千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ		
コロンビア		Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	90,000	114,263	3,370	2027/06/28
		Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	45,253	1,334	2023/03/21
		Colombian TES	国債証券	7.0000	4,335,000	4,640,270	136,887	2022/05/04
		Colombian TES	国債証券	10.0000	3,650,000	4,519,466	133,324	2024/07/24
		Colombian TES	国債証券	6.0000	5,090,000	5,244,430	154,710	2028/04/28
		Colombian TES	国債証券	7.5000	4,310,000	4,985,075	147,059	2026/08/26
		Colombian TES	国債証券	7.7500	2,700,000	2,995,785	88,375	2030/09/18
		Colombian TES	国債証券	7.0000	3,000,000	3,139,380	92,611	2032/06/30
		Colombian TES	国債証券	6.2500	2,300,000	2,519,650	74,329	2025/11/26
		Colombian TES	国債証券	7.2500	2,200,000	2,330,438	68,747	2034/10/18
通貨小計	銘柄数	10銘柄						
	金額				27,720,000	30,534,012	900,753	
					千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア		
インドネシア		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	8,250,000	8,638,162	63,922	2036/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	6,000,000	6,508,440	48,162	2031/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	5,441,315	40,265	2032/08/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,202,618	53,299	2038/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	10,571,200	78,226	2024/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	5,000,000	5,283,150	39,095	2039/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	12,000,000	12,793,920	94,675	2029/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	8,100,000	7,987,167	59,105	2030/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	9,000,000	8,995,770	66,568	2025/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	6,100,000	6,041,562	44,707	2035/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	3,600,000	4,268,628	31,587	2025/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	2,180,000	2,665,050	19,721	2030/08/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,386,542	25,060	2031/07/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	10,224,000	11,039,261	81,690	2026/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	4,972,300	36,795	2032/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	10,330,000	10,368,737	76,728	2027/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	11,060,000	11,385,053	84,249	2022/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	10,910,000	10,789,771	79,844	2023/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	8,700,000	8,153,988	60,339	2028/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	7,075,000	6,480,417	47,955	2033/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,520,000	13,190,446	97,609	2034/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	13,150,000	13,965,694	103,346	2024/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	11,120,000	12,327,854	91,226	2029/03/15
通貨小計	銘柄数	23銘柄						
	金額				185,839,000	192,457,049	1,424,182	
					千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル		
ブラジル		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	13,310	15,134	306,482	2023/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	9,490	11,171	226,225	2025/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	7,250	8,689	175,960	2027/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	5,100	6,221	125,987	2029/01/01
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	500	620	12,562	2031/01/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	7,200	6,897	139,679	2022/01/01

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル	千円	
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	6, 100	5, 695	115, 340	2022/07/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	12, 700	11, 121	225, 205	2023/07/01
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	6, 500	5, 481	111, 008	2024/01/01
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金額				68, 150	71, 034	1, 438, 452	
					千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ		
チェコ		Czech Republic Government Bond	国債証券	3. 8500	8, 200	8, 588	38, 990	2021/09/29
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2. 5000	12, 600	14, 381	65, 289	2028/08/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	5. 7000	8, 600	10, 407	47, 248	2024/05/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	4. 7000	10, 200	11, 240	51, 031	2022/09/12
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2. 4000	16, 100	17, 591	79, 866	2025/09/17
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1. 0000	17, 900	18, 313	83, 144	2026/06/26
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0. 9500	12, 000	12, 160	55, 207	2030/05/15
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0. 4500	9, 900	9, 947	45, 162	2023/10/25
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0. 2500	13, 000	12, 668	57, 516	2027/02/10
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2. 7500	12, 000	14, 105	64, 037	2029/07/23
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2. 0000	20, 000	22, 640	102, 785	2033/10/13
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1. 2000	10, 000	10, 368	47, 074	2031/03/13
通貨小計	銘柄数	12銘柄						
	金額				150, 500	162, 413	737, 355	
					千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ		
ルーマニア		Romania Government Bond	国債証券	5. 8500	1, 430	1, 520	38, 125	2023/04/26
		Romania Government Bond	国債証券	4. 7500	1, 150	1, 204	30, 204	2025/02/24
		Romania Government Bond	国債証券	5. 8000	2, 100	2, 365	59, 301	2027/07/26
		Romania Government Bond	国債証券	3. 5000	1, 090	1, 092	27, 385	2022/12/19
		Romania Government Bond	国債証券	3. 2500	1, 600	1, 584	39, 728	2024/04/29
		Romania Government Bond	国債証券	3. 4000	1, 700	1, 702	42, 674	2022/03/08
		Romania Government Bond	国債証券	4. 2500	1, 500	1, 532	38, 420	2023/06/28
		Romania Government Bond	国債証券	4. 0000	1, 000	1, 010	25, 328	2021/10/27
		Romania Government Bond	国債証券	5. 0000	2, 600	2, 798	70, 158	2029/02/12
		Romania Government Bond	国債証券	4. 8500	1, 000	1, 057	26, 518	2026/04/22
		Romania Government Bond	国債証券	3. 6500	1, 400	1, 330	33, 366	2031/09/24
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金額				16, 570	17, 200	431, 213	
					千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		
中国		China Government Bond	国債証券	3. 2900	1, 800	1, 846	28, 123	2023/10/18
		China Government Bond	国債証券	3. 2200	2, 100	2, 148	32, 722	2025/12/06
		China Government Bond	国債証券	3. 2500	1, 800	1, 836	27, 968	2028/11/22
		China Government Bond	国債証券	3. 1900	2, 700	2, 769	42, 173	2024/04/11
		China Government Bond	国債証券	3. 2900	5, 400	5, 540	84, 377	2029/05/23
		China Government Bond	国債証券	3. 2500	4, 800	4, 914	74, 851	2026/06/06
		China Government Bond	国債証券	3. 1200	4, 500	4, 570	69, 607	2026/12/05
		China Government Bond	国債証券	3. 1300	4, 500	4, 577	69, 719	2029/11/21
		China Government Bond	国債証券	2. 9400	4, 500	4, 577	69, 710	2024/10/17
		China Government Bond	国債証券	2. 8500	1, 600	1, 598	24, 349	2027/06/04
		China Government Bond	国債証券	2. 6800	3, 000	2, 945	44, 852	2030/05/21
		China Government Bond	国債証券	1. 9900	4, 000	3, 894	59, 320	2025/04/09
通貨小計	銘柄数	12銘柄						
	金額				40, 700	41, 219	627, 778	
					千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル		
ロシア		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8. 1500	31, 760	36, 394	55, 319	2027/02/03
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7. 6000	32, 910	34, 905	53, 056	2022/07/20
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7. 0000	14, 400	15, 196	23, 098	2023/01/25
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7. 0500	46, 160	50, 137	76, 209	2028/01/19
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7. 0000	24, 300	25, 896	39, 362	2023/08/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7. 5000	29, 300	30, 285	46, 034	2021/08/18
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8. 5000	31, 000	37, 266	56, 645	2031/09/17
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7. 7500	43, 100	48, 358	73, 505	2026/09/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7. 4000	59, 000	62, 730	95, 350	2022/12/07
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7. 7000	45, 100	51, 187	77, 804	2033/03/23
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7. 1000	35, 600	38, 290	58, 201	2024/10/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7. 0000	49, 000	50, 732	77, 112	2021/12/15
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6. 5000	38, 000	39, 936	60, 702	2024/02/28
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7. 2500	45, 000	49, 457	75, 175	2034/05/10
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6. 9000	51, 000	54, 728	83, 187	2029/05/23
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7. 9500	51, 000	57, 751	87, 782	2026/10/07
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7. 4000	55, 000	59, 688	90, 726	2024/07/17
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7. 1500	35, 000	37, 899	57, 607	2025/11/12
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7. 6500	40, 000	44, 970	68, 354	2030/04/10

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル	千円	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	33,000	38,182	58,037	2039/03/16
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.0000	32,000	32,693	49,694	2027/10/06
通貨小計	銘柄数	21銘柄						
	金額				821,630	896,691	1,362,970	
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.9480	3,400	3,507	88,174	2022/04/14
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,978	49,750	2027/07/26
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0940	2,000	2,117	53,226	2023/11/30
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	1,700	1,888	47,478	2028/10/31
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	2,600	2,847	71,586	2029/07/09
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.6550	1,700	1,788	44,973	2024/10/15
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	1,400	1,488	37,427	2026/03/31
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	1,500	1,584	39,844	2030/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	2,350	2,505	62,977	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,869	46,991	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,850	1,991	50,053	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,400	1,463	36,782	2023/08/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	3,000	3,232	81,255	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	1,200	1,226	30,838	2021/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,420	1,520	38,230	2024/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	2,120	2,285	57,460	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	2,600	2,984	75,026	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,457	36,648	2023/04/20
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	2,000	2,149	54,034	2026/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,400	1,520	38,217	2029/08/15
通貨小計	銘柄数	20銘柄						
	金額				38,580	41,407	1,040,981	
					千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
南アフリカ		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	30,050	34,216	216,247	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	11,220	7,329	46,322	2036/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	9,880	6,201	39,194	2041/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	15,940	12,980	82,038	2031/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	13,880	14,822	93,676	2023/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	29,520	22,875	144,574	2048/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	14,500	11,471	72,500	2037/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	22,900	20,912	132,169	2030/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	16,600	12,856	81,254	2044/01/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	15,300	13,114	82,884	2032/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	14,100	11,941	75,471	2035/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	11,300	9,159	57,889	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	12銘柄						
	金額				205,190	177,883	1,124,223	
					千タイ・バーツ	千タイ・バーツ		
タイ		Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	26,050	33,848	117,115	2029/06/22
		Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	23,300	25,380	87,817	2023/06/16
		Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	22,610	26,100	90,307	2025/12/12
		Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	30,600	32,020	110,791	2021/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	22,700	27,530	95,254	2031/06/20
		Thailand Government Bond	国債証券	1.8750	17,200	17,668	61,131	2022/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	16,600	20,467	70,817	2036/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	24,900	26,602	92,044	2026/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	20,000	20,720	71,691	2022/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	29,000	36,011	124,599	2032/06/25
		Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	24,900	29,262	101,247	2046/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.4000	22,000	23,341	80,761	2023/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	20,000	22,572	78,099	2028/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	21,000	25,837	89,398	2038/06/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1.4500	22,000	22,623	78,278	2024/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	9,000	9,267	32,065	2029/12/17
		Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	12,000	11,991	41,489	2035/06/17
通貨小計	銘柄数	17銘柄						
	金額				363,860	411,245	1,422,911	
					千ペルー・ソル	千ペルー・ソル		
ペルー		Peru Government Bond	国債証券	5.7000	730	848	25,790	2024/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.3500	1,970	2,331	70,879	2028/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.1500	1,850	2,113	64,255	2032/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	5.9400	1,900	2,191	66,635	2029/02/12
		Peru Government Bond	国債証券	5.4000	1,250	1,314	39,955	2034/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	5.3500	1,400	1,407	42,790	2040/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	8.2000	1,965	2,539	77,213	2026/08/12

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千ペルー・ソル	千ペルー・ソル	千円	
		Peru Government Bond	国債証券	6.9000	2,065	2,476	75,280	2037/08/12
		Peru Government Bond	国債証券	6.9500	1,920	2,334	70,977	2031/08/12
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金額				15,050	17,558	533,778	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	3,610	4,060	110,282	2022/09/23
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,740	4,086	110,980	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,640	3,982	108,175	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,200	3,325	90,313	2022/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,176	86,279	2023/01/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,500	5,940	161,346	2024/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	5,450	6,157	167,250	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,820	1,955	53,122	2021/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,530	2,835	77,023	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	5,400	6,015	163,391	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	3,550	3,995	108,523	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金額				41,440	45,533	1,236,688	
					千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント		
ハンガリー		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	98,500	105,946	36,276	2024/06/26
		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	170,000	185,087	63,373	2027/10/27
		Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	89,000	91,519	31,336	2021/10/27
		Hungary Government Bond	国債証券	1.7500	140,000	143,182	49,025	2022/10/26
		Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000	139,685	47,828	2026/12/22
		Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	88,000	120,718	41,333	2028/10/22
		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	120,000	128,558	44,018	2030/08/21
		Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	160,000	169,182	57,928	2024/10/24
		Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	65,000	71,194	24,376	2031/10/22
		Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	131,800	153,673	52,617	2023/11/24
		Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	125,000	140,668	48,164	2022/06/24
		Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	142,500	171,584	58,750	2025/06/24
通貨小計	銘柄数	12銘柄						
	金額				1,459,800	1,621,001	555,030	
					千ウルグアイ・ペソ	千ウルグアイ・ペソ		
ウルグアイ		Uruguay Government International Bond	国債証券	9.8750	5,300	5,289	13,329	2022/06/20
		Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	2,800	2,562	6,457	2028/03/15
通貨小計	銘柄数	2銘柄						
	金額				8,100	7,851	19,786	
					千ドミニカ・ペソ	千ドミニカ・ペソ		
ドミニカ共和国		Dominican Republic International Bond	国債証券	9.7500	11,000	9,927	18,167	2026/06/05
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金額				11,000	9,927	18,167	
合計	銘柄数	217銘柄						
	金額						15,204,460	

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

■投資信託財産の構成

2020年７月６日現在

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
公社債	15,204,460	95.0
コール・ローン等、その他	794,810	5.0
投資信託財産総額	15,999,270	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、７月６日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝107.65円、１トルコ・リラ＝15.69円、１メキシコ・ペソ＝4.81円、１フィリピン・ペソ＝2.17円、１アルゼンチン・ペソ＝1.52円、100チリ・ペソ＝13.41円、100コロンビア・ペソ＝2.95円、100インドネシア・ルピア＝0.74円、１ブラジル・レアル＝20.25円、１チェコ・コルナ＝4.54円、１ルーマニア・レイ＝25.07円、１オフショア・人民元＝15.23円、１ロシア・ルーブル＝1.52円、１マレーシア・リンギット＝25.14円、１南アフリカ・ランド＝6.32円、１タイ・バーツ＝3.46円、１ペルー・ソル＝30.40円、１ポーランド・ズロチ＝27.16円、100ハンガリー・フォリント＝34.24円、１ウルグアイ・ペソ＝2.52円、１ドミニカ・ペソ＝1.83円です。
（注３）当期末における外貨建純資産（15,718,458千円）の投資信託財産総額（15,999,270千円）に対する比率は、98.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年７月６日現在

項　　目	当　期　末
(A)資産	**16, 234, 609, 781円**
コール・ローン等	576, 230, 846
公社債（評価額）	15, 204, 460, 582
未収入金	243, 168, 944
未収利息	193, 911, 880
前払費用	16, 837, 529
(B)負債	**309, 390, 371**
未払金	288, 857, 058
未払解約金	20, 526, 161
その他未払費用	7, 152
(C)純資産総額（A－B）	**15, 925, 219, 410**
元本	11, 831, 677, 635
次期繰越損益金	4, 093, 541, 775
(D)受益権総口数	**11, 831, 677, 635口**
１万口当り基準価額（C／D）	**13, 460円**

＊期首における元本額は9, 423, 800, 647円、当作成期間中における追加設定元本額は3, 467, 075, 255円、同解約元本額は1, 059, 198, 267円です。
＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、新興国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）55, 786, 582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）255, 895, 312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）353, 072, 397円、Ｄ－Ｉ's　新興国債券インデックス54, 311, 180円、ｉＦｒｅｅ　新興国債券インデックス2, 854, 911, 762円、ｉＦｒｅｅ　８資産バランス1, 912, 727, 809円、ＤＣダイワ新興国債券インデックスファンド6, 133, 418, 719円、ダイワ・インデックスセレクト　新興国債券173, 893, 569円、ダイワ・ノーロード　新興国債券ファンド37, 660, 305円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は13, 460円です。

■損益の状況

当期　自 2019年７月６日　至 2020年７月６日

項　　目	当　　期
(A)配当等収益	**757, 470, 572円**
受取利息	757, 573, 046
支払利息	△ 102, 474
(B)有価証券売買損益	**△ 1, 322, 317, 061**
売買益	594, 453, 788
売買損	△ 1, 916, 770, 849
(C)その他費用	**△ 18, 122, 115**
(D)当期損益金（A＋B＋C）	**△ 582, 968, 604**
(E)前期繰越損益金	**3, 735, 990, 237**
(F)解約差損益金	**△ 328, 483, 412**
(G)追加信託差損益金	**1, 269, 003, 554**
(H)合計（D＋E＋F＋G）	**4, 093, 541, 775**
次期繰越損益金（H）	**4, 093, 541, 775**

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

ダイワファンドラップ
J－REITインデックス

運用報告書（全体版）
第５期
（決算日　2021年６月15日）
（作成対象期間　2020年６月16日～2021年６月15日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／不動産投信（リート）／インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	投資成果を東証ＲＥＩＴ指数（配当込み、以下同じ。）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの受益証券	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果を東証ＲＥＩＴ指数の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

<4640>

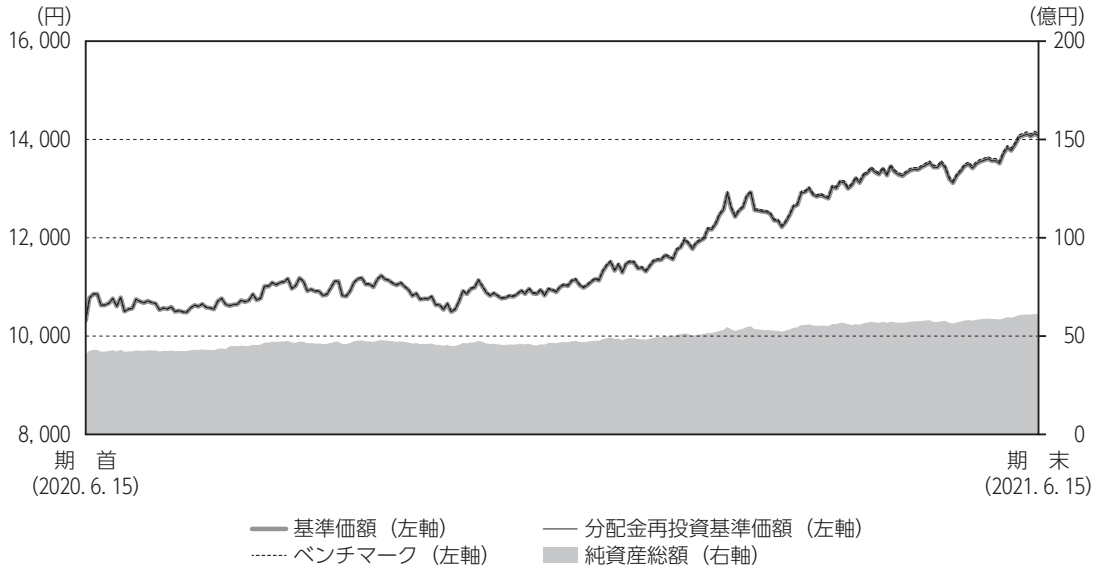
設定以来の運用実績

決算期	基準価額			東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）		投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1期末（2017年6月15日）	9,906	0	△ 0.9	3,274.94	△ 0.7	98.3	1.4	1,224
2期末（2018年6月15日）	10,250	0	3.5	3,398.25	3.8	98.3	1.5	2,355
3期末（2019年6月17日）	11,818	0	15.3	3,934.65	15.8	98.4	1.4	3,254
4期末（2020年6月15日）	10,318	0	△ 12.7	3,448.87	△ 12.3	96.3	2.6	4,081
5期末（2021年6月15日）	14,075	0	36.4	4,720.99	36.9	96.9	2.4	6,102

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

運用経過

基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期　首：10,318円
期　末：14,075円（分配金０円）
騰落率：36.4%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、国内リート市況が上昇したことを反映して、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。

年　月　日	基準価額		東証ＲＥＩＴ指数(配当込み)		投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2020年６月15日	10,318	—	3,448.87	—	96.3	2.6
６月末	10,545	2.2	3,525.99	2.2	97.4	2.6
７月末	10,571	2.5	3,535.10	2.5	97.4	2.5
８月末	11,165	8.2	3,735.15	8.3	97.3	2.5
９月末	11,053	7.1	3,698.94	7.3	97.5	2.5
10月末	10,494	1.7	3,512.43	1.8	97.5	2.4
11月末	10,859	5.2	3,635.82	5.4	97.5	2.4
12月末	11,509	11.5	3,854.76	11.8	97.6	2.4
2021年１月末	11,952	15.8	4,004.00	16.1	97.6	2.4
２月末	12,563	21.8	4,207.24	22.0	97.6	2.4
３月末	13,126	27.2	4,399.26	27.6	97.5	2.4
４月末	13,479	30.6	4,518.99	31.0	97.5	2.4
５月末	13,570	31.5	4,551.00	32.0	97.5	2.4
(期末)2021年６月15日	14,075	36.4	4,720.99	36.9	96.9	2.4

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2020.6.16～2021.6.15)

■国内リート市況

国内リート市況は上昇しました。

国内リート市況は、当作成期首より、国内外での新型コロナウイルス感染者数の増加によって投資家のリスク回避姿勢が強まり、下落しました。2020年８月以降は、「Go To トラベル」に東京発着分を加えるか判断するとの報道があり、期待感からホテルを中心に上昇に転じたものの、10月に入ると、大型オフィス銘柄において国内リート市場で過去最大規模の公募増資が発表されたことによる需給悪化懸念や、欧米での感染者数の再拡大などから下落しました。11月は、ワクチン開発の進展によってリスク選好姿勢が強まる中で上昇しました。12月以降も、ＦＴＳＥグローバル株式指数による国内リートの組入比率引き上げや、ワクチン接種が開始されたことによる経済活動正常化への期待感などを背景に、国内リート市場は上昇を続け、当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

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

ポートフォリオについて　（2020. 6. 16 ～ 2021. 6. 15）

■当ファンド

国内リートへの投資は、「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の受益証券を通じて行いました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

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

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

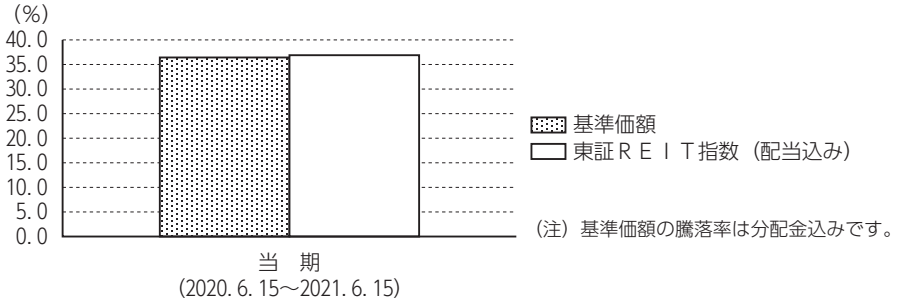
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は36. 9％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は36. 4％となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



＊ベンチマークは東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）です。

分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったことから、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６月16日 ～2021年６月15日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**―**
対基準価額比率	（%）	―
当期の収益	（円）	―
当期の収益以外	（円）	―
翌期繰越分配対象額	（円）	4, 074

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

今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2020. 6. 16～2021. 6. 15) 金額	比率	項目の概要
信託報酬	40円	0. 341%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は11, 732円です。**
(投信会社)	(25)	(0. 209)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(13)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0. 002	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0. 002)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 000)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0. 005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監査費用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0. 000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	41	0. 348	

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

(注２) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

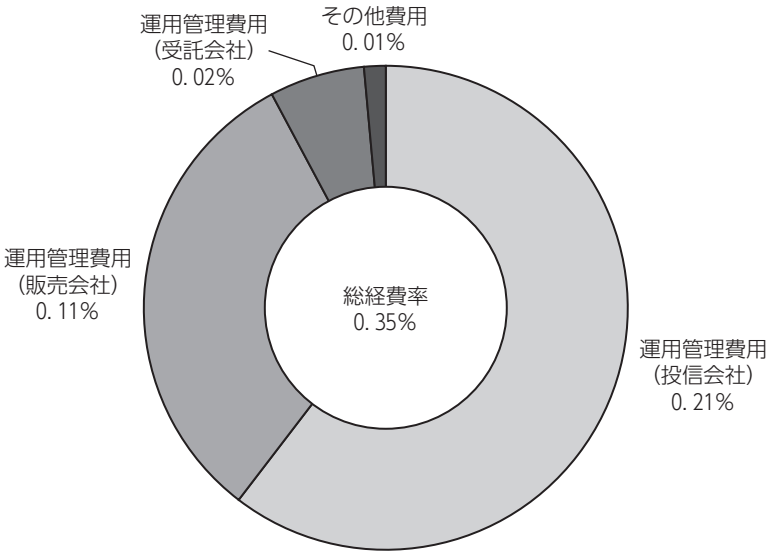
(注３) 各比率は１万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第３位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

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



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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	404,151	1,160,180	256,996	750,680

（注）単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	109,923	924	0.8	54,950	—	—
不動産投信指数先物取引	57,071	—	—	56,837	—	—
コール・ローン	1,734,719	—	—	—	—	—

（注）平均保有割合1.3％
※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

種類	当期		
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド		
	買付額	売付額	作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
投資信託証券	3,124	2,011	14,374

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

種類	当期
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド
	買付額
	百万円
投資信託証券	3,699

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

(5) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第１項に規定される利害関係人であり、当作成期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、サムティ・レジデンシャル投資法人、大和証券リビング投資法人です。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種　　類	期　首	当　期　末	
	口　数	口　数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワＪ－ＲＥＩＴ マザーファンド	1, 595, 500	1, 742, 654	6, 099, 988

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年６月15日現在

項　　目	当　期　末	
	評 価 額	比　率
	千円	%
ダイワＪ－ＲＥＩＴ マザーファンド	6, 099, 988	99. 8
コール・ローン等、その他	14, 172	0. 2
投資信託財産総額	6, 114, 161	100. 0

（注）評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年６月15日現在

項　　目	当　期　末
（Ａ）資産	**6, 114, 161, 056円**
コール・ローン等	14, 172, 531
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド （評価額）	6, 099, 988, 525
（Ｂ）負債	**11, 185, 071**
未払解約金	1, 841, 673
未払信託報酬	9, 195, 177
その他未払費用	148, 221
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）	**6, 102, 975, 985**
元本	4, 336, 083, 892
次期繰越損益金	1, 766, 892, 093
（Ｄ）受益権総口数	**4, 336, 083, 892口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）	**14, 075円**

＊期首における元本額は3, 955, 757, 912円、当作成期間中における追加設定元本額は1, 408, 443, 585円、同解約元本額は1, 028, 117, 605円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は14, 075円です。

■損益の状況

当期　自 2020年６月16日　至 2021年６月15日

項　　目	当　期
（Ａ）配当等収益	△ **2, 802円**
受取利息	436
支払利息	△ 3, 238
（Ｂ）有価証券売買損益	**1, 478, 153, 827**
売買益	1, 607, 345, 289
売買損	△ 129, 191, 462
（Ｃ）信託報酬等	△ **17, 196, 683**
（Ｄ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	**1, 460, 954, 342**
（Ｅ）前期繰越損益金	△ **242, 998, 948**
（Ｆ）追加信託差損益金	**548, 936, 699**
（配当等相当額）	(488, 129, 514)
（売買損益相当額）	(60, 807, 185)
（Ｇ）合計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	**1, 766, 892, 093**
次期繰越損益金（Ｇ）	**1, 766, 892, 093**
追加信託差損益金	548, 936, 699
（配当等相当額）	(488, 129, 514)
（売買損益相当額）	(60, 807, 185)
分配準備積立金	1, 217, 958, 196
繰越損益金	△ 2, 802

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項　　目	当　期
（ａ）経費控除後の配当等収益	0円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	955, 917, 834
（ｃ）収益調整金	548, 936, 699
（ｄ）分配準備積立金	262, 040, 362
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	1, 766, 894, 895
（ｆ）分配金	0
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	1, 766, 894, 895
（ｈ）受益権総口数	4, 336, 083, 892口

＜補足情報＞
当ファンド（ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の決算日（2021年３月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2021年６月15日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの主要な売買銘柄
投資信託証券

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
日本ビルファンド	16. 037	9, 616, 973	599, 674	日本ビルファンド	5. 534	3, 469, 838	627, 003
ＧＬＰ投資法人	52. 065	8, 640, 531	165, 956	ジャパンリアルエステイト	5. 518	3, 264, 263	591, 566
日本プロロジスリート	17. 482	5, 889, 640	336, 897	日本プロロジスリート	8. 071	2, 732, 012	338, 497
ジャパンリアルエステイト	9. 688	5, 753, 515	593, 880	野村不動産マスターＦ	17. 628	2, 620, 096	148, 632
野村不動産マスターＦ	31. 313	4, 591, 010	146, 616	ＧＬＰ投資法人	15. 579	2, 618, 810	168, 098
大和ハウスリート投資法人	13. 824	3, 770, 296	272, 735	大和ハウスリート投資法人	7. 875	2, 166, 700	275, 136
ラサールロジポート投資	21. 153	3, 708, 877	175, 335	日本都市ファンド投資法人	15. 457	2, 079, 702	134, 547
日本都市ファンド投資法人	25. 064	3, 463, 216	138, 174	ユナイテッド・アーバン投資法人	15. 943	1, 971, 197	123, 640
産業ファンド	18. 114	3, 364, 003	185, 712	オリックス不動産投資	10. 997	1, 837, 463	167, 087
オリックス不動産投資	19. 305	3, 207, 070	166, 126	アドバンス・レジデンス	5. 187	1, 663, 191	320, 646

（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６月15日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（140, 780, 222千口）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６月15日現在		
	口数	評価額	比率
不動産投信	千口	千円	%
エスコンジャパンリート	6. 727	937, 071	0. 2
サンケイリアルエステート	10. 073	1, 300, 424	0. 3
SOSILA 物流リート投	10. 824	1, 632, 259	0. 3
日本アコモデーションファンド投資法人	14. 186	9, 008, 110	1. 8
森ヒルズリート	48. 352	7, 944, 233	1. 6
産業ファンド	58. 185	11, 997, 747	2. 4
アドバンス・レジデンス	39. 099	14, 349, 333	2. 9
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	28. 055	6, 567, 675	1. 3
ＡＰＩ投資法人	20. 626	10, 436, 756	2. 1
ＧＬＰ投資法人	128. 624	24, 348, 523	4. 9
コンフォリア・レジデンシャル	18. 507	6, 542, 224	1. 3
日本プロロジスリート	65. 076	23, 069, 442	4. 7
星野リゾート・リート	6. 263	4, 240, 051	0. 9
Ｏｎｅリート投資法人	6. 416	2, 043, 496	0. 4
イオンリート投資	41. 751	6, 517, 331	1. 3
ヒューリックリート投資法	34. 123	6, 213, 798	1. 3
日本リート投資法人	13. 37	6, 043, 240	1. 2
インベスコ・オフィス・Ｊリート	261. 579	5, 911, 685	1. 2
積水ハウス・リート投資	121. 07	11, 102, 119	2. 3
トーセイ・リート投資法人	9. 107	1, 260, 408	0. 3
ケネディクス商業リート	16. 373	4, 833, 309	1. 0
ヘルスケア＆メディカル投資	8. 78	1, 282, 758	0. 3
サムティ・レジデンシャル	7. 924	984, 160	0. 2
野村不動産マスターＦ	133. 111	24, 292, 757	4. 9
いちごホテルリート投資	7. 198	732, 036	0. 1
ラサールロジポート投資	49. 791	9, 027, 108	1. 8
スターアジア不動産投	42. 293	2, 571, 414	0. 5
マリモ地方創生リート	3. 856	527, 115	0. 1
三井不ロジパーク	14. 367	8, 490, 897	1. 7
大江戸温泉リート	6. 644	562, 082	0. 1
投資法人みらい	44. 456	2, 280, 592	0. 5
森トラスト・ホテルリート投	8. 915	1, 254, 340	0. 3
三菱地所物流 REIT	10. 353	4, 953, 910	1. 0
CRE ロジスティクスファンド	13. 17	2, 460, 156	0. 5
ザイマックス・リート	6. 307	769, 454	0. 2
タカラレーベン不動産投	12. 369	1, 521, 387	0. 3
伊藤忠アドバンスロジ	15. 966	2, 396, 496	0. 5
日本ビルファンド	46. 326	33, 864, 306	6. 9
ジャパンリアルエステイト	41. 163	28, 608, 285	5. 8
日本都市ファンド投資法人	205. 029	24, 029, 398	4. 9
オリックス不動産投資	82. 016	17, 305, 376	3. 5
日本プライムリアルティ	25. 628	11, 455, 716	2. 3
NTT 都市開発リート投資法人	37. 179	6, 093, 638	1. 2
東急リアル・エステート	27. 598	5, 577, 555	1. 1
グローバル・ワン不動産投資法人	28. 583	3, 607, 174	0. 7
ユナイテッド・アーバン投資法人	88. 031	13, 926, 504	2. 8
森トラスト総合リート	29. 419	4, 674, 679	0. 9
インヴィンシブル投資法人	172. 115	7, 934, 501	1. 6
フロンティア不動産投資	13. 66	7, 103, 200	1. 4
平和不動産リート	26. 598	4, 612, 093	0. 9
日本ロジスティクスファンド投資法人	26. 895	8, 781, 217	1. 8
福岡リート投資法人	21. 288	3, 885, 060	0. 8
ケネディクス・オフィス投資法人	12. 734	9, 970, 722	2. 0
いちごオフィスリート投資法人	33. 728	3, 372, 800	0. 7
大和証券オフィス投資法人	8. 77	6, 945, 840	1. 4
阪急阪神リート投資法人	18. 593	2, 917, 241	0. 6
スターツプロシード投資法人	6. 41	1, 547, 374	0. 3
大和ハウスリート投資法人	58. 731	19, 469, 326	4. 0
ジャパン・ホテル・リート投資法人	132. 609	9, 203, 064	1. 9
大和証券リビング投資法人	53. 751	6, 444, 744	1. 3
ジャパンエクセレント投資法人	38. 195	6, 191, 409	1. 3
合計　口数、金額	2, 578. 935	477, 927, 135	
合計　銘柄数＜比率＞	61 銘柄		<97. 0%>

（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６月15日現在	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
国内	東証ＲＥＩＴ	11, 916	—

（注）単位未満は切捨て。

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

運用報告書　第34期（決算日　2021年３月15日）

（作成対象期間　2020年９月16日～2021年３月15日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

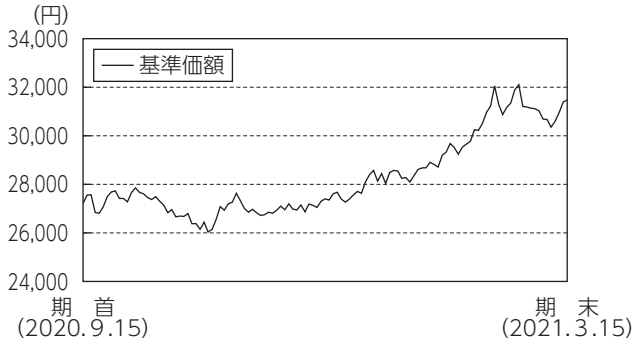
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		東証ＲＥＩＴ指数(配当込み)		投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2020年９月15日	27,210	－	3,670.48	－	96.9	2.5
９月末	27,419	0.8	3,698.94	0.8	97.5	2.5
10月末	26,038	△ 4.3	3,512.43	△ 4.3	97.6	2.4
11月末	26,952	△ 0.9	3,635.82	△ 0.9	97.6	2.4
12月末	28,574	5.0	3,854.76	5.0	97.6	2.4
2021年１月末	29,683	9.1	4,004.00	9.1	97.6	2.4
２月末	31,210	14.7	4,207.24	14.6	97.6	2.4
(期末)2021年３月15日	31,472	15.7	4,243.77	15.6	97.0	2.5

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：27,210円　期末：31,472円　騰落率：15.7%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク（東証ＲＥＩＴ指数（配当込み））の動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展や需給環境の改善などを背景に国内リート市況が上昇したことにより、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内リート市況

国内リート市況は上昇しました。

国内リート市況は、当作成期首より、ＦＴＳＥグローバル株式指数への組み入れの期待から上昇しました。2020年10月に、大型オフィス銘柄での国内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。11月前半は、米国大統領・連邦議会選挙の結果や、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展を受け、市場のリスク選好姿勢が強まる中で上昇しました。12月中旬以降は、夏以降続いていた公募増資が年末に向けて一段落したことによる需給の改善によって上昇しました。2021年１月下旬以降は、感染者数が減少に転じたことや公募増資の規模が小さく需給が良好な中で上昇基調が続き、２月以降も日本株式に対する出遅れ感もあり、上昇が続きました。当作成期末にかけては、国内外での金利上昇もあり、上値が重い展開でした。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は15.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は15.7%となりました。

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

《今後の運用方針》

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

■１万口当りの費用の明細

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

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

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

（2020年９月16日から2021年３月15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	411.912	56,656,822	165.3009 (－)	25,422,115 (－)

（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９月16日から2021年３月15日まで）

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	不動産投信指数先物取引	33,590	33,143	－	－

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託証券

（2020年９月16日から2021年３月15日まで）

当期 買付 銘柄	口数	金額	平均単価	当期 売付 銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
日本ビルファンド	11.272	6,519,123	578,346	日本ビルファンド	2.65	1,596,274	602,367
ＧＬＰ投資法人	24.645	4,001,002	162,345	ジャパンリアルエステイト	2.744	1,579,092	575,470
日本プロロジスリート	10.277	3,444,298	335,146	日本プロロジスリート	4.04	1,341,964	332,169
ジャパンリアルエステイト	5.039	2,959,904	587,399	野村不動産マスターＦ	8.871	1,284,015	144,743
野村不動産マスターＦ	16.293	2,379,643	146,053	ＧＬＰ投資法人	7.884	1,269,852	161,067
三井不ロジパーク	4.129	2,084,824	504,922	大和ハウスリート投資法人	3.915	1,019,198	260,331
大和ハウスリート投資法人	7.19	1,906,961	265,224	日本都市ファンド投資法人	6.36	987,358	155,244
日本都市ファンド投資法人	11.131	1,755,662	157,727	オリックス不動産投資	5.468	898,805	164,375
オリックス不動産投資	10.041	1,678,857	167,200	アドバンス・レジデンス	2.606	791,999	303,913
アドバンス・レジデンス	4.786	1,473,859	307,952	ユナイテッド・アーバン投資法人	5.867	757,730	129,151

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当期末 口数	当期末 評価額	当期末 比率
不動産投信	千口	千円	%
エスコンジャパンリート	6.659	853,683	0.2
サンケイリアルエステート	9.97	1,119,631	0.3
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投	10.714	1,400,319	0.3
日本アコモデーションファンド投資法人	14.042	8,537,536	1.9
森ヒルズリート	47.861	7,227,011	1.6
産業ファンド	57.593	10,257,313	2.3
アドバンス・レジデンス	38.701	12,577,825	2.9
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	27.769	5,481,600	1.2
ＡＰＩ投資法人	20.416	9,656,768	2.2
ＧＬＰ投資法人	127.316	20,803,434	4.7
コンフォリア・レジデンシャル	18.319	5,843,761	1.3
日本プロロジスリート	64.414	20,387,031	4.6
星野リゾート・リート	6.2	3,782,000	0.9
Ｏｎｅリート投資法人	6.351	1,834,168	0.4
イオンリート投資	41.326	6,058,391	1.4
ヒューリックリート投資法	32.802	5,612,422	1.3
日本リート投資法人	13.234	5,207,579	1.2
インベスコ・オフィス・Ｊリート	261.761	4,593,905	1.0
積水ハウス・リート投資	119.839	10,330,121	2.3
トーセイ・リート投資法人	9.014	1,153,792	0.3
ケネディクス商業リート	14.982	3,977,721	0.9
ヘルスケア&メディカル投資	8.69	1,174,019	0.3
サムティ・レジデンシャル	7.843	879,984	0.2
野村不動産マスターＦ	131.757	22,675,379	5.2
いちごホテルリート投資	7.125	607,762	0.1
ラサールロジポート投資	45.405	7,246,638	1.6
スターアジア不動産投	41.863	2,227,111	0.5
マリモ地方創生リート	3.817	465,674	0.1
三井不ロジパーク	14.221	7,281,152	1.7
大江戸温泉リート	6.576	518,188	0.1
投資法人みらい	44.003	2,013,137	0.5
森トラスト・ホテルリート投	8.824	1,168,297	0.3
三菱地所物流ＲＥＩＴ	10.247	4,150,035	0.9
ＣＲＥロジスティクスファンド	13.036	2,023,187	0.5
ザイマックス・リート	6.242	669,766	0.2
タカラレーベン不動産投	12.243	1,319,795	0.3
伊藤忠アドバンスロジ	15.804	2,067,163	0.5
日本ビルファンド	45.855	30,906,270	7.0
ジャパンリアルエステイト	40.744	27,502,200	6.3
日本都市ファンド投資法人	202.944	21,999,129	5.0
オリックス不動産投資	81.182	14,937,488	3.4
日本プライムリアルティ	25.367	10,007,281	2.3
プレミア投資法人	36.801	5,501,749	1.3
東急リアル・エステート	27.317	4,917,060	1.1
グローバル・ワン不動産投資法人	28.293	3,482,868	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人	87.136	12,817,705	2.9
森トラスト総合リート	29.12	4,504,864	1.0
インヴィンシブル投資法人	170.365	6,865,709	1.6
フロンティア不動産投資	13.521	6,294,025	1.4
平和不動産リート	25	3,742,500	0.9
日本ロジスティクスファンド投資法人	26.622	8,053,155	1.8
福岡リート投資法人	21.072	3,552,739	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人	12.604	9,503,416	2.2
いちごオフィスリート投資法人	33.803	2,991,565	0.7
大和証券オフィス投資法人	8.681	6,371,854	1.4
阪急阪神リート投資法人	18.404	2,714,590	0.6
スターツプロシード投資法人	6.345	1,377,499	0.3
大和ハウスリート投資法人	58.133	16,742,304	3.8
ジャパン・ホテル・リート投資法人	131.255	7,967,178	1.8
大和証券リビング投資法人	53.205	5,676,973	1.3
ジャパンエクセレント投資法人	37.807	5,096,383	1.2
合計 口数・金額	2,548,555	426,709,819	
合計 銘柄数<比率>	61銘柄		<97.0%>

※エスコンジャパンリート、ＳＯＳＩＬＡ物流リート投、日本アコモデーションファンド投資法人、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、サムティ・レジデンシャル、マリモ地方創生リート、三井不ロジパーク、三菱地所物流ＲＥＩＴ、ＣＲＥロジスティクスファンド、伊藤忠アドバンスロジ、日本ビルファンド、オリックス不動産投資、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、スターツプロシード投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、大和証券リビング投資法人につきましては、各ファンドで開示されている直近の有価証券報告書または有価証券届出書において、当社の利害関係人等（投資信託及び投資法人に関する法律第11条第１項に規定される法人等をいいます。）である大和証券、大和リアル・エステート・アセット・マネジメントが当該ファンドの運用会社または一般事務受託会社となっています。
（注１）比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。
（注２）評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当期末 買建額	当期末 売建額
国内	東証ＲＥＩＴ	百万円 10,827	百万円 －

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年３月15日現在

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
投資信託証券	426,709,819	96.7
コール・ローン等、その他	14,668,400	3.3
投資信託財産総額	441,378,219	100.0

（注）評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年３月15日現在

項目	当期末
(A) 資産	**446,056,793,701円**
コール・ローン等	8,948,501,901
投資信託証券(評価額)	426,709,819,600
未収入金	1,521,643,784
未収配当金	4,198,254,616
差入委託証拠金	4,678,573,800
(B) 負債	**6,075,837,000**
未払解約金	1,046,462,000
差入委託証拠金代用有価証券	5,029,375,000
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	**439,980,956,701**
元本	139,798,959,653
次期繰越損益金	300,181,997,048
(D) 受益権総口数	**139,798,959,653口**
１万口当り基準価額(Ｃ／Ｄ)	**31,472円**

＊期首における元本額は131,456,354,868円、当作成期間中における追加設定元本額は21,922,987,487円、同解約元本額は13,580,382,702円です。
＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン5,630,199,358円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）123,199,247,584円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年１回決算型）355,173,740円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050　2,532,317円、ｉＦｒｅｅ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス335,046,143円、ｉＦｒｅｅ８資産バランス1,115,984,460円、ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン5,435,863,037円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030　4,884,756円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040　3,251,533円、ダイワ・ノーロード　Ｊ－ＲＥＩＴファンド102,236,224円、ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス1,728,992,114円、ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）384,932,477円、ダイワファンドラップオンライン　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス446,692,332円、ダイワ・インデックスセレクト　Ｊ－ＲＥＩＴ1,053,923,578円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は31,472円です。

■損益の状況

当期　自2020年９月16日　至2021年３月15日

項目	当期
(A) 配当等収益	**7,901,248,903円**
受取配当金	7,752,987,367
受取利息	3,058
その他収益金	149,118,065
支払利息	△　859,587
(B) 有価証券売買損益	**48,988,387,848**
売買益	53,486,774,471
売買損	△　4,498,386,623
(C) 先物取引等損益	**1,429,170,600**
取引益	1,591,012,900
取引損	△　161,842,300
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	**58,318,807,351**
(E) 前期繰越損益金	**226,242,554,046**
(F) 解約差損益金	**△　24,470,185,862**
(G) 追加信託差損益金	**40,090,821,513**
(H) 合計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	**300,181,997,048**
次期繰越損益金(Ｈ)	**300,181,997,048**

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

ダイワファンドラップ
外国ＲＥＩＴインデックス
（為替ヘッジあり）

運用報告書（全体版）
第５期
（決算日　2021年６月15日）
（作成対象期間　2020年６月16日～2021年６月15日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券に投資し、海外リート市場の動きを反映した投資成果をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）		
信託期間	無期限		
運用方針	海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

<2736>

設定以来の運用実績

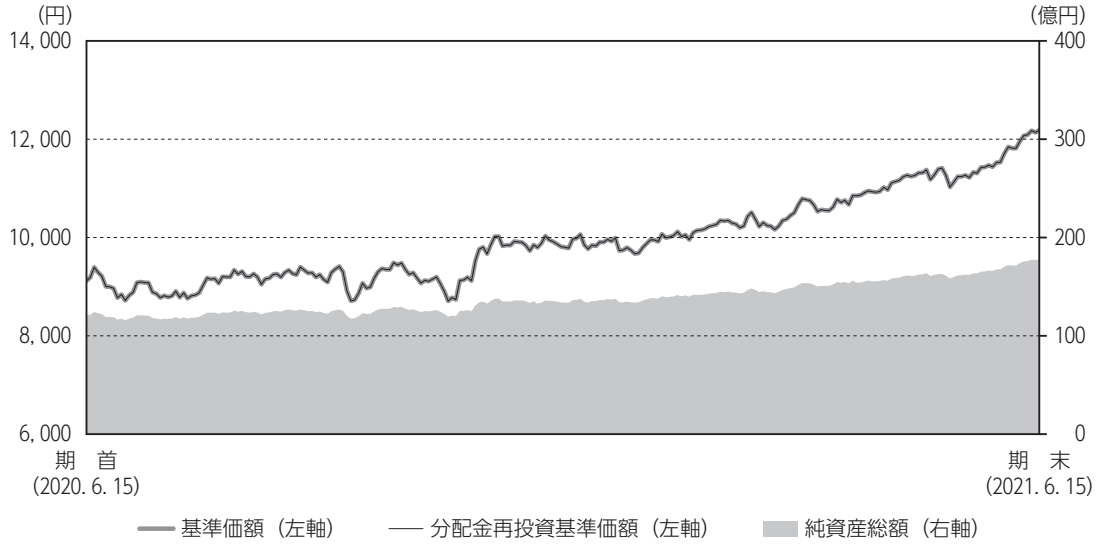
決算期	基準価額			S＆P先進国ＲＥＩＴ指数(除く日本)（現地通貨ベース）		投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1期末(2017年6月15日)	9,844	0	△ 1.6	9,995	△ 0.1	—	98.2	—	5,285
2期末(2018年6月15日)	9,722	0	△ 1.2	10,123	1.3	0.8	99.1	1.0	8,688
3期末(2019年6月17日)	10,760	0	10.7	11,570	14.3	0.6	98.4	1.0	10,895
4期末(2020年6月15日)	9,117	0	△ 15.3	10,043	△ 13.2	2.2	94.5	3.2	12,056
5期末(2021年6月15日)	12,187	0	33.7	13,579	35.2	0.9	97.8	1.7	17,785

（注１）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注２）Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数(除く日本)（現地通貨ベース)は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、Ｓ＆Ｐダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるＳ＆Ｐグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのＲＥＩＴ制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。同指数の所有権およびその他一切の権利は、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。
（注５）組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
（注６）不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「ＳＰＤＪＩ」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's® およびＳ＆Ｐ®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「Ｓ＆Ｐ」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがＳＰＤＪＩに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、ＳＰＤＪＩ、Dow Jones、Ｓ＆Ｐまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行なわず、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

運用経過

基準価額等の推移について



＊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：9,117円
期　末：12,187円（分配金0円）
騰落率：33.7%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、海外リート市場の上昇が主な要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

年　月　日	基準価額		Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（現地通貨ベース）		投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率
		騰落率	（参考指数）	騰落率			
	円	%		%	%	%	%
（期首）2020年６月15日	9,117	—	10,043	—	2.2	94.5	3.2
６月末	8,823	△ 3.2	9,726	△ 3.2	1.0	96.9	2.5
７月末	9,153	0.4	10,103	0.6	0.6	94.7	2.5
８月末	9,336	2.4	10,309	2.6	0.5	96.6	2.8
９月末	8,968	△ 1.6	9,902	△ 1.4	1.2	95.2	2.9
10月末	8,777	△ 3.7	9,698	△ 3.4	0.9	95.1	2.8
11月末	9,839	7.9	10,910	8.6	0.5	97.0	2.5
12月末	9,923	8.8	11,019	9.7	0.7	97.0	2.2
2021年１月末	10,054	10.3	11,182	11.3	1.0	97.7	2.4
２月末	10,370	13.7	11,543	14.9	0.9	98.4	2.5
３月末	10,758	18.0	11,965	19.1	0.8	100.3	2.4
４月末	11,377	24.8	12,668	26.1	1.6	95.7	1.8
５月末	11,529	26.5	12,845	27.9	0.7	98.3	1.7
（期末）2021年６月15日	12,187	33.7	13,579	35.2	0.9	97.8	1.7

（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

（2020.6.16 ～ 2021.6.15）

■海外リート市況

海外リート市況は上昇しました。

海外リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染第２波への警戒などから上値が重い展開で始まりました。2020年９月以降は、感染再拡大やそれに伴うロックダウン（都市封鎖）への懸念などから、世界的に下落基調となりました。11月以降は、ワクチン開発で高い効果を示す結果が報告されたことなどを背景に、上昇に転じました。その後も、ワクチン普及による経済正常化期待から、商業施設やホテル／リゾートを中心として世界的に上昇傾向が続き、当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。また、保有外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて　（2020. 6. 16 ～ 2021. 6. 15）

■当ファンド

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資を90～110％の範囲で行いました。また、保有外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。なお、マザーファンドの組入比率が100％程度にならないのは、為替の売りヘッジ予約による評価損益が発生する影響が主要因です。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

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

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

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）

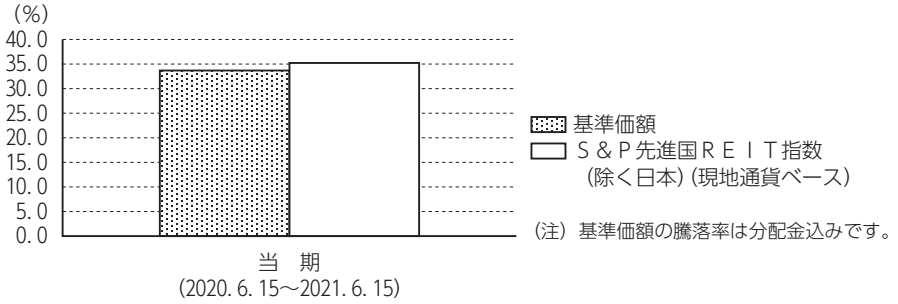
ベンチマークとの差異について

当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。

マザーファンドについては、配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。また、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のズレも、かい離要因としてあげられます。

なお、為替ヘッジを行う時に、通貨間の金利差等による損益（為替ヘッジコスト／プレミアム）が発生します。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（１万口当り）

項　　目		当　　期 2020年６月16日 ～2021年６月15日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**―**
対基準価額比率	（％）	―
当期の収益	（円）	―
当期の収益以外	（円）	―
翌期繰越分配対象額	（円）	3,133

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

今後の運用方針

■当ファンド

引き続き「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。また、保有外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

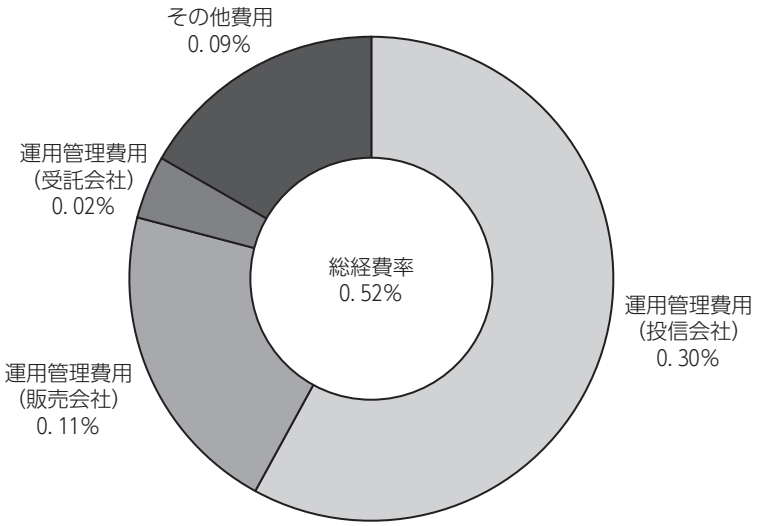
項　　目	当　期 (2020. 6. 16～2021. 6. 15) 金　額	比　率	項　目　の　概　要
信　託　報　酬	43円	0. 434%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は9, 952円です。**
（投 信 会 社）	(30)	(0. 302)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(11)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(2)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	2	0. 017	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（先物･オプション）	(0)	(0. 004)	
（投資信託受益証券）	(0)	(0. 004)	
（投資信託証券）	(1)	(0. 009)	
有価証券取引税	1	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
（投資信託受益証券）	(0)	(0. 000)	
（投資信託証券）	(1)	(0. 013)	
そ の 他 費 用	9	0. 087	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. 023)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ　の　他）	(6)	(0. 058)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	55	0. 551	

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（１口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0. 52%です。



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

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	1, 346, 274	3, 098, 430	1, 059, 638	2, 532, 670

（注）単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	5, 819, 881	6, 106, 516	17, 864, 614

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年６月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	17, 864, 614	99. 7
コール・ローン等、その他	61, 477	0. 3
投資信託財産総額	17, 926, 091	100. 0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、６月15日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝110. 11円、１カナダ・ドル＝90. 68円、１オーストラリア・ドル＝84. 91円、１香港・ドル＝14. 19円、１シンガポール・ドル＝82. 99円、１ニュージーランド・ドル＝78. 64円、１イギリス・ポンド＝155. 39円、１イスラエル・シュケル＝33. 923円、100韓国・ウォン＝9. 86円、１ユーロ＝133. 45円です。
（注３）ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（43, 089, 810千円）の投資信託財産総額（43, 434, 395千円）に対する比率は、99. 2% です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年６月15日現在

項目	当期末
（Ａ）資産	**34, 637, 917, 852円**
コール・ローン等	56, 363, 712
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド（評価額）	17, 864, 614, 746
未収入金	16, 716, 939, 394
（Ｂ）負債	**16, 852, 464, 447**
未払金	16, 797, 306, 015
未払解約金	22, 051, 024
未払信託報酬	32, 693, 661
その他未払費用	413, 747
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）	**17, 785, 453, 405**
元本	14, 593, 897, 109
次期繰越損益金	3, 191, 556, 296
（Ｄ）受益権総口数	**14, 593, 897, 109口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）	**12, 187円**

＊期首における元本額は13, 224, 446, 669円、当作成期間中における追加設定元本額は4, 211, 375, 221円、同解約元本額は2, 841, 924, 781円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は12, 187円です。

■損益の状況

当期　自 2020年６月16日　至 2021年６月15日

項目		当期
（Ａ）配当等収益	△	**8, 021円**
受取利息		1, 127
支払利息	△	9, 148
（Ｂ）有価証券売買損益		**4, 184, 298, 066**
売買益		6, 002, 837, 309
売買損	△	1, 818, 539, 243
（Ｃ）信託報酬等	△	**60, 700, 782**
（Ｄ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）		**4, 123, 589, 263**
（Ｅ）前期繰越損益金	△	**789, 234, 311**
（Ｆ）追加信託差損益金	△	**142, 798, 656**
（配当等相当額）	(	1, 237, 935, 151)
（売買損益相当額）	(△	1, 380, 733, 807)
（Ｇ）合計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）		**3, 191, 556, 296**
次期繰越損益金（Ｇ）		**3, 191, 556, 296**
追加信託差損益金	△	142, 798, 656
（配当等相当額）	(	1, 237, 935, 151)
（売買損益相当額）	(△	1, 380, 733, 807)
分配準備積立金		3, 334, 362, 973
繰越損益金	△	8, 021

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項目	当期
（ａ）経費控除後の配当等収益	0円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	2, 630, 151, 149
（ｃ）収益調整金	1, 237, 935, 151
（ｄ）分配準備積立金	704, 211, 824
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	4, 572, 298, 124
（ｆ）分配金	0
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	4, 572, 298, 124
（ｈ）受益権総口数	14, 593, 897, 109口

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワファンドラップ　外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ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６月15日）現在におけるダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

(1)投資信託受益証券

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF（アメリカ）	566	5,307,970	9,378	VANGUARD REAL ESTATE ETF（アメリカ）	595	5,537,260	9,306

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

(2)投資信託証券

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
PROLOGIS INC（アメリカ）	41.4	449,826	10,865	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT（アメリカ）	2.8	48,166	17,202
EQUINIX INC（アメリカ）	5.3	403,585	76,148	PROLOGIS INC（アメリカ）	3.6	41,121	11,422
DIGITAL REALTY TRUST INC（アメリカ）	19.8	297,989	15,049	EQUINIX INC（アメリカ）	0.4	30,109	75,273
SIMON PROPERTY GROUP INC（アメリカ）	24	220,272	9,178	EQUITY RESIDENTIAL（アメリカ）	4	26,425	6,606
PUBLIC STORAGE（アメリカ）	8.8	211,293	24,010	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES（アメリカ）	3.8	25,174	6,624
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT（アメリカ）	10.5	189,478	18,045	GOODMAN GROUP（オーストラリア）	15.4	23,523	1,527
REALTY INCOME CORP（アメリカ）	27.8	183,657	6,606	DIGITAL REALTY TRUST INC（アメリカ）	1.5	23,292	15,528
WELLTOWER INC（アメリカ）	27.5	177,124	6,440	SIMON PROPERTY GROUP INC（アメリカ）	2	21,481	10,740
SUN COMMUNITIES INC（アメリカ）	10.5	165,334	15,746	WELLTOWER INC（アメリカ）	2.8	20,330	7,260
GOODMAN GROUP（オーストラリア）	112.67	159,667	1,417	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT（シンガポール）	71.5	18,054	252

（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６月15日現在におけるダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド（14,827,050千口）の内容です。

(1)ファンド・オブ・ファンズが組み入れた外貨建ファンドの明細

(i)外国投資信託受益証券

ファンド名	2021年６月15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	%
（アメリカ）				
VANGUARD REAL ESTATE ETF	33.5	3,533	389,119	0.9

（注１）邦貨換算金額は、2021年６月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
（注２）比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。
（注３）評価額の単位未満は切捨て。

(ii)外国投資信託証券

ファンド名	2021年６月15日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
不動産ファンド				
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
（シンガポール）				
MANULIFE US REAL ESTATE INV	364.562	275	30,307	0.1
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	151.4	115	12,753	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90	9	1,018	0.0
PRIME US REIT	99	85	9,374	0.0
（アメリカ）				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	33.2	809	89,124	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	18.9	137	15,150	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	26.882	539	59,436	0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	27.1	551	60,694	0.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC	35	7,497	825,533	1.9
SIMON PROPERTY GROUP INC	82.347	10,975	1,208,480	2.8
BOSTON PROPERTIES INC	35.6	4,415	486,187	1.1
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	36.789	282	31,150	0.1
VORNADO REALTY TRUST	39.364	1,970	217,021	0.5

ファンド名	2021年6月15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	%
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	19.5	427	47,022	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	15.7	780	85,952	0.2
NEXPOINT RESIDENTIAL	5.5	311	34,289	0.1
QTS REALTY TRUST INC-CL A	15.9	1,240	136,645	0.3
EQUITY RESIDENTIAL	86	6,958	766,174	1.8
APPLE HOSPITALITY REIT INC	50.7	824	90,772	0.2
EPR PROPERTIES	18.5	993	109,348	0.3
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.5	35	3,930	0.0
CITY OFFICE REIT INC	9.3	118	13,046	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	21.433	428	47,152	0.1
EQUINIX INC	22.3	18,374	2,023,268	4.7
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	18.629	539	59,403	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	10.8	149	16,410	0.0
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	8.8	166	18,284	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	13.9	1,124	123,789	0.3
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	28.3	526	57,959	0.1
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	5.5	283	31,182	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	176.9	3,125	344,184	0.8
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	67.408	2,645	291,325	0.7
CORESITE REALTY CORP	10.8	1,455	160,254	0.4
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	37.3	1,129	124,363	0.3
RLJ LODGING TRUST	41.871	672	73,997	0.2
FARMLAND PARTNERS INC	6.7	85	9,420	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	51.4	1,004	110,589	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	14	194	21,381	0.0
CYRUSONE INC	30.2	2,386	262,800	0.6
KIMCO REALTY CORP	108.5	2,356	259,487	0.6
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9.8	155	17,157	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	54.95	1,622	178,612	0.4
WHITESTONE REIT	8.5	73	8,114	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	54.837	2,622	288,802	0.7
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	30.2	612	67,470	0.2
PARK HOTELS & RESORTS INC	59.48	1,281	141,072	0.3
COLONY CAPITAL INC	120.211	949	104,567	0.2
INVITATION HOMES INC	142.297	5,380	592,419	1.4
JBG SMITH PROPERTIES	27.932	972	107,030	0.2
ALEXANDER & BALDWIN INC	18.7	370	40,831	0.1
CLIPPER REALTY INC	1.4	10	1,196	0.0
GLADSTONE LAND CORP	6.4	158	17,420	0.0
AMERICOLD REALTY TRUST	63.3	2,485	273,710	0.6
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	15.9	420	46,342	0.1
VICI PROPERTIES INC	134.6	4,417	486,418	1.1
RETAIL VALUE INC	2.99	64	7,104	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	9	166	18,333	0.0
BRT APARTMENTS CORP	1.3	23	2,639	0.0
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	6.1	1,169	128,786	0.3
SAFEHOLD INC	3.2	250	27,613	0.1
WASHINGTON PRIME GROUP INC	3.329	11	1,238	0.0
AMERICAN FINANCE TRUST INC	26	234	25,765	0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	28.1	811	89,357	0.2
COREPOINT LODGING INC	6.7	68	7,495	0.0
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	5.7	113	12,539	0.0
STORE CAPITAL CORP	60.2	2,180	240,088	0.6
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2.4	22	2,513	0.0
BROADSTONE NET LEASE INC	9	232	25,617	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	25.3	256	28,247	0.1
LIFE STORAGE INC	18.65	2,012	221,557	0.5
AMERICAN ASSETS TRUST INC	12.3	477	52,589	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	24.882	466	51,343	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	12.2	132	14,575	0.0
PARAMOUNT GROUP INC	40.2	455	50,107	0.1
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	34	431	47,508	0.1
NETSTREIT CORP	6.3	150	16,593	0.0
APARTMENT INCOME REIT CO	37.389	1,865	205,392	0.5
CTO REALTY GROWTH INC	1.2	67	7,379	0.0
CIM COMMERCIAL TRUST-RIGHTS	2.4	0	105	0.0
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	32.5	1,925	211,994	0.5
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	28.1	524	57,766	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	39.8	1,565	172,358	0.4
VENTAS INC	93.979	5,541	610,119	1.4
CARETRUST REIT INC	22.903	548	60,448	0.1
GEO GROUP INC/THE	27.4	187	20,606	0.0

ファンド名	2021年6月15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	%
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	74.4	1,777	195,711	0.5
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	11.8	364	40,135	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	51.487	939	103,463	0.2
UMH PROPERTIES INC	8.6	193	21,287	0.0
IRON MOUNTAIN INC	72.3	3,321	365,726	0.8
TERRENO REALTY CORP	16.8	1,131	124,587	0.3
VEREIT INC	57.481	2,813	309,815	0.7
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	28.92	1,457	160,492	0.4
SUN COMMUNITIES INC	28	4,972	547,555	1.3
ACADIA REALTY TRUST	21.111	473	52,139	0.1
ALEXANDER'S INC	0.5	140	15,449	0.0
PROLOGIS INC	184.819	23,316	2,567,408	5.9
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	31.9	6,173	679,775	1.6
BRANDYWINE REALTY TRUST	43.3	646	71,182	0.2
SAUL CENTERS INC	3.2	150	16,581	0.0
MACK-CALI REALTY CORP	20.2	360	39,680	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	24.5	3,312	364,701	0.8
COUSINS PROPERTIES INC	37.306	1,491	164,228	0.4
SITE CENTERS CORP	40.678	637	70,141	0.2
DUKE REALTY CORP	93.7	4,638	510,706	1.2
EASTGROUP PROPERTIES INC	10	1,705	187,748	0.4
ESSEX PROPERTY TRUST INC	16.267	5,130	564,931	1.3
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	32.4	1,746	192,327	0.4
FEDERAL REALTY INVS TRUST	17.3	2,134	235,084	0.5
GETTY REALTY CORP	8.803	300	33,033	0.1
WELLTOWER INC	104.7	8,502	936,230	2.2
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	135.1	4,769	525,117	1.2
HIGHWOODS PROPERTIES INC	26.2	1,273	140,262	0.3
SERVICE PROPERTIES TRUST	39.5	543	59,890	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	35.2	1,136	125,113	0.3
EQUITY COMMONWEALTH	30.075	845	93,121	0.2
KILROY REALTY CORP	26.2	1,931	212,731	0.5
LTC PROPERTIES INC	9.6	379	41,838	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	73.3	952	104,923	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	28.728	4,929	542,780	1.3
MACERICH CO/THE	28.379	494	54,465	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	42.5	3,252	358,088	0.8
NATL HEALTH INVESTORS INC	11.2	752	82,873	0.2
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	44	2,197	241,951	0.6
REALTY INCOME CORP	93.617	6,609	727,756	1.7
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	28.5	851	93,798	0.2
PUBLIC STORAGE	38.1	11,225	1,236,029	2.8
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4.9	779	85,781	0.2
REGENCY CENTERS CORP	39.62	2,648	291,593	0.7
RPT REALTY	21.1	289	31,875	0.1
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	24	463	51,029	0.1
SL GREEN REALTY CORP	17.157	1,429	157,404	0.4
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	57.5	237	26,148	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6	117	12,929	0.0
UDR INC	74.4	3,728	410,592	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3.1	219	24,197	0.1
WP CAREY INC	44	3,420	376,637	0.9
WASHINGTON REIT	21.6	579	63,811	0.1
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	30.3	1,007	110,899	0.3
AGREE REALTY CORP	16	1,154	127,146	0.3
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	58.148	2,197	241,957	0.6
CUBESMART	50.1	2,340	257,676	0.6
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	52.626	694	76,431	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	70.478	11,440	1,259,734	2.9
EXTRA SPACE STORAGE INC	33.1	5,294	582,923	1.3
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7.875	93	10,292	0.0
CENTERSPACE	2.96	223	24,636	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	20.55	474	52,201	0.1
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	23.3	457	50,413	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3.633	107	11,796	0.0
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	34.6	1,690	186,185	0.4
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8.8	203	22,392	0.1
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	51.342	531	58,567	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	145.5	3,196	351,981	0.8
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21	115	12,763	0.0
DOUGLAS EMMETT INC	41.4	1,518	167,253	0.4
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	54.4	678	74,755	0.2
アメリカ・ドル通貨計 口数、金額	6,081.674	286,808	31,580,507	
アメリカ・ドル通貨計 銘柄数＜比率＞	157銘柄			<72.8%>

ファンド名		2021年6月15日現在			
		口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		千口	千カナダ・ドル	千円	%
(カナダ)					
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		17.1	192	17,429	0.0
SLATE GROCERY REIT		7	89	8,143	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		12.7	255	23,170	0.1
SLATE OFFICE REIT		5.1	27	2,474	0.0
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		4.2	94	8,557	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		23.4	303	27,478	0.1
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI		20.6	342	31,027	0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E		11.2	84	7,627	0.0
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I		10.8	244	22,133	0.1
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E		4.1	50	4,546	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		7.6	626	56,842	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		21.6	316	28,714	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		16.2	261	23,680	0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		26.9	481	43,663	0.1
CHOICE PROPERTIES REIT		40.3	596	54,085	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		4.2	71	6,478	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		14.1	237	21,544	0.0
PLAZA RETAIL REIT		11.1	50	4,620	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		18	535	48,575	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		21.9	1,249	113,334	0.3
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U		21.79	224	20,332	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		34.966	580	52,665	0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		38.9	847	76,827	0.2
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV		5.4	125	11,419	0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		5.9	236	21,411	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		12.3	223	20,243	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		15.6	714	64,803	0.1
カナダ・ドル通貨計	口数、金額	432.956	9,062	821,831	
	銘柄数<比率>	27銘柄			<1.9%>
		千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
(オーストラリア)					
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR		78.38	282	23,958	0.1
CROMWELL PROPERTY GROUP		485.284	444	37,702	0.1
CENTURIA INDUSTRIAL REIT		120.89	448	38,082	0.1
AVENTUS GROUP		103	315	26,761	0.1
RURAL FUNDS GROUP		78.595	199	16,950	0.0
WAYPOINT REIT		193.83	513	43,613	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT		149.458	732	62,183	0.1
CENTURIA OFFICE REIT		105.95	248	21,141	0.0
CENTURIA CAPITAL GROUP		128.88	353	29,984	0.1
IRONGATE GROUP		149.63	228	19,438	0.0
HOME CONSORTIUM		48	237	20,133	0.0
HOMECO DAILY NEEDS REIT		74.34	108	9,215	0.0
NATIONAL STORAGE REI - RTS		39.903	12	1,062	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA		276.86	708	60,180	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		70.547	282	24,020	0.1
NATIONAL STORAGE REIT		250.195	517	43,975	0.1
APN INDUSTRIA REIT		42.76	137	11,654	0.0
GDI PROPERTY GROUP		123.31	141	11,988	0.0
SCENTRE GROUP		1,330.65	3,858	327,657	0.8
ARENA REIT		93.89	326	27,743	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS		38.3	126	10,731	0.0
BWP TRUST		123.87	536	45,542	0.1
DEXUS		278.43	2,987	253,673	0.6
GPT GROUP		499.39	2,452	208,199	0.5
CHARTER HALL RETAIL REIT		130.4	503	42,738	0.1
MIRVAC GROUP		1,009.47	2,998	254,570	0.6
STOCKLAND		611.97	2,931	248,899	0.6
ABACUS PROPERTY GROUP		107.93	342	29,050	0.1
GOODMAN GROUP		431	8,887	754,613	1.7
VICINITY CENTRES		981.46	1,643	139,587	0.3
CHARTER HALL GROUP		118.02	1,785	151,618	0.3
INGENIA COMMUNITIES GROUP		76.66	449	38,209	0.1
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額	8,351.252	35,742	3,034,887	
	銘柄数<比率>	32銘柄			<7.0%>
		千口	千香港・ドル	千円	%
(香港)					
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		398	1,663	23,607	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		250	1,150	16,318	0.0
FORTUNE REIT		346	2,923	41,487	0.1
PROSPERITY REIT		300	897	12,728	0.0
LINK REIT		533.7	41,014	582,000	1.3
CHAMPION REIT		481	2,222	31,533	0.1
香港・ドル通貨計	口数、金額	2,308.7	49,871	707,675	
	銘柄数<比率>	6銘柄			<1.6%>

ファンド名		2021年6月15日現在			
		口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		千口	千シンガポール・ドル	千円	%
(シンガポール)					
KEPPEL DC REIT		331.683	852	70,742	0.2
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		249.876	68	5,702	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC		542	579	48,129	0.1
AIMS APAC REIT		119	171	14,221	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST		201.8	108	9,043	0.0
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI		683.19	963	79,944	0.2
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		134	122	10,175	0.0
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL		208.9	168	13,955	0.0
EC WORLD REIT		57	45	3,807	0.0
IREIT GLOBAL		105.124	68	5,714	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		815.677	2,422	201,048	0.5
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		1,164.622	2,503	207,801	0.5
SUNTEC REIT		535.4	787	65,316	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		750.2	1,515	125,763	0.3
KEPPEL REIT		501.4	596	49,517	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST		453.456	471	39,137	0.1
ESR-REIT		559.902	229	19,051	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS		191.6	241	20,035	0.0
FRASERS CENTREPOINT TRUST		347.776	848	70,423	0.2
STARHILL GLOBAL REIT		383.8	214	17,836	0.0
CAPITALAND CHINA TRUST		234.442	323	26,849	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		96.3	422	35,084	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL		1,214.72	77	6,451	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		506.469	1,402	116,428	0.3
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST		294.5	241	20,041	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		558.184	1,200	99,595	0.2
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		248.1	147	12,250	0.0
SPH REIT		275.6	241	20,013	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		219.4	94	7,829	0.0
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		651.063	260	21,612	0.0
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	12,635.184	17,393	1,443,525	
	銘柄数<比率>	30銘柄			<3.3%>
		千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
(ニュージーランド)					
ARGOSY PROPERTY LTD		194.47	302	23,780	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD		392.92	467	36,770	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		89.92	278	21,885	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST		273.22	631	49,632	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL		266.82	432	33,992	0.1
ニュージーランド・ドル通貨計	口数、金額	1,217.35	2,111	166,061	
	銘柄数<比率>	5銘柄			<0.4%>
		千口	千イギリス・ポンド	千円	%
(イギリス)					
ASSURA PLC		668.52	515	80,144	0.2
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		159.57	137	21,423	0.0
STANDARD LIFE INV PROP INC		100	72	11,219	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		177.71	144	22,422	0.1
PICTON PROPERTY INCOME LTD		121.11	108	16,843	0.0
REGIONAL REIT LTD		111.31	97	15,220	0.0
NEWRIVER REIT PLC		69.33	62	9,663	0.0
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE		212.29	372	57,959	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		155.49	183	28,510	0.1
CUSTODIAN REIT PLC		89.42	88	13,769	0.0
GCP STUDENT LIVING PLC		112.86	195	30,444	0.1
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		67.9	75	11,753	0.0
LXI REIT PLC		131.188	194	30,170	0.1
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		98.2	103	16,052	0.0
AEW UK REIT PLC		25.61	24	3,780	0.0
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS		201.12	184	28,689	0.1
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		207	244	37,955	0.1
HOME REIT PLC		60	67	10,535	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		186.931	1,343	208,733	0.5
SEGRO PLC		299.8	3,285	510,581	1.2
HAMMERSON PLC		1,011.984	447	69,584	0.2
UNITE GROUP PLC/THE		100.19	1,152	179,038	0.4
BRITISH LAND CO PLC		235.99	1,214	188,779	0.4
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		63.871	479	74,436	0.2
DERWENT LONDON PLC		27.82	986	153,335	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		329.37	520	80,865	0.2
WORKSPACE GROUP PLC		32.26	283	44,113	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC		52.35	505	78,580	0.2
SHAFTESBURY PLC		76.37	468	72,804	0.2
BIG YELLOW GROUP PLC		41.56	537	83,566	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		225.15	536	83,336	0.2

ファンド名		2021年6月15日現在			
		口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		千口	千イギリス・ポンド	千円	%
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		121.6	56	8,824	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC		427.74	876	136,256	0.3
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	6,001.614	15,569	2,419,397	
	銘柄数<比率>	33銘柄			<5.6%>
		千口	千イスラエル・シュケル	千円	%
(イスラエル)					
REIT 1 LTD		28.84	508	17,248	0.0
イスラエル・シュケル通貨計	口数、金額	28.84	508	17,248	
	銘柄数<比率>	1銘柄			<0.0%>
		千口	千韓国・ウォン	千円	%
(韓国)					
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		6	49,200	4,851	0.0
LOTTE REIT CO LTD		25.375	155,041	15,287	0.0
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1		17.96	89,081	8,783	0.0
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD		5.6	31,304	3,086	0.0
JR REIT XXVII		25.5	133,110	13,124	0.0
KORAMCO ENERGY PLUS REIT		8.5	51,255	5,053	0.0
韓国・ウォン通貨計	口数、金額	88.935	508,991	50,186	
	銘柄数<比率>	6銘柄			<0.1%>
		千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ(アイルランド)					
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		102.05	158	21,217	0.0
HIBERNIA REIT PLC		159.24	200	26,690	0.1
国小計	口数、金額	261.29	358	47,908	
	銘柄数<比率>	2銘柄			<0.1%>
		千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ(オランダ)					
WERELDHAVE NV		8.97	142	19,021	0.0
EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV		8.687	198	26,454	0.1
NSI NV		4.131	142	19,074	0.0
VASTNED RETAIL NV		3.75	97	12,986	0.0
国小計	口数、金額	25.538	581	77,536	
	銘柄数<比率>	4銘柄			<0.2%>
		千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ(ベルギー)					
AEDIFICA		7.726	859	114,651	0.3
COFINIMMO		6.79	888	118,611	0.3
BEFIMMO		5.87	209	28,004	0.1
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS		5.48	133	17,843	0.0
RETAIL ESTATES		2.54	182	24,371	0.1
WAREHOUSES DE PAUW SCA		32.6	1,056	140,955	0.3
CARE PROPERTY INVEST		6.1	166	22,182	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV		4.08	204	27,223	0.1
MONTEA		2.5	261	34,830	0.1
国小計	口数、金額	73.686	3,961	528,675	
	銘柄数<比率>	9銘柄			<1.2%>
		千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ(フランス)					
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		33.09	2,651	353,798	0.8
ICADE		7.49	571	76,314	0.2
CARMILA		10	133	17,802	0.0
ALTAREA		0.89	162	21,639	0.0
GECINA SA		12.961	1,758	234,712	0.5
KLEPIERRE		47.91	1,195	159,583	0.4
COVIVIO		11.452	929	124,064	0.3
MERCIALYS		8.63	92	12,380	0.0
国小計	口数、金額	132.423	7,495	1,000,298	
	銘柄数<比率>	8銘柄			<2.3%>
		千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ(ドイツ)					
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		42.49	659	88,059	0.2
HAMBORNER REIT AG		17.28	159	21,266	0.0
国小計	口数、金額	59.77	819	109,325	
	銘柄数<比率>	2銘柄			<0.3%>
		千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ(スペイン)					
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		14.53	76	10,218	0.0
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		60.633	576	76,909	0.2
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		79.7	762	101,807	0.2
国小計	口数、金額	154.863	1,415	188,935	
	銘柄数<比率>	3銘柄			<0.4%>
		千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ(イタリア)					
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		13.24	61	8,215	0.0
国小計	口数、金額	13.24	61	8,215	
	銘柄数<比率>	1銘柄			<0.0%>

ファンド名		2021年６月15日現在			
		口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		千口	千ユーロ	千円	%
ユーロ（その他）					
CROMWELL REIT EUR		70.92	165	22,146	0.1
国小計	口数、金額	70.92	165	22,146	
	銘柄数＜比率＞	1銘柄			<0.1%>
ユーロ通貨計	口数、金額	791.73	14,859	1,983,042	
	銘柄数＜比率＞	30銘柄			<4.6%>
合計	口数、金額	37,938.235	―	42,224,363	
	銘柄数＜比率＞	327銘柄			<97.3%>

（注１）邦貨換算金額は、2021年６月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
（注２）比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。
（注３）評価額の単位未満は切捨て。

(2)先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別		2021年６月15日現在	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
外国	DJ US REAL ESTATE（アメリカ）	542	―
外国	STOXX 600 REAL（ドイツ）	192	―

（注１）外貨建の評価額は、2021年６月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
（注２）単位未満は切捨て。

ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

運用報告書　第16期（決算日　2020年11月30日）

（作成対象期間　2019年12月３日～2020年11月30日）

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

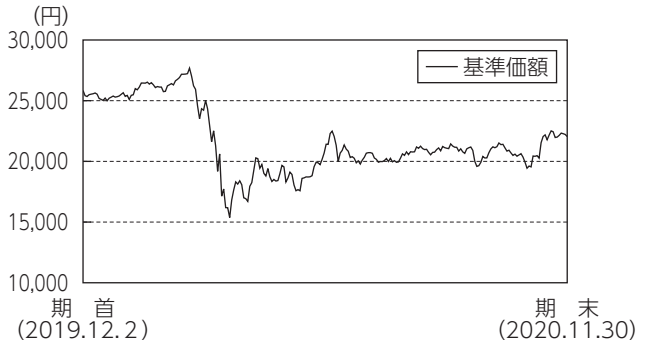
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額	騰落率	Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）（ベンチマーク）	騰落率	投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率
	円	%		%	%	%	%
(期首)2019年12月２日	25,842	－	29,879	－	2.0	95.1	2.9
12月末	25,654	△ 0.7	29,698	△ 0.6	1.2	97.1	1.9
2020年１月末	26,120	1.1	30,141	0.9	1.7	96.2	2.1
２月末	24,572	△ 4.9	28,596	△ 4.3	1.6	95.7	2.7
３月末	18,399	△28.8	21,171	△29.1	1.5	95.7	2.9
４月末	19,668	△23.9	22,705	△24.0	0.8	96.0	3.2
５月末	19,882	△23.1	23,018	△23.0	2.1	94.8	3.2
６月末	20,105	△22.2	23,265	△22.1	0.9	96.6	2.5
７月末	20,495	△20.7	23,781	△20.4	0.6	96.9	2.5
８月末	21,131	△18.2	24,446	△18.2	0.5	96.8	2.8
９月末	20,278	△21.5	23,428	△21.6	1.2	95.9	2.9
10月末	19,615	△24.1	22,704	△24.0	0.9	96.3	2.8
(期末)2020年11月30日	22,044	△14.7	25,605	△14.3	0.5	97.0	2.5

（注１）騰落率は期首比。
（注２）Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）は、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、Ｓ＆Ｐダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるＳ＆Ｐグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのＲＥＩＴ制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。
（注３）海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
（注４）指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
（注５）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：25,842円　期末：22,044円　騰落率：△14.7%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

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

○為替相場

為替相場は、まちまちな動きとなりました。

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。

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

《今後の運用方針》

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

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

Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「ＳＰＤＪＩ」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびＳ＆Ｐ®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「Ｓ＆Ｐ」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがＳＰＤＪＩに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、ＳＰＤＪＩ、Dow Jones、Ｓ＆Ｐまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行なわず、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

■１万口当りの費用の明細

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

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

■売買および取引の状況

(1) 株　式

（2019年12月３日から2020年11月30日まで）

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル
外国	アメリカ	－ (27.78)	－ (8)	27.78	9

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

(2) 投資信託受益証券

（2019年12月３日から2020年11月30日まで）

		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
外国	アメリカ	510 (　－)	41,340 (　－)	547 (　－)	44,723 (　－)

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

(3) 投資信託証券

（2019年12月３日から2020年11月30日まで）

		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
外国	アメリカ	1,743.4 (△ 17.686)	59,233 (32)	388.388 (　－)	10,376 (　－)
		千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
	カナダ	149.9 (△ 7.4)	2,666 (△ 225)	33.9 (　－)	626 (　－)
		千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
	オーストラリア	2,620.44 (22.073)	9,234 (24)	492.59 (　－)	1,812 (　－)
		千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	香港	435.3 (　－)	11,372 (　－)	56.9 (　－)	3,970 (　－)
		千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
	シンガポール	3,198.5 (△ 51.578)	4,551 (△ 95)	860.7 (　－)	1,571 (　－)
		千口	千ニュージーランド・ドル	千口	千ニュージーランド・ドル
	ニュージーランド	271 (　－)	506 (　－)	51.45 (　－)	96 (　－)
		千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
	イギリス	2,809.82 (273.95)	4,643 (△ 189)	1,020.166 (　－)	860 (　－)
		千口	千韓国ウォン	千口	千韓国ウォン
	韓国	35.92 (0.546)	176,097 (　－)	0.546 (　－)	154 (　－)
		千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	ユーロ (アイルランド)	24 (　－)	44 (　－)	－ (　－)	－ (　－)
		千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	ユーロ (オランダ)	1.7 (　－)	34 (　－)	－ (　－)	－ (　－)
		千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	ユーロ (ベルギー)	19.84 (20.066)	906 (87)	3.504 (　－)	157 (　－)
		千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	ユーロ (フランス)	35.65 (　－)	1,566 (△ 30)	13.09 (　－)	595 (　－)
		千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	ユーロ (ドイツ)	11.42 (　－)	149 (△ 17)	3.2 (　－)	45 (　－)
		千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	ユーロ (スペイン)	27.31 (　－)	250 (△ 1)	12.5 (　－)	101 (　－)
		千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	ユーロ (その他)	294.6 (　－)	140 (　－)	－ (　－)	－ (　－)
		千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	ユーロ (ユーロ　通貨計)	414.52 (20.066)	3,092 (37)	32.294 (　－)	899 (　－)

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

（2019年12月３日から2020年11月30日まで）

種類別		買建 新規買付額	買建 決済額	売建 新規売付額	売建 決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
外国	不動産投信指数先物取引	4,449	4,476	－	－

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

（2019年12月３日から2020年11月30日まで）

当期							
買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF（アメリカ）	510	4,437,202	8,700	VANGUARD REAL ESTATE ETF（アメリカ）	547	4,798,191	8,771

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

（2019年12月３日から2020年11月30日まで）

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

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

（ｉ）外国投資信託受益証券

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

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

（ⅱ）外国投資信託証券

ファンド名	当期末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
不動産ファンド				
(シンガポール)	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
MANULIFE US REAL ESTATE INV	320.562	238	24,810	0.1
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	151.4	106	11,088	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90	12	1,280	0.0
PRIME US REIT	99	76	7,970	0.0
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	29.5	572	59,517	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13.7	76	7,970	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	21.982	301	31,309	0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	25.4	374	38,948	0.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC	31.4	5,271	547,616	1.9
SIMON PROPERTY GROUP INC	71.847	6,146	638,561	2.2
BOSTON PROPERTIES INC	31.4	3,216	334,141	1.2
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	32.467	999	103,820	0.4
VORNADO REALTY TRUST	35.064	1,414	146,914	0.5
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	18	395	41,103	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13.9	468	48,679	0.2
NEXPOINT RESIDENTIAL	4.8	208	21,662	0.1
QTS REALTY TRUST INC-CL A	13.6	816	84,774	0.3
EQUITY RESIDENTIAL	76.5	4,528	470,497	1.6
APPLE HOSPITALITY REIT INC	43.8	585	60,838	0.2
EPR PROPERTIES	16.1	611	63,559	0.2
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.5	32	3,410	0.0
CITY OFFICE REIT INC	9.3	84	8,772	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	19.833	336	34,986	0.1
EQUINIX INC	19.6	13,730	1,426,429	4.9
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	15.529	438	45,511	0.2
CHATHAM LODGING TRUST	7.4	82	8,610	0.0
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	7.1	128	13,299	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	12.3	799	83,060	0.3
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	25.7	349	36,258	0.1
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4.9	225	23,376	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	157.6	2,304	239,374	0.8

ファンド名	当期末			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	59.008	1,683	174,898	0.6
CORESITE REALTY CORP	9.5	1,188	123,517	0.4
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	34.1	916	95,190	0.3
RLJ LODGING TRUST	35.871	451	46,918	0.2
FARMLAND PARTNERS INC	2.9	23	2,464	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	46.1	809	84,052	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	14	152	15,839	0.1
CYRUSONE INC	25.9	1,812	188,271	0.7
KIMCO REALTY CORP	94.4	1,422	147,794	0.5
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9.8	133	13,887	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	48.85	1,289	133,929	0.5
WHITESTONE REIT	8.5	67	7,029	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	46.349	1,926	200,119	0.7
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	27.2	443	46,060	0.2
PARK HOTELS & RESORTS INC	51.68	864	89,770	0.3
COLONY CAPITAL INC	105.011	457	47,565	0.2
INVITATION HOMES INC	125.297	3,603	374,371	1.3
JBG SMITH PROPERTIES	25.132	805	83,733	0.3
ALEXANDER & BALDWIN INC	16.5	268	27,855	0.1
CLIPPER REALTY INC	1.4	8	907	0.0
GLADSTONE LAND CORP	4.5	67	6,984	0.0
AMERICOLD REALTY TRUST	45.1	1,533	159,304	0.6
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	14.3	312	32,460	0.1
VICI PROPERTIES INC	118.2	3,035	315,345	1.1
RETAIL VALUE INC	2.815	43	4,494	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12.5	206	21,414	0.1
BRT APARTMENTS CORP	1.3	17	1,832	0.0
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10.1	165	17,145	0.1
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4.9	768	79,815	0.3
SAFEHOLD INC	3.2	213	22,197	0.1
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29.96	31	3,299	0.0
AMERICAN FINANCE TRUST INC	22.4	181	18,849	0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	22.9	478	49,675	0.2

ファンド名	当期末 口数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	比率
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
COREPOINT LODGING INC	6.7	45	4,705	0.0
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3.4	45	4,683	0.0
STORE CAPITAL CORP	50.5	1,683	174,864	0.6
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2.4	25	2,690	0.0
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	22.4	203	21,176	0.1
LIFE STORAGE INC	10.4	1,128	117,197	0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	10.1	304	31,667	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	20.082	258	26,830	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	9.2	73	7,684	0.0
PARAMOUNT GROUP INC	36.4	359	37,324	0.1
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29.2	283	29,425	0.1
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	27.4	1,331	138,372	0.5
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	23.7	342	35,603	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	32.5	977	101,529	0.4
VENTAS INC	83.379	3,993	414,921	1.4
CARETRUST REIT INC	21.503	424	44,075	0.2
GEO GROUP INC/THE	27.4	266	27,640	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	64.3	1,037	107,817	0.4
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	10.6	252	26,275	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	44.987	769	79,966	0.3
UMH PROPERTIES INC	8.6	122	12,740	0.0
IRON MOUNTAIN INC	63.8	1,698	176,442	0.6
TERRENO REALTY CORP	15.2	886	92,110	0.3
VEREIT INC	240.908	1,768	183,705	0.6
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22.32	842	87,558	0.3
SUN COMMUNITIES INC	21.8	3,021	313,924	1.1
ACADIA REALTY TRUST	17.011	251	26,084	0.1
ALEXANDER'S INC	0.4	113	11,742	0.0
PROLOGIS INC	163.619	16,460	1,710,036	5.9
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26.2	4,248	441,331	1.5
BRANDYWINE REALTY TRUST	38.3	440	45,718	0.2
SAUL CENTERS INC	2.4	76	7,958	0.0
MACK-CALI REALTY CORP	20.2	283	29,422	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	21.8	2,130	221,361	0.8
COUSINS PROPERTIES INC	32.906	1,128	117,258	0.4
SITE CENTERS CORP	31.878	340	35,403	0.1
DUKE REALTY CORP	82.1	3,151	327,442	1.1
EASTGROUP PROPERTIES INC	8.7	1,223	127,071	0.4
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14.467	3,616	375,759	1.3
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	27.8	1,180	122,688	0.4
FEDERAL REALTY INVS TRUST	15.4	1,360	141,383	0.5
GETTY REALTY CORP	7.703	220	22,951	0.1
WELLTOWER INC	93.2	6,015	624,911	2.2
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	120.3	3,594	373,439	1.3
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23.1	897	93,282	0.3
SERVICE PROPERTIES TRUST	36.5	449	46,679	0.2
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30.1	910	94,594	0.3
EQUITY COMMONWEALTH	27.375	726	75,479	0.3
KILROY REALTY CORP	23.2	1,463	152,086	0.5
LTC PROPERTIES INC	8.4	318	33,118	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	60	622	64,640	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	25.328	3,140	326,284	1.1
MACERICH CO/THE	21.979	238	24,774	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	37.5	2,201	228,726	0.8
NATL HEALTH INVESTORS INC	9.6	630	65,525	0.2
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	38.4	1,474	153,152	0.5
REALTY INCOME CORP	77.117	4,753	493,840	1.7
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	24	653	67,919	0.2
PUBLIC STORAGE	33.8	7,437	772,631	2.7
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4.3	570	59,280	0.2
REGENCY CENTERS CORP	34.92	1,637	170,109	0.6
RPT REALTY	17.8	137	14,313	0.0
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17.6	174	18,156	0.1
SL GREEN REALTY CORP	16.4	993	103,164	0.4
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	49	242	25,198	0.1
TAUBMAN CENTERS INC	13.3	568	59,096	0.2
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6	85	8,932	0.0
UDR INC	65.3	2,561	266,069	0.9
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2.6	162	16,930	0.1
WP CAREY INC	38.5	2,690	279,543	1.0
WASHINGTON REIT	17.8	427	44,437	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	25.9	571	59,357	0.2
AGREE REALTY CORP	11.7	770	80,077	0.3
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50.748	1,819	189,008	0.7
CUBESMART	43.3	1,379	143,365	0.5
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45.526	493	51,317	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	59.778	8,173	849,139	2.9
EXTRA SPACE STORAGE INC	28.6	3,146	326,837	1.1
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7.875	67	7,003	0.0

ファンド名	当期末 口数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	比率
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2.46	175	18,216	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	18.95	281	29,294	0.1
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	21	310	32,289	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2.233	39	4,110	0.0
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	30.5	1,234	128,298	0.4
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6.3	114	11,872	0.0
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	42.342	336	34,927	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	117.1	2,291	238,079	0.8
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21	102	10,646	0.0
DOUGLAS EMMETT INC	36.5	1,165	121,078	0.4
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	46.7	394	40,948	0.1
アメリカ・ドル 通貨計 口数、金額	5,540.075	197,536	20,522,019	
銘柄数<比率>	155銘柄			<71.0%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	%
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13.1	141	11,332	0.0
SLATE GROCERY REIT	8.1	100	8,049	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10.2	179	14,344	0.0
SLATE OFFICE REIT	5.1	21	1,724	0.0
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4.2	80	6,457	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	19.7	240	19,262	0.1
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	17.6	233	18,658	0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11.2	74	5,927	0.0
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	8.5	151	12,137	0.0
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4.1	45	3,599	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6.2	474	37,945	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	18.3	236	18,873	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	16.2	229	18,352	0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	24.7	385	30,806	0.1
CHOICE PROPERTIES REIT	36.8	489	39,130	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4.2	68	5,496	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11.9	178	14,252	0.0
PLAZA RETAIL REIT	11.1	40	3,274	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	16.3	395	31,602	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	19.5	1,001	80,040	0.3
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21.79	199	15,975	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	32.566	467	37,362	0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	34.3	623	49,827	0.2
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5.4	116	9,282	0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4.7	164	13,144	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9.5	139	11,165	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13.3	545	43,575	0.2
カナダ・ドル 通貨計 口数、金額	388.556	7,024	561,600	
銘柄数<比率>	27銘柄			＜ 1.9%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	78.38	235	18,084	0.1
CROMWELL PROPERTY GROUP	435.284	396	30,464	0.1
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	95.11	299	23,041	0.1
AVENTUS GROUP	88	237	18,273	0.1
RURAL FUNDS GROUP	78.595	204	15,716	0.1
WAYPOINT REIT	177.83	489	37,611	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	98.668	483	37,183	0.1
CENTURIA OFFICE REIT	84.95	192	14,831	0.1
CENTURIA CAPITAL GROUP	97.59	247	19,064	0.1
INVESTEC AUSTRALIA PROPERTY	119.63	155	11,960	0.0
HOME CONSORTIUM	35	132	10,202	0.0
HOMECO DAILY NEEDS REIT	17.5	23	1,810	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	241.86	623	47,991	0.2
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	70.547	263	20,238	0.1
NATIONAL STORAGE REIT	206.195	391	30,131	0.1
APN INDUSTRIA REIT	29.76	89	6,912	0.0
GDI PROPERTY GROUP	123.31	149	11,475	0.0
SCENTRE GROUP	1,194.91	3,441	264,673	0.9
ARENA REIT	79.89	223	17,204	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38.3	121	9,367	0.0
BWP TRUST	105.55	458	35,231	0.1
DEXUS	251.73	2,471	190,120	0.7
GPT GROUP	444	2,104	161,861	0.6
CHARTER HALL RETAIL REIT	120.4	463	35,650	0.1
MIRVAC GROUP	908.06	2,370	182,279	0.6
STOCKLAND	550.01	2,541	195,431	0.7
ABACUS PROPERTY GROUP	81.12	257	19,777	0.1
GOODMAN GROUP	381.71	7,103	546,339	1.9
VICINITY CENTRES	878.9	1,467	112,885	0.4
CHARTER HALL GROUP	105.06	1,399	107,627	0.4
INGENIA COMMUNITIES GROUP	68.66	318	24,502	0.1
オーストラリア・ドル 通貨計 口数、金額	7,286.509	29,358	2,257,947	
銘柄数<比率>	31銘柄			＜ 7.8%>
(香港)	千口	千香港ドル	千円	%
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	349	1,333	17,864	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193	717	9,620	0.0

ファンド名		当期末 口数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 比率
		千口	千香港ドル	千円	%
FORTUNE REIT		311	2,183	29,255	0.1
PROSPERITY REIT		300	714	9,567	0.0
LINK REIT		476.9	32,667	437,746	1.5
CHAMPION REIT		431	1,973	26,451	0.1
香港ドル通貨計	口数、金額	2,060.9	39,589	530,505	
	銘柄数<比率>	6銘柄			< 1.8%>
(シンガポール)		千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT		293.783	837	65,048	0.2
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		126.2	59	4,657	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC		455	423	32,874	0.1
AIMS APAC REIT		89	108	8,435	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST		121.8	63	4,967	0.0
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI		591.19	821	63,842	0.2
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		86	69	5,411	0.0
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL		208.9	141	10,954	0.0
EC WORLD REIT		57	41	3,188	0.0
IREIT GLOBAL		105.124	67	5,267	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		722.377	2,181	169,486	0.6
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		1,029.422	2,048	159,151	0.6
SUNTEC REIT		473.4	724	56,271	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		608.2	1,192	92,612	0.3
KEPPEL REIT		375.4	401	31,206	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST		417.456	429	33,405	0.1
ESR-REIT		559.902	226	17,617	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS		161.6	202	15,693	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		211.776	497	38,664	0.1
STARHILL GLOBAL REIT		308.8	149	11,635	0.0
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS		179.396	222	17,282	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		86.3	341	26,550	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL		467.2	42	3,266	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		384.78	1,135	88,185	0.3
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST		244.5	152	11,872	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		498.484	1,031	80,165	0.3
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		182.1	117	9,125	0.0
SPH REIT		220.6	183	14,224	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI		202.1	101	7,850	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		219.4	76	5,965	0.0
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		541.063	208	16,183	0.1
(非上場)					
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS		10.046	0	34	0.0
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	10,238.299	14,301	1,111,099	
	銘柄数<比率>	32銘柄			< 3.8%>
(ニュージーランド)		千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
ARGOSY PROPERTY LTD		158.52	237	17,384	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD		357.92	440	32,186	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		76.8	228	16,732	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST		248.22	598	43,735	0.2
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL		245.82	427	31,271	0.1
ニュージーランド・ドル通貨計	口数、金額	1,087.28	1,932	141,308	
	銘柄数<比率>	5銘柄			< 0.5%>
(イギリス)		千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC		594.52	433	60,130	0.2
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		129.57	94	13,051	0.0
STANDARD LIFE INV PROP INC		100	55	7,647	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		177.71	124	17,259	0.1
PICTON PROPERTY INCOME LTD		121.11	86	11,963	0.0
REGIONAL REIT LTD		81.31	60	8,449	0.0
NEWRIVER REIT PLC		69.33	52	7,242	0.0
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE		183.29	249	34,536	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		135.49	138	19,147	0.1
CUSTODIAN REIT PLC		89.42	76	10,642	0.0
GCP STUDENT LIVING PLC		96.86	136	18,922	0.1
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		67.9	73	10,160	0.0
LXI REIT PLC		118.038	136	18,970	0.1
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		75.2	78	10,939	0.0
AEW UK REIT PLC		25.61	19	2,710	0.0
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS		180	129	17,906	0.1
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		150	160	22,185	0.1
RDI REIT PLC		41.036	38	5,372	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		166.381	1,106	153,319	0.5
SEGRO PLC		263.74	2,377	329,382	1.1
HAMMERSON PLC		811.984	181	25,143	0.1
UNITE GROUP PLC/THE		87.26	862	119,508	0.4
BRITISH LAND CO PLC		208.52	980	135,813	0.5
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		53.581	346	48,075	0.2
DERWENT LONDON PLC		24.39	753	104,350	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		283.37	394	54,651	0.2
WORKSPACE GROUP PLC		26.46	185	25,662	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC		46.35	353	48,934	0.2
SHAFTESBURY PLC		53.85	286	39,729	0.1
BIG YELLOW GROUP PLC		36.96	418	57,967	0.2

ファンド名		当期末 口数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 比率
		千口	千イギリス・ポンド	千円	%
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		203.15	448	62,147	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		121.6	43	5,980	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC		370.26	596	82,592	0.3
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	5,194.25	11,479	1,590,499	
	銘柄数<比率>	33銘柄			< 5.5%>
(イスラエル)		千口	千イスラエル・シュケル	千円	%
REIT 1 LTD		28.84	455	14,289	0.0
イスラエル・シュケル通貨計	口数、金額	28.84	455	14,289	
	銘柄数<比率>	1銘柄			< 0.0%>
(韓国)		千口	千韓国ウォン	千円	%
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		6	44,460	4,188	0.0
LOTTE REIT CO LTD		17.96	96,984	9,135	0.0
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1		17.96	73,456	6,919	0.0
韓国ウォン通貨計	口数、金額	41.92	214,900	20,243	
	銘柄数<比率>	3銘柄			< 0.1%>
ユーロ（アイルランド）		千口	千ユーロ	千円	%
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		82.05	115	14,389	0.0
HIBERNIA REIT PLC		116.24	134	16,771	0.1
国小計	口数、金額	198.29	250	31,160	
	銘柄数<比率>	2銘柄			< 0.1%>
ユーロ（オランダ）		千口	千ユーロ	千円	%
WERELDHAVE NV		6.47	75	9,343	0.0
EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV		8.23	126	15,702	0.1
NSI NV		3.231	108	13,543	0.0
VASTNED RETAIL NV		3.75	87	10,844	0.0
国小計	口数、金額	21.681	397	49,433	
	銘柄数<比率>	4銘柄			< 0.2%>
ユーロ（ベルギー）		千口	千ユーロ	千円	%
AEDIFICA		6.256	606	75,477	0.3
COFINIMMO		5.3	661	82,269	0.3
BEFIMMO		5.07	192	23,899	0.1
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS		4.61	104	13,044	0.0
RETAIL ESTATES		1.94	116	14,477	0.1
WAREHOUSES DE PAUW SCA		25.48	718	89,308	0.3
CARE PROPERTY INVEST		4.9	133	16,638	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV		2.7	136	16,959	0.1
MONTEA		2.15	208	25,912	0.1
国小計	口数、金額	58.406	2,878	357,988	
	銘柄数<比率>	9銘柄			< 1.2%>
ユーロ（フランス）		千口	千ユーロ	千円	%
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		26.77	1,690	210,300	0.7
ICADE		5.94	355	44,255	0.2
CARMILA		10	123	15,373	0.1
ALTAREA		0.74	102	12,701	0.0
GECINA SA		10.521	1,337	166,323	0.6
KLEPIERRE		39.94	774	96,274	0.3
COVIVIO		8.992	647	80,526	0.3
MERCIALYS		4.03	28	3,543	0.0
国小計	口数、金額	106.933	5,059	629,299	
	銘柄数<比率>	8銘柄			< 2.2%>
ユーロ（ドイツ）		千口	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		34.82	478	59,506	0.2
HAMBORNER REIT AG		11.98	107	13,340	0.0
国小計	口数、金額	46.8	585	72,847	
	銘柄数<比率>	2銘柄			< 0.3%>
ユーロ（スペイン）		千口	千ユーロ	千円	%
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		10.53	51	6,417	0.0
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		50.033	406	50,500	0.2
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		66.1	524	65,237	0.2
国小計	口数、金額	126.663	982	122,155	
	銘柄数<比率>	3銘柄			< 0.4%>
ユーロ（イタリア）		千口	千ユーロ	千円	%
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		6.24	22	2,782	0.0
国小計	口数、金額	6.24	22	2,782	
	銘柄数<比率>	1銘柄			< 0.0%>
ユーロ（その他）		千口	千ユーロ	千円	%
CROMWELL EUROPEAN REIT		294.6	142	17,771	0.1
国小計	口数、金額	294.6	142	17,771	
	銘柄数<比率>	1銘柄			< 0.1%>
ユーロ通貨計	口数、金額	859.613	10,318	1,283,439	
	銘柄数<比率>	30銘柄			< 4.4%>
合計	口数、金額	32,726.242	－	28,032,952	
	銘柄数<比率>	323銘柄			<97.0%>

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当期末 買建額	当期末 売建額
		百万円	百万円
外国	DJ US REAL ESTATE（アメリカ）	451	－
外国	STOXX 600　REAL（ドイツ）	271	－

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

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
投資信託受益証券	154,336	0.5
投資信託証券	28,032,952	96.8
コール・ローン等、その他	778,544	2.7
投資信託財産総額	28,965,833	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝103.89円、１カナダ・ドル＝79.95円、１オーストラリア・ドル＝76.91円、１香港ドル＝13.40円、１シンガポール・ドル＝77.69円、１ニュージーランド・ドル＝73.11円、１イギリス・ポンド＝138.55円、１イスラエル・シュケル＝31.34円、100韓国ウォン＝9.42円、１ユーロ＝124.38円です。
（注３）当期末における外貨建純資産（28,578,706千円）の投資信託財産総額（28,965,833千円）に対する比率は、98.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

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

＊期首における元本額は10,530,038,419円、当作成期間中における追加設定元本額は5,074,786,065円、同解約元本額は2,494,533,516円です。
＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）6,132,754,799円、ダイワファンドラップ 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）1,093,059,962円、ダイワファンドラップオンライン 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）373,261,192円、ダイワファンドラップオンライン 外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）273,443,934円、Ｄ－Ｉ's グローバルＲＥＩＴインデックス1,889,346円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050 1,550,762円、ｉＦｒｅｅ 外国ＲＥＩＴインデックス123,942,403円、ｉＦｒｅｅ ８資産バランス1,373,085,035円、グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）58,109,678円、グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）22,959,674円、ＤＣダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックスファンド2,665,764,298円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020 3,110,210円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030 6,033,482円、ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040 3,580,507円、ダイワバランスファンド2020－07（適格機関投資家専用）249,211,041円、ダイワ・インデックスセレクト グローバルＲＥＩＴ253,711,264円、ダイワ・ノーロード グローバルＲＥＩＴファンド52,204,021円、ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）217,637,598円、ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）204,981,762円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は22,044円です。

■損益の状況

当期　自2019年12月３日　至2020年11月30日

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

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

ダイワファンドラップ
外国ＲＥＩＴインデックス
（為替ヘッジなし）

運用報告書（全体版）
第５期
（決算日　2021年６月15日）
（作成対象期間　2020年６月16日～2021年６月15日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）／インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	投資成果をＳ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドの受益証券	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果をＳ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

<2737>

設定以来の運用実績

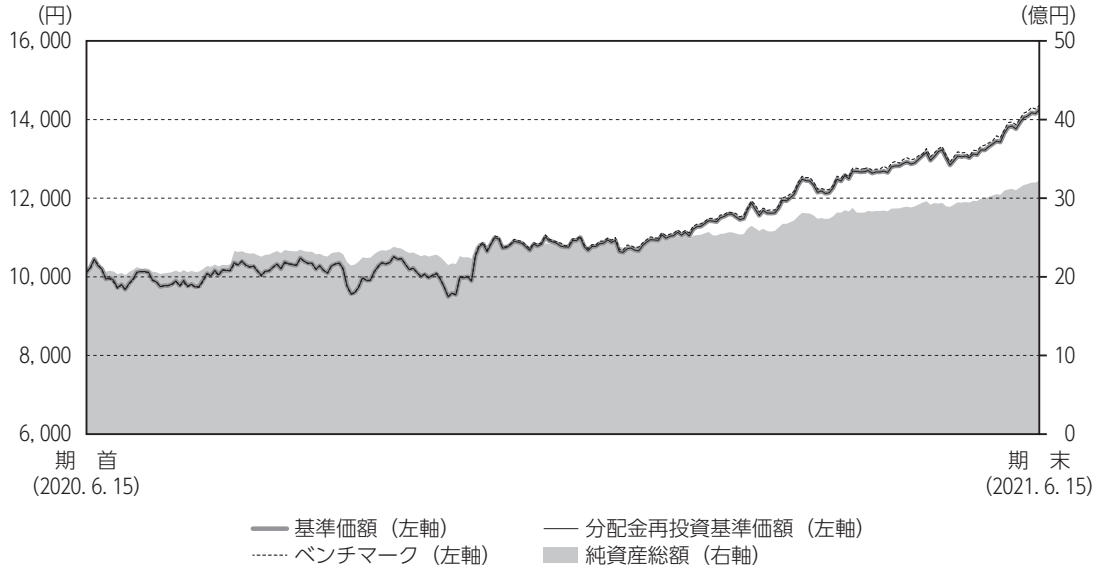
決算期	基準価額			Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）		投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1期末（2017年6月15日）	10,729	0	7.3	10,780	7.8	—	99.1	—	609
2期末（2018年6月15日）	10,864	0	1.3	11,093	2.9	0.8	97.8	1.0	1,189
3期末（2019年6月17日）	11,931	0	9.8	12,298	10.9	0.6	98.2	1.0	1,667
4期末（2020年6月15日）	10,120	0	△ 15.2	10,533	△ 14.4	2.2	94.6	3.2	2,091
5期末（2021年6月15日）	14,252	0	40.8	14,945	41.9	0.9	97.3	1.7	3,226

（注１）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注２）Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、Ｓ＆Ｐダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるＳ＆Ｐグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのＲＥＩＴ制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。
（注３）海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
（注４）指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
（注５）組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
（注６）不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「ＳＰＤＪＩ」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's® およびＳ＆Ｐ®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「Ｓ＆Ｐ」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがＳＰＤＪＩに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、ＳＰＤＪＩ、Dow Jones、Ｓ＆Ｐまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行なわず、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

運用経過

基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期　首：10,120円
期　末：14,252円（分配金０円）
騰落率：40.8％（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100％投資した結果、米国を中心にリート市況が上昇したことおよび為替相場で円安が進んだことを受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

年　月　日	基準価額		Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）		投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率			
	円	%		%	%	%	%
（期首）2020年６月15日	10,120	—	10,533	—	2.2	94.6	3.2
６月末	9,836	△ 2.8	10,225	△ 2.9	0.9	96.6	2.5
７月末	10,023	△ 1.0	10,451	△ 0.8	0.6	96.9	2.5
８月末	10,330	2.1	10,744	2.0	0.5	96.8	2.8
９月末	9,910	△ 2.1	10,296	△ 2.2	1.2	95.9	2.9
10月末	9,582	△ 5.3	9,978	△ 5.3	0.9	96.2	2.8
11月末	10,765	6.4	11,253	6.8	0.5	97.0	2.5
12月末	10,874	7.5	11,377	8.0	0.7	97.1	2.2
2021年１月末	11,129	10.0	11,635	10.5	1.0	96.6	2.4
２月末	11,710	15.7	12,305	16.8	0.9	96.6	2.4
３月末	12,577	24.3	13,128	24.6	0.7	97.0	2.3
４月末	13,163	30.1	13,802	31.0	1.6	96.7	1.8
５月末	13,454	32.9	14,145	34.3	0.7	97.7	1.7
（期末）2021年６月15日	14,252	40.8	14,945	41.9	0.9	97.3	1.7

（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

（2020.6.16 ～ 2021.6.15）

■海外リート市況

海外リート市況は上昇しました。

海外リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染第２波への警戒などから上値が重い展開で始まりました。2020年９月以降は、感染再拡大やそれに伴うロックダウン（都市封鎖）への懸念などから、世界的に下落基調となりました。11月以降は、ワクチン開発で高い効果を示す結果が報告されたことなどを背景に、上昇に転じました。その後も、ワクチン普及による経済正常化期待から、商業施設やホテル／リゾートを中心として世界的に上昇傾向が続き、当作成期末を迎えました。

■為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると円安となりました。

対円為替相場は、当作成期首より、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。しかし2020年11月以降は、新型コロナウイルスのワクチン開発に進展があったことで市場のリスク選好姿勢が強まり、円安傾向となりました。2021年に入ると、米国において民主党が大統領府・議会上下両院を制したことから、株価が上昇するなど市場のリスク選好姿勢が強まり、円安となりました。３月には、米国での追加経済対策の成立や、経済指標の改善によって米国金利が上昇したことなどから米ドルが買い進められ、全般的に円安が進行しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

主として「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

（2020. 6. 16 ～ 2021. 6. 15）

■当ファンド

「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ100％行いました。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

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

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

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）

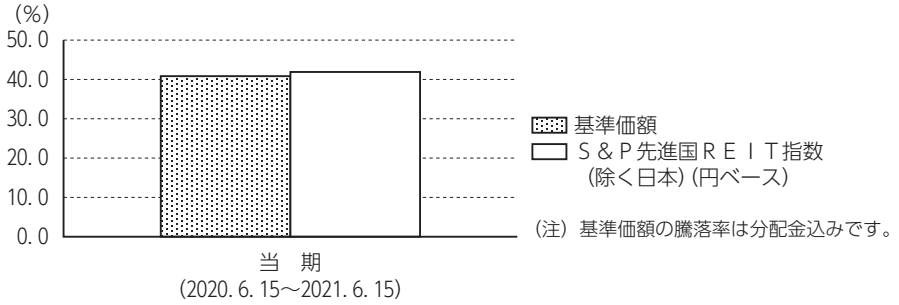
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は41. 9％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は40. 8％となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



＊ベンチマークはＳ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）です。

分配金について

当作成期は、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６月16日 ～2021年６月15日
当期分配金（税込み）		**（円）**	**―**
	対基準価額比率	（％）	―
	当期の収益	（円）	―
	当期の収益以外	（円）	―
翌期繰越分配対象額		（円）	4,251

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

今後の運用方針

■当ファンド

主として「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

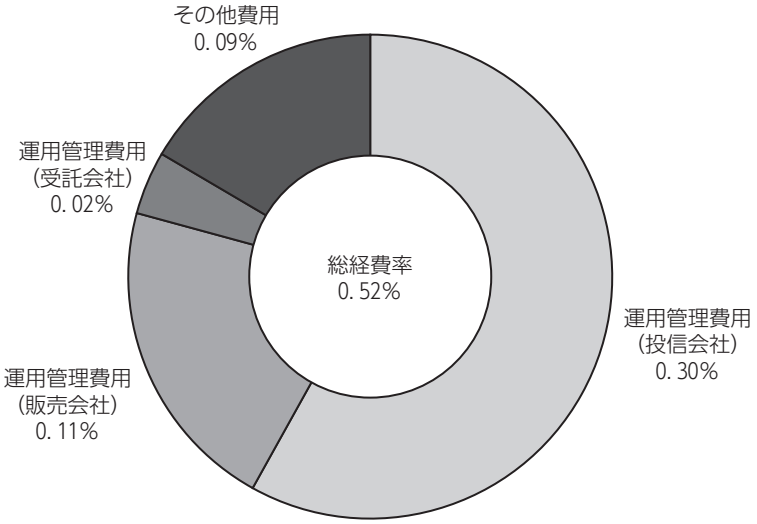
項　　目	当　期 (2020. 6. 16～2021. 6. 15) 金　額	比　率	項　目　の　概　要
信　託　報　酬	49円	0. 434%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は11, 168円です。**
(投 信 会 社)	(34)	(0. 302)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(12)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	2	0. 017	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0. 004)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0. 004)	
(投資信託証券)	(1)	(0. 009)	
有価証券取引税	1	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
(投資信託受益証券)	(0)	(0. 000)	
(投資信託証券)	(1)	(0. 013)	
そ の 他 費 用	10	0. 086	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. 023)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ　の　他)	(6)	(0. 058)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	62	0. 551	

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（１口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0. 52%です。



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

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2020年６月16日から2021年６月15日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	281,006	630,487	189,542	439,104

（注）単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	1,011,439	1,102,903	3,226,545

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年６月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	3,226,545	99.8
コール・ローン等、その他	7,133	0.2
投資信託財産総額	3,233,678	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、６月15日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝110.11円、１カナダ・ドル＝90.68円、１オーストラリア・ドル＝84.91円、１香港・ドル＝14.19円、１シンガポール・ドル＝82.99円、１ニュージーランド・ドル＝78.64円、１イギリス・ポンド＝155.39円、１イスラエル・シュケル＝33.923円、100韓国・ウォン＝9.86円、１ユーロ＝133.45円です。
（注３）ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（43,089,810千円）の投資信託財産総額（43,434,395千円）に対する比率は、99.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年６月15日現在

項目	当期末
（A）資産	**3,233,678,966円**
コール・ローン等	7,133,780
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド（評価額）	3,226,545,186
（B）負債	**6,849,089**
未払解約金	886,817
未払信託報酬	5,887,831
その他未払費用	74,441
（C）純資産総額（A－B）	**3,226,829,877**
元本	2,264,129,492
次期繰越損益金	962,700,385
（D）受益権総口数	**2,264,129,492口**
１万口当り基準価額（C／D）	**14,252円**

＊期首における元本額は2,067,091,677円、当作成期間中における追加設定元本額は758,967,899円、同解約元本額は561,930,084円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は14,252円です。

■損益の状況

当期　自 2020年６月16日　至 2021年６月15日

項目	当期
（A）配当等収益	△ **934円**
受取利息	127
支払利息	△ 1,061
（B）有価証券売買損益	**882,246,241**
売買益	942,635,540
売買損	△ 60,389,299
（C）信託報酬等	△ **10,919,416**
（D）当期損益金（A＋B＋C）	**871,325,891**
（E）前期繰越損益金	△ **145,850,886**
（F）追加信託差損益金	**237,225,380**
（配当等相当額）	(216,923,668)
（売買損益相当額）	(20,301,712)
（G）合計（D＋E＋F）	**962,700,385**
次期繰越損益金（G）	**962,700,385**
追加信託差損益金	237,225,380
（配当等相当額）	(216,923,668)
（売買損益相当額）	(20,301,712)
分配準備積立金	725,475,939
繰越損益金	△ 934

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項目	当期
（a）経費控除後の配当等収益	0円
（b）経費控除後の有価証券売買等損益	634,973,851
（c）収益調整金	237,225,380
（d）分配準備積立金	90,502,088
（e）当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	962,701,319
（f）分配金	0
（g）翌期繰越分配対象額（e－f）	962,701,319
（h）受益権総口数	2,264,129,492口

★「ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド」の第16期にかかる運用状況については273～278ページをご参照ください。

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワファンドラップ　外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ・グローバルＲＥＩＴ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６月15日）現在におけるダイワ・グローバルＲＥＩＴ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。266～272ページをご参照ください。