

ダイワTOP I Xインデックス (ダイワSMA専用)  
ダイワ日経225インデックス (ダイワSMA専用)  
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)  
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)  
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)  
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)  
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)  
ダイワJ-R E I Tインデックス (ダイワSMA専用)  
ダイワ外国R E I Tインデックス (為替ヘッジあり) (ダイワSMA専用)  
ダイワ外国R E I Tインデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用)

---

---

# 運用報告書 (全体版)

## 第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

---

---

## 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/>

<4660>  
<4661>  
<5694>  
<5695>  
<4662>  
<5696>  
<5697>  
<4663>  
<5698>  
<5699>

# ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)

## 運用報告書(全体版)

### 第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

#### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の株式に投資し、投資成果を東証株価指数(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/>

#### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/株式/インデックス型		
信託期間	無期限(設定日:2017年2月16日)		
運用方針	投資成果を東証株価指数(TOPIX)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	東京証券取引所上場株式(上場予定を含みます。)	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

最近5期の運用実績

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
2 期末 (2018年 6 月15日)	11,678	110	14.7	1,789.04	12.7	99.7	1.2	99
3 期末 (2019年 6 月17日)	10,218	30	△ 12.2	1,539.74	△ 13.9	98.8	1.5	1,892
4 期末 (2020年 6 月15日)	10,189	200	1.7	1,530.78	△ 0.6	100.2	1.7	5,083
5 期末 (2021年 6 月15日)	13,209	190	31.5	1,975.48	29.1	98.8	2.6	2,958
6 期末 (2022年 6 月15日)	12,400	270	△ 4.1	1,855.93	△ 6.1	100.3	1.9	2,264

(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。

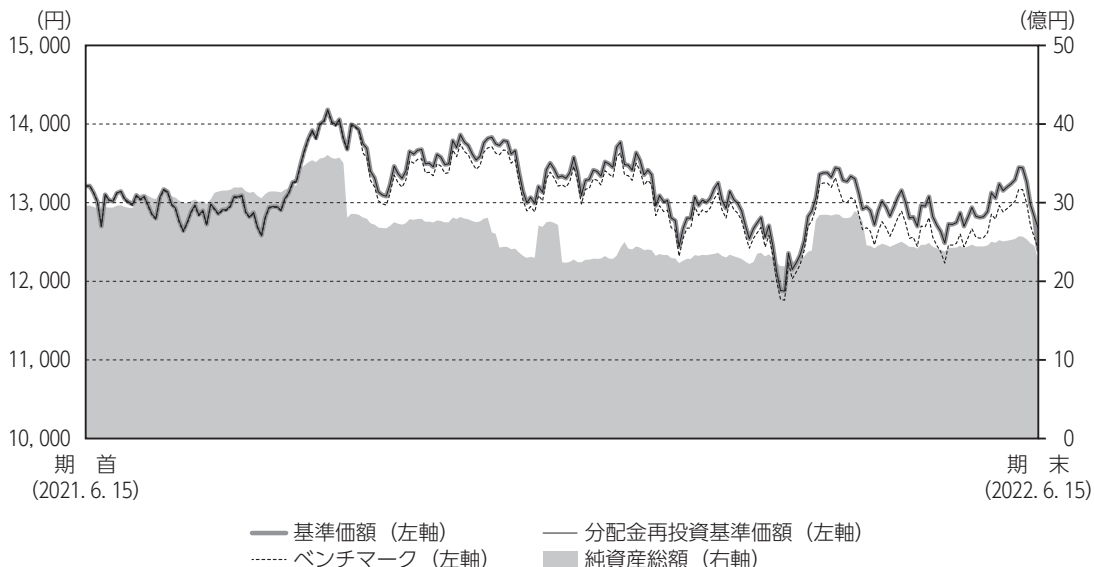
(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

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



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

#### 基準価額・騰落率

期首：13,209円

期末：12,400円 (分配金270円)

騰落率：△4.1% (分配金込み)

#### 基準価額の主な変動要因

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

ダイワTOP I Xインデックス (ダイワSMA専用)

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組入比率	株 式 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2021年 6月15日	円	%		%	%	%
	13,209	—	1,975.48	—	98.8	2.6
6月末	13,009	△ 1.5	1,943.57	△ 1.6	98.0	2.0
7月末	12,724	△ 3.7	1,901.08	△ 3.8	97.0	3.0
8月末	13,121	△ 0.7	1,960.70	△ 0.7	98.3	1.6
9月末	13,692	3.7	2,030.16	2.8	98.1	1.8
10月末	13,495	2.2	2,001.18	1.3	97.5	2.5
11月末	12,999	△ 1.6	1,928.35	△ 2.4	97.2	3.0
12月末	13,451	1.8	1,992.33	0.9	98.2	1.8
2022年 1月末	12,802	△ 3.1	1,895.93	△ 4.0	97.7	2.4
2月末	12,743	△ 3.5	1,886.93	△ 4.5	97.5	2.7
3月末	13,285	0.6	1,946.40	△ 1.5	97.3	2.6
4月末	12,964	△ 1.9	1,899.62	△ 3.8	96.8	3.3
5月末	13,058	△ 1.1	1,912.67	△ 3.2	96.0	4.0
(期末)2022年 6月15日	12,670	△ 4.1	1,855.93	△ 6.1	100.3	1.9

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

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

### 国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

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

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### 当ファンド

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

### トピックス・インデックス・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

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

### 当ファンド

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

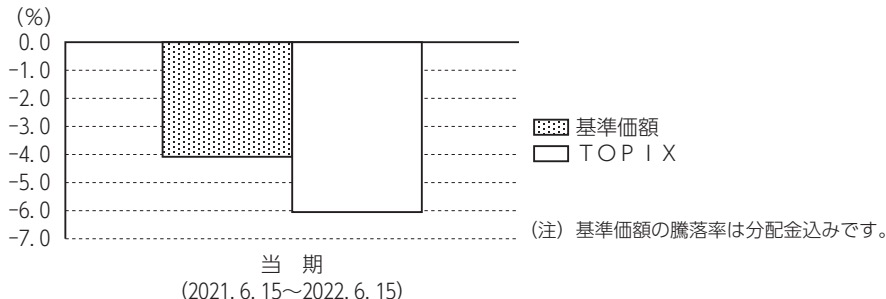
## ベンチマークとの差異について

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

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

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\* ベンチマークはTOPIXです。

## 分配金について

当作成期の1万口当り分配金(税込み)は下記「分配原資の内訳(1万口当り)」の「当期分配金(税込み)」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程(1万口当り)」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### 分配原資の内訳(1万口当り)

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
<b>当期分配金(税込み)</b>	<b>(円)</b>	<b>270</b>
対基準価額比率	(%)	2.13
当期の収益	(円)	270
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	2,399

(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。

### 収益分配金の計算過程(1万口当り)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 271.71円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	2,196.47
(d) 分配準備積立金	201.72
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	2,669.91
(f) 分配金	270.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	2,399.91

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 今後の運用方針

### 当ファンド

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

### トピックス・インデックス・マザーファンド

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



## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16~2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	45円	0. 341%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は13, 156円です。
(投 信 会 社)	(27)	(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)	(14)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	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)	
(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. 006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	46	0. 350	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

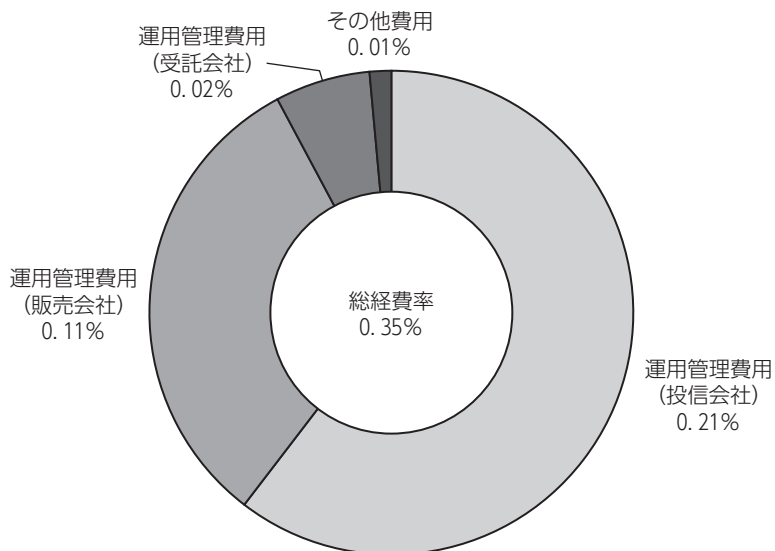
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

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



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数 千口	金 額 千円	□ 数 千口	金 額 千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	1,266,542	1,676,470	1,714,644	2,327,390

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	33,978,631千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	180,818,819千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.18	

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
株式	百万円 25,021	百万円 7,696	% 30.8	百万円 8,957	百万円 25	% 0.3
株式先物取引	37,760	11,043	29.2	38,793	10,311	26.6
コール・ローン	2,560,168	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合1.4%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	104千円
うち利害関係人への支払額 (B)	7千円
(B) / (A)	7.5%

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

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

■投信会社 (自社) による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首 保有額	当作成期中 設定額	当作成期中 解約額	当作成期末 保有額	取引の理由
百万円 1	百万円 —	百万円 —	百万円 1	当初設定時における取得

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■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	2,252,508	1,804,406	2,313,970

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	2,313,970	95.3
コール・ローン等、その他	113,839	4.7
投資信託財産総額	2,427,810	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,427,810,902円
コール・ローン等	4,309,981
トピックス・インデックス・マザーファンド (評価額)	2,313,970,921
未収入金	109,530,000
(B) 負債	162,992,256
未払収益分配金	49,314,933
未払解約金	109,495,807
未払信託報酬	4,115,216
その他未払費用	66,300
(C) 純資産総額 (A - B)	2,264,818,646
元本	1,826,479,001
次期繰越損益金	438,339,645
(D) 受益権総口数	1,826,479,001口
1万口当り基準価額 (C/D)	12,400円

\*期首における元本額は2,239,926,064円、当作成期間中における追加設定元本額は1,305,791,488円、同解約元本額は1,719,238,551円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は12,400円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 320円
受取利息	211
支払利息	△ 531
(B) 有価証券売買損益	△ 80,081,869
売買益	57,802,707
売買損	△ 137,884,576
(C) 信託報酬等	△ 9,280,300
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 89,362,489
(E) 前期繰越損益金	36,844,397
(F) 追加信託差損益金	540,172,670
(配当等相当額)	( 109,053,336)
(売買損益相当額)	( 431,119,334)
(G) 合計 (D + E + F)	487,654,578
(H) 収益分配金	△ 49,314,933
次期繰越損益金 (G + H)	438,339,645
追加信託差損益金	540,172,670
(配当等相当額)	( 109,053,336)
(売買損益相当額)	( 431,119,334)
分配準備積立金	37,157,504
繰越損益金	△ 138,990,529

(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	49,628,040円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	401,182,141
(d) 分配準備積立金	36,844,397
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	487,654,578
(f) 分配金	49,314,933
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	438,339,645
(h) 受益権総口数	1,826,479,001口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)	270円

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

《お知らせ》

■マザーファンドにおける主要投資対象について

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

変更前：東京証券取引所第一部上場株式

変更後：東京証券取引所上場株式

# トピックス・インデックス・マザーファンド

## <補足情報>

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

## トピックス・インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

株式

（2021年6月16日から2022年6月15日まで）

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ソフトバンク	526.3	806,304	1,532	ソフトバンクグループ	126.8	774,874	6,111
ソニーグループ	58.6	696,146	11,879	キーエンス	4.9	319,597	65,224
トヨタ自動車	249.4	668,951	2,682	日本電信電話	85.1	265,837	3,123
リクルートホールディングス	82.4	518,902	6,297	三菱UFJフィナンシャルG	398.6	252,598	633
三菱商事	138.2	501,089	3,625	トヨタ自動車	105.6	226,485	2,144
東京エレクトロン	9.1	498,988	54,833	信越化学	10	200,798	20,079
日本電信電話	138.6	493,471	3,560	KDDI	46.8	168,246	3,595
キーエンス	8.4	477,566	56,853	東京海上HD	17.6	124,273	7,060
日本郵政	424.3	379,922	895	新生銀行	54.7	108,089	1,976
日本電産	28.8	338,298	11,746	ダイキン工業	5.3	107,355	20,255

（注1）金額は受渡し代金。

（注2）金額の単位未満は切捨て。

## 組入資産明細表

下記は、2022年6月15日現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンド（144,235,597千口）の内容です。

### (1) 国内株式

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>			タマホーム	6.2	14,687	清水建設	207.1	148,283	戸田建設	92.2	65,001
極洋	3.4	11,203	サンヨーホームズ	0.8	578	飛島建設	5.9	5,894	熊谷組	11.6	31,262
日本水産	96.4	51,188	日本アークア	4.1	2,439	長谷工コーポレーション	65.2	101,646	北野建設	1.4	2,871
マルハニチロ	14.2	32,944	ファーストコーポレーション	2.1	1,518	松井建設	8.1	5,386	植木組	1.8	2,604
雪国まいたけ	7.4	6,393	ベステラ	2	2,256	銭高組	0.9	2,988	矢作建設	9.4	7,050
カネコ種苗	2.9	4,721	キャンディル	1	530	鹿島建設	163.3	234,825	ピーエス三菱	7.5	4,447
サカタのタネ	11.3	51,584	ダイセキ環境ソリューション	1.9	1,767	不動産トラ	5	7,780	日本ハウスHDGS	15.7	6,123
ホクト	7.9	15,010	第一カッター興業	2.3	2,973	大未建設	2.4	3,691	大東建託	24	264,480
ホクリョウ	1.5	951	安藤・間	47.6	39,127	鉄建建設	4.6	8,280	新日本建設	9.7	6,984
<b>鉱業 (0.4%)</b>			東急建設	27.9	17,074	西松建設	14.2	59,853	東亜道路	1.2	6,480
住石ホールディングス	17.5	3,255	コムシスホールディングス	32.7	80,343	三井住友建設	52.5	23,835	日本道路	2	13,000
日鉄鉱業	2.1	11,655	ピーエールホールディングス	12.8	3,942	大豊建設	3.4	15,113	東亜建設	5.4	12,873
三井松島HDGS	4.2	11,424	高松コンストラクショング	6.1	12,486	佐田建設	4.7	2,100	日本国土開発	19.4	9,874
I N P E X	363.9	604,801	東建コーポレーション	2.8	21,420	ナカノフード一建設	5.1	1,530	若築建設	3.6	7,671
石油資源開発	11.9	41,055	ソネック	1	1,016	奥村組	12.2	35,538	東洋建設	24.2	19,239
K&Oエナジーグループ	4.2	6,552	ヤマウラ	4.1	3,763	東鉄工業	9.8	22,236	五洋建設	88.6	55,818
<b>建設業 (2.2%)</b>			オリエンタル白石	33.6	8,030	イチケン	1.6	2,902	世紀東急	11.1	8,868
ショーボンドHD	12.7	77,216	大成建設	63.5	254,000	富士ビー・エス	2.7	1,255	福田組	2.5	11,050
ミライト・ホールディングス	32.7	52,908	大林組	223	212,073	浅沼組	2.6	13,728	住友林業	54.2	105,961

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
日本基礎技術	5.8	3,300	山崎製パン	49.2	72,914	日本たばこ産業	401.2	954,856	中越パルプ	2.4	2,150
巴コーポレーション	8.7	3,497	第一屋製パン	1.6	808	ケンコーマヨネーズ	4	5,584	巴川製紙	2.7	1,638
大和ハウス	195.5	594,515	モロゾフ	2.3	7,785	ならべや日洋HD	4.6	7,820	大王製紙	32.5	44,720
ライト工業	13.3	23,793	亀田製菓	4	17,940	なとり	4.4	8,637	阿波製紙	1	308
積水ハウス	232.7	542,889	寿スピリッツ	6.7	47,704	イフジ産業	1.5	1,434	レンゴウ	61	43,310
日特建設	4.6	3,592	カルビー	34	81,294	ビックルコーポレーション	3.6	4,672	トーモク	3.8	5,692
北陸電気工事	4.2	3,120	森永乳業	13	56,355	ファーマフーズ	9.4	13,940	ザ・バック	5	10,745
ユアテック	13.2	9,266	六甲バター	5.2	7,228	ユーグレナ	38.3	32,861	<b>化学 (6.4%)</b>		
日本リーテック	4.5	4,639	ヤクルト	50.1	368,736	紀文食品	5.8	5,394	北の達人コーポ	26.7	5,340
四電工	2.2	3,700	明治ホールディングス	43.5	270,135	ミヨシ油脂	2.8	2,900	クラレ	101.1	113,434
中電工	9.8	20,354	雪印メグミルク	16.8	28,308	理研ビタミン	6.7	10,653	旭化成	462.5	488,862
関電工	38	30,970	プリマハム	9.4	19,740	<b>繊維製品 (0.5%)</b>			共和レザー	3.6	2,070
きんでん	49.2	74,095	日本ハム	27	108,810	片倉工業	7	14,413	昭和電工	63.9	164,670
東京エネシス	7.1	6,766	林兼産業	2.7	1,312	グンゼ	4.5	16,357	住友化学	510.8	283,494
トーエネック	2.3	7,394	丸大食品	7	10,367	東洋紡	29.6	30,192	住友精化	3	8,856
住友電設	5.7	14,147	S Foods	6.7	20,167	ユニチカ	21.2	4,876	日産化学	35.3	236,863
日本電設工業	10.9	17,276	柿安本店	2.4	5,632	富士紡ホールディングス	3.1	10,292	ラサ工業	2.6	5,023
エクシオグループ	33.6	70,257	伊藤ハム米久HLDGS	47.9	31,709	倉敷紡績	5.7	11,331	クレハ	5.4	56,646
新日本空調	5.4	9,828	サッポロホールディングス	23.1	63,848	シキボウ	3.3	2,910	多木化学	2.5	11,325
九電工	15.9	42,421	アサヒグループホールディング	160.4	677,369	日本毛織	19.3	18,277	テイカ	4.6	5,570
三機工業	15.2	22,404	キリンHD	275	559,075	ダイトウボウ	10	900	石原産業	12.6	13,973
日揮ホールディングス	68.1	127,551	宝ホールディングス	44.7	42,465	トーア紡コーポレーション	2.1	781	片倉コープアグリ	1.8	2,547
中外炉工業	2.1	3,559	オエノンホールディングス	20.8	6,052	グایدローリミテッド	7.7	1,039	日本曹達	8.4	36,666
ヤマト	5.7	4,235	養命酒	2.3	3,979	帝国繊維	7.7	11,873	東ソー	95.3	170,301
太平電業	4.5	12,244	コカ・コーラボトラーズHD	49.2	70,011	帝人	65.9	91,205	トクヤマ	22.3	40,429
高砂熱学	19	30,305	サントリー食品インター	50	233,000	東レ	477.7	336,396	セントラル硝子	11.2	33,992
三晃金属	0.8	2,056	グایدグループHD	3.8	18,506	住江織物	1.2	1,981	東亜合成	36.7	37,837
朝日工業社	3	4,725	伊藤園	22.7	117,132	日本フェルト	4.4	1,826	大阪ソーダ	5.9	18,526
明星工業	12.4	9,039	キーコーヒー	6.9	14,200	イチカワ	0.7	964	関東電化	14.1	12,929
大気社	10.3	31,672	ユニカフェ	2.4	2,176	日東製網	0.7	929	デンカ	25.3	83,996
ダイダイン	4.7	9,635	ジャパンフーズ	1.1	1,284	アツギ	5.1	2,529	信越化学	118.9	2,056,970
日比谷総合設備	6.6	12,447	日清オリオグループ	8.8	26,215	ダイニック	2.3	1,522	日本カーバイド	2.5	3,495
フィル・カンパニー	1.3	1,450	不二製油グループ	16.1	30,058	セーレン	14	26,698	堺化学	4.9	9,427
テスホールディングス	6.5	7,774	かどや製油	0.8	2,760	ソトー	2.5	2,082	第一稀元素化学工	6.4	7,142
インフロンニアHD	90.7	82,537	J-オイルミルズ	7.2	10,821	東海染工	0.5	571	エア・ウォーター	61.9	105,044
東洋エンジニア	9.8	6,076	キックーマン	47.9	318,535	小松マテーレ	11.2	14,100	日本酸素HLDGS	63.4	153,745
レイズネクスト	10.4	11,648	味の素	153.3	466,645	ワコールホールディングス	16.2	33,906	日本化学工業	2.1	4,391
<b>食料品 (3.3%)</b>			ブルドックソース	2.8	5,056	ホギメディカル	9.4	26,752	東邦アセチレン	1.6	1,836
ニッポン	19.4	30,244	キューピー	34.8	74,576	クラウドディアHLDGS	1.6	380	日本パーカラライジング	32.6	29,177
日清製粉G本社	75.1	112,574	ハウス食品G本社	24.8	67,034	T S Iホールディングス	22.9	8,015	高圧ガス	11	7,128
日東富士製粉	1.2	5,058	カゴメ	28.3	91,267	マツオココーポレーション	2	1,948	チタン工業	0.9	1,521
昭和産業	6.4	15,443	焼津水産化工	3.4	3,066	ワールド	9.5	12,027	四国化成	8.7	10,779
鳥越製粉	6.1	3,843	アリアケジャパン	6.8	35,360	三陽商会	3.2	2,700	戸田工業	1.5	3,825
中部飼料	8.1	8,010	ピエトロ	1.1	1,983	ナイガイ	2.3	664	ステラケミファ	3.6	9,068
フィード・ワン	9.4	6,110	エバラ食品工業	1.7	5,015	オンワードホールディングス	41.4	10,225	保土谷化学	2.1	8,085
東洋精糖	1.5	1,425	やまみ	0.7	1,083	ルックホールディングス	2.3	3,514	日本触媒	10.9	58,097
日本甜菜糖	4	6,544	ニチレイ	30	66,450	ゴールドウイン	12.4	96,596	大日精化	5.4	9,736
DM三井製糖ホールディ	6.3	11,718	東洋水産	34.2	165,015	デサント	13.1	36,287	カナカ	16.7	56,696
塩水港精糖	9.3	1,934	イートアンドHLDGS	2.8	6,249	キング	3.3	1,768	三菱瓦斯化学	60.9	127,707
日新製糖	9.8	6,551	大冷	0.9	1,706	ヤマインターナショナル	5.2	1,461	三井化学	60	189,000
森永製菓	15.8	60,593	ヨシムラ・フード・HLDGS	3.9	1,992	<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>			J S R	68	250,240
中村屋	1.6	4,880	日清食品HD	25.7	216,651	特種東海製紙	4	12,320	東京応化工業	11.2	78,288
江崎グリコ	18.4	65,596	永谷園ホールディングス	3.4	6,630	王子ホールディングス	289.8	163,157	大阪有機化学	5.5	13,090
名糖産業	3	4,824	一正蒲鉾	3.1	2,480	日本製紙	31.6	29,893	三菱ケミカルHLDGS	464.6	372,516
井村屋グループ	3.9	8,595	フジッコ	7.1	13,575	三菱製紙	8.1	2,405	K Hネオケム	11.4	28,967
不二家	4.4	9,966	ロックフィールド	7.6	10,381	北越コーポレーション	44.9	30,487	ダイセル	99.2	87,395



## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
住友ベークライト	10.7	48,471	コタ	5.3	7,600	小野薬品	151.7	490,597	住友大阪セメント	12.6	45,171
積水化学	145.4	265,936	シーボン	1	1,682	久光製薬	17.1	56,686	太平洋セメント	42.4	87,301
日本ゼオン	58	79,634	ポーラ・オルビスHD	31.8	48,081	持田製薬	8.6	26,359	日本ヒューム	6	3,966
アイカ工業	18.2	50,960	ノエビアホールディングス	5.7	31,236	参天製薬	133	130,074	日本コンクリート	13.3	3,737
UBE	34.4	71,827	アジupanホールディング	1.8	1,717	扶桑薬品	2.5	5,307	三谷セキサン	3.2	13,840
積水樹脂	10.3	17,252	新日本製薬	3	4,044	日本ケミファ	0.9	1,700	アジアパイルHD	9.8	4,380
タキロンシーアイ	17.2	9,150	エステー	4.9	7,105	ツムラ	21.9	62,020	東海カーボン	59.1	68,733
旭有機材	4.5	9,468	アグロカネシヨウ	2.5	3,097	日医工	21.8	7,651	日本カーボン	3.8	16,093
ニチパン	4.1	6,564	コニシ	12.2	18,641	キッセイ薬品工業	11.5	27,600	東洋炭素	4.9	13,249
リケンテクノス	16.1	6,858	長谷川香料	12.7	30,543	生化学工業	13	10,270	ノリタケ	3.9	16,146
大倉工業	3.2	5,488	星光PMC	4.4	2,446	栄研化学	11.7	18,989	TOTO	47.9	204,293
積水化成成品	14.7	5,982	小林製薬	20.9	166,573	日本製薬	2.9	4,959	日本碍子	76	143,944
群栄化学	1.6	4,179	荒川化学工業	5.6	5,577	鳥屋薬品	4	11,416	日本特殊陶業	53.5	137,548
タイガース ポリマー	7.5	3,225	メック	5.2	12,838	JCRファーマ	21	47,418	ダントホールディングス	4.8	1,238
ミライアル	2.3	4,218	日本高純度化学	1.9	4,377	東和薬品	10.7	23,968	MARUWA	2.6	38,740
ダイキアグクス	2.7	1,979	タカラバイオ	19.5	36,016	富士製薬工業	4.3	3,999	品川リファクトリーズ	1.7	5,992
ダイキョーニシカフ	17.3	8,598	JCU	7.8	26,481	ゼリア新薬工業	11.8	24,319	黒崎播磨	1.2	5,070
竹本容器	2.5	1,995	新田ゼラチン	4.3	2,588	第一三共	555.8	1,712,419	ヨータイ	4.6	6,380
森六ホールディングス	3.6	6,386	OATアグリオ	3	5,004	キョーリン製薬HD	13.9	23,296	東京窯業	6.7	1,822
恵和	2	8,010	デクセリアルズ	19.4	78,667	大幸薬品	11.2	6,384	ニッカトー	2.8	1,327
日本化薬	52.4	58,321	アース製薬	6.1	30,439	ダイト	4.7	12,596	フジミニューボレーテッド	6	33,960
カーリットホールディングス	6.2	4,395	北興化学	6.5	6,688	大塚ホールディングス	146.3	630,699	クニミネ工業	2	1,826
日本精化	5.1	10,200	大成ラミック	2	5,218	大正製薬HD	15.1	73,914	エーアンドエーマテリアル	0.5	431
扶桑化学工業	6	21,720	クミアイ化学	27.5	31,570	ペプチドリーム	39.2	51,665	ニチアス	16.3	37,424
トリケミカル	7.5	18,262	日本農業	13.2	9,688	あずか製薬HD	7.5	7,237	ニチハ	9.8	24,421
ADEKA	30.4	76,273	アキレス	5.2	6,983	サワイグループHD	14.9	56,918	<b>鉄鋼 (0.8%)</b>		
日油	22.3	111,054	有沢製作所	10.2	11,056	<b>石油・石化製品 (0.6%)</b>			日本製鉄	315.4	635,531
新日本理化	10.9	2,703	日東電工	44.9	422,060	日本コークス工業	62.7	7,837	神戸製鋼所	131.7	86,658
ハリマ化成グループ	5	3,775	レック	9.1	6,124	ニチレキ	8.5	11,075	中山製鋼所	10.4	4,357
花王	157.6	803,760	三光合成	9.8	3,273	ユシロ化学	3.5	3,377	合同製鐵	3.6	4,719
第一工業製薬	2.6	5,525	きもと	10.9	2,430	富士・カストロール	2.6	3,094	JFEホールディングス	180.3	272,613
石原ケミカル	3.6	4,672	藤森工業	6.1	21,350	宝士石油	17.4	5,689	東京製鐵	22.7	34,708
日華化学	2.5	2,170	前澤化成工業	4.3	5,538	MORESCO	2.6	3,190	共英製鋼	7.5	9,757
ニイタカ	1.4	2,968	未来工業	2.7	3,998	出光興産	78.2	277,610	大和工業	12.5	55,125
三洋化成	4.3	20,124	ウェーブロックHLDGS	3.1	2,011	ENEOSホールディングス	1,122	604,421	東京製鋼	2.9	3,509
有機合成薬品	5.2	1,409	ジェイ・エス・ピー	4.2	5,871	コスモエネルギーHLDGS	26.8	101,572	大阪製鐵	3.8	5,399
大日本塗料	8.4	6,174	エフピコ	13.6	35,400	<b>ゴム製品 (0.7%)</b>			淀川製鋼所	8.6	18,997
日本ペイントHOLD	274.3	251,807	天馬	6.3	14,779	横浜ゴム	37.9	65,263	丸一鋼管	22	63,800
関西ペイント	67.3	118,919	信越ポリマー	13.2	14,902	TOYO TIRE	36.8	62,928	モリ工業	1.9	4,582
神東塗料	6.8	1,033	東リ	16.5	3,399	ブリヂストン	203.8	1,032,247	大同特殊鋼	10.6	37,259
中国塗料	16.2	13,818	ニフコ	24.7	76,199	住友化学	62.9	74,851	日本高周波	2	676
日本特殊塗料	4.6	4,443	バルカー	6.7	18,317	藤倉コンポジット	6.5	5,505	日本冶金工	5.1	10,883
藤倉化成	8.7	4,123	ユニ・チャーム	143.7	600,809	オカモト	4.3	16,318	山陽特殊製鋼	6.7	13,400
太陽ホールディングス	10.6	31,291	ショーエイコーポ	2.7	1,544	フコク	2.9	2,746	愛知製鋼	4.1	8,355
DIC	27.8	69,639	<b>医薬品 (5.1%)</b>			ニッタ	8	22,760	日立金属	71.5	142,285
サカタインクス	14.3	12,769	協和キリン	79.2	223,502	住友理工	16.2	9,282	日本金属	1.8	1,987
東洋インキSCホールディン	14.2	27,590	武田薬品	585.9	2,071,156	三ツ星ベルト	9.2	25,668	大太平洋金属	4.5	11,871
T&K TOKA	5.9	4,702	アステラス製薬	637.3	1,271,413	バンドー化学	13.9	12,690	新日本電工	42.9	15,315
富士フィルムHLDGS	131	906,389	住友ファーマ	46.1	48,036	<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>			栗本鉄工所	2.9	4,689
資生堂	138.9	707,139	塩野義製薬	88.9	577,227	日東紡績	9.8	23,941	虹技	0.7	679
ライオン	79	110,126	わかもも製薬	7.7	1,963	AGC	65	326,950	日本鋳鉄管	0.8	800
高砂香料	4.5	10,651	日本新薬	17.3	125,252	日本板硝子	34.5	13,351	三菱製鋼	4.7	4,469
マンダム	14.8	21,193	中外製薬	233.2	788,216	石塚硝子	1.4	2,312	日亜鋼業	7.6	1,945
ミルボン	9.2	45,356	科研製薬	10.9	40,493	日本山村硝子	1.9	1,320	日本精線	1.2	4,998
ファンケル	30.2	66,832	エーザイ	84.7	430,614	日本電気硝子	28.4	78,582	エンビプロHD	4.9	4,223
コーセー	14	159,600	ロート製薬	36.4	125,944	オハラ	2.9	3,445	シンニッタン	14.8	3,285



銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
新家工業	1.5	2,190	ジーテクト	8.3	10,624	三井海洋開発	7.8	9,438	フジテック	24.2	65,001
<b>非鉄金属 (0.8%)</b>			東プレ	12	12,384	レオン自動機	8	9,744	C K D	20	36,280
大紀アルミニウム	9.8	12,083	高周波熱錬	12.1	8,058	S M C	21.7	1,317,841	キトー	5.8	15,167
日本軽金属HD	18.7	28,536	東京製綱	4.5	4,005	ホンカワミクロン	5.2	13,462	平和	20.7	39,640
三井金属	19.9	65,073	サンコール	6	3,738	ユニオンツール	3	10,575	理想科学工業	6	13,380
東邦亜鉛	3.9	8,927	モリテックスチル	5.8	1,670	オイレシ工業	11.3	17,390	S A N K Y O	16.1	66,010
三菱マテリアル	44.7	88,371	パイオラックス	9.8	19,090	日精工エスビー	2.8	9,492	日本金銭機械	7.4	4,861
住友鉱山	85.3	417,372	エイチワン	6.3	3,717	サトールホールディングス	9.7	18,439	マースグループHLDGS	4.7	7,971
DOWAホールディングス	18.2	82,901	日本発条	63.3	59,185	技研製作所	6.5	20,540	フクシマガリレイ	4.8	15,576
古河機金	11.1	13,519	中央発條	4.7	3,214	日本エアージェット	3.7	3,718	オーイズミ	2.8	1,136
エス・サイエンス	33.3	932	アドパネクス	1.2	1,560	カワタ	2.6	2,633	ダイコク電機	3.4	4,069
大阪チタニウム	8.5	21,335	立川プラインド	2.9	3,053	日精樹脂工業	5.4	4,822	竹内製作所	11.4	27,485
東邦チタニウム	13.2	32,604	三益半導体	5.7	13,195	オカダアイオン	2.2	3,216	アマノ	19.5	47,385
U A C J	10.5	22,407	<b>機械 (5.4%)</b>			ワイエイシイホールディングス	2.9	4,787	J U K I	10.4	7,332
C K サンエツ	1.4	5,425	日本ドライケミカル	2.1	3,200	小松製作所	337.7	1,115,085	サンデン	10	2,190
古河電工	22	49,104	日本製鋼所	19.8	61,083	住友重機械	40.1	126,315	ジャノメ	6.1	4,196
住友電工	263.3	382,706	三浦工業	29.8	78,463	マックス	29.9	99,118	マックス	9.8	15,670
フジクラ	82.3	66,251	タクマ	22.1	30,188	日工	8.7	5,237	グローリー	18.1	36,743
昭和電線 HLDGS	6.4	10,937	ツガミ	15.7	17,992	巴工業	3.2	7,264	新晃工業	6.9	11,122
東京特殊電線	0.9	2,070	オクマ	7.7	41,426	井関農機	6.1	7,423	大和冷機工業	10.6	10,939
タツタ電線	12.7	6,019	芝浦機械	8.3	23,513	T O W A	6.4	11,289	セガサミホールディングス	73.9	159,697
カナレ電気	1.1	1,772	アマダ	115.5	120,004	丸山製作所	1.3	1,990	日本ピストンリング	2.4	3,084
平河ヒューテック	3.8	4,107	アイダエンジニア	17.9	16,163	丸山鉄工所	2.9	4,210	リケン	2.8	6,524
リョービ	7.7	8,162	滝澤鉄工所	2.7	3,221	ローツェ	3.7	34,817	T P R	8.8	10,824
アールステイ	7.4	2,708	F U J I	30.7	63,180	タカキタ	2.3	1,225	ツバキ・ナカシマ	16.4	15,826
アサヒHD	29.5	59,914	牧野フライス	7.7	34,226	クボタ	361.2	797,710	ホシガキ	21.8	168,296
<b>金属製品 (0.6%)</b>			オーエスジー	32.7	52,516	荏原実業	3.4	7,731	大豊工業	5.8	4,048
稲葉製作所	3.8	5,126	ダイジェット	1.3	1,193	三菱化工機	2.2	4,501	日本精工	130.5	99,571
富地エンジニアリング	2.1	6,919	旭ダイヤモンド	19.3	11,560	月島機械	12.4	11,122	N T N	146.7	41,076
トーカコ	19.3	24,530	DMG森精機	41.4	76,258	帝国電機製作所	5.1	7,971	ジェイテクト	66.3	70,145
アルファCO	2.3	2,194	ソディック	17.1	13,816	東京機械	3.1	2,697	不二越	5.9	21,476
S U M C O	118.9	240,296	テック	10.9	347,165	新東工業	16.5	11,220	日本トムソン	19.3	10,151
川田テクノロジーズ	1.3	4,550	日東工器	4.6	6,895	渋谷工業	6.4	14,400	T H K	41.6	110,406
RS TECHNOLOGIES	2.4	14,424	日進工具	6.1	7,576	アイチコーポレーション	10.1	8,564	ユーション精機	7.3	5,037
ジテックコーポレーション	1	1,967	パンチ工業	6.9	3,180	小森コーポレーション	18.5	14,707	前澤給装工業	5	4,350
信和	4.5	3,510	富士ダイス	5.3	3,439	鶴見製作所	5.9	10,743	イーグル工業	8.3	7,976
東洋製罐グループHD	40.7	55,677	豊和工業	4.7	4,582	住友精密	1	2,813	前澤工業	4.9	2,905
ホッカンホールディングス	5	6,040	O K K	2.8	2,844	日本ギア工業	8.7	2,340	日本ビラー工業	6.9	18,885
コロナ	3.6	2,952	石川製作所	2.2	3,828	酒井重工業	1.2	3,507	キッツ	24.9	16,832
横河ブリッジHLDGS	11.3	22,204	東洋機械金属	5.5	3,168	石原製作所	29.6	161,616	マキタ	85.7	297,121
駒井ハルテック	1.2	2,024	津田駒工業	2	1,118	石井鉄工所	0.7	1,971	三井E&SHD	21.7	7,768
高田機工	0.5	1,238	エンシュウ	2	1,728	西島製作所	6.8	9,282	日立造船	59.9	50,855
三和ホールディングス	69.7	86,985	島精機製作所	10.8	22,507	北越工業	6.2	5,046	三菱重工業	111.9	584,677
文化シヤッター	22.1	21,459	オプトラン	9.2	18,078	ダイキン工業	86	1,710,110	I H I	46.4	181,888
三協立山	9.5	5,500	NCホールディングス	2	3,736	オルガン	2.1	20,412	サノヤホールディングス	6	762
アルインコ	4.7	3,952	イワキポンプ	5.2	4,778	トヨーカネツ	2.6	6,952	スター精密	10.7	18,318
東洋シヤッター	1.6	993	フリュー	6.6	7,015	栗田工業	38.6	194,158	<b>電気機器 (17.7%)</b>		
L I X I L	116.1	294,081	ヤマシンフィルタ	13.9	4,378	椿本チエイン	10.3	32,445	日清紡ホールディングス	42.6	45,326
日本フィルコン	7.1	3,514	日阪製作所	10	8,450	大同工業	3.4	2,760	イビデン	37	151,885
ノーリツ	12.6	18,547	やまびこ	12.9	15,131	木村化工機	5.9	3,970	コニカミノルタ	155	71,300
長府製作所	7.3	12,702	野村マイクロ・サイエンス	2.5	9,500	アナスト岩田	12.3	10,664	プラザー工業	86.3	205,221
リンナイ	13.2	118,536	平田機工	3.3	13,530	ダイフク	37.1	281,218	ミネベアミツミ	121.9	282,076
ダイニチ工業	3.5	2,170	ペガサスミシン製造	7.8	4,594	サムコ	1.9	4,810	日立	358.6	2,393,655
日東精工	9.8	4,733	マルメシ	3	5,685	加藤製作所	3.1	2,507	東芝	130.3	713,392
三洋工業	0.9	1,532	タツモ	3.3	3,857	油研工業	1.6	2,795	三菱電機	712.6	1,001,559
岡部	11.6	7,203	ナプテスコ	39.7	123,864	タダノ	36.9	35,313	富士電機	42.7	246,806

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
東洋電機製造	2.1	1,879	アンリツ	47.6	69,876	岡谷電機	4	1,028	エフテック	4.8	2,601
安川電機	75.5	323,895	富士通ゼネラル	20.2	48,379	ヘリオステクノH	9	2,655	レシップホールディングス	2.3	1,251
シンフォニアテクノロジー	7.7	10,572	ソニーグループ	467.5	190,705	エノモト	2	3,142	GMB	1.2	840
明電舎	11.3	22,419	T D K	108	473,580	日本セラミック	6.9	13,938	ファルテック	1	603
オリジソ	1.6	1,944	帝国通信工業	3.2	4,272	遠藤照明	3.3	2,461	武蔵精密工業	16.7	22,327
山洋電気	2.9	15,225	タムラ製作所	27.4	15,316	古河電池	5.3	6,428	日産車体	10.5	6,111
デンヨー	5.5	8,497	アルプスアルパイン	62.6	91,208	双葉電機	3.4	1,887	新明和工業	20.4	22,705
PHCホールディングス	11.4	14,797	池上通信機	2.4	1,428	山一電機	5	9,345	極東開発工業	12.5	17,937
東芝テック	8	32,160	日本電波工業	7.4	8,317	図研	4.8	13,473	トビー工業	5.6	7,240
芝浦メカトロニクス	1.3	14,365	鈴木	3.4	2,726	日本電子	14.7	84,084	ティラド	1.9	5,179
マブチモーター	17.1	61,303	メイコー	8.1	31,387	カシオ	48.1	60,125	タチエス	12.4	13,776
日本電産	174.8	1,440,876	日本トリム	1.4	3,409	ファナック	65.4	1,310,616	NOK	30.7	36,011
ユーエムシーエレクトロニクス	2.7	1,225	ローランドディー・ジー	4.3	14,147	日本シイエムケイ	13.5	6,183	フタバ産業	17.1	6,549
トリス・セミコンダクター	3.4	9,625	フオスター電機	6.8	5,032	エンプレス	1.8	6,048	K Y B	7	20,944
東光高岳	4.1	6,965	S M K	1.5	3,136	大真空	9.5	9,367	大同メタル工業	13	6,734
ダブル・スコープ	21.5	31,024	ヨコオ	5.1	11,148	ローム	31.8	317,046	プレクス工業	33.4	14,028
ダイベル	7.3	30,733	ティアック	10.9	1,286	浜松ホトニクス	50.9	292,675	ミクニ	8.7	3,001
ヤーマン	12.1	16,927	ホシデン	16.9	20,651	三井ハイテック	6.7	62,980	太平洋工業	14.7	15,096
J V Cケンウッド	60.5	10,769	ヒロセ電機	10.9	192,385	新光電気工業	21.9	92,527	河西工業	8.5	2,337
ミマキエンジニアリング	6.5	3,380	日本航空電子	15.6	33,056	京セラ	104.9	754,860	アイシン	54.6	232,323
I P E X	3.4	4,562	T O A	7.6	5,776	太陽誘電	34.2	176,472	マツダ	224.4	248,410
日新電機	17.5	26,880	マクセル	13.9	18,250	村田製作所	208.6	1,679,230	今仙電機製作所	4.3	2,511
大崎電気	12.4	6,051	古野電気	8.8	9,090	双葉電子工業	12.3	7,982	本田技研	559.1	1,847,825
オムロン	61.8	413,998	ユニテホールディングス	1.6	6,160	北陸電気工業	2.6	2,893	スズキ	155.4	627,039
日東工業	9.3	21,129	スミダコーポレーション	6.9	5,582	ニチコン	21	28,623	SUBARU	201.8	493,905
I D E C	9.2	24,315	アイコム	2.5	6,047	日本ケミコン	7	12,656	安永	3	2,094
正興電機製作所	2.1	2,270	リオン	2.7	6,752	K O A	10.6	17,490	ヤマハ発動機	97.4	251,292
不二電機工業	0.7	781	本多通信工業	5	2,615	小光工業	8.8	3,238	T B K	6	2,040
ジエス・コアサコ	23.1	48,810	横河電機	70.2	158,441	市糸製作所	38.5	174,597	エクセディ	11.2	19,588
サクサホールディングス	1.7	2,352	新元元工業	2.7	8,910	ミツバ	12.2	4,721	豊田合成	22.1	46,211
メルコホールディングス	1.9	6,403	アズビル	43.7	150,765	SCREENホールディングス	12.2	127,368	愛三工業	11.6	8,178
テクノメディア	2	3,050	東亜ディーケーケー	4.3	3,560	キャノン電子	6.6	10,078	盟和産業	0.6	605
ダイヤモンドエレクトロニクスHD	2.1	2,543	日本光電工業	29.2	85,176	キャノン	370.3	1,203,845	日本ブラスト	5.1	2,300
日本電気	90.6	462,966	チノー	2.5	4,025	リコー	187.2	206,668	ヨロズ	6	5,226
富士通	67.1	1,147,410	共和電業	8.7	2,766	象印マホービン	19	26,866	エフ・シー・シー	12.1	16,504
沖電気	28.9	22,888	日本電子材料	3.6	6,681	MUTOHホールディングス	0.8	1,644	シマノ	28.4	598,530
岩崎通信機	3.2	2,601	堀場製作所	13.1	83,840	東京エレクトロン	47.3	2,412,300	ティ・エス テック	31.5	43,879
電気興業	3.9	9,726	アドバンテスト	55.4	428,242	<b>輸送用機器 (8.2%)</b>			ジャムコ	4.3	5,276
サンケン電気	6.6	32,637	小野測器	3.6	1,580	トヨタ紡織	27.6	56,883	<b>精密機器 (2.6%)</b>		
ナカヨ	1.4	1,517	エスベック	5.9	10,519	芦森工業	1.5	1,534	テルモ	210.8	806,731
アイホン	3.6	6,138	キーエンス	67.5	3,121,875	ユニプレス	11.8	10,773	クリエートメディック	3	2,934
ルネサスエレクトロニクス	405.2	542,968	日置電機	3.5	23,100	豊田自動織機	55.3	454,566	日機装	20.1	17,185
セイコーエプソン	86.3	187,098	シスメックス	56.6	437,178	モリタホールディングス	11.7	14,917	日本エム・ディ・エム	4.5	6,777
ワコム	57.9	48,462	日本マイクロニクス	11.8	16,307	三桜工業	10.4	6,708	島津製作所	91.2	405,384
アルバック	14.7	74,235	メガチップス	6.6	20,130	デンソー	152	1,147,296	J M S	6.3	3,565
アクセル	2.8	2,282	OBARA GROUP	3.4	9,802	東海理化電機	19.6	28,263	クボテック	2.2	580
E I Z O	5.4	20,493	藤澤電機	0.8	1,152	川崎重工業	51.8	146,645	長野計器	5.2	5,954
ジャパンディスプレイ	61.7	3,948	原田工業	3.1	2,821	名村造船所	20.1	8,220	ブイ・テクノロジー	3.3	9,256
日本信号	16.6	15,006	コーセル	7.9	6,406	日本車輛	2.3	4,671	東京計器	5.1	7,058
京三製作所	14.4	6,076	イリソ電子工業	6.3	20,601	三菱ロジスネクスト	9.8	7,840	愛知時計	2.8	3,959
能美防災	8.9	14,969	オプテックスグループ	12.2	23,655	近畿車輛	0.8	900	インターアクション	3.8	7,212
ホーチキ	4.6	5,699	千代田インテグレ	2.8	5,404	日産自動車	879.6	469,354	オーバル	7.3	2,255
星和電機	3.2	1,494	レーザーテック	31.3	535,230	いすゞ自動車	222	348,762	東京精密	11.9	55,930
エレコム	17	25,789	スタンレー電気	49.5	110,385	トヨタ自動車	3,524.4	7,330,752	マニー	27.7	37,561
パナソニックホールディング	795.2	879,093	岩崎電気	2.4	6,211	日野自動車	93.3	64,563	ニコン	107.9	180,085
シャープ	75.6	77,565	ウシオ電機	36.2	59,947	三菱自動車工業	276.1	121,207	トプコン	34.9	64,460

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
オリンパス	370.7	1,002,743	兼松サステック	0.5	793	南海電鉄	30.1	76,634	近鉄エクスプレス	12.8	53,376
理研計器	5.2	19,500	キングジム	5.8	5,295	京阪ホールディングス	28.9	91,902	東海運	3.4	992
タムロン	5.3	13,006	リントック	15.8	37,793	神戸電鉄	2	6,410	エーアイテー	4.4	6,221
H O Y A	143.9	1,757,738	イトーキ	13.2	5,029	名古屋鉄道	71.3	149,230	内外トランスライン	2.7	5,100
シード	4.3	2,102	任天堂	42.1	2,366,441	山陽電鉄	5	10,470	日本コンセプト	2.2	3,146
ノーリツ鋼機	6.7	15,611	三菱鉛筆	10.7	14,744	アルプス物流	4.8	5,241	<b>情報・通信業 (8.8%)</b>		
A&Dホールディングス	8.4	8,022	タカラスタンダード	13.1	16,427	ヤマトホールディングス	99	205,821	NEC ネットエスアイ	24.3	43,958
朝日インテック	81.5	145,070	コクヨ	33.7	55,065	山九	17.7	67,879	クロスキャスト	3.8	3,727
シチズン時計	77.6	43,456	ナカバヤシ	6.3	3,093	丸連	3.1	737	システナ	104.6	43,095
リズム	2.3	4,020	グローブライド	5.9	12,502	丸全昭和運輸	5.1	14,988	デジタルアーツ	3.9	22,074
大研医器	7.2	3,556	オカムラ	22.5	24,862	センコグループHLDGS	33.8	28,290	日鉄ソリューションズ	12	42,360
メニコン	23.6	63,366	美津濃	6.5	14,384	トナミホールディングス	1.4	4,767	キューブシステム	3.6	3,222
シンシア	1	416	<b>電気・ガス業 (1.3%)</b>			ニッコンホールディングス	22.7	46,194	WOW WORLD	1	1,021
松風	2.8	4,592	東京電力HD	558.1	274,585	日石輸送	0.7	1,764	コア	3	4,185
セイコーHD	10.5	29,106	中部電力	216.5	271,707	福山通運	9.9	30,442	手間いらず	1.1	5,478
ニプロ	52.6	53,441	関西電力	267.9	335,946	セイノーホールディングス	41.7	43,034	ラクーンホールディングス	6.2	9,758
<b>その他製品 (2.4%)</b>			中国電力	110.4	91,852	エスライン	1.8	1,526	ソリトンシステムズ	3.7	4,480
中本パックス	2.1	3,286	北陸電力	64.5	32,185	神奈川中央交通	2	6,740	ソフトクリエイトHD	3.2	12,032
スノーピーク	9.7	23,377	東北電力	167	117,067	日立物流	13.3	113,715	T I S	65.9	209,232
パラマウントベッドHD	14.3	28,242	四国電力	63.5	46,926	丸和運輸機関	12.9	18,266	JNSホールディングス	3.1	1,326
トランザクション	4.6	4,972	九州電力	146.4	121,512	C&Fロジホールディングス	6.3	6,300	グリー	33.2	27,224
粧美堂	2.4	945	北海道電力	64.4	29,559	九州旅客鉄道	49.7	130,959	GMOペパボ	0.8	1,596
ニホンフラッシュ	5.9	5,764	沖縄電力	15.7	19,154	SGホールディングス	123.6	273,032	コーエーテックモHD	23.3	98,093
前田工織	7.4	19,291	電源開発	57.8	119,010	NIPPON EXPRESS	22.1	168,181	三菱総合研究所	3.4	13,991
永大産業	7.9	2,133	エフオン	4.5	2,457	<b>海運業 (0.7%)</b>			ボルテージ	2	696
アートネイチャー	6.1	4,361	イーレックス	10.1	20,563	日本郵船	59.1	572,088	電算	0.6	1,342
バンダイナムコHLDGS	63.4	590,000	レノバ	14.6	29,346	商船三井	111.7	357,998	AGS	2.8	2,060
アイフィスジャパン	2.1	1,428	東京瓦斯	136.1	355,901	川崎汽船	21.8	200,560	ファインデックス	6.1	3,782
共立印刷	10.9	1,667	大阪瓦斯	128.6	311,212	NS ユナイテッド海運	3.5	13,720	ブレインパッド	6.2	6,429
S H O E I	6.7	33,634	東邦瓦斯	30.9	94,245	明治海運	7.2	10,576	K L a b	12.8	6,156
フランスベッドHLDGS	9.3	8,277	北海道瓦斯	3.6	5,734	飯野海運	29.5	22,361	ポルトクワインホールディン	10.5	9,786
パロットコーポレーション	11.3	56,952	広島ガス	13	4,069	共栄タンカー	1.2	1,201	ネクソン	166.2	487,298
萩原工業	4.8	5,251	西部ガスHLDGS	7.5	13,702	乾汽船	4.4	7,801	アイススタイル	18.6	4,259
アジアインターナショナル	16	23,600	静岡ガス	18.2	15,178	<b>空運業 (0.4%)</b>			エムアップホールディングス	8.4	9,912
タカラトミー	30.7	38,774	メタウオーター	7.8	15,303	日本航空	155.2	351,993	エイチーム	4.6	3,293
広済堂ホールディングス	4.6	5,267	<b>陸運業 (3.0%)</b>			ANAホールディングス	172	418,390	エニグモ	8.1	4,195
エステールホールディングス	1.4	889	SBSホールディングス	5.5	14,602	パスコ	1.4	1,787	テクノスジャパン	5.8	2,842
タカノ	2.5	1,915	東武鉄道	69.6	206,364	<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>			enish	5.1	1,601
プロネクサス	5.8	5,979	相鉄ホールディングス	22.5	51,322	トランコム	2	12,240	コロブラ	24	15,000
ウクシン	5.1	734	東急	178.2	263,736	日新	5.2	8,195	オルトプラス	5.8	2,111
ウッドワン	2.2	2,589	京浜急行	87.2	123,649	三菱倉庫	19.8	62,964	ブロードリーフ	36.4	15,360
大建工業	3.9	6,797	小田急電鉄	99.6	169,818	三井倉庫 HOLD	7.1	21,229	クロス・マーケティングG	2.8	2,242
凸版印刷	102.5	239,440	京王電鉄	34.8	154,338	住友倉庫	22	44,264	デジタルハーツHLDGS	3.3	5,204
大日本印刷	83.2	239,449	京成電鉄	46.5	161,355	渋沢倉庫	3.7	8,132	システム情報	5.4	5,211
共同印刷	2	5,200	富士急行	8	31,920	東陽倉庫	10.2	3,009	メディアアドック	2.6	4,482
N I S S H A	13.7	20,317	新京成電鉄	2	5,642	日本トランスシティ	13.5	6,723	じげん	20.7	6,913
光村印刷	0.6	753	東日本旅客鉄道	119.6	809,692	ケイヒン	1.2	1,588	ブイキューブ	7.5	7,155
TAKARA & COMPANY	4.3	7,800	西日本旅客鉄道	82.9	395,515	中央倉庫	3.7	3,552	エンカレッジ・テクノロジー	0.9	465
アシックス	60.1	146,463	東海旅客鉄道	55.6	856,796	川西倉庫	1.3	1,418	サイバーリンクス	2.5	2,805
ツツミ	1.9	3,585	西武ホールディングス	92.3	127,374	安田倉庫	4.7	4,441	ディー・エル・イー	4.3	1,444
ローランド	5.2	22,256	鴻池運輸	10.8	12,333	フェイスホールディングス	1.5	1,060	フィックススターズ	7.2	6,847
小松ウオール工業	2.2	4,092	西日本鉄道	18.7	52,116	東洋埠頭	1.8	2,287	CARTA HOLDINGS	2.9	5,208
ヤマハ	43.4	230,888	ハマキョウレックス	4.9	14,126	上組	36.4	92,856	オプティム	5.3	4,001
河合楽器	1.9	4,978	サカイ引越センター	3.4	14,484	サンリツ	1.6	1,169	セレス	2.7	3,121
クリナップ	6.7	3,651	近鉄グループHLDGS	67.7	261,999	キムラユニティー	1.8	2,637	S H I F T	4.3	74,777
ピジョン	45.1	76,715	阪急阪神HLDGS	84.3	295,471	キューソー流通システム	3.4	3,655	ティーガイア	6.6	10,599

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
セック	1	2,425	ニーズウェル	1.8	1,161	大塚商会	39.6	152,262	D T S	13.7	41,374
テクマトリックス	12.4	19,740	マネーフォワード	14.9	48,648	サイボウズ	9.9	9,405	スクウェア・エニックス・HD	34	195,840
プロシッパ	2.3	3,243	サインポスト	2.3	1,867	電通国際情報 S	9.6	35,664	シーイーシー	7.8	8,642
ガホー・オンライン・エンター	19	44,517	電算システムHD	3	6,813	A C C E S S	8.2	5,674	カブコン	69	221,835
GMOペイメントゲートウェイ	14.2	129,078	ソルクシーズ	6.2	2,225	デジタルガレージ	12.1	45,677	アイ・エス・ビー	3.4	3,410
ザッパラス	2.6	1,008	フェイス	1.9	1,216	イーエムシステムズ	12.1	11,567	ジャストテック	4.1	4,710
システムリサーチ	2	4,050	プロトコルソリューション	7.9	7,441	ウェザーニューズ	2.3	13,869	S C S K	50.8	108,356
インターネットインシアティブ	19.5	86,775	ハイマックス	1.9	2,348	C I J	5.2	3,946	日本システムウエア	2.7	6,407
さくらインターネット	7.7	4,173	野村総合研究所	132	481,140	ビジネスエンジニアリング	1.6	3,235	アイネス	6.1	9,241
ヴィンクス	2	2,228	サイバネットシステム	5.2	3,993	日本エンタープライズ	6.7	1,051	T K C	11.6	36,482
GMOグローバルサインHD	1.6	9,040	C E ホールディングス	3.4	1,417	WOWOW	3.5	5,120	富士ソフト	7.3	52,633
SRAホールディングス	3.5	9,779	日本システム技術	1.3	3,123	スカラ	6.1	4,599	N S D	23	52,969
システムインテグレート	1.9	910	インテジールホールディングス	8.4	11,348	インテリジェントウェイブ	3.3	2,649	コナミホールディングス	26.6	208,544
朝日ネット	6.7	3,785	東邦システムサイエンス	1.6	1,414	IMAGICA GROUP	5.5	3,905	福井コンピュータHLDS	3.4	10,659
e B A S E	8.8	4,593	ソースネクスト	31.6	7,900	ネットワークシステムズ	27	74,574	JBCCホールディングス	4.9	7,693
アバント	7.8	9,757	インフォコム	8	16,616	システムソフト	19.6	1,960	ミロク情報サービス	6.4	6,963
アドソル日進	2.6	3,840	シンプレクスHD	11.6	21,030	アルゴグラフィックス	5.7	17,584	ソフトバンクグループ	438.7	2,205,783
ODKソリューションズ	1.3	746	H E R O Z	2.1	1,902	マーベラス	11.5	7,682	<b>卸売業 (5.8%)</b>		
フリービット	3.8	2,872	ラクスル	8.5	13,149	エイベックス	12.7	15,887	高千穂交易	2.6	4,654
コムチュア	8.2	21,254	I P S	2	4,518	B I P R O G Y	22.9	64,188	オルパヘルスケアHLDS	1.5	2,652
サイバーコム	0.9	1,025	F I G	7.6	2,287	兼松エレクトロニクス	3.9	15,054	伊藤忠食品	1.6	7,528
アステリア	5.3	5,395	システムサポート	2.6	3,010	都築電気	3.4	4,307	エレマテック	5.7	7,358
アイル	3.7	5,379	イースル	4.5	2,434	TBSホールディングス	38.3	65,607	あらた	5.5	20,762
マークラインズ	3.7	7,718	アルテリア・ネットワークス	7.6	9,348	日本テレビHLDS	60.8	75,574	トーマンデバイス	1.1	6,380
メディカル・データ・ビジ	9.4	9,136	東海ソフト	1.1	1,048	朝日放送グループHD	6.4	4,147	東京エレクトロンデバイス	2.2	11,902
g u m i	10.2	5,763	ウイングアーク1ST	5.6	8,215	朝日朝日HD	18	26,550	フィールズ	6.4	6,374
ショーケース	1.6	737	ヒト・コミュニケーションズHD	1.7	2,522	スカパーJSATHD	61.7	31,713	双日	77.2	156,561
モバイルファクトリー	1.7	1,936	サーパワークス	1.3	2,628	テレビ東京HD	5	9,825	アルフレッサホールディングス	77.9	129,080
テラスカイ	2.7	3,788	東名	0.7	786	日本BS放送	3	3,126	横浜冷凍	18.1	15,113
デジタル・インフォメーション	3.2	4,336	ヴィッツ	0.6	649	ビジョン	12	15,540	神栄	1.1	977
PCIホールディングス	3	2,883	トピラスシステムズ	1.4	1,201	S マートパリュウ	1.7	797	ラサ商事	3.2	3,056
パイプHD	1.3	3,543	S a n s a n	24.2	21,731	USEN-NEXT HLDGS	6	11,262	アルコニクス	9.2	11,822
アイビーシー	0.9	408	L i n k e r U	1.4	911	ワイヤレスゲート	3	897	神戸物産	52.7	160,471
ネオジャパン	2	2,142	ギフティ	6.2	6,522	コネクシオ	5.3	6,810	ハイパー	2.2	1,005
P R T I M E S	1.6	3,177	ベース	1.2	6,888	日本通信	60.7	11,411	あいホールディングス	10.4	16,484
ラクス	33.6	47,342	J M D C	9.2	46,092	クロップス	1.4	1,432	ディーブイエックス	2.9	2,920
ランドコンピュータ	1.3	1,158	フォーカスシステムズ	4.5	3,982	日本電機電話	801.6	3,065,318	ダイワボウHD	32.7	54,707
ダブルスタンダード	2.2	3,968	クレスコ	5.3	10,329	K D D I	533.2	2,321,019	マクニカ・富士エレHLDGS	17.5	48,352
オープンディア	4.4	7,629	フジ・メディア・HD	66.6	74,592	ソフトバンク	1,107.6	1,615,434	ラクト・ジャパン	2.5	4,990
マイネット	2.6	1,292	オービック	23.1	423,885	光通信	8.4	115,164	グリムス	3.3	4,481
アカツキ	3.3	9,055	ジャストシステム	10.4	38,636	エムティイーアイ	6.1	2,702	パイタルK S K HD	12.1	8,107
ベネフィットジャパン	0.6	1,120	T D Cソフト	6	6,024	GMOインターネット	25.6	57,497	八洲電機	4.7	4,450
UBICOMホールディングス	1.9	4,254	Zホールディングス	1,054.8	418,228	ファイバーゲート	3.4	3,080	メディアスホールディングス	4.5	4,360
カネミックネットワーク	9.2	4,784	トレンドマイクロ	37	243,090	アイドマーケティングコム	1.8	538	レスターホールディングス	6.8	13,239
ルミナステクノロジー	3.5	819	IDホールディングス	4.2	3,456	K A D O K A W A	39.5	106,571	ジュエテックHD	1.5	1,492
チェンジ	14.7	27,077	日本オラクル	11.9	87,703	学研ホールディングス	10.3	8,744	大光	3.2	2,230
シンクロ・フード	4	1,328	アルファシステムズ	1.9	7,894	ゼンリン	12.1	10,865	OCHIホールディングス	1.8	2,192
オークネット	3.9	6,996	フューチャー	15.5	23,854	昭文社ホールディングス	3	1,155	TOKAIホールディングス	35.6	30,544
キャピタル・アセット・プラン	1.2	823	CAC HOLDINGS	3.8	5,289	インプレスホールディングス	6.5	1,358	黒谷	1.9	1,111
セグエグループ	1.9	1,022	S B テクノロジー	3.2	7,075	アイネット	3.3	3,969	C o m i n i x	2.8	2,010
エイトレッド	1	1,957	トーセ	2.3	1,708	松竹	4.4	55,440	三洋貿易	7	6,706
マクロミル	14.6	13,446	オービックビジネスC	7	29,715	東宝	43.2	207,792	ビューティガレージ	1.2	2,920
ビーグリー	1.7	2,266	伊藤忠テクノソリューション	33.4	105,043	東映	2.2	37,576	ウイン・パートナーズ	5.9	5,858
オロ	2.3	3,804	アイティフォー	8.7	6,681	N T T データ	194.9	362,319	ミタチ産業	1.7	1,545
ユーザーローカル	2.2	3,630	東計電算	0.8	4,768	ピー・シー・エー	4.3	4,489	シッパヘルスケアHD	21.7	50,300
テモナ	1.6	598	エックスネット	0.7	698	ビジネスB 木田昭和	2.3	3,187	明治電機工業	3	3,210

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
デリカフーズ HLDGS	3	1,560	日本紙パルプ	3.5	12,635	コア商事 HLDGS	4.6	3,574	DCMホールディングス	43.2	43,804
スターティアホールディングス	1.7	1,215	カメイ	8.1	8,480	国際紙パルプ商事	14	6,370	ペッパーフードサービス	10	3,920
コメダホールディングス	16	36,288	東都水産	0.4	1,742	ヤマタネ	3	4,662	Monotaro	92.8	165,648
ピーバンドットコム	0.8	416	OUGホールディングス	1.1	3,011	丸紅建材リース	0.7	1,348	東京一番フーズ	2.2	1,295
アセンテック	2.5	1,600	スターゼン	5.2	10,056	日鉄物産	4.7	23,970	DDホールディングス	3.9	2,414
富士興産	1.8	1,974	山善	27.8	27,605	泉州物産	1.9	9,861	きちりホールディングス	2.3	952
協栄産業	0.5	691	橋本興業	1.5	5,302	トラコス中山	15.3	26,132	アークランドサービスHD	5.6	11,844
フルサト・マルカHD	6.6	18,664	住友商事	444.2	821,325	オートパックスセブン	23.4	31,847	J フロントリテイリング	83.7	93,158
ヤマエグループHD	4.4	5,068	内田洋行	3	15,600	モリト	5.2	3,832	ドトール・日レスHD	12	18,324
小野建	6.7	9,306	三菱商事	504.4	2,210,785	加藤産業	8.8	26,488	マツココカラ&カンパニー	43.7	210,415
雨陽	1.7	3,027	第一実業	2	10,050	北恵	1.9	1,634	ブロンコビルリー	4	9,680
佐鳥電機	4.4	5,214	キャノンマーケティングJPN	18.1	52,254	イノテック	4.2	5,544	Zozo	50.4	119,347
Eコートレーディング	1.8	1,020	西華産業	3.3	5,329	イエローハット	12	19,284	トレジャー・ファクトリー	2.3	2,382
伯東	4.4	12,064	佐藤商事	5.1	5,610	JKホールディングス	5.3	4,791	物語コーポレーション	3.6	20,448
コンドートック	5.4	5,335	菱洋エレクトロ	4.3	9,769	日伝	6.2	11,848	三越伊勢丹HD	116.5	121,160
中山福	3.8	1,212	東京産業	5.6	3,864	北沢産業	4.1	861	Hamee	2.7	2,754
フクイレーベン	9	16,542	ユアサ商事	6.2	20,801	杉本商事	3.8	7,991	マーケットエンタープライズ	0.8	820
三菱食品	7	21,910	神鋼商事	1.7	6,477	因幡電機産業	18.2	48,539	ウエルシアHD	38.9	91,220
松田産業	5.3	10,499	トルク	10.1	1,989	東テック	2.3	6,490	クリエイトSDH	10.8	29,041
第一興商	14	52,150	阪和興業	13.4	38,953	ミスグループ本社	91.8	253,184	丸善CHI HD	10.6	4,070
メディアパルHD	71.6	128,808	正栄食品	4.7	16,614	アルテック	5.7	1,333	ミサワ	1.6	979
SPK	2.5	3,297	カナデン	6.2	6,218	タキヒヨー	1.9	1,896	ティーライフ	1	1,357
萩原電気 HLDGS	2.3	4,650	菱電商事	5.8	9,193	葦正産業	1.9	3,634	イー・ピーホールディングス	1.5	675
アズワン	10.5	60,165	岩谷産業	16.7	87,341	スズケン	27	93,825	チムニー	2.3	2,748
スズデン	2.6	5,098	ナイス	2.5	4,055	ジェコス	5.1	4,131	シュッピン	6.1	8,540
尾家産業	1.8	1,542	ニチモウ	1	2,292	グロースル	7.4	2,960	オイシックス・ラ・大地	10.5	16,023
シモジマ	4.6	4,301	極東貿易	2.1	5,493	<b>小売業 (4.1%)</b>			ネクスステージ	14.9	30,604
ドウシシャ	6.9	10,350	アステナホールディングス	9.8	4,076	ローソン	16.3	69,845	ジョイフル本田	21.9	34,383
小津産業	1.4	2,567	三愛オプリー	17	16,150	サンエー	5.1	20,170	鳥貴族ホールディングス	2.5	5,885
高速	4.3	6,402	稲畑産業	14.7	33,104	カワチ薬品	5.6	11,340	ホットランド	5.7	7,592
たげびし	2.2	3,161	G S I グレオス	3.5	4,438	エピーシー・マート	11.4	65,322	すかいらーく HD	91	143,143
リックス	2.3	4,215	明和産業	6.7	4,589	ハードオフコーポレーション	3.6	3,078	SFPホールディングス	3.7	5,605
丸文	5.7	4,286	クワザワホールディングス	2.5	1,155	アスクル	16.5	23,677	綿半ホールディングス	5.4	6,966
ハビネット	5.6	8,607	フキタ	13.8	15,870	ゲオホールディングス	9.1	10,910	ヨシックスホールディングス	1.5	3,552
橋本総業 HLDGS	1.3	2,490	東邦ホールディングス	21	39,396	アダストリア	7.8	15,280	ユナイテッド・スーパーマーケット	21.1	21,669
日本ライフライン	22	19,866	サンゲツ	18	27,378	ジーフット	4	1,320	ゴルフダイジェスト・オン	3.8	5,396
タカショー	5.5	4,125	ミツウロコグループ	9.1	8,108	シー・ヴィー・エス・バイエリア	0.7	278	B E E N O S	3.7	7,248
I D O M	22.2	15,673	シナネンホールディングス	2.5	8,350	くら寿司	7.6	22,085	あさひ	6.4	8,211
進和	4.9	10,172	伊藤忠エネクス	16	16,848	キャンドゥ	2.7	5,745	日本調剤	4.5	5,665
エスケイジャパン	1.8	822	サンリョ	21.3	53,186	アイケイ	2.4	1,236	コスモ薬品	7.4	85,692
ダイトロン	2.8	5,392	サンワ テクノス	3.7	5,057	パルグループ HLDGS	6.5	11,329	トールエル	3.3	2,884
シークス	9.7	9,680	リョーサン	7.6	17,381	エディオン	33.5	39,429	セブン&アイ・HLDGS	259.9	1,353,039
田中商事	2.2	1,304	新光商事	9.7	8,448	サラコーポレーション	14.7	9,099	クリエイト・リストランツ・ホール	45.7	42,729
オーハシテックニカ	3.5	4,483	トーホー	3	3,936	ワッツ	3.1	2,185	ツルハホールディングス	16	102,080
白銅	2.3	5,602	三信電気	3	4,707	ハローズ	3.3	9,705	サンマルクホールディングス	6	9,162
ダイコー通産	0.6	675	東陽テックニカ	7.9	8,650	フジオフードG 本社	5.8	7,801	フェリシモ	1.7	1,926
伊藤忠	464.7	1,720,319	モスフード サービス	9.6	28,896	あみやき亭	1.8	5,162	トリドルホールディングス	18.2	40,021
丸紅	670.5	893,776	加賀電子	6.2	19,127	ひらまつ	15.3	3,044	TOKYO BASE	6.9	2,270
高島	1.1	2,726	ソーダニツカ	6.5	3,900	大黒天物産	2.3	9,269	ウイルプラス HLDGS	1.3	1,155
長瀬産業	35.2	65,014	立花エレテック	5.1	7,741	ハニスホールディングス	6.2	7,173	JMホールディングス	5.3	7,642
蝶理	4.1	7,794	フオパール	2.8	2,265	ファーマライズHD	1.7	1,190	サツドラホールディングス	3.6	2,329
豊田通商	68.3	326,815	P A L T A C	10.3	42,848	アルペン	5.5	10,780	アレンザホールディングス	5.2	5,038
三生生興	9.1	4,895	三谷産業	11.6	3,549	ハブ	2.5	1,415	串カツ田中 HLDGS	2	3,620
兼松	26	34,554	太平洋興発	2.7	1,690	コールホールディングス	9	11,421	パロックジャパン	4.8	3,792
ツカモトコーポレーション	1.2	1,371	西本 WISMETTAC HD	1.7	6,579	ジンスホールディングス	4.2	16,947	クスリのアオキ HLDGS	6.8	34,408
三井物産	544.8	1,750,442	ヤマシヘルスケア HLDGS	0.8	1,473	ビックカメラ	43.1	47,194	力の源 HD	4	2,784



トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
FOOD&LIFE COMPAN	39.4	108,822	チヨダ	6.7	4,884	ペルーナ	15.7	10,770	阿波銀行	10.2	20,359
メディカルシステムネットワーク	6.7	2,713	ライフコーポレーション	6.1	15,079	<b>銀行業 (5.5%)</b>			大分銀行	4	7,208
一家ホールディングス	1.3	754	リンガーハット	8.7	19,809	島根銀行	2	1,024	宮崎銀行	4.1	8,405
藤久ホールディングス	2.4	1,696	Mr Ma x HD	9.4	5,433	じもとホールディングス	4.7	2,679	佐賀銀行	3.7	5,276
はるやま HLDGS	3.7	1,594	テンアライド	7.3	2,241	めびきフィナンシャルG	321.2	83,190	琉球銀行	15.7	12,167
ノジマ	11.8	33,417	AOKIホールディングス	14	9,282	東京きらぼしFG	8.8	17,600	セブン銀行	219.6	54,900
コッパ・クリエイト	10.5	14,595	オークワ	10.5	8,893	九州フィナンシャルG	136.2	52,709	みずほフィナンシャルG	901.2	1,359,910
ライトオン	5.7	4,075	コメリ	11.3	29,809	ゆうちょ銀行	173.6	171,169	高知銀行	2.2	1,601
良品計画	84.5	113,314	青山商事	14.3	12,455	富山第一銀行	16.1	6,987	山口フィナンシャルG	7.8	59,124
パルミキホールディングス	10	2,680	エイチ・オーリテイリング	8.5	95,625	コソルディア・フィナンシャル	383.9	179,281	長野銀行	2.1	2,568
アドヴァングループ	6.6	5,181	はせがわ	4.8	1,267	西日本フィナンシャルHD	41.1	31,071	名古屋銀行	4.8	14,592
アルビス	2.4	5,260	高島屋	50.9	65,050	33FG	6	8,154	北洋銀行	99.2	21,526
コナカ	8.2	2,730	松屋	13.2	11,497	第四北越フィナンシャルG	10.9	27,173	愛知銀行	2.4	13,248
ハウス ローゼ	1.1	1,824	イチ・ツ・オーリテイリング	32.9	32,735	ひろぎん HLDGS	99.2	60,016	中京銀行	2.3	4,057
G7ホールディングス	8.1	11,032	近鉄百貨店	2.3	5,485	おきなわFG	6.4	13,440	大光銀行	2.2	2,851
イオン北海道	10.7	11,213	丸井グループ	54.8	124,450	十六FG	9.1	20,848	愛媛銀行	9.7	8,710
コジマ	12.8	7,526	アクリルリテイリング	5.1	15,060	北国FH D	6.5	29,022	トマト銀行	2.1	2,118
ヒマラヤ	2.5	2,345	井筒屋	3.4	1,196	プロクラホールディングス	7.5	14,017	京葉銀行	30.7	14,398
コーナン商事	10.3	36,307	イオン	255.7	555,380	新生銀行	48	92,928	栃木銀行	33.4	8,550
エコス	2.4	4,764	イズミ	12.2	35,794	あおぞら銀行	41.1	108,873	北日本銀行	2	3,014
ワタミ	8.8	8,016	平和堂	11.3	21,029	三菱UFJフィナンシャルG	4,406.4	3,261,617	東和銀行	12.1	6,134
マルシェ	2.7	1,239	フジ	17.4	38,558	りそなホールディングス	796.5	406,374	福島銀行	7.3	1,613
パソパシフィックHD	146.8	279,213	ヤオコー	8.3	50,132	三井住友トラストHD	127.4	523,614	大東銀行	2.9	1,856
西松屋チェーン	14.9	21,128	ゼビオホールディングス	10.2	9,078	三井住友フィナンシャルG	487.8	1,959,004	トモニホールディングス	54.4	16,755
センショーホールディングス	35.6	108,224	ケーズホールディングス	63.9	78,852	千葉銀行	220.8	164,716	フィデアホール	6.7	8,455
幸楽苑ホールディングス	4.5	5,746	OLYMPICグループ	3	1,929	群馬銀行	125.4	46,774	池田泉州HD	80.6	15,555
ハークスレイ	3.6	2,055	日産東京販売HD	9	2,295	武蔵野銀行	9.9	17,344	<b>証券・商品先物取引業 (0.7%)</b>		
サイゼリヤ	10.8	27,853	シルバーライフ	1.6	2,675	千葉興業銀行	15.8	4,060	F P G	24.7	22,477
V Tホールディングス	27.4	12,549	GENKY DRUGSTORES	3.2	10,192	筑波銀行	28.3	5,263	ジャパインバステメントA	5.6	7,812
魚力	2.3	5,152	ナルミヤ・インターナショナル	1.6	1,377	七十七銀行	20.8	39,894	マキアホールディングス	3.5	2,072
ポプラ	1.8	255	ブックオフGHD	4.6	4,443	秋田銀行	4.3	6,699	SBIホールディングス	90.8	232,448
フジ・コーポレーション	4.1	4,780	ギフトホールディングス	1.2	2,444	山形銀行	7	5,992	日本アジア投資	5.9	1,421
ユナイテッドアローズ	7.6	14,622	アインホールディングス	9.3	63,054	岩手銀行	4.5	9,054	ジャフコグループ	28.1	45,297
ハイデイ日高	10.6	21,518	元気寿司	2.2	5,445	東邦銀行	54.6	10,920	大和証券G本社	524	322,574
YU-WA CREATION H	5.2	1,216	ヤマダホールディングス	266.3	122,498	東北銀行	3	2,940	野村ホールディングス	1,122.3	549,927
コロナウイド	30	53,760	アークランドサカモト	11.4	16,621	ふくおかフィナンシャルG	56.2	138,926	岡三証券グループ	54	18,036
ピーシーデポコーポ	8.8	2,965	ニトリホールディングス	29.1	353,710	静岡銀行	161.2	130,410	丸三証券	21.9	10,424
壱番屋	5.2	24,986	グルメ軒屋	5.9	5,841	スルガ銀行	63	22,428	東洋証券	22.8	4,104
トップカルチャー	3.7	969	愛眼	7.4	1,369	八十二銀行	150.1	70,396	東海東京HD	75.3	27,936
P L A N T	1.7	1,105	ケユーホールディングス	3.7	3,770	山梨中央銀行	7.4	8,273	光世証券	1.9	879
スギホールディングス	14.7	74,382	吉野家ホールディングス	25.4	61,645	大垣共立銀行	13.2	22,532	水戸証券	18.9	4,838
薬王堂ホールディングス	3.8	7,672	松屋フーズHLDGS	3.7	14,004	福井銀行	5.9	7,717	いちよし証券	13.1	8,253
ヴィア・ホールディングス	9.9	1,475	サガミホールディングス	10.8	12,106	清水銀行	2.5	3,637	松井証券	35.9	29,043
スクロール	11.2	9,732	関西フードマーケット	6.3	7,452	富山銀行	1.1	2,033	マックスG	61.3	26,052
ヨドシホールディングス	6.3	11,018	王将フードサービス	4.9	32,095	滋賀銀行	12.6	34,108	極東証券	8.9	6,007
木曽路	9.8	20,364	プレナス	8.3	15,969	南都銀行	10.5	20,475	岩井コスモホールディング	7	8,596
SRSホールディングス	10.7	8,945	ミニストップ	5.2	7,238	百五銀行	64.8	20,865	アイゼン証券グループ	10.8	7,300
千趣会	13.7	5,370	アークス	13.3	25,669	京都銀行	24	140,880	マネーパートナーズGP	7.5	1,800
タカキュー	6.3	573	パルコホールディングス	15.4	27,566	紀陽銀行	23	30,820	スパークス・グループ	33.8	8,281
リテールパートナーズ	10.4	11,440	ベルク	3.2	16,096	ほくほくフィナンシャルG	43	35,131	小林洋行	3	657
ケーヨー	13.7	12,699	大庄	3.9	4,430	山陰合同銀行	41.9	27,486	<b>保険業 (2.4%)</b>		
上新電機	7.6	13,870	ファーストリテイリング	9.8	657,972	中国銀行	55.5	53,058	かんぽ生命保険	73.9	164,279
日本瓦斯	35.7	68,008	サンドラッグ	27.7	76,645	鳥取銀行	2	2,340	SOMPOホールディングス	110	650,540
ロイヤルホールディングス	12	26,808	サックスパーホールディング	7.1	3,841	伊予銀行	87.9	57,662	アニコムホールディングス	22.5	14,490
東天紅	0.7	639	ヤマザワ	1.6	2,395	百十四銀行	7	12,033	M S & A D	155.7	631,986
いなげや	7.7	8,893	やまや	1.8	4,415	四国銀行	10	8,090	第一生命HLDGS	350.1	926,014

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
東京海上HD	215.1	1,599,268	シーアールイー	2.5	3,957	コジカホールディングス	19.2	14,668	TAC	2.3	517
T&Dホールディングス	172.8	277,516	プロパティエージェン	0.8	1,143	アルトナー	1.8	1,497	電通グループ	69	290,145
アドパンスクリエイト	3.5	3,353	ケイアスター不動産	3.3	14,404	パソナグループ	7.7	14,383	テイクアンドギヴェーズ	3.3	4,907
<b>その他金融業 (1.2%)</b>			アグレ都市デザイン	1.2	1,722	CDS	1.7	3,080	ぴあ	2.3	7,544
全国保証	17.5	74,637	ジェイ・エス・ビー	1.5	4,890	リンクアンドモチベーション	15.7	6,656	イオンファンタジー	2.7	6,679
あんしん保証	3.5	924	ロードスターキャピタル	1.9	2,886	エス・エム・エス	24.2	61,855	シーティーエス	8	6,280
ジェイリース	2.5	4,432	トンポイノベーション	1.9	1,559	サニーサイドアップG	2.5	1,400	ネクシイズグループ	2.3	1,212
イントラスト	3.5	1,862	グローバルマネジメント	1.2	1,098	パーソルホールディングス	71.3	161,637	HUグループHD	18.6	49,978
日本モーゲージサービス	4.2	3,960	フェイスネットワーク	0.7	937	リニカル	3.9	2,971	アルプス技研	5.9	10,625
Casa	2.9	2,415	パーク24	43.6	81,139	クックパッド	22.1	4,464	サニックス	12.3	2,619
アルヒ	10.8	10,692	パラカ	1.9	3,262	エスクリ	3.2	1,280	ダイオーズ	1.2	1,254
プレミアムグループ	3.7	14,189	宮越ホールディングス	2.8	2,380	アイ・ケイ・ケイホールディング	3.2	1,801	日本空調サービス	7.6	5,935
ネットプロHD	22.4	11,468	三井不動産	303.7	877,085	学情	2.9	2,734	オリエンタルランド	78.6	1,421,481
クレディセゾン	44.4	67,710	三菱地所	440.4	852,834	スタジオアリス	3.2	7,251	ダスキン	15.7	42,013
芙蓉総合リース	6.7	50,317	平和不動産	12	46,440	シミックホールディングス	3.6	5,061	明光ネットワークジャパン	8.1	4,795
みずほリース	9.8	29,890	東京建物	66.5	113,515	エプロ	1.6	1,161	ファルコホールディングス	3.1	6,324
東京センチュリー	12.4	50,902	京阪神ビルディング	10.2	12,699	NJS	1.6	3,092	秀英予備校	2.2	946
日本証券金融	28.7	24,595	住友不動産	139.7	486,854	総合警備保障	26.8	94,336	田谷	1.6	897
アィフ	123.5	42,360	テオオーシー	11.9	7,389	カカココム	52.3	112,706	ラウンドワン	19.9	31,342
リコーリース	6.5	22,230	東京楽天地	1	3,890	アリコムグループ	2.6	4,539	リゾートトラスト	31	63,984
イソフィナンシャルサービス	40.1	48,120	スタツコポリューション	10.1	25,856	セントケア・ホールディング	4.6	3,675	ビー・エム・エル	9	30,915
アコム	144.9	45,498	フジ住宅	8.2	5,174	サイネックス	1.7	999	りらいあコミュニケーション	10.5	10,941
ジャックス	7.6	24,966	空港施設	6.9	3,615	リネサンス	4.9	4,512	リソー教育	32.7	10,333
オリコ	198.6	24,427	明和地所	3.1	1,884	ディップ	12.5	43,000	早稲田アカデミー	3.7	4,166
オリックス	436.9	1,011,205	ゴールドクレスト	5.8	9,657	デジタルホールディングス	4.9	6,306	ユー・エス・エス	79.7	187,693
三菱HCキャピタル	248.5	153,573	エスリード	2.7	4,422	新日本科学	8.7	16,617	東京個別指導学院	6.2	3,689
九州リースサービス	3.3	1,864	日神グループHLDGS	11.6	5,011	キャリアデザインセンター	1.6	1,780	サイバーエージェント	160	200,000
日本取引所グループ	175.3	364,010	日本エスコン	13.6	10,363	ベネフィット・ワン	26	43,940	楽天グループ	342.4	222,217
イー・ギャラリーンティ	10.8	21,081	タカラレーベン	30.4	10,123	エムスリー	125.7	448,246	クロー・アド・リバー社	3.7	6,941
アサックス	4.6	2,741	AVANTIA	3.2	2,643	ツガダ・グローバルHOLD	4.4	1,421	モーニングスター	12.5	6,237
NECキャピタルリソリューション	3.2	6,256	イオンモール	37.1	59,322	プラス	0.9	763	テー・オー・ダブリュー	13.5	4,374
<b>不動産業 (2.0%)</b>			毎日コムネット	2.1	1,377	アウトソーシング	40.8	43,288	山田コンサルティングGP	3.7	4,070
いちご	81.4	23,280	ファースト住建	2.6	2,808	ウエルネット	6.4	3,110	セントラルスポーツ	2.6	6,211
日本駐車場開発	75.4	12,516	ランド	403.8	4,038	ワールドホールディングス	2.8	6,437	フルキャストホールディングス	6	12,606
スター・マイカ・HLDGS	4	6,224	カチタス	18.3	47,982	ディー・エヌ・エー	27.1	46,828	エン・ジャパン	12.3	20,996
SREホールディングス	1.9	3,456	トーセイ	10.2	11,526	博報堂DY HLDGS	93.2	109,603	リソルホールディングス	0.7	3,150
ADワークスグループ	12.4	1,897	穴吹興産	1.5	3,363	なるなび	10.9	4,381	テクノロ・ホールディング	42.7	114,009
ビューリック	165.7	174,813	サンフロンティア不動産	10.3	10,897	タカミヤ	8.6	3,121	アトラグループ	1.9	380
三栄建築設計	2.9	4,660	インテリックス	1.5	877	ジャパベストレスキューS	4.3	3,285	インターワークス	2	740
野村不動産HLDGS	38.2	122,813	ランドビジネス	1.7	396	ファンコミュニケーションズ	16.6	6,440	アイ・アールジャパンHD	3.3	6,570
三重交通グループHD	14.8	7,133	サンネクスダグループ	2.2	2,497	ライク	2.4	4,944	Ke e P e r 技研	4.6	14,766
サムティ	10.4	20,789	グランディハウス	4.8	2,510	ビジネス・ブレイクスルー	2	828	ファーストロジック	1.3	1,053
地主	4.6	9,062	日本空港ビルディング	25.2	126,000	エスプール	20.1	22,270	三機サービス	1.1	1,127
プレサンスコーポレーション	8.6	12,814	<b>サービス業 (5.1%)</b>			WDBホールディングス	3.2	6,988	G u n o s y	3.9	3,572
ハウスコム	0.9	875	明豊ファシリティアワークス	3.2	1,980	ティア	3.1	1,336	デザインワン・ジャパン	2.3	404
JPMC	3.4	3,386	日本工営	4.5	14,715	CDG	0.9	1,154	イー・ガーディアン	2.6	7,306
サンセイランディック	1.7	1,485	L I F U L L	21.3	3,429	アドウェイズ	10.6	6,974	リブセブス	4.1	672
エストラスト	1.1	601	ミクシィ	16.2	35,137	バリューコマース	5.6	16,592	ジャパンマテリアル	21.9	40,931
フージャーズHD	9.3	7,374	ジェイエイシクルメント	5.7	9,450	インフォーマート	78.3	29,597	ペクトル	10	9,980
オーブハウスグループ	23.4	119,340	日本M&Aセンターホールデ	116.9	155,593	JPホールディングス	18.1	3,963	ウチヤマホールディングス	2.8	814
東急不動産HD	206.2	138,566	メンパース	1.9	4,993	エコナックホールディングス	13.5	1,161	チャームケアコーポレーション	5.3	5,125
飯田GHD	61.4	124,703	中広	1.1	420	CLホールディングス	1.5	1,456	キャリアリンク	2.6	4,947
イーブランド	1	1,411	UTグループ	10.3	23,690	プレステージ・インター	26.5	16,138	I B J	6	4,176
ビーロッド	4.7	2,279	アイティメディア	3.4	5,280	アミューズ	3.9	7,686	アサンテ	3.1	4,650
ファーストブラザーズ	1.7	1,443	E・Jホールディングス	4.1	4,682	ドリームインキュベータ	2.1	4,504	バリューHR	6	7,380
AND DOホールディングス	3.6	3,153	夢真ベネックスグループ	23.2	31,436	クイック	4.6	6,426	M&Aキャピタルパートナー	5.9	18,083

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ライドオンエクスプレスHD	2.8	3,253
ERIホールディングス	2	2,844
アビスト	1.1	3,083
シグマシス・ホールディング	8.5	8,313
ウィルグループ	5.2	5,527
エスクローA J	8.4	1,402
メドピア	5.2	9,666
レアジョブ	1.3	700
リクルートホールディングス	523.4	102,497
エラン	9.9	9,820
土木管理総合試験	3.5	1,134
ネットマーケティング	3.5	2,215
日本郵政	852.7	822,684
ベルシステム24HLDGS	10.2	13,923
鎌倉新書	8.1	4,033
SMN	1.6	960
一蔵	0.7	354
グローバルキッズCOMP	1	671
エアトリ	4.3	10,965
アトラエ	5	8,640
ストライク	3	10,110
ソラスト	17.7	11,487
セラク	2.3	2,417
インソース	7.6	15,124
ペイカレントコンサルティング	5	158,250
ORCHESTRA HLDGS	1.4	3,507
アイモバイル	3	4,053
キャリアインデックス	2.4	1,106
MS - Japan	2.9	2,531
船場	0.7	469
ジャパンエレベーターSHD	22.6	29,380
フルテック	1.1	1,442
グリーンズ	2.5	1,560
ツナググループHLDGS	1.6	500
GAMEWITH	1.9	885
MS&CONSULTING	1.1	771
ウェルビー	4.7	3,473
エル・ティール・エス	0.9	3,123
ミダックホールディングス	3.2	8,384
日総工産	5.6	3,113
キューベネットHLDGS	3.3	4,200
RPAホールディングス	10	3,750
スプリックス	2.3	2,214
マネジメントリレーションズ	3.5	8,802
プロレド・パートナーズ	1.7	827
AND FACTORY	1.6	657
テノ・ホールディングス	0.8	512
フロンティア・マネジメント	1.9	2,251
ピアラ	1.2	848
コプロ・ホールディングス	1.4	1,250
ギークス	1.2	1,146
カープスホールディングス	19.5	12,714
フォーラムエンジニアリング	4.5	4,162
FAST FITNESS JAP	1.3	1,766
ダイレクトマーケティングミクス	7.5	12,570
ポピビンス	1.7	3,192

銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
LITALICO	5.8	13,032
アドバンテッジリスクマネ	3.6	1,641
リログループ	39	77,805
東祥	5.4	6,841
ビーウィズ	1.9	2,580
TREホールディングス	12.2	22,887
人・夢・技術グループ	2.8	6,624
エイチ・アイ・エス	15.2	29,776
ラックランド	2.1	6,237
共立メンテナンス	12.7	62,039
イチノンホールディングス	7.6	9,104
建設技術研究所	3.8	9,500
スペース	4.7	4,234
燦ホールディングス	3.1	5,487
スバル興業	0.4	3,544
東京テアトル	2	2,420
タナベ経営	2.9	1,887
ナガワ	2.1	16,569
東京都競馬	5.4	20,250
常盤興産	2.2	2,816
カナモト	11.9	23,312
西尾レントオール	6.1	16,640
アゴラホスピタリティG	34	816
トランス・コスモス	9	31,050
乃村工藝社	30.4	26,144
藤田観光	3.1	8,900
KNT-CTホールディングス	4.4	6,991
日本管財	7.5	18,900
トーカイ	5.7	9,336
白洋舎	0.6	876
セコム	70.2	569,041
セントラル警備保障	3.5	7,679
丹青社	13.7	11,261
メイテック	8.4	54,768
応用地質	7.2	12,297
船井総研ホールディン	13.7	27,564
進学会ホールディングス	1.7	613
オオバ	4.5	3,312
いであ	1.8	3,114
学究社	2.2	3,392
ベネッセホールディングス	23.8	49,170
イオンディライト	8.1	22,307
ナック	3.2	2,995
ダイセキ	13	57,330
ステップ	2.5	4,322
	千株	千円
合計	株数、金額	78,201.3 181,589,336
	銘柄数<比率>	2,160銘柄 <98.2%>

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

(2)先物取引の銘柄別残高  
(評価額)

銘柄別		2022年6月15日現在	
		買建額	売建額
国内	TOPIX	百万円	百万円
		3,389	—

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入状況

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

(注1) ( )内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。  
(注2) 当ファンドに係る当作成期中の利害関係人のうち、大和証券株式会社へ26,100株を貸付けています。



# トピックス・インデックス・マザーファンド 運用報告書 第33期（決算日 2021年9月21日）

（作成対象期間 2020年9月24日～2021年9月21日）

トピックス・インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

## ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行いません。
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

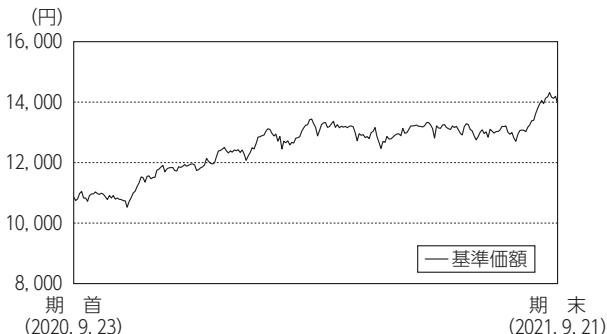
## 大和アセットマネジメント

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

(注1) 騰落率は期首比。

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

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注4) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

## 《運用経過》

## ◆基準価額等の推移について

## 【基準価額・騰落率】

期首：10,865円 期末：13,951円 騰落率：28.4%

## 【基準価額の主な変動要因】

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

## ◆投資環境について

## ○国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

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

## ◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

## ◆ポートフォリオについて

株式を中心に、一部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(株価変動を数論的にいくつかの要因に分解し、それに基づいて、ポートフォリオがベンチマークと同じように変動するよう、銘柄、株数を決定する体系的な手法)を用いて構築しています。

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

## ◆ベンチマークとの差異について

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

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

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

\*ベンチマークはTOPIXです。

## 《今後の運用方針》

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

## ■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■売買および取引の状況

## (1) 株 式

(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 6,069.7 (△ 7,114.63)	千円 14,873,822 ( ー)	千株 7,752.67004	千円 19,217,399

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

## (2) 先物取引の種類別取引状況

(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■主要な売買銘柄

## 株 式

(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

## トピックス・インデックス・マザーファンド

## ■組入資産明細表

## (1) 国内株式

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円	
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>																				
極洋	3.3	3.1	9,455					奥村組	10	11.5	35,937						明星工業	13.8	13.1	10,087
日本水産	92.4	84.3	54,120					東鉄工業	9	8.5	21,505						大氣社	10.4	10.1	33,885
マルハニチロ	13.4	14	37,156					イチケン	1.5	1.5	2,904						ダイダク	5.1	4.6	12,521
カネコ種苗	2.8	2.7	4,163					富士ピー・エス	3	2.4	1,420						日比谷総合設備	6.9	6.7	13,192
サカタのタネ	11	10.8	39,096					浅沼組	2.4	2.6	12,012						フィル・カンパニー	1.2	1.3	3,926
ホクト	7.1	7.9	15,626					戸田建設	87.6	86.1	71,032						OS J B HD	33.3	—	—
ホクリヨウ	1.6	2.3	1,741					熊谷組	9.9	9.9	27,383						東洋エンジニア	8.7	9.1	8,071
								北野建設	1.3	1.2	2,628						レイズネクスト	11.2	11.1	13,708
<b>鉱業 (0.2%)</b>								植木組	0.9	1.8	2,766						<b>食料品 (3.4%)</b>			
住石ホールディングス	18.4	21.6	3,002					矢作建設	9.3	9.3	7,746						ニッパン	20.1	19.5	32,565
日鉄鉱業	2.1	2.1	13,818					ピーエス三菱	7	6.8	4,488						日清製粉G本社	77.3	76.2	146,761
三井松島 HLDGS	3.4	3.6	5,058					日本ハウス HLDGS	14.2	14.7	6,438						日東富士製粉	0.5	0.5	3,390
I N P E X	339.1	367.2	289,353					大東建託	23.1	23	300,380						昭和産業	6.3	5.9	16,726
石油資源開発	12.1	12.4	24,366					新日本建設	9	8.4	7,660						鳥越製粉	6	6.4	5,030
K&O エナジーグループ	4.5	4.3	5,925					N I P P O	17.4	17.7	70,623						中部飼料	8.4	8.4	9,752
								東亜道路	1.3	1.3	5,999						フィード・ワン	45.7	9.3	7,244
<b>建設業 (2.3%)</b>								前田道路	18.8	13.2	26,334						東洋精糖	1.2	1.5	1,795
ヒノキヤグループ	2.3	2.3	5,451					日本道路	2	2.1	17,850						日本甜菜糖	3.5	3.5	5,866
ショールボンドHD	14.3	13.2	66,792					東亜建設	6.7	6	14,622						DM三井製糖ホールディ	6	5.1	10,383
ミライト・ホールディングス	27.4	31.9	73,497					日本国土開発	20.8	20	12,140						塩水港精糖	6.9	10.3	2,317
タマホーム	5	5.9	16,543					若築建設	3.7	3.6	7,660						日新製糖	3.3	3.1	5,446
サンヨーホームズ	0.5	1.5	1,113					東洋建設	23.9	24.2	13,866						森永製菓	16	15.7	66,332
日本アーク	3.8	4.4	2,578					五洋建設	84.8	90.1	68,385						中村屋	1.8	1.6	6,312
ファーストコーポレーション	3	3.2	2,576					世紀東急	10.2	10.2	8,843						江崎グリコ	19	18.4	80,592
ベステラ	1.6	1.9	2,755					福田組	2.5	2.4	12,192						名糖産業	3.3	3.2	5,744
キャンディル	1.4	1.7	1,057					住友林業	53.9	54.4	120,332						井村屋グループ	3.8	3.8	9,237
スペースバリューHD	11.1	11.5	9,740					日本基礎技術	7.3	6.3	3,830						不二家	3.8	4.1	9,987
ダイセキ環境ソリューション	1.8	1.8	2,982					BCコーポレーション	9.2	8.4	4,107						山崎製パン	51.2	50.7	101,349
第一カッター興業	1.1	2.3	3,045					大和ハウス	209.9	194.3	738,340						第一屋製パン	1.3	1.8	1,441
安藤・間	54.9	58.4	47,420					ライト工業	12.2	12.2	23,838						モロゾフ	1.1	1.1	6,149
東急建設	27.1	29	23,200					積水ハウス	229.3	227.9	541,376						亀田製菓	3.9	3.8	17,480
コムシスホールディングス	32.6	32.6	97,343					日特建設	5.5	5.3	3,895						寿スピリッツ	6.6	6.6	47,322
ピーアールホールディングス	9.9	12.5	6,050					北陸電気工事	3.6	3.4	4,617						カルビー	31.2	30.6	87,332
高松コンストラクションGP	5.7	5.7	11,747					エアテック	11.9	12.1	8,990						森永乳業	12.6	12.6	90,216
東建コーポレーション	2.8	2.8	29,064					日本リーテック	4.5	4.4	7,862						六甲バター	4.5	4.5	7,663
ソネック	0.9	1	1,130					四電工	1.1	1.2	4,254						ヤクルト	46.8	46.4	270,048
ヤマウラ	4	4.1	3,825					中電工	8.2	10.1	23,714						明治ホールディングス	45	44.2	323,986
オリエンタル白石	—	32.3	8,656					関電工	29.8	34.9	33,015						雪印メグミルク	16.5	16	37,552
大成建設	70.8	65.4	235,440					きんでん	50.1	42.2	82,712						プリマハム	10.7	9.6	29,184
大林組	212.7	209	195,624					東京エネシス	7	6.7	7,309						日本ハム	26.1	25.7	112,566
清水建設	215.5	197.8	167,338					トーエネック	2	2	7,500						林業産業	2.3	2.8	1,705
飛鳥建設	5.9	5.7	6,418					住友電設	6	5.9	14,000						丸大食品	7.3	6.4	11,526
長谷工コーポレーション	81.8	68.6	102,900					日本電設工業	11.6	11.1	20,723						S Foods	5.5	6	18,900
松井建設	8.3	7.8	6,208					協和エクシオ	32.2	32.3	91,441						柿安本店	2.3	2.2	5,896
銭高組	0.9	0.9	3,960					新日本空調	5.6	5.4	13,748						伊藤ハム米久 HLDGS	44.2	42.8	32,613
鹿島建設	166.7	153.9	225,617					九電工	14.9	14.8	58,904						サッポロホールディングス	23.3	22.8	57,433
不動産テトラ	5.5	5.1	9,149					三機工業	15.3	15.5	23,870						アサヒグループホールディン	143.3	158.6	869,921
大末建設	2.3	2.5	2,462					日揮ホールディングス	65.8	70.1	68,698						キリンHD	288	247.6	507,332
鉄建建設	4.6	3.9	7,133					中外炉工業	2.3	2.4	4,447						宝ホールディングス	50.7	50.2	78,563
西松建設	16.4	15.5	55,257					ヤマト	6.8	6.8	5,331						オエノンホールディングス	18	19.9	7,820
三井住友建設	51.7	51.7	25,126					太平電業	5.2	4.9	14,283						養命酒	2.1	2.3	4,330
大豊建設	4.8	5	19,100					高砂熱学	17.7	18.7	40,878						コカ・コーラボラータズJHD	48	47.2	77,030
前田建設	53.5	53.4	46,618					三晃金属	0.8	0.9	2,079						サントリー食品インター	45.7	45.2	221,028
佐田建設	4.5	5.1	2,468					朝日工業社	1.4	1.4	4,949						ダイドーグループHD	3.5	3.8	22,344
ナカノブドー建設	5.7	5	1,790																	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
伊藤園	20.8	20.5	158,670	158,670	日東製網	0.8	0.9	1,341	1,341	日本カーバイド	2.1	2.2	3,174	3,174
キーコーヒー	6.7	6.9	15,587	15,587	アツギ	5.3	5.2	3,354	3,354	堺化学	4.3	4.4	10,524	10,524
ユニカフェ	1.6	2.5	2,730	2,730	ダイニツク	2.4	2.5	1,955	1,955	第一稀元素化学工	7.1	7.3	11,877	11,877
ジャパンフーズ	0.9	1	1,258	1,258	セーレン	16.4	16.4	34,440	34,440	エア・ウォーター	61.8	67.3	121,678	121,678
日清オイリオグループ	8.8	8.5	26,690	26,690	ソトー	2.4	1.8	1,477	1,477	日本酸素 HLDGS	63.7	54.3	156,221	156,221
不二製油グループ	16.7	16.5	43,840	43,840	東海染工	0.9	0.8	908	908	日本化学工業	2.1	1.9	6,289	6,289
かどや製油	0.8	0.7	2,996	2,996	小松マテール	10.8	10.5	10,741	10,741	東邦アセチレン	0.8	1.2	1,634	1,634
J-オイルミルズ	3.6	6.2	11,482	11,482	ワコールホールディングス	16.7	16.3	37,310	37,310	日本パーカラライジング	33.6	32	39,200	39,200
キッコーマン	49.1	48.5	461,720	461,720	ホギメディカル	7.5	8.7	28,579	28,579	高圧ガス	10.6	9.8	7,859	7,859
味の素	150.4	160.3	555,279	555,279	クラウディア HLDGS	1.7	2.1	594	594	チタン工業	0.9	0.9	1,746	1,746
キューピー	38.1	37.8	105,953	105,953	T S Iホールディングス	22.1	19.7	6,638	6,638	四国化成	9.7	8	11,448	11,448
ハウス食品G本社	25.6	25.1	93,497	93,497	マツコカコーポレーション	1.9	2	2,900	2,900	戸田工業	1.5	1.5	4,972	4,972
カゴメ	26	25.4	76,454	76,454	ワールド	9.5	8.5	12,087	12,087	ステラ ケミファ	3.6	3.5	10,535	10,535
焼津水産化工	3.2	3.1	3,199	3,199	三陽商会	3.5	4	3,788	3,788	保土谷化学	2.5	1.9	9,842	9,842
アリアケジャパン	6.2	6.2	41,664	41,664	ナイガイ	2.5	3.2	1,126	1,126	日本触媒	10.2	11.7	69,498	69,498
ピエトロ	0.8	0.9	1,640	1,640	オンワードホールディングス	40.1	41.8	13,501	13,501	大日精化	5.9	5	14,110	14,110
エバラ食品工業	1.7	1.7	4,437	4,437	ルックホールディングス	2.1	2.3	3,192	3,192	カネカ	17.2	17	81,005	81,005
やまみ	0.6	0.8	1,596	1,596	ゴールドウイン	12	11	80,630	80,630	三菱瓦斯化学	61.8	65.8	154,827	154,827
ニチレイ	32.6	32.1	95,658	95,658	デサント	13	11.4	43,890	43,890	三井化学	61.8	57	224,580	224,580
東洋水産	35.1	34.7	182,522	182,522	キング	3	3.4	1,740	1,740	J S R	61.8	66.3	287,410	287,410
イトアンド HLDGS	2.3	2.3	5,287	5,287	ヤマトインタナショナル	5.7	5.8	1,908	1,908	東京応化工業	11.4	11.4	87,666	87,666
大冷	0.8	1.1	2,206	2,206	<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>					大阪有機化学	6.1	6.1	25,345	25,345
ヨシムラ・フード・HLDGS	3.8	4	3,052	3,052	特種東海製紙	4.1	3.9	18,271	18,271	三菱ケミカル HLDGS	442.5	439.1	453,151	453,151
日清食品HD	29	26.4	243,672	243,672	王子ホールディングス	277.1	297.6	173,203	173,203	K H Nオケム	11	11.1	35,131	35,131
永谷園ホールディングス	3.4	3.5	7,619	7,619	日本製紙	29.3	29.5	36,196	36,196	ダイセル	86.7	88.5	78,853	78,853
一正蒲鉾	2.6	2.8	2,648	2,648	三菱製紙	7.3	7.8	2,964	2,964	住友ベークライト	10.5	10.4	55,744	55,744
フジッコ	7.4	7.5	14,617	14,617	北越コーポレーション	39.9	48.7	32,434	32,434	積水化学	139.9	137.3	276,110	276,110
ロックフィールド	7.3	7.5	12,795	12,795	中越パルプ	2.8	2.3	2,838	2,838	日本ゼオン	60.2	59.3	93,931	93,931
日本たばこ産業	364.8	360.4	779,905	779,905	巴川製紙	2.1	2.1	1,877	1,877	アイカ工業	19.9	18.2	70,616	70,616
ケンコーマヨネーズ	3.8	4	6,712	6,712	大王製紙	29	31.8	69,546	69,546	宇部興産	33.4	33.1	75,732	75,732
わらべや日洋 HD	4.4	4.6	11,785	11,785	阿波製紙	2	1.6	668	668	積水樹脂	11.9	10.2	22,378	22,378
なとり	3.9	4.1	8,183	8,183	レンゴー	62.5	68.3	61,879	61,879	タキロンシーアイ	14	13.8	9,259	9,259
イフジ産業	1	1.5	1,432	1,432	トーモク	4.1	4.1	7,990	7,990	旭有機材	3.8	3.6	5,626	5,626
ピックスコーポレーション	1.5	3.4	7,473	7,473	ザ・パック	5	4.8	14,856	14,856	ニチバ	3.5	3.2	5,872	5,872
北の達人コーポ	23.8	24	11,664	11,664	<b>化学 (7.2%)</b>					リケンテクノス	16.6	16.2	9,525	9,525
ユーグレナ	29.4	35.3	30,816	30,816	クラレ	104.8	96.3	101,789	101,789	大倉工業	3.1	3.5	7,910	7,910
ミヨシ油脂	2.5	2.3	3,079	3,079	旭化成	439.2	435.4	541,419	541,419	積水化成成品	8.9	7.9	4,858	4,858
理研ビタミン	6.5	6.4	12,371	12,371	共和レザー	3.6	3.3	2,339	2,339	群栄化学	1.4	1.4	4,424	4,424
<b>繊維製品 (0.5%)</b>					昭和電工	47.5	47	127,887	127,887	タイガース ポリマー	3.4	2.2	957	957
片倉工業	9.2	8.8	13,912	13,912	住友化学	488.4	518.1	306,197	306,197	ミリアール	2.3	1.9	3,106	3,106
グンゼ	4.9	4.8	21,048	21,048	住友精化	3	3.2	11,808	11,808	ダイキアクシス	2.4	2.6	2,459	2,459
東洋紡	26.4	25.6	35,737	35,737	日産化学	36.8	36	249,120	249,120	ダイキョーニシカワ	14.1	13.7	9,192	9,192
ユニチカ	19.8	18.5	7,141	7,141	ラサ工業	2.3	2.2	4,303	4,303	竹本容器	2.2	2.9	2,711	2,711
富士紡ホールディングス	3.2	3.2	14,464	14,464	クレハ	5.7	5.6	44,576	44,576	森六ホールディングス	3.6	3.5	7,574	7,574
倉敷紡績	6.6	5.6	11,407	11,407	多木化学	2.6	2.6	18,200	18,200	日本化薬	41.4	39.9	51,111	51,111
シキボウ	4	3.7	3,492	3,492	テイカ	4.9	4.6	6,412	6,412	カーリットホールディングス	6.9	6.3	5,859	5,859
日本毛織	21.4	20.2	21,068	21,068	石原産業	11.9	12.1	16,068	16,068	日本精化	5.4	4.8	12,201	12,201
ダイトウボウ	12.1	12.1	1,210	1,210	片倉コープアグリ	1.6	1.6	1,964	1,964	扶桑化学工業	6.7	5.3	27,931	27,931
トーア紡コーポレーション	2.6	2.3	995	995	日本曹達	9.9	9.1	32,760	32,760	トリケミカル	1.5	6.4	23,616	23,616
ダイドーリミテッド	9.7	7.6	1,307	1,307	東ソー	102.5	101.6	211,429	211,429	A D E K A	30.5	30.2	79,818	79,818
帝国繊維	7.5	7.6	15,922	15,922	トクヤマ	19.2	19.3	42,730	42,730	日油	24.9	24.9	167,826	167,826
帝人	54.1	61.6	100,038	100,038	セントラル硝子	13.5	12	26,532	26,532	新日本理化学	10.7	13	4,745	4,745
東レ	480.7	476.3	346,412	346,412	東亜合成	41.5	39	52,494	52,494	ハリマ化成グループ	5.5	4.7	4,488	4,488
サカイオーベックス	1.7	—	—	—	大阪ソーダ	6.7	6.4	17,984	17,984	花王	162	148.3	991,088	991,088
住江織物	1.4	1.4	2,641	2,641	関東電化	15.8	15	16,275	16,275	第一工業製薬	2.5	2.3	7,659	7,659
日本フェルト	3.5	3	1,401	1,401	デンカ	24.2	24	97,080	97,080	石原ケミカル	1.8	1.7	5,100	5,100
イチカワ	0.9	0.8	1,146	1,146	信越化学	113.7	121.6	2,571,840	2,571,840	日華化学	2.2	2.7	2,837	2,837

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ニイタカ	1.4	1.5	3,633		ジェイ エス ピー	4	4.3	7,193		出光興産	74.9	73.9	213,644	
三洋化成	3.9	3.9	23,478		エフピコ	7.5	12.5	53,500		ENEOSホールディングス	1,014.5	1,004.4	462,124	
有機合成薬品	5.9	5.7	1,846		天馬	4.5	5.2	15,600		コスモエネルギーHLDGS	19.7	21.3	50,523	
大日本塗料	7.5	7	6,188		信越ポリマー	12.2	9.9	10,662		<b>ゴム製品 (0.7%)</b>				
日本ペイント HOLD	54.7	247.6	323,118		東リ	16.8	14.7	3,528		横浜ゴム	39.4	39.2	77,772	
関西ペイント	74.5	74	217,486		ニフコ	25.1	25	90,625		TOYO TIRE	35.9	35.7	70,614	
神東塗料	6.8	5.8	1,142		パルカー	5.5	5.3	12,110		ブリヂストン	179.5	193.5	1,026,130	
中国塗料	18.8	16.4	14,727		ユニ・チャーム	143.7	129.4	640,788		住友ゴム	61.2	60.9	85,625	
日本特殊塗料	5	4.9	5,316		ショーエイコーポ	0.9	2.2	1,872		藤倉コンポジット	6.2	6.2	4,984	
藤倉化成	8.9	8.2	4,600		<b>医薬品 (5.1%)</b>					オカモト	4.1	3.9	17,316	
太陽ホールディングス	4.9	4.9	29,645		協和キリン	68	79	326,270		フコク	3	3.1	3,292	
D I C	28.1	27.2	89,488		武田薬品	562.5	558.4	2,099,025		ニッタ	7.7	6.8	19,278	
サカタインクス	14.6	13.7	16,686		アステラス製薬	586.3	581.9	1,091,644		住友理工	13.3	13.3	9,948	
東洋インキSCホールディング	13.9	13.3	28,222		大日本住友製薬	50.2	50.2	103,261		三ツ星ベルト	9	7.7	16,023	
T & K T O K A	5.1	4.6	4,057		塩野義製薬	85.1	84.3	621,375		バンドー化学	12	11.1	10,678	
富士フィルム HLDGS	129.7	118.1	1,144,861		わかもと製薬	8.5	8.5	2,924		<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>				
資生堂	134.5	125.3	957,041		あすか製薬	7.7	—	—		日東紡績	10.1	10	37,250	
ライオン	88	81.1	149,629		日本新薬	17.7	19.1	183,933		A G C	62.1	61.7	351,690	
高砂香料	4.3	4.2	12,768		ピオフエルミン製薬	1.2	—	—		日本板硝子	32.3	34.6	19,895	
マンダム	15.3	14.5	23,214		中外製薬	211.4	210.1	867,502		石塚硝子	1.2	1	2,262	
ミルボン	9.1	8.5	58,310		科研製薬	11.6	11.3	54,409		日本山村硝子	2.8	2.4	2,200	
ファンケル	27.5	24.7	94,477		エーザイ	81	74.4	623,397		日本電気硝子	25.5	26.9	64,775	
コーセー	12.8	12.8	165,120		ロート製薬	34.7	31.8	111,141		オハラ	2.7	2.8	4,370	
コタ	3.9	4.7	7,985		小野薬品	155.3	153.7	409,303		住友大阪セメント	12.8	11.9	37,544	
シーボン	0.8	0.8	1,518		久光製薬	17.9	19.4	84,293		太平洋セメント	43	38	93,100	
ポーラ・オルビス HD	29.1	28.9	74,851		持田製薬	9.3	9.2	32,660		日本ヒューム	6.7	5.6	4,211	
ノエビアホールディングス	5.8	5.6	33,544		参天製薬	126.1	117	189,540		日本コンクリート	14.6	15	4,665	
アジロバンホールディング	1.4	1.9	2,029		扶桑薬品	2.4	2.1	5,571		三谷セキサン	3.1	3.1	21,359	
エステー	4.4	4.2	7,677		日本ケミファ	0.9	0.8	1,876		アジアパイルHD	9.6	9.6	4,809	
アグロカネショウ	2.7	2.5	3,887		ツムラ	21	22.5	86,062		東海カーボン	66.3	56.9	87,284	
コニシ	11.1	10.9	19,652		日医工	19.2	19	17,252		日本カーボン	3.5	3.7	15,743	
長谷川香料	11.7	11.5	32,959		キッセイ薬品工業	12	11.5	28,957		東洋炭素	4	4.6	13,938	
星光PMC	3.8	3.8	3,332		生化学工業	13.2	11.5	12,937		ノリタケ	3.8	3.7	17,038	
小林製薬	19	18.8	171,080		栄研化学	11.9	12	26,988		T O T O	48.3	47.9	267,282	
荒川化学工業	6.1	5	6,455		日水製薬	2.8	2.5	2,555		日本碍子	81.6	73.3	138,097	
メック	4.6	5.2	18,746		鳥居薬品	4.3	4.2	12,810		日本特殊陶業	51.6	51.5	92,545	
日本高純度化学	1.8	2	6,140		J C R ファーマ	4.8	19.3	56,857		ダントーホールディングス	6.3	6.2	1,612	
タカラバイオ	17.8	17.7	57,436		東和薬品	8.6	9.8	32,634		M A R U W A	2.6	2.4	28,368	
J C U	8.2	7.5	35,550		富士製薬工業	4.6	4.5	5,413		品川リフラクトリズ	1.7	1.5	5,985	
新田ゼラチン	4	4	2,632		沢井製薬	13.9	—	—		黒崎播磨	1.3	1.1	5,522	
O A T アグリオ	1.2	1.2	2,274		ゼリア新薬工業	12.3	12.1	26,414		ユーティ	5.3	5	6,855	
デクセラリアルズ	17.6	19.6	44,825		第一三共	193.5	527.7	1,593,654		インソライト	3.4	3	2,406	
アース製薬	4.8	5.6	39,144		キョーリン製薬HD	15	14.8	27,557		東京窯業	8.4	7.7	2,671	
北興化学	6.6	6.4	7,603		大幸薬品	8.3	10.5	9,933		ニッカトー	3	2.9	2,093	
大成ラミック	2.2	2.4	6,955		ダイト	4.2	4.3	15,028		フジミンコボレーテッド	6.1	5.5	37,125	
クミアイ化学	28.1	27.1	25,474		大塚ホールディングス	140.5	139	675,123		クニミネ工業	2.8	2.2	2,490	
日本農業	12	12.1	6,776		大正製薬HD	14.3	16.8	113,232		エーアンドエーテリアル	1.1	0.9	909	
アキレス	4.7	4.5	6,228		ペプチドリーム	34.4	35.4	133,989		ニチアス	18.6	16.9	48,824	
有沢製作所	10.7	9	8,163		あすか製薬HD	—	7.8	8,564		ニチハ	9.5	9.2	31,050	
日東電工	46.7	40.5	336,555		サワイグループHD	—	14.8	76,664		<b>鉄鋼 (0.8%)</b>				
レック	7.2	7.8	8,689		<b>石油・石炭製品 (0.4%)</b>					日本製鉄	299.9	317	651,910	
三光合成	7.5	7.2	3,297		日本コークス工業	56	58.3	7,695		神戸製鋼所	123.2	122.5	83,912	
きもと	12.4	12.7	3,225		ニチレキ	8	7.7	10,564		中山製鋼所	8.7	8.4	3,654	
藤森工業	6.1	6	29,580		ユシロ化学	3.7	3.4	4,158		合同製鐵	3.6	3.5	5,390	
前澤化成工業	4.3	4.5	5,868		ビービー・カストロール	2.4	2.4	3,324		J F E ホールディングス	181.8	192.4	339,008	
未来工業	3.5	2.5	4,135		富士石油	17.7	18.9	4,895		東京製鐵	32.6	26.2	31,518	
ウェーブロックHLDGS	2.3	2.3	1,626		M O R E S C O	2.3	2.1	2,564		共英製鋼	7.6	7.4	10,493	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
大和工業	14.2	14.1	53,721	53,721	信和	3.6	3.5	2,520	2,520	豊和工業	3.9	3.8	3,195	3,195
東京製鋼	2.7	2.7	4,363	4,363	東洋製罐グループHD	42.9	42.4	57,028	57,028	OKK	2.7	2.9	1,209	1,209
大阪製鋼	3.6	3.3	3,719	3,719	ホッカンホールディングス	3.7	3.1	4,535	4,535	石川製作所	1.7	1.8	2,943	2,943
淀川製鋼所	8.9	8.4	21,092	21,092	コナ	3.4	3.7	3,407	3,407	東洋機械金属	4.6	3.9	2,020	2,020
丸一鋼管	21.7	21.4	59,192	59,192	横河ブリッジHLDGS	12.5	11.6	28,744	28,744	津田駒工業	1.2	1.3	1,095	1,095
モリ工業	2	1.9	4,694	4,694	駒井ハルテック	1.2	1.4	2,490	2,490	エンシュウ	1.5	1.4	1,124	1,124
大同特殊鋼	11.1	11	54,560	54,560	高田機工	0.6	0.6	1,765	1,765	島精機製作所	10.6	9.4	22,785	22,785
日本高周波	2.4	2.3	945	945	三和ホールディングス	63.4	62.7	94,739	94,739	オプトラン	7.5	8.3	19,239	19,239
日本冶金工	5.5	5.1	13,948	13,948	文化シャッター	19.8	20.2	23,896	23,896	NCホールディングス	2	2.7	3,780	3,780
山陽特殊製鋼	4.6	7.8	13,540	13,540	三協立山	8.7	8.7	6,907	6,907	イワキポンプ	4.2	4	4,124	4,124
愛知製鋼	3.6	3.8	10,374	10,374	アルインコ	4.9	4.4	4,545	4,545	フリュー	6.5	6.8	12,512	12,512
日立金属	72.1	63.1	135,791	135,791	東洋シャッター	1.7	1.7	1,147	1,147	ヤマシンフィルタ	14.6	13.8	9,480	9,480
日本金属	1.6	1.7	1,866	1,866	LIXIL	98.8	91.3	287,595	287,595	日阪製作所	8.4	8.1	7,500	7,500
大太平洋金属	4.5	4.5	8,523	8,523	日本ファイルコン	5	4.2	2,196	2,196	やまびこ	13	12.6	16,430	16,430
新日本電工	43.6	44.3	14,530	14,530	ノーリツ	14	13.6	25,513	25,513	平田機工	3.2	3	21,060	21,060
栗本鉄工所	3.3	2.9	4,903	4,903	長府製作所	6.8	6.5	14,098	14,098	ペガサスモシン製造	6.6	6.6	2,976	2,976
虹技	1	0.8	919	919	リンナイ	13.1	12.9	168,345	168,345	マルマエ	2.7	2.9	6,304	6,304
日本鑄鉄管	0.8	0.7	850	850	ダイニチ工業	3.5	3.8	2,990	2,990	タツメ	3.1	3.1	5,006	5,006
三菱製鋼	4.9	5	6,450	6,450	日東精工	9.2	8.6	5,882	5,882	ナブテスコ	39.5	39	181,935	181,935
日亜鋼業	9.6	8.8	2,798	2,798	三洋工業	0.8	0.7	1,332	1,332	三井海洋開発	7.1	7.3	12,548	12,548
日本精線	1.1	1	5,010	5,010	岡部	13.7	12.2	8,564	8,564	レオン自動車	6.6	6.3	9,884	9,884
エンビプロHD	3	3.2	5,705	5,705	ジーテクト	8.4	7.9	11,865	11,865	S/MC	21.2	19.6	1,515,668	1,515,668
シンニッタン	10.4	8.5	2,116	2,116	東プレ	12.6	12.3	16,912	16,912	ホソカワミクロン	2.4	2.3	16,744	16,744
新家工業	1.5	1.6	2,481	2,481	高周波熱錬	12.9	11.8	8,047	8,047	ユニオンツール	2.5	2.6	10,439	10,439
<b>非鉄金属 (0.7%)</b>					東京製鋼	4.7	2.9	2,871	2,871	オイレス工業	8.8	8.9	15,379	15,379
大紀アルミニウム	11	10.1	18,664	18,664	サンコール	4.9	5.4	2,565	2,565	日精エーエスピー	2	2.2	9,130	9,130
日本軽金属HD	170.7	17.7	35,683	35,683	モリテックスチル	5.4	5.4	2,467	2,467	サトーホールディングス	9.6	8.6	24,123	24,123
三井金属	18.2	18	59,400	59,400	パイオラックス	9.9	9.3	14,703	14,703	技研製作所	5.9	5.9	28,585	28,585
東邦亜鉛	3.4	3.6	10,328	10,328	エイチワン	6.4	6.4	4,755	4,755	日本エアーテック	2.3	3.2	4,099	4,099
三菱マテリアル	44.2	43.6	97,620	97,620	日本発条	72	66.5	53,931	53,931	カワタ	1.9	1.8	1,816	1,816
住友鉱山	85.5	85	351,985	351,985	中央発条	0.7	4.4	4,950	4,950	日精樹脂工業	5.6	5.5	6,534	6,534
DOWAホールディングス	17	17	77,775	77,775	アドパネクス	0.9	1.1	1,513	1,513	オカダアイオン	2	2.1	2,883	2,883
古河機金	12	10.3	12,833	12,833	立川プラインド	3	3.1	4,123	4,123	ワイエイシイホールディングス	2.8	2.8	2,548	2,548
エス・サイエンス	37.6	35.4	1,239	1,239	三益半導体	5.3	5	12,975	12,975	小松製作所	306.9	304	825,208	825,208
大阪チタニウム	6.9	6.7	5,286	5,286	<b>機械 (5.6%)</b>					住友重機械	39	38.5	116,462	116,462
東邦チタニウム	12	12.5	14,875	14,875	日本ドライケミカル	1.7	1.6	3,721	3,721	日立建機	27.3	31.6	100,804	100,804
UACJ	10.2	10	28,670	28,670	日本製鋼所	20.4	20.3	60,027	60,027	日工	9.2	10.1	6,928	6,928
CKサンエツ	1.4	1.4	4,620	4,620	三浦工業	28.9	28.8	144,000	144,000	巴工業	2.7	2.6	6,541	6,541
古河電工	20.9	20.6	49,543	49,543	タクマ	22.7	22.9	37,349	37,349	井関農機	6.8	6.3	10,930	10,930
住友電工	250.1	230.9	344,618	344,618	ツガミ	13.9	14.3	27,770	27,770	TOWA	6.8	6.3	17,595	17,595
フジクラ	81.2	80.7	55,440	55,440	オークマ	7.9	7.6	42,864	42,864	丸山製作所	1.8	1.3	2,141	2,141
昭和電線HLDGS	7.8	6.7	15,470	15,470	芝浦機械	7.6	6.8	18,938	18,938	北川鉄工所	3	2.7	4,471	4,471
東京特殊電線	1	0.7	2,065	2,065	アマダ	83.3	97.1	116,617	116,617	ローツェ	3	3.1	27,962	27,962
タツタ電線	13.3	12.5	6,787	6,787	アイダエンジニア	17.7	16.9	18,995	18,995	タカキタ	2.5	2.2	1,546	1,546
カナレ電気	1.1	0.9	1,592	1,592	滝澤鉄工所	2	1.8	2,068	2,068	クボタ	359	327.4	791,980	791,980
平河ヒューテック	3.3	3.7	4,621	4,621	FUJI	29	26.4	80,652	80,652	荏原実業	1.7	3.4	9,832	9,832
リョービ	8.3	7.8	10,124	10,124	牧野フライス	7.9	7.7	34,342	34,342	三菱化工機	2.3	2.3	5,646	5,646
アールステイ	8.6	8.1	3,726	3,726	オーエスジー	31.2	30.3	62,024	62,024	月島機械	12.6	11.8	14,289	14,289
アサヒHD	11.8	25.6	54,528	54,528	ダイジェット	0.7	0.7	884	884	帝国電機製作所	5.6	4.5	6,507	6,507
<b>金属製品 (0.6%)</b>					旭ダイヤモンド	17.6	16.3	10,660	10,660	東京機械	3.1	3.4	6,721	6,721
稲葉製作所	3.7	4.9	6,909	6,909	DMG森精機	42.6	39.7	84,402	84,402	新東工業	16.2	15.3	12,148	12,148
宮地エンジニアリングG	2	2.3	6,046	6,046	ソディック	15.4	16.1	15,182	15,182	渋谷工業	5.9	5.9	19,145	19,145
トーカロ	18.7	16.7	24,248	24,248	ディスコ	9.1	9	303,300	303,300	アイチコーポレーション	11.8	11.2	8,803	8,803
アルファCO	2.2	2.2	2,851	2,851	日東工器	3.7	3.2	6,556	6,556	小森コーポレーション	17.3	16.8	15,120	15,120
SUMCO	80.1	84.6	201,771	201,771	日進工具	2.6	5.1	7,466	7,466	鶴見製作所	5.1	5	9,225	9,225
川田テクノロジーズ	1.4	1.3	4,914	4,914	パンチ工業	5.9	5.8	3,642	3,642	住友精密	1	0.9	2,277	2,277
RS TECHNOLOGIES	1.9	2.2	13,574	13,574	富士ダイス	2.9	2.8	1,920	1,920	日本ギア工業	2.4	2.4	760	760



## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
酒井重工業	1.2	1.1	2,866		マキタ	88.2	87.6	598,308		セイコーエプソン	84.4	83.4	190,068	
荏原製作所	28.1	28	162,960		日立造船	53.6	54.6	50,232		ワコム	45.8	49.2	36,211	
石井鉄工所	0.9	0.9	2,799		三菱重工業	113.9	105.7	316,360		アルバック	12.5	12.5	81,500	
西島製作所	6.8	6.6	6,263		IHI	49.1	45.3	116,375		アクセル	2.7	2.8	2,164	
北越工業	7	6.8	7,051		スター精密	10.5	10.4	17,097		EIZO	5.3	5.8	24,766	
ダイキン工業	86.2	85.5	2,281,140		電気機器 (18.8%)					ジャパンディスプレイ	61.7	61.7	2,282	
オルガノ	2.4	2.3	16,031		日清紡ホールディングス	42.4	40.4	33,814		日本信号	17.4	15.5	15,577	
トーヨーカネツ	3	2.6	7,001		イビデン	41.5	32.6	217,442		京三製作所	15.8	13.4	7,169	
栗田工業	36.7	36.7	215,796		コニカミノルタ	148.9	137.2	82,457		能美防災	9	8.8	18,585	
椿本チエイン	9.8	9.6	34,800		ブラザー工業	83.1	81.6	207,753		ホーチキ	4.9	4.6	5,543	
大同工業	3.2	3.3	3,643		ミネベアミツミ	125.9	115.7	340,505		星和電機	3.5	3.4	1,788	
木村化工機	5.7	6.3	4,731		日立	325	322.9	2,080,444		エレコム	7.6	15.6	29,016	
アナスト岩田	10.6	10.9	10,627		東芝	—	133	629,090		パナソニック	773.4	715.6	990,748	
ダイフク	34.7	37	412,180		三菱電機	676.1	670.3	1,056,727		シャープ	78.8	89.6	124,185	
サムコ	1.9	1.7	5,040		富士電機	41	40.6	208,278		アンリツ	43.6	40.9	83,108	
加藤製作所	3.7	3.4	3,083		東洋電機製造	2.4	2.4	2,865		富士通ゼネラル	18.5	20.8	60,569	
油研工業	1.1	0.9	1,611		安川電機	72.9	72.2	423,814		ソニーグループ	423.6	420.6	5,190,204	
タダノ	32.8	32.7	39,141		シンフォニアテクノロジー	8.8	8.6	10,569		TDK	32.7	32.5	404,950	
フジテック	24.8	23.3	66,731		明電舎	12.5	11.3	28,464		帝国通信工業	3	2.7	4,317	
CKD	18.7	15.7	39,673		オリジン	1.8	1.6	2,160		タムラ製作所	22.7	25.2	18,849	
キトー	5.2	5.6	10,332		山洋電気	3.3	3.3	24,090		アルプスアルパイン	60.3	54.7	66,351	
平和	18.7	18.3	37,789		デンヨー	5.8	5.6	12,796		池上通信機	2.1	2.4	1,936	
理想科学工業	6	5	12,535		東芝テック	8.5	7.2	34,020		日本電波工業	6.3	7.1	6,397	
SANKYO	15	16	44,816		芝浦メカトロニクス	1.2	1.3	9,646		鈴木	3.3	3.1	2,690	
日本金銭機械	7.3	6.6	4,237		マブチモーター	18.8	15.7	60,288		日本トリム	0.9	1.6	6,056	
マースグループHLDGS	4.2	3.8	6,422		日本電産	162.7	161.6	2,156,552		ローランドディー・ジー	3.7	4	12,400	
フクシマガリレイ	4.2	4.7	24,205		ユーエムシーエレクトロニクス	4.2	3.9	3,026		フオスター電機	7.1	6.6	6,164	
オーイズミ	2.8	2.3	883		トレックス・セミコンダクター	3.9	3.8	10,138		SMMK	1.7	1.6	3,825	
ダイコク電機	3.1	2.6	3,426		東高岳	3.7	3.4	5,113		ヨコオ	4.4	5.5	14,157	
竹内製作所	11.4	11.6	30,345		ダブル・スコープ	10.7	19.3	17,370		ティアック	4.9	5.2	608	
アマノ	17.8	17.6	52,800		宮越ホールディングス	2.7	2.7	3,472		ホシデン	18.6	18	17,154	
JUKI	9.3	9.2	7,709		ダイヘン	7.5	7.4	37,518		ヒロセ電機	10.4	10.4	204,568	
サンデンホールディングス	9	9.2	2,723		ヤーマン	11.1	11.5	16,514		日本航空電子	15.6	15.8	26,322	
蛇の目ミシン	6	6.5	4,927		JVCケンウッド	55.1	60.1	12,621		TOA	7.3	7.4	6,445	
マックス	10.4	8.8	17,485		ミマキエンジニアリング	6	6.2	5,611		マクセルホールディングス	14.6	13.1	17,344	
グローリー	17.5	16.9	42,976		IPEX	2.8	3.2	6,595		古野電気	8.7	8.5	9,868	
新晃工業	6.3	6.3	14,351		日新電機	16	15.8	22,467		ユニデンホールディングス	1.9	1.8	5,094	
大和冷機工業	9.8	10.9	13,995		大崎電気	13.3	13.2	7,418		スミダコーポレーション	5.2	6.2	7,570	
セガサミーホールディングス	67.1	60.8	96,976		オムロン	60.6	55.8	640,584		アイコム	3.8	2.8	6,857	
日本ピストンリング	2.4	2.7	3,982		日東工業	10	9.8	17,257		リオン	2.8	2.9	8,265	
リケン	3.1	2.9	8,418		IDEC	9.8	9.2	20,884		本多通信工業	5.8	4.4	2,173	
TPR	9.1	8.6	13,201		正興電機製作所	1.8	2.5	3,585		船井電機	6.8	—	—	
ツバキ・ナカシマ	13.8	15	22,755		不二電機工業	1	1	1,276		横河電機	62.5	66.6	131,068	
ホシザキ	19.9	19.6	208,152		ジーエス・ユアサコーポ	22.7	24.4	63,049		新電元工業	2.4	2.7	11,164	
大豊工業	5.4	6	5,106		サクサホールディングス	1.5	1.5	2,121		アズビル	42.9	45.6	233,472	
日本精工	128.4	138	104,466		メルコホールディングス	2.3	2.4	11,904		東亜ディーケーケー	3.3	2.8	2,836	
NTN	157.3	154.3	38,575		テクノメヂカ	1.5	1.4	2,380		日本光電工業	28	27.8	109,254	
ジェイテクト	65.5	64.7	62,176		ダイヤモンドエレクトロニクスHD	1.4	2	4,736		チノー	2.3	1.8	2,685	
不二越	6.4	6	27,420		日本電気	82	85.5	531,810		共和電業	6.9	6.6	2,580	
日本トムソン	19.9	18.6	10,230		富士通	65.2	60.5	1,272,315		日本電子材料	2.7	2.9	5,585	
THK	39.6	39	100,893		沖電気	27.7	27.1	26,639		堀場製作所	13.5	12.3	101,106	
ユーシン精機	5.3	4.3	3,581		岩崎通信機	2.9	2.9	2,636		アドバンテクト	50.5	50	555,000	
前澤給装工業	2.4	4.7	4,991		電気興業	3.3	3.1	8,022		小野測器	2.7	2.5	1,367	
イーグル工業	8.5	8.1	10,327		サンケン電気	7.4	7.5	51,525		エスベック	6	5.8	13,728	
前澤工業	4	4.9	3,973		ナカヨ	1.3	1.1	1,580		キーエンス	61.3	65.9	4,720,417	
日本ビラー工業	6.8	7.3	20,272		アイホン	3.8	4.3	10,109		日置電機	3.3	3.3	32,241	
キッツ	27.7	22.6	19,187		ルネサスエレクトロニクス	290.1	362.2	496,938		シスメックス	48.3	52.4	769,756	



銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
日本マイクロニクス	11.8	11.5	17,664		三機工業	8.6	9.5	10,089		クリエートメディック	2.1	1.8	1,796	
メガチップス	6.3	6.7	23,215		デンソー	148.8	147.8	1,143,972		日機装	20.4	21.5	20,790	
OBARA GROUP	4	3.7	15,336		東海理化電機	18	17.5	28,892		日本エム・ディ・エム	3.9	4	9,068	
澤藤電機	0.9	0.8	1,640		三井E&SHD	21.7	21.7	10,524		島津製作所	80.9	86.5	462,775	
原田工業	3.2	2.7	2,600		川崎重工業	53	52.7	128,904		JMS	5.7	5.9	4,967	
コーセル	9	8.2	8,167		名村造船所	22.2	21.9	5,277		クボテック	1.9	1.8	545	
イリソ電子工業	5.7	5.7	27,075		サノヤスホールディングス	9.4	9.8	1,381		長野計器	5	5.1	5,967	
オプテックスグループ	11.2	11.1	17,438		日本車輛	2.5	2.2	4,620		ブイ・テクノロジ	3.2	3.1	14,554	
千代田インテグレ	2.9	2.7	5,896		三菱ロジスネクスト	9	9.1	10,474		東京計器	4.2	4.1	4,309	
アイ・オー・データ	2.3	2.4	2,205		近畿車輛	1	1	1,154		愛知時計	0.9	0.7	3,360	
レーザーテック	29.8	29.6	843,896		日産自動車	799.9	790.6	439,810		インターアクション	3.6	3.5	9,877	
スタンレー電気	47.5	46.9	134,696		いすゞ自動車	196.8	178.9	264,593		オーバル	6.4	6.6	1,782	
岩崎電気	2.6	2.4	4,915		トヨタ自動車	754.3	680.1	6,752,712		東京精密	12.4	11.4	54,492	
ウシオ電機	37.6	35	75,145		日野自動車	85.1	84.6	85,699		マニ	27	26.7	60,261	
岡谷電機	5.2	4.6	1,669		三菱自動車工業	252.4	250.8	69,973		ニコン	104.1	102.7	134,947	
ヘリオステックノH	6.3	6.2	2,083		エフテック	4.8	5.3	3,354		トプコン	34.3	34	70,142	
エノモト	2	2.1	3,906		レシップホールディングス	2.6	2.9	1,737		オリンパス	374.2	352.1	818,984	
日本セラミック	6.9	6.7	20,535		GMB	1.5	1.6	1,454		理研計器	6	5.9	18,142	
遠藤照明	3.3	3.3	3,356		ファルテック	1.4	1.4	1,037		タムロン	5.5	5.6	15,573	
古河電池	4.8	4.9	7,604		武蔵精密工業	15.1	15.4	29,768		HOYA	134.1	131	2,412,365	
双信電機	3.3	3.3	2,847		日産車体	13.3	9.3	7,393		シード	2.9	2.4	1,644	
山一電機	4.9	4.5	7,600		新明和工業	18.3	19.5	18,681		ノーリツ鋼機	4.6	6.2	17,050	
図研	4.4	4.6	19,619		極東開発工業	12.6	11.6	20,172		エー・アンド・デイ	6.1	5.8	6,153	
日本電子	13.4	12.4	112,096		日信工業	13.3	—	—		朝日インテック	76.6	72.2	233,928	
カシオ	60.3	54	97,902		トビー工業	5.6	5.4	6,744		シチズン時計	79.6	85.2	44,730	
ファナック	63.6	58.9	1,506,367		ティラド	2.4	2.2	7,150		リズム	2.1	1.9	2,832	
日本シイエムケイ	15.9	13.9	6,268		タチエス	11.1	10.5	13,734		大研医器	5.1	4.8	2,976	
エンプラス	3.5	3.1	9,935		NOK	36.6	32.4	44,226		メニコン	9.6	10.5	95,550	
大真空	2.5	2.5	10,100		フタバ産業	18.9	16.1	7,711		シンシア	0.9	1.4	942	
ローム	28.2	27.9	312,759		K Y B	7.6	7.7	23,408		松風	3	3.2	7,033	
浜松ホトニクス	48.5	48.3	339,066		大同メタル工業	13.1	13	8,177		セイコーHD	9.6	9.7	21,378	
三井ハイテック	7.5	6.7	57,151		プレス工業	33.6	32.6	11,279		ゼロ	46.9	49.8	59,062	
新光電気工業	22.9	22.9	90,111		ミクニ	8.4	7.9	2,607		<b>その他製品 (2.2%)</b>				
京セラ	95	102	713,592		太平洋工業	14.3	14.1	17,018		中本パックス	1.6	1.6	3,056	
太陽誘電	30.2	30	221,700		ケーヒン	15	—	—		スノーピーク	3.5	4.5	27,225	
村田製作所	198.6	197.2	1,974,958		河西工業	9.2	9.4	3,609		パラマウントベッドHD	7.1	12.5	28,337	
双葉電子工業	10.8	10.8	8,834		アイシン	55.7	49.2	205,656		トランザクション	4.4	4.5	5,445	
北陸電気工業	2.7	2.2	2,321		マツダ	200.4	211.9	198,126		粧美堂	2	2.3	984	
ニチコン	23.1	21.8	23,805		今仙電機製作所	6.1	5.6	4,076		二ホンフラッシュ	6.3	5.7	6,697	
日本ケミコン	5.1	7	15,582		本田技研	532.4	528.2	1,763,131		前田工織	7.5	7.6	26,182	
K O A	10.2	9.6	17,068		スズキ	134.2	133.1	676,946		永大産業	8.6	8.6	2,648	
市光工業	10.2	9.8	6,154		SUBARU	210.2	192	394,944		アートネイチャー	7.2	6.3	4,699	
小糸製作所	40.6	40.1	273,482		安永	3.3	3.2	3,830		パナダイナムコHLDGS	69.9	55.5	493,006	
ミツバ	12.4	12.7	8,521		ヤマハ発動機	88.9	87.8	270,863		アイフィスジャパン	1.8	1.8	1,294	
SCREENホールディングス	11.8	11.7	119,457		ショーワ	15.4	—	—		共立印刷	11.3	8.2	1,459	
キャノン電子	6.1	6.2	10,180		T B K	7.9	7.4	3,100		S H O E I	6	6.5	34,125	
キャノン	336.3	333.6	896,716		エクセディ	9.3	9.1	15,925		フランスベッドHLDGS	9.2	9.8	9,359	
リコー	173.2	171.6	188,931		豊田合成	22	22	50,446		パイロットコポレーション	11.1	11.1	49,062	
象印マホービン	18.4	17.9	33,562		愛三工業	10.6	10.6	8,957		萩原工業	3.7	3.8	6,224	
MUTOHホールディングス	1	0.9	1,499		盟和産業	1	1.1	1,153		トップパン・フォームズ	14.6	11.9	12,304	
東京エレクトロン	43	39.3	2,124,951		日本プラスト	5	5.1	3,401		フジールインターナショナル	15.3	13.7	35,784	
<b>輸送用機器 (7.6%)</b>					ヨロズ	6.4	5.5	6,809		タカラトミー	30.5	30.3	35,784	
トヨタ紡織	19.8	19.8	39,857		エフ・シー・シー	11.2	10.5	16,401		廣済堂	4.9	5.2	8,632	
芦森工業	1.3	1.2	1,258		シマノ	25.3	27.1	929,530		エスデルホールディングス	2	4	2,640	
ユニプレス	13.2	10.6	9,826		テイ・エス・テック	15.7	30.8	44,752		タカノ	2.6	2.1	1,745	
豊田自動織機	54.8	54.3	518,565		ジャムコ	3.3	4.3	4,235		プロネクサス	5.8	5.3	5,787	
モリタホールディングス	12	10.2	16,238		<b>精密機器 (3.0%)</b>					ホクシン	5.7	6.9	1,166	
					テルモ	191.4	205.8	1,094,032						

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ウッドワン	2.4	2.5	2,870		小田急電鉄	100.5	107.3	276,297		浜沢倉庫	3.5	3.4	8,255	
大建工業	4.6	4.5	10,651		京王電鉄	35.1	37.4	224,026		東陽倉庫	11.3	9.6	3,398	
凸版印刷	95.9	101.3	201,789		京成電鉄	47.1	50.5	179,527		日本トランスシティ	13.8	13.5	9,045	
大日本印刷	88.8	79	217,961		富士急行	9.3	9.2	42,136		ケイヒン	0.9	1.1	1,577	
共同印刷	2.1	2	5,564		新京成電鉄	1.7	1.9	4,142		中央倉庫	3.9	3.5	3,661	
N I S S H A	13.9	13.8	25,281		東日本旅客鉄道	119	118.2	837,801		川西倉庫	1.1	1.1	1,468	
光村印刷	0.6	0.6	1,030		西日本旅客鉄道	60.4	75	389,400		安田倉庫	5.1	5	5,005	
TAKARA & COMPANY	3.3	3.3	6,039		東海旅客鉄道	56.2	55.8	913,167		ファイズホールディングス	1.4	1.4	1,073	
アシックス	56.2	59.7	152,772		西武ホールディングス	88.9	81.3	108,372		東洋埠頭	2	1.8	2,818	
ツツミ	2.1	2.1	4,953		鴻池運輸	10.9	10.4	14,227		宇徳	5.5	5.4	3,099	
小松ウオール工業	1.9	2.2	4,371		西日本鉄道	18.8	18.4	52,826		上組	35.7	34.9	83,829	
ヤマハ	40.3	39.9	290,073		ハマキョウレックス	5.2	5	17,275		サンリツ	1.5	1.9	1,569	
河合楽器	2.1	2	7,820		サカイ引越センター	3.6	3.2	15,808		キムラユニティ	1.6	1.4	2,146	
クリナップ	6.3	6	3,588		近鉄グループHLDGS	64.1	63.4	236,482		キューソー流通システム	1.6	1.5	2,802	
ビジョン	41.2	40.8	117,136		阪急阪神HLDGS	85.4	84	295,680		近鉄エクスプレス	13.7	12	37,680	
オリバー	1.4	—	—		南海電鉄	30.5	29.8	71,132		東海運	3.6	4	1,404	
兼松サステック	0.4	0.6	1,086		京阪ホールディングス	28.5	28.3	88,296		エーアイティー	4.5	4.1	5,079	
キングジム	5.7	5.6	5,006		神戸電鉄	1.5	1.5	5,422		内外トランスライン	2.1	2.7	6,642	
リンテック	16.1	14	37,450		名古屋鉄道	52.4	52.3	106,901		日本コンセプト	2	2.2	4,952	
イトーキ	14.4	12.9	5,108		山陽電鉄	4.7	4.4	9,081		<b>情報・通信業 (8.5%)</b>				
任天堂	41.5	38.5	2,027,410		日本通運	22.2	22	178,640		NEC ネットズエスアイ	18.9	22.3	49,082	
三菱鉛筆	11.3	10.6	15,984		ヤマトホールディングス	112.3	89.1	259,637		クロスキャット	1.8	1.8	2,545	
タカラスタンダード	13.7	13.2	21,978		山九	17.8	16.2	86,670		システナ	23.7	24	57,360	
コクヨ	32.3	32.5	65,162		丸連	3.5	4.3	1,186		デジタルアーツ	3.3	3.9	36,114	
ナカバヤシ	6.6	5.8	3,520		丸全昭和運輸	5.2	5.2	19,136		日鉄ソリューションズ	9.9	9.7	38,751	
グローブライド	3	3.4	32,164		センコーグループHLDGS	34.9	36.2	38,010		キューブシステム	3.5	3.8	4,187	
オカムラ	23.5	23.6	40,049		トナミホールディングス	1.5	1.5	7,875		WOW WORLD	1.4	1.7	2,981	
美津濃	6.2	6.8	18,700		ニッコンホールディングス	22.9	21.3	52,376		コア	2.8	2.6	4,053	
<b>電気・ガス業 (1.2%)</b>					日石輸送	0.6	0.6	1,602		ラクーンホールディングス	3.2	5	7,595	
東京電力HD	542	573.4	177,180		福山通運	8.2	8.1	40,743		ソリトンシステムズ	3.1	3.6	5,569	
中部電力	205.8	204.9	279,483		セイノーホールディングス	47.9	47.6	65,640		ソフトクリエイトHD	2.9	2.7	9,396	
関西電力	255.9	253.5	291,905		エスライン	1.7	1.3	1,231		T I S	66.3	66.3	210,171	
中国電力	97.1	97.7	104,343		神奈川中央交通	1.5	1.5	5,415		JNSホールディングス	2.8	4.3	2,201	
北陸電力	62.2	62.4	38,438		日立物流	11.7	13.4	66,866		電算システム	2.5	—	—	
東北電力	168.3	156.4	134,660		丸和運輸機関	6.8	13.8	23,156		グリ	40.9	42.6	27,349	
四国電力	61.1	55.1	45,567		C&Fロジホールディングス	6.5	6.3	12,196		コーエーテックモHD	13.6	17.9	105,252	
九州電力	139.3	148.5	130,531		九州旅客鉄道	56.3	49.5	123,255		三菱総合研究所	2.9	2.8	12,418	
北海道電力	63.7	64.3	35,300		SGホールディングス	67.2	120.5	407,892		ホルテージ	1.9	3.1	1,398	
沖縄電力	13.2	13	19,487		<b>海運業 (0.6%)</b>					電算	0.7	0.8	2,064	
電源開発	54	53.3	88,904		日本郵船	53.7	53.4	537,204		AGS	3.7	3.1	3,081	
エフオン	3.7	4.5	4,090		商船三井	40.7	37.9	348,301		ファインデックス	5.7	6.1	6,423	
イーレックス	9.7	10.2	28,968		川崎汽船	19.8	19.8	144,738		ブレインパッド	1.7	1.9	11,552	
レノバ	11.3	11.7	64,233		NSユナイテッド海運	3.6	3.2	16,096		K L a b	12.6	12	7,296	
東京瓦斯	130.1	128.7	277,798		明治海運	6.6	7	6,251		ポルトタウン・ピットクル	8	8.9	9,095	
大阪瓦斯	131.5	120.9	257,396		飯野海運	30.2	29.3	16,818		イーブグイニシアティブ	0.9	1.3	5,297	
東邦瓦斯	33.3	33.1	179,733		共栄タンカー	1.2	1.2	1,300		ネクソン	167.2	148.6	259,752	
北海道瓦斯	3.6	3.5	5,607		乾汽船	3.7	4.5	12,060		アイスタイル	18.4	21.6	9,763	
広島ガス	13	11.7	4,680		<b>空運業 (0.5%)</b>					エムアップホールディングス	1.9	2	6,730	
西部ガスHLDGS	7.6	7.4	18,973		日本航空	113.5	155.4	388,344		エイチーム	4.5	5.1	7,435	
静岡ガス	19.3	19.3	24,993		ANAホールディングス	117.3	172	466,120		エニグモ	6.3	6.5	8,417	
メタウォーター	3.3	7.9	15,215		パスコ	1.3	1.3	1,913		テクノスジャパン	5.3	5.3	3,296	
<b>陸運業 (3.1%)</b>					<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>					enish	3.5	3.9	1,770	
SBSホールディングス	5.1	5.4	22,923		トランコム	1.8	2	17,400		コロプラ	21.9	21.3	17,657	
東武鉄道	70.4	69.5	206,971		日新	5.6	4.9	8,467		オルトプラス	4.6	5.1	2,142	
相鉄ホールディングス	21.6	22.6	50,488		三菱倉庫	20.4	22	72,380		プロードリーフ	32.9	33.8	19,435	
東急	170.5	168.3	270,626		三井倉庫 HOLD	7.4	6.9	18,719		クロス・マーケティングG	3.2	3.3	2,930	
京浜急行	87.1	86	116,444		住友倉庫	23	22.5	43,897		デジタルハーツHLDGS	3.7	3.4	7,650	

## トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
システム情報	4.9	5.4	5,529	5,529	カナミックネットワーク	6	7.5	4,740	4,740	エックスネット	1.1	1.6	1,657	1,657
メディアドゥ	2.1	2.8	14,000	14,000	ノムラシステムコーポレーション	3.6	3.9	1,119	1,119	大塚商会	35.9	35.9	212,169	212,169
じげん	16.5	17	6,987	6,987	チェンジ	4.6	12.6	28,350	28,350	サイボウズ	7.8	9.2	23,404	23,404
ブイキューブ	3.7	7	11,571	11,571	シンクロ・フード	2.7	5.2	2,069	2,069	ソフトブレン	4.1	—	—	—
エンカレッジ・テクノロジー	1.3	1.1	674	674	オークネット	3.6	3.9	8,872	8,872	電通国際情報S	4.1	9.8	43,806	43,806
サイバーリンクス	1.2	2.6	3,746	3,746	セグエグループ	1.3	2	1,644	1,644	A C C E S S	6.1	8.4	8,601	8,601
ディー・エル・イー	4.3	4.3	1,259	1,259	エイトレッド	1.1	1.6	4,096	4,096	デジタルガレージ	12	10.9	54,500	54,500
フィックスターズ	7.1	7.1	5,687	5,687	AOI TYO HOLDINGS	6.7	—	—	—	イーエムシステムズ	9.3	11.7	9,711	9,711
CARTA HOLDINGS	3.1	3	7,605	7,605	マクロミル	13.5	13.5	10,840	10,840	ウェザーニューズ	2.3	2.1	13,986	13,986
オプティム	3.5	5	9,810	9,810	ビーグリー	1.3	1.7	2,415	2,415	C I J	4.8	4	3,500	3,500
セレス	2.3	2.6	7,033	7,033	オロ	1.7	2.3	9,165	9,165	ビジネスエンジニアリング	0.8	0.8	2,916	2,916
S H I F T	2.7	3.4	92,922	92,922	ユーザーローカル	0.6	2.7	5,429	5,429	日本エンタープライズ	7.3	8.4	1,806	1,806
ティーガイア	5.9	6.7	13,567	13,567	デモナ	1.3	2	1,618	1,618	WOWOW	3.2	3.3	8,157	8,157
セック	1	1	2,442	2,442	ニーズウェル	1	1.8	1,405	1,405	スカラ	4.6	6.5	4,933	4,933
日本アジアグループ	7.3	—	—	—	サインポスト	1.3	1.8	2,484	2,484	インテリジェントウェイブ	3.7	3.7	2,345	2,345
テクマトリックス	9.4	11.1	22,422	22,422	電算システムHD	—	2.9	8,569	8,569	IMAGICA GROUP	5.7	5.4	2,986	2,986
プロシップ	1.9	2.2	3,680	3,680	ソルクシーズ	3	3	3,309	3,309	ネットワンシステムズ	25.3	27.1	105,961	105,961
ガンホー・オンライン・エンター	16.1	17.8	37,967	37,967	フェイス	2.3	2.5	1,760	1,760	システムソフト	22.4	18.4	3,128	3,128
GMOペイメントゲートウェイ	14.1	12.9	196,983	196,983	プロトコーポレーション	6	8.1	12,708	12,708	アルゴグラフィックス	5.7	5.3	17,967	17,967
ザッパラス	2.9	4.1	2,140	2,140	ハイマックス	0.8	2.2	2,448	2,448	マーベラス	10	10.4	7,290	7,290
システムリサーチ	1.8	2.1	4,380	4,380	野村総合研究所	94	114.8	516,026	516,026	エイベックス	11.5	11.7	17,585	17,585
インターネットイニシアティブ	9.9	18	71,460	71,460	サイバネットシステム	5.1	5.3	3,439	3,439	日本ユニシス	20.7	23.1	69,762	69,762
さくらインターネット	7	7.8	4,898	4,898	C E ホールディングス	4	3.8	2,382	2,382	兼松エレクトロニクス	3.6	3.6	14,526	14,526
ヴェンクス	1.9	1.9	1,873	1,873	日本システム技術	1.2	1.2	2,175	2,175	TBS ホールディングス	40.2	43.6	74,556	74,556
GMOグローバルサインHD	1.2	1.6	7,408	7,408	インテージホールディングス	8.4	8.8	14,440	14,440	日本テレビ HLD S	55.1	55.1	68,930	68,930
SRA ホールディングス	3.6	3.6	10,659	10,659	東邦システムサイエンス	1.7	1.4	1,491	1,491	朝日放送グループHD	6.4	5.3	4,049	4,049
システムインテグレート	2.3	1.8	1,137	1,137	ソースネクスト	31.6	33.4	8,183	8,183	テレビ朝日HD	18.3	20.6	36,008	36,008
朝日ネット	4.7	6	4,530	4,530	インフォコム	7.3	6.6	16,691	16,691	スカパー JSATHD	43.9	42.6	18,147	18,147
e B A S E	8	8.6	7,172	7,172	HEROZ	0.9	2	4,066	4,066	テレビ東京HD	5.5	4.5	9,864	9,864
アバント	6.3	7.7	11,958	11,958	ラクスル	5.3	7.4	47,952	47,952	日本BS放送	2.1	2	2,286	2,286
アドソル日進	2.4	2.7	6,166	6,166	F I G	7.7	6.8	1,972	1,972	ビジョン	6.1	11.9	16,671	16,671
フリービット	3.7	4.7	5,480	5,480	システムサポート	1.4	1.9	2,540	2,540	スマートパリュウ	1.8	2.1	1,472	1,472
コムチュア	7.5	6.2	19,902	19,902	イソソル	3.1	4	4,068	4,068	USEN-NEXT HLDGS	2.6	6.8	25,296	25,296
サイバーコム	1.2	1.1	1,465	1,465	アルテリア・ネットワークス	7.4	7.8	13,751	13,751	ワイヤレスゲート	3.2	3.1	1,236	1,236
アステリア	4.4	5.2	3,666	3,666	東海ソフト	0.4	1.3	1,718	1,718	コネクシオ	3.8	4.2	6,678	6,678
アイル	3.7	3.9	7,538	7,538	ヒト・コミュニケーションズHD	1.6	1.9	3,718	3,718	日本通信	51.7	60.9	14,128	14,128
マークラインズ	3.2	3.6	10,998	10,998	トピラスシステムズ	0.8	1.6	2,140	2,140	クロップス	1.3	1.2	1,194	1,194
メディカル・データ・ビジ	5	8.9	14,151	14,151	S a n s a n	—	6	75,540	75,540	日本電信電話	886.5	770.5	2,485,633	2,485,633
g u m i	8.6	9.5	7,780	7,780	フォーカスシステムズ	4.2	5.6	5,796	5,796	K D D I	483.8	528.4	2,000,522	2,000,522
ショールケース	1.6	1.9	1,238	1,238	クレスコ	4	4.7	10,133	10,133	ソフトバンク	607.9	599.1	932,199	932,199
モバイルファクトリー	1.6	2.1	2,188	2,188	フジ・メディア・HD	64.4	68.5	81,583	81,583	光通信	6.8	7.8	152,958	152,958
テラスカイ	2.4	2.5	5,400	5,400	オービック	23	20.8	484,016	484,016	N T T ドコモ	474.3	—	—	—
デジタル・インフォメーション	2.9	3.4	6,953	6,953	ジャストシステム	10.8	9.5	67,260	67,260	エムティーアイ	6.4	7.6	5,449	5,449
PCI ホールディングス	2.8	3.6	4,060	4,060	T D C ソフト	5.9	5.9	8,572	8,572	GMO インターネット	24	23.7	70,815	70,815
パイブドHD	0.9	1.6	4,038	4,038	Z ホールディングス	912.6	869.7	638,794	638,794	ファイバーゲート	2.1	2.9	4,341	4,341
アイビーシー	1.4	1.4	1,239	1,239	トレンドマイクロ	35.5	35.3	219,213	219,213	アイドマーケティングコミュ	2.1	1.7	649	649
ネオジャパン	1.2	1.7	2,888	2,888	ID ホールディングス	2.5	3.6	3,459	3,459	K A D O K A W A	18	17.3	98,437	98,437
P R T I M E S	1.2	1.8	5,490	5,490	日本オラクル	13.4	13.5	126,495	126,495	学研ホールディングス	8.9	9.6	11,625	11,625
ラクス	—	20.4	94,758	94,758	アルファシステムズ	2.1	1.9	8,103	8,103	ゼンリン	13.3	11.7	12,647	12,647
ランドコンピュータ	1	1	1,309	1,309	フューチャー	8	7.9	22,159	22,159	昭文社ホールディングス	3.1	3.4	1,774	1,774
ダブルスタンダード	0.9	1	7,830	7,830	CAC HOLDINGS	4.4	4.1	7,216	7,216	インプレスホールディングス	5.3	8.9	2,536	2,536
オーブントア	3.4	4.3	10,074	10,074	S B テクノロジー	2.4	2.8	8,540	8,540	アイネット	3.4	3	4,236	4,236
マイネット	2.1	2.6	1,682	1,682	トーセ	1.8	1.7	1,337	1,337	松竹	4.4	4.3	55,126	55,126
アカツキ	2.4	2.9	9,367	9,367	オービックビジネスC	6.8	6.5	37,570	37,570	東宝	39.2	38.9	204,614	204,614
ベネフィットジャパン	0.5	0.7	1,640	1,640	伊藤忠テクノソリューション	30.1	30.5	114,832	114,832	東映	2.5	2.2	48,202	48,202
UBICOMホールディングス	1.6	2	5,786	5,786	アイティフォー	8.1	8.8	7,664	7,664	N T T データ	176.7	175.8	382,365	382,365
LINE	20.4	—	—	—	東計電算	1	0.9	4,383	4,383	ピー・シー・エー	1.1	1.1	6,798	6,798

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ビジネスB太田昭和	2.2	2.6	4,479		明治電機工業	2	2.1	2,908		カメイ	8.6	8.1	10,116	
D T S	14.9	14	37,660		デリカフーズ HLDGS	2.2	3.5	2,359		東都水産	0.8	0.4	2,832	
スウェア・エニックス・HD	28.3	28.1	179,278		スターティアホールディングス	1.7	1.6	2,924		OUGホールディングス	1.1	1	2,935	
シーイーシー	7.1	7.2	9,907		コマダホールディングス	14.6	14.6	31,375		スターゼン	2.5	5	11,205	
カプコン	31.3	56.8	189,996		ピーバンドットコム	0.6	1.2	858		山善	26.2	25	28,300	
アイ・エス・ピー	1.4	4.1	5,231		アセンテック	1.4	2	2,500		椿本興業	1.2	1.2	4,698	
ジャステック	4.2	4.1	5,198		富士興産	2.2	2.1	2,221		住友商事	420.5	416.2	665,920	
S C S K	15.3	15.3	114,444		協栄産業	0.7	0.7	1,027		内田洋行	2.7	2.9	16,675	
日本システムウエア	2.2	2.1	5,212		小野建	5.5	5.5	9,581		三菱商事	436.9	402.7	1,422,336	
アイネス	6.5	6.8	10,778		南陽	1.4	1.2	2,490		第一実業	3.3	3.2	16,224	
T K C	5.6	11.5	42,492		佐島電機	4.5	4	3,668		キャノンマーケティングJPN	16.7	16.3	42,005	
富士ソフト	7.1	7.2	43,704		エコートレーディング	1.5	1.9	1,274		西華産業	3.7	3.3	5,494	
N S D	21.3	21.6	45,403		伯東	4.1	4.4	8,676		佐藤商事	5.6	5.1	6,186	
コナミホールディングス	24.2	24	164,160		コンドーテック	5.2	4.8	4,968		菱洋エレクトロ	6.8	5.1	12,138	
福井コンピュータ HLDGS	2.6	3.3	14,520		中山福	3.7	4.3	1,840		東京産業	6	6.6	4,989	
JBCCホールディングス	4.5	4.2	6,997		ナガイレーベン	8.9	8.4	23,007		ユアサ商事	6.4	6.6	20,559	
ミロク情報サービス	5.9	6.6	11,338		三菱食品	7.4	7	20,517		神鋼商事	1.6	1.5	5,085	
ソフトバンクグループ	526.6	522.9	3,309,434		松田産業	4.9	5.2	15,782		トルク	3.9	3.9	897	
<b>卸売業 (4.8%)</b>					第一興商	10	12.9	49,213		阪和興業	12.5	13.3	47,747	
ハウスイ	0.5	0.5	471		メディアパルHD	71.5	66.2	145,706		正栄食品	4.3	4.2	18,501	
高千穂交易	2.5	2.5	3,092		S P K	2.8	2.9	4,065		カナデン	5.4	5.3	5,618	
オルパルスケア HLDGS	0.7	1.1	1,755		萩原電気 HLDGS	2.5	2.4	5,551		菱電商事	4.8	4.7	8,629	
伊藤忠食品	1.7	1.6	8,736		アズワン	4.4	4.8	84,720		フルサト工業	3.4	3.4	7,752	
エレマテック	6.3	5.8	6,849		スズデン	2.3	2.2	3,568		岩谷産業	14.9	16.1	107,065	
J A L U X	1.8	1.7	3,054		尾家産業	1.9	2	2,302		ナイス	2.5	2.5	4,925	
あらた	5.3	5.1	23,358		シモジマ	4.1	4.2	5,481		昭光通商	2.3	—	—	
トーマンデバイス	1	0.9	4,941		ドウシシャ	6.3	6.2	11,042		ニチモウ	1	1	2,076	
東京エレクトロンデバイス	2.4	2.2	18,876		小津産業	1.5	1.7	3,394		極東貿易	1.9	2.1	5,707	
フィールズ	4.9	5.9	3,097		高速	4	3.5	5,656		アステナホールディングス	8.7	10.8	6,696	
双日	368.1	367.4	130,059		たけびし	2.4	2.2	3,823		三菱石油	16.5	16.2	24,478	
アルフレッサホールディングス	73.9	68.6	119,981		リックス	1.5	1.3	1,989		稲畑産業	14.8	16	28,080	
横浜冷凍	17.5	17.4	16,077		丸文	5.6	5.6	4,390		G S I クレオス	1.6	3.6	3,790	
神栄	1	1.2	1,296		ハピネット	5.5	6	8,988		明和産業	6.3	5.9	6,820	
ラサ商事	3.4	3.3	3,184		橋本総業 HLDGS	1.3	1.6	3,652		クワザホールディングス	2.1	2.5	1,630	
アルコニクス	7.1	7.2	12,139		日本ライフライン	19.9	21.3	29,394		ヤマエ久野	4.9	4.6	5,796	
神戸物産	23	51.6	208,980		タカショー	3.9	5.1	4,758		ワキタ	14.2	13	14,144	
ハイパー	0.9	1.6	870		マルカ	2.3	2.3	6,713		東邦ホールディングス	21.1	20.8	39,520	
あいホールディングス	9.5	9.3	22,329		I D O M	18	22.7	22,858		サンゲツ	18.3	17.5	28,647	
ディービーエックス	2.3	2.1	2,370		進和	4	3.8	9,450		ミツウロコグループ	9.8	9.9	14,404	
ダイワボウHD	5.7	30.3	59,812		エスケイジャパン	1.6	2.6	1,276		シナモンホールディングス	2.8	2.5	9,275	
マクニカ・富士エレ HLDGS	15.9	16	44,624		ダイترون	2.8	2.8	6,801		伊藤忠エニックス	14.1	14.9	15,555	
ラクト・ジャパン	2.5	3	8,532		シークス	8.5	9.4	11,458		サンリオ	18.8	19.1	47,769	
バイタルK S K HD	11.5	11.3	9,446		田中商事	2.1	1.7	1,149		サンワテクノス	4.7	4.4	6,542	
八洲電機	5.1	4.6	4,968		オーハシテクニカ	3.5	3.4	5,348		リョーサン	7.4	6.8	15,925	
メディアスホールディングス	3.7	3.9	3,662		白銅	2.3	2.3	7,831		新光商事	10.3	9.1	8,171	
レスターホールディングス	7	6.5	12,629		ダイコー通産	0.4	0.9	1,131		トーホー	3	3	5,223	
ジュエテックHD	1.3	1.4	1,569		伊藤忠	465.8	462.5	1,597,937		三信電気	3.6	4.1	7,047	
大光	2.8	3	2,124		丸紅	693.5	652.2	602,893		東陽テクニカ	7.6	6.9	8,907	
OCHIホールディングス	1.9	1.9	2,492		高島	1	1	1,901		モスフードサービス	8.8	9	29,835	
TOKAIホールディングス	34.9	31.5	29,295		長瀬産業	37.3	35.8	70,311		加賀電子	6.7	6.2	19,902	
黒谷	1.6	2.4	1,910		蝶理	4.3	4.3	8,406		ソーダニツカ	6.8	6.3	4,139	
Cominix	1.1	1.3	939		豊田通商	74.5	66.2	316,105		立花エレテック	4.9	4.6	7,318	
三洋貿易	6.7	6.9	8,438		三共生興	10	9.2	5,023		フラワーパル	2.9	2.2	2,435	
ビューティガレージ	1.1	1.2	4,362		兼松	25	26.1	37,688		P A L T A C	10.7	10.7	54,891	
ウイン・パートナーズ	4.8	4.6	4,558		ツカモトコーポレーション	1.3	1.4	1,993		三谷産業	8.7	9.4	3,647	
ミタチ産業	2	1.1	963		三井物産	577	527.9	1,290,715		太平洋興発	2.6	2.6	1,739	
シップヘルスケアHD	10.7	23.5	68,385		日本紙パルプ	3.8	3.3	12,837		西本 WISMETTAC HD	1.2	1.5	5,700	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ヤマシタヘルスケア HLDGS	0.7	0.9	1,708		MonotaRO	47.5	84.2	212,015		メディカシステムネットワーク	6.4	6.2	4,761	
国際紙パルプ商事	15.9	13.6	4,787		東京一番フーズ	1.5	1.6	953		はるやま HLDGS	3.1	2.3	1,382	
ヤマタネ	3.3	2.9	4,808		DD ホールディングス	2.7	3.4	1,700		ノジマ	12	11.7	33,590	
丸紅建材リース	0.7	0.5	949		きちりホールディングス	1.7	1.4	898		カッパ・クリエイト	9.4	9.1	12,794	
日鉄物産	4.7	4.6	24,150		アークランドサービスHD	4.9	5.5	13,018		ライトオン	4.9	4.6	3,353	
泉州電業	2	2	10,160		J. フロントリテイリング	79.8	79.4	80,511		ジーンズメイト	2.7	—	—	
トラスコ中山	14	13.8	41,096		ドトール・日レスHD	9.7	10.4	17,648		良品計画	88.9	76.2	195,605	
オートボックスセブン	24.6	23.4	35,357		マツモトキヨシ HLDGS	27.5	27.5	141,900		三城ホールディングス	6.9	7.9	2,117	
モリト	4.9	4.5	3,145		ブロンコビルー	3.5	3.6	9,183		アドヴァングループ	10.3	6.6	6,448	
加藤産業	9.7	9.3	32,550		ZOZO	45.9	39.2	166,600		アルビス	2.5	1.9	4,721	
北恵	1.6	1.8	1,886		トレジャー・ファクトリー	2	2.1	2,064		コナカ	7.7	7.8	2,870	
イノテック	3.9	3.7	5,335		物語コーポレーション	1.8	3.7	27,713		ハウス ローゼ	0.8	0.6	1,008	
イエローハット	12.6	12	23,952		ココカラファイン	6.9	5.9	51,330		G+ホールディングス	3.9	3.9	16,731	
JK ホールディングス	6	5.8	4,901		三越伊勢丹HD	117.3	116.5	93,083		イオン北海道	8.5	8.9	11,570	
日伝	6.1	5.3	13,393		Hamee	2.4	1.9	2,513		コジマ	11.4	12.3	8,142	
北沢産業	5.2	4.3	1,130		ウエルシアHD	39.6	35.2	145,904		ヒマラヤ	2.2	2.2	3,080	
杉本商事	3.5	3.2	9,558		クリエイティブSDH	11.2	9.7	37,830		コーナン商事	9.5	9.6	35,808	
因幡電機産業	19.1	17.5	49,577		丸善 CHI HD	5.6	5.1	1,963		エコス	2.4	2.5	4,937	
東テック	2.2	2.3	6,433		ミサワ	1.6	1.9	1,282		ワタミ	7.9	8.9	8,997	
ミスミグループ本社	83.6	82.9	398,334		ディーライフ	0.9	1.4	2,121		マルシェ	1.5	1.5	741	
アルテック	5.6	6.3	2,003		エー・ピーホールディングス	1.5	1.7	761		パンパシフィック HD	146.4	132.5	269,372	
タキヒヨー	2	2.1	4,063		テムニー	2	2.1	3,173		西松屋チェーン	14.7	14.9	21,083	
蔵王産業	1	1	1,736		シュッピン	4.6	4.8	6,100		ゼンショーホールディングス	32	35.4	99,898	
スズケン	28.1	28	91,700		オイシックス・ラ・大地	6.6	9	45,630		幸楽苑ホールディングス	4.2	4.1	6,211	
ジェコス	4.6	4.5	4,099		ネクステージ	9.6	13.7	32,332		ハークスレイ	1.3	1	1,026	
グローセル	6.7	6.4	2,668		ジョイフル本田	19.6	18.6	29,332		サイゼリヤ	10	10.2	28,345	
<b>小売業 (4.4%)</b>					鳥貴族ホールディングス	2.3	2.6	5,558		V Tホールディングス	27.6	25.2	14,389	
ローソン	16.9	16.6	95,118		キリン堂ホールディングス	2.6	—	—		魚力	1.9	1.9	4,216	
サンエー	5.5	4.8	19,416		ホットランド	4.5	4.6	6,242		ポプラ	1.8	3.1	688	
カワチ薬品	5.2	4.6	10,704		すかいらーく HD	74.9	92.6	147,048		フジ・コーポレーション	1.8	3.4	4,195	
エービーシー・マート	10.4	10.3	60,255		SFP ホールディングス	3.8	2.9	4,176		ユナイテッドアローズ	7	7.7	15,030	
ハードオフコーポレーション	2.5	2.5	1,952		綿半ホールディングス	2.5	4.9	6,374		ハイデッド日高	9.7	9.5	16,539	
アスクル	7	11.2	19,219		ヨシックスホールディングス	1.1	1.3	2,973		京都きもの友禅	3.9	4.3	1,105	
ゲオホールディングス	11.9	8.9	10,920		ユナイテッド・スーパーマーケット	19.3	19	21,964		コロワイド	22.3	22	38,016	
アダストリア	9.3	9.4	18,630		ゴルフダイジェスト・オン	2.9	3.9	5,460		ピーシーデポコーポ	8.8	7.4	3,507	
ジーフット	4.4	3	1,224		BEENOS	3	3.6	10,782		壱番屋	4.7	4.4	20,636	
シー・ヴィー・エス・バイエリア	1	1	413		あさひ	5	5	7,050		トップカルチャー	2.4	2.5	855	
くら寿司	3.5	7.1	28,293		日本調剤	4.1	4.2	7,320		P L ANT	1.6	1.6	1,182	
キャンドゥ	3.2	3.6	6,872		コスモス薬品	5.9	6.7	136,747		スギホールディングス	13.3	13.3	116,242	
パルグループ HLDGS	6.9	5.9	10,307		トーエール	3.2	3.1	2,824		薬王堂ホールディングス	2.9	2.8	7,092	
エディオン	30.8	27.5	29,617		オンリー	1.1	1.1	840		ヴィア・ホールディングス	8.1	7.6	1,504	
サラココーポレーション	13.4	13.6	8,880		セブン & アイ・HLDGS	260.5	258.8	1,326,091		スクロール	10.1	9.9	8,751	
ワッツ	2.8	3.4	3,022		クリエイティブ・レストラン・ホール	36.1	36.2	33,050		ヨンドシーホールディングス	6.8	6.2	11,352	
ハロース	2.5	2.7	8,140		ツルハホールディングス	14.5	14.5	203,000		ファミリーマート	53.2	—	—	
フジオフード G 本社	5.7	5.6	7,800		サンマルクホールディングス	5.3	5.1	8,058		木曽路	8.8	8.3	20,575	
あみやき亭	1.4	1.3	3,802		フェリシモ	1.4	1.7	2,864		SRS ホールディングス	8.1	8.2	6,888	
ひらまつ	11.8	12.7	2,705		トリドールホールディングス	16.6	16.6	43,259		千趣会	12.2	11.8	4,625	
大黒天物産	1.6	2.2	15,158		TOKYO BASE	6	6.9	4,319		タカキユー	6.1	7.3	963	
ハニーズホールディングス	5.8	5	5,640		ウィルプラス HLDGS	1.1	1.2	1,306		リテールパートナーズ	8.9	7.9	10,262	
ファーマライズ HD	1.5	1.5	1,218		JM ホールディングス	5.1	4.9	10,691		ケーヨー	13.7	11.9	10,103	
アルペン	5.1	5.3	17,543		サツドラホールディングス	0.9	0.9	2,000		上新電機	7.9	7.4	19,402	
ハブ	1.9	2.1	1,520		アレンザホールディングス	3.3	4.9	7,154		日本瓦斯	10.6	32.6	55,159	
クオールホールディングス	9.8	8.8	14,229		串カツ田中 HLDGS	1.3	1.9	4,284		ロイヤルホールディングス	11.7	11.6	24,812	
ジーンズホールディングス	3.6	4.6	37,398		パロックジャパン	4.6	4.9	4,272		東天紅	0.5	0.5	557	
ビックカメラ	39.8	38.5	40,964		クスリのアオキ HLDGS	6	6.6	56,034		いなげや	8.2	7.3	10,570	
DCM ホールディングス	37.3	40.7	46,113		力の源 HD	3	2.3	1,405		島忠	12.5	—	—	
ペッパーフードサービス	5.7	9.2	3,413		FOOD&LIFE COMPAN	36.7	38.9	195,667		チヨダ	7.1	6.4	5,254	



トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千円		株数	千株	株数	千円		株数	千株	株数	千円
ライフコーポレーション	5.1	6.2	29,667		<b>銀行業 (4.9%)</b>					阿波銀行	10.9	9.9	21,968	
リンガーハット	8.3	7.9	19,054		島根銀行	1.5	3	1,845		大分銀行	3.9	3.7	6,889	
Mr Ma x HD	9.2	8.8	6,036		じもとホールディングス	45	4.3	3,048		富崎銀行	4.5	4.1	8,745	
テンアライド	5.9	5.3	1,738		めぶきフィナンシャルG	346	344.1	86,369		佐賀銀行	4	3.8	5,719	
AOKI ホールディングス	13.5	13.3	9,123		東京きらぼしFG	9	8.8	13,860		沖縄銀行	6.1	5.8	16,634	
オークワ	10.5	10	12,170		九州フィナンシャルG	146.2	134.9	56,658		琉球銀行	15.5	13.6	10,812	
コメコ	10.3	10	27,250		ゆうちょ銀行	187.6	187.2	179,337		セブン銀行	223	221.9	56,806	
青山商事	13.8	15.3	12,163		富山第一銀行	15.7	14.7	4,410		みずほフィナンシャルG	9,059.1	898.7	1,439,717	
しまむら	7.8	7.7	77,077		コンソルディア・フィナンシャル	380.6	402.8	178,843		高知銀行	2.5	2.5	2,102	
はせがわ	3.4	3.3	884		西日本フィナンシャルHD	44.6	43.3	30,959		山口フィナンシャルG	83.5	82.6	54,929	
高島屋	48.9	49.2	56,973		関西みらいFG	39.5	—	—		長野銀行	2.1	2.4	2,812	
松屋	13.5	14.4	16,156		33FG	6.2	5.6	8,366		名古屋銀行	5.1	5.2	14,414	
イチ・ツー・オーリテイリング	31.8	32.5	30,712		第四北越フィナンシャルG	11.7	10.7	27,841		北洋銀行	101.3	101.2	26,716	
近鉄百貨店	2.6	2.5	6,507		ひろぎん HLDGS	—	98.7	64,352		愛知銀行	2.4	2.3	8,418	
丸井グループ	61.2	56.4	118,045		新生銀行	49.1	54.7	103,164		中京銀行	2.7	2.6	3,653	
アクシアリテイリング	5.5	5.3	21,677		あおぞら銀行	40	39.5	107,993		大光銀行	2.2	2.2	3,498	
井筒屋	4	3.7	987		三菱UFJフィナンシャルG	4,562.2	4,527.4	2,863,580		愛媛銀行	9	8.9	7,120	
イオン	256.1	254.2	767,175		りそなホールディングス	725.8	768.7	341,225		トマト銀行	2.5	2.3	2,566	
イズミ	13.7	13.5	48,465		三井住友トラストHD	126	125.2	479,516		京葉銀行	28.5	25.7	11,693	
平和堂	13.4	12	27,684		三井住友フィナンシャルG	461	457.6	1,797,910		栃木銀行	31.6	31.6	5,846	
フジ	8.1	7.9	17,917		千葉銀行	222.5	221.2	157,715		北日本銀行	2	1.9	3,060	
ヤオコー	7.6	7.5	54,075		群馬銀行	128	136.6	49,449		東和銀行	11.7	12.2	6,771	
ゼビオホールディングス	8	7.4	8,569		武蔵野銀行	10	9.7	18,284		福島銀行	7.3	7.7	1,940	
ケーズホールディングス	64.4	56.6	67,750		千葉興業銀行	18	16.6	4,648		大東銀行	3.3	3	2,055	
OLYMPIC グループ	3.4	3.6	2,876		筑波銀行	28.1	29.1	5,267		トモニホールディングス	51.8	48.2	16,147	
日産東京販売HD	9.7	8.9	2,171		七七七銀行	22.7	20.5	26,076		フィデアホール	64.4	66.2	8,473	
シルバライフ	0.9	1.5	2,320		青森銀行	5.2	5.1	11,123		池田泉州HD	76.9	74.8	12,641	
一家ダイニングプロジ	0.5	1.3	757		秋田銀行	4.3	4	5,980		<b>証券、商品先物取引業 (0.7%)</b>				
GENKY DRUGSTORES	2.9	2.9	14,964		山形銀行	7.5	7	6,244		FPG	20.6	22.7	16,048	
カルミヤ・インターナショナル	1.4	1.6	1,654		岩手銀行	4.4	4.2	7,413		マキアインベストメント	2.8	—	—	
ブックオフGHD	3.9	3.7	3,637		東邦銀行	59.7	56.7	12,247		マキアホールディングス	—	3.2	2,422	
アインホールディングス	8.2	9.6	71,328		東北銀行	3.1	3.3	3,418		SBIホールディングス	74.6	81.8	227,240	
元気寿司	1.7	1.8	4,941		みちのく銀行	4.4	4.5	3,996		日本アジア投資	6.3	6.1	1,518	
ヤマダホールディングス	203.4	221	105,196		ふくおかフィナンシャルG	56.3	60.1	121,161		ジャフコグループ	10.3	8.7	63,423	
アークランドサカモト	10.5	10.3	17,911		静岡銀行	162.2	161.8	150,150		大和証券G本社	534.4	495.5	330,845	
ニトリホールディングス	28.8	26.2	588,976		十六銀行	8.4	8.3	18,284		野村ホールディングス	1,174.1	1,013	558,264	
ブルメ梓屋	4.7	4.1	4,169		スルガ銀行	63	63	24,129		岡三証券グループ	57.3	53.9	22,476	
美眼	5.4	4.4	976		八十二銀行	161	148.5	58,954		丸三証券	19.7	19.6	12,759	
ケーユーホールディングス	2.9	3.4	3,478		山梨中央銀行	7.8	7.4	6,349		東洋証券	24.3	21.5	3,612	
吉野家ホールディングス	22	21.7	48,759		大垣共立銀行	13.2	12.9	25,038		東海東京HD	76.9	68.8	29,240	
松屋フーズHLDGS	3.2	2.9	10,614		福井銀行	5.7	5.9	9,971		光世証券	1.8	1.8	1,089	
サガミホールディングス	8.9	8.7	9,291		北國銀行	6.7	6.2	13,106		水戸証券	19.1	17.8	5,571	
関西スーパーマーケット	5.5	4.8	9,528		清水銀行	2.7	2.5	4,232		いちよし証券	12.2	13.3	9,522	
王将フードサービス	4.9	4.1	25,010		富山銀行	1.3	1.3	2,996		松井証券	37.7	32.2	26,822	
プレナス	7.2	7.5	16,222		滋賀銀行	13.4	13.2	24,987		マネックスG	50	60.4	34,428	
ミニストップ	5	5.4	8,127		南都銀行	11.2	9.3	18,972		極東証券	8.7	8.5	7,403	
アークス	13.6	12.7	29,959		百五銀行	59.5	59.3	19,924		岩井コスモホールディング	6.3	7.7	11,118	
パローホールディングス	14.7	13.3	33,795		京都銀行	23.9	23.9	119,978		藍澤證券	12	11.9	13,768	
藤久	0.6	1.7	1,283		紀陽銀行	23.7	23	36,593		マネーパートナーズGP	6.6	9.1	1,992	
ベルク	3.3	3.2	19,872		ほくほくフィナンシャルG	44.5	44.2	37,083		スパークス・グループ	30.8	31.6	9,290	
大庄	3.5	3.1	3,205		広島銀行	99	—	—		小林洋行	2.8	4.1	1,123	
ファーストリテイリング	8.9	8.9	664,207		山陰合同銀行	39.9	41	23,124		<b>保険業 (2.0%)</b>				
サンドラッグ	25.1	25	91,250		中国銀行	57.5	56	49,840		かんぽ生命保険	23.5	82.4	171,227	
サックスパーホールディング	5.5	5	2,845		鳥取銀行	2.2	2.2	2,530		SOMPOホールディングス	125.4	116.6	592,094	
ヤマザワ	1.4	1.1	1,927		伊予銀行	95.1	88.2	51,597		アニコムホールディングス	5.5	19.5	17,667	
やまや	1.3	1.2	3,050		百十四銀行	7.1	6.5	10,400		M S & A D	174.3	160.3	615,071	
ペルーナ	14.4	14.9	12,650		四国銀行	10.2	9.3	6,937		第一生命HLDGS	377.8	326.2	769,342	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
東京海上HD	235.9	218.1	1,308.600	600	ケイアイスター不動産	2.2	2.3	12,788		リンクアンドモチベーション	13.7	14.5	16,037	
T&Dホールディングス	199.7	198.3	305,382		アブレ都市デザイン	1.7	1.7	2,007		G C A	7.8	8.2	11,439	
アドパンスクリエイト	1.6	3.4	3,787		ジェイ・エス・ビー	1.3	1.4	4,298		エス・エム・エス	20.2	22.2	94,128	
<b>その他金融業 (1.1%)</b>					テンポイノベーション	1.7	2.2	2,010		サニーサイドアップG	2.1	2	1,566	
全国保証	18.9	17.2	94,944		グローバルリンクマネジメント	1.4	1.3	1,223		パーソルホールディングス	65.1	64.2	175,009	
ジェイリース	2.5	2.5	5,120		パーク24	36	35.8	64,547		リニカル	3.2	3.7	2,963	
イントラスト	2.5	2.7	1,917		パラカ	1.7	1.6	2,944		クックパッド	22.4	21.7	5,099	
日本モーゲージサービス	2.8	3.7	3,870		三井不動産	329	301.5	760,533		エスクリ	2	3	1,671	
C a s a	2.3	2.1	2,034		三菱地所	467.2	433.9	750,863		アイ・ケイ・ケイ	3.1	3.1	2,135	
アルヒ	10.7	10.1	13,180		平和不動産	12.2	11.5	47,092		学情	2.4	2.8	3,533	
プレミアグループ	3.6	3.4	11,798		東京建物	66.1	65.4	111,114		スタジオアリス	3.2	3.4	8,027	
クレディセゾン	47	38.9	52,787		ダイビル	17	16.9	26,296		シックホールディングス	3.6	3.6	5,403	
芙蓉総合リース	7	6.8	53,924		京阪神ビルディング	10.5	10.5	15,456		エプコ	1.3	1.5	1,336	
みずほリース	10.2	10.5	38,377		住友不動産	149.9	148.9	578,923		N J S	1.4	1.6	3,152	
東京センチュリー	13.4	15.3	99,450		テーオーシー	12.9	12.1	8,022		総合警備保障	25.9	25.4	129,032	
日本証券金融	29.5	29	27,318		東京楽天地	1.2	1	4,125		カクコム	48	47.8	177,099	
アイフル	102	113.8	40,968		スターツコーポレーション	9	7.7	21,937		アイロムグループ	2.4	2.4	5,232	
リコーリース	5.2	5.2	19,578		フジ住宅	7.7	7.7	5,528		セントケア・ホールディング	4	5.2	5,215	
イオンフィナンシャルサービス	41.1	40.4	52,802		空港施設	6.8	7.2	4,305		サイネックス	1.1	1.8	1,213	
アコム	133.9	129.8	54,645		明和地所	4.2	3.4	2,077		ルネサンス	3.5	4.2	4,897	
ジャックス	7.4	7.7	23,485		ゴールドクレスト	5	5.8	9,987		ディップ	9.1	10.4	42,484	
オリコ	181.6	179.6	27,478		エスリード	2.7	2.5	4,175		デジタルホールディングス	3.5	4.9	8,619	
日立キャピタル	15.8	—	—		日神グループHLDGS	10.3	9.3	4,752		新日本科学	7.1	8.1	7,452	
アプラスフィナンシャル	34.1	—	—		日本エスコ	12.2	13.1	10,427		ツクイホールディングス	15.2	—	—	
オリックス	413.9	401.5	850,577		タカラレーベン	30.2	29.3	9,434		キャリアデザインセンター	1.7	1.6	1,936	
三菱HCキャピタル	168.4	227	134,838		A V A N T I A	3.8	3.6	3,178		ベネフィット・ワン	23.7	23.5	129,485	
九州リースサービス	2.9	3	1,842		イオンモール	33.4	33.1	55,674		エムスリー	142.6	113.6	975,596	
日本取引所グループ	191.3	178.7	519,659		毎日コムネット	2	2.7	2,073		ツガク・グローバルHOLD	4	4.9	1,734	
イー・キャランティ	7.2	8	20,144		ファースト住建	2.9	2.9	3,862		プラス	0.7	1.4	1,143	
アサックス	3.5	3.9	2,780		ランド	378.1	371.2	4,454		アウトソーシング	37.1	37.4	74,987	
NECキャピタルソリューション	2.7	2.8	6,014		カチタス	16.6	16.4	66,502		ウエルネット	6.6	6.3	3,320	
<b>不動産業 (1.9%)</b>					トーセイ	9.4	9.3	10,648		ワールドホールディングス	2.3	2.6	7,264	
いちご	85.5	74.3	26,153		穴吹興産	1.5	1.8	3,668		ディー・エヌ・エー	27.5	27.8	55,155	
日本駐車場開発	69.7	73.5	11,907		サンフロンティア不動産	9.5	8.1	9,185		博報堂D Y HLDGS	90.5	89.1	169,913	
スター・マイカ・HLDGS	3.3	3.5	5,281		インテリックス	2.8	2	1,542		ぐるなび	11.3	11.1	5,805	
ADワークスグループ	14.9	13.1	2,096		ランドビジネス	2.6	2.9	783		タカミヤ	6.7	7.5	3,720	
ヒューリック	141.5	139.7	186,359		サンネクスタグループ	1.9	2.3	2,339		ジャパンベストレスクー5	5	5	6,340	
三栄建築設計	2.7	3	5,907		グランディハウス	5.3	5.2	2,527		ファンコミュニケーションズ	18	16.4	7,183	
野村不動産HLDGS	40.5	38.3	110,074		日本空港ビルデング	21.4	23.1	115,962		ライク	2.3	1.9	3,465	
三重交通グループHD	13.3	12.8	6,758		<b>サービス業 (6.0%)</b>					ビジネス・ブレイクスルー	3.2	3	1,317	
サムティ	9.5	9.7	22,765		明豊ファシリティアークス	2.7	3.3	3,012		エスプール	16.6	19.1	20,131	
日本商業開発	4.5	4.6	8,050		日本工営	4.4	3.8	13,148		WDBホールディングス	3	3	10,920	
プレサンスコーポレーション	11.1	11	20,614		L I F U L L	22.6	22.5	8,212		手間いらすず	0.4	1	5,850	
ハウスコム	0.9	1.2	1,536		ミクシィ	12.4	16.5	43,560		ティア	3.6	3.6	1,828	
日本管理センター	3.9	3.7	4,643		ジェイエイシリアルメント	4.3	5.5	11,698		C D G	0.7	0.5	785	
サンセイランディック	2.5	2	1,656		日本M&Aセンター	49.2	105.5	378,745		パリュウコマース	3.6	5.3	25,705	
エストラスト	1.4	1.1	729		メンバーズ	1.9	2.4	8,280		インフォーマット	65.6	71.5	76,648	
フージャースHD	13.3	10.4	7,238		中広	0.6	1.1	442		JPホールディングス	20.2	18.8	5,264	
オープンハウス	19.5	21.2	139,072		UTグループ	10.2	9.4	29,046		エコナックホールディングス	13.5	13.5	1,201	
東急不動産HD	181.9	180.4	119,785		アイティメディア	2.6	2.5	5,910		EPSホールディングス	9	—	—	
飯田GHD	55.5	55.3	160,093		タケエイ	6.2	7.5	14,175		レックス	1.7	1.7	3,610	
イーグルランド	1	1.3	2,139		E・Jホールディングス	1.2	3.5	4,753		プレステージ・インター	24.3	23.6	18,360	
ビーロッド	3.4	4.7	2,547		夢真ビーネックスグループ	8.1	17.6	23,496		アミューズ	3.5	3.5	8,319	
ファーストブラザーズ	1.5	1.2	1,238		コシダカホールディングス	15.5	18.6	10,843		ドリームインキュベータ	1.9	2.1	1,782	
ハウスドゥ	3.5	3.3	3,286		アルトナー	1.8	1.6	1,385		クイック	3.9	3.9	5,440	
シーアールイー	1.8	1.9	4,582		パソナグループ	7	7.3	24,345		T A C	4.4	4	972	
プロパティエージェント	1.1	1.4	4,494		C D S	1.6	1.5	2,446		ケネディクス	56.8	—	—	

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
電通グループ	67.1	66.2	278,040		ERIホールディングス	1.8	1.8	2,039		長大	2.5	2.6	5,842	
テイクアンドギヴニーズ	2.4	3.4	3,437		アビスト	0.9	1.1	3,349		燦ホールディングス	2.8	2.7	3,923	
びあ	1.8	1.9	6,688		シグマクシス	4.4	3.8	10,978		スバル興業	0.4	0.4	3,324	
イオンファンタジー	2.5	2.5	5,097		ウィルグループ	4.3	4.7	6,138		東京テアトル	3.1	2.3	2,980	
シーティーエス	7.3	7.3	5,847		エスクローA J	9	10.3	2,451		タナベ経営	1.1	1	1,613	
ネクシィーズグループ	2.4	2.3	2,047		リクルートホールディングス	463.1	459.6	3,209,386		ナガフ	2	2	23,980	
HUグループHD	18.2	18.1	58,372		エラン	3.8	9.7	11,950		よみうりランド	1.4	—	—	
アルプス技研	5.7	5.5	11,423		土木管理総合試験	2.9	3.4	1,244		東京都競馬	4.2	5	20,400	
ザニックス	11.4	10.8	3,574		ネットマーケティング	2.3	4.6	2,125		常磐興産	2.6	2.6	3,868	
ダイオーズ	1.2	0.8	900		日本郵政	527	484.9	468,801		東京ドーム	26.4	—	—	
日本空調サービス	6.8	6.3	5,216		ベルシステム24HLDGS	10.9	10.9	18,257		西尾レントオール	6	5.8	17,162	
オリエンタルランド	68.7	68.1	1,175,065		鎌倉新書	4.9	6.9	5,865		アゴラホスピタリティーG	47.5	52.2	1,305	
ダスキン	16.2	14.5	38,976		S MN	1.3	2.1	1,421		トランス・コスモス	6.2	6.4	23,616	
明光ネットワークジャパン	8.1	8.1	5,038		一蔵	0.7	0.9	369		乃村工務社	27.8	27.7	27,118	
ファルコホールディングス	3.5	2.9	5,251		LITALICO	2.2	—	—		藤田観光	2.9	2.7	6,480	
秀英予備校	1.4	2	862		グローバルキッズCOMP	1	1.7	1,283		KNT-CTホールディングス	3.9	3.8	5,354	
田谷	1.2	1.5	862		エアトリ	3.3	4.6	15,226		日本管財	7.2	6.7	18,029	
ラウンドワン	18.1	22.7	31,439		アトラエ	1.9	4.9	12,475		トーカイ	6.3	6.1	14,347	
リゾートトラスト	29.8	29.8	61,477		ストライク	2.4	2.6	10,881		白洋舎	0.8	0.7	1,464	
ビー・エム・エル	8.3	8.4	37,212		ソラスト	18	16.2	25,077		セコム	68.7	63.1	530,040	
ワタベウエディング	1	—	—		セラク	2.2	2.6	6,117		セントラル警備保障	3.1	3	8,412	
りあおコミュニケーション	11.7	9.9	12,315		インソース	2.8	6.7	13,929		丹青社	12.2	11.9	10,186	
リソー教育	29.6	34.2	14,671		ペイカレントコンサルティング	3.9	4.2	258,720		メイテック	8	7.8	51,246	
早稲田アカデミー	2.8	2.8	2,738		ORCHESTRA HLDGS	1.6	1.6	6,192		応用地質	6.9	7.1	10,302	
ユー・エス・エス	72.9	71.5	143,071		アイモバイル	2.2	2.6	3,601		船井総研ホールディング	13.4	13.1	39,496	
東京個別指導学院	2.3	5.7	3,762		キャリアインデックス	2.8	3.2	3,244		進学会ホールディングス	2.5	2.6	1,089	
サイバーエージェント	39.9	159.1	348,906		MS-Japan	2.2	3	3,189		オオバ	4.8	4.2	3,704	
楽天グループ	301.7	330.2	366,522		船場	1.1	0.9	743		いであ	1.5	1.5	2,872	
クワーク・アンド・リバー社	3.4	3.5	6,436		グレイステクノロジー	3	7.2	7,689		学究社	1.8	1.9	2,660	
テー・オー・ダブリュー	10.4	10.8	3,704		ジャパンエレベーターSHD	6.8	19.1	50,443		ベネッセホールディングス	21.7	23.6	58,221	
山田コンサルティングGP	4.1	3.6	4,132		フルテック	0.9	0.9	1,320		イオンディライト	8	7.8	28,236	
セントラルススポーツ	2.4	2.4	6,211		グリーンズ	1.8	2.8	1,540		ナック	3.9	2.7	2,629	
フルキャストホールディングス	6.2	5.7	12,722		ツナググループHLDGS	0.9	2.1	632		ニチイ学館	6.2	—	—	
エン・ジャパン	11.5	11.5	46,920		GAMEWITH	1.7	2.4	1,308		ダイセキ	10.9	12.9	63,081	
リソルホールディングス	0.7	0.7	2,891		ソウルドアウト	1.3	1.6	2,585		ステップ	2.4	2.3	4,372	
テクノプロ・ホールディング	13	38.6	128,924		MS&CONSULTING	1	1.3	783						
アトラグループ	1.7	1.9	590		ミダックホールディングス	0.8	2.9	17,081						
インテックス	1.6	1.6	651		日総工産	4.5	5.3	3,821		株数、金額	79,781,50004	70,983,9	189,973,468	
アイ・アールジャパンHD	2.6	2.7	37,125		キュービネットHLDGS	2.9	3	5,613		銘柄数<比率>	2,151銘柄	2,126銘柄	<98.7%>	
Keeper 技研	2.4	4.4	16,786		RPAホールディングス	4.8	8.8	5,306						
ファーストロジック	1.4	2.2	1,683		スプリックス	2.2	2.1	2,009						
三機サービス	1.3	1.5	1,699		マネジメントソリューションズ	2.8	3.4	10,608		(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。				
Gunosy	4	4.8	3,494		プロレド・パートナーズ	0.9	1.7	3,173		(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価 額の比率。				
デジワン・ジャパン	1.5	3.5	836		AND FACTORY	0.5	1.9	957		(注3) 評価額の単位未満は切捨て。				
イー・ガーディアン	3.2	3.2	10,304		ギークス	0.6	1.5	2,296						
リブセンス	4.5	6.6	1,346		カープスホールディングス	17.8	18.2	16,289						
ジャパンマテリアル	20	19.1	25,594		フォーラムエンジニアリング	3.3	4.7	4,399						
ベクトル	8.2	8.3	9,154		LITALICO	—	2.8	20,104						
ウチャマホールディングス	3.2	3	1,029		アドバンテッジリスマネ	3.3	3.6	4,032						
チャムケアコーポレーション	5.5	5.4	8,920		リログループ	35.4	35.2	75,856						
キャリアリンク	2.4	2.5	4,650		東祥	4	4.3	7,675						
I B J	4.5	5.9	6,407		エイチ・アイ・エス	10.1	14.5	35,728						
Aサンテ	2.7	2.6	4,693		ラックランド	1.5	1.9	5,468						
N・フィールド	4.3	—	—		共立メンテナンス	10.8	10.7	42,158						
パリュールHR	2.6	2.7	4,819		イチネンホールディングス	7.2	6.2	8,320						
M&Aキャピタルパートナー	5.3	5.5	31,735		建設技術研究所	4.4	4.1	10,783						
ライオンエクスプレスHD	2.5	2.6	4,248		スペース	4.1	3.9	3,802						

(2)先物取引の銘柄別期末残高(評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内	百万円 1,788	百万円 —
TOPIX		

(注) 単位未満は切捨て。



## ■有価証券の貸付及び借入の状況

項 目	当 期 末	
	貸 付	借 入
株式	3,837,400 (株 16,100)	株 一 (—)

(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期中の利害関係人のうち、大和証券へ16,100株を貸付しています。

## ■投資信託財産の構成

2021年9月21日現在

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

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年9月21日現在

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

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

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、トピックス・インデックスファンド2,989,191,828円、ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A5,882,696,138円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A2 925,539円、ダイワ国内重視バランスファンド30 V A (一般投資家私募) 25,469,299円、ダイワ国内重視バランスファンド50 V A (一般投資家私募) 429,078,400円、ダイワ国際分散バランスファンド30 V A (一般投資家私募) 23,164,900円、ダイワ国際分散バランスファンド50 V A (一般投資家私募) 721,398,709円、日本株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用) 212,609,568円、D - I's T O P I Xインデックス50,045,732円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 112,275,070円、iFree T O P I Xインデックス4,271,085,355円、iFree 8資産バランス3,194,833,049円、iFree 年金バランス442,601,861円、D Cダイワ日本株式インデックス

65,726,059,110円、ダイワ・ライフ・バランス30 2,904,866,842円、ダイワ・ライフ・バランス50 3,951,974,309円、ダイワ・ライフ・バランス70 3,760,977,295円、年金ダイワ日本株式インデックス5,858,241,088円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 50,696,932円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 51,725,840円、ダイワつみたてインデックス日本株式1,353,026,496円、ダイワつみたてインデックスバランス30 9,628,593円、ダイワつみたてインデックスバランス50 8,568,294円、ダイワつみたてインデックスバランス70 17,409,216円、ダイワ世界バランスファンド40 V A113,101,715円、ダイワ世界バランスファンド60 V A130,262,046円、ダイワ・バランスファンド35 V A 6,161,189,519円、ダイワ・バランスファンド25 V A (適格機関投資家専用) 559,246,637円、ダイワ国内バランスファンド25 V A (適格機関投資家専用) 80,610,399円、ダイワ国内バランスファンド30 V A (適格機関投資家専用) 146,638,577円、ダイワ・ノーロード T O P I Xファンド178,771,082円、ダイワファンドラップ T O P I Xインデックス10,294,148,277円、ダイワT O P I Xインデックス (ダイワSMA専用) 2,512,120,167円、ダイワファンドラップオンライン T O P I Xインデックス2,644,643,973円、ダイワ・インデックスセレクト T O P I X1,211,577,472円、ダイワライフスタイル25 153,686,797円、ダイワライフスタイル50 617,422,037円、ダイワライフスタイル75 487,367,793円、D C・ダイワ・トピックス・インデックス (確定拠出年金専用ファンド) 10,633,113,617円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,951円です。

## ■損益の状況

当期 自 2020年9月24日 至 2021年9月21日

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

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

# ダイワ日経225インデックス (ダイワSMA専用)

## 運用報告書(全体版)

### 第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

#### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

#### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型		
信託期間	無期限(設定日:2017年2月16日)		
運用方針	投資成果を日経平均株価(日経225)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券	
	ストックインデックス225・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
2 期末 (2018年 6 月15日)	円 11,850	円 90	% 17.0	円 22,851.75	% 15.2	% 99.0	% 1.7	百万円 27
3 期末 (2019年 6 月17日)	10,971	180	△ 5.9	21,124.00	△ 7.6	99.3	2.3	33
4 期末 (2020年 6 月15日)	11,262	120	3.7	21,530.95	1.9	99.2	1.9	376
5 期末 (2021年 6 月15日)	15,388	220	38.6	29,441.30	36.7	99.3	2.2	439
6 期末 (2022年 6 月15日)	13,812	160	△ 9.2	26,326.16	△ 10.6	98.7	2.4	1,748

(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。

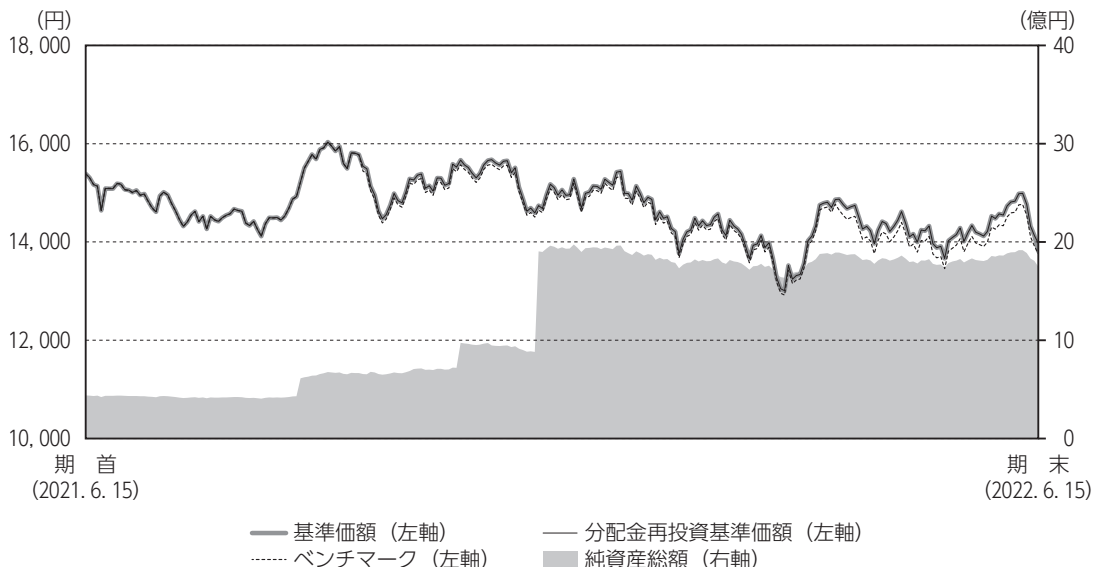
(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

「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、「ダイワ日経225インデックス (ダイワSMA専用)」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。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

#### 基準価額・騰落率

期首：15,388円

期末：13,812円 (分配金160円)

騰落率：△9.2% (分配金込み)

#### 基準価額の主な変動要因

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

ダイワ日経225インデックス (ダイワSMA専用)

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 組入比率	株 式 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2021年 6月15日	円	%	円	%	%	%
	15,388	—	29,441.30	—	99.3	2.2
6月末	15,057	△ 2.2	28,791.53	△ 2.2	98.3	1.7
7月末	14,263	△ 7.3	27,283.59	△ 7.3	98.2	1.8
8月末	14,686	△ 4.6	28,089.54	△ 4.6	98.4	1.6
9月末	15,490	0.7	29,452.66	0.0	96.4	3.6
10月末	15,189	△ 1.3	28,892.69	△ 1.9	97.6	2.4
11月末	14,623	△ 5.0	27,821.76	△ 5.5	97.1	2.9
12月末	15,153	△ 1.5	28,791.71	△ 2.2	98.6	1.4
2022年 1月末	14,205	△ 7.7	27,001.98	△ 8.3	97.7	2.3
2月末	13,960	△ 9.3	26,526.82	△ 9.9	97.6	2.4
3月末	14,761	△ 4.1	27,821.43	△ 5.5	98.1	1.9
4月末	14,243	△ 7.4	26,847.90	△ 8.8	96.6	3.4
5月末	14,478	△ 5.9	27,279.80	△ 7.3	98.3	1.6
(期末)2022年 6月15日	13,972	△ 9.2	26,326.16	△ 10.6	98.7	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

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

### 国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

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

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### 当ファンド

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

### ストックインデックス225・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

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

### 当ファンド

「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れて運用を行いました。なお、当作成期末の実質株式組入比率（日経平均先物を含む。以下同じ。）は101.1%となっておりますが、翌営業日計上のマザーファンド解約金額を考慮した実質組入比率は100%程度となっております。

## ■ストックインデックス225・マザーファンド

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

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

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

\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

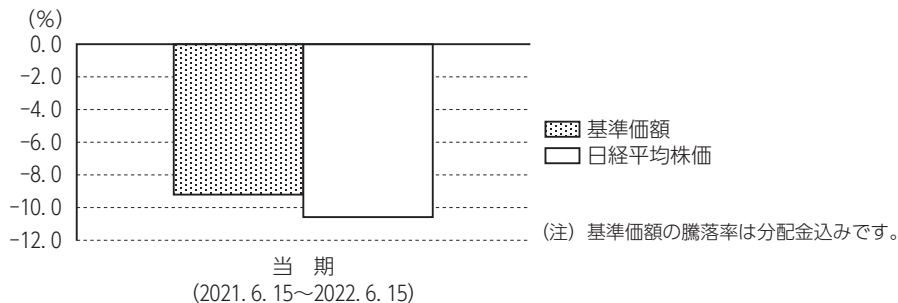
## ベンチマークとの差異について

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

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

また、ファンドから運用管理費用が控除されたことがマイナス要因となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\* ベンチマークは日経平均株価です。



## 分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### 分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
<b>当期分配金（税込み）</b>	<b>（円）</b>	<b>160</b>
対基準価額比率	（％）	1.15
当期の収益	（円）	160
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	3,811

（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。

### 収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 168.59円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	3,305.79
(d) 分配準備積立金	497.27
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	3,971.66
(f) 分配金	160.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	3,811.66

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 今後の運用方針

### 当ファンド

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

### ストックインデックス225・マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16~2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	50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14,715円です。
(投 信 会 社)	(31)	(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	0.002	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.006	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)	(0.006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	51	0.348	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

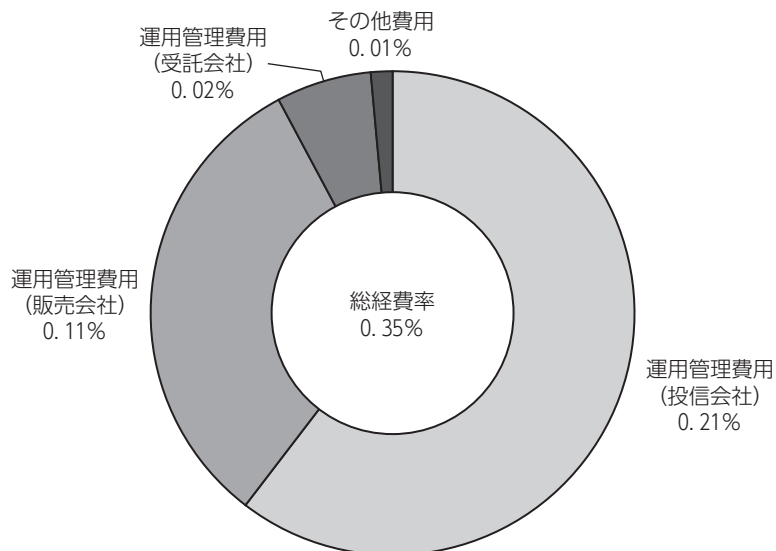
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

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



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数 千口	金 額 千円	□ 数 千口	金 額 千円
ストックインデックス225・マザーファンド	419,029	1,545,203	28,283	105,801

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

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

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

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

(注) 平均保有割合0.6%

※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

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	23千円
うち利害関係人への支払額 (B)	11千円
(B) / (A)	49.2%

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

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

■投信会社 (自社) による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首保有額	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取引の理由
1	—	—	1	当初設定時における取得

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）

### ■組入資産明細表 親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ストックインデックス225・マザーファンド	116,453	507,198	1,768,196

(注) 単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ストックインデックス225・マザーファンド	1,768,196	98.8
コール・ローン等、その他	21,977	1.2
投資信託財産総額	1,790,174	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>1,790,174,328円</b>
コール・ローン等	3,447,530
ストックインデックス225・マザーファンド (評価額)	1,768,196,798
未収入金	18,530,000
<b>(B) 負債</b>	<b>41,926,662</b>
未払収益分配金	20,252,414
未払解約金	18,514,230
未払信託報酬	3,109,949
その他未払費用	50,069
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>1,748,247,666</b>
元本	1,265,775,901
次期繰越損益金	482,471,765
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>1,265,775,901口</b>
1万口当り基準価額 (C / D)	13,812円

\* 期首における元本額は285,541,229円、当作成期間中における追加設定元本額は1,043,814,417円、同解約元本額は63,579,745円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,812円です。

### ■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 206円</b>
受取利息	5
支払利息	△ 211
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 116,554,367</b>
売買益	1,872,298
売買損	△ 118,426,665
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 4,355,746</b>
<b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b>	<b>△ 120,910,319</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>62,943,396</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>560,691,102</b>
(配当等相当額)	( 270,154,347)
(売買損益相当額)	( 290,536,755)
<b>(G) 合計 (D + E + F)</b>	<b>502,724,179</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 20,252,414</b>
<b>次期繰越損益金 (G + H)</b>	<b>482,471,765</b>
追加信託差損益金	560,691,102
(配当等相当額)	( 270,154,347)
(売買損益相当額)	( 290,536,755)
分配準備積立金	64,031,780
繰越損益金	△ 142,251,117

(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	21,340,798円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	418,439,985
(d) 分配準備積立金	62,943,396
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	502,724,179
(f) 分配金	20,252,414
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	482,471,765
(h) 受益権総口数	1,265,775,901口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)	160円

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

## ストックインデックス 2 2 5 ・マザーファンド

### <補足情報>

当ファンド（ダイワ日経 2 2 5 インデックス（ダイワ SMA 専用））が投資対象としている「ストックインデックス 2 2 5 ・マザーファンド」の決算日（2021年 9 月 21 日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年 6 月 15 日）現在におけるストックインデックス 2 2 5 ・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

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

（2021年 6 月 16 日から 2022年 6 月 15 日まで）

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ファーストリテイリング	62	4,286,740	69,140	ファーストリテイリング	19	1,431,372	75,335
東京エレクトロン	62	3,257,220	52,535	東京エレクトロン	19	1,025,214	53,958
ソフトバンクグループ	372	2,193,636	5,896	ソフトバンクグループ	114	746,984	6,552
村田製作所	220.8	2,138,543	9,685	ダイキン工業	19	511,862	26,940
キーエンス	27.6	1,816,904	65,829	ファナック	19	480,387	25,283
任天堂	27.6	1,501,634	54,407	KDDI	114	440,283	3,862
ファナック	62	1,418,750	22,883	アドバンテスト	38	396,197	10,426
ダイキン工業	62	1,409,300	22,730	テルモ	76	384,017	5,052
KDDI	372	1,368,144	3,677	信越化学	19	379,782	19,988
アドバンテスト	124	1,153,600	9,303	リクルートホールディングス	57	370,866	6,506

（注 1）金額は受渡し代金。

（注 2）金額の単位未満は切捨て。

### ■組入資産明細表

下記は、2022年 6 月 15 日現在におけるストックインデックス 2 2 5 ・マザーファンド（60,104,604千円）の内容です。

#### (1) 国内株式

銘 柄	2022年 6 月 15 日現在		銘 柄	2022年 6 月 15 日現在		銘 柄	2022年 6 月 15 日現在	
	株 数	評 価 額		株 数	評 価 額		株 数	評 価 額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>			<b>食料品 (3.4%)</b>			帝人	54.6	75,566
日本水産	273	144,963	日清製粉G本社	273	409,227	東レ	273	192,246
マルハニチロ	27.3	63,336	明治ホールディングス	54.6	339,066	<b>パルプ・紙 (0.1%)</b>		
<b>鉱業 (0.1%)</b>			日本ハム	136.5	550,095	王子ホールディングス	273	153,699
INPEX	109.2	181,490	サッポロホールディングス	54.6	150,914	日本製紙	27.3	25,825
<b>建設業 (1.8%)</b>			アサヒグループホールディング	273	1,152,879	<b>化学 (7.6%)</b>		
コムシスホールディングス	273	670,761	キリンHD	273	555,009	クラレ	273	306,306
大成建設	54.6	218,400	宝ホールディングス	273	259,350	旭化成	273	288,561
大林組	273	259,623	キッコーマン	273	1,815,450	昭和電工	27.3	70,352
清水建設	273	195,468	味の素	273	831,012	住友化学	273	151,515
長谷工コーポレーション	54.6	85,121	ニチレイ	136.5	302,347	日産化学	273	1,831,830
鹿島建設	136.5	196,287	日本たばこ産業	273	649,740	東ソー	136.5	243,925
大和ハウス	273	830,193	<b>繊維製品 (0.1%)</b>			トクヤマ	54.6	98,989
積水ハウス	273	636,909	東洋紡	27.3	27,846	デンカ	54.6	181,272
日揮ホールディングス	273	511,329	ユニチカ	27.3	6,279	信越化学	273	4,722,900



銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
三井化学	54.6	171,990	古河電工	27.3	60,933	京セラ	546	3,929,016
三菱ケミカル HLDGS	136.5	109,445	住友電工	273	396,805	太陽誘電	273	1,408,680
UBE	27.3	57,002	フジクラ	273	219,765	村田製作所	218.4	1,758,120
花王	273	1,392,300	<b>金属製品 (0.0%)</b>			SCREENホールディングス	54.6	570,024
DIC	27.3	68,386	SUMCO	27.3	55,173	キヤノン	409.5	1,331,284
富士フイルム HLDGS	273	1,888,887	<b>機械 (4.9%)</b>			リコー	273	301,392
資生堂	273	1,389,843	日本製鋼所	54.6	168,441	東京エレクtron	273	13,923,000
日東電工	273	2,566,200	オークマ	54.6	293,748	<b>輸送用機器 (4.8%)</b>		
<b>医薬品 (7.0%)</b>			アマダ	273	283,647	デンソー	273	2,060,604
協和キリン	273	770,406	小松製作所	273	901,446	川崎重工業	27.3	77,286
武田薬品	273	965,055	住友重機械	54.6	171,990	日産自動車	273	145,672
アステラス製薬	1,365	2,723,175	日立建機	273	904,995	いすゞ自動車	136.5	214,441
住友ファーマ	273	284,466	クボタ	273	602,920	トヨタ自動車	1,365	2,839,200
塩野義製薬	273	1,772,589	荏原製作所	54.6	298,116	日野自動車	273	188,916
中外製薬	819	2,768,220	ダイキン工業	273	5,428,605	三菱自動車工業	27.3	11,984
エーザイ	273	1,387,932	日本精工	273	208,299	マツダ	54.6	60,442
第一三共	819	2,523,339	NTN	273	76,440	本田技研	546	1,804,530
大塚ホールディングス	273	1,176,903	ジェイテクト	273	288,834	スズキ	273	1,101,555
<b>石油・石炭製品 (0.3%)</b>			三井E&SHD	27.3	9,773	SUBARU	273	668,167
出光興産	109.2	387,660	日立造船	54.6	46,355	ヤマハ発動機	273	704,340
ENEOSホールディングス	273	147,065	三菱重工業	27.3	142,642	<b>精密機器 (3.8%)</b>		
<b>ゴム製品 (0.8%)</b>			IHI	27.3	107,016	テルモ	1,092	4,179,084
横浜ゴム	136.5	235,053	<b>電気機器 (24.2%)</b>			ニコン	273	455,637
ブリヂストン	273	1,382,745	コニカミノルタ	273	125,580	オリンパス	1,092	2,953,860
<b>ガラス・土石製品 (1.0%)</b>			ミネベアミツミ	273	631,722	シチズン時計	273	152,880
AGC	54.6	274,638	日立	54.6	364,455	<b>その他製品 (3.1%)</b>		
日本板硝子	27.3	10,565	三菱電機	273	383,701	バンダイナムコ HLDGS	273	2,540,538
日本電気硝子	81.9	226,617	富士電機	54.6	315,588	凸版印刷	136.5	318,864
住友大阪セメント	27.3	97,870	安川電機	273	1,171,170	大日本印刷	136.5	392,847
太平洋セメント	27.3	56,210	オムロン	273	1,828,827	ヤマハ	273	1,452,360
東海カーボン	273	317,499	ジーエス・ユアサ コーポ	54.6	115,369	任天堂	27.3	1,534,533
TOTO	136.5	582,172	日本電気	27.3	139,503	<b>電気・ガス業 (0.2%)</b>		
日本碍子	273	517,062	富士通	27.3	466,830	東京電力HD	27.3	13,431
<b>鉄鋼 (0.1%)</b>			沖電気	27.3	21,621	中部電力	27.3	34,261
日本製鉄	27.3	55,009	セイコーエプソン	546	1,183,728	関西電力	27.3	34,234
神戸製鋼所	27.3	17,963	パナソニックホールディング	273	301,801	東京瓦斯	54.6	142,779
JFEホールディングス	27.3	41,277	シャープ	273	280,098	大阪瓦斯	54.6	132,132
大太平洋金属	27.3	72,017	ソニーグループ	273	3,034,395	<b>陸運業 (1.4%)</b>		
<b>非鉄金属 (0.9%)</b>			TDK	819	3,591,315	東武鉄道	54.6	161,889
日本軽金属HD	27.3	41,659	アルプスアルパイン	273	397,761	東急	136.5	202,020
三井金属	27.3	89,271	横河電機	273	616,161	小田急電鉄	136.5	232,732
東邦亜鉛	27.3	62,489	アドバンテスト	546	4,220,580	京王電鉄	54.6	242,151
三菱マテリアル	27.3	53,972	キーエンス	27.3	1,262,625	京成電鉄	136.5	473,655
住友鉱山	136.5	667,894	カシオ	273	341,250	東日本旅客鉄道	27.3	184,821
DOWAホールディングス	54.6	248,703	ファナック	273	5,470,920	西日本旅客鉄道	27.3	130,248

# ストックインデックス225・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
東海旅客鉄道	27.3	420,693
ヤマトホールディングス	273	567,567
NIPPON EXPRESS	27.3	207,753
<b>海運業 (0.4%)</b>		
日本郵船	27.3	264,264
商船三井	81.9	262,489
川崎汽船	27.3	251,160
<b>空運業 (0.0%)</b>		
ANAホールディングス	27.3	66,407
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>		
三菱倉庫	136.5	434,070
<b>情報・通信業 (11.9%)</b>		
ネクソン	546	1,600,872
Zホールディングス	109.2	43,297
トレンドマイクロ	273	1,793,610
日本電信電話	109.2	417,580
KDDI	1,638	7,130,214
ソフトバンク	273	398,170
東宝	27.3	131,313
NTTデータ	1,365	2,537,535
コナミホールディングス	273	2,140,320
ソフトバンクグループ	1,638	8,235,864
<b>卸売業 (2.6%)</b>		
双日	27.3	55,364
伊藤忠	273	1,010,646
丸紅	273	363,909
豊田通商	273	1,306,305
三井物産	273	877,149
住友商事	273	504,777
三菱商事	273	1,196,559
<b>小売業 (10.5%)</b>		
J.フロントリテイリング	136.5	151,924
三越伊勢丹HD	273	283,920
セブン&アイ・HLDGS	273	1,421,238
高島屋	136.5	174,447
丸井グループ	273	619,983
イオン	273	592,956
ファーストリテイリング	273	18,329,220
<b>銀行業 (0.6%)</b>		
コンソルディア・フィナンシャル	273	127,491
あおぞら銀行	27.3	72,317
三菱UFJフィナンシャルG	273	202,074
りそなホールディングス	27.3	13,928
三井住友トラストHD	27.3	112,203
三井住友フィナンシャルG	27.3	109,636

銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
千葉銀行	273	203,658
ふくおかフィナンシャルG	54.6	134,971
静岡銀行	273	220,857
みずほフィナンシャルG	27.3	41,195
<b>証券・商品先物取引業 (0.3%)</b>		
大和証券G本社	273	168,058
野村ホールディングス	273	133,770
松井証券	273	220,857
<b>保険業 (0.9%)</b>		
SOMPOホールディングス	54.6	322,904
MS&AD	81.9	332,432
第一生命HLDGS	27.3	72,208
東京海上HD	136.5	1,014,877
T&Dホールディングス	54.6	87,687
<b>その他金融業 (0.8%)</b>		
クレディセゾン	273	416,325
オリックス	273	631,858
日本取引所グループ	273	566,884
<b>不動産業 (1.3%)</b>		
東急不動産HD	273	183,456
三井不動産	273	788,424
三菱地所	273	528,664
東京建物	136.5	233,005
住友不動産	273	951,405
<b>サービス業 (4.8%)</b>		
エムスリー	655.2	2,336,443
ディー・エヌ・エー	81.9	141,523
電通グループ	273	1,147,965
サイバーエージェント	218.4	273,000
楽天グループ	273	177,177
リクルートホールディングス	819	3,289,923
日本郵政	273	263,390
セコム	273	2,212,938
	千株	千円
合計	株数、金額	51,324 204,507,294
	銘柄数<比率>	225銘柄 <97.6%>

(注1) 銘柄欄の( )内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (2)先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2022年6月15日現在	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
日経平均	4,993	—

(注) 単位未満は切捨て。

## ■有価証券の貸付及び借入状況

区分	2022年6月15日現在	
	貸付	借入
株式	株 1,287,000 ( )	株 — ( )

(注) ( )内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

# ストックインデックス225・マザーファンド

## 運用報告書 第20期 (決算日 2021年9月21日)

(作成対象期間 2020年9月24日～2021年9月21日)

ストックインデックス225・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

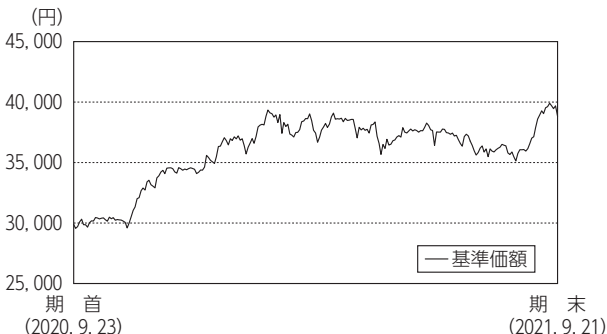
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



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

(注1) 基準価額の騰落率は期首比。

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

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：29,884円 期末：38,825円 騰落率：29.9%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆ 投資環境について

○ 国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

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

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ ポートフォリオについて

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

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

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

◆ ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は27.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は29.9%となりました。

- ・ファンドには保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークである日経平均株価では配当金の影響が考慮されないことが、プラス要因となりました。
- ・資金の流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。

\* ベンチマークは日経平均株価です。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

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

■売買および取引の状況

(1)株 式

(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 5,707.3 ( 182)	千円 22,448,831 ( —)	千株 8,877.1	千円 33,973,327

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

(2)先物取引の種類別取引状況

(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。  
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

ストックインデックス225・マザーファンド

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円	
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>													<b>金属製品 (0.2%)</b>							
日本水産	250	234	150,228					宇部興産	25	23.4	53,539		SUMCO	25	23.4	55,809				
マルハニチロ	25	23.4	62,103					日本化薬	250	—	—		東洋製罐グループHD	250	234	314,730				
<b>鉱業 (0.0%)</b>								花王	250	234	1,563,822		<b>機械 (5.1%)</b>							
INPEX	100	93.6	73,756					D I C	25	23.4	76,986		日本製鋼所	50	46.8	138,387				
<b>建設業 (1.7%)</b>								富士フィルム HLDGS	250	234	2,268,396		オークマ	50	46.8	263,952				
コムシスホールディングス	250	234	698,724					資生堂	250	234	1,787,292		アマダ	250	234	281,034				
大成建設	50	46.8	168,480					日東電工	250	234	1,944,540		小松製作所	250	234	635,193				
大林組	250	234	219,024					<b>医薬品 (7.4%)</b>					住友重機械	50	46.8	141,570				
清水建設	250	234	197,964					協和キリン	250	234	966,420		日立建機	250	234	746,460				
長谷工コーポレーション	50	46.8	70,200					武田薬品	250	234	879,606		クボタ	250	234	566,046				
鹿島建設	125	117	171,522					アステラス製薬	1,250	1,170	2,194,920		荏原製作所	50	46.8	272,376				
大和ハウス	250	234	889,200					大日本住友製薬	250	234	481,338		日立造船	250	234	6,243,120				
積水ハウス	250	234	555,867					塩野義製薬	250	234	1,724,814		日本精工	250	234	177,138				
日揮ホールディングス	250	234	229,320					中外製薬	750	702	2,898,558		NTN	250	234	58,500				
<b>食料品 (3.8%)</b>								エーザイ	250	234	1,960,686		ジェイテクト	250	234	224,874				
日清製粉G本社	250	234	450,684					第一三共	250	702	2,120,040		三菱重工業	25	23.4	70,036				
明治ホールディングス	50	46.8	343,044					大塚ホールディングス	250	234	1,136,538		I H I	25	23.4	60,114				
日本ハム	125	117	512,460					<b>石油・石炭製品 (0.2%)</b>					<b>電気機器 (23.7%)</b>							
サッポロホールディングス	50	46.8	117,889					出光興産	100	93.6	270,597		日清紡ホールディングス	250	234	195,858				
アサヒグループホールディングス	250	234	1,283,490					ENEOSホールディングス	250	234	107,663		コニカミノルタ	250	234	140,634				
キリンHD	250	234	479,466					<b>ゴム製品 (0.8%)</b>					ミネベアミツミ	250	234	688,662				
宝ホールディングス	250	234	366,210					横浜ゴム	125	117	232,128		日立	50	46.8	301,532				
キッコーマン	250	234	2,227,680					ブリヂストン	250	234	1,240,902		三菱電機	250	234	368,901				
味の素	250	234	810,576					<b>ガラス・土石製品 (1.0%)</b>					富士電機	50	46.8	240,084				
ニチレイ	125	117	348,660					AGC	50	46.8	266,760		安川電機	250	234	1,373,580				
日本たばこ産業	250	234	506,376					日本板硝子	25	23.4	13,455		オムロン	250	234	2,686,320				
<b>繊維製品 (0.1%)</b>								日本電気硝子	75	70.2	169,041		ジーエス・ユアサコーポ	50	46.8	120,931				
東洋紡	25	23.4	32,666					住友大阪セメント	25	23.4	73,827		日本電気	25	23.4	145,548				
ユニチカ	25	23.4	9,032					太平洋セメント	25	23.4	57,330		富士通	25	23.4	492,102				
帝人	50	46.8	76,003					東海カーボン	250	234	358,956		沖電気	25	23.4	23,002				
東レ	250	234	170,188					TOTO	125	117	652,860		セイコーエプソン	500	468	1,066,572				
<b>パルプ・紙 (0.1%)</b>								日本碍子	250	234	440,856		パナソニック	250	234	323,973				
王子ホールディングス	250	234	136,188					<b>鉄鋼 (0.1%)</b>					シャープ	—	234	324,324				
日本製紙	25	23.4	28,711					日本製鉄	25	23.4	16,029		ソニーグループ	250	234	2,887,560				
<b>化学 (8.2%)</b>								神戸製鋼所	25	23.4	16,029		T D K	250	234	2,915,640				
クラレ	250	234	247,338					J F Eホールディングス	25	23.4	41,230		アルプスアルパイン	250	234	283,842				
旭化成	250	234	290,979					大太平洋金属	25	23.4	44,319		横河電機	250	234	460,512				
昭和電工	25	23.4	63,671					<b>非鉄金属 (0.8%)</b>					アドバンテス	500	468	5,194,800				
住友化学	250	234	138,294					日本軽金属HD	250	23.4	47,174		カシオ	250	234	424,242				
日産化学	250	234	1,619,280					三井金属	25	23.4	76,752		ファナック	250	234	5,984,550				
東ソー	125	117	243,477					東邦亜鉛	25	23.4	67,134		京セラ	500	468	3,274,128				
トクヤマ	50	46.8	103,615					三菱マテリアル	25	23.4	52,392		太陽誘電	250	234	1,729,260				
デンカ	50	46.8	189,306					住友鉱山	125	117	484,497		SCREENホールディングス	50	46.8	477,828				
信越化学	250	234	4,949,100					DOWAホールディングス	50	46.8	214,110		キャノン	375	351	943,488				
三井化学	50	46.8	184,392					古河電工	25	23.4	56,277		リコー	250	234	257,634				
三菱ケミカル HLDGS	125	117	120,744					住友電工	250	234	349,245									
								フジクラ	250	234	160,758									

ストックインデックス225・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
東京エレクトロン	250	234	12,652	380	空運業 (0.0%)					証券・商品先物取引業 (0.2%)				
輸送用機器 (4.5%)					ANAホールディングス	25	23.4	63,414		大和証券G本社	250	234	156,241	
デンソー	250	234	1,811	160	倉庫・運輸関連業 (0.2%)					野村ホールディングス	250	234	128,957	
三井E&SHD	25	23.4	11,349		三菱倉庫	125	117	384,930		松井証券	250	234	194,922	
川崎重工業	25	23.4	57,236		情報・通信業 (11.1%)					保険業 (0.7%)				
日産自動車	250	234	130,174		ネクソン	—	468	818,064		SOMPOホールディングス	62.5	58.5	297,063	
いすゞ自動車	125	117	173,043		Zホールディングス	100	93.6	68,749		MS&AD	75	70.2	269,357	
トヨタ自動車	250	234	2,323,386		トレンドマイクロ	250	234	1,453,140		第一生命HLDGS	25	23.4	55,188	
日野自動車	250	234	237,042		スカパーJSATHD	25	23.4	9,968		東京海上HD	125	117	702,000	
三菱自動車工業	25	23.4	6,528		日本電信電話	100	93.6	301,953		T&Dホールディングス	50	46.8	72,072	
マツダ	50	46.8	43,758		KDDI	1,500	1,404	5,315,544		その他金融業 (0.5%)				
本田技研	500	468	1,562,184		ソフトバンク	—	234	364,104		クレディセゾン	250	234	317,538	
スズキ	250	234	1,190,124		N T T ドコモ	25	—	—		日本取引所グループ	250	234	680,472	
SUBARU	250	234	481,338		東宝	25	23.4	123,084		不動産業 (1.2%)				
ヤマハ発動機	250	234	721,890		N T T データ	1,250	1,170	2,544,750		東急不動産HD	250	234	155,376	
精密機器 (3.9%)					コナミホールディングス	250	234	1,600,560		三井不動産	250	234	590,265	
テルモ	1,000	936	4,975,776		ソフトバンクグループ	1,500	1,404	8,885,916		三菱地所	250	234	404,937	
ニコン	250	234	307,476		卸売業 (2.0%)					東京建物	125	117	198,783	
オリンパス	1,000	936	2,177,136		双日	25	23.4	8,283		住友不動産	250	234	909,792	
シチズン時計	250	234	122,850		伊藤忠	250	234	808,470		サービス業 (7.1%)				
その他製品 (2.2%)					丸紅	250	234	216,309		エムスリー	600	561.6	4,823,020	
パナソニックHLDGS	250	234	2,078,622		豊田通商	250	234	1,117,350		ディー・エヌ・エー	75	70.2	139,276	
凸版印刷	125	117	233,064		三井物産	250	234	572,130		電通グループ	250	234	982,800	
大日本印刷	125	117	322,803		住友商事	250	234	374,400		サイバーエージェント	50	187.2	410,529	
ヤマハ	250	234	1,701,180		三菱商事	250	234	826,488		楽天グループ	250	234	259,740	
電気・ガス業 (0.1%)					小売業 (10.5%)					リクルートホールディングス	750	702	4,902,066	
東京電力HD	25	23.4	7,230		J.フロントリテイリング	125	117	118,638		日本郵政	250	234	226,231	
中部電力	25	23.4	31,917		三越伊勢丹HD	250	234	186,966		セコム	250	234	1,965,600	
関西電力	25	23.4	26,945		セブン&アイ・HLDGS	250	234	1,199,016						
東京瓦斯	50	46.8	101,017		ファミリーマート	1,000	—	—						
大阪瓦斯	50	46.8	99,637		高島屋	125	117	135,486						
陸運業 (1.5%)					丸井グループ	250	234	489,762						
東武鉄道	50	46.8	139,370		イオン	250	234	706,212						
東急	125	117	188,136		ファーストリテイリング	250	234	17,463,420						
小田急電鉄	125	117	301,275		銀行業 (0.6%)									
京王電鉄	50	46.8	280,332		コンソルディア・フィナンシャル	250	234	103,896						
京成電鉄	125	117	415,935		新生銀行	25	23.4	44,132						
東日本旅客鉄道	25	23.4	165,859		あおぞら銀行	25	23.4	63,975						
西日本旅客鉄道	25	23.4	121,492		三菱UFJフィナンシャルG	250	234	148,005						
東海旅客鉄道	25	23.4	382,941		りそなホールディングス	25	23.4	10,387						
日本通運	25	23.4	190,008		三井住友トラストHD	25	23.4	89,622						
ヤマトホールディングス	250	234	681,876		三井住友フィナンシャルG	25	23.4	91,938						
海運業 (0.3%)					千葉銀行	250	234	166,842						
日本郵船	25	23.4	235,404		ふくおかフィナンシャルG	50	46.8	94,348						
商船三井	25	23.4	215,046		静岡銀行	250	234	217,152						
川崎汽船	25	23.4	171,054		みずほフィナンシャルG	250	23.4	37,486						

銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株
合計	45,587.5	42,599.7	193,896.831	<97.8%>

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
日経平均	2,886	—

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
日経平均	2,886	—

(注) 単位未満は切捨て。



## ストックインデックス225・マザーファンド

### ■有価証券の貸付及び借入の状況

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

(注) ( )内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

### ■投資信託財産の構成

2021年9月21日現在

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

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年9月21日現在

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

\* 期首における元本額は55,323,152,743円、当作成期間中における追加設定元本額は12,733,160,542円、同解約元本額は16,999,574,513円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ストックインデックス ファンド225 20,583,545,296円、適格機関投資家専用・ダイワ・ストックインデックスファンド225 V A333,474,643円、大和 ストックインデックス 225 ファンド7,295,860,497円、D-1's 日経225インデックス113,106,768円、iFree 日経225インデックス6,285,660,509円、D-C・ダイワ・ストックインデックス225 (確定拠出年金専用ファンド) 5,483,055,624円、ダ

イワ・ノーロード 日経225ファンド307,165,744円、ダイワファンドラップ 日経225インデックス3,954,737,892円、ダイワ日経225インデックス (ダイワ S M A 専用) 169,533,410円、ダイワ・インデックスセレクト 日経225 6,530,598,389円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は38,825円です。

### ■損益の状況

当期 自 2020年9月24日 至 2021年9月21日

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

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

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

# ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジあり) (ダイワSMA専用)

## 運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、外国の株式（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運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2017年2月16日）		
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの受益証券	
	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
2期末(2018年6月15日)	11,436	100	10.8	11,319	8.9	96.6	3.4	—	2.3	1,333
3期末(2019年6月17日)	11,475	190	2.0	11,338	0.2	93.1	6.1	—	2.8	3,003
4期末(2020年6月15日)	11,475	160	1.4	11,331	△ 0.1	96.4	2.0	—	2.7	7,959
5期末(2021年6月15日)	15,732	210	38.9	15,559	37.3	95.5	3.7	—	2.4	11,208
6期末(2022年6月15日)	13,560	160	△ 12.8	13,405	△ 13.8	97.1	6.1	—	2.5	9,983

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

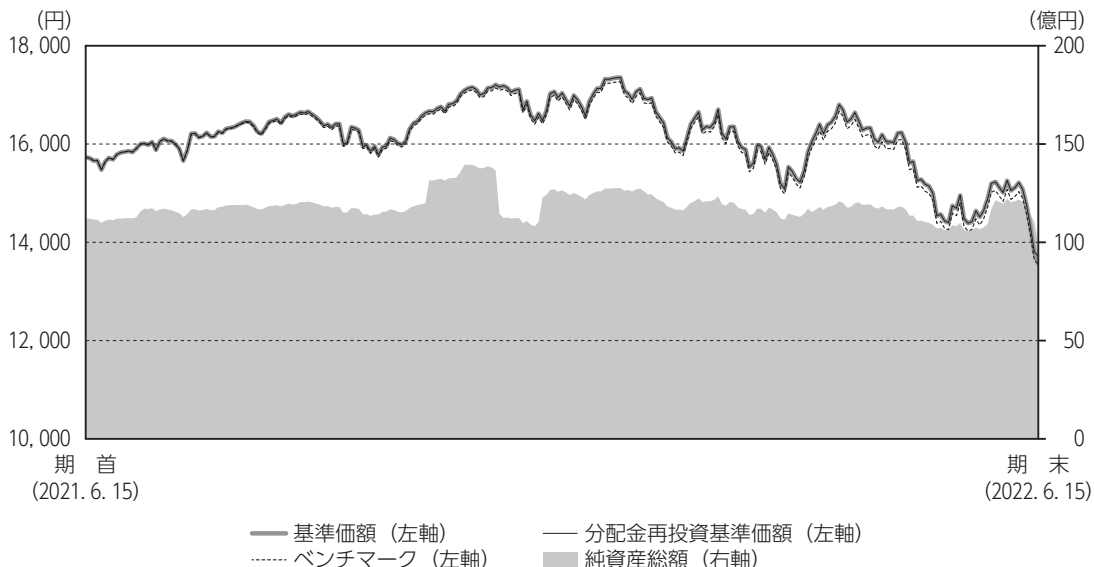
(注6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注7) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：15,732円

期末：13,560円（分配金160円）

騰落率：△12.8%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

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

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)

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 組入比率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首)2021年 6月15日	15,732	—	15,559	—	95.5	3.7	—	2.4
6月末	15,857	0.8	15,681	0.8	93.7	4.3	—	2.3
7月末	16,229	3.2	16,044	3.1	92.0	4.4	—	2.3
8月末	16,605	5.5	16,392	5.4	91.2	6.5	—	2.2
9月末	15,981	1.6	15,761	1.3	94.3	4.9	—	2.3
10月末	16,807	6.8	16,570	6.5	94.0	5.8	—	2.3
11月末	16,871	7.2	16,617	6.8	93.0	3.7	—	2.3
12月末	17,336	10.2	17,062	9.7	93.4	5.7	—	2.4
2022年 1月末	16,124	2.5	15,861	1.9	93.0	4.4	—	2.3
2月末	15,979	1.6	15,697	0.9	92.5	5.4	—	2.3
3月末	16,699	6.1	16,379	5.3	96.8	6.6	—	2.5
4月末	15,280	△ 2.9	14,977	△ 3.7	95.8	6.9	—	2.7
5月末	15,232	△ 3.2	14,889	△ 4.3	88.8	8.1	—	2.3
(期末)2022年 6月15日	13,720	△ 12.8	13,405	△ 13.8	97.1	6.1	—	2.5

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

（2021. 6. 16 ～ 2022. 6. 15）

### ■海外株式市況

海外株式市況は下落しました。

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

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

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

### ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

（2021. 6. 16 ～ 2022. 6. 15）

### ■当ファンド

「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の受益証券組入比率は、当作成期を通じておおむね100%程度を維持しました。なお、当作成期末のマザーファンド組入比率は101.2%となっておりますが、翌営業日計上のマザーファンド解約金額を考慮したマザーファンド実質組入比率は100%程度となっております。

## ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

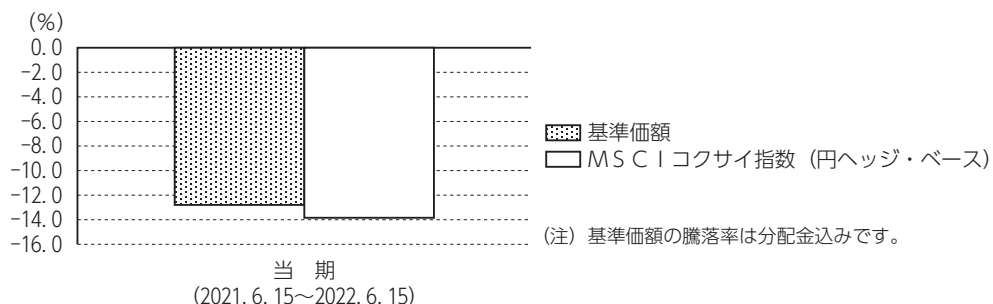
組入ファンド	ベンチマーク
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	M S C I コクサイ指数（円ヘッジ・ベース）

## ベンチマークとの差異について

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

マザーファンドにおいて保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークには配当分が含まれていないことが、かい離要因となりました。その他、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M S C I コクサイ指数（円ヘッジ・ベース）です。



## 分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### 分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
<b>当期分配金（税込み）</b>	<b>（円）</b>	<b>160</b>
対基準価額比率	（％）	1.17
当期の収益	（円）	160
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	4,117

(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。

### 収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 186.97円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	2,190.62
(d) 分配準備積立金	1,899.91
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	4,277.52
(f) 分配金	160.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	4,117.52

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 今後の運用方針

### 当ファンド

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

### 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	72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16, 155円です。
（投 信 会 社）	(51)	(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）	(18)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(4)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	1	0. 006	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株 式）	(1)	(0. 003)	
（先物・オプション）	(0)	(0. 002)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
有 価 証 券 取 引 税	1	0. 003	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株 式）	(1)	(0. 003)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	5	0. 032	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(2)	(0. 014)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0. 006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(2)	(0. 013)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	79	0. 486	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

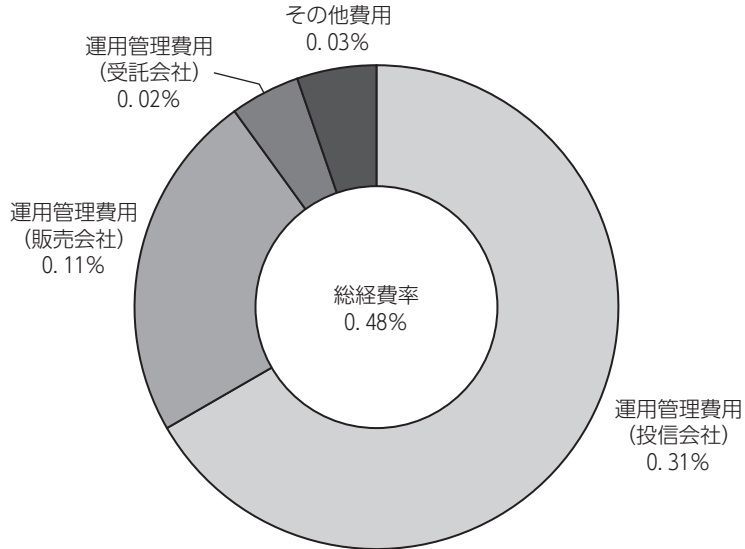
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

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



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

## 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）

### ■売買および取引の状況

#### 親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2021年6月16日から2022年6月15日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数 千口	金 額 千円	□ 数 千口	金 額 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	2,006,261	5,717,623	1,943,546	5,540,633

（注）単位未満は切捨て。

### ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2021年6月16日から2022年6月15日まで）

項 目	当 期
	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	17,819,330千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	74,812,154千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.23

（注1）(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

（注2）単位未満は切捨て。

### ■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

### ■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首 保有額	当作成期中 設定額	当作成期中 解約額	当作成期末 保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

（注1）金額は元本ベース。

（注2）単位未満は切捨て。

### ■組入資産明細表

#### 親投資信託残高

種 類	当 期 末		
	□ 数 千口	□ 数 千口	評 価 額 千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	4,117,936	4,180,652	10,100,037

（注）単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額 千円	比 率 %
外国株式インデックス 為替ヘッジ型マザーファンド	10,100,037	91.9
コール・ローン等、その他	895,730	8.1
投資信託財産総額	10,995,767	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。

（注2）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.01円、1カナダ・ドル=104.20円、1オーストラリア・ドル=93.10円、1香港・ドル=17.20円、1シンガポール・ドル=96.95円、1ニュージーランド・ドル=83.95円、1イギリス・ポンド=162.21円、1イスラエル・シケル=38.942円、1スイス・フラン=135.01円、1デンマーク・クローネ=18.93円、1ノルウェー・クローネ=13.49円、1スウェーデン・クローネ=13.25円、1ユーロ=140.80円です。

（注3）外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（72,926,239千円）の投資信託財産総額（76,386,708千円）に対する比率は、95.5%です。

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	10,995,767,980円
コール・ローン等	28,029,703
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）	10,100,037,277
未収入金	867,701,000
(B) 負債	1,012,018,005
未払収益分配金	117,804,530
未払解約金	867,734,338
未払信託報酬	26,156,308
その他未払費用	322,829
(C) 純資産総額（A - B）	9,983,749,975
元本	7,362,783,159
次期繰越損益金	2,620,966,816
(D) 受益権総口数	7,362,783,159口
1万口当り基準価額（C / D）	13,560円

\* 期首における元本額は7,124,652,730円、当作成期間中における追加設定元本額は3,696,975,613円、同解約元本額は3,458,845,184円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,560円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,836円
受取利息	850
支払利息	△ 3,686
(B) 有価証券売買損益	△ 1,551,947,506
売買益	393,170,995
売買損	△ 1,945,118,501
(C) 信託報酬等	△ 53,420,709
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 1,605,371,051
(E) 前期繰越損益金	1,398,865,840
(F) 追加信託差損益金	2,945,276,557
(配当等相当額)	( 1,612,910,682)
(売買損益相当額)	( 1,332,365,875)
(G) 合計 (D + E + F)	2,738,771,346
(H) 収益分配金	△ 117,804,530
次期繰越損益金 (G + H)	2,620,966,816
追加信託差損益金	2,945,276,557
(配当等相当額)	( 1,612,910,682)
(売買損益相当額)	( 1,332,365,875)
分配準備積立金	1,418,730,312
繰越損益金	△ 1,743,040,053

- (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せん。
- (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	137,669,002円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	1,612,910,682
(d) 分配準備積立金	1,398,865,840
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	3,149,445,524
(f) 分配金	117,804,530
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	3,031,640,994
(h) 受益権総口数	7,362,783,159口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)	160円

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

### <補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の決算日（2022年1月11日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

### ■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの主要な売買銘柄

（2021年6月16日から2022年6月15日まで）

買 付				売 付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.832	315,115	378,744	APPLE INC (アメリカ)	27.233	560,521	20,582
APPLE INC (アメリカ)	14.364	281,276	19,582	MICROSOFT CORP (アメリカ)	10.8	412,091	38,156
MICROSOFT CORP (アメリカ)	7.1	254,077	35,785	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.677	255,389	377,236
TESLA INC (アメリカ)	2.37	239,795	101,179	TESLA INC (アメリカ)	1.335	169,258	126,785
SEA LTD-ADR (ケイマン諸島)	6.1	124,734	20,448	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.452	151,433	335,029
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.336	107,964	321,321	ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.436	147,070	337,316
SNOWFLAKE INC-CLASS A (アメリカ)	2.409	80,014	33,214	NVIDIA CORP (アメリカ)	3.556	111,656	31,399
NVIDIA CORP (アメリカ)	2.667	69,792	26,168	META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)	3.674	110,658	30,119
AIRBNB INC-CLASS A (アメリカ)	3.796	69,074	18,196	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	2.4	100,169	41,737
ASTRAZENECA PLC (イギリス)	4.872	68,765	14,114	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	5.19	90,457	17,429

（注1）金額は受渡し代金。

（注2）金額の単位未満は切捨て。

### ■組入資産明細表

下記は、2022年6月15日現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（30,012,407千円）の内容です。

#### (1) 外国株式

銘柄	柄	2022年6月15日現在		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)					
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	12.95	174	23,501	情報技術	
PALO ALTO NETWORKS INC	11.66	561	75,818	情報技術	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	20.63	278	37,648	情報技術	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	15.94	130	17,651	資本財・サービス	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7.46	106	14,408	ヘルスケア	
SYNCHRONY FINANCIAL	63.3	186	25,219	金融	
ABBOTT LABORATORIES	204.45	2,104	284,143	ヘルスケア	
HOWMET AEROSPACE INC	39.5	127	17,171	資本財・サービス	
VERISK ANALYTICS INC	21.4	338	45,716	資本財・サービス	
LAS VEGAS SANDS CORP	38.8	125	16,904	一般消費財・サービス	
AMPHENOL CORP-CL A	69.05	452	61,089	情報技術	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5	203	27,485	情報技術	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	69.34	660	89,169	情報技術	
QORVO INC	12.83	124	16,743	情報技術	
AFLAC INC	73.4	394	53,225	金融	
DARDEN RESTAURANTS INC	15.06	171	23,185	一般消費財・サービス	

## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	18.35	155	21,043	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	55.15	2,045	276,105	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	24.29	226	30,580	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	14.07	394	53,283	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	17.24	166	22,512	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24.66	589	79,644	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	81.05	1,485	200,555	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	26.56	177	23,932	金融
AUTOZONE INC	2.32	471	63,696	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	25.66	400	54,050	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	123.65	97	13,104	ヘルスケア
CELANESE CORP	12.11	164	22,269	素材
DR HORTON INC	37.92	249	33,645	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	87	11,772	ヘルスケア
AUTODESK INC	25.07	430	58,078	情報技術
MOODY'S CORP	18.84	485	65,543	金融
DEVON ENERGY CORP	72.76	513	69,342	エネルギー
ALBEMARLE CORP	13.24	295	39,920	素材
ATMOS ENERGY CORP	19.85	209	28,284	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	28.7	159	21,547	公益事業
CITIGROUP INC	235.48	1,082	146,116	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	50.58	1,032	139,396	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	56.49	510	68,976	公益事業
ALLEGHANY CORP	1.46	121	16,399	金融
DOMINO'S PIZZA INC	4.07	153	20,722	一般消費財・サービス
HESS CORP	32.31	387	52,376	エネルギー
DAVITA INC	7.09	63	8,612	ヘルスケア
DANAHER CORP	78.26	1,897	256,138	ヘルスケア
FORTIVE CORP	37.94	212	28,720	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	63.76	599	80,960	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	63.03	521	70,349	生活必需品
BUNGE LTD	16.93	176	23,851	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	37.5	443	59,939	情報技術
APPLE INC	1,882.24	24,988	3,373,713	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33.87	311	41,996	金融
BOEING CO/THE	62.67	765	103,360	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17.41	202	27,364	金融
BECTON DICKINSON AND CO	34.52	815	110,138	ヘルスケア
LEIDOS HOLDINGS INC	14	137	18,506	資本財・サービス
NISOURCE INC	62.99	173	23,471	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14.04	149	20,159	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	89.05	361	48,811	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	478.95	2,354	317,883	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	148.59	4,125	556,977	金融
ANSYS INC	9.93	228	30,802	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	149.34	690	93,230	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	88.22	841	113,650	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	247.85	1,806	243,839	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	336.97	3,843	518,908	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	29.88	321	43,439	金融
LKQ CORP	33	160	21,617	一般消費財・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	36.65	238	32,241	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	31.49	451	60,961	情報技術



## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12.69	308	41,644	金融
DOLLAR GENERAL CORP	26.46	608	82,171	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	24.12	1,072	144,830	情報技術
CATERPILLAR INC	60.68	1,254	169,328	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	27.52	150	20,308	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	27.67	115	15,630	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	5.74	120	16,235	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	33.84	211	28,563	公益事業
MOSAIC CO/THE	42.85	225	30,505	素材
DELTA AIR LINES INC	13.58	42	5,753	資本財・サービス
CORNING INC	91.15	292	39,502	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	473.34	2,031	274,219	情報技術
MORGAN STANLEY	150.47	1,127	152,280	金融
MSCI INC	9.38	366	49,515	金融
FAIR ISAAC CORP	3.25	123	16,647	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	3.22	62	8,498	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	27.8	158	21,416	情報技術
BROADCOM INC	47.46	2,468	333,302	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14.16	189	25,525	ヘルスケア
ARAMARK	31.73	96	12,992	一般消費財・サービス
DTE ENERGY COMPANY	21.62	257	34,767	公益事業
CENTENE CORP	65.39	498	67,298	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12.31	132	17,869	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	66.82	238	32,170	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	23.34	357	48,284	金融
GARTNER INC	9.35	219	29,614	情報技術
SPLUNK INC	19.21	166	22,426	情報技術
DOMINION ENERGY INC	91.9	685	92,559	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	43.42	382	51,621	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	14	77	10,516	資本財・サービス
DEERE & CO	33.11	1,081	145,987	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC	16.57	204	27,639	資本財・サービス
POOL CORP	4.38	153	20,663	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	32.97	369	49,921	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	24.85	301	40,702	情報技術
CABLE ONE INC	0.6	73	9,913	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	7.66	121	16,384	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	13.28	193	26,153	金融
VAIL RESORTS INC	4.92	113	15,334	一般消費財・サービス
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	63.6	75	10,235	コミュニケーション・サービス
TARGA RESOURCES CORP	28.16	186	25,206	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	115	15,577	金融
WESTLAKE CORP	5.72	65	8,832	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	39.99	355	47,932	公益事業
COGNEX CORP	19.94	85	11,581	情報技術
WEBSTER FINANCIAL CORP	22	99	13,383	金融
TELEFLEX INC	5.63	142	19,193	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	9.79	158	21,335	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8.52	239	32,278	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	2.41	113	15,291	ヘルスケア
CATALENT INC	18.63	194	26,231	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	16.6	297	40,188	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	6.9	180	24,378	ヘルスケア

## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
IDEX CORP	8.69	155	21,049	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	88.91	660	89,151	生活必需品
ROLLINS INC	26.85	88	11,882	資本財・サービス
AMETEK INC	25.97	289	39,038	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	27.07	221	29,968	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	16.44	74	10,025	資本財・サービス
HEICO CORP	5.35	71	9,634	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	7.16	171	23,214	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3.99	139	18,892	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	30.45	296	40,074	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	4.67	145	19,581	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	51.11	2,324	313,828	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	11.28	80	10,847	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	6.24	173	23,450	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	15.87	123	16,656	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3.18	382	51,691	一般消費財・サービス
UGI CORP	20.85	82	11,178	公益事業
CUMMINS INC	16.04	315	42,577	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	88.74	662	89,424	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	15.67	254	34,378	情報技術
SIGNATURE BANK	6.92	123	16,635	金融
COSTAR GROUP INC	46.91	258	34,940	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	6.77	275	37,144	金融
AMERCO	1.19	55	7,460	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	10.77	257	34,820	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	5.36	330	44,606	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	148	20,014	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	31.86	379	51,247	一般消費財・サービス
DEXCOM INC	44.16	306	41,322	ヘルスケア
NORDSON CORP	5.95	119	16,132	資本財・サービス
COPART INC	23.84	246	33,341	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	19.52	292	39,433	エネルギー
SEAGEN INC	15.45	223	30,170	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	8.31	197	26,710	ヘルスケア
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	9.71	183	24,715	金融
TRANSDIGM GROUP INC	5.87	309	41,816	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	4.3	139	18,820	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	12.03	109	14,815	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	25.6	208	28,088	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	231.08	413	55,813	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	28.39	508	68,716	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4.2	112	15,223	金融
COTERRA ENERGY INC	105.27	327	44,215	エネルギー
T-MOBILE US INC	75.5	942	127,313	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	17.86	53	7,279	不動産
COCA-COLA CO/THE	472.06	2,796	377,489	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	25.75	130	17,618	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.25	189	25,625	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	38.51	88	11,999	金融
CSX CORP	252.87	741	100,166	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10.44	223	30,143	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	15.63	159	21,509	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	1,057.4	10,818	1,460,573	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	70.32	608	82,122	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	486.82	4,678	631,622	エネルギー
AES CORP	74.55	140	19,032	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	4.33	118	15,940	金融
EOG RESOURCES INC	65.93	865	116,837	エネルギー
EQT CORP	45.84	187	25,269	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	19.14	170	23,075	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1.57	97	13,200	金融
ABIOMED INC	5.12	117	15,875	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	17.73	250	33,801	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	34.22	396	53,597	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	446.66	544	73,570	一般消費財・サービス
EXACT SCIENCES CORP	22.19	82	11,126	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	51	6,996	コミュニケーション・サービス
ENTEGRIS INC	17	167	22,667	情報技術
AERCAP HOLDINGS NV	17	67	9,095	資本財・サービス
FORTINET INC	15.95	429	57,976	情報技術
MARKEL CORP	1.59	206	27,834	金融
NEXTERA ENERGY INC	229.73	1,642	221,701	公益事業
MASIMO CORP	6.93	85	11,513	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	165.2	608	82,122	素材
INSULET CORP	7.69	158	21,340	ヘルスケア
US BANCORP	159.18	727	98,256	金融
UNITED RENTALS INC	8.26	214	29,008	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	6.59	99	13,416	情報技術
FASTENAL CO	65.3	320	43,313	資本財・サービス
FISERV INC	74.14	666	89,976	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	132.41	901	121,650	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	167.52	556	75,088	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	13.05	74	10,044	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	27.38	591	79,809	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	39.92	1,127	152,277	金融
ALPHABET INC-CL A	34.84	7,435	1,003,925	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	32.64	6,997	944,749	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	11.93	98	13,313	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	69.11	459	62,001	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	58.4	224	30,268	公益事業
GENUINE PARTS CO	16.26	215	29,074	一般消費財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	81	280	37,816	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21.91	497	67,124	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	102.3	375	50,646	エネルギー
HOME DEPOT INC	119.83	3,339	450,839	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	5.93	104	14,091	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	169.2	207	27,960	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5	102	13,825	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	16.16	334	45,116	生活必需品
HUMANA INC	14.51	615	83,047	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	29.85	502	67,821	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9.17	44	6,028	情報技術
HENRY SCHEIN INC	14.91	111	15,097	ヘルスケア
HP INC	132.53	447	60,388	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	141.15	192	26,050	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6.81	24	3,330	コミュニケーション・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22.62	131	17,749	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20.28	73	9,933	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	42.74	190	25,706	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	93.36	337	45,552	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	13.86	248	33,592	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	105.97	1,438	194,174	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	176	23,833	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	91	12,418	資本財・サービス
ZOETIS INC	53.61	845	114,213	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	26.87	340	45,955	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	28.36	370	49,974	エネルギー
ALLEGION PLC	11.1	112	15,176	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	33.41	75	10,153	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	28.95	339	45,870	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	40	113	15,293	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	12.25	153	20,732	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	299.74	5,041	680,629	ヘルスケア
PLUG POWER INC	62.51	88	11,984	資本財・サービス
ABBVIE INC	203.59	2,801	378,271	ヘルスケア
HOLOGIC INC	28.01	190	25,665	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	37.65	464	62,680	生活必需品
KROGER CO	80.9	407	55,037	生活必需品
KLA CORP	17.19	544	73,447	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	28.02	1,166	157,436	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8.4	190	25,748	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	28.72	94	12,718	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	79.29	1,410	190,483	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	93.67	2,723	367,744	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	16	719	97,157	情報技術
LOEWS CORP	23.65	138	18,691	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	19.81	95	12,923	金融
MCDONALD'S CORP	86.68	2,069	279,412	一般消費財・サービス
3M CO	64.77	876	118,270	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	265.49	4,346	586,870	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	41.71	1,324	178,753	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6.82	215	29,139	素材
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	5.75	152	20,543	情報技術
ALCOA CORP	24.04	117	15,877	素材
PHILLIPS 66	54.02	562	75,944	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	45.19	132	17,937	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	28.21	236	31,916	生活必需品
METLIFE INC	81.54	504	68,099	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	110.88	537	72,633	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	25.99	238	32,257	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	19.04	387	52,262	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.6	300	40,635	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	116.87	384	51,958	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	13.4	268	36,258	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	291.04	2,459	332,028	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	59.74	360	48,691	素材
MASCO CORP	27.31	139	18,881	資本財・サービス
M & T BANK CORP	18.48	304	41,142	金融
MARSH & MCLENNAN COS	61.19	901	121,655	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BLACK KNIGHT INC	16.44	105	14,298	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	7.54	81	11,000	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	31.57	480	64,880	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	22.75	317	42,810	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	8.8	41	5,600	一般消費財・サービス
BLOCK INC CLASS A	59.91	361	48,773	情報技術
TRANSUNION	22.93	177	23,939	資本財・サービス
VISTRA CORP	42.85	98	13,282	公益事業
NOVOCURE LTD	10.54	63	8,519	ヘルスケア
NETAPP INC	17.3	173	23,472	情報技術
NIKE INC -CL B	149.92	1,659	224,105	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	27.46	611	82,604	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	62.14	378	51,134	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	21.46	186	25,142	金融
ALLY FINANCIAL INC	43.51	148	20,019	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	16.91	768	103,754	資本財・サービス
APTIV PLC	30.63	290	39,252	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	99.13	625	84,436	素材
MCKESSON CORP	17.02	521	70,434	ヘルスケア
XYLEM INC	19.72	150	20,367	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	181.38	1,795	242,358	生活必需品
NUCOR CORP	32.07	364	49,238	素材
WESTERN UNION CO	43.5	71	9,666	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	19.3	128	17,291	情報技術
NEWELL BRANDS INC	40.58	74	10,119	一般消費財・サービス
EVERGY INC	26.54	162	21,971	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	104.88	651	87,918	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	46	6,284	金融
OKTA INC	16.34	133	17,972	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	8.8	47	6,345	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	16.14	183	24,751	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	48.77	101	13,761	ヘルスケア
LINDE PLC	52.88	1,563	211,052	素材
WIX.COM LTD	7.85	43	5,891	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	42.93	112	15,191	金融
KKR & CO INC	75.84	357	48,226	金融
PAYCHEX INC	36.57	429	57,998	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7.56	451	60,902	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	206.46	955	129,029	生活必需品
P G & E CORP	173.68	172	23,354	公益事業
PFIZER INC	649.11	3,110	419,953	ヘルスケア
CIGNA CORP	37.11	911	123,106	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	32.76	155	20,942	情報技術
XCEL ENERGY INC	69.88	460	62,154	公益事業
STERIS PLC	11.73	238	32,254	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	51	361	48,852	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	15.3	45	6,124	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	38.31	122	16,566	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	38.15	765	103,311	ヘルスケア
LYFT INC-A	31.91	45	6,100	資本財・サービス
DOW INC	82.99	485	65,613	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	11.3	73	9,876	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	25.74	275	37,135	情報技術

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
PARKER HANNIFIN CORP	14.23	359	48,535	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	172.53	363	49,125	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	25.89	684	92,471	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	275.98	3,693	498,688	生活必需品
EXELON CORP	111.5	471	63,691	公益事業
TELADOC HEALTH INC	16.18	47	6,393	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	58.97	258	34,847	資本財・サービス
NVR INC	0.37	144	19,507	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	148.09	1,651	222,908	エネルギー
TWILIO INC - A	20.53	168	22,689	情報技術
DOCUSIGN INC	23.33	133	18,041	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	6.01	162	21,944	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	14.7	66	8,962	情報技術
PEPSICO INC	158.88	2,480	334,883	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4.09	48	6,597	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	37.43	76	10,384	情報技術
MONGODB INC	7.12	171	23,166	情報技術
SNAP INC - A	129.1	153	20,758	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	81.98	462	62,413	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42.85	403	54,461	金融
AMCOR PLC	174.57	211	28,494	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	23.36	372	50,227	情報技術
ROKU INC	14.17	105	14,212	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20.92	279	37,697	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	73.42	2,019	272,710	情報技術
KORNIT DIGITAL LTD	6	20	2,750	資本財・サービス
PENTAIR PLC	15.75	72	9,751	資本財・サービス
QUALCOMM INC	130.95	1,705	230,293	情報技術
INVESCO LTD	37	60	8,112	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	6.64	113	15,372	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31.93	204	27,563	金融
DATADOG INC - CLASS A	25.87	225	30,424	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	67.63	116	15,695	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	10.47	73	9,860	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	12.77	700	94,539	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	24.68	303	41,004	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	4.61	899	121,461	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	41.1	304	41,061	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	9.98	146	19,837	素材
RESMED INC	16.6	335	45,273	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	13.27	168	22,765	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	12.09	98	13,291	資本財・サービス
MODERNA INC	39.1	475	64,170	ヘルスケア
HUBSPOT INC	5.64	166	22,527	情報技術
PERKINELMER INC	17.6	243	32,824	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	111.61	401	54,156	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	45.2	312	42,235	資本財・サービス
BILL. COM HOLDINGS INC	9	95	12,876	情報技術
AVANTOR INC	66.86	198	26,827	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	18.36	60	8,227	金融
DYNATRACE INC	23.39	90	12,258	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	51.91	235	31,817	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	108.25	209	28,279	金融

## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	33.64	104	14,111	コミュニケーション・サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	41.76	159	21,537	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	10.21	80	10,867	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	31.62	231	31,193	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	224.04	3,753	506,799	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A	31.74	30	4,105	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	9.85	139	18,898	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	43.65	266	35,936	公益事業
ETSY INC	14.09	100	13,622	一般消費財・サービス
TESLA INC	101.52	6,727	908,269	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	25.02	284	38,464	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	67.67	148	20,090	情報技術
UNITY SOFTWARE INC	29.86	100	13,610	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	18.95	202	27,316	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	17.16	506	68,381	情報技術
CARVANA CO	9.64	20	2,722	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	8.56	23	3,126	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	31.13	126	17,143	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	14.27	644	87,076	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	137.45	141	19,150	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	26.83	156	21,176	一般消費財・サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	49.45	129	17,438	コミュニケーション・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	43.29	428	57,785	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	38.49	271	36,677	不動産
TWITTER INC	90.07	335	45,260	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	118.75	793	107,064	公益事業
SYSCO CORP	57.47	460	62,180	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	27.8	462	62,420	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6	26	3,550	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	9.56	50	6,822	金融
STEEL DYNAMICS INC	23	163	22,053	素材
SCHLUMBERGER LTD	157.94	682	92,160	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	88	11,909	資本財・サービス
AFFIRM HOLDINGS INC	20.35	36	4,862	情報技術
AT&T INC	836.15	1,626	219,568	コミュニケーション・サービス
APA CORP	43.54	200	27,040	エネルギー
SOUTHWEST AIRLINES CO	10.08	37	5,065	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	51.37	291	39,289	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	23.88	94	12,699	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	28.3	649	87,679	素材
SEMPRA ENERGY	36.02	521	70,426	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	22.64	69	9,423	情報技術
CLARIVATE PLC	47.21	62	8,419	資本財・サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	197.7	154	20,872	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	22.4	169	22,872	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	16.57	85	11,539	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC	107.78	1,660	224,207	情報技術
SALESFORCE.COM INC	115.1	1,892	255,549	情報技術
WESTROCK CO	29.71	127	17,155	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	55.49	273	36,979	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	79.32	393	53,116	資本財・サービス
TERADYNE INC	18.27	166	22,424	情報技術
UNION PACIFIC CORP	72.2	1,505	203,230	資本財・サービス



外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MARATHON OIL CORP	93.23	268	36,237	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	68.55	703	95,020	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	175.23	1,600	216,043	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	85.8	1,494	201,744	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	21.41	430	58,065	ヘルスケア
AMEREN CORPORATION	28.61	238	32,175	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	107.72	4,973	671,535	ヘルスケア
APPLOVIN CORP CLASS A	21.44	69	9,364	情報技術
VERISIGN INC	12.1	195	26,330	情報技術
LUCID GROUP INC	51	84	11,429	一般消費財・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	22	60	8,108	一般消費財・サービス
VALERO ENERGY CORP	45.84	613	82,775	エネルギー
UPSTART HOLDINGS INC	2	6	925	金融
ULTA BEAUTY INC	5.5	215	29,157	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	112	15,180	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7.67	80	10,859	ヘルスケア
ANTHEM INC	27.19	1,251	169,009	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	211.9	1,996	269,550	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	447.85	1,676	226,317	金融
WASTE MANAGEMENT INC	46.7	680	91,812	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	136.22	440	59,476	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	12.49	240	32,405	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	6.86	106	14,388	一般消費財・サービス
WALMART INC	178.41	2,131	287,744	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	23.48	247	33,370	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	11.45	66	8,967	一般消費財・サービス
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	139	34	4,597	資本財・サービス
WABTEC CORP	18.98	163	22,119	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	135.04	774	104,522	一般消費財・サービス
WATERS CORP	6.99	224	30,339	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5.71	171	23,184	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	79.88	321	43,354	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14	272	36,833	金融
WESTERN DIGITAL CORP	35.31	173	23,473	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	36.5	335	45,360	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	58.55	356	48,195	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	190.79	3,692	498,479	情報技術
PPL CORP	83.6	217	29,379	公益事業
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	36.96	201	27,165	公益事業
PULTEGROUP INC	27.95	111	15,048	一般消費財・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	250.13	349	47,210	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC	26.8	298	40,347	素材
NORTHERN TRUST CORP	22.6	211	28,559	金融
NVIDIA CORP	288.63	4,570	617,096	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	48.69	757	102,325	金融
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	11.77	58	7,937	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	33.22	278	37,638	生活必需品
NETFLIX INC	49.77	833	112,577	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	45.47	2,307	311,518	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	30	118	15,966	公益事業
GLOBE LIFE INC	12.15	108	14,673	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	20.67	283	38,220	金融
TEXTRON INC	23.88	143	19,405	資本財・サービス

## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
NEWS CORP - CLASS A	37.49	58	7,870	コミュニケーション・サービス
OMNICOM GROUP	25.46	165	22,325	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	184.58	1,305	176,235	情報技術
MASTERCARD INC - A	100.48	3,236	437,008	情報技術
ONEOK INC	50.33	303	41,035	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	110.62	117	15,815	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	11.95	454	61,414	情報技術
YUM! BRANDS INC	32.75	361	48,739	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	20.69	251	33,914	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	22.06	113	15,296	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	847.45	2,666	359,947	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5.23	190	25,760	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	22.63	161	21,839	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	74.47	1,076	145,383	金融
ANALOG DEVICES INC	60.05	883	119,315	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	190.8	1,659	224,085	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	92.09	479	64,676	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	19.4	179	24,295	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	26.09	103	13,910	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	9.29	149	20,204	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	59.54	404	54,557	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	67.86	574	77,600	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	25	627	84,762	金融
AMGEN INC	66.17	1,559	210,565	ヘルスケア
EATON CORP PLC	50.05	653	88,195	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	18.59	430	58,102	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	101.47	980	132,364	情報技術
CME GROUP INC	40.78	799	107,972	金融
ECOLAB INC	29.18	438	59,204	素材
EQUIFAX INC	13.57	233	31,515	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	143.13	827	111,673	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	99.75	343	46,327	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	33.15	149	20,193	生活必需品
STATE STREET CORP	41.52	258	34,855	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	173.13	1,057	142,840	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	56.65	382	51,610	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	21.66	98	13,288	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	15.97	150	20,271	素材
CARDINAL HEALTH INC	33.19	169	22,902	ヘルスケア
FEDEX CORP	28.31	650	87,889	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	48.73	519	70,119	金融
FMC CORP	13.6	146	19,815	素材
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	27.48	321	43,470	素材
CITRIX SYSTEMS INC	14.12	130	17,616	情報技術
INTEL CORP	472.82	1,793	242,127	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	43.18	119	16,194	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	39.7	264	35,696	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	35.67	663	89,540	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	102.27	60	8,187	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	16.89	319	43,191	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	14.5	84	11,467	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	43.34	828	111,818	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	13.3	161	21,807	情報技術

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
SNAP-ON INC	6.23	128	17,290	資本財・サービス
CARMAX INC	18.34	164	22,232	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP	86.25	870	117,540	公益事業
TARGET CORP	53.73	766	103,515	一般消費財・サービス
DOVER CORP	17.13	210	28,446	資本財・サービス
VVV GRAINGER INC	4.75	223	30,134	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14.62	181	24,538	資本財・サービス
CINTAS CORP	10.4	366	49,486	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	55.67	177	23,900	生活必需品
CLOROX COMPANY	13.84	172	23,289	生活必需品
ENTERGY CORP	22.43	240	32,490	公益事業
MICROSOFT CORP	821.66	20,088	2,712,184	情報技術
INCYTE CORP	20.06	132	17,923	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	155.28	1,407	190,020	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	157.69	1,395	188,371	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	124.93	733	99,008	情報技術
BLACKROCK INC	17.18	1,015	137,134	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	69.14	190	25,763	公益事業
HASBRO INC	14.49	117	15,797	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	29.14	199	26,886	生活必需品
KEYCORP	103.89	182	24,601	金融
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	166.95	976	131,790	生活必需品
COOPER COS INC/THE	5.47	172	23,256	ヘルスケア
CHUBB LTD	48.39	957	129,316	金融
ARROW ELECTRONICS INC	7.37	84	11,347	情報技術
ALLSTATE CORP	32.42	395	53,395	金融
EBAY INC	70.68	300	40,631	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	124.99	905	122,275	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	14.92	143	19,386	素材
DISH NETWORK CORP-A	29.84	52	7,102	コミュニケーション・サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	26.15	629	85,007	生活必需品
TRIMBLE INC	29.38	173	23,466	情報技術
LENNAR CORP-A	29.92	206	27,929	一般消費財・サービス
LEAR CORP	6	75	10,234	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	66.01	742	100,179	金融
PACCAR INC	39.19	329	44,529	資本財・サービス
BIOGEN INC	16.99	329	44,541	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	9.62	316	42,729	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	131.72	952	128,592	一般消費財・サービス
PTC INC	12	119	16,183	情報技術
EVERSOURCE ENERGY	39.06	315	42,578	公益事業
INTUIT INC	32.06	1,169	157,892	情報技術
BORGWARNER INC	27.41	96	12,974	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	25.7	181	24,493	一般消費財・サービス
BALL CORP	36.3	241	32,590	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	161.99	570	77,070	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	32.21	410	55,389	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	14.25	215	29,058	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28.56	711	96,042	ヘルスケア
VF CORP	36.36	165	22,296	一般消費財・サービス
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	67.79	172	23,256	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	6.28	77	10,480	一般消費財・サービス
CARNIVAL CORP	99.86	95	12,834	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
CLEVELAND-CLIFFS INC	63.61	112	15,149	素材
COMCAST CORP-CLASS A	528.64	2,106	284,344	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	28	150	20,292	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	131	63	8,595	不動産
アメリカ・ドル通貨計	38,087.49	374,164	50,515,991	
	603銘柄		<69.7%>	
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル	千円	
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	96.62	525	54,718	生活必需品
IMPERIAL OIL LTD	23	158	16,536	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2.29	425	44,370	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	31.36	194	20,266	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	52.7	265	27,676	素材
INTACT FINANCIAL CORP	19.97	350	36,542	金融
BCE INC	9	57	5,950	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	22	394	41,134	素材
SUNCOR ENERGY INC	163.65	834	86,966	エネルギー
METRO INC/CN	27.76	188	19,640	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	39.41	351	36,589	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	149.98	1,209	126,054	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	102.3	664	69,266	金融
TORONTO-DOMINION BANK	214.88	1,919	200,059	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	39	124	12,943	金融
ROYAL BANK OF CANADA	167.46	2,110	219,879	金融
TOURMALINE OIL CORP	36.56	257	26,804	エネルギー
TC ENERGY CORP	123.64	867	90,427	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	63.75	317	33,094	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	203.69	513	53,506	素材
CAE INC	37.52	115	12,033	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	19.68	247	25,791	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	18	71	7,459	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	10.34	109	11,389	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	15.6	90	9,379	素材
HYDRO ONE LTD	39.86	134	14,038	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	20.86	234	24,457	生活必需品
NORTHLAND POWER INC	30.03	111	11,621	公益事業
WSP GLOBAL INC	14.44	200	20,890	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9.74	102	10,651	資本財・サービス
PARKLAND CORP	16.21	60	6,286	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	23	63	6,585	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	27.31	162	16,897	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC	11	107	11,202	資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	38	4,005	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	43.06	255	26,647	コミュニケーション・サービス
BRP INC/CA- SUB VOTING	10.17	82	8,603	一般消費財・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	88.5	81	8,474	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	52.12	327	34,154	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	118.88	203	21,182	公益事業
AIR CANADA	17	30	3,183	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	147.57	77	8,088	素材
BANK OF MONTREAL	80.79	1,037	108,091	金融
POWER CORP OF CANADA	63	213	22,267	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	13.05	512	53,447	情報技術

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	柄	2022年6月15日現在		業種等	
		株数	評価額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
		百株	千カナダ・ドル	千円	
NUTRIEN LTD		65.33	738	76,923	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A		15.32	68	7,172	公益事業
CAMECO CORP		50.21	144	15,099	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP		4.22	64	6,727	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT		18.65	63	6,634	資本財・サービス
LIGHTSPEED COMMERCE INC		15.6	41	4,276	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG		10	52	5,493	情報技術
TELUS CORP		6	17	1,831	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B		53.74	274	28,648	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A		7.43	121	12,663	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES		132.69	1,041	108,508	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		3	197	20,606	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC		31.67	234	24,469	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD		9.01	131	13,726	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP		26.15	70	7,370	素材
BLACKBERRY LTD		64	42	4,454	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC		66.71	395	41,234	金融
ENBRIDGE INC		244.33	1,359	141,654	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		173.41	1,009	105,199	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP		221.84	486	50,646	金融
BAUSCH HEALTH COS INC		35.14	33	3,511	ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		106.07	941	98,079	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC		11	68	7,125	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC		23.64	86	8,991	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO		69.45	975	101,689	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A		23.84	231	24,155	情報技術
ONEX CORPORATION		11.04	75	7,904	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		51.72	176	18,361	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC		27.84	98	10,277	金融
TMX GROUP LTD		7.94	105	11,025	金融
OPEN TEXT CORP		32.1	154	16,148	情報技術
SAPUTO INC		29	78	8,213	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		63	201	20,954	素材
FORTIS INC		54.74	324	33,846	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS		13.55	106	11,087	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP		66	65	6,856	素材
CENOVUS ENERGY INC		173.9	499	52,059	エネルギー
DOLLARAMA INC		35.29	255	26,578	一般消費財・サービス
ALTAGAS LTD		32.01	88	9,235	公益事業
KEYERA CORP		22	73	7,672	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		92.53	182	18,994	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額	4,727.86	27,786	2,895,374	
	銘柄数 < 比率 >	86銘柄		< 4.0% >	
(オーストラリア)		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
THE LOTTERY CORPORATION LTD		265.51	121	11,346	一般消費財・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD		539.23	165	15,412	金融
BHP GROUP LTD		605.7	2,680	249,585	素材
SOUTH32 LTD		563.87	253	23,570	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD		211.41	697	64,931	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD		196.91	386	35,986	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		376.85	1,011	94,167	金融
WESTPAC BANKING CORP		424.01	850	79,226	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
SANTOS LTD	370.03	299	27,904	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	328.92	723	67,369	金融
RIO TINTO LTD	41.69	462	43,102	素材
ORIGIN ENERGY LTD	209.68	124	11,556	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD	234.38	94	8,771	資本財・サービス
XERO LTD	14.26	116	10,873	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	27.48	65	6,096	エネルギー
COLES GROUP LTD	155.7	266	24,845	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	16.45	60	5,611	情報技術
IDP EDUCATION LTD	26.19	58	5,400	一般消費財・サービス
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	107.16	86	8,041	素材
EVOLUTION MINING LTD	170.17	56	5,275	素材
REECE LTD	37.62	52	4,861	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	139.06	99	9,256	生活必需品
SEEK LTD	26	56	5,255	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	86.16	93	8,703	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	103.31	239	22,333	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	206.53	1,883	175,358	金融
AMPOL LTD	20	68	6,412	エネルギー
ORICA LTD	47.83	74	6,977	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	153.48	176	16,432	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD	138.36	468	43,577	生活必需品
CROWN RESORTS LTD	30	39	3,644	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	63.73	30	2,871	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	507.1	190	17,704	コミュニケーション・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	47.96	155	14,498	素材
MACQUARIE GROUP LTD	45.02	735	68,465	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	64.62	221	20,605	一般消費財・サービス
CSL LTD	59.05	1,559	145,162	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	129.17	542	50,508	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	8.05	165	15,411	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	50.24	82	7,703	素材
SUNCORP GROUP LTD	145.04	152	14,151	金融
ASX LTD	22.6	175	16,310	金融
COMPUTERSHARE LTD	60.54	142	13,262	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	112	10,519	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	52.23	174	16,202	ヘルスケア
BRAMBLES LTD	183.37	192	17,925	資本財・サービス
MINERAL RESOURCES LTD	18.81	104	9,729	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20.64	154	14,369	ヘルスケア
REA GROUP LTD	6.08	62	5,855	コミュニケーション・サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	7.6	48	4,505	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額	7,636.77	16,838	1,567,652
	銘柄数 < 比率 >	50銘柄		< 2.2% >
(香港)	百株	千香港・ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	175	895	15,396	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	290	1,196	20,575	一般消費財・サービス
MTR CORP	165	684	11,777	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	190	1,772	30,490	不動産
SINO LAND CO	340	380	6,549	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	325.52	1,725	29,674	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	80	382	6,577	不動産

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千香港・ドル	千円	
CLP HOLDINGS LTD	190	1,434	24,673	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	205.65	604	10,399	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,450.27	1,237	21,277	公益事業
HANG SENG BANK LTD	100	1,370	23,564	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT	175	511	8,789	不動産
WH GROUP LTD	1,135	634	10,912	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	154	5,260	90,483	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	200	287	4,946	不動産
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	260	455	7,834	資本財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	80	152	2,625	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	235.52	1,223	21,044	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	282	4,857	公益事業
AIA GROUP LTD	1,530	12,025	206,843	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120	310	5,335	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	200	692	11,902	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	192	395	6,802	生活必需品
ESR CAYMAN LTD	280	590	10,161	不動産
SANDS CHINA LTD	290	436	7,501	一般消費財・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	260	352	6,064	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	160	1,491	25,648	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	450	1,374	23,645	金融
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,287.96 28銘柄	38,160 < 0.9% >	
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円	
CAPITALAND INVESTMENT LTD	334	121	11,819	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD	149	403	39,132	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	223	664	64,470	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	177.5	91	8,828	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	173	115	11,220	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	30	21	2,094	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	41	3,992	不動産
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	407	465	45,101	金融
GENTING SINGAPORE LTD	450	33	3,272	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	32	54	5,286	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,034	260	25,262	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	56	5,440	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	118	113	11,028	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	64	6,219	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,478.5 14銘柄	2,508 < 0.3% >	
(ニュージーランド)	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	150	66	5,578	公益事業
MERCURY NZ LTD	32.94	17	1,482	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD	275.03	124	10,459	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	132.89	96	8,110	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	72.38	141	11,848	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	663.24 5銘柄	446 < 0.1% >	
(イギリス)	百株	千イギリス・ポンド	千円	
SHELL PLC	892.51	2,059	334,138	エネルギー



## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BP PLC	2,230.25	970	157,351	エネルギー
UNILEVER PLC	305.42	1,102	178,822	生活必需品
BARCLAYS PLC	1,838.69	288	46,754	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	912.45	80	13,012	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	314.21	305	49,622	金融
NATWEST GROUP PLC	662.75	146	23,801	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	17.58	34	5,670	素材
BAE SYSTEMS PLC	364.45	282	45,804	資本財・サービス
AVIVA PLC	340.02	137	22,287	金融
AVEVA GROUP PLC	11.4	26	4,373	情報技術
GSK	601.83	1,030	167,149	ヘルスケア
INFORMA PLC	162	81	13,186	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	494.22	74	12,109	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	105.87	54	8,816	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	9.38	48	7,914	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	51.49	40	6,553	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7.4	68	11,144	資本財・サービス
HALMA PLC	39.78	77	12,495	情報技術
ENTAIN PLC	58.23	78	12,671	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	320.55	35	5,810	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	68.57	41	6,751	金融
M&G PLC	259.64	52	8,499	金融
RELX PLC	220.83	459	74,543	資本財・サービス
DIAGEO PLC	278.48	960	155,753	生活必需品
RIO TINTO PLC	138	766	124,348	素材
STANDARD CHARTERED PLC	295.93	177	28,782	金融
TESCO PLC	847.03	208	33,895	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	92.37	107	17,440	ヘルスケア
GLENCORE PLC	1,209.36	584	94,809	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	24	4,006	金融
SMITHS GROUP PLC	40.8	60	9,758	資本財・サービス
PEARSON PLC	82.71	61	9,906	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	176.31	35	5,814	生活必需品
NEXT PLC	16.85	100	16,229	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	40	6,520	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	17.85	45	7,429	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	39.54	103	16,823	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	3,150.36	395	64,163	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	14.09	84	13,635	素材
KINGFISHER PLC	247.03	58	9,408	一般消費財・サービス
WPP PLC	130.21	106	17,277	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	84	13,747	公益事業
SEVERN TRENT PLC	29.71	83	13,527	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	222.42	100	16,322	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	89.64	536	87,068	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	48.83	53	8,740	金融
SCHRODERS PLC	12.27	32	5,226	金融
SSE PLC	119.27	195	31,757	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	60	9,774	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	182.85	1,782	289,185	ヘルスケア
FERGUSON PLC	24.79	227	36,938	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	682.32	164	26,729	金融
3I GROUP PLC	111.52	123	19,980	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ASHTAD GROUP PLC	51.39	187	30,434	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	115.48	69	11,209	情報技術
NATIONAL GRID PLC	414.25	435	70,588	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,100.12	351	56,984	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	108.06	194	31,568	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	11.55	46	7,540	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	246.58	864	140,172	生活必需品
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34.83	54	8,861	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	2,398.77	1,248	202,489	金融
ANGLO AMERICAN PLC	144.24	498	80,837	素材
MONDI PLC	59.21	84	13,671	素材
COMPASS GROUP PLC	201.76	336	54,654	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	39.69	85	13,841	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	1,027.57	184	29,944	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	25.74	43	6,989	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	45.08	71	11,648	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	20.78	90	14,666	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	18.97	80	13,025	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	36.24	244	39,609	金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	20.39	30	4,992	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	33	5,424	金融
ANTOFAGASTA PLC	34.6	48	7,818	素材
ABRDN PLC	277.75	47	7,632	金融
EXPERIAN PLC	104.96	243	39,550	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	32,704.25 78銘柄	20,519 <4.6%>	
	百株	千イスラエル・シケル	千円	
(イスラエル)				
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	120	216	8,425	金融
AZRIELI GROUP LTD	5.3	122	4,778	不動産
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	18.59	299	11,669	情報技術
ICL GROUP LTD	82.94	295	11,491	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	3	203	7,920	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	151.6	456	17,764	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	190.43	592	23,063	金融
NICE LTD	8	525	20,468	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	18.83	208	8,102	金融
イスラエル・シケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	598.69 9銘柄	2,919 <0.2%>	
	百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)				
UBS GROUP AG-REG	389.06	622	83,990	金融
ROCHE HOLDING AG-BR	4.28	149	20,224	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.89	63	8,615	素材
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	58	7,933	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	80.79	2,470	333,495	ヘルスケア
SIKA AG-REG	18.12	411	55,581	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	96	13,055	生活必需品
ABB LTD-REG	181.74	499	67,402	資本財・サービス
SWISS RE AG	33.1	251	33,963	金融
NESTLE SA-REG	325.98	3,540	478,042	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2.43	207	27,951	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2.61	45	6,184	資本財・サービス

## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	301.22	177	24,010	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	26.84	123	16,690	金融
SGS SA-REG	0.94	199	26,942	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	4.67	79	10,781	資本財・サービス
TEMENOS AG - REG	7.93	57	7,714	情報技術
VAT GROUP AG	3.39	81	11,030	資本財・サービス
ALCON INC	55.13	365	49,362	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	3.77	86	11,655	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	16.79	703	95,002	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	6.11	93	12,687	金融
CLARIANT AG-REG	25.52	47	6,415	素材
NOVARTIS AG-REG	242.42	1,956	264,189	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.41	85	11,491	生活必需品
BACHEM HOLDING AG-REG B	3.9	26	3,609	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	58.09	574	77,517	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	2.76	146	19,756	コミュニケーション・サービス
GEBERIT AG-REG	3.89	183	24,788	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	1.04	324	43,864	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	17.09	174	23,603	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	6.37	200	27,038	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	17.3	89	12,108	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	8.29	416	56,207	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	19	2,627	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD	58.05	264	35,761	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3.49	179	24,171	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	6.4	149	20,193	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	83	11,309	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.14	130	17,672	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,952.46 40銘柄	15,440 2,084,647	<2.9%>
(デンマーク)	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	211.87	16,004	302,968	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	92.36	1,012	19,162	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0.39	715	13,539	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	120.49	1,931	36,557	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S	21.59	511	9,690	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B	12.32	1,044	19,767	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	24.64	987	18,694	素材
COLOPLAST-B	15.19	1,138	21,554	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	24.04	2,391	45,261	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	0.98	176	3,339	資本財・サービス
DEMANT A/S	13.14	359	6,798	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.66	1,224	23,182	資本財・サービス
TRYG A/S	40.74	633	11,988	金融
PANDORA A/S	13.25	639	12,102	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	12.62	600	11,369	素材
GENMAB A/S	7.78	1,531	28,991	ヘルスケア
ORSTED A/S	22.46	1,558	29,493	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	634.52 17銘柄	32,459 614,461	<0.8%>

## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(ノルウェー)	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
DNB BANK	116.96	2,142	28,897	金融
NORSK HYDRO ASA	166.15	1,064	14,353	素材
ORKLA ASA	74.83	547	7,383	生活必需品
TELENOR ASA	87.46	1,115	15,054	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	117.89	4,169	56,250	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	21.12	996	13,447	素材
MOWI ASA	46.77	1,119	15,098	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	388	5,234	金融
AKER BP ASA	13.55	561	7,576	エネルギー
KONGSBERG GRUPPEN ASA	19.73	653	8,815	資本財・サービス
SALMAR ASA	9.43	641	8,656	生活必需品
ADEVINTA ASA	45.82	301	4,070	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	739.71 12銘柄	13,701 <0.3%>	184,837
(スウェーデン)	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
SAGAX CLASS B	20.2	413	5,476	不動産
INVESTOR CLASS A	62.56	1,183	15,674	金融
VOLVO CAR CLASS B	85.56	634	8,408	一般消費財・サービス
ERICSSON LM-B SHS	348.35	2,621	34,732	情報技術
VOLVO AB-B SHS	193.33	3,181	42,148	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES	40	667	8,837	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	26	348	4,617	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	205.45	2,075	27,494	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	70.26	808	10,715	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS	28.69	717	9,503	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	196.1	2,129	28,217	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	174.28	1,650	21,868	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	108.21	1,616	21,420	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	88.36	1,177	15,599	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSEA AB SCA-B	73.2	1,181	15,654	素材
SKANSKA AB-B SHS	37.09	601	7,968	資本財・サービス
SANDVIK AB	135.38	2,560	33,920	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	234.46	4,006	53,085	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	317.12	3,182	42,169	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS	39.23	671	8,898	資本財・サービス
HOLMEN AB-B SHARES	13.42	604	8,008	素材
SECURITAS AB-B SHS	39.3	345	4,574	資本財・サービス
TELIA CO AB	332.69	1,299	17,213	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	38.03	927	12,295	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	192.52	1,688	22,371	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	119.97	2,646	35,066	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	16.38	387	5,139	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	64.2	351	4,658	不動産
INDUTRADE AB	36	741	9,826	資本財・サービス
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	32.95	715	9,473	ヘルスケア
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	405	5,377	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	20.48	428	5,674	資本財・サービス
LIFCO AB-B SHS	29.24	505	6,692	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	167.16	1,200	15,911	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB	29	1,393	18,459	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	72.6	1,828	24,231	生活必需品

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
EMBRACER GROUP AB	70.9	572	7,585	コミュニケーション・サービス
BOLIDEN AB	31.71	1,132	15,003	素材
EPIROC AB-A	86.6	1,534	20,332	資本財・サービス
EPIROC AB-B	40.15	608	8,056	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS	54	419	5,558	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP	426.56	4,186	55,467	金融
EQT AB	33.65	735	9,742	金融
EVOLUTION AB	20.64	1,868	24,763	一般消費財・サービス
SINCH AB	64	240	3,182	情報技術
KINNEVIK AB - B	30.03	504	6,684	金融
HEXAGON AB-B SHS	235.58	2,571	34,070	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13	305	4,044	金融
スウェーデン・クロネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,804.07 48銘柄	61,575 <1.1%>	
<b>ユーロ (アイルランド)</b>		百株	千ユーロ	千円
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	30.55	98	13,897	素材
KINGSPAN GROUP PLC	17.44	122	17,188	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A	18.22	166	23,457	生活必需品
CRH PLC	83.4	283	39,925	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	17.85	166	23,494	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	167.46 5銘柄	837 <0.2%>	
<b>ユーロ (オランダ)</b>		百株	千ユーロ	千円
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	89.3	176	24,802	コミュニケーション・サービス
QIAGEN N. V.	25.21	102	14,492	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	103.01	215	30,327	ヘルスケア
NN GROUP NV	31	138	19,458	金融
HEINEKEN NV	31.23	277	39,134	生活必需品
AEGON NV	179.67	78	11,022	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	110.69	278	39,274	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.	23.19	164	23,097	素材
KONINKLIJKE DSM NV	21.12	299	42,181	素材
WOLTERS KLUWER	31.58	268	37,777	資本財・サービス
ING GROEP NV	426.86	410	57,842	金融
KONINKLIJKE KPN NV	376.07	124	17,558	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV	44.67	2,104	296,362	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA	40.3	41	5,776	金融
IMCD NV	7.15	94	13,313	資本財・サービス
ADYEN NV	2.56	295	41,646	情報技術
JUST EAT TAKEAWAY	23.81	40	5,735	一般消費財・サービス
PROSUS NV	100.88	480	67,674	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV	14.76	38	5,432	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV	6.02	154	21,703	情報技術
RANDSTAD NV	14.9	70	9,902	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	12.85	89	12,646	生活必需品
OCI NV	18.79	62	8,809	素材
EURONEXT NV	10.95	80	11,375	金融
STMICROELECTRONICS NV	81.18	263	37,147	情報技術
AIRBUS SE	63.5	611	86,153	資本財・サービス
ARGENX SE	5.16	161	22,805	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55.46	50	7,048	生活必需品

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄		2022年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
EXOR NV		10.88	65	9,252	金融
CNH INDUSTRIAL NV		116.91	145	20,518	資本財・サービス
STELLANTIS NV		264.95	330	46,549	一般消費財・サービス
FERRARI NV		14.99	243	34,328	一般消費財・サービス
国	小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,359.6 32銘柄	7,962 <1.5%>	1,121,153
		百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (ベルギー)</b>					
UCB SA		15.5	122	17,245	ヘルスケア
KBC GROUP NV		30.11	162	22,901	金融
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		11.39	90	12,787	金融
SOLVAY SA		8.73	75	10,661	素材
UMICORE		22.7	87	12,250	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		93.95	458	64,579	生活必需品
AGEAS		21.72	87	12,388	金融
D'ETEREN GROUP		4.42	62	8,737	一般消費財・サービス
PROXIMUS		22.69	34	4,838	コミュニケーション・サービス
ELIA GROUP SA/NV		4.32	61	8,698	公益事業
SOFINA		1.46	28	4,080	金融
国	小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	236.99 11銘柄	1,272 <0.2%>	179,171
		百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (ルクセンブルグ)</b>					
AROUNDTOWN SA		104.12	37	5,289	不動産
ARCELORMITTAL		74.77	193	27,303	素材
EUROFINS SCIENTIFIC		14.8	115	16,220	ヘルスケア
TENARIS SA		47	67	9,559	エネルギー
国	小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	240.69 4銘柄	414 <0.1%>	58,372
		百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (フランス)</b>					
TOTALENERGIES SE		281.13	1,520	214,065	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		21.46	233	32,814	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		60.69	819	115,342	素材
KERING		8.26	405	57,138	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		58.24	681	95,925	資本財・サービス
BOUYGUES SA		27.21	82	11,600	資本財・サービス
BNP PARIBAS		122.39	579	81,570	金融
THALES SA		13.06	148	20,870	資本財・サービス
DANONE		69.56	359	50,674	生活必需品
CARREFOUR SA		72.48	136	19,150	生活必需品
VIVENDI		89.3	97	13,717	コミュニケーション・サービス
L'OREAL		27.26	822	115,779	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		60.93	293	41,384	資本財・サービス
LEGRAND SA		39.4	284	40,053	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA		23.02	389	54,873	生活必需品
EURAZEO SE		4	25	3,624	金融
SOCIETE GENERALE SA		97.9	219	30,897	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		31.39	1,707	240,432	一般消費財・サービス
ACCOR SA		18.5	50	7,095	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		19.19	318	44,784	情報技術
VALEO SA		28.67	54	7,621	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		29.18	134	18,936	コミュニケーション・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
BUREAU VERITAS SA	32.27	80	11,381	資本財・サービス
EIFFAGE	9.45	82	11,676	資本財・サービス
SODEXO SA	10.85	71	10,049	一般消費財・サービス
IPSEN	2.76	23	3,283	ヘルスケア
AMUNDI SA	10.05	47	6,732	金融
TELEPERFORMANCE	7.01	195	27,567	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	9.77	43	6,060	コミュニケーション・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3.14	93	13,099	ヘルスケア
SEB SA	2.16	19	2,724	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA	30.3	407	57,380	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA	2.2	34	4,804	資本財・サービス
WORLDLINE SA	31.35	102	14,363	情報技術
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8.78	28	3,968	一般消費財・サービス
AXA SA	216.72	485	68,321	金融
EDENRED	30.07	128	18,087	情報技術
RENAULT SA	20.44	49	6,979	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	3.39	332	46,814	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	2.53	38	5,439	生活必需品
DASSAULT SYSTEMES SE	81.65	273	38,506	情報技術
WENDEL	3.31	28	4,008	金融
ORANGE	241.19	261	36,886	コミュニケーション・サービス
ALSTOM	36.68	91	12,916	資本財・サービス
SANOFI	130.43	1,227	172,902	ヘルスケア
VINCI SA	58.02	485	68,368	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	78.49	184	25,970	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	146.09	129	18,169	金融
BIOMERIEUX	4.57	39	5,506	ヘルスケア
ENGIE	217.58	260	36,633	公益事業
EDF	67.6	55	7,766	公益事業
SAFRAN SA	36.41	322	45,472	資本財・サービス
ARKEMA	7.31	71	10,018	素材
ADP	3.5	42	6,031	資本財・サービス
GETLINK SE	49.73	84	11,847	資本財・サービス
BOLLORE	73	34	4,882	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,872.02 56銘柄	15,220 <3.0%>	2,142,977
	百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (ドイツ)</b>				
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	50.55	138	19,473	資本財・サービス
BAYER AG-REG	106.07	674	94,999	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	44.31	109	15,428	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	243.43	225	31,724	金融
COMMERZBANK AG	96.89	72	10,261	金融
VOLKSWAGEN AG	4.2	80	11,321	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	19.7	283	39,986	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	88.86	970	136,650	資本財・サービス
E.ON SE	271.11	246	34,698	公益事業
UNIPER SE	11.92	24	3,460	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	35.27	273	38,541	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	19.08	66	9,332	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	14.74	104	14,656	一般消費財・サービス
BASF SE	99.78	482	67,983	素材
ALLIANZ SE-REG	44.59	811	114,302	金融



## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等	
		評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千ユーロ	千円		
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	21.41	125	17,719	生活必需品	
RHEINMETALL AG	6.25	129	18,189	資本財・サービス	
RWE AG	75.26	287	40,447	公益事業	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	66.13	37	5,318	資本財・サービス	
BRENNTAG SE	18.93	133	18,865	資本財・サービス	
FRESENIUS SE & CO KGAA	48.35	143	20,171	ヘルスケア	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9.59	27	3,860	コミュニケーション・サービス	
SAP SE	119.87	1,042	146,852	情報技術	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	15.44	338	47,696	金融	
ZALANDO SE	28.56	79	11,126	一般消費財・サービス	
HEIDELBERGCEMENT AG	17.72	88	12,395	素材	
KION GROUP AG	6	23	3,320	資本財・サービス	
COVESTRO AG	19.45	77	10,844	素材	
RATIONAL AG	0.74	42	6,043	資本財・サービス	
SARTORIUS AG-VORZUG	3.1	97	13,744	ヘルスケア	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	17.4	119	16,772	一般消費財・サービス	
DELIVERY HERO SE	21.48	68	9,626	一般消費財・サービス	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	5.6	63	8,890	ヘルスケア	
BECHTLE AG	8.19	29	4,215	情報技術	
NEMETSCHKE SE	7.89	45	6,383	情報技術	
SCOUT24 AG	10.83	57	8,026	コミュニケーション・サービス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	34.61	172	24,248	ヘルスケア	
KNORR-BREMSE AG	9.26	53	7,585	資本財・サービス	
HELLOFRESH SE	18.14	52	7,386	生活必需品	
SIEMENS ENERGY AG	47.32	73	10,397	資本財・サービス	
BEIERSDORF AG	12.75	118	16,702	生活必需品	
MERCK KGAA	15.64	255	35,993	ヘルスケア	
ADIDAS AG	20.45	336	47,376	一般消費財・サービス	
PUMA SE	12.95	85	12,052	一般消費財・サービス	
HENKEL AG & CO KGAA	13.11	76	10,789	生活必需品	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	349.87	623	87,774	コミュニケーション・サービス	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	25.61	129	18,195	ヘルスケア	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	93.01	579	81,573	一般消費財・サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	140.76	341	48,100	情報技術	
HANNOVER RUECK SE	6.44	89	12,626	金融	
DEUTSCHE POST AG-REG	108.78	376	52,963	資本財・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	20.99	318	44,877	金融	
MTU AERO ENGINES AG	6.66	112	15,824	資本財・サービス	
SYMRISE AG	16.56	158	22,318	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	62.4	17	2,442	コミュニケーション・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	7.33	52	7,420	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	80.41	254	35,799	不動産	
LEG IMMOBILIEN SE	8.69	72	10,175	不動産	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,790.43 58銘柄	11,974 <2.3%>	1,685,957	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ポルトガル)					
JERONIMO MARTINS		29	54	7,684	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		359.64	161	22,726	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		61.35	77	10,901	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	449.99 3銘柄	293 <0.1%>	41,311	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (スペイン)</b>				
TELEFONICA SA	644.91	284	40,035	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA	37.6	71	10,103	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	722.68	303	42,675	金融
IBERDROLA SA	638.68	630	88,775	公益事業
REPSOL SA	172.83	265	37,341	エネルギー
GRIFOLS SA	27.95	49	6,932	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	1,859.13	487	68,661	金融
AMADEUS IT GROUP SA	54	273	38,533	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA	27.21	73	10,370	公益事業
CAIXABANK SA	670.15	215	30,354	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	29.53	70	9,987	資本財・サービス
AENA SME SA	8.66	113	15,991	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA	74.19	263	37,062	コミュニケーション・サービス
ACCIONA SA	3.53	62	8,807	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	118.36	266	37,513	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	32.93	58	8,306	資本財・サービス
ENAGAS SA	32.18	67	9,478	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	51.47	92	13,019	公益事業
FERROVIAL SA	60.55	140	19,838	資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA	30.29	65	9,229	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,296.83 20銘柄	3,856 <0.7%>	543,015
	百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (イタリア)</b>				
PRYSMIAN SPA	29.49	81	11,493	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	129.44	200	28,276	金融
MEDIOBANCA SPA	83.45	74	10,525	金融
UNICREDIT SPA	255.29	248	34,920	金融
TELECOM ITALIA SPA	1,085.03	26	3,790	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO	1,761.98	311	43,911	金融
ATLANTIA SPA	60.27	133	18,864	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	77.27	70	9,920	金融
MONCLER SPA	24.35	93	13,158	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	12.85	48	6,799	ヘルスケア
ENI SPA	272.08	358	50,452	エネルギー
DIASORIN SPA	2.77	30	4,348	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	24.14	22	3,141	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA	65.11	47	6,701	情報技術
AMPLIFON SPA	14.4	37	5,346	ヘルスケア
ENEL SPA	887.93	473	66,673	公益事業
SNAM SPA	243	123	17,394	公益事業
TERNA SPA	158.15	114	16,094	公益事業
FINCOBANK SPA	80.77	83	11,753	金融
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,267.77 19銘柄	2,582 <0.5%>	363,566
	百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (フィンランド)</b>				
UPM-KYMMENE OYJ	65.25	199	28,122	素材
NOKIA OYJ	627.53	283	39,937	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	41.16	29	4,186	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	69.84	108	15,325	素材
ELISA OYJ	17.34	91	12,822	コミュニケーション・サービス

## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	柄	2022年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
SAMPO OYJ-A SHS		58.26	236	33,304	金融
FORTUM OYJ		44	72	10,268	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		34.7	75	10,699	生活必需品
KONE OYJ-B		37.96	169	23,912	資本財・サービス
NESTE OYJ		49.41	207	29,170	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		17.63	64	9,067	ヘルスケア
国	小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,063.08 11銘柄	1,539 <0.3%>	
		百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (オーストリア)</b>					
VERBUND AG		8.76	82	11,624	公益事業
OMV AG		20.56	100	14,095	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		34.89	92	12,983	金融
VOESTALPINE AG		13.23	33	4,761	素材
国	小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	77.44 4銘柄	308 <0.1%>	
<b>ユーロ通貨計</b>		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	20,822.3 223銘柄	46,262 <9.0%>	
<b>ファンド合計</b>		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	126,137.82 1,213銘柄	— <95.9%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (2) 外国投資信託証券

銘柄	柄	2022年6月15日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千アメリカ・ドル	千円
<b>(アメリカ)</b>				
AVALONBAY COMMUNITIES INC		1.606	297	40,154
SIMON PROPERTY GROUP INC		3.755	362	48,926
BOSTON PROPERTIES INC		1.658	150	20,289
VORNADO REALTY TRUST		2.128	61	8,320
SBA COMMUNICATIONS CORP		1.216	361	48,768
EQUITY RESIDENTIAL		4.032	277	37,441
EQUINIX INC		1.021	631	85,258
AMERICAN TOWER CORP		5.381	1,261	170,354
HOST HOTELS & RESORTS INC		10.529	180	24,421
AMERICAN HOMES 4 RENT- A		4.335	142	19,278
KIMCO REALTY CORP		7.054	135	18,285
INVITATION HOMES INC		6.976	234	31,673
VICI PROPERTIES INC		12.524	352	47,564
VENTAS INC		4.401	213	28,776
WEYERHAEUSER CO		8.683	298	40,350
CROWN CASTLE INTL CORP		4.914	776	104,770
IRON MOUNTAIN INC		3.474	164	22,175
SUN COMMUNITIES INC		1.35	203	27,529
PROLOGIS INC		8.288	917	123,824
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		2.091	283	38,215

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千□	千アメリカ・ドル	千円
CAMDEN PROPERTY TRUST	1.177	148	20,022
DUKE REALTY CORP	4.262	218	29,461
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.771	197	26,669
WELLTOWER INC	4.901	379	51,247
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6.434	150	20,361
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.326	212	28,649
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1.95	133	18,078
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15.632	92	12,494
REALTY INCOME CORP	7.325	459	62,096
PUBLIC STORAGE	1.784	531	71,737
REGENCY CENTERS CORP	1.939	109	14,816
UDR INC	3.7	156	21,140
WP CAREY INC	2.131	172	23,295
DIGITAL REALTY TRUST INC	3.174	395	53,380
EXTRA SPACE STORAGE INC	1.575	250	33,754
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	6.944	103	14,006
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	160.441 36銘柄	11,018 <2.1%>
		千□	千カナダ・ドル
(カナダ)			千円
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.831	36	3,825
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1.4	28	2,933
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	2.231 2銘柄	64 <0.0%>
		千□	千オーストラリア・ドル
(オーストラリア)			千円
DEXUS/AU	13.949	126	11,778
LENLEASE GROUP	8.477	81	7,607
TRANSURBAN GROUP	40.411	564	52,558
APA GROUP	14.243	163	15,249
SCENTRE GROUP	64.017	163	15,197
GPT GROUP	21.774	90	8,432
MIRVAC GROUP	43.513	89	8,304
STOCKLAND	18.729	67	6,277
GOODMAN GROUP	20.198	361	33,678
VICINITY CENTRES	50.371	87	8,183
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	295.682 10銘柄	1,796 <0.2%>
		千□	千香港・ドル
(香港)			千円
LINK REIT	26	1,778	30,588
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	33	252	4,336
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	54	578	9,956
香港・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	113 3銘柄	2,609 <0.1%>
		千□	千シンガポール・ドル
(シンガポール)			千円
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30.5	83	8,131
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	56.826	120	11,679
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	46	74	7,224
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	37.6	66	6,415
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	170.926 4銘柄	345 <0.0%>

## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘 柄		2022年6月15日現在		
		□ 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		8,969	65	10,643
SEGRO PLC		11,371	108	17,611
BRITISH LAND CO PLC		9,799	49	8,052
イギリス・ポンド通貨計		30,139	223	36,307
		□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >		<0.1%>
		千口	千ユーロ	千円
(ユーロ(ベルギー)) WAREHOUSES DE PAUW SCA		2,198	67	9,519
国 小 計		2,198	67	9,519
		□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >		<0.0%>
		千口	千ユーロ	千円
(ユーロ(フランス)) UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		1,507	80	11,351
GECINA SA		0,578	55	7,788
KLEPIERRE		2,394	45	6,343
COVIVIO		0,353	20	2,818
国 小 計		4,832	201	28,302
		□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >		<0.0%>
ユ ー ロ 通 貨 計		7,03	268	37,821
		□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >		<0.1%>
合 計		779,449	—	1,814,081
		□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >		<2.5%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

### (3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

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

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

(注2) 単位未満は切捨て。

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

## 運用報告書 第14期 (決算日 2022年1月11日)

(作成対象期間 2021年1月13日～2022年1月11日)

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

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

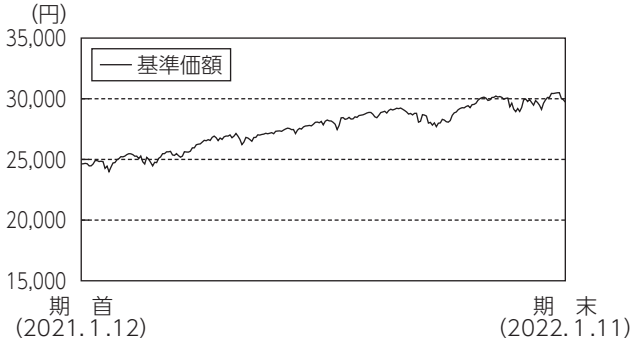
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みません。）
株式組入制限	無制限

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託証券組入比率
	円	%	円ヘッジ・ベース	%					
(期首)2021年1月12日	24,628	-	18,522	-	91.1		7.9	2.0	
2021年1月末	24,448	△ 0.7	18,380	△ 0.8	91.1		6.3	2.2	
2月末	24,805	0.7	18,622	0.5	94.5		4.9	2.2	
3月末	25,602	4.0	19,179	3.5	97.5		3.3	2.3	
4月末	27,019	9.7	20,212	9.1	94.2		2.9	2.3	
5月末	27,153	10.3	20,267	9.4	94.8		3.7	2.3	
6月末	27,802	12.9	20,733	11.9	93.7		4.3	2.3	
7月末	28,466	15.6	21,213	14.5	92.1		4.4	2.3	
8月末	29,136	18.3	21,674	17.0	91.2		6.5	2.2	
9月末	28,052	13.9	20,838	12.5	94.3		4.9	2.3	
10月末	29,513	19.8	21,908	18.3	94.0		5.8	2.3	
11月末	29,636	20.3	21,970	18.6	93.0		3.7	2.3	
12月末	30,465	23.7	22,559	21.8	93.4		5.7	2.4	
(期末)2022年1月11日	29,723	20.7	21,997	18.8	94.4		3.3	2.4	

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

《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：24,628円 期末：29,723円 騰落率：20.7%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆ 投資環境について

○ 先進国株式市況

先進国株式市況は上昇しました。

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

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ ポートフォリオについて

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

◆ ベンチマークとの差異について

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

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

\*ベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)です。

《今後の運用方針》

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



# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

## ■ 1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■ 売買および取引の状況

### (1) 株 式

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	アメリカ	百株 2,529.02 (△ 260.83)	千アメリカ・ドル 27,716 (△ 702)	百株 3,244.57	千アメリカ・ドル 36,904
	カナダ	百株 483.49 ( 99.36)	千カナダ・ドル 2,316 ( 212)	百株 702.42	千カナダ・ドル 2,409
	オーストラリア	百株 320.69 ( 58.3)	千オーストラリア・ドル 841 (△ 48)	百株 617.54	千オーストラリア・ドル 663
	香港	百株 1,090 ( 81.91)	千香港ドル 2,190 (△ 22)	百株 1,388	千香港ドル 2,829
	シンガポール	百株 50 ( 370.97)	千シンガポール・ドル 128 (△ 34)	百株 510.97	千シンガポール・ドル 295
	ニュージーランド	百株 — ( —)	千ニュージーランド・ドル — ( —)	百株 70	千ニュージーランド・ドル 42
	イギリス	百株 1,632.56 (△ 595.44)	千イギリス・ポンド 977 (△ 206)	百株 2,255.52	千イギリス・ポンド 1,419
	イスラエル	百株 — ( —)	千イスラエル・シケル — ( —)	百株 20	千イスラエル・シケル 196
	スイス	百株 32.88 ( —)	千スイス・フラン 807 (△ 30)	百株 121.39	千スイス・フラン 1,104
	デンマーク	百株 45.94 ( 102.28)	千デンマーク・クローネ 716 ( —)	百株 56.48	千デンマーク・クローネ 2,648
	ノルウェー	百株 30.67 ( —)	千ノルウェー・クローネ 1,182 ( —)	百株 27.83	千ノルウェー・クローネ 775
	スウェーデン	百株 338.93 ( 1,035.13)	千スウェーデン・クローネ 8,970 ( —)	百株 679.14	千スウェーデン・クローネ 8,392

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	ユーロ (アイルランド)	百株 8.28 ( —)	千ユーロ 80 ( —)	百株 20.76	千ユーロ 162
	ユーロ (オランダ)	百株 240.31 ( 112.9)	千ユーロ 1,378 (△ 62)	百株 481.66	千ユーロ 1,036
	ユーロ (ベルギー)	百株 — ( —)	千ユーロ — ( —)	百株 15.07	千ユーロ 85
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 57.91 ( —)	千ユーロ 87 ( —)	百株 70.11	千ユーロ 66
	ユーロ (フランス)	百株 49.15 ( 1.91)	千ユーロ 582 (△ 58)	百株 221.3	千ユーロ 1,414
	ユーロ (ドイツ)	百株 108.81 ( 153.04)	千ユーロ 616 (△ 32)	百株 328.33	千ユーロ 1,307
	ユーロ (ポルトガル)	百株 169.85 ( —)	千ユーロ 79 ( —)	百株 85.97	千ユーロ 41
	ユーロ (スペイン)	百株 269.49 ( 3,614.69)	千ユーロ 342 ( 61)	百株 3,168.18	千ユーロ 304
	ユーロ (イタリア)	百株 45.25 ( —)	千ユーロ 79 (△ 0)	百株 817.2	千ユーロ 207
	ユーロ (フィンランド)	百株 22.35 ( —)	千ユーロ 78 ( —)	百株 38.62	千ユーロ 133
ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 971.4 ( 3,882.54)	千ユーロ 3,325 (△ 92)	百株 5,247.2	千ユーロ 4,758	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ( )内は株式分割、合併等による増減分で、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。

## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

### (2) 投資信託証券

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

	買		付		売		付		
	口数	金額	口数	金額	口数	金額	口数	金額	
外	アメリカ	千口 6.081 (△ 0.155)	千アメリカ・ドル 382 ( - )	千口 15.238 ( - )	千アメリカ・ドル 876 ( - )	国	シンガポール	千口 - ( 5.166)	千シンガポール・ドル - ( 6)
	オーストラリア	千口 27.011 ( 3.711)	千オーストラリア・ドル 256 ( - )	千口 10.674 ( - )	千オーストラリア・ドル 61 ( - )		香港	千口 - ( - )	千香港ドル - ( - )
	香港	千口 - ( - )	千香港ドル - ( - )	千口 6 ( - )	千香港ドル 421 ( - )				

(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

(2021年1月13日から2022年1月11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 25,850	百万円 29,410	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

### ■主要な売買銘柄 株 式

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘	柄	株数	金額	平均単価	銘	柄	株数	金額	平均単価
AMAZON.COM INC (アメリカ)		千株	千円	円	APPLE INC (アメリカ)		千株	千円	円
TESLA INC (アメリカ)		0.523	203,757	389,593	MICROSOFT CORP (アメリカ)		21.313	315,537	14,804
APPLE INC (アメリカ)		1.477	135,224	91,553	ALPHABET INC-CL C (アメリカ)		7.183	214,856	29,911
MICROSOFT CORP (アメリカ)		5.422	92,141	16,993	AMAZON.COM INC (アメリカ)		0.55	141,838	257,888
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)		2.5	84,468	33,787	META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)		0.37	135,438	366,050
SNOWFLAKE INC-CLASS A (アメリカ)		0.281	75,780	269,679	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)		2.255	77,877	34,535
SEA LTD-ADR (ケイマン諸島)		2.091	71,227	34,063	TESLA INC (アメリカ)		0.287	74,208	258,565
AIRBNB INC-CLASS A (アメリカ)		1.7	59,641	35,082	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)		0.668	60,233	90,170
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A (アメリカ)		2.931	57,800	19,720	ALEXION PHARMACEUTICALS INC (アメリカ)		3.155	55,500	17,591
PROSUS NV (オランダ)		19.77	55,009	2,782	ORACLE CORP (アメリカ)		2.652	52,988	19,980
		5.3	49,511	9,341			5.72	52,828	9,235

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

## ■組入資産明細表

### (1) 外国株式

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円	
(アメリカ)	百株	百株			
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	12.95	12.95	217	25,130	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	12.2	12.2	637	73,538	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22.71	22.71	424	48,924	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS INC	15.94	15.94	137	15,906	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7.46	7.46	109	12,604	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	62	72.38	349	40,322	金融
ABBOTT LABORATORIES	223.7	212.42	2,873	331,394	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	39.5	39.5	134	15,481	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	19.43	19.43	401	46,318	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	47.29	47.29	172	19,870	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	41.67	69.05	565	65,242	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	1.87	4.43	199	22,958	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES	77.66	74.82	870	100,424	情報技術
QORVO INC	12.83	12.83	194	22,428	情報技術
AFLAC INC	84.71	84.71	532	61,465	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	12.48	18.7	274	31,701	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	18.35	18.35	211	24,407	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	60.97	57.19	3,007	346,852	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	28.72	28.72	193	22,349	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	16.07	14.07	490	56,544	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	15.27	20.68	268	31,019	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	28.19	26.02	767	88,563	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	88.26	83.91	1,791	206,590	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	17.71	17.71	149	17,238	金融
AUTOZONE INC	2.91	2.61	525	60,588	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	33.98	25.66	348	40,173	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	123.65	123.65	112	13,006	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	15.08	-	-	-	公益事業
CELANESE CORP	12.97	12.97	220	25,474	素材
DR HORTON INC	43.97	43.97	420	48,544	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	24.5	135	15,669	ヘルスケア
AUTODESK INC	26.84	26.84	704	81,228	情報技術
MOODY'S CORP	21.43	20.35	736	84,918	金融
DEVON ENERGY CORP	77.48	77.48	375	43,342	エネルギー
ALBEMARLE CORP	16.68	14.27	323	37,357	素材
ATMOS ENERGY CORP	16.54	16.54	173	20,059	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	36.14	36.14	219	25,272	公益事業
CITIGROUP INC	261.68	248.66	1,641	189,376	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	53.55	51.05	1,188	137,128	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	59.18	59.18	535	61,773	公益事業
ALLEGHANY CORP	1.46	1.46	98	11,417	金融
DOMINO'S PIZZA INC	5.26	5.26	264	30,495	一般消費財・サービス
HESS CORP	34.26	38.07	324	37,389	エネルギー
DAVITA INC	10	10	113	13,117	ヘルスケア
DANAHER CORP	80.31	76.75	2,325	268,252	ヘルスケア
FORTIVE CORP	43.35	43.35	312	36,044	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	71.72	66.22	870	100,437	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	65.8	65.8	460	53,072	生活必需品

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円	
BUNGE LTD	18.38	18.38	176	20,374	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	42.21	40.02	633	73,055	情報技術
APPLE INC	2,156.06	1,997.15	34,388	3,966,418	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33.59	37.57	479	55,258	金融
BOEING CO/THE	67.41	66.98	1,401	161,701	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20.63	20.63	243	28,137	金融
BECTON DICKINSON AND CO	36.79	34.85	903	104,175	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT	20	20	18	2,094	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	14	14	125	14,486	資本財・サービス
NISOURCE INC	40.26	40.26	111	12,895	一般消費財・サービス
CH. ROBINSON WORLDWIDE INC	17.08	17.08	184	21,244	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	99.78	99.78	626	72,274	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	519.78	493.71	2,659	306,760	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	173.71	159.59	5,089	587,057	金融
ANSYS INC	10.38	10.38	376	43,480	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	171.23	160.8	1,049	121,091	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	81.93	86.15	988	113,991	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	286.15	272.84	1,776	204,865	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	382.84	359.51	6,015	693,807	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	30.13	26.58	502	58,006	金融
LKQ CORP	33	33	190	21,954	一般消費財・サービス
RENAISSANCECERE HOLDINGS LTD	5.47	-	-	-	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	36.65	36.65	241	27,815	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	36.14	33.59	557	64,266	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16.11	13.48	429	49,543	金融
DOLLAR GENERAL CORP	30.52	28.25	667	76,998	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	24.19	24.19	1,383	159,592	情報技術
CATERPILLAR INC	68.56	65.72	1,456	168,006	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	28.86	28.86	196	22,661	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	24.78	24.78	128	14,779	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	-	6.4	213	24,663	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	33.84	33.84	219	25,284	公益事業
MOSAIC CO/THE	52.09	52.09	208	24,056	素材
DELTA AIR LINES INC	16.5	16.5	67	7,732	資本財・サービス
CORNING INC	99.83	99.83	375	43,294	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	534.5	505.01	3,121	360,088	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12.97	-	-	-	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	189.09	170.09	1,771	204,284	金融
ZILLOW GROUP INC - A	5.87	10.16	56	6,475	不動産
MSCI INC	10.06	10.06	545	62,873	金融
FAIR ISAAC CORP	3.98	3.98	175	20,207	情報技術
LENIXX INTERNATIONAL INC	4.5	4.5	137	15,871	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	27.8	27.8	229	26,488	情報技術
BROADCOM INC	50.58	48.79	3,030	349,553	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14.16	14.16	212	24,524	ヘルスケア
ARAMARK	31.73	31.73	115	13,303	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	16.12	-	-	-	素材
DTE ENERGY COMPANY	27.39	22.81	274	31,610	公益事業

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
CENTENE CORP	77.79	68.44	532	61,445			ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	13.58	13.58	166	19,214			金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	55.32	55.32	298	34,404			金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	22.32	24.75	402	46,368			金融
GARTNER INC	11.74	10.48	307	35,500			情報技術
SPLUNK INC	20.29	20.29	240	27,689			情報技術
DOMINION ENERGY INC	109.95	97.4	777	89,681			公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	47.68	47.68	442	50,996			生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	14	14	116	13,384			資本財・サービス
DEERE & CO	36.23	36.23	1,376	158,734			資本財・サービス
POOL CORP	1.74	4.38	217	25,073			一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	38.66	35.67	524	60,482			情報技術
VMWARE INC-CLASS A	8.92	23.35	286	33,002			情報技術
CABLE ONE INC	0.6	0.6	97	11,294			コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	7.66	7.66	189	21,822			一般消費財・サービス
NASDAQ INC	14.27	14.27	269	31,127			金融
VAIL RESORTS INC	5.53	5.53	164	18,933			一般消費財・サービス
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	-	63.6	144	16,710			コミュニケーション・サービス
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	8.94	-	-	-			金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	8.74	119	13,755			金融
CONSOLIDATED EDISON INC	46.02	37.8	320	36,962			公益事業
COGNEX CORP	24.39	24.39	175	20,229			情報技術
TELEFLEX INC	5.63	5.63	182	21,008			ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	9.79	9.79	193	22,355			資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8.52	8.52	334	38,577			ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	3	3	199	22,992			ヘルスケア
CATALENT INC	20	20	236	27,291			ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17.57	17.57	421	48,608			ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	8	8	231	26,731			ヘルスケア
IDEX CORP	11.56	9.53	214	24,714			資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	104.86	97.15	813	93,799			生活必需品
ROLLINS INC	26.85	26.85	90	10,461			資本財・サービス
AMETEK INC	25.97	25.97	364	42,004			資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	30.47	30.47	313	36,128			生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	16.44	16.44	95	10,988			資本財・サービス
HEICO CORP	5.35	5.35	79	9,150			資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	10.6	-	-	-			資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	2.64	7.16	231	26,734			資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4.8	4.8	212	24,520			金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	34.22	34.22	334	38,601			素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	5.09	5.09	247	28,556			情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	55.33	52.6	2,728	314,749			生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	11.28	11.28	120	13,910			情報技術
EPAM SYSTEMS INC	7.49	7.49	408	47,155			情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	17.5	17.5	160	18,557			素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3.53	3.53	544	62,842			一般消費財・サービス
UGI CORP	20.85	20.85	94	10,857			公益事業
CUMMINS INC	17.63	17.63	407	47,049			資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	99.82	93.22	588	67,855			コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	17.92	17.92	358	41,381			情報技術

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	
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
SIGNATURE BANK	-	8	282	32,594			金融
COSTAR GROUP INC	4.92	49.2	351	40,579			資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	6.9	6.9	490	56,601			金融
AMERCO	0.7	0.7	48	5,605			資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	12.39	12.39	409	47,183			資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	6.03	5.56	585	67,547			一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	8.37	141	16,369			情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	38.01	34.77	516	59,598			一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	2.5	2.5	41	4,738			情報技術
DEXCOM INC	11.88	11.88	549	63,351			ヘルスケア
NORDSON CORP	7.5	7.5	178	20,616			資本財・サービス
COPART INC	24.95	24.95	339	39,163			資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	-	22	266	30,792			エネルギー
SEAGEN INC	15.45	15.45	224	25,853			ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	9.63	9.09	498	57,549			ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	6.98	6.37	410	47,315			資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	-	5.07	216	25,014			ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	12.03	12.03	91	10,606			ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	14.47	24.57	233	26,893			ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	278.51	278.51	485	55,990			エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	32.61	32.61	813	93,831			ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	5.44	4.2	159	18,447			金融
COTERRA ENERGY INC	46.08	95	202	23,404			エネルギー
T-MOBILE US INC	72.44	76.24	806	92,982			コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	17.86	17.86	100	11,647			不動産
COCA-COLA CO/THE	514.9	488.85	2,954	340,728			生活必需品
COCA-COLA EUROPEANIC PARTNE	25.75	25.75	148	17,178			生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.46	19.46	242	28,004			資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	38.51	38.51	134	15,510			金融
CSX CORP	94.51	272.23	994	114,731			資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDS	11.66	11.66	340	39,218			ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	15.63	15.63	282	32,552			一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	8	-	-	-			一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	53.52	55.05	17,779	2,050,700			一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	81.09	73.71	885	102,122			ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	529.46	515.19	3,527	406,862			エネルギー
AES CORP	83.41	83.41	191	22,088			公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	5.71	5.71	159	18,453			金融
EOG RESOURCES INC	76.55	72.38	709	81,863			エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	19.14	19.14	215	24,868			情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	-	1	90	10,449			金融
ABIOMED INC	5.55	5.55	170	19,639			ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	19.89	19.89	267	30,887			ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	36.83	36.83	534	61,663			ヘルスケア
FORD MOTOR CO	475.97	475.97	1,135	130,932			一般消費財・サービス
NOVAVAX INC	-	9.75	131	15,180			ヘルスケア
DISCOVERY INC - A	15.21	15.21	43	5,015			コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	17.21	22.19	165	19,047			ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	24.16	65	7,604			コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	5.95	3.24	47	5,492			コミュニケーション・サービス

## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
ENTEGRIS INC	-	17	227	26,256	情報技術
DISCOVERY INC-C	45.54	45.54	126	14,633	コミュニケーション・サービス
FORTINET INC	15.95	15.95	517	59,736	情報技術
MARKEL CORP	1.77	1.77	222	25,642	金融
NEXTERA ENERGY INC	243.24	233.99	1,972	227,485	公益事業
MASIMO CORP	6.93	6.93	176	20,332	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	197.64	182.97	761	87,833	素材
INSULET CORP	7.69	7.69	185	21,349	ヘルスケア
US BANCORP	180.05	171.43	1,051	121,325	金融
UNITED RENTALS INC	10.55	9.18	295	34,116	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	11.11	6.59	156	18,039	情報技術
FASTENCO	79.24	67.16	404	46,609	資本財・サービス
FISERV INC	73.39	72.06	776	89,555	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	1,169.58	132.27	1,315	151,675	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	165.43	154.98	946	109,165	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	4.65	13.05	130	15,050	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	32.11	28.75	605	69,838	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	41.76	40.78	1,627	187,752	金融
ALPHABET INC-CL A	36.37	36.31	10,070	1,161,494	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	39.68	34.69	9,614	1,108,909	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	17.63	17.63	161	18,660	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	78.49	78.49	539	62,257	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	76.12	58.4	242	27,967	公益事業
GENUINE PARTS CO	17.7	17.7	244	28,181	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	44.17	44.17	542	62,535	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	81	81	395	45,591	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	27.79	24.78	553	63,861	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	102.3	102.3	264	30,501	エネルギー
HOME DEPOT INC	135.34	128.45	4,976	574,038	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	8.4	8.4	131	15,148	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	166.84	190.88	325	37,493	金融
WASHINGTON INGALLS INDUSTRIE	5	5	98	11,314	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	17.25	17.25	335	38,725	生活必需品
HUMANA INC	17.33	15.69	604	69,705	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	36.71	33.62	745	86,019	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9.17	9.17	159	18,448	情報技術
HENRY SCHEIN INC	18.7	18.7	148	17,071	ヘルスケア
HP INC	174.43	153.38	597	68,923	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	200.5	141.15	239	27,676	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	13.95	13.95	68	7,859	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	27.62	27.62	173	19,971	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20.28	20.28	99	11,484	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	50.11	50.11	230	26,598	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	83.9	83.9	313	36,153	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	15.58	15.58	229	26,439	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	110.82	107.57	1,452	167,533	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	40.47	196	22,671	素材

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	15	150	17,365	資本財・サービス
ZOETIS INC	60.03	56.48	1,200	138,496	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	32.74	29.08	552	63,774	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	24.84	29.38	317	36,580	エネルギー
ALLEGION PLC	11.1	11.1	138	16,014	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-C	51.08	51.08	140	16,207	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	34.31	34.31	438	50,618	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	49.12	49.12	169	19,551	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC	8.64	-	-	-	ヘルスケア
JM SMUCKER CO/THE	13.93	13.93	199	23,020	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	332.56	317.89	5,502	634,641	ヘルスケア
PLUG POWER INC	-	62.51	154	17,844	資本財・サービス
ABBVIE INC	223.87	211.65	2,886	332,951	ヘルスケア
HOLOGIC INC	30.42	30.42	223	25,770	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	44.29	39.87	576	66,491	生活必需品
KROGER CO	100.13	86.74	425	49,122	生活必需品
KLA CORP	19.19	18.3	766	88,382	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	31.47	29.82	1,083	124,937	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	9.76	9.76	232	26,794	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	-	28.72	167	19,352	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	94.68	84.7	2,097	241,975	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	109.21	97.69	2,541	293,080	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	17.56	17.56	1,166	134,543	情報技術
LOEVNS CORP	35.91	28.73	174	20,124	金融
INCOLN NATIONAL CORP	26.43	26.43	190	22,024	金融
MCDONALD'S CORP	94.58	90.35	2,388	275,540	一般消費財・サービス
3M CO	72.16	69.54	1,233	142,296	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	303.64	287.43	9,429	1,087,623	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	29.23	29.23	1,272	146,786	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7.67	7.67	319	36,823	素材
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	5.75	5.75	146	16,942	情報技術
CONCHO RESOURCES INC	25.52	-	-	-	その他
PHILLIPS 66	51.07	51.07	428	49,397	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	56.59	56.59	246	28,471	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTF SHRS	29.92	29.92	283	32,653	生活必需品
METLIFE INC	90.65	90.65	611	70,575	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	86.17	104.85	861	99,419	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	5.93	23.72	312	35,987	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	24.19	-	-	-	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22.32	20.48	524	60,478	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.84	2.84	444	51,296	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	84.46	84.46	220	25,396	エネルギー
RCKWELL AUTOMATION INC	14.6	14.6	482	55,596	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	318.87	303.2	2,497	288,056	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	91.81	66.57	545	62,938	素材
MASCO CORP	35.43	35.43	235	27,220	資本財・サービス
M & T BANK CORP	19.84	13.71	243	28,066	金融
MARSH & MCLENNAN COS	64.53	60.48	999	115,225	金融
BLACK KNIGHT INC	16.44	16.44	129	14,978	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	10.18	10.18	131	15,183	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ドル	千円			
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	33.61	33.61	544	62,819	千ドル	千円	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	21.23	23.03	581	67,020			情報技術
WAYFAIR INC-CLASS A	8.8	8.8	155	17,913			一般消費財・サービス
BLOCK INC CLASS A	48.01	46.73	675	77,872			情報技術
TRANSUNION	22.93	22.93	250	28,928			資本財・サービス
VISTRA CORP	42.85	42.85	96	11,100			公益事業
NOVOCLURE LTD	6.16	10.54	69	7,978			ヘルスケア
NETAPP INC	27.03	27.03	251	29,056			情報技術
NIKE INC-CL B	155.47	152.54	2,294	264,683			一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	33.43	29.93	861	99,410			資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	34.92	66.46	551	63,569			情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17.49	26.23	282	32,580			金融
ALLY FINANCIAL INC	50.94	50.94	255	29,471			金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	20.25	18.35	738	85,131			資本財・サービス
APTIV PLC	32.32	32.32	533	61,534			一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	104.13	92.52	559	64,486			素材
MCKESSON CORP	21.61	18.5	463	53,498			ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	32.57	-	-	-			情報技術
XYLEM INC	19.72	19.72	225	25,988			資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	196.39	187.91	1,884	217,342			生活必需品
NUCOR CORP	36.92	36.92	412	47,633			素材
SUNRUN INC	15	15	47	5,453			資本財・サービス
WESTERN UNION CO	68.11	43.5	81	9,382			情報技術
GODADDY INC - CLASS A	19.3	19.3	147	17,051			情報技術
NEWELL BRANDS INC	40.58	40.58	94	10,886			一般消費財・サービス
EVERGY INC	32.43	26.54	177	20,454			公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	102.38	102.38	331	38,235			エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	2.69	51	5,979			金融
OKTA INC	13.76	16.34	328	37,926			情報技術
COUPA SOFTWARE INC	8.8	8.8	129	14,987			情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	8.84	18.78	283	32,649			コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	48.77	48.77	140	16,161			ヘルスケア
LINDE PLC	61.08	57.29	1,921	221,646			素材
WIX.COM LTD	7.85	7.85	115	13,303			情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	61.84	61.84	217	25,085			金融
KKR & CO INC	64.89	64.89	449	51,874			金融
PAYCHEX INC	46	36.57	462	53,391			情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9.16	8.38	565	65,249			一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	232.79	220.86	1,116	128,745			生活必需品
P G & E CORP	155.15	155.15	189	21,885			公益事業
PFIZER INC	702.37	669.99	3,768	434,603			ヘルスケア
CIGNA CORP	46.3	40.86	954	110,133			ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	32.76	32.76	196	22,625			情報技術
ALTICE USA INC- A	41.47	-	-	-			コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	65.28	65.28	456	52,600			公益事業
STERIS PLC	8.97	13.29	307	35,488			ヘルスケア
SEA LTD-ADR	-	17	318	36,686			コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	15.3	15.3	55	6,347			コミュニケーション・サービス

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ドル	千円			
FOX CORP - CLASS A	52.67	41.92	163	18,871	千ドル	千円	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	44.82	40.86	1,078	124,347			ヘルスケア
LYFT INC-A	-	36.49	161	18,573			資本財・サービス
DOW INC	96.64	87.18	509	58,723			素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	15.08	15.08	138	15,984			金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	23.26	27.23	469	54,196			情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	18.39	15.38	488	56,313			資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	116.86	151.86	646	74,616			資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	22.03	30.37	604	69,749			エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	310.59	291.25	4,675	539,231			生活必需品
EXELON CORP	118.82	118.82	675	77,870			公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	26.52	-	-	-			その他
TELADOC HEALTH INC	13.4	19.85	163	18,815			ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	53.97	49.86	294	33,924			資本財・サービス
NVR INC	0.45	0.45	248	28,626			一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	141.85	167.66	1,358	156,695			エネルギー
TWILIO INC - A	17.46	20.53	467	53,875			情報技術
DOCUSIGN INC	22.52	25.65	349	40,303			情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	6.01	6.01	218	25,233			情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	6.12	14.7	131	15,208			情報技術
PSPICO INC	174.34	167.68	2,920	336,848			生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4.09	4.09	64	7,440			情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	23.92	54.14	128	14,824			情報技術
MONGODB INC	6.1	7.12	309	35,723			情報技術
SNAP INC - A	116.75	116.75	486	56,166			コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	85.3	85.3	404	46,624			素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	53.88	49.01	560	64,702			金融
AMCOR PLC	174.57	174.57	212	24,463			素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	19.1	23.36	449	51,866			情報技術
ROKU INC	14.88	15.56	284	32,835			コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20.92	20.92	355	41,026			公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	79.88	75.59	2,819	325,201			情報技術
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	58.76	-	-	-			情報技術
10X GENOMICS INC-CLASS A	4.21	8.18	104	12,050			ヘルスケア
KORNIT DIGITAL LTD	-	6	74	8,611			資本財・サービス
PENTAIR PLC	15.75	15.75	109	12,627			資本財・サービス
QUALCOMM INC	142.14	135.24	2,429	280,275			情報技術
INVESCO LTD	37	37	89	10,310			金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	8.19	8.19	191	22,116			一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31.93	31.93	242	27,919			金融
DATADOG INC - CLASS A	18.25	25.36	371	42,801			情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	60.8	77.35	252	29,173			コミュニケーション・サービス
INMODE LTD	-	6	32	3,780			ヘルスケア
AVALARA INC	12.57	12.57	143	16,501			情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	13.27	12.61	783	90,359			ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	26.67	26.67	351	40,490			資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	5.01	5.01	1,215	140,210			一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	48.88	41.1	423	48,883			一般消費財・サービス



外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
PACKAGING CORP OF AMERICA	9.98	9.98	135	15,651	千円	千円	素材
RESMED INC	19.83	16.6	394	45,444	千円	千円	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	18.12	15.58	248	28,680	千円	千円	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	14.99	14.99	165	19,078	千円	千円	資本財・サービス
MODERNA INC	33.62	42.39	990	114,262	千円	千円	ヘルスケア
HUBSPOT INC	3.54	5.64	296	34,210	千円	千円	情報技術
PERKINELMER INC	11.63	11.63	213	24,648	千円	千円	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	97.33	97.33	509	58,734	千円	千円	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	48.66	48.66	411	47,514	千円	千円	資本財・サービス
BILL.COM HOLDINGS INC	—	9	180	20,863	千円	千円	情報技術
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	23	—	—	—	千円	千円	金融
AVANTOR INC	56	66.86	255	29,520	千円	千円	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	31.23	14.76	74	8,535	千円	千円	金融
DYNATRACE INC	23.39	23.39	127	14,713	千円	千円	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	5.4	5.4	437	50,449	千円	千円	情報技術
FIVERR INTERNATIONAL LTD	—	4	38	4,408	千円	千円	一般消費財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	153.5	108.25	269	31,039	千円	千円	金融
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	—	28	149	17,193	千円	千円	コミュニケーション・サービス
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	—	41.76	177	20,441	千円	千円	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	10.21	10.21	133	15,366	千円	千円	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	31.62	31.62	400	46,157	千円	千円	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	234.68	231.9	2,901	334,636	千円	千円	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A	25.9	31.74	109	12,582	千円	千円	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	12.94	10.89	300	34,623	千円	千円	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	49.85	49.85	327	37,741	千円	千円	公益事業
ETSY INC	13.29	16.62	305	35,216	千円	千円	一般消費財・サービス
TESLA INC	93.77	101.86	10,778	1,243,135	千円	千円	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3.63	24.54	742	85,686	千円	千円	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	79.44	79.44	213	24,601	千円	千円	情報技術
DRAFTKINGS INC - CL A	12.2	41.34	108	12,459	千円	千円	一般消費財・サービス
UNITY SOFTWARE INC	—	7.52	94	10,928	千円	千円	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	22	18.95	356	41,110	千円	千円	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	20.31	17.76	585	67,522	千円	千円	情報技術
CARVANA CO	6.88	9.64	176	20,396	千円	千円	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	8.56	8.56	42	4,927	千円	千円	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	20.3	29.34	324	37,478	千円	千円	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	18.26	15.9	962	111,030	千円	千円	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	137.45	137.45	206	23,796	千円	千円	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	—	9.49	126	14,607	千円	千円	一般消費財・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	—	29.31	471	54,329	千円	千円	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	38.49	38.49	397	45,903	千円	千円	不動産
TWITTER INC	105.16	95.99	383	44,252	千円	千円	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	139.16	125.64	861	99,308	千円	千円	公益事業
SYSCO CORP	61.6	61.6	488	56,349	千円	千円	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	29.58	29.58	485	55,973	千円	千円	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	—	6	25	2,944	千円	千円	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	19.25	19.25	121	14,007	千円	千円	金融
STEEL DYNAMICS INC	23	23	139	16,073	千円	千円	素材

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
SCHLUMBERGER LTD	178.99	178.99	628	72,504	千円	千円	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	20.26	126	14,623	千円	千円	資本財・サービス
AFFIRM HOLDINGS INC	—	11	86	9,926	千円	千円	情報技術
AT&T INC	897.21	855.56	2,263	261,108	千円	千円	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	17.58	17.58	79	9,173	千円	千円	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	44.52	55.54	361	41,715	千円	千円	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	25.95	229	26,428	千円	千円	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10.19	30.57	988	113,993	千円	千円	素材
SEMPRA ENERGY	39.15	38.07	524	60,463	千円	千円	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	—	22.64	97	11,215	千円	千円	情報技術
CLARIVATE PLC	—	47.21	97	11,249	千円	千円	資本財・サービス
OAK STREET HEALTH INC	—	16.54	40	4,712	千円	千円	ヘルスケア
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	—	197.7	326	37,624	千円	千円	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	26.06	26.06	298	34,391	千円	千円	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	—	5	112	12,976	千円	千円	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC	114.44	109.81	2,009	231,727	千円	千円	情報技術
SALESFORCE.COM INC	114.15	116.24	2,669	307,867	千円	千円	情報技術
ASANA INC CLASS A	—	8	49	5,681	千円	千円	情報技術
WESTROCK CO	26.18	26.18	119	13,763	千円	千円	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	—	36.82	251	29,027	千円	千円	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	99.06	83.22	652	75,262	千円	千円	資本財・サービス
TERADYNE INC	20.96	20.96	328	37,860	千円	千円	情報技術
UNION PACIFIC CORP	85.02	80.74	2,020	233,074	千円	千円	資本財・サービス
MARATHON PETROLEUM CORP	81.28	81.28	572	66,045	千円	千円	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	190.09	182.23	1,635	188,598	千円	千円	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	87.73	87.73	1,857	214,244	千円	千円	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	24.35	24.35	626	72,243	千円	千円	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	18	—	—	—	千円	千円	金融
AMEREN CORPORATION	28.61	28.61	250	28,877	千円	千円	公益事業
AMEREN HEALTH GROUP INC	119.3	114.28	5,314	612,919	千円	千円	ヘルスケア
VERISIGN INC	13.65	13.65	322	37,250	千円	千円	情報技術
LUCID GROUP INC	—	51	212	24,541	千円	千円	一般消費財・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	—	22	179	20,665	千円	千円	一般消費財・サービス
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	—	23	35	4,141	千円	千円	金融
VALERO ENERGY CORP	58.84	45.84	371	42,842	千円	千円	エネルギー
SOFI TECHNOLOGIES INC	—	65	86	10,023	千円	千円	金融
UPSTART HOLDINGS INC	—	2	22	2,639	千円	千円	金融
ULTA BEAUTY INC	6.35	6.35	241	27,907	千円	千円	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	30.08	161	18,585	千円	千円	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9.92	9.92	131	15,201	千円	千円	ヘルスケア
ANTHEM INC	32.54	29.98	1,312	151,396	千円	千円	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	228.95	217.61	3,407	393,052	千円	千円	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	483.84	496.46	2,747	316,943	千円	千円	金融
WASTE MANAGEMENT INC	55.07	50.34	802	92,556	千円	千円	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	171.23	145.42	406	46,879	千円	千円	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	15.91	13.93	316	36,534	千円	千円	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	8.7	8.7	193	22,321	千円	千円	一般消費財・サービス
WALMART INC	178.52	184.85	2,673	308,317	千円	千円	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	24.92	24.92	316	36,474	千円	千円	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	11.45	11.45	94	10,851	千円	千円	一般消費財・サービス



外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
WABTEC CORP	18.98	18.98	179	20,669	資本財・サービス		
TJX COMPANIES INC	149.98	145.67	1,055	121,794	一般消費財・サービス		
WATERS CORP	7.6	7.6	262	30,244	ヘルスケア		
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5.55	6.5	348	40,140	情報技術		
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	86.95	86.95	467	53,884	生活必需品		
WILLIS TOWERS WATSON PLC	18.68	14.52	337	38,957	金融		
WESTERN DIGITAL CORP	35.31	35.31	231	26,692	情報技術		
WEC ENERGY GROUP INC	41.89	41.89	405	46,818	公益事業		
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	68.77	58.55	387	44,746	公益事業		
VISA INC-CLASS A SHARES	212.64	202.64	4,295	495,426	情報技術		
PPL CORP	101.94	101.94	308	35,543	公益事業		
PULTEGROUP INC	35.56	35.56	188	21,737	一般消費財・サービス		
PPG INDUSTRIES INC	32.34	28.34	470	54,323	素材		
NORTHERN TRUST CORP	22.6	22.6	292	33,691	金融		
NVIDIA CORP	77.62	300.67	8,238	950,212	情報技術		
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	51.6	51.6	1,147	132,392	金融		
TYSON FOODS INC-CL A	33.22	33.22	301	34,779	生活必需品		
NETFLIX INC	55.58	53.01	2,861	330,073	コミュニケーション・サービス		
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	49.85	46.9	2,931	338,112	ヘルスケア		
NRG ENERGY INC	30	30	121	13,972	公益事業		
GLOBE LIFE INC	12.15	12.15	122	14,155	金融		
FIRST REPUBLIC BANK/CA	19.53	21.06	426	49,181	金融		
TEXTRON INC	28.31	28.31	217	25,060	資本財・サービス		
NEWS CORP - CLASS A	37.49	37.49	83	9,612	公益事業		
OGE ENERGY CORP	24.52	-	-	-	公益事業		
OMNICOM GROUP	25.46	25.46	197	22,834	コミュニケーション・サービス		
ORACLE CORP	257.94	200.74	1,792	206,713	情報技術		
MASTERCARD INC - A	112.66	106.04	3,858	445,085	情報技術		
ONEOK INC	45.66	55.26	335	38,739	エネルギー		
LUMEN TECHNOLOGIES INC	110.62	110.62	150	17,415	コミュニケーション・サービス		
ROPER TECHNOLOGIES INC	12.69	12.69	575	66,396	資本財・サービス		
YUM! BRANDS INC	41.58	36.01	480	55,431	一般消費財・サービス		
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	14.13	14.13	202	23,303	コミュニケーション・サービス		
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	33.74	22.06	108	12,541	生活必需品		
BANK OF AMERICA CORP	980.93	926.34	4,532	522,787	金融		
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4.18	6.22	262	30,223	情報技術		
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	29.08	28.38	239	27,623	ヘルスケア		
AMERICAN EXPRESS CO	88.35	81.72	1,419	163,760	金融		
ANALOG DEVICES INC	48.3	64.8	1,104	127,357	情報技術		
ADVANCED MICRO DEVICES	146.31	146.31	1,931	222,755	情報技術		
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	100.84	100.84	619	71,425	金融		
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22.83	19.4	298	34,479	情報技術		
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	21.47	32.66	261	30,105	一般消費財・サービス		
AVERY DENNISON CORP	11.31	11.31	234	27,063	素材		
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	65.6	65.6	568	65,584	情報技術		
EMERSON ELECTRIC CO	78.46	71.75	683	78,866	資本財・サービス		
AON PLC-CLASS A	30.57	27.11	764	88,177	金融		
AMGEN INC	73.75	69.99	1,612	185,969	ヘルスケア		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
EATON CORP PLC	50.56	50.56	841	97,049	資本財・サービス		
CONSTELLATION BRANDS INC-A	21.81	20.19	498	57,537	生活必需品		
APPLIED MATERIALS INC	119.64	109.56	1,638	189,031	情報技術		
CME GROUP INC	45.88	42.9	955	110,243	金融		
ECOLAB INC	33.15	31.06	701	80,906	素材		
QUALIFAX INC	17.75	14.41	375	43,342	資本財・サービス		
GILEAD SCIENCES INC	158.31	148.98	1,073	123,874	ヘルスケア		
KEURIG DR PEPPER INC	45.94	92.36	344	39,745	生活必需品		
HORMEL FOODS CORP	33.15	33.15	165	19,060	生活必需品		
STATE STREET CORP	41.52	41.52	420	48,463	金融		
SCHWAB (CHARLES) CORP	187.78	173.79	1,592	183,711	金融		
BAXTER INTERNATIONAL INC	65.68	60.96	526	60,685	ヘルスケア		
CAMPBELL SOUP CO	21.66	21.66	99	11,452	生活必需品		
CROWN HOLDINGS INC	15.97	15.97	173	20,049	素材		
CARDINAL HEALTH INC	33.19	33.19	169	19,534	ヘルスケア		
FEDEX CORP	31.93	29.79	764	88,150	資本財・サービス		
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	54.87	54.87	862	99,455	金融		
FMC CORP	13.6	13.6	146	16,847	素材		
CERNER CORP	41.33	41.33	381	43,999	ヘルスケア		
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11.63	30.05	422	48,728	素材		
CITRIX SYSTEMS INC	14.12	14.12	137	15,833	情報技術		
INTEL CORP	534.49	483.45	2,669	307,857	情報技術		
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	52.31	52.31	195	22,522	コミュニケーション・サービス		
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	48.66	48.66	349	40,319	金融		
ILLINOIS TOOL WORKS	40.4	37.68	918	105,973	資本財・サービス		
SIRIUS XM HOLDINGS INC	153	153	95	11,047	コミュニケーション・サービス		
ILLUMINA INC	17.87	17.87	647	74,670	ヘルスケア		
SEALED AIR CORP	14.5	14.5	94	10,941	素材		
INTUITIVE SURGICAL INC	15.22	42.55	1,385	159,760	ヘルスケア		
CHECK POINT SOFTWARE TECH	13.3	13.3	161	18,578	情報技術		
SNAP-ON INC	5	5	108	12,554	資本財・サービス		
CARMAX INC	19.9	19.9	236	27,237	一般消費財・サービス		
DUKE ENERGY CORP	89.87	91.33	954	110,143	公益事業		
TARGET CORP	64.74	60	1,364	157,383	一般消費財・サービス		
DOVER CORP	17.13	17.13	307	35,435	資本財・サービス		
VW GRAINGER INC	5.88	5.88	294	33,916	資本財・サービス		
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17.5	17.5	233	26,956	資本財・サービス		
CINTAS CORP	11.62	11.62	463	53,506	資本財・サービス		
CONAGRA BRANDS INC	55.67	55.67	190	21,940	生活必需品		
LAMB WESTON HOLDINGS INC	15	-	-	-	生活必需品		
CLOXO COMPANY	16.28	16.28	292	33,742	生活必需品		
ENTERGY CORP	22.43	22.43	250	28,897	公益事業		
MICROSOFT CORP	908.49	861.66	27,079	3,123,336	情報技術		
INCYTE CORP	26.89	26.89	200	23,155	ヘルスケア		
CVS HEALTH CORP	160.17	160.17	1,682	194,087	ヘルスケア		
MEDTRONIC PLC	169.39	161.74	1,708	197,035	ヘルスケア		
MICRON TECHNOLOGY INC	146.66	135.86	1,275	147,126	情報技術		
BLACKROCK INC	19.59	18.34	1,601	184,740	金融		
CENTERPOINT ENERGY INC	56.36	56.36	156	18,000	公益事業		
HASBRO INC	14.49	14.49	146	16,946	一般消費財・サービス		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
KELLOGG CO	36.9	36.9	247	28,506	生活必需品		
KEYCORP	117.82	117.82	310	35,780	金融		
KANSAS CITY SOUTHERN	11.76	—	—	—	資本財・サービス		
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	183.59	173.19	1,160	133,897	生活必需品		
COOPER COS INC/THE	6.47	6.47	269	31,050	ヘルスケア		
CHUBB LTD	58.31	54.52	1,083	125,024	金融		
ARROW ELECTRONICS INC	10	10	131	15,175	情報技術		
ALLSTATE CORP	39.99	34.77	429	49,544	金融		
EBAY INC	93.21	83.08	536	61,873	一般消費財・サービス		
PAYPAL HOLDINGS INC	141.1	133.7	2,446	282,126	情報技術		
EASTMAN CHEMICAL CO	14.92	14.92	178	20,588	素材		
XILINX INC	28.92	28.92	559	64,544	情報技術		
DISH NETWORK CORP-A	29.84	29.84	101	11,684	コミュニケーション・サービス		
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	27.83	27.83	934	107,817	生活必需品		
TRIMBLE INC	29.38	29.38	231	26,692	情報技術		
LENNAR CORP-A	33.94	33.94	353	40,723	一般消費財・サービス		
LEAR CORP	6	6	111	12,882	一般消費財・サービス		
PROGRESSIVE CORP	73.91	69.8	767	88,558	金融		
PACCAR INC	48.25	41.7	385	44,422	資本財・サービス		
BIOGEN INC	19.48	19.48	458	52,869	ヘルスケア		
IDEXX LABORATORIES INC	10.24	10.24	572	65,981	ヘルスケア		
STARBUCKS CORP	148.28	142.74	1,513	174,563	一般消費財・サービス		
PTC INC	12	12	137	15,853	情報技術		
PERRIGO CO PLC	19.29	—	—	—	ヘルスケア		
EVERSOURCE ENERGY	42.9	42.9	381	44,033	公益事業		
INTUIT INC	34.01	32.63	1,860	214,593	情報技術		
BORGWARNER INC	30.81	30.81	148	17,075	一般消費財・サービス		
BEST BUY CO INC	29.87	29.87	306	35,399	一般消費財・サービス		
BALL CORP	38.6	38.6	347	40,042	素材		
BOSTON SCIENTIFIC CORP	184.24	171.49	727	83,885	ヘルスケア		
ELECTRONIC ARTS INC	36.77	36.77	473	54,667	コミュニケーション・サービス		
VULCAN MATERIALS CO	16.06	16.06	321	37,062	素材		
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	32.07	32.07	718	82,841	ヘルスケア		
VF CORP	42.16	42.16	299	34,544	一般消費財・サービス		
VIACOMCBS INC - CLASS B	72.02	72.02	251	28,998	コミュニケーション・サービス		
MOHAWK INDUSTRIES INC	9.42	6.28	108	12,491	一般消費財・サービス		
NUANCE COMMUNICATIONS INC	—	37	203	23,522	情報技術		
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10.03	—	—	—	その他		
CARNIVAL CORP	49.92	99.86	213	24,648	一般消費財・サービス		
COMCAST CORP-CLASS A	574.77	548.2	2,769	319,434	コミュニケーション・サービス		
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	21	—	—	—	その他		
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	36	16	92	10,614	資本財・サービス		
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	231	231	125	14,467	不動産		
アメリカ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	39,340.65 591銘柄	38,364.27 606銘柄	496,046 57,213,958	<69.2%>		
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円			
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	—	100.13	508	46,328	生活必需品		
IMPERIAL OIL LTD	23	23	112	10,216	エネルギー		

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	
			千円	千円			
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2.5	2.5	541	49,283	情報技術		
RESTAURANT BRANDS INTERN	37.21	37.21	274	25,004	一般消費財・サービス		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	63	63	314	28,604	素材		
INTACT FINANCIAL CORP	17	23.79	391	35,632	金融		
BCE INC	9	9	59	5,387	コミュニケーション・サービス		
FRANCO-NEVADA CORP	22	22	366	33,398	素材		
SUNCOR ENERGY INC	218.12	173.48	584	53,263	エネルギー		
METRO INC/CN	30	30	201	18,328	生活必需品		
NATIONAL BANK OF CANADA	39.41	39.41	389	35,456	金融		
BANK OF NOVA SCOTIA	150.75	150.75	1,370	124,849	金融		
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	57	57	895	81,538	金融		
TORONTO-DOMINION BANK	230.3	217.6	2,170	197,654	金融		
GREAT-WEST LIFE CO INC	39	39	148	13,544	金融		
ROYAL BANK OF CANADA	182.32	170.86	2,435	221,804	金融		
TOURMALINE OIL CORP	—	39	168	15,355	エネルギー		
TC ENERGY CORP	113.04	121.44	757	69,008	エネルギー		
PEMBINA PIPELINE CORP	63.75	63.75	250	22,807	エネルギー		
BARRICK GOLD CORP	218.48	218.48	515	46,942	素材		
CAE INC	23	23	73	6,711	資本財・サービス		
THOMSON REUTERS CORP	22.84	22.84	321	29,279	資本財・サービス		
EMPIRE CO LTD 'A'	18	18	69	6,302	生活必需品		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	10.34	120	11,007	素材		
BALLARD POWER SYSTEMS INC	—	32.06	45	4,120	資本財・サービス		
CCL INDUSTRIES INC - CL B	15.6	15.6	102	9,292	素材		
HYDRO ONE LTD	48	48	151	13,797	公益事業		
LOBLAW COMPANIES LTD	24.89	24.89	252	23,030	生活必需品		
NORTHLAND POWER INC	—	30.03	107	9,753	公益事業		
WSP GLOBAL INC	12	12	207	18,873	資本財・サービス		
TOROMONT INDUSTRIES LTD	—	9.74	106	9,745	資本財・サービス		
PARKLAND CORP	28	28	98	8,953	エネルギー		
QUEBECOR INC -CL B	23	23	67	6,163	コミュニケーション・サービス		
EMERA INC	27.31	27.31	165	15,091	公益事業		
TFI INTERNATIONAL INC	—	11	137	12,545	資本財・サービス		
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	10	35	3,226	公益事業		
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	56	43.06	266	24,229	コミュニケーション・サービス		
IVANHOE MINES LTD-CL A	—	142.61	158	14,469	素材		
AGNICO EAGLE MINES LTD	29	29	189	17,266	素材		
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	70	70	124	11,316	公益事業		
B2GOLD CORP	164	—	—	—	素材		
AIR CANADA	17	17	38	3,480	資本財・サービス		
KINROSS GOLD CORP	147.57	147.57	103	9,462	素材		
BANK OF MONTREAL	82	78.55	1,123	102,342	金融		
POWER CORP OF CANADA	63	63	265	24,185	金融		
SHOPIFY INC - CLASS A	14.44	13.56	1,944	177,091	情報技術		
NUTRIEN LTD	80.27	69.06	600	54,685	素材		
CANOPY GROWTH CORP	20	20	22	2,021	ヘルスケア		
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	31.93	31.93	164	14,971	素材		
TOPICUS.COM INC-SUB VOTING	4.64	—	—	—	情報技術		
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	—	15.32	66	6,073	公益事業		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円			
CAMECO CORP	28	28	82	7,510			エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	4.22	4.22	92	8,401			不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	-	24.05	105	9,589			資本財・サービス
LIGHTSPEED COMMERCE INC	-	15.6	71	6,494			情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTC	-	10	79	7,236			情報技術
TELUS CORP	6	6	17	1,611			コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	44	44	173	15,837			素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	7.43	7.43	135	12,304			一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	152	152	906	82,580			エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3	3	189	17,243			金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	31	36.93	399	36,387			一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	9.01	9.01	128	11,741			生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	43.08	12.18	35	3,233			素材
BLACKBERRY LTD	64	64	71	6,522			情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	72.66	72.66	515	46,920			金融
ENBRIDGE INC	267	246.95	1,275	116,127			エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	180	172.13	1,236	112,612			金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	266	221.84	568	51,785			金融
BAUSCH HEALTH COS INC	43	43	143	13,100			ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	18	114.36	1,098	100,086			資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	11	11	85	7,742			金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	28	28	147	13,434			一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	87.93	87.93	1,366	124,422			資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	28	28	295	26,912			情報技術
ONEX CORPORATION	16	16	153	13,998			金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	68	68	259	23,627			コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	3	3	13	1,274			金融
TMX GROUP LTD	7.94	7.94	98	8,961			金融
OPEN TEXT CORP	45	32.1	187	17,071			情報技術
CI FINANCIAL CORP	20	-	-	-			金融
SAPUTO INC	29	29	86	7,879			生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63	63	195	17,787			素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	100.13	-	-	-			生活必需品
YAMANA GOLD INC	119	-	-	-			素材
FORTIS INC	62	62	366	33,418			公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	13.55	13.55	103	9,441			資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	66	66	65	5,993			素材
CENOVUS ENERGY INC	141	141	242	22,114			エネルギー
DOLLARAMA INC	35.29	35.29	218	19,863			一般消費財・サービス
ATCO LTD - CLASS I	8	-	-	-			公益事業
ALTAGAS LTD	47	47	125	11,459			公益事業
KEYERA CORP	22	22	63	5,790			エネルギー
INTER PIPELINE LTD	48	-	-	-			エネルギー
カナダ・ドル 通貨計	4,855.61 銘柄数<比率>	4,736.04 87銘柄	30,988 ---	2,822,425 < 3.4%>			
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円			
MEDIBANK PRIVATE LTD	228.24	228.24	81	6,719			金融
BHP GROUP LTD	365.48	365.48	1,636	135,724			素材
SOUTH32 LTD	563.87	563.87	228	18,985			素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	156.53	105.76	245	20,374			エネルギー

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円			
FORTESCUE METALS GROUP LTD	205.54	205.54	424	35,181			素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	421.03	419.83	1,233	102,325			金融
WESTPAC BANKING CORP	442.7	442.7	966	80,144			金融
SANTOS LTD	182.7	291.53	199	16,536			エネルギー
AUSNET SERVICES	285	285	72	6,050			公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	351.9	351.9	998	82,792			金融
RIO TINTO LTD	41.69	41.69	441	36,644			素材
ORIGIN ENERGY LTD	209.68	209.68	115	9,581			公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD	290.47	290.47	105	8,768			資本財・サービス
XERO LTD	6.32	14.26	181	15,045			情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	9.53	9.53	28	2,376			エネルギー
COLES GROUP LTD	166.96	166.96	285	23,635			生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	25.09	25.09	136	11,325			情報技術
IDP EDUCATION LTD	-	26.19	85	7,121			一般消費財・サービス
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	81.83	148.32	132	10,971			素材
EVOLUTION MINING LTD	170.17	170.17	63	5,306			素材
AFTERPAY LTD	30	30	216	17,985			情報技術
TPG TELECOM LTD	50	-	-	-			コミュニケーション・サービス
REECE LTD	-	63.58	169	14,035			資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRAU	-	139.06	91	7,622			生活必需品
OIL SEARCH LTD	173.45	-	-	-			エネルギー
SEEK LTD	26	26	79	6,587			コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	101.73	101.73	126	10,461			生活必需品
NEWCREST MINING LTD	119.81	119.81	287	23,855			素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	218.56	218.56	2,258	187,269			金融
AMPOL LTD	20	20	60	4,977			エネルギー
ORICA LTD	58.45	58.45	78	6,514			素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	153.48	153.48	186	15,502			金融
CIMIC GROUP LTD	10	-	-	-			資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	169.8	157.79	585	48,547			生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	26	-	-	-			その他
TABCORP HOLDINGS LTD	173.52	173.52	88	7,338			一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	30	30	35	2,910			一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	63.73	63.73	32	2,700			資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	351.14	351.14	145	12,055			コミュニケーション・サービス
AMP LTD	249.35	-	-	-			金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	67.33	58.26	296	24,587			素材
MACQUARIE GROUP LTD	42.77	42.77	889	73,768			金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	61.63	64.62	283	23,536			一般消費財・サービス
CSL LTD	55.5	55.5	1,554	128,873			ヘルスケア
WESFARMERS LTD	137.98	137.98	788	65,360			一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	8.05	8.05	167	13,852			ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	70.92	70.92	153	12,697			素材
SUNCORP GROUP LTD	145.04	145.04	167	13,904			金融
ASX LTD	22.6	22.6	204	16,956			金融
COMPUTERSHARE LTD	60.54	60.54	126	10,493			情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	270.97	120	9,977			金融
SONIC HEALTHCARE LTD	52.23	52.23	231	19,209			ヘルスケア
AGL ENERGY LTD	84.66	-	-	-			公益事業

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
BRAMBLES LTD	183.37	183.37	193	16,043	資本財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20.64	20.64	138	11,511	ヘルスケア
REA GROUP LTD	6.08	6.08	96	7,999	コミュニケーション・サービス
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15.51	15.51	31	2,648	金融
DOMINOS PIZZA ENTERPRISES L	—	12.88	145	12,061	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル 通貨計	7,535.57 株数、金額 銘柄数<比率>	7,297.02 株数、金額 銘柄数<比率>	17,695	1,467,459	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	235	235	1,144	16,926	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	230	230	932	13,793	一般消費財・サービス
MTR CORP	165	165	705	10,432	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	190	160	1,520	22,480	不動産
SINO LAND CO	340	340	331	4,902	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	375.52	375.52	2,029	30,019	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	80	80	367	5,430	不動産
CLP HOLDINGS LTD	170	170	1,323	19,573	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	205.65	205.65	678	10,037	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,638.36	1,720.27	2,081	30,785	公益事業
HANG SENG BANK LTD	80	80	1,236	18,292	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT	175	175	529	7,829	不動産
WH GROUP LTD	1,695	1,695	889	13,161	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	149	149	6,827	100,973	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	370	370	596	8,821	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	30	—	—	—	情報技術
BANK OF EAST ASIA LTD	86	—	—	—	金融
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	—	260	494	7,306	資本財・サービス
SJM HOLDINGS LTD	100	—	—	—	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	80	80	162	2,407	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	285.52	285.52	1,413	20,903	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	55	268	3,973	公益事業
PCCW LTD	600	—	—	—	コミュニケーション・サービス
AIA GROUP LTD	1,594	1,500	12,000	177,480	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	—	220	642	9,501	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	200	200	775	11,462	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	192	192	403	5,963	生活必需品
ESR CAYMAN LTD	180	180	481	7,121	不動産
SANDS CHINA LTD	290	290	500	7,402	一般消費財・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	—	350	446	6,605	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	190	170	2,363	34,948	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	450	450	1,291	19,101	金融
WYNN MACAU LTD	168	—	—	—	一般消費財・サービス
香港ドル 通貨計	10,599.05 株数、金額 銘柄数<比率>	10,382.96 株数、金額 銘柄数<比率>	42,436	627,638	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
CAPITALAND INVESTMENT LTD	—	334	118	10,121	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD	179	159	463	39,465	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	233	213	746	63,583	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	177.5	177.5	88	7,569	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	173	173	88	7,495	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	30	30	21	1,792	不動産

銘柄	期首		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	52	35	3,023	不動産
CAPITALAND LTD	334	—	—	—	不動産
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	447	447	540	46,038	金融
GENTING SINGAPORE LTD	450	450	34	2,949	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	32	32	57	4,902	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,284	1,284	299	25,465	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	141	52	4,488	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	168	118	113	9,692	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	158	67	5,783	生活必需品
シンガポール・ドル 通貨計	3,858.5 株数、金額 銘柄数<比率>	3,768.5 株数、金額 銘柄数<比率>	2,729	232,372	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	150	150	69	5,411	公益事業
MERCURY NZ LTD	32.94	32.94	20	1,584	公益事業
A2 MILK CO LTD	70	—	—	—	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	168.6	168.6	75	5,885	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	132.89	132.89	101	7,938	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	92	92	295	23,075	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	44.19	44.19	52	4,127	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル 通貨計	690.62 株数、金額 銘柄数<比率>	620.62 株数、金額 銘柄数<比率>	614	48,023	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BP PLC	2,510.81	2,510.81	911	142,776	エネルギー
UNILEVER PLC	337.93	314.26	1,246	195,241	生活必需品
BARCLAYS PLC	2,413.6	2,037.15	423	66,336	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	768.95	1,031.03	131	20,615	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	314.21	314.21	407	63,782	金融
NATWEST GROUP PLC	508.36	823.39	203	31,854	金融
EVRAZ PLC	74.41	74.41	44	6,929	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	17.58	17.58	36	5,653	素材
BAE SYSTEMS PLC	377.96	377.96	216	33,862	資本財・サービス
AVIVA PLC	510.81	510.81	221	34,715	金融
AVEVA GROUP PLC	11.4	11.4	34	5,387	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC	629.03	605.42	975	152,804	ヘルスケア
INFORMA PLC	162	162	87	13,661	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	643.35	579.01	98	15,381	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	144.99	144.99	100	15,787	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	9.38	9.38	57	9,041	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	62.34	62.34	96	15,110	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7.4	7.4	105	16,476	資本財・サービス
HALMA PLC	39.78	39.78	112	17,589	情報技術
ENTAIN PLC	88.05	73.37	122	19,151	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	64.11	320.55	68	10,684	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	108.88	72	11,419	金融
M&G PLC	259.64	259.64	53	8,430	金融
RELX PLC	242.03	242.03	529	82,945	資本財・サービス
DIAGEO PLC	293.51	279.1	1,074	168,238	生活必需品
RIO TINTO PLC	145.2	136.27	708	111,031	素材

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
STANDARD CHARTERED PLC	319.51	319.51	157	24,647	金融		
TESCO PLC	1,344.91	867.91	253	39,755	生活必需品		
FRESNILLO PLC	39.07	—	—	—	素材		
SMITH & NEPHEW PLC	112.97	112.97	149	23,365	ヘルスケア		
GLENCORE PLC	1,292.26	1,292.26	502	78,726	素材		
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	32	44	6,971	金融		
SMITHS GROUP PLC	40.8	40.8	64	10,180	資本財・サービス		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	168.79	—	—	—	金融		
PEARSON PLC	82.71	82.71	49	7,744	コミュニケーション・サービス		
SAINSBURY (J) PLC	176.31	176.31	49	7,707	生活必需品		
NEXT PLC	16.85	16.85	128	20,200	一般消費財・サービス		
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	322.36	53	8,429	一般消費財・サービス		
WHITBREAD PLC	17.85	17.85	56	8,840	一般消費財・サービス		
BUNZL PLC	31.59	31.59	85	13,339	資本財・サービス		
VODAFONE GROUP PLC	3,591.29	3,635.21	426	66,879	コミュニケーション・サービス		
CRODA INTERNATIONAL PLC	17.49	17.49	158	24,748	素材		
KINGFISHER PLC	172.29	172.29	58	9,164	一般消費財・サービス		
WPP PLC	130.21	130.21	150	23,555	コミュニケーション・サービス		
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	82.44	86	13,622	公益事業		
SEVERN TRENT PLC	43	33.27	95	14,914	公益事業		
RENTOKIL INITIAL PLC	222.42	222.42	118	18,533	資本財・サービス		
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	91.11	86.77	548	85,907	生活必需品		
ST JAMES'S PLACE PLC	48.83	48.83	80	12,623	金融		
SCHRODERS PLC	12.27	12.27	43	6,759	金融		
SSE PLC	124.6	124.6	204	31,977	公益事業		
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	123.68	86	13,552	一般消費財・サービス		
ASTRAZENECA PLC	166.08	186.18	1,551	243,030	ヘルスケア		
FERGUSON PLC	27.24	27.24	336	52,713	資本財・サービス		
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	682.32	682.32	208	32,638	金融		
3I GROUP PLC	132.93	132.93	187	29,440	金融		
ASHTREAD GROUP PLC	59.21	59.21	337	52,862	資本財・サービス		
SAGE GROUP PLC/THE	115.48	115.48	93	14,600	情報技術		
NATIONAL GRID PLC	451.05	451.05	475	74,420	公益事業		
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,652.13	8,652.13	456	71,567	金融		
RSA INSURANCE GROUP LTD	125.86	—	—	—	その他		
IMPERIAL BRANDS PLC	137.85	108.06	179	28,163	生活必需品		
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	19.63	18.12	83	13,027	一般消費財・サービス		
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	286.95	258.15	740	116,005	生活必需品		
BHP GROUP PLC	269.34	269.34	608	95,384	素材		
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	49.64	49.64	103	16,180	生活必需品		
HSBC HOLDINGS PLC	2,560.05	2,448.46	1,204	188,683	金融		
ANGLO AMERICAN PLC	146.45	168.85	547	85,741	素材		
MONDI PLC	59.21	59.21	110	17,333	素材		
WM MORRISON SUPERMARKETS	391.67	—	—	—	生活必需品		
COMPASS GROUP PLC	219.92	219.92	373	58,523	一般消費財・サービス		
PERSIMMON PLC	49.69	26.88	71	11,157	一般消費財・サービス		
BT GROUP PLC	1,317.54	1,027.57	182	28,616	コミュニケーション・サービス		
COCA-COLA HBC AG-DI	25.74	25.74	68	10,768	生活必需品		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
BURBERRY GROUP PLC	51.36	51.36	89	14,037	一般消費財・サービス		
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	21.82	22.68	111	17,527	一般消費財・サービス		
INTERTEK GROUP PLC	18.97	18.97	104	16,330	資本財・サービス		
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	37.5	37.5	268	42,125	金融		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	495.26	518.12	896	140,443	エネルギー		
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	482.46	446.23	772	120,970	エネルギー		
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	20.39	20.39	42	6,716	ヘルスケア		
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	15.7	48	7,571	金融		
ANTOFAGASTA PLC	34.6	34.6	46	7,291	素材		
ABRDN PLC	330.46	330.46	79	12,494	金融		
EXPERIAN PLC	121.19	113.47	366	57,388	資本財・サービス		
イギリス・ポンド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	36,870.13 35,651.73	22,542	3,530,810			
(イスラエル)	株数	株数	千イスラエル・ シケル	千円			
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	120	120	261	9,621	金融		
AZRIELI GROUP LTD	5.3	5.3	154	5,678	不動産		
ICL GROUP LTD	110.96	110.96	361	13,280	素材		
ELBIT SYSTEMS LTD	3	3	163	6,007	資本財・サービス		
BANK HAPOALIM BM	151.6	151.6	507	18,679	金融		
BANK LEUMI LE-ISRAEL	190.43	190.43	648	23,856	金融		
NICE LTD	8	8	679	24,981	情報技術		
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	38.83	18.83	234	8,608	金融		
イスラエル・シケル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	628.12 608.12	3,010	110,715			
(スイス)	株数	株数	千スイス・フラン	千円			
UBS GROUP AG-REG	464.78	425.54	756	94,160	金融		
ROCHE HOLDING AG-BR	—	2.8	112	13,973	ヘルスケア		
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1.3	1.3	125	15,571	素材		
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	17.54	83	10,414	資本財・サービス		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	88.76	83.88	3,113	387,490	ヘルスケア		
SIKA AG-REG	16.9	16.9	575	71,572	素材		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	0.01	113	14,137	生活必需品		
ABB LTD-REG	221.39	210.74	712	88,645	資本財・サービス		
SWISS RE AG	36.66	36.66	348	43,342	金融		
NESTLE SA-REG	360.55	342.92	4,180	520,225	生活必需品		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2.34	2.87	380	47,343	金融		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5.31	4.89	114	14,228	資本財・サービス		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	301.22	301.22	283	35,245	金融		
JULIUS BAER GROUP LTD	26.84	26.84	166	20,776	金融		
SGS SA-REG	0.65	0.65	189	23,580	資本財・サービス		
SCHINDLER HOLDING AG-REG	4.67	4.67	108	13,448	資本財・サービス		
VIFOR PHARMA AG	6.65	6.65	109	13,572	ヘルスケア		
TEMENOS AG - REG	7.93	7.93	92	11,566	情報技術		
VAT GROUP AG	—	3.39	134	16,731	資本財・サービス		
ALCON INC	58.53	58.53	417	51,979	ヘルスケア		
SWATCH GROUP AG/THE-BR	5	5	147	18,399	一般消費財・サービス		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	17.92	17.92	758	94,424	金融		
BALOISE HOLDING AG - REG	6.11	6.11	97	12,074	金融		
CLARIANT AG-REG	15.68	15.68	29	3,722	素材		
NOVARTIS AG-REG	278.51	269.42	2,219	276,248	ヘルスケア		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.56	0.56	122	15,262	生活必需品		



外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
BACHEM HOLDING AG-REG B	—	0.78	43	5,426	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	67.1	60.87	807	100,523	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	2.76	2.76	143	17,847	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	7.84	—	—	—	金融
GEBERIT AG-REG	4.56	4.56	312	38,873	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	1.13	1.13	497	61,946	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1.11	1.11	186	23,221	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	6.72	6.72	216	26,970	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	21.65	21.65	160	20,024	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	9.13	9.13	618	76,968	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	4.5	25	3,183	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD	65.87	65.87	320	39,930	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3.81	3.81	226	28,136	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	6.4	6.4	174	21,704	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	9.46	82	10,254	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.17	0.14	162	20,210	生活必需品
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,158.02 39銘柄	2,069.51 41銘柄	19,472 2,423,357	< 2.9%>
<b>(デンマーク)</b>	百株	百株	千円	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	236.71	213.44	13,986	245,746	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	72.36	72.36	870	15,294	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0.39	0.39	841	14,787	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	5	—	—	—	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	25.57	127.85	2,305	40,501	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S	11.59	11.59	436	7,662	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B	12.32	12.32	1,402	24,644	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	29.81	29.81	1,449	25,475	素材
COLOPLAST-B	15.19	15.19	1,557	27,369	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	27.98	25.8	3,560	62,556	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	1.43	1.43	369	6,499	資本財・サービス
DEMANT A/S	13.14	13.14	424	7,459	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.66	0.66	1,537	27,019	資本財・サービス
TRYG A/S	17	45.94	751	13,197	金融
PANDORA A/S	16.37	13.25	1,023	17,977	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	12.62	12.62	642	11,281	素材
GENMAB A/S	9.19	9.19	2,170	38,138	ヘルスケア
ORSTED A/S	28.37	22.46	1,657	29,123	公益事業
AMBU A/S-B	20.91	20.91	318	5,593	ヘルスケア
デンマーク・クローネ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	556.61 19銘柄	648.35 18銘柄	35,306 620,328	< 0.8%>
<b>(ノルウェー)</b>	百株	百株	千円	千円	
DNB BANK	—	128.38	2,688	34,974	金融
NORSK HYDRO ASA	130.5	130.5	910	11,850	素材
DNB	128.38	—	—	—	金融
ORKLA ASA	74.83	74.83	648	8,432	生活必需品
TELENOR ASA	87.46	87.46	1,232	16,038	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	142.48	122.6	2,987	38,870	エネルギー
SCHIBSTED ASA-CL A	—	9.17	285	3,710	コミュニケーション・サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	27.56	27.56	1,242	16,170	素材

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
MOWI ASA	46.77	46.77	939	12,224	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	20	435	5,669	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	17	17	475	6,188	コミュニケーション・サービス
AKER BP ASA	—	13.55	378	4,927	エネルギー
ADEVINTA ASA	45.82	45.82	509	6,631	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	720.8 10銘柄	723.64 12銘柄	12,735 165,689	< 0.2%>
<b>(スウェーデン)</b>	百株	百株	千円	千円	
SAGAX CLASS B	—	20.2	537	6,812	不動産
INVESTOR CLASS A	—	62.56	1,415	17,929	金融
ICA GRUPPEN AB	26	12.97	696	8,827	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	445.95	384.64	3,896	49,367	情報技術
VOLVO AB-B SHS	188.73	188.73	4,030	51,064	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES	40	40	885	11,220	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	26	26	553	7,013	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	21.88	21.88	1,619	20,514	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	70.26	70.26	890	11,278	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS	—	28.69	996	12,628	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	217.79	217.79	2,757	34,933	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	241.45	154.82	1,563	19,811	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	108.21	108.21	1,985	25,158	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	103.52	103.52	1,831	23,210	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	82.01	82.01	1,324	16,780	素材
SKANSKA AB-B SHS	37.09	37.09	864	10,949	資本財・サービス
SANDVIK AB	146.57	146.57	3,664	46,426	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	62.9	219.28	4,797	60,788	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	85.75	85.75	5,036	63,818	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS	—	39.23	845	10,706	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	25	25	306	3,878	資本財・サービス
TELIA CO AB	364.21	364.21	1,302	16,508	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	48.4	48.4	1,637	20,751	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	48.13	48.13	2,414	30,587	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	144.49	126.35	3,352	42,470	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	29	16.38	476	6,030	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHS	19	13.19	772	9,789	不動産
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	9.48	458	5,814	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	9.24	9.24	300	3,804	資本財・サービス
LIFCO AB-B SHS	—	29.24	652	8,268	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	41.79	167.16	1,834	23,244	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB	19	19	647	8,208	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	72.6	72.6	2,090	26,482	生活必需品
EMBRACER GROUP AB	—	70.9	619	7,847	コミュニケーション・サービス
BOLIDEN AB	31.71	31.71	1,156	14,652	素材
EPIROC AB-A	121.82	86.6	1,909	24,193	資本財・サービス
EPIROC AB-B	40.15	40.15	739	9,372	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS	114	54	742	9,407	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP	435.48	406.44	4,582	58,056	金融
EQT AB	38.45	29.6	1,267	16,062	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
EVOLUTION AB	20.64	20.64	2,384	30,209	千ユーロ	千円	一般消費財・サービス
SINCH AB	-	64	638	8,089	千ユーロ	千円	情報技術
KINNEVIK AB - B	36.41	36.41	1,040	13,179	千ユーロ	千円	金融
HEXAGON AB-B SHS	38.68	270.76	3,542	44,888	千ユーロ	千円	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13	13	371	4,707	千ユーロ	千円	金融
スウェーデン・クロス 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,624.79 38銘柄	4,319.71 45銘柄	75,434	955,749	< 1.2% >	
ユーロ (アイルランド)	株数	株数	千ユーロ	千円			
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	30.55	30.55	149	19,597	千ユーロ	千円	素材
KINGSPAN GROUP PLC	16	20.88	200	26,204	千ユーロ	千円	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A	18.22	18.22	211	27,635	千ユーロ	千円	生活必需品
CRH PLC	105.17	92	425	55,612	千ユーロ	千円	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	22.04	17.85	238	31,215	千ユーロ	千円	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	191.98 5銘柄	179.5 5銘柄	1,226	160,265	< 0.2% >	
ユーロ (オランダ)	株数	株数	千ユーロ	千円			
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	-	89.3	205	26,896	千ユーロ	千円	コミュニケーション・サービス
QIAGEN N.V.	25.21	25.21	110	14,418	千ユーロ	千円	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	114.2	114.2	380	49,718	千ユーロ	千円	ヘルスケア
NN GROUP NV	31	31	155	20,339	千ユーロ	千円	金融
HEINEKEN NV	37.11	31.23	315	41,205	千ユーロ	千円	生活必需品
AEGON NV	380.61	179.67	87	11,433	千ユーロ	千円	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	138.93	121.3	370	48,401	千ユーロ	千円	生活必需品
AKZO NOBEL N.V.	25.04	25.04	240	31,385	千ユーロ	千円	素材
KONINKLIJKE DSM NV	22.3	22.3	404	52,871	千ユーロ	千円	素材
WOLTERS KLUWER	33	33	314	41,069	千ユーロ	千円	資本財・サービス
ING GROEP NV	456.01	456.01	596	77,993	千ユーロ	千円	金融
KONINKLIJKE KPN NV	376.07	376.07	103	13,566	千ユーロ	千円	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV	53.27	49.16	3,059	399,840	千ユーロ	千円	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA	90.53	40.3	56	7,394	千ユーロ	千円	金融
IMCD NV	-	7.15	115	15,106	千ユーロ	千円	資本財・サービス
ADYEN NV	2.15	2.25	442	57,803	千ユーロ	千円	情報技術
JUST EAT TAKEAWAY	14	23.81	100	13,179	千ユーロ	千円	一般消費財・サービス
PROSUS NV	59.99	112.99	797	104,290	千ユーロ	千円	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV	-	14.76	40	5,330	千ユーロ	千円	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV	-	6.02	204	26,783	千ユーロ	千円	情報技術
VOPAK	6.3	-	-	-	千ユーロ	千円	エネルギー
RANDSTAD NV	20.2	20.2	121	15,935	千ユーロ	千円	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	12.85	12.85	106	13,872	千ユーロ	千円	生活必需品
ALTICE EUROPE NV	112.95	-	-	-	千ユーロ	千円	その他
EURONEXT NV	-	15	127	16,683	千ユーロ	千円	金融
STMICROELECTRONICS NV	85.75	85.75	363	47,553	千ユーロ	千円	情報技術
AIRBUS SE	74.02	69.81	823	107,592	千ユーロ	千円	資本財・サービス
ARGENX SE	5.16	5.16	137	17,939	千ユーロ	千円	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	85	85	102	13,448	千ユーロ	千円	生活必需品
EXOR NV	10.88	10.88	81	10,702	千ユーロ	千円	金融
CNH INDUSTRIAL NV	116.91	116.91	163	21,361	千ユーロ	千円	資本財・サービス
STELLANTIS NV	169.37	248.03	443	57,910	千ユーロ	千円	一般消費財・サービス
FERRARI NV	17.22	17.22	380	49,739	千ユーロ	千円	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,576.03 28銘柄	2,447.58 31銘柄	10,954	1,431,766	< 1.7% >	

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	
			千ユーロ	千円			
ユーロ (ベルギー)	株数	株数	千ユーロ	千円			
GALAPAGOS NV	5.57	-	-	-	千ユーロ	千円	ヘルスケア
UCB SA	19.21	19.21	178	23,395	千ユーロ	千円	ヘルスケア
KBC GROUP NV	30.11	30.11	240	31,467	千ユーロ	千円	金融
COLRUYT SA	3.5	3.5	13	1,722	千ユーロ	千円	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11.39	11.39	111	14,541	千ユーロ	千円	金融
SOLVAY SA	8.73	8.73	92	12,077	千ユーロ	千円	素材
UMICORE	22.7	22.7	80	10,562	千ユーロ	千円	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	98.76	89.26	506	66,182	千ユーロ	千円	生活必需品
AGEAS	16.54	16.54	81	10,631	千ユーロ	千円	金融
PROXIMUS	22.69	22.69	39	5,149	千ユーロ	千円	コミュニケーション・サービス
ELIA GROUP SA/NV	7	7	77	10,109	千ユーロ	千円	公益事業
SOFINA	2.39	2.39	95	12,519	千ユーロ	千円	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	248.59 12銘柄	233.52 11銘柄	1,517	198,359	< 0.2% >	
ユーロ (ルクセンブルグ)	株数	株数	千ユーロ	千円			
AROUNDTOWN SA	160.64	160.64	87	11,413	千ユーロ	千円	不動産
ARCELORMITTAL	80.31	80.31	242	31,688	千ユーロ	千円	素材
INPOST SA	-	31.82	26	3,433	千ユーロ	千円	資本財・サービス
EUROFINS SCIENTIFIC	14.8	14.8	139	18,213	千ユーロ	千円	ヘルスケア
SES	44.02	-	-	-	千ユーロ	千円	コミュニケーション・サービス
TENARIS SA	47	47	45	5,988	千ユーロ	千円	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	346.77 5銘柄	334.57 5銘柄	541	70,737	< 0.1% >	
ユーロ (フランス)	株数	株数	千ユーロ	千円			
TOTALENERGIES SE	307.62	299.62	1,400	183,035	千ユーロ	千円	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	21.46	21.46	327	42,773	千ユーロ	千円	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	61.19	57.59	898	117,481	千ユーロ	千円	素材
KERING	9.77	8.88	616	80,558	千ユーロ	千円	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	67.45	63.38	1,018	133,120	千ユーロ	千円	資本財・サービス
BOUYGUES SA	27.21	27.21	87	11,487	千ユーロ	千円	資本財・サービス
BNP PARIBAS	134	134	857	112,088	千ユーロ	千円	金融
PEUGEOT SA	64.97	-	-	-	千ユーロ	千円	その他
NATIXIS	76.74	-	-	-	千ユーロ	千円	金融
THALES SA	14.04	14.04	110	14,456	千ユーロ	千円	資本財・サービス
DANONE	75.51	75.51	429	56,155	千ユーロ	千円	生活必需品
CARREFOUR SA	80.22	80.22	141	18,526	千ユーロ	千円	生活必需品
SUEZ	29.5	29.5	58	7,665	千ユーロ	千円	公益事業
VIVENDI	104.3	89.3	105	13,760	千ユーロ	千円	コミュニケーション・サービス
L'OREAL	32.05	29.56	1,166	152,472	千ユーロ	千円	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	69.75	69.75	443	57,979	千ユーロ	千円	資本財・サービス
LEGRAND SA	41.19	34.59	340	44,449	千ユーロ	千円	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA	27.44	25.44	519	67,963	千ユーロ	千円	生活必需品
EURAZEO SE	5.6	5.6	43	5,665	千ユーロ	千円	金融
SOCIETE GENERALE SA	110.65	110.65	365	47,746	千ユーロ	千円	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	34.42	33.37	2,344	306,479	千ユーロ	千円	一般消費財・サービス
ACCOR SA	18.5	18.5	56	7,437	千ユーロ	千円	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	19.81	19.81	385	50,346	千ユーロ	千円	情報技術
VALEO SA	37.03	37.03	99	12,990	千ユーロ	千円	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	29.18	29.18	173	22,684	千ユーロ	千円	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA	32.27	32.27	88	11,569	千ユーロ	千円	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
EIFFAGE	9.45	9.45	86	11,321	資本財・サービス	
SODEXO SA	12.48	12.48	100	13,156	一般消費財・サービス	
IPSEN	2.76	2.76	22	2,958	ヘルスケア	
ORPEA	5.24	5.24	45	5,969	ヘルスケア	
AMUNDI SA	4.37	4.37	31	4,120	金融	
TELEPERFORMANCE	8.7	7.01	254	33,322	資本財・サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT	9.77	9.77	41	5,460	コミュニケーション・サービス	
FAURECIA	5.6	10.41	45	5,974	一般消費財・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3.99	3.99	157	20,567	ヘルスケア	
SEB SA	1.97	2.16	29	3,856	一般消費財・サービス	
ESSILORLUXOTTICA	38.09	35.06	611	79,897	一般消費財・サービス	
DASSAULT AVIATION SA	0.22	2.2	22	2,990	資本財・サービス	
WORLDLINE SA	31.35	31.35	152	19,958	情報技術	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	22.16	8.78	33	4,414	一般消費財・サービス	
AXA SA	243.18	243.18	666	87,103	金融	
EDENRED	30.07	30.07	129	16,946	情報技術	
RENAULT SA	25.54	25.54	86	11,357	一般消費財・サービス	
HERMES INTERNATIONAL	4.51	4.05	556	72,730	一般消費財・サービス	
REMY COINTREAU	2.53	2.53	50	6,613	生活必需品	
ATOS SE	9.46	-	-	-	情報技術	
DASSAULT SYSTEMES SE	16.33	81.65	380	49,708	情報技術	
WENDEL	2.01	5.55	57	7,580	金融	
ORANGE	257.92	257.92	248	32,459	コミュニケーション・サービス	
ALSTOM	29.61	51.06	168	22,069	資本財・サービス	
CNP ASSURANCES	13.49	13.49	29	3,840	金融	
SANOFI	142.91	133.26	1,184	154,750	ヘルスケア	
VINCI SA	69.25	64.38	607	79,398	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	73.51	73.51	237	31,100	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA	146.09	146.09	197	25,830	金融	
BIOMERIEUX	4.57	4.57	48	6,382	ヘルスケア	
ENGIE	210.99	210.99	281	36,770	公益事業	
EDF	67.6	67.6	68	8,985	公益事業	
SAFRAN SA	43.81	39.31	442	57,872	資本財・サービス	
ILIAD SA	2.19	-	-	-	コミュニケーション・サービス	
ARKEMA	8.38	8.38	107	14,112	素材	
ADP	3.5	3.5	42	5,610	資本財・サービス	
SCOR SE	32.89	-	-	-	金融	
GETLINK SE	49.73	49.73	71	9,346	資本財・サービス	
BOLLORE	73	73	35	4,594	コミュニケーション・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,251.09 65銘柄	3,080.85 60銘柄	19,418 < 3.1%>	2,538,026	
ユーロ (ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	-	50.55	169	22,126	資本財・サービス	
BAYER AG-REG	125.53	115.83	579	75,755	ヘルスケア	
EVONIK INDUSTRIES AG	18	18	51	6,770	素材	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	255.58	255.58	316	41,334	金融	
COMMERZBANK AG	96.89	96.89	74	9,747	金融	
VOLKSWAGEN AG	4.2	4.2	113	14,854	一般消費財・サービス	

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
VOLKSWAGEN AG-PREF	22.72	22.72	426	55,755	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	94.65	90.95	1,344	175,787	資本財・サービス
E.ON SE	300.06	300.06	354	46,363	公益事業
UNIPER SE	20.66	20.66	84	10,984	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	37.29	37.29	362	47,373	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	13	13	58	7,594	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	14.74	14.74	141	18,523	一般消費財・サービス
BASF SE	112.83	112.83	745	97,462	素材
ALLIANZ SE-REG	53.92	50.14	1,120	146,400	金融
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	26.83	21.41	161	21,138	生活必需品
RWE AG	75.26	75.26	260	34,063	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	17	17	12	1,614	資本財・サービス
BRENNTAG SE	21.21	21.21	160	20,935	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	48.35	48.35	176	23,100	ヘルスケア
UNICOM INTERNET AG-REG SHARE	9.59	9.59	33	4,353	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG	1.66	-	-	-	資本財・サービス
SAP SE	130.66	122.83	1,483	193,834	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	17.04	17.04	464	60,655	金融
ZALANDO SE	20.25	28.56	184	24,076	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	21.28	21.28	132	17,316	素材
KION GROUP AG	6	6	55	7,289	資本財・サービス
COVESTRO AG	19.45	19.45	109	14,301	素材
RATIONAL AG	-	0.74	59	7,791	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	5.13	3.88	191	25,092	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HDLG-PREF	21.02	21.02	187	24,456	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	19.79	21.48	176	23,004	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	5.6	5.6	89	11,674	ヘルスケア
BECHTLE AG	2.73	8.19	46	6,092	情報技術
NEUMOSCHECK SE	11.39	11.39	101	13,243	情報技術
SCOUT24 AG	14.6	14.6	87	11,449	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	40.38	28.94	176	23,065	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	5.49	13.57	119	15,565	資本財・サービス
HELLOFRESH SE	18.14	18.14	102	13,433	生活必需品
TEAMVIEWER AG	14.61	-	-	-	情報技術
SIEMENS ENERGY AG	47.32	47.32	104	13,637	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	12.75	12.75	113	14,801	生活必需品
FUCHS PETROLUB PREF	7	7	27	3,615	素材
MERCK KGAA	16.92	16.92	335	43,819	ヘルスケア
ADIDAS AG	23.85	21.88	534	69,848	一般消費財・サービス
PUMA SE	12.95	12.95	125	16,444	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	13.11	13.11	93	12,268	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	418.6	411.35	638	83,483	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	25.61	25.61	147	19,300	ヘルスケア
INFINEON TECHNOLOGIES AG	110.27	101.1	738	96,526	一般消費財・サービス
HANNOVER RUECK SE	164.97	155.1	597	78,126	情報技術
DEUTSCHE POST AG-REG	6.44	6.44	112	14,675	金融
DEUTSCHE BOERSE AG	131.16	116.91	625	81,764	資本財・サービス
LANXESS AG	24.04	24.04	352	46,124	金融
	15.29	15.29	87	11,470	素材



外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	金額			
MTU AERO ENGINES AG	百株	百株	千ユーロ	千円	128	16,756	資本財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	47.96	-	-	-	-	-	不動産
SYMRISE AG	16.56	16.56	199	26,113			素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	62.4	62.4	15	2,012			コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	9	9	73	9,586			一般消費財・サービス
VONOVIA SE	71.86	80.41	375	49,121			不動産
LEG IMMOBILIEN SE	10.73	10.73	125	16,338			不動産
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,998.98 60銘柄	2,932.5 59銘柄	16,069	2,100,220	< 2.5%>	
ユーロ (ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円			
JERONIMO MARTINS	29	29	59	7,732			生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	275.76	359.64	161	21,091			公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	71.83	71.83	67	8,856			エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	376.59 3銘柄	460.47 3銘柄	288	37,680	< 0.0%>	
ユーロ (スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円			
IBERDROLA RIGHTS SA	-	720.39	11	1,562			公益事業
TELEFONICA SA	570.39	644.91	259	33,918			コミュニケーション・サービス
ENDESA SA	37.6	37.6	72	9,496			公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	951.66	835.83	466	60,924			金融
IBERDROLA SA	720.39	720.39	721	94,343			公益事業
REPSOL SA	176.85	176.85	190	24,917			エネルギー
GRIFOLS SA	51.14	27.95	46	6,045			ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	2,073.7	2,073.7	646	84,440			金融
AMADEUS IT GROUP SA	54	54	335	43,814			情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA	39.78	39.78	114	14,932			公益事業
CAIXABANK SA	468.59	468.59	126	16,487			金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	35.83	35.83	86	11,323			資本財・サービス
AENA SME SA	8.66	8.66	126	16,479			資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA	45.46	65.12	273	35,746			コミュニケーション・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	142.55	124.17	343	44,921			一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	17.93	32.93	64	8,373			資本財・サービス
ENAGAS SA	36.75	36.75	73	9,544			公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	51.47	51.47	91	12,011			公益事業
FERROVIAL SA	60.55	60.55	162	21,240			資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA	-	43.83	84	11,084			公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,543.3 18銘柄	6,259.3 20銘柄	4,296	561,610	< 0.7%>	
ユーロ (イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円			
PRYSMIAN SPA	41.45	41.45	136	17,796			資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	159.85	129.44	238	31,230			金融
MEDIOBANCA SPA	99.71	99.71	103	13,520			金融
UNICREDIT SPA	294.71	294.71	419	54,781			金融
TELECOM ITALIA SPA	1,085.03	1,085.03	48	6,374			コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP	483.81	-	-	-			コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO	2,135.25	1,910.98	470	61,517			金融
ATLANTIA SPA	60.27	60.27	99	13,009			資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	77.27	77.27	90	11,780			金融

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			株数	金額			
MONCLER SPA	百株	百株	千ユーロ	千円	147	19,292	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	24.35	24.35	12.85	12.85	69	9,082	ヘルスケア
ENI SPA	360.61	281.9	357	46,733			エネルギー
DIASORIN SPA	2.77	2.77	41	5,361			ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	24.14	24.14	23	3,103			コミュニケーション・サービス
NEXI SPA	35.53	80.78	108	14,115			情報技術
AMPLIFON SPA	17.5	17.5	72	9,528			ヘルスケア
ENEL SPA	983.37	983.37	681	89,068			公益事業
SNAM SPA	243	243	125	16,400			公益事業
TERNA SPA	199	199	136	17,837			公益事業
FINECOBANK SPA	59.72	59.72	90	11,864			金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	6,400.19 20銘柄	5,628.24 19銘柄	3,461	452,400	< 0.5%>	
ユーロ (フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円			
UPM-KYMMENE OYJ	65.25	65.25	221	29,004			素材
NOKIA OYJ	652.61	652.61	355	46,486			情報技術
WARTSILA OYJ ABP	41.16	41.16	51	6,708			資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	88.53	88.53	146	19,149			素材
ELISA OYJ	17.34	17.34	91	11,979			コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS	68.09	68.09	300	39,290			金融
FORTUM OYJ	44	44	111	14,509			公益事業
KESKO OYJ-B SHS	51.25	42.45	118	15,435			生活必需品
KONE OYJ-B	45.43	37.96	233	30,581			資本財・サービス
NESTE OYJ	57.78	57.78	254	33,296			エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	17.63	17.63	62	8,106			ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,149.07 11銘柄	1,132.8	1,947	254,548	< 0.3%>	
ユーロ (オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円			
VERBUND AG	12.16	12.16	112	14,701			公益事業
OMV AG	12.09	12.09	65	8,542			エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	34.89	34.89	148	19,407			金融
VOESTALPINE AG	18	18	61	7,975			素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	11	11	28	3,694			金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	88.14 5銘柄	88.14 5銘柄	415	54,321	< 0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	23,170.73 232銘柄	22,777.47 229銘柄	60,137	7,859,935	< 9.5%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	134,609.2 1,208銘柄	131,967.94 1,227銘柄	-	78,078,463	< 9.4%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

# 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

## (2) 外国投資信託証券

銘柄	期首		当期		期末	
	□数	□数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,679	1,679	417	48,150		
SIMON PROPERTY GROUP INC	4,233	4,012	645	74,446		
BOSTON PROPERTIES INC	2,356	1,915	239	27,633		
VORNADO REALTY TRUST	2,128	2,128	97	11,194		
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,501	1,28	438	50,576		
EQUITY RESIDENTIAL	5,245	4,406	395	45,574		
EQUINIX INC	1,081	1,081	826	95,298		
AMERICAN TOWER CORP	5,555	5,453	1,441	166,300		
HOST HOTELS & RESORTS INC	12,228	6,701	118	13,718		
INVITATION HOMES INC	6,976	6,976	297	34,308		
VICI PROPERTIES INC	5,464	8,607	247	28,501		
VENTAS INC	4,401	4,401	233	26,964		
WEYERHAEUSER CO	8,683	8,683	348	40,210		
AGNC INVESTMENT CORP	7,559	7,559	115	13,374		
CROWN CASTLE INTL CORP	5,102	5,102	972	112,202		
IRON MOUNTAIN INC	3,474	3,474	162	18,704		
VEREIT INC	2,726	-	-	-		
SUN COMMUNITIES INC	1,214	1,214	236	27,304		
PROLOGIS INC	9,436	8,863	1,356	156,425		
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,648	1,648	342	39,502		
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,177	1,177	194	22,466		
DUKE REALTY CORP	4,971	4,971	299	34,487		
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0,771	0,771	266	30,681		
WELLTOWER INC	4,901	4,901	429	49,484		
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6,434	6,434	230	26,589		
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,714	1,452	311	35,956		
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,95	1,95	156	18,083		
ANNUAL CAPITAL MANAGEMENT IN	15,632	15,632	124	14,369		
REALTY INCOME CORP	4,587	6,508	466	53,767		
PUBLIC STORAGE	2,105	1,857	668	77,068		
REGENCY CENTERS CORP	1,939	1,939	147	17,059		
UDR INC	4,752	3,7	214	24,756		
WP CAREY INC	2,702	2,702	216	24,978		
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,164	-	-	-		
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,415	3,415	543	62,722		
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,797	1,797	374	43,217		
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,597	8,597	202	23,311		
アメリカ・ドル 通貨計	□数、金額 162,297 37銘柄	□数、金額 152,985 35銘柄	□数、金額 13,780	□数、金額 1,589,393 <1.9%>		
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1.6	1.6	91	8,310		
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1.4	1.4	31	2,883		
カナダ・ドル 通貨計	□数、金額 3 2銘柄	□数、金額 3 2銘柄	□数、金額 122	□数、金額 11,193 <0.0%>		
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円		
DEXUS/AU	-	13,949	156	12,990		
LENDLEASE GROUP	4,303	14,733	156	12,987		
TRANSURBAN GROUP	33,406	33,406	449	37,289		
SYDNEY AIRPORT	9,129	18,747	162	13,510		
APA GROUP	14,243	14,243	142	11,847		

銘柄	期首		当期		期末	
	□数	□数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額
			外貨建金額	邦貨換算金額		
SCENTRE GROUP	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円		
DEXUS	13,949	-	-	-		
GPT GROUP	30,647	30,647	167	13,851		
MIRVAC GROUP	61,117	61,117	176	14,597		
STOCKLAND	18,729	18,729	80	6,647		
GOODMAN GROUP	20,198	20,198	490	40,635		
VICINITY CENTRES	50,371	50,371	88	7,310		
オーストラリア・ドル 通貨計	□数、金額 320,109 11銘柄	□数、金額 340,157 11銘柄	□数、金額 2,272	□数、金額 188,496 <0.2%>		
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円		
LINK REIT	32	26	1,765	26,110		
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	52	52	400	5,929		
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34	34	361	5,340		
香港・ドル 通貨計	□数、金額 118 3銘柄	□数、金額 112 3銘柄	□数、金額 2,527	□数、金額 37,380 <0.0%>		
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30.5	30.5	87	7,476		
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	51.66	56.826	112	9,577		
SUNTEC REIT	26	-	-	-		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	46	46	81	6,969		
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	37.6	37.6	68	5,856		
シンガポール・ドル 通貨計	□数、金額 191.76 5銘柄	□数、金額 170,926 4銘柄	□数、金額 351	□数、金額 29,880 <0.0%>		
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円		
LAND SECURITIES GROUP PLC	10,295	10,295	79	12,480		
SEGRO PLC	13,286	13,286	174	27,302		
BRITISH LAND CO PLC	14,58	14,58	80	12,564		
イギリス・ポンド 通貨計	□数、金額 38,161 3銘柄	□数、金額 38,161 3銘柄	□数、金額 334	□数、金額 52,348 <0.1%>		
ユーロ (フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円		
UNIBAIL-RODAMICO-WESTFIELD	1,751	1,751	117	15,312		
GECINA SA	0,578	0,578	70	9,235		
KLEPIERRE	2,394	2,394	54	7,177		
COVIVIO	0,353	0,353	26	3,431		
ユーロ通貨計	□数、金額 5,076 4銘柄	□数、金額 5,076 4銘柄	□数、金額 268	□数、金額 35,157 <0.0%>		
合計	□数、金額 838,403 65銘柄	□数、金額 822,305 62銘柄	□数、金額 -	□数、金額 1,943,851 <2.4%>		

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

### (3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

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

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

(注2) 単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2022年1月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	78,078,463	94.3
投資信託証券	1,943,851	2.3
コール・ローン等、その他	2,734,299	3.4
投資信託財産総額	82,756,614	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、1月11日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=115.34円、1カナダ・ドル=91.08円、1オーストラリア・ドル=82.93円、1香港ドル=14.79円、1シンガポール・ドル=85.12円、1ニュージーランド・ドル=78.09円、1イギリス・ポンド=156.63円、1イスラエル・シケル=36.781円、1スイス・フラン=124.45円、1デンマーク・クローネ=17.57円、1ノルウェー・クローネ=13.01円、1スウェーデン・クローネ=12.67円、1ユーロ=130.70円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(80,971,863千円)の投資信託財産総額(82,756,614千円)に対する比率は、97.8%です。

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年1月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	165,654,019,939円
コール・ローン等	1,955,672,980
株式(評価額)	78,078,463,848
投資信託証券(評価額)	1,943,851,071
未収入金	82,999,580,622
未収配当金	65,682,838
差入委託証拠金	610,768,580
(B) 負債	82,967,774,276
未払金	82,959,674,276
未払解約金	8,100,000
(C) 純資産総額(A - B)	82,686,245,663
元本	27,819,075,015
次期繰越損益金	54,867,170,648
(D) 受益権総口数	27,819,075,015口
1万口当り基準価額(C / D)	29,723円

\* 期首における元本額は27,480,973,178円、当作成期間中における追加設定元本額は5,991,910,031円、同解約元本額は5,653,808,194円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：  
 ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 20,806,492,720円  
 ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 1,138,436,766円  
 iFree 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 1,640,820,976円  
 ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジあり) (ダイワSMA専用) 4,233,324,553円  
 \* 当期末の計算口数当りの純資産額は29,723円です。

### ■損益の状況

当期 自2021年1月13日 至2022年1月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,194,345,220円
受取配当金	1,194,533,790
受取利息	1,226
その他収益金	674,785
支払利息	△ 864,581
(B) 有価証券売買損益	12,065,620,947
売買益	24,744,271,123
売買損	△12,678,650,176
(C) 先物取引等損益	637,837,134
取引益	737,569,138
取引損	△ 99,732,004
(D) その他費用	△ 20,508,168
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	13,877,295,133
(F) 前期繰越損益金	40,198,140,352
(G) 解約差損益金	△ 9,957,048,806
(H) 追加信託差損益金	10,748,783,969
(I) 合計(E + F + G + H)	54,867,170,648
次期繰越損益金(I)	54,867,170,648

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

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

# ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用)

## 運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、外国の株式（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。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2017年2月16日）		
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券	
	外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式（預託証券を含みます。）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2期末(2018年6月15日)	11,273	220	13.9	11,344	12.0	97.9	1.5	2.4	1
3期末(2019年6月17日)	11,306	30	0.6	11,184	△ 1.4	96.1	1.3	2.9	16
4期末(2020年6月15日)	11,489	0	1.6	11,193	0.1	96.5	0.6	2.7	223
5期末(2021年6月15日)	16,693	140	46.5	16,202	44.8	92.6	5.9	2.3	10,845
6期末(2022年6月15日)	17,240	190	4.4	16,694	3.0	95.1	3.4	2.5	6,056

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

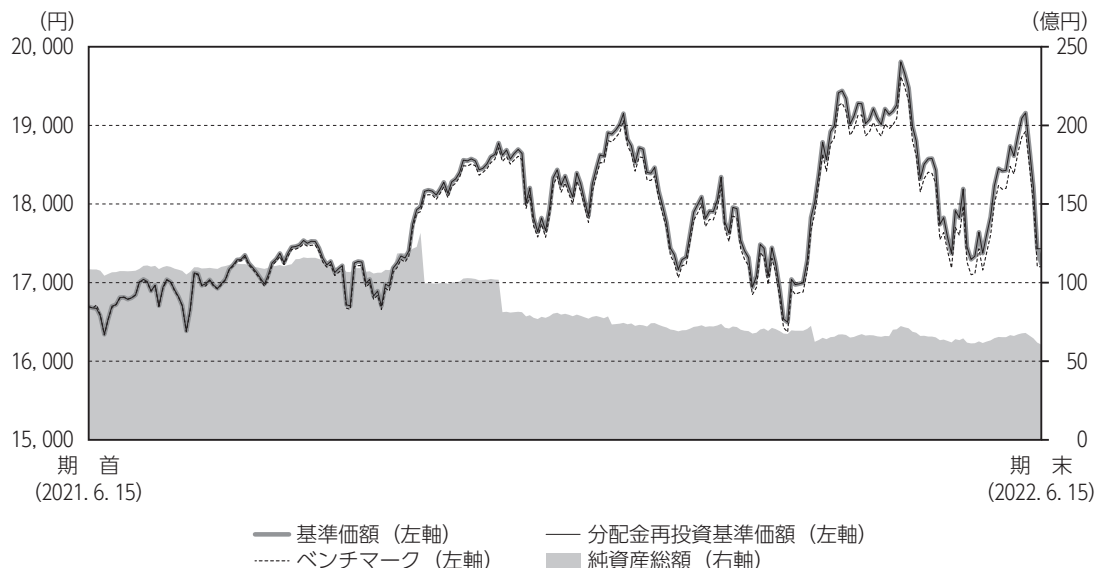
(注6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注7) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

#### 基準価額・騰落率

期首：16,693円

期末：17,240円（分配金190円）

騰落率：4.4%（分配金込み）

#### 基準価額の主な変動要因

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

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）

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				
(期首)2021年 6月15日	円 16,693	% —	16,202	% —	% 92.6	% 5.9	% 2.3
6月末	16,806	0.7	16,309	0.7	91.0	6.7	2.2
7月末	17,037	2.1	16,529	2.0	92.0	5.7	2.2
8月末	17,452	4.5	16,908	4.4	91.2	6.8	2.2
9月末	17,041	2.1	16,494	1.8	92.2	5.6	2.2
10月末	18,281	9.5	17,687	9.2	92.0	5.8	2.3
11月末	18,205	9.1	17,584	8.5	91.4	6.5	2.2
12月末	18,943	13.5	18,293	12.9	92.8	4.8	2.4
2022年 1月末	17,610	5.5	17,000	4.9	92.1	5.7	2.3
2月末	17,486	4.8	16,873	4.1	91.1	6.4	2.2
3月末	19,341	15.9	18,620	14.9	93.0	4.5	2.4
4月末	18,507	10.9	17,784	9.8	92.3	5.2	2.6
5月末	18,451	10.5	17,700	9.2	90.6	7.1	2.4
(期末)2022年 6月15日	17,430	4.4	16,694	3.0	95.1	3.4	2.5

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

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

### ■海外株式市況

海外株式市況は下落しました。

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

### ■為替相場

為替相場は円安となりました。

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

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

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

### ■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。



## ポートフォリオについて

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

### 当ファンド

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

### 外国株式インデックスマザーファンド

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

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

\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

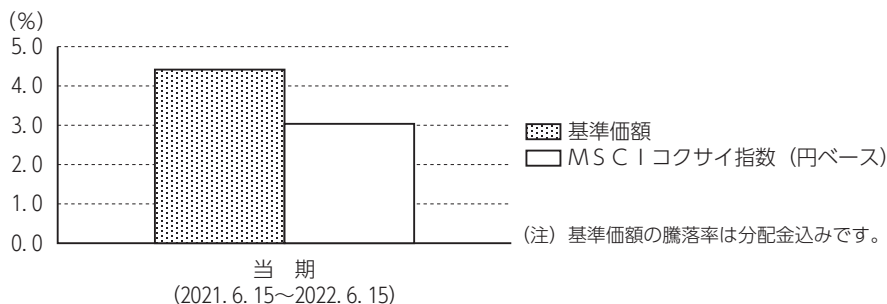
組入ファンド	ベンチマーク
外国株式インデックスマザーファンド	M S C I コクサイ指数（円ベース）

## ベンチマークとの差異について

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

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、運用管理費用、売買コスト等がかい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\* ベンチマークはM S C I コクサイ指数（円ベース）です。

## 分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。  
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### 分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
<b>当期分配金（税込み）</b>	<b>（円）</b>	<b>190</b>
対基準価額比率	（％）	1.09
当期の収益	（円）	190
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	7,240

- (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。

### 収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 191.28円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	50.07
(c) 収益調整金	5,860.97
(d) 分配準備積立金	1,328.03
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	7,430.37
(f) 分配金	190.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	7,240.37

- (注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 今後の運用方針

### 当ファンド

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

### 外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16~2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	79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, 830円です。
（投 信 会 社）	(56)	(0. 313)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(20)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(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)	
（先物・オプション）	(0)	(0. 002)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
有 価 証 券 取 引 税	1	0. 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)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	7	0. 040	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(3)	(0. 019)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0. 006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(3)	(0. 016)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	88	0. 494	

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

(注 2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

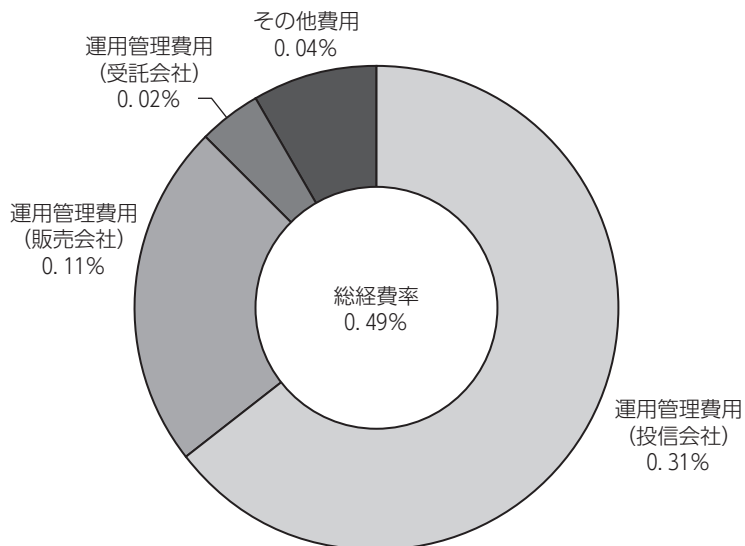
(注 3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

## 参考情報

### ■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.49%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 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	984,368	3,952,479	2,339,946	9,557,809

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期
	外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	39,447,732千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	229,720,983千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.17

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首 保有額	当作成期中 設定額	当作成期中 解約額	当作成期末 保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	□ 数	金 額	□ 数	評 価 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	2,907,948	1,552,370	6,122,858	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス マザーファンド	6,122,858	98.8
コール・ローン等、その他	73,119	1.2
投資信託財産総額	6,195,978	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.01円、1カナダ・ドル=104.20円、1オーストラリア・ドル=93.10円、1香港・ドル=17.20円、1シンガポール・ドル=96.95円、1ニュージーランド・ドル=83.95円、1イギリス・ポンド=162.21円、1イスラエル・シェケル=38.942円、1スイス・フラン=135.01円、1デンマーク・クローネ=18.93円、1ノルウェー・クローネ=13.49円、1スウェーデン・クローネ=13.25円、1ユーロ=140.80円です。

(注3) 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（254,328,525千円）の投資信託財産総額（257,632,004千円）に対する比率は、98.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	6,195,978,323円
コール・ローン等	15,947,114
外国株式インデックス マザーファンド（評価額）	6,122,858,909
未収入金	57,172,300
(B) 負債	139,328,451
未払収益分配金	66,748,182
未払解約金	57,063,031
未払信託報酬	15,328,104
その他未払費用	189,134
(C) 純資産総額 (A - B)	6,056,649,872
元本	3,513,062,218
次期繰越損益金	2,543,587,654
(D) 受益権総口数	3,513,062,218口
1万口当り基準価額 (C / D)	17,240円

\* 期首における元本額は6,496,771,590円、当作成期間中における追加設定元本額は2,411,536,407円、同解約元本額は5,395,245,779円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は17,240円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,837円
受取利息	1,275
支払利息	△ 3,112
(B) 有価証券売買損益	123,925,836
売買益	595,649,789
売買損	△ 471,723,953
(C) 信託報酬等	△ 39,132,975
(D) 当期繰越損益金 (A + B + C)	84,791,024
(E) 前期繰越損益金	466,547,238
(F) 追加信託差損益金	2,058,997,574
(配当等相当額)	( 1,280,803,552)
(売買損益相当額)	( 778,194,022)
(G) 合計 (D + E + F)	2,610,335,836
(H) 収益分配金	△ 66,748,182
次期繰越損益金 (G + H)	2,543,587,654
追加信託差損益金	2,058,997,574
(配当等相当額)	( 1,280,803,552)
(売買損益相当額)	( 778,194,022)
分配準備積立金	484,590,080

(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せん。

(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	67,199,486円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	17,591,538
(c) 収益調整金	2,058,997,574
(d) 分配準備積立金	466,547,238
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,610,335,836
(f) 分配金	66,748,182
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,543,587,654
(h) 受益権総口数	3,513,062,218口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)

190円

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

<補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「外国株式インデックスマザーファンド」の決算日（2021年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在における外国株式インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■外国株式インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄  
株 式

（2021年6月16日から2022年6月15日まで）

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC (アメリカ)	76.4	1,445,332	18,917	ALEXION PHARMACEUTICALS INC (アメリカ)	7.98	159,446	19,980
MICROSOFT CORP (アメリカ)	39.1	1,394,438	35,663	DEUTSCHE WOHNEN SE (ドイツ)	12.05	73,268	6,080
AMAZON.COM INC (アメリカ)	3.66	1,374,537	375,556	ORACLE CORP (アメリカ)	6	62,614	10,435
TESLA INC (アメリカ)	8.88	902,720	101,657	XPO LOGISTICS INC (アメリカ)	3.1	47,864	15,440
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	1.74	547,466	314,635	VIFOR PHARMA AG (スイス)	1.75	41,510	23,720
NVIDIA CORP (アメリカ)	13.85	437,993	31,624	AUTOLIV INC (アメリカ)	2.95	32,702	11,085
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	1.27	398,057	313,430	LAMB WESTON HOLDINGS INC (アメリカ)	5.45	32,540	5,970
META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)	10	328,517	32,851	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD (バミューダ)	1.83	32,435	17,724
SEA LTD-ADR (ケイマン諸島)	14.3	325,630	22,771	SUEZ (フランス)	12.625	32,200	2,550
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	15.4	316,356	20,542	REINSURANCE GROUP OF AMERICA (アメリカ)	2.45	31,755	12,961

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2022年6月15日現在における外国株式インデックスマザーファンド（65,283,819千円）の内容です。

(1)外国株式

銘 柄	2022年6月15日現在			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	47	631	85,295	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	40	1,926	260,099	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	74	1,000	135,044	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	54	442	59,797	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	24	343	46,354	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	211	622	84,065	金融
ABBOTT LABORATORIES	714.66	7,356	993,229	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	149.83	482	65,135	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	65	1,028	138,857	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	139	448	60,559	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	243	1,592	214,987	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	18	732	98,947	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	247	2,352	317,634	情報技術
QORVO INC	44.2	427	57,681	情報技術
AFLAC INC	250	1,342	181,284	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	51	581	78,515	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	68	577	77,980	コミュニケーション・サービス



外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ADOBE INC	191.2	7,090	957,231	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	84	783	105,753	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	48	1,346	181,777	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	63	609	82,266	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	90	2,152	290,673	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	278	5,095	687,900	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	86.42	576	77,869	金融
AUTOZONE INC	8.2	1,667	225,133	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	90.71	1,415	191,073	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	459	360	48,646	ヘルスケア
CELANESE CORP	44.5	606	81,834	素材
DR HORTON INC	136.16	894	120,812	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	89	316	42,764	ヘルスケア
AUTODESK INC	89	1,527	206,180	情報技術
MOODY'S CORP	68	1,752	236,567	金融
DEVON ENERGY CORP	256	1,807	243,977	エネルギー
ALBEMARLE CORP	47	1,049	141,713	素材
ATMOS ENERGY CORP	55	580	78,369	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	102	567	76,580	公益事業
CITIGROUP INC	804.73	3,698	499,339	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	170	3,470	468,513	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	204	1,844	249,090	公益事業
ALLEGHANY CORP	5.2	432	58,410	金融
DOMINO'S PIZZA INC	15.3	577	77,901	一般消費財・サービス
HESS CORP	113	1,356	183,180	エネルギー
DAVITA INC	27.5	247	33,403	ヘルスケア
DANAHER CORP	276.5	6,702	904,960	ヘルスケア
FORTIVE CORP	138	773	104,466	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	228	2,144	289,507	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	228	1,884	254,477	生活必需品
BUNGE LTD	57	594	80,303	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	131.95	1,562	210,906	情報技術
APPLE INC	6,611	87,767	11,849,508	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	114	1,046	141,352	金融
BOEING CO/THE	225	2,748	371,088	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	62.15	723	97,686	金融
BECTON DICKINSON AND CO	114.99	2,717	366,882	ヘルスケア
LEIDOS HOLDINGS INC	54	528	71,381	資本財・サービス
NISOURCE INC	165	455	61,483	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	51	542	73,227	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	307.71	1,249	168,668	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,703.04	8,372	1,130,323	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	523.5	14,534	1,962,296	金融
ANSYS INC	35	804	108,569	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	538.17	2,488	335,972	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	284	2,709	365,867	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	883	6,434	868,711	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	1,196.7	13,649	1,842,827	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	93	1,001	135,202	金融
LKQ CORP	108	524	70,747	一般消費財・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	126.12	821	110,950	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	112	1,605	216,821	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	45	1,093	147,675	金融

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DOLLAR GENERAL CORP	94	2,162	291,917	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	81	3,602	486,370	情報技術
CATERPILLAR INC	217	4,485	605,543	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	97	530	71,582	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	94	393	53,098	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	20	419	56,569	ヘルスクエア
CMS ENERGY CORP	117	731	98,757	公益事業
MOSAIC CO/THE	149	785	106,074	素材
DELTA AIR LINES INC	62	194	26,267	資本財・サービス
CORNING INC	326	1,046	141,282	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,684.5	7,228	975,877	情報技術
MORGAN STANLEY	541.52	4,059	548,037	金融
MSCI INC	33	1,290	174,203	金融
FAIR ISAAC CORP	11	417	56,346	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	13	254	34,311	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	94	536	72,414	情報技術
BROADCOM INC	166.12	8,641	1,166,630	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	49	654	88,330	ヘルスクエア
ARAMARK	90	272	36,853	一般消費財・サービス
DTE ENERGY COMPANY	79	940	127,040	公益事業
CENTENE CORP	236.07	1,799	242,958	ヘルスクエア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	42	451	60,968	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	202	720	97,252	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	85	1,302	175,844	金融
GARTNER INC	33.5	785	106,105	情報技術
SPLUNK INC	63	544	73,548	情報技術
DOMINION ENERGY INC	329.41	2,457	331,773	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	161	1,417	191,412	生活必需品
SMITH (A. O. ) CORP	53	294	39,813	資本財・サービス
DEERE & CO	118	3,853	520,280	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC	60	741	100,082	資本財・サービス
POOL CORP	16	559	75,484	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	112.84	1,265	170,855	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	85	1,031	139,225	情報技術
CABLE ONE INC	2	244	33,046	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	27	427	57,752	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	46	671	90,591	金融
VAIL RESORTS INC	16	369	49,869	一般消費財・サービス
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	209	249	33,634	コミュニケーション・サービス
TARGA RESOURCES CORP	90	596	80,560	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	28	369	49,903	金融
WESTLAKE CORP	16	182	24,705	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	144	1,278	172,601	公益事業
COGNEX CORP	69	296	40,076	情報技術
WEBSTER FINANCIAL CORP	73	328	44,409	金融
TELEFLEX INC	19	479	64,773	ヘルスクエア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	34	548	74,097	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	30	841	113,655	ヘルスクエア
BIO-RAD LABORATORIES-A	9	422	57,104	ヘルスクエア
CATALENT INC	69	719	97,153	ヘルスクエア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	56	1,004	135,575	ヘルスクエア
MOLINA HEALTHCARE INC	24	628	84,793	ヘルスクエア
IDEX CORP	31	556	75,088	資本財・サービス

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
COLGATE-PALMOLIVE CO	324	2,406	324,881	生活必需品
ROLLINS INC	86.07	282	38,091	資本財・サービス
AMETEK INC	94	1,046	141,300	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	98	803	108,494	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	64.5	291	39,334	資本財・サービス
HEICO CORP	18	240	32,416	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	26	624	84,298	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	15	526	71,026	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	106	1,033	139,504	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	17	527	71,283	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	179.6	8,168	1,102,789	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	32.5	231	31,254	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	23	640	86,437	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	53	412	55,627	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	11	1,324	178,808	一般消費財・サービス
UGI CORP	85	337	45,570	公益事業
CUMMINS INC	58	1,140	153,957	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	316	2,358	318,437	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	55	893	120,665	情報技術
SIGNATURE BANK	25.5	454	61,301	金融
COSTAR GROUP INC	160	882	119,176	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	24	975	131,680	金融
AMERCO	4	185	25,078	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	40	957	129,323	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	17.9	1,103	148,964	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	30	531	71,734	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	113.16	1,348	182,018	一般消費財・サービス
DEXCOM INC	156	1,081	145,977	ヘルスケア
NORDSON CORP	20.9	419	56,665	資本財・サービス
COPART INC	87	901	121,675	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	68	1,017	137,370	エネルギー
SEAGEN INC	56	809	109,355	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	30	714	96,429	ヘルスケア
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	33	622	83,996	金融
TRANSDIGM GROUP INC	20.9	1,102	148,887	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	15.8	512	69,152	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	39	355	48,030	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	87	707	95,458	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	826.81	1,479	199,701	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	98	1,756	237,205	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	15	402	54,371	金融
COTERRA ENERGY INC	330	1,026	138,605	エネルギー
T-MOBILE US INC	253.27	3,163	427,082	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	67.5	203	27,512	不動産
COCA-COLA CO/THE	1,670.5	9,894	1,335,839	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	85	430	58,159	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	69.5	685	92,518	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	117	270	36,457	金融
CSX CORP	889	2,608	352,150	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	38	812	109,718	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	61.25	624	84,289	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	3,712	37,977	5,127,338	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	253	2,188	295,462	ヘルスケア

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
EXXON MOBIL CORP	1,717.05	16,500	2,227,779	エネルギー
AES CORP	271	512	69,187	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	16	436	58,901	金融
EOG RESOURCES INC	237	3,110	419,997	エネルギー
EQT CORP	141	575	77,725	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	65	580	78,366	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	5	311	42,038	金融
ABIOMED INC	18	413	55,811	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	64	903	122,014	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	122	1,415	191,082	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1,595.23	1,946	262,753	一般消費財・サービス
EXACT SCIENCES CORP	71	263	35,601	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	62.37	133	18,062	コミュニケーション・サービス
ENTEGRIS INC	55	543	73,334	情報技術
AERCAP HOLDINGS NV	56	221	29,962	資本財・サービス
FORTINET INC	55	1,480	199,918	情報技術
MARKEL CORP	5.5	713	96,283	金融
NEXTERA ENERGY INC	795.8	5,688	767,987	公益事業
MASIMO CORP	20	246	33,228	ヘルスケア
FREEMPORT-MCMORAN INC	590.08	2,172	293,332	素材
INSULET CORP	28	575	77,703	ヘルスケア
US BANCORP	572	2,615	353,075	金融
UNITED RENTALS INC	29	754	101,844	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	25	376	50,895	情報技術
FASTENAL CO	233	1,144	154,549	資本財・サービス
FISERV INC	251.33	2,259	305,015	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	446.06	3,035	409,814	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	560	1,859	251,010	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	49	279	37,714	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	96	2,072	279,827	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	137.5	3,884	524,503	金融
ALPHABET INC-CL A	121.9	26,017	3,512,587	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	115.07	24,669	3,330,646	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	39	322	43,523	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	245	1,628	219,799	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	220.18	845	114,120	公益事業
GENUINE PARTS CO	58.5	774	104,602	一般消費財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	277	957	129,321	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	78.5	1,781	240,496	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	364	1,334	180,209	エネルギー
HOME DEPOT INC	423.5	11,801	1,593,344	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	22.5	396	53,466	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	583	713	96,342	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	16.1	329	44,518	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	59	1,220	164,720	生活必需品
HUMANA INC	51	2,162	291,897	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	109	1,834	247,657	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	33.2	161	21,824	情報技術
HENRY SCHEIN INC	56	420	56,704	ヘルスケア
HP INC	473	1,596	215,526	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	527	720	97,262	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	68.28	247	33,389	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	79	459	61,989	コミュニケーション・サービス

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	29.5	107	14,449	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	154	686	92,626	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	298.03	1,077	145,416	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	54	969	130,879	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	365	4,953	668,809	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	143	623	84,214	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	52	318	43,049	資本財・サービス
ZOETIS INC	191	3,013	406,917	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	94.99	1,203	162,462	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	94	1,226	165,642	エネルギー
ALLEGION PLC	36.5	369	49,904	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	129.73	292	39,425	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	104.37	1,224	165,371	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	127	359	48,558	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	44	551	74,469	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	1,066	17,929	2,420,601	ヘルスケア
PLUG POWER INC	211	299	40,451	資本財・サービス
ABBVIE INC	716.72	9,863	1,331,671	ヘルスケア
HOLOGIC INC	101	685	92,547	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	137	1,689	228,078	生活必需品
KROGER CO	283	1,426	192,529	生活必需品
KLA CORP	61	1,930	260,632	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	99	4,120	556,252	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	31	703	95,023	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	105	344	46,497	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	272	4,839	653,444	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	327.85	9,533	1,287,124	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	56.8	2,554	344,909	情報技術
LOEWS CORP	86	503	67,969	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	66.49	321	43,375	金融
MCDONALD'S CORP	301.5	7,198	971,884	一般消費財・サービス
3M CO	231.9	3,136	423,451	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	936	15,325	2,069,045	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	144.39	4,583	618,801	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	25	791	106,816	素材
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	21.2	561	75,742	情報技術
ALCOA CORP	77	376	50,856	素材
PHILLIPS 66	195	2,030	274,142	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	160.5	471	63,707	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	101	846	114,269	生活必需品
METLIFE INC	284	1,756	237,188	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	342	1,659	224,033	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	100	919	124,114	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	67.98	1,382	186,597	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	9	1,041	140,662	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	388.23	1,278	172,602	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	47	941	127,175	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	1,025.21	8,663	1,169,594	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	207.51	1,252	169,132	素材
MASCO CORP	95	486	65,681	資本財・サービス
M & T BANK CORP	72.99	1,203	162,498	金融
MARSH & MCLENNAN COS	203.7	2,999	404,987	金融
BLACK KNIGHT INC	63.5	409	55,228	情報技術

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
HEICO CORP-CLASS A	30.2	326	44,059	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	112.02	1,705	230,214	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	80	1,115	150,541	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	29	136	18,456	一般消費財・サービス
BLOCK INC CLASS A	210.12	1,267	171,060	情報技術
TRANSUNION	78	603	81,434	資本財・サービス
VISTRA CORP	176	404	54,557	公益事業
NOVOCURE LTD	38.5	230	31,119	ヘルスケア
NETAPP INC	90	578	78,154	情報技術
NIKE INC -CL B	517	5,724	772,827	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	97	2,161	291,791	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	225	1,371	185,149	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	76.05	659	89,101	金融
ALLY FINANCIAL INC	142	483	65,336	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	60	2,726	368,139	資本財・サービス
APTIV PLC	110	1,044	140,966	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	323.11	2,038	275,218	素材
MCKESSON CORP	61	1,869	252,437	ヘルスケア
XYLEM INC	73	558	75,396	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	628	6,215	839,129	生活必需品
NUCOR CORP	111	1,262	170,422	素材
WESTERN UNION CO	152.46	250	33,880	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	68	451	60,922	情報技術
NEWELL BRANDS INC	164.42	303	41,000	一般消費財・サービス
EVERGY INC	93.5	573	77,406	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	379.24	2,354	317,908	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	10.5	181	24,530	金融
OKTA INC	60	488	65,995	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	29	154	20,911	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	56	636	85,880	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	173.05	361	48,829	ヘルスケア
LINDE PLC	208.46	6,162	831,998	素材
WIX.COM LTD	23.1	128	17,337	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	158	414	55,910	金融
KKR & CO INC	226	1,064	143,712	金融
PAYCHEX INC	132	1,550	209,347	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	27	1,611	217,509	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	737	3,411	460,596	生活必需品
P G & E CORP	604	601	81,219	公益事業
PFIZER INC	2,280.13	10,926	1,475,170	ヘルスケア
CIGNA CORP	130	3,194	431,252	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	118.01	558	75,440	情報技術
XCEL ENERGY INC	221	1,455	196,567	公益事業
STERIS PLC	41	835	112,739	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	149	1,057	142,726	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	60.33	178	24,150	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	127.99	409	55,347	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	137.8	2,763	373,166	ヘルスケア
LYFT INC-A	125	177	23,896	資本財・サービス
DOW INC	298.18	1,746	235,746	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	41	265	35,836	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	88	940	126,959	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	52	1,313	177,359	資本財・サービス

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
UBER TECHNOLOGIES INC	594	1,252	169,133	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	94	2,486	335,738	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	971.67	13,004	1,755,782	生活必需品
EXELON CORP	397.22	1,680	226,902	公益事業
TELADOC HEALTH INC	65	190	25,686	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	165.08	722	97,552	資本財・サービス
NVR INC	1.3	507	68,539	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	527.02	5,875	793,284	エネルギー
TWILIO INC - A	70	573	77,363	情報技術
DOCUSIGN INC	80	458	61,866	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	21	567	76,678	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	53	239	32,314	情報技術
PEPSICO INC	561	8,758	1,182,462	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	16.2	193	26,130	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	114	234	31,628	情報技術
MONGODB INC	27	650	87,851	情報技術
SNAP INC - A	444	528	71,393	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	294.68	1,661	224,346	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	152	1,430	193,189	金融
AMCOW PLC	614	742	100,221	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	80	1,274	172,013	情報技術
ROKU INC	48	356	48,143	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	74	987	133,346	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	256	7,043	950,885	情報技術
KORNIT DIGITAL LTD	19	64	8,708	資本財・サービス
PENTAIR PLC	66.75	306	41,328	資本財・サービス
QUALCOMM INC	457	5,952	803,698	情報技術
INVESCO LTD	141	228	30,915	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	25.5	437	59,036	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	106	677	91,504	金融
DATADOG INC - CLASS A	91	792	107,022	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	231	397	53,610	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	36.5	254	34,376	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	43	2,357	318,340	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	90	1,107	149,528	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	17	3,317	447,904	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	143	1,058	142,867	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	38.3	563	76,130	素材
RESMED INC	59	1,191	160,912	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	47.3	601	81,146	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	45	366	49,472	資本財・サービス
MODERNA INC	139	1,689	228,124	ヘルスケア
HUBSPOT INC	17.8	526	71,098	情報技術
PERKINELMER INC	51	704	95,116	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	346.87	1,246	168,310	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	173.38	1,199	162,007	資本財・サービス
BILL. COM HOLDINGS INC	38	402	54,366	情報技術
AVANTOR INC	248	737	99,509	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	80	265	35,847	金融
DYNATRACE INC	81	314	42,452	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	179	812	109,717	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	379.85	735	99,233	金融
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	110	341	46,142	コミュニケーション・サービス



銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	140	534	72,203	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	32.3	254	34,380	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	116	847	114,436	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	790.18	13,239	1,787,460	エネルギー
PELTON INTERACTIVE INC-A	117	112	15,132	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	34	483	65,233	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	154	939	126,786	公益事業
ETSY INC	52	372	50,273	一般消費財・サービス
TESLA INC	355.5	23,557	3,180,554	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	87	990	133,750	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	236	518	70,065	情報技術
UNITY SOFTWARE INC	79	266	36,007	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	66.02	704	95,167	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	62	1,829	247,067	情報技術
CARVANA CO	39	81	11,015	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	32.5	87	11,869	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	101	411	55,621	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	49.05	2,216	299,305	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	490.21	505	68,301	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	78.5	458	61,957	一般消費財・サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	146	381	51,486	コミュニケーション・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	136	1,344	181,538	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	136	959	129,594	不動産
TWITTER INC	325	1,209	163,314	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	430	2,871	387,686	公益事業
SYSCO CORP	206	1,650	222,885	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	98.03	1,630	220,111	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	25	109	14,793	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	46	243	32,828	金融
STEEL DYNAMICS INC	78.5	557	75,269	素材
SCHLUMBERGER LTD	572.52	2,474	334,072	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	62	269	36,445	資本財・サービス
AFFIRM HOLDINGS INC	77	136	18,400	情報技術
AT&T INC	2,895.91	5,632	760,449	コミュニケーション・サービス
APA CORP	144	662	89,430	エネルギー
SOUTHWEST AIRLINES CO	60.5	225	30,401	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	175	991	133,845	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	87	342	46,266	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	100	2,294	309,820	素材
SEMPRA ENERGY	128	1,853	250,267	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	78	240	32,466	情報技術
CLARIVATE PLC	134	177	23,898	資本財・サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	665	520	70,209	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	84.5	639	86,281	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	49	252	34,122	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC	374	5,762	778,007	情報技術
SALESFORCE.COM INC	398.66	6,555	885,120	情報技術
WESTROCK CO	107	457	61,785	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	162.09	800	108,018	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	285.34	1,415	191,077	資本財・サービス
TERADYNE INC	66	600	81,006	情報技術
UNION PACIFIC CORP	257.8	5,374	725,661	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	299	860	116,219	エネルギー

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MARATHON PETROLEUM CORP	239.88	2,462	332,509	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	604.79	5,522	745,652	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	297	5,172	698,346	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	77.04	1,547	208,938	ヘルスケア
AMEREN CORPORATION	105	874	118,086	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	380.66	17,576	2,373,067	ヘルスケア
APPLOVIN CORP CLASS A	49	158	21,401	情報技術
VERISIGN INC	40	644	87,043	情報技術
LUCID GROUP INC	168	278	37,651	一般消費財・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	70	191	25,800	一般消費財・サービス
VALERO ENERGY CORP	166.42	2,225	300,514	エネルギー
UPSTART HOLDINGS INC	28	95	12,955	金融
ULTA BEAUTY INC	22	863	116,631	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	108.88	406	54,948	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	28.3	296	40,068	ヘルスケア
ANTHEM INC	98	4,511	609,154	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	737.62	6,949	938,300	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,550.22	5,802	783,391	金融
WASTE MANAGEMENT INC	168	2,446	330,290	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	493	1,594	215,254	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	46	883	119,346	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	24	372	50,340	一般消費財・サービス
WALMART INC	619	7,394	998,341	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	85	894	120,806	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	45	261	35,243	一般消費財・サービス
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	455	111	15,050	資本財・サービス
WABTEC CORP	71.11	613	82,872	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	484	2,774	374,621	一般消費財・サービス
WATERS CORP	25	803	108,510	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	22	661	89,326	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	297	1,193	161,193	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	48.63	947	127,942	金融
WESTERN DIGITAL CORP	127	625	84,428	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	128	1,178	159,074	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	204	1,243	167,923	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	672.5	13,014	1,757,049	情報技術
PPL CORP	298	775	104,726	公益事業
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	132.24	719	97,195	公益事業
PULTEGROUP INC	98.5	392	53,034	一般消費財・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	902.53	1,261	170,347	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC	96	1,070	144,527	素材
NORTHERN TRUST CORP	80	748	101,095	金融
NVIDIA CORP	1,013.8	16,054	2,167,523	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	170.13	2,648	357,539	金融
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	35	174	23,603	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	119	998	134,827	生活必需品
NETFLIX INC	179.9	3,014	406,926	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	159	8,068	1,089,322	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	98.5	388	52,422	公益事業
GLOBE LIFE INC	36.55	326	44,140	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	72	986	133,134	金融
TEXTRON INC	86	517	69,885	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	152.87	237	32,093	コミュニケーション・サービス

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
OMNICOM GROUP	83	539	72,781	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	649.33	4,592	619,974	情報技術
MASTERCARD INC - A	354	11,403	1,539,621	情報技術
ONEOK INC	181	1,093	147,573	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	373.52	395	53,404	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	43	1,636	220,989	情報技術
YUM! BRANDS INC	117	1,289	174,121	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	66	801	108,184	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	74	380	51,312	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	2,944.01	9,261	1,250,443	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	19	693	93,585	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	75	536	72,378	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	262	3,788	511,488	金融
ANALOG DEVICES INC	211.91	3,118	421,052	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	663.27	5,769	778,978	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	329.72	1,715	231,569	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	66	612	82,655	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	93	367	49,583	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	33.3	536	72,423	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	213	1,445	195,174	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	241	2,041	275,591	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	87	2,184	294,974	金融
AMGEN INC	226	5,326	719,173	ヘルスケア
EATON CORP PLC	162.36	2,119	286,102	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	67	1,551	209,407	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	358	3,458	466,999	情報技術
CME GROUP INC	146	2,863	386,561	金融
ECOLAB INC	105	1,577	213,037	素材
EQUIFAX INC	49	842	113,799	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	508	2,935	396,353	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	317	1,090	147,225	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	121	545	73,708	生活必需品
STATE STREET CORP	148.13	921	124,353	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	588.4	3,595	485,457	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	204	1,376	185,853	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	86	390	52,759	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	49.8	468	63,214	素材
CARDINAL HEALTH INC	110	562	75,903	ヘルスケア
FEDEX CORP	102	2,345	316,664	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	167.54	1,785	241,079	金融
FMC CORP	51.5	555	75,036	素材
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	103.13	1,208	163,142	素材
CITRIX SYSTEMS INC	51	471	63,628	情報技術
INTEL CORP	1,651	6,262	845,465	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	160	444	60,009	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	134.5	895	120,937	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	127	2,361	318,800	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	386	228	30,903	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	64	1,212	163,662	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	58	339	45,871	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	145	2,770	374,105	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	43.5	528	71,326	情報技術
SNAP-ON INC	22	452	61,058	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CARMAX INC	66	592	80,008	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP	312.28	3,152	425,572	公益事業
TARGET CORP	194	2,768	373,758	一般消費財・サービス
DOVER CORP	58	713	96,316	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	19	892	120,538	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	52.2	648	87,614	資本財・サービス
CINTAS CORP	38	1,339	180,815	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	194	616	83,290	生活必需品
CLOROX COMPANY	50	623	84,138	生活必需品
ENTERGY CORP	82	879	118,778	公益事業
MICROSOFT CORP	2,886	70,559	9,526,280	情報技術
INCYTE CORP	76	502	67,905	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	531.69	4,819	650,645	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	543.98	4,813	649,821	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	454	2,664	359,798	情報技術
BLACKROCK INC	62	3,665	494,896	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	255	703	95,020	公益事業
HASBRO INC	54	436	58,871	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	104	710	95,956	生活必需品
KEYCORP	376	659	89,039	金融
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	563.11	3,292	444,520	生活必需品
COOPER COS INC/THE	20	629	85,034	ヘルスケア
CHUBB LTD	172.99	3,424	462,296	金融
ARROW ELECTRONICS INC	27	307	41,570	情報技術
ALLSTATE CORP	112	1,366	184,462	金融
EBAY INC	249	1,060	143,143	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	449.5	3,257	439,737	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	52	500	67,565	素材
DISH NETWORK CORP-A	96	169	22,850	コミュニケーション・サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	94	2,263	305,572	生活必需品
TRIMBLE INC	102	603	81,469	情報技術
LENNAR CORP-A	106	732	98,946	一般消費財・サービス
LEAR CORP	23	290	39,231	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	237	2,664	359,682	金融
PACCAR INC	141.37	1,189	160,630	資本財・サービス
BIOGEN INC	60	1,165	157,297	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	34	1,118	151,017	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	466	3,369	454,935	一般消費財・サービス
PTC INC	44	439	59,339	情報技術
EVERSOURCE ENERGY	140	1,130	152,609	公益事業
INTUIT INC	108.8	3,968	535,828	情報技術
BORGWARNER INC	97	340	45,914	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	88.5	624	84,343	一般消費財・サービス
BALL CORP	130.04	864	116,752	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	578.97	2,040	275,459	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	114	1,452	196,036	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	54	815	110,116	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	103	2,565	346,371	ヘルスケア
VF CORP	134	608	82,170	一般消費財・サービス
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	246.25	625	84,478	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	22	271	36,714	一般消費財・サービス
CARNIVAL CORP	340	323	43,700	一般消費財・サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC	218	384	51,918	素材

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
COMCAST CORP-CLASS A	1,833.9	千アメリカ・ドル 7,306	千円 986,417	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	87	467	63,051	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	448	217	29,395	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	133,369.57 603銘柄	1,314,532 <68.9%>	
(カナダ)		百株 千カナダ・ドル	千円	
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	335	1,820	189,719	生活必需品
IMPERIAL OIL LTD	91	627	65,427	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	8	1,487	155,005	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	116.87	724	75,527	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	179	902	94,005	素材
INTACT FINANCIAL CORP	70.5	1,238	129,004	金融
BCE INC	49.3	312	32,594	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	76	1,363	142,102	素材
SUNCOR ENERGY INC	567.3	2,893	301,474	エネルギー
METRO INC/CN	96	651	67,921	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	134	1,193	124,408	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	482	3,887	405,110	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	357	2,319	241,721	金融
TORONTO-DOMINION BANK	722	6,451	672,201	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	107	340	35,510	金融
ROYAL BANK OF CANADA	561.5	7,075	737,263	金融
TOURMALINE OIL CORP	125	879	91,643	エネルギー
TC ENERGY CORP	389.5	2,733	284,872	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	218.29	1,087	113,319	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	705	1,777	185,195	素材
CAE INC	126	387	40,411	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	68.12	856	89,272	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	65	258	26,936	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	35	369	38,552	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	58.5	337	35,172	素材
HYDRO ONE LTD	131	442	46,137	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	65.6	738	76,913	生活必需品
NORTHLAND POWER INC	87	323	33,668	公益事業
WSP GLOBAL INC	47	652	67,995	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	33	346	36,088	資本財・サービス
PARKLAND CORP	58	215	22,494	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	60	164	17,180	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	104	617	64,348	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC	33	322	33,608	資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A	48	184	19,226	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	140	831	86,638	コミュニケーション・サービス
BRP INC/CA- SUB VOTING	16	129	13,535	一般消費財・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	225	206	21,545	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	181.17	1,139	118,723	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	267	456	47,574	公益事業
AIR CANADA	65	116	12,171	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	465	244	25,486	素材
BANK OF MONTREAL	257	3,299	343,847	金融
POWER CORP OF CANADA	222	753	78,465	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	45	1,768	184,301	情報技術
NUTRIEN LTD	220.19	2,488	259,264	素材

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	47	211	22,004	公益事業
CAMECO CORP	158	455	47,513	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	15	229	23,913	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	71	242	25,257	資本財・サービス
LIGHTSPEED COMMERCE INC	53	139	14,529	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	26	137	14,282	情報技術
TELUS CORP	108	316	32,973	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	188	961	100,220	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	22	359	37,496	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	466	3,657	381,076	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	10	659	68,689	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	113	837	87,308	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	29.37	429	44,745	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	78	210	21,985	素材
BLACKBERRY LTD	194	129	13,503	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	232	1,376	143,402	金融
ENBRIDGE INC	803	4,467	465,554	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	559.25	3,255	339,270	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	770	1,687	175,792	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	113	108	11,291	ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	368.2	3,267	340,463	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	41	254	26,560	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	75	273	28,524	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	271.5	3,815	397,535	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	87	845	88,151	情報技術
ONEX CORPORATION	29	199	20,762	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	190	647	67,451	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	31	109	11,444	金融
TMX GROUP LTD	21	279	29,159	金融
OPEN TEXT CORP	104	502	52,320	情報技術
SAPUTO INC	95	258	26,905	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	233	743	77,497	素材
FORTIS INC	187	1,109	115,626	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	44	345	36,004	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	246	245	25,556	素材
CENOVUS ENERGY INC	555	1,594	166,148	エネルギー
DOLLARAMA INC	112	809	84,353	一般消費財・サービス
ALTAGAS LTD	111	307	32,026	公益事業
KEYERA CORP	88	294	30,690	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	286	563	58,708	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	15,743.16 86銘柄	93,764 <3.8%>	
	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
(オーストラリア)				
THE LOTTERY CORPORATION LTD	849.5	389	36,301	一般消費財・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,050.94	322	30,037	金融
BHP GROUP LTD	1,924.1	8,516	792,845	素材
SOUTH32 LTD	1,770.77	795	74,021	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	717.02	2,365	220,223	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	643.7	1,263	117,639	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,227.82	3,295	306,808	金融
WESTPAC BANKING CORP	1,348.48	2,706	251,965	金融
SANTOS LTD	1,223.04	990	92,230	エネルギー

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,065.11	2,343	218,155	金融
RIO TINTO LTD	141.34	1,569	146,127	素材
ORIGIN ENERGY LTD	647	383	35,659	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD	676	271	25,300	資本財・サービス
XERO LTD	51.35	420	39,153	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	79	188	17,526	エネルギー
COLES GROUP LTD	507.94	870	81,053	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	54	197	18,420	情報技術
IDP EDUCATION LTD	79	174	16,291	一般消費財・サービス
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	445.84	359	33,455	素材
EVOLUTION MINING LTD	656	218	20,337	素材
REECE LTD	105	145	13,568	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	512.6	366	34,121	生活必需品
SEEK LTD	128.45	278	25,962	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	275.29	298	27,808	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	340.97	791	73,710	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	647.87	5,908	550,088	金融
AMPOL LTD	88	303	28,216	エネルギー
ORICA LTD	149	233	21,737	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	562.69	647	60,244	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD	459.92	1,555	144,855	生活必需品
CROWN RESORTS LTD	134	174	16,280	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	354.69	171	15,982	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	1,563.94	586	54,601	コミュニケーション・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	164	532	49,576	素材
MACQUARIE GROUP LTD	139.28	2,275	211,815	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	229.09	784	73,049	一般消費財・サービス
CSL LTD	183.15	4,836	450,238	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	431.07	1,810	168,556	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	25.1	516	48,054	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	178	293	27,293	素材
SUNCORP GROUP LTD	480.15	503	46,847	金融
ASX LTD	73.65	570	53,154	金融
COMPUTERSHARE LTD	206.89	486	45,322	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	906.36	377	35,187	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	173.28	577	53,753	ヘルスケア
BRAMBLES LTD	527	553	51,516	資本財・サービス
MINERAL RESOURCES LTD	62	344	32,070	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD	69.73	521	48,546	ヘルスケア
REA GROUP LTD	20.23	209	19,482	コミュニケーション・サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	22	140	13,042	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	24,371.35 50銘柄	54,438 <2.0%>	
(香港)	百株	千香港・ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	580	2,966	51,027	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	880	3,630	62,436	一般消費財・サービス
MTR CORP	620	2,573	44,255	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	605	5,644	97,087	不動産
SINO LAND CO	1,420	1,590	27,354	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,116.69	5,918	101,797	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	185	884	15,209	不動産
CLP HOLDINGS LTD	670	5,058	87,006	公益事業



外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千香港・ドル	千円	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	595.07	1,749	30,091	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	4,534.75	3,868	66,532	公益事業
HANG SENG BANK LTD	310	4,247	73,048	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT	635	1,854	31,892	不動産
WH GROUP LTD	3,610	2,017	34,709	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	501	17,114	294,363	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	780	1,121	19,292	不動産
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	690	1,208	20,792	資本財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	450	858	14,767	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	911.69	4,736	81,463	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	265	1,360	23,405	公益事業
AIA GROUP LTD	5,036	39,582	680,826	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	540	1,395	24,009	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	670	2,318	39,873	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	679	1,398	24,058	生活必需品
ESR CAYMAN LTD	800	1,688	29,033	不動産
SANDS CHINA LTD	928	1,395	24,006	一般消費財・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	820	1,111	19,125	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	575	5,359	92,174	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,540	4,704	80,920	金融
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	30,947.2 28銘柄	127,358 <0.9%>	
	百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)				
CAPITALAND INVESTMENT LTD	1,074	392	38,005	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD	491	1,330	128,955	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	754	2,248	217,985	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	539.75	276	26,844	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	593	396	38,461	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	171	123	11,936	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	161	127	12,362	不動産
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,410	1,611	156,247	金融
GENTING SINGAPORE LTD	2,380	178	17,305	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	112	190	18,502	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,438.5	866	84,007	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	627	249	24,193	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	357	344	33,365	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD	800	324	31,489	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,908.25 14銘柄	8,660 <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	525	232	19,524	公益事業
MERCURY NZ LTD	300	160	13,499	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD	727.89	329	27,681	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	521.13	378	31,805	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	242	471	39,616	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,316.02 5銘柄	1,573 <0.1%>	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)				
SHELL PLC	3,052.97	7,046	1,142,972	エネルギー
BP PLC	7,812.94	3,398	551,228	エネルギー

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
UNILEVER PLC	1,027.96	3,710	601,867	生活必需品
BARCLAYS PLC	6,726.97	1,054	171,053	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	3,363.9	295	47,974	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	1,102.58	1,073	174,127	金融
NATWEST GROUP PLC	2,255.36	499	80,997	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	70.64	140	22,785	素材
BAE SYSTEMS PLC	1,262.79	978	158,707	資本財・サービス
AVIVA PLC	1,156.48	467	75,806	金融
AVEVA GROUP PLC	44	104	16,879	情報技術
GSK	2,041.62	3,495	567,031	ヘルスケア
INFORMA PLC	600.95	301	48,915	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,691	255	41,432	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	380.02	195	31,647	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	39.64	206	33,448	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	183	143	23,290	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	29	269	43,672	資本財・サービス
HALMA PLC	152.6	295	47,934	情報技術
ENTAIN PLC	227	304	49,396	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	997	111	18,072	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	301.68	183	29,703	金融
M&G PLC	1,045.04	210	34,208	金融
RELX PLC	776.24	1,615	262,026	資本財・サービス
DIAGEO PLC	929.3	3,204	519,757	生活必需品
RIO TINTO PLC	451.02	2,505	406,403	素材
STANDARD CHARTERED PLC	1,046.59	627	101,792	金融
TESCO PLC	3,063.36	755	122,587	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	353.11	411	66,671	ヘルスケア
GLENCORE PLC	3,969.5	1,918	311,193	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	132.5	102	16,588	金融
SMITHS GROUP PLC	153.83	226	36,792	資本財・サービス
PEARSON PLC	283.63	209	33,972	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	653.25	132	21,542	生活必需品
NEXT PLC	53.11	315	51,155	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	1,466.73	182	29,668	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	81.27	208	33,827	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	135.62	355	57,703	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	10,810.03	1,357	220,168	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	56.01	334	54,203	素材
KINGFISHER PLC	787.11	184	29,978	一般消費財・サービス
WPP PLC	458.47	375	60,833	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	264	271	44,022	公益事業
SEVERN TRENT PLC	97.33	273	44,316	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	747.06	337	54,822	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	286.99	1,718	278,757	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	217.32	239	38,900	金融
SCHRODERS PLC	46.5	122	19,807	金融
SSE PLC	427.91	702	113,938	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	395	192	31,216	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	622.04	6,064	983,785	ヘルスケア
FERGUSON PLC	87.77	806	130,782	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,396.89	578	93,895	金融
3I GROUP PLC	390.73	431	70,003	金融
ASHTAD GROUP PLC	178.54	651	105,736	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
SAGE GROUP PLC/THE	401.14	240	38,937	情報技術
NATIONAL GRID PLC	1,463.68	1,537	249,413	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	28,500.13	1,236	200,499	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	381.61	687	111,483	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	42.32	170	27,630	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	873.95	3,062	496,809	生活必需品
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	138	216	35,110	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	8,128.75	4,230	686,180	金融
ANGLO AMERICAN PLC	510.15	1,762	285,906	素材
MONDI PLC	188	267	43,410	素材
COMPASS GROUP PLC	716.29	1,196	194,036	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	128.32	275	44,751	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	3,453	620	100,623	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	78	130	21,180	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	160.61	255	41,501	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	71.36	310	50,364	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	64.81	274	44,500	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	132.11	890	144,392	金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	66	99	16,160	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	75	159	25,913	金融
ANTOFAGASTA PLC	153	213	34,571	素材
ABRDN PLC	843.62	142	23,181	金融
EXPERIAN PLC	370.16	859	139,481	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	114,323.91 78銘柄	70,994 <4.5%>	
	百株	千イスラエル・シュケル	千円	
(イスラエル)				
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	514.98	928	36,158	金融
AZRIELI GROUP LTD	16.5	381	14,874	不動産
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	45.41	732	28,506	情報技術
ICL GROUP LTD	281	999	38,934	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	11	745	29,043	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	528.58	1,590	61,937	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	604.86	1,881	73,254	金融
NICE LTD	26.28	1,726	67,237	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	64.07	707	27,570	金融
イスラエル・シュケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,092.68 9銘柄	9,694 <0.1%>	
	百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)				
VIFOR N. LINIE AG	18	312	42,212	ヘルスケア
UBS GROUP AG-REG	1,380.62	2,207	298,049	金融
ROCHE HOLDING AG-BR	11.8	413	55,759	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2.8	200	27,104	素材
ADECCO GROUP AG-REG	63.6	213	28,765	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	275.8	8,432	1,138,483	ヘルスケア
SIKA AG-REG	57.17	1,298	175,364	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.04	386	52,221	生活必需品
ABB LTD-REG	644.47	1,770	239,016	資本財・サービス
SWISS RE AG	118.42	899	121,507	金融
NESTLE SA-REG	1,104.93	12,001	1,620,356	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	9	766	103,525	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	16.01	280	37,934	資本財・サービス

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,040.49	614	82,937	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	87.08	401	54,151	金融
SGS SA-REG	2.52	534	72,229	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	9.34	159	21,562	資本財・サービス
TEMENOS AG - REG	25	180	24,322	情報技術
VAT GROUP AG	10.5	253	34,164	資本財・サービス
ALCON INC	196.11	1,300	175,594	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	10.9	249	33,699	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	59.05	2,474	334,120	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	18	276	37,376	金融
CLARIANT AG-REG	77	143	19,356	素材
NOVARTIS AG-REG	860.01	6,942	937,239	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1.41	292	39,519	生活必需品
BACHEM HOLDING AG-REG B	12.5	85	11,568	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	204.9	2,025	273,426	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	10	530	71,582	コミュニケーション・サービス
GEBERIT AG-REG	14	660	89,214	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	3.6	1,124	151,837	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	43.89	448	60,618	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	21.1	663	89,563	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	66	342	46,192	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	29.25	1,468	198,320	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	19	82	11,091	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD	218.29	996	134,477	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	12.37	634	85,674	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	21.35	498	67,363	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	30.25	267	36,164	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.42	392	53,018	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,806.99 41銘柄	53,230 <2.8%>	7,186,692
(デンマーク)	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	701.05	52,957	1,002,482	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	279	3,057	57,884	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1.31	2,402	45,480	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	420.42	6,738	127,559	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S	54.65	1,295	24,528	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B	41.8	3,542	67,068	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	83	3,326	62,973	素材
COLOPLAST-B	48.5	3,635	68,821	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	82.8	8,235	155,894	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	3.7	666	12,607	資本財・サービス
DEMANT A/S	42.75	1,168	22,117	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2.3	4,267	80,786	資本財・サービス
TRYG A/S	149.9	2,330	44,110	金融
PANDORA A/S	40	1,930	36,534	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	43	2,046	38,737	素材
GENMAB A/S	27.37	5,387	101,990	ヘルスケア
ORSTED A/S	78.75	5,462	103,412	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,100.3 17銘柄	108,451 <0.8%>	2,052,989
(ノルウェー)	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
DNB BANK	380.5	6,968	94,009	金融

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORSK HYDRO ASA	542	3,470	46,823	素材
ORKLA ASA	303.5	2,219	29,945	生活必需品
TELENOR ASA	291.31	3,717	50,143	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	406.87	14,390	194,134	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	66.6	3,143	42,406	素材
MOWI ASA	178	4,259	57,461	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	80.5	1,561	21,067	金融
AKER BP ASA	49	2,031	27,398	エネルギー
KONGSBERG GRUPPEN ASA	37.23	1,233	16,633	資本財・サービス
SALMAR ASA	24.52	1,668	22,509	生活必需品
ADEVINTA ASA	120	790	10,659	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,480.03 12銘柄	45,455 < 0.2% >	
	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)				
SAGAX CLASS B	79.24	1,621	21,481	不動産
INVESTOR CLASS A	200	3,782	50,111	金融
VOLVO CAR CLASS B	248.08	1,840	24,380	一般消費財・サービス
ERICSSON LM-B SHS	1,215.13	9,143	121,156	情報技術
VOLVO AB-B SHS	628.23	10,336	136,963	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES	154	2,567	34,025	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	86	1,152	15,273	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	657.78	6,643	88,027	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	202	2,325	30,806	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS	92	2,300	30,475	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	677.56	7,358	97,497	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	607.23	5,750	76,193	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	377.02	5,632	74,632	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	293	3,903	51,727	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	244	3,938	52,180	素材
SKANSKA AB-B SHS	136.5	2,213	29,326	資本財・サービス
SANDVIK AB	457	8,641	114,504	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	758.5	12,961	171,736	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	1,118.24	11,222	148,700	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS	80	1,369	18,147	資本財・サービス
HOLMEN AB-B SHARES	39.06	1,759	23,310	素材
SECURITAS AB-B SHS	119.5	1,049	13,908	資本財・サービス
TELIA CO AB	1,106.67	4,321	57,260	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	127	3,098	41,059	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	649.81	5,698	75,509	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	417.27	9,204	121,965	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	52.43	1,241	16,450	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	262.68	1,438	19,059	不動産
INDUTRADE AB	113.71	2,342	31,037	資本財・サービス
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	70.32	1,525	20,218	ヘルスケア
LUNDBERGS AB-B SHS	30	1,284	17,016	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	57	1,191	15,792	資本財・サービス
LIFCO AB-B SHS	95	1,641	21,744	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	630.92	4,532	60,056	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB	80.5	3,867	51,240	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	253.54	6,386	84,623	生活必需品
EMBRACER GROUP AB	265.94	2,147	28,453	コミュニケーション・サービス
BOLIDEN AB	113.87	4,066	53,878	素材

銘柄	柄	2022年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
EPIROC AB-A		274.36	4,861	64,416	資本財・サービス
EPIROC AB-B		157	2,377	31,505	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		170.5	1,324	17,548	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP		1,377.6	13,519	179,136	金融
EQT AB		123.18	2,691	35,662	金融
EVOLUTION AB		76.12	6,892	91,327	一般消費財・サービス
SINCH AB		213	799	10,590	情報技術
KINNEVIK AB - B		93	1,562	20,701	金融
HEXAGON AB-B SHS		810.32	8,844	117,191	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		62	1,455	19,288	金融
スウェーデン・クロネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	16,153.81 48銘柄	205,834	2,727,305	
		百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (アイルランド)</b>					
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		94	303	42,762	素材
KINGSPAN GROUP PLC		60.76	425	59,885	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		62.72	573	80,750	生活必需品
CRH PLC		301.26	1,024	144,219	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		65.69	614	86,461	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	584.43 5銘柄	2,940	414,078	
		百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (オランダ)</b>					
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV		278.91	550	77,465	コミュニケーション・サービス
QIAGEN N. V.		91.05	371	52,343	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV			349	102,750	ヘルスケア
NN GROUP NV		112.92	503	70,878	金融
HEINEKEN NV		101.96	907	127,768	生活必需品
AEGON NV		679.94	296	41,711	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		411.49	1,036	146,003	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.		71	502	70,717	素材
KONINKLIJKE DSM NV		68.8	975	137,410	素材
WOLTERS KLUWER		103.28	877	123,547	資本財・サービス
ING GROEP NV		1,536.19	1,478	208,162	金融
KONINKLIJKE KPN NV		1,278	423	59,668	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		159.79	7,529	1,060,126	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA		167	170	23,936	金融
IMCD NV		22.46	297	41,822	資本財・サービス
ADYEN NV		8.57	990	139,417	情報技術
JUST EAT TAKEAWAY		72.2	123	17,391	一般消費財・サービス
PROSUS NV		354.8	1,690	238,014	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV		37	96	13,617	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV		18	460	64,893	情報技術
RANDSTAD NV		47.2	222	31,367	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		42.5	297	41,828	生活必需品
OCI NV		43.86	146	20,564	素材
EURONEXT NV		33	243	34,281	金融
STMICROELECTRONICS NV		268.92	873	123,057	情報技術
AIRBUS SE		231.99	2,235	314,752	資本財・サービス
ARGENX SE		19.12	600	84,504	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		195	176	24,781	生活必需品
EXOR NV		42.73	258	36,338	金融
CNH INDUSTRIAL NV		402.65	501	70,667	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2022年6月15日現在			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
STELLANTIS NV		百株 866.43	千ユーロ 1,081	千円 152,223	一般消費財・サービス	
FERRARI NV		49.6	806	113,589	一般消費財・サービス	
国	小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,165.36 32銘柄	27,454 <1.5%>	3,865,605	
<b>ユーロ (ベルギー)</b>		百株	千ユーロ	千円		
UCB SA		49.76	393	55,363	ヘルスケア	
KBC GROUP NV		98.43	531	74,866	金融	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		42	334	47,155	金融	
SOLVAY SA		28	242	34,196	素材	
UMICORE		82.69	316	44,626	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		341.79	1,668	234,941	生活必需品	
AGEAS		62.9	254	35,876	金融	
D'IETTEREN GROUP		10.36	145	20,479	一般消費財・サービス	
PROXIMUS		60.35	91	12,869	コミュニケーション・サービス	
ELIA GROUP SA/NV		12	171	24,161	公益事業	
SOFINA		6	119	16,769	金融	
国	小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	794.28 11銘柄	4,270 <0.2%>	601,305	
<b>ユーロ (ルクセンブルグ)</b>		百株	千ユーロ	千円		
AROUNDTOWN SA		380	137	19,304	不動産	
ARCELORMITTAL		257	666	93,847	素材	
EUROFINS SCIENTIFIC		52.96	412	58,043	ヘルスケア	
TENARIS SA		186.08	268	37,845	エネルギー	
国	小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	876.04 4銘柄	1,484 <0.1%>	209,041	
<b>ユーロ (フランス)</b>		百株	千ユーロ	千円		
TOTALENERGIES SE		974.92	5,272	742,349	エネルギー	
MICHELIN (CGDE)		66.85	725	102,219	一般消費財・サービス	
AIR LIQUIDE SA		205.76	2,777	391,050	素材	
KERING		29.42	1,445	203,512	一般消費財・サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE		212.74	2,488	350,399	資本財・サービス	
BOUYGUES SA		90.62	274	38,635	資本財・サービス	
BNP PARIBAS		436.84	2,067	291,143	金融	
THALES SA		41	465	65,521	資本財・サービス	
DANONE		257.08	1,330	187,282	生活必需品	
CARREFOUR SA		244.54	458	64,610	生活必需品	
VIVENDI		295.91	322	45,455	コミュニケーション・サービス	
L'OREAL		95	2,865	403,487	生活必需品	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		195.72	944	132,936	資本財・サービス	
LEGRAND SA		105.24	759	106,984	資本財・サービス	
PERNOD RICARD SA		82.41	1,395	196,444	生活必需品	
EURAZEO SE		17.24	110	15,620	金融	
SOCIETE GENERALE SA		308	690	97,205	金融	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		109.21	5,941	836,496	一般消費財・サービス	
ACCOR SA		67.17	182	25,762	一般消費財・サービス	
CAPGEMINI SE		64.52	1,069	150,574	情報技術	
VALEO SA		84	158	22,329	一般消費財・サービス	
PUBLICIS GROUPE		87	400	56,458	コミュニケーション・サービス	
BUREAU VERITAS SA		116.05	290	40,931	資本財・サービス	
EIFFAGE		32.85	288	40,591	資本財・サービス	



銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
SODEXO SA	34.91	229	32,333	一般消費財・サービス
IPSEN	14	118	16,656	ヘルスケア
AMUNDI SA	22.5	107	15,073	金融
TELEPERFORMANCE	23.15	646	91,038	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	36	158	22,333	コミュニケーション・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	11	325	45,890	ヘルスケア
SEB SA	9.97	89	12,577	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA	113.17	1,522	214,316	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA	10	155	21,838	資本財・サービス
WORLDLINE SA	91.14	296	41,756	情報技術
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	41.63	133	18,815	一般消費財・サービス
AXA SA	762.06	1,706	240,240	金融
EDENRED	95	405	57,142	情報技術
RENAULT SA	70.5	170	24,071	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	12.46	1,222	172,068	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	9	137	19,350	生活必需品
DASSAULT SYSTEMES SE	262.47	879	123,783	情報技術
WENDEL	9.3	79	11,261	金融
ORANGE	785.04	852	120,061	コミュニケーション・サービス
ALSTOM	125.25	313	44,105	資本財・サービス
SANOFI	447.47	4,212	593,180	ヘルスケア
VINCI SA	209.83	1,756	247,254	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	261.79	615	86,621	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	491.28	433	61,099	金融
BIOMERIEUX	15.2	130	18,315	ヘルスケア
ENGIE	718.69	859	121,004	公益事業
EDF	221.2	180	25,414	公益事業
SAFRAN SA	134.49	1,192	167,964	資本財・サービス
ARKEMA	22.2	216	30,426	素材
ADP	11.1	135	19,129	資本財・サービス
GETLINK SE	173.45	293	41,321	資本財・サービス
BOLLORE	324	153	21,669	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,789.34 56銘柄	52,458 < 2.9% >	7,386,118
		百株	千ユーロ	千円
<b>ユーロ (ドイツ)</b>				
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	179.02	489	68,963	資本財・サービス
BAYER AG-REG	386.59	2,459	346,241	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	80	197	27,855	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	813.28	752	105,990	金融
COMMERZBANK AG	420.31	316	44,514	金融
VOLKSWAGEN AG	12	229	32,347	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	73	1,052	148,173	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	297	3,243	456,731	資本財・サービス
E.ON SE	883.44	803	113,069	公益事業
UNIPER SE	66.5	137	19,306	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	130.27	1,011	142,352	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	58	201	28,370	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	43.42	306	43,173	一般消費財・サービス
BASF SE	361.41	1,748	246,239	素材
ALLIANZ SE-REG	159	2,894	407,581	金融
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	68	399	56,278	生活必需品
RHEINMETALL AG	18.13	374	52,764	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
RWE AG	252.79	964	135,857	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	219.5	125	17,653	資本財・サービス
BRENNTAG SE	60.9	431	60,691	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	164.83	488	68,765	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	38.39	109	15,453	コミュニケーション・サービス
SAP SE	405.92	3,531	497,292	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	55.14	1,209	170,335	金融
ZALANDO SE	87.83	243	34,218	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	57.08	283	39,927	素材
KION GROUP AG	27	106	14,944	資本財・サービス
COVESTRO AG	73	289	40,702	素材
RATIONAL AG	1.9	110	15,516	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	12.1	381	53,648	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	60.35	413	58,172	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	64.43	205	28,875	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	15.92	179	25,273	ヘルスケア
BECHTLE AG	32.38	118	16,668	情報技術
NEMETSCHKE SE	22.84	131	18,478	情報技術
SCOUT24 AG	36	189	26,682	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	110.97	552	77,747	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	28	162	22,936	資本財・サービス
HELLOFRESH SE	65.16	188	26,532	生活必需品
SIEMENS ENERGY AG	172.9	269	37,989	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	39.8	370	52,138	生活必需品
MERCK KGAA	50.86	831	117,047	ヘルスケア
ADIDAS AG	72	1,184	166,804	一般消費財・サービス
PUMA SE	41.63	275	38,744	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	41.01	239	33,750	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,275.96	2,273	320,109	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	80.7	407	57,335	ヘルスケア
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	325	2,024	285,039	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	513.88	1,247	175,603	情報技術
HANNOVER RUECK SE	23.78	331	46,624	金融
DEUTSCHE POST AG-REG	390.03	1,348	189,900	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	74.78	1,135	159,883	金融
MTU AERO ENGINES AG	21.04	355	49,991	資本財・サービス
SYMRISE AG	52.28	500	70,459	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	413.12	114	16,170	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	22	158	22,271	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	280	885	124,658	不動産
LEG IMMOBILIEN SE	28	232	32,784	不動産
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,860.57 58銘柄	41,219 <2.3%>	5,803,636
ユーロ (ポルトガル)	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	105	197	27,823	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,094	490	69,130	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	187.5	236	33,316	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,386.5 3銘柄	925 <0.1%>	130,271
ユーロ (スペイン)	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA	2,044.87	901	126,942	コミュニケーション・サービス

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
ENDESA SA	121	230	32,514	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,623.74	1,100	154,935	金融
IBERDROLA SA	2,279.05	2,249	316,782	公益事業
REPSOL SA	572.01	877	123,587	エネルギー
GRIFOLS SA	118.3	208	29,340	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	6,823.35	1,789	251,998	金融
AMADEUS IT GROUP SA	177.28	898	126,502	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA	103	278	39,257	公益事業
CAIXABANK SA	1,749.27	562	79,233	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	88.76	213	30,018	資本財・サービス
AENA SME SA	29	380	53,551	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA	214.6	761	107,205	コミュニケーション・サービス
ACCIONA SA	10.28	182	25,648	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	429.2	966	136,030	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	94.14	168	23,746	資本財・サービス
ENAGAS SA	98.84	206	29,113	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	157	282	39,712	公益事業
FERROVIAL SA	190.18	442	62,310	資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA	110	238	33,516	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	18,033.87 20銘柄	12,939 <0.7%>	1,821,951
	百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (イタリア)</b>				
PRYSMIAN SPA	100.4	277	39,129	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	435.47	675	95,128	金融
MEDIOBANCA SPA	223.65	200	28,208	金融
UNICREDIT SPA	832.17	808	113,830	金融
TELECOM ITALIA SPA	3,787.82	93	13,231	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO	6,498.77	1,150	161,959	金融
ATLANTIA SPA	195.31	434	61,131	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	192	175	24,649	金融
MONCLER SPA	78	299	42,150	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	38.5	144	20,371	ヘルスケア
ENI SPA	993.14	1,307	184,161	エネルギー
DIASORIN SPA	10	111	15,699	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	128	118	16,656	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA	199	145	20,482	情報技術
AMPLIFON SPA	47	123	17,450	ヘルスケア
ENEL SPA	3,200.36	1,706	240,310	公益事業
SNAM SPA	793.5	403	56,800	公益事業
TERNA SPA	554.64	400	56,445	公益事業
FINECOBANK SPA	232	239	33,759	金融
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	18,539.73 19銘柄	8,817 <0.5%>	1,241,558
	百株	千ユーロ	千円	
<b>ユーロ (フィンランド)</b>				
UPM-KYMMENE OYJ	210.01	642	90,511	素材
NOKIA OYJ	2,129.8	962	135,543	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	170	122	17,291	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	214	333	46,959	素材
ELISA OYJ	54	283	39,932	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS	196.22	796	112,168	金融
FORTUM OYJ	169	280	39,440	公益事業

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
KESKO OYJ-B SHS	104	227	32,068	生活必需品
KONE OYJ-B	133.75	598	84,254	資本財・サービス
NESTE OYJ	166.46	697	98,273	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	40	146	20,573	ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,587.24 11銘柄	5,092 <0.3%>	
ユーロ (オーストリア)	百株	千ユーロ	千円	
VERBUND AG	26	245	34,503	公益事業
OMV AG	56.5	275	38,733	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	135.46	358	50,409	金融
VOESTALPINE AG	42.5	108	15,295	素材
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	260.46 4銘柄	986 <0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	71,877.82 223銘柄	158,590 <8.7%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	435,491.09 1,214銘柄	— <94.1%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (2) 外国投資信託証券

銘柄	□数	2022年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千□	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5.737	1,062	143,439
SIMON PROPERTY GROUP INC	13.307	1,284	173,387
BOSTON PROPERTIES INC	6	543	73,423
VORNADO REALTY TRUST	6.297	182	24,620
SBA COMMUNICATIONS CORP	4.4	1,307	176,466
EQUITY RESIDENTIAL	14.5	997	134,646
EQUINIX INC	3.708	2,293	309,636
AMERICAN TOWER CORP	18.5	4,338	585,682
HOST HOTELS & RESORTS INC	29.043	498	67,364
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	13	428	57,813
KIMCO REALTY CORP	25	480	64,804
INVITATION HOMES INC	24.7	830	112,147
VICI PROPERTIES INC	39	1,097	148,115
VENTAS INC	16.2	784	105,924
WEYERHAEUSER CO	30.314	1,043	140,870
CROWN CASTLE INTL CORP	17.5	2,763	373,113
IRON MOUNTAIN INC	11.8	557	75,322
SUN COMMUNITIES INC	4.7	709	95,841
PROLOGIS INC	30.002	3,320	448,236

銘柄	□ 数	2022年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6.2	839	113,313
CAMDEN PROPERTY TRUST	4	504	68,045
DUKE REALTY CORP	15.5	793	107,143
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2.6	666	89,936
WELLTOWER INC	18.1	1,401	189,263
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	21.9	513	69,305
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4.7	752	101,546
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7.2	494	66,752
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	63.4	375	50,673
REALTY INCOME CORP	23.995	1,506	203,412
PUBLIC STORAGE	6.4	1,906	257,352
REGENCY CENTERS CORP	6.3	356	48,141
UDR INC	12.9	545	73,705
WP CAREY INC	7.7	623	84,174
DIGITAL REALTY TRUST INC	11.5	1,432	193,409
EXTRA SPACE STORAGE INC	5.4	857	115,730
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	24.2	361	48,812
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	555.703 36銘柄	38,453 <2.0% >
		千口	千カナダ・ドル
(カナダ)			千円
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3.4	150	15,652
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5.8	116	12,153
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	9.2 2銘柄	266 <0.0% >
		千口	千オーストラリア・ドル
(オーストラリア)			千円
DEXUS/AU	40.978	371	34,602
LENDLEASE GROUP	25.3	243	22,706
TRANSURBAN GROUP	116.72	1,630	151,806
APA GROUP	45.041	517	48,223
SCENTRE GROUP	190.722	486	45,278
GPT GROUP	73.031	303	28,284
MIRVAC GROUP	144.9	297	27,654
STOCKLAND	91.123	328	30,540
GOODMAN GROUP	63.909	1,144	106,563
VICINITY CENTRES	137.273	239	22,301
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	928.997 10銘柄	5,563 <0.2% >
		千口	千香港・ドル
(香港)			千円
LINK REIT	87.9	6,012	103,412
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	107	817	14,060
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	152	1,629	28,026
香港・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	346.9 3銘柄	8,459 <0.1% >
		千口	千シンガポール・ドル
(シンガポール)			千円
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	134.5	369	35,859
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	220.07	466	45,231
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	125.3	202	19,679

# 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2022年6月15日現在		
		□ 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		千口 87.5	千シンガポール・ドル 154	千円 14,930
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	567.37 4銘柄	1,193	115,701 <0.0%>
(イギリス)		千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC		28,317	207	33,604
SEGRO PLC		48,274	460	74,765
BRITISH LAND CO PLC		35,395	179	29,086
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	111,986 3銘柄	847	137,456 <0.1%>
(ユーロ(ベルギー))		千口	千ユーロ	千円
WAREHOUSES DE PAUW SCA		6,192	190	26,817
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,192 1銘柄	190	26,817 <0.0%>
(ユーロ(フランス))		千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		4.6	246	34,650
GECINA SA		1,817	173	24,483
KLEPIERRE		8,527	160	22,595
COVIVIO		2	113	15,966
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	16,944 4銘柄	693	97,696 <0.0%>
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	23,136 5銘柄	884	124,513 <0.0%>
フ ァ ン ド 合 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,543,292 63銘柄	—	6,260,515 <2.4%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (3)先物取引の銘柄別残高(評価額)

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

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

(注2) 単位未満は切捨て。

# 外国株式インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第22期 (決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日)

外国株式インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

## 大和アセットマネジメント

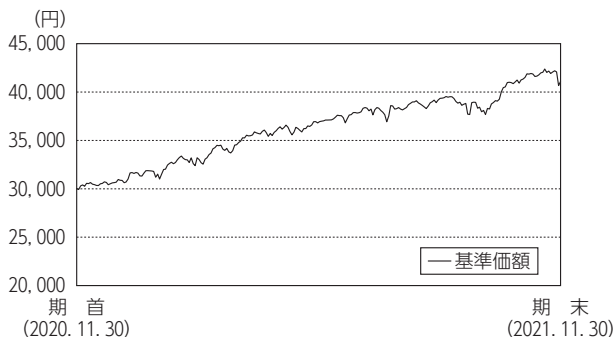
Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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



■当作成期中の基準価額と市況等の推移



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

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

(注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：30,015円 期末：41,095円 騰落率：36.9%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。

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

○為替相場

為替相場は、当作成期を通じて見ると円安が進みました。

為替相場は、当作成期首より、米国において民主党が大統領・議会上下両院を制したことから、株価が上昇するなど市場のリスク選好姿勢が強まり、円安となりました。2021年3月には、米国での追加経済対策の成立や、経済指標の改善により米国金利が上昇したことなどから米ドルが買い進められ、全般的に円安が進行しました。7月以降は、新型コロナウイルスの新規感染者数の増加を受けた景気への懸念などを受け、円高が進みました。9月以降は、日本以外の各国で利上げ観測が高まり、金融政策の方向性の違いを要因として、円安となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

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

\*ベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ベース)です。

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

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

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

(注 2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	アメリカ	百株 15,282.5 (△ 828.54)	千アメリカ・ドル 166,102 (△ 1,904)	百株 1,904.86	千アメリカ・ドル 9,623
	カナダ	百株 1,880 ( 214.08)	千カナダ・ドル 10,122 (△ 32)	百株 356.08	千カナダ・ドル 732
	オーストラリア	百株 1,960.2 ( 301.86)	千オーストラリア・ドル 5,090 (△ 238)	百株 1,186.06	千オーストラリア・ドル 243
	香港	百株 5,643 ( 201.17)	千香港・ドル 21,457 (△ 19)	百株 2,647.4	千香港・ドル 5,196
	シンガポール	百株 1,052 ( 1,013.12)	千シンガポール・ドル 801 (△ 98)	百株 1,953.12	千シンガポール・ドル 132
	ニュージーランド	百株 344 ( — )	千ニュージーランド・ドル 292 ( — )	百株 —	千ニュージーランド・ドル —
	イギリス	百株 11,569.5 (△ 1,546.66)	千イギリス・ポンド 7,107 ( 1,666)	百株 107.38	千イギリス・ポンド 63
	イスラエル	百株 294.5 ( — )	千イスラエル・シェケル 944 ( — )	百株 —	千イスラエル・シェケル —
	スイス	百株 548.91 ( — )	千スイス・フラン 4,917 (△ 90)	百株 36	千スイス・フラン 364
	デンマーク	百株 290.45 ( 650.6)	千デンマーク・クローネ 11,548 ( — )	百株 411	千デンマーク・クローネ 1,511
ノルウェー	百株 333.5 ( — )	千ノルウェー・クローネ 5,172 ( — )	百株 —	千ノルウェー・クローネ —	

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	スウェーデン	百株 1,523 ( 2,840.43)	千スウェーデン・クローネ 32,328 ( — )	百株 663.5	千スウェーデン・クローネ 2,486
	ユーロ (アイルランド)	百株 57.2 ( — )	千ユーロ 414 ( — )	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (オランダ)	百株 1,074.8 (△ 72)	千ユーロ 4,391 (△ 98)	百株 335.09	千ユーロ 482
	ユーロ (ベルギー)	百株 51 ( — )	千ユーロ 327 ( — )	百株 28.4	千ユーロ 138
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 143.5 ( — )	千ユーロ 242 ( — )	百株 177	千ユーロ 111
	ユーロ (フランス)	百株 748 (△ 93.56)	千ユーロ 4,645 (△ 164)	百株 230	千ユーロ 137
	ユーロ (ドイツ)	百株 804.1 ( 354.42)	千ユーロ 4,935 (△ 88)	百株 663.32	千ユーロ 919
	ユーロ (ポルトガル)	百株 134 ( — )	千ユーロ 78 ( — )	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (スペイン)	百株 2,106.38 ( 8,378.69)	千ユーロ 1,626 ( 156)	百株 8,900.19	千ユーロ 346
	ユーロ (イタリア)	百株 2,231 ( — )	千ユーロ 972 (△ 1)	百株 241.75	千ユーロ 129
国	ユーロ (フィンランド)	百株 269.5 ( — )	千ユーロ 642 ( — )	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (オーストリア)	百株 26.8 ( — )	千ユーロ 104 ( — )	百株 21	千ユーロ 74
	ユーロ (その他)	百株 — ( — )	千ユーロ — (△ 2,409)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 7,646.28 ( 8,567.55)	千ユーロ 18,379 (△ 2,606)	百株 10,596.75	千ユーロ 2,340

(注 1) 金額は受渡し代金。

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

(注 3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 新株予約権証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

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

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) ( )内は、割当、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注 3) 単位未満は切捨て。

# 外国株式インデックスマザーファンド

## (3) 投資信託証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

## (4) 先物取引の種類別取引状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■主要な売買銘柄 株 式

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

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

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TE CONNECTIVITY LTD	106.75	119.25	1,900	216,245	情報技術
APPLE INC	5,678	6,056	97,041	11,040,393	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	102	110.5	1,252	142,461	金融
BOEING CO/THE	175.6	201.3	3,995	454,602	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	51.65	55.65	659	75,000	金融
BECTON DICKINSON AND CO	94.19	106.19	2,586	294,310	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	67	76	76	8,750	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	43.5	49	443	50,479	資本財・サービス
CDK GLOBAL INC	40	—	—	—	情報技術
NISOURCE INC	126	139	350	39,930	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	44.5	49	468	53,305	資本財・サービス
BOSTON BEER COMPANY INC-A	—	3.2	141	16,105	生活必需品
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	260.21	300.71	1,714	195,041	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,355.04	1,502.04	7,759	882,802	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	455.5	488.5	13,781	1,567,928	金融
ANSYS INC	27.8	32	1,272	144,795	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	444.17	490.67	2,996	340,858	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	222	249.5	3,714	422,605	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	740	810	4,425	503,527	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	997.7	1,097.7	17,698	2,013,526	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	77	83	1,718	195,487	金融
LKQ CORP	91.5	102.5	590	67,169	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	16.6	18.3	283	32,291	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	100.62	114.12	846	96,324	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	93	100.5	1,876	213,459	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	40.1	42.2	1,239	141,012	金融
DOLLAR GENERAL CORP	83.5	88.5	1,991	226,614	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	62.6	71.5	4,810	547,309	情報技術
CATERPILLAR INC	176.5	198.5	3,889	442,452	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	79.5	85.5	559	63,626	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	73	83	402	45,741	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	—	18	675	76,858	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	93	106.5	651	74,068	公益事業
MOSAIC CO/THE	120.5	128	461	52,468	素材
DELTA AIR LINES INC	51.5	57.5	208	23,707	資本財・サービス
CORNING INC	246	294	1,130	128,642	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,382.5	1,529.5	8,528	970,286	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	42	—	—	—	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	459.02	506.52	4,924	560,305	金融
ZILLOW GROUP INC - A	—	21	113	12,939	不動産
MSCI INC	28.2	30	1,936	220,312	金融
FAIR ISAAC CORP	10	10	350	39,894	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	11	12	386	43,977	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	75	85	667	75,893	情報技術
BROADCOM INC	130.52	148.12	8,359	951,003	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	37.8	43.5	786	89,448	ヘルスケア
ARAMARK	72	85	292	33,247	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	72.5	—	—	—	素材
DTE ENERGY COMPANY	62.5	71.7	799	90,945	公益事業
CENTENE CORP	189.87	213.87	1,577	179,497	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	35	39.5	512	58,286	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	143	157	765	87,130	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	61.5	75	1,236	140,628	金融

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
GARTNER INC	29.2	31.5	1,023	116,472	情報技術
SPLUNK INC	51.8	60.1	751	85,469	情報技術
DOMINION ENERGY INC	276.41	294.41	2,190	249,269	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	128.5	143	1,241	141,297	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	42.5	50	404	45,997	資本財・サービス
DEERE & CO	96.5	108	3,759	427,703	資本財・サービス
POOL CORP	—	14.8	828	94,309	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	98.84	106.84	1,284	146,178	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	28.3	74.8	900	102,443	情報技術
CABLE ONE INC	1.7	2	365	41,548	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	21.9	24	704	80,104	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	37	42	878	99,905	金融
VAIL RESORTS INC	13.6	14.9	496	56,525	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	46	—	—	—	金融
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	—	184	677	77,119	コミュニケーション・サービス
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	22.5	—	—	—	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	24.3	26.3	363	41,333	金融
CONSOLIDATED EDISON INC	109	126	1,012	115,181	公益事業
COGNEX CORP	55	65	511	58,169	情報技術
TELEFLEX INC	15	17.2	531	60,456	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	28	30.5	597	67,966	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	24	27.1	1,212	137,934	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	7.1	7.9	592	67,369	ヘルスケア
CATALENT INC	51.5	62	830	94,491	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	44.8	50.5	1,485	168,966	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	20	21.2	630	71,761	ヘルスケア
IDEX CORP	25.2	27.6	646	73,609	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	268	293.5	2,280	259,485	生活必需品
ROLLINS INC	49.25	80.87	285	32,505	資本財・サービス
AMETEK INC	74.25	84.45	1,182	134,519	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	82	89	834	94,926	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	43.5	55.5	320	36,515	資本財・サービス
HEICO CORP	14	16	224	25,517	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	31	—	—	—	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	—	23.2	985	112,066	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	12.4	14	657	74,769	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	88.5	97	864	98,405	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	13	15	781	88,959	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	144.4	160.6	8,911	1,013,846	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	26	28	331	37,739	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	18	20	1,268	144,299	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	43.5	46	427	48,681	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	8.8	10	1,678	190,917	一般消費財・サービス
UGI CORP	70.5	76.5	332	37,772	公益事業
CUMMINS INC	48.5	53.5	1,162	132,245	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	253	283.5	1,709	194,522	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	46.5	51	993	113,028	情報技術
SIGNATURE BANK	16.5	—	—	—	金融
COSTAR GROUP INC	13.1	145	1,159	131,956	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	17.1	20.2	1,463	166,501	金融
AMERCO	2.9	3.7	265	30,191	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	31.5	36.4	1,300	147,932	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	14.8	16.1	1,986	226,049	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	25	27.6	420	47,826	情報技術

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	90.16	100.16	1,382	157,333	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	11.7	14.2	231	26,362	情報技術
DEXCOM INC	30	35.4	2,021	229,971	ヘルスケア
NORDSON CORP	17.3	19.1	500	56,965	資本財・サービス
COPART INC	68.5	78.3	1,158	131,850	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	51.5	—	—	—	エネルギー
SEAGEN INC	39.5	49.5	818	93,096	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	25.1	27.1	1,719	195,617	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	17.1	18.9	1,104	125,622	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	—	14	671	76,404	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	28	33.5	283	32,296	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	—	77.5	791	90,005	ヘルスケア
NIELSEN HOLDINGS PLC	111	—	—	—	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	673.81	733.81	1,174	133,660	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	90	98	2,253	256,348	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	12.2	14	494	56,218	金融
COTERRA ENERGY INC	124	290	604	68,758	エネルギー
T-MOBILE US INC	183.27	226.77	2,571	292,567	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	45.5	59.5	322	36,730	不動産
COCA-COLA CO/THE	1,336	1,486.5	8,113	923,052	生活必需品
COCA-COLA EUROPA PACIFIC PARTNE	65	73.5	380	43,332	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	55.5	61.5	779	88,692	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	95	111.5	376	42,813	金融
CSX CORP	252.5	821	2,924	332,709	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	31.3	34.6	1,010	114,912	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	43.75	51.75	861	98,028	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	27.5	29.5	282	32,196	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	138.8	164.7	58,659	6,673,641	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	202.4	226.9	2,512	285,791	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,384.05	1,536.05	9,460	1,076,324	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	42	—	—	—	その他
AES CORP	219	246	581	66,106	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	13.5	15	396	45,116	金融
EOG RESOURCES INC	193	210	1,856	211,178	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	52	60	685	77,996	情報技術
ABIOMED INC	15.2	16.1	513	58,453	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	49.5	56.8	682	77,694	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	101.4	111.7	1,713	194,967	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1,263.23	1,433.23	2,819	320,736	一般消費財・サービス
NOVAVAX INC	—	26	504	57,373	ヘルスケア
DISCOVERY INC - A	46.9	62.9	154	17,596	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	48.5	62.5	541	61,556	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48.87	56.37	155	17,726	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	8.5	8.5	132	15,118	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	103.89	113.89	273	31,162	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	40	—	—	—	資本財・サービス
FORTINET INC	48	50.5	1,733	197,239	情報技術
MARKEL CORP	4.6	5.1	634	72,165	金融
NEXTERA ENERGY INC	640.8	711.8	6,310	717,981	公益事業
MASIMO CORP	17	19.2	553	62,973	ヘルスケア
FREEMPORT-MCMORAN INC	472.08	536.08	2,036	231,639	素材
INSULET CORP	22.2	24.4	721	82,133	ヘルスケア
US BANCORP	441.5	512	2,938	334,356	金融
UNITED RENTALS INC	23.5	25.7	917	104,388	資本財・サービス



銘柄	株数	当 株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
F5 NETWORKS INC	19	22.5	519	59,149	情報技術
FASTENAL CO	186	210.5	1,282	145,942	資本財・サービス
FISERV INC	185.83	219.33	2,137	243,218	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	2,880.5	398.56	3,921	446,186	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	426	476.5	2,852	324,509	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	—	43.7	415	47,286	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	79.5	87.5	1,701	193,562	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	107.6	123.5	4,773	543,111	金融
ALPHABET INC-CL A	98.2	109	31,725	3,609,427	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	98.87	105.57	30,850	3,509,862	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	33.5	39	339	38,659	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	200.5	220.5	1,400	159,348	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	180.68	197.68	771	87,823	公益事業
GENUINE PARTS CO	48.5	51	677	77,117	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	125.84	138.84	1,806	205,551	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	230	259	1,113	126,676	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	71.6	75.5	1,620	184,402	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	276	326	725	82,523	エネルギー
HOME DEPOT INC	352	385.5	15,682	1,784,244	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	19	22.5	351	39,943	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	318	529	813	92,503	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	12.9	15.1	274	31,218	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	47.4	53.9	965	109,864	生活必需品
HUMANA INC	43.5	47.2	2,020	229,871	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	93	101	2,261	257,324	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	23.6	28.2	626	71,250	情報技術
HENRY SCHEIN INC	45	51	376	42,803	ヘルスケア
HP INC	473	473	1,699	193,350	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	419	476	695	79,119	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	59.78	59.78	297	33,822	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	65	70	420	47,823	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	29.5	29.5	147	16,744	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	132	144	600	68,365	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	217.53	243.03	845	96,165	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	—	46.9	1,203	136,975	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	291.5	324	3,839	436,808	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	122	137.5	649	73,868	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	43.5	49	504	57,397	資本財・サービス
ZOETIS INC	156	173	3,867	439,995	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	79.79	87.79	1,693	192,695	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	76.5	88.5	943	107,331	エネルギー
ALLEGION PLC	29	33	424	48,311	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	129.73	129.73	362	41,208	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	85.07	94.87	1,301	148,074	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	105	122	388	44,193	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC	24	—	—	—	ヘルスケア
JM SMUCKER CO/THE	36.7	40.5	523	59,609	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	862	955	15,256	1,735,689	ヘルスケア
PLUG POWER INC	—	186	774	88,072	資本財・サービス
ABBVIE INC	577.72	640.72	7,489	852,066	ヘルスケア
HOLOGIC INC	83.5	91.5	695	79,084	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	112.5	122	1,647	187,434	生活必需品
KROGER CO	255	264	1,118	127,199	生活必需品
KLA CORP	50.3	55.6	2,300	261,779	情報技術



## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LOCKHEED MARTIN CORP	82.6	90.3	3,081	350,560	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	27.8	29.3	624	70,996	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	—	97	735	83,727	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	244.5	260	6,463	735,304	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	281.85	295.35	7,526	856,278	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	48.2	52	3,538	402,610	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	16.5	—	—	—	不動産
LOEWS CORP	83	83	457	52,039	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	62.49	66.49	454	51,696	金融
MCDONALD'S CORP	243	270.5	6,770	770,292	一般消費財・サービス
3M CO	188.5	210.4	3,707	421,845	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	787.5	869	29,374	3,341,971	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	79	87.7	4,077	463,889	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	21.1	23.1	966	109,943	素材
SOLAREDDGE TECHNOLOGIES INC	—	19.2	666	75,843	情報技術
CONCHO RESOURCES INC	62	—	—	—	その他
PHILLIPS 66	141.5	157.5	1,100	125,180	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	152.5	160.5	660	75,103	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	40.5	92	800	91,051	生活必需品
METLIFE INC	255.5	270	1,617	183,969	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	217	299.5	2,246	255,624	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	18.7	84.8	1,073	122,139	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	48	48	404	46,008	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	56.58	62.28	1,616	183,871	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	8	8.5	1,305	148,559	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	213.73	265.23	624	71,002	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	37.6	41.9	1,427	162,353	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	826.21	918.21	6,876	782,336	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	242.18	207.51	1,598	181,879	素材
MASCO CORP	87	91	612	69,717	資本財・サービス
M & T BANK CORP	42.89	46.89	713	81,172	金融
MARSH & MCLENNAN COS	168.5	185.2	3,093	351,935	金融
BLACK KNIGHT INC	50	56	409	46,598	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	25	27.2	345	39,300	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	91.22	101.72	1,533	174,481	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	56.8	69	1,942	221,051	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	21	27.1	724	82,477	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	118	142	3,022	343,898	情報技術
TRANSUNION	61.5	69	787	89,593	資本財・サービス
VISTRA CORP	142.5	156.5	314	35,770	公益事業
BEIGENE LTD-ADR	14.5	—	—	—	ヘルスケア
NOVOCURE LTD	—	34.5	322	36,640	ヘルスケア
NETAPP INC	74.5	82	750	85,380	情報技術
NIKE INC -CL B	406	462	7,847	892,866	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	84.5	90.5	2,432	276,699	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	80	201	1,696	193,003	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	41.5	68.55	689	78,433	金融
ALLY FINANCIAL INC	125.5	136.5	651	74,091	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	52.2	57.1	2,034	231,520	資本財・サービス
APTIV PLC	87	97.5	1,613	183,571	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	264.61	293.11	1,623	184,743	素材
MCKESSON CORP	52.5	57.5	1,283	146,058	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	87	—	—	—	情報技術
XYLEM INC	58.7	66.7	825	93,945	資本財・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	510	565	4,935	561,486	生活必需品
NUCOR CORP	99	109.5	1,227	139,614	素材
SUNRUN INC	39	61	291	33,214	資本財・サービス
WESTERN UNION CO	129.46	152.46	246	28,030	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	57	60	414	47,162	情報技術
NEWELL BRANDS INC	125.42	134.42	300	34,179	一般消費財・サービス
EVERGY INC	74	82.5	538	61,253	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	302.24	343.24	1,031	117,385	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	8.2	9	183	20,907	金融
OKTA INC	38.6	45.1	1,008	114,734	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	21.8	25.5	516	58,794	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	36	56	895	101,899	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	133.55	157.55	475	54,113	ヘルスケア
LINDE PLC	171.96	188.46	6,044	687,701	素材
WIX.COM LTD	17.8	21.3	339	38,620	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	133	143	461	52,451	金融
KKR & CO INC	163	188	1,434	163,217	金融
PAYCHEX INC	107	117	1,447	164,698	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	24.1	24.8	1,597	181,746	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	611.5	667	2,900	329,946	生活必需品
P G & E CORP	355	551	682	77,606	公益事業
PFIZER INC	1,819.13	2,031.13	10,643	1,210,867	ヘルスケア
CIGNA CORP	121.6	126.2	2,519	286,595	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	78.51	101.01	581	66,158	情報技術
ALTICE USA INC- A	109	109	174	19,829	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	174.5	197	1,292	147,004	公益事業
STERIS PLC	28.5	36	816	92,845	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	—	27	804	91,527	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	54.33	54.33	187	21,318	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	108.49	121.99	450	51,240	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	111.2	123.3	3,002	341,577	ヘルスケア
LYFT INC-A	—	92	384	43,772	資本財・サービス
DOW INC	240.68	273.68	1,556	177,042	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	28	38.5	374	42,618	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	51.8	77.4	1,694	192,829	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	41.7	46.6	1,440	163,896	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	315	445	1,766	200,991	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	53.5	84.5	1,549	176,274	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	809.17	886.67	13,213	1,503,260	生活必需品
EXELON CORP	322.72	357.72	1,937	220,460	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	73.5	—	—	—	その他
TELADOC HEALTH INC	23	51	542	61,741	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	113.58	147.08	879	100,065	資本財・サービス
NVR INC	1.1	1.2	633	72,108	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	355	492.02	3,549	403,874	エネルギー
TWILIO INC - A	40.5	59.5	1,744	198,496	情報技術
DOCUSIGN INC	57.5	71	1,785	203,153	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	16.1	18.9	845	96,208	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	50	564	64,262	情報技術
PEPSICO INC	454	501	8,223	935,577	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	13	15	265	30,199	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	80	114	284	32,359	情報技術
MONGODB INC	16.2	20.2	1,062	120,878	情報技術
SNAP INC - A	295	347.5	1,697	193,128	コミュニケーション・サービス

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CORTEVA INC	248.18	269.18	1,254	142,680	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	128	143	1,501	170,874	金融
AMCO PLC	522	564	653	74,304	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	46.5	69	1,549	176,290	情報技術
ROKU INC	33.5	42.2	976	111,039	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	60	65.5	1,135	129,156	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	208.5	230.5	8,432	959,325	情報技術
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	126	—	—	—	情報技術
10X GENOMICS INC-CLASS A	—	27.5	397	45,193	ヘルスケア
PENTAIR PLC	55.05	59.25	455	51,769	資本財・サービス
QUALCOMM INC	364.5	408.5	7,505	853,932	情報技術
INVESCO LTD	120	141	327	37,280	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	23.5	23.5	534	60,762	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	92	100	709	80,685	金融
DATADOG INC - CLASS A	43.5	68	1,244	141,567	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	131	199	806	91,783	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	25	30.5	435	49,516	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	33.2	38	2,486	282,914	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	74	82.5	1,140	129,743	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	13.5	15	3,273	372,370	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	118	131	1,462	166,416	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	31	34.5	461	52,478	素材
RESMED INC	48.5	53.3	1,369	155,794	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	43.5	47.3	741	84,325	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	36	41.5	476	54,183	資本財・サービス
MODERNA INC	88	123.7	4,558	518,616	ヘルスケア
RALPH LAUREN CORP	14.5	—	—	—	一般消費財・サービス
HUBSPOT INC	—	15.9	1,354	154,105	情報技術
PERKINELMER INC	37.3	41.3	764	87,029	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	266.37	302.37	1,692	192,574	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	137.18	149.38	1,248	142,043	資本財・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	58	63	462	52,573	金融
AVANTOR INC	155	193.5	769	87,573	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	47	57	323	36,834	金融
DYNATRACE INC	61	67	431	49,142	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	13.3	158.2	1,693	192,691	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	321.35	351.85	828	94,230	金融
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	—	65.5	270	30,806	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	25.3	28.8	376	42,860	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	81.7	93.7	1,256	142,932	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	610.18	701.18	8,053	916,195	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A	65	94	417	47,472	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	24	30	1,067	121,479	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	123.5	140	924	105,234	公益事業
ETSY INC	—	46.5	1,308	148,911	一般消費財・サービス
TESLA INC	242.7	296.2	33,677	3,831,505	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10	70	2,553	290,507	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	178.5	214	541	61,621	情報技術
DRAFTKINGS INC - CL A	—	117	411	46,855	一般消費財・サービス
UNITY SOFTWARE INC	—	21	357	40,694	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	50.22	58.52	1,077	122,603	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	50.4	55.8	1,985	225,919	情報技術
CARVANA CO	—	26.2	764	87,029	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	—	32.5	223	25,387	一般消費財・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	—	85	1,624	184,792	情報技術
PPD INC	—	44	207	23,627	ヘルスケア
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	46.85	47.85	3,197	363,755	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	386.21	433.21	542	61,706	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	—	27	494	56,216	一般消費財・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	—	46	828	94,243	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	108.5	121.5	1,190	135,410	不動産
TWITTER INC	259.5	292	1,336	152,085	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	347.5	386.5	2,427	276,232	公益事業
SYSCO CORP	160	187.5	1,372	156,149	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	84.03	91.03	1,387	157,832	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	—	20	100	11,488	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	43	43	264	30,096	金融
STEEL DYNAMICS INC	66	76.5	469	53,438	素材
SCHLUMBERGER LTD	460.02	503.52	1,492	169,851	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	50.5	58.5	338	38,535	資本財・サービス
AT&T INC	2,332.91	2,589.91	6,187	703,928	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	47	55.5	247	28,123	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	129	155	976	111,131	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	75	701	79,764	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	26.9	91.7	3,065	348,744	素材
SEMPRA ENERGY	96.7	114	1,415	161,084	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	—	65	325	37,019	情報技術
CLARIVATE PLC	—	125	285	32,467	資本財・サービス
OAK STREET HEALTH INC	—	36	110	12,561	ヘルスケア
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	—	560	1,179	134,239	情報技術
TIFFANY & CO	36.5	—	—	—	その他
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	76.5	79.5	827	94,119	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	297.5	335	6,511	740,839	情報技術
SALESFORCE.COM INC	294.21	352.16	10,449	1,188,896	情報技術
WESTROCK CO	85.3	98.8	455	51,841	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	244.84	259.34	2,032	231,202	資本財・サービス
TERADYNE INC	55	60.5	934	106,309	情報技術
UNION PACIFIC CORP	219.8	240.8	5,766	656,020	資本財・サービス
MARATHON PETROLEUM CORP	215.88	234.88	1,451	165,090	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	494.79	549.29	4,555	518,314	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	230.5	262	5,361	609,985	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	62.44	70.44	1,878	213,724	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	43.5	43.5	270	30,807	金融
AMEREN CORPORATION	80.5	92	782	89,062	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	310.16	342.16	15,465	1,759,524	ヘルスケア
VERISIGN INC	33.7	37	904	102,905	情報技術
VALERO ENERGY CORP	131.42	147.92	1,008	114,722	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	17.6	18.9	758	86,315	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	86.88	98.88	493	56,191	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	25	28.3	343	39,045	ヘルスケア
ANTHEM INC	83	89.2	3,712	422,391	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	591.62	658.62	9,735	1,107,558	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,274.22	1,499.22	7,370	838,503	金融
WASTE MANAGEMENT INC	140	152	2,535	288,499	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	402	438	1,226	139,577	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	37	42.5	963	109,614	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	19.5	23.2	516	58,801	一般消費財・サービス
WALMART INC	464	561	8,001	910,335	生活必需品

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	67.5	76.5	944	107,487	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	30.5	37	307	34,938	一般消費財・サービス
WABTEC CORP	58.61	65.11	602	68,497	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	394	438	3,095	352,157	一般消費財・サービス
WATERS CORP	20.5	22.3	760	86,569	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	17.6	18.9	1,147	130,563	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	247	265	1,221	138,926	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	41.73	47.43	1,092	124,321	金融
WESTERN DIGITAL CORP	97.5	112.5	663	75,502	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	104.8	114.3	1,034	117,672	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	168	182.5	1,172	133,402	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	552	612.5	12,022	1,367,829	情報技術
PPL CORP	248	279	793	90,273	公益事業
PULTEGROUP INC	89	94.5	486	55,379	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	78.5	85.3	1,342	152,711	素材
NORTHERN TRUST CORP	64	73	875	99,612	金融
NVIDIA CORP	201	903.8	30,165	3,431,898	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	138.43	154.63	3,106	353,393	金融
HD SUPPLY HOLDINGS INC	53	—	—	—	その他
TYSON FOODS INC-CL A	98	108.5	888	101,073	生活必需品
NETFLIX INC	144	160.7	10,667	1,213,687	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	129.2	142.4	9,238	1,051,062	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	79.5	86.5	316	36,047	公益事業
GLOBE LIFE INC	32.25	36.55	323	36,788	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	57	64.5	1,383	157,366	金融
TEXTRON INC	71.5	83	604	68,734	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	131.37	141.37	308	35,094	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	67.5	—	—	—	公益事業
OMNICOM GROUP	71.5	79.5	536	61,024	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	720.33	681.33	6,332	720,423	情報技術
MASTERCARD INC - A	292	320.5	10,352	1,177,800	情報技術
ONEOK INC	144	164	1,024	116,539	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	311.52	347.52	450	51,200	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	34.2	38	1,829	208,156	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	98	108.5	1,358	154,609	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	37	42.5	720	82,005	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	60.5	69.5	315	35,842	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	2,556.01	2,794.01	12,737	1,449,189	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	12.1	17.2	742	84,512	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	58.5	67.5	589	67,118	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	226	247.5	3,907	444,503	金融
ANALOG DEVICES INC	121.99	193.91	3,552	404,160	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	383	441.5	7,148	813,265	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	283.22	311.72	1,712	194,876	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	55	59.5	921	104,870	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	59	84.5	590	67,189	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	27.5	30.3	653	74,298	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	179	191.5	1,526	173,663	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	197	215.5	1,958	222,765	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	76.2	82.4	2,444	278,136	金融
AMGEN INC	192.5	208.5	4,242	482,652	ヘルスケア
EATON CORP PLC	130.86	145.86	2,441	277,758	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	55.8	62.5	1,418	161,389	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	302	332.5	5,028	572,042	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CME GROUP INC	118	131.2	2,956	336,341	金融
NOV INC	116.94	—	—	—	エネルギー
ECOLAB INC	84.5	94	2,135	242,922	素材
EQUIFAX INC	40.5	44.3	1,258	143,166	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	411.5	456.5	3,225	366,927	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	115	255	896	102,032	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	96	105.5	448	50,999	生活必需品
STATE STREET CORP	117.43	124.63	1,161	132,135	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	502.9	525.4	4,208	478,795	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	169	182	1,383	157,428	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	60	70	288	32,811	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	45.5	49.8	539	61,416	素材
CARDINAL HEALTH INC	94.5	104	493	56,166	ヘルスケア
FEDEX CORP	82	92	2,213	251,800	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	151.04	165.04	2,426	276,053	金融
FMC CORP	42	46.5	481	54,775	素材
CERNER CORP	100.5	108.5	790	89,938	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	28.24	90.13	1,326	150,929	素材
CITRIX SYSTEMS INC	38	46	378	43,107	情報技術
INTEL CORP	1,386	1,465	7,325	833,365	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	124	142	483	54,960	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	116.5	131.5	902	102,645	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	103	115.5	2,750	312,886	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	346	386	242	27,534	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	48.5	53.3	1,976	224,856	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	50	54	346	39,441	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	38.2	128.7	4,308	490,132	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	40.5	43.5	483	54,988	情報技術
SNAP-ON INC	16.3	20.2	429	48,909	資本財・サービス
CARMAX INC	53.5	58	849	96,657	一般消費財・サービス
COMERICA INC	45	—	—	—	金融
INGREDION INC	21.5	—	—	—	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	241.78	280.28	2,808	319,576	公益事業
TARGET CORP	162.8	179.5	4,472	508,827	一般消費財・サービス
DOVER CORP	48	52	893	101,637	資本財・サービス
VWV GRAINGER INC	14.9	15.8	783	89,083	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	42.5	47.2	689	78,449	資本財・サービス
CINTAS CORP	29.4	34.2	1,486	169,150	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	158	173	545	62,018	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	47.5	54.5	290	33,042	生活必需品
CLOROX COMPANY	40.5	44.3	749	85,256	生活必需品
ENTERGY CORP	66.5	74.2	779	88,697	公益事業
MICROSOFT CORP	2,359	2,596	87,389	9,942,263	情報技術
INCYTE CORP	60	69.3	487	55,481	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	429.69	477.69	4,395	500,099	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	438.98	488.98	5,392	613,501	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	366.5	408.5	3,518	400,336	情報技術
BLACKROCK INC	50	55.1	5,113	581,737	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	158	211	561	63,830	公益事業
HASBRO INC	44	47	465	53,006	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	84	93	593	67,578	生活必需品
KEYCORP	326	354	808	91,946	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	31.5	33.5	992	112,886	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	468.11	510.61	3,096	352,270	生活必需品

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
COOPER COS INC/THE	17.7	17.7	674	76,761	ヘルスケア	
CHUBB LTD	148.69	162.19	3,001	341,442	金融	
ARROW ELECTRONICS INC	27	27	335	38,219	情報技術	
ALLSTATE CORP	102.5	109.5	1,238	140,947	金融	
EBAY INC	256.5	249	1,756	199,859	一般消費財・サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	365	405	7,583	862,742	情報技術	
EASTMAN CHEMICAL CO	45.5	50.5	556	63,302	素材	
XILINX INC	80	88.5	2,062	234,679	情報技術	
DISH NETWORK CORP-A	82	89	294	33,545	コミュニケーション・サービス	
ZIONS BANCORP NA	52	—	—	—	金融	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	74.5	84.7	2,880	327,683	生活必需品	
TRIMBLE INC	82.5	90.5	783	89,092	情報技術	
LENNAR CORP-A	90	100.5	1,077	122,628	一般消費財・サービス	
LEAR CORP	18	21.5	363	41,338	一般消費財・サービス	
PROGRESSIVE CORP	193	213.9	2,031	231,113	金融	
PACCAR INC	114.87	125.37	1,079	122,835	資本財・サービス	
BIOGEN INC	56.2	55.2	1,303	148,279	ヘルスケア	
IDEXX LABORATORIES INC	27.7	30.9	1,950	221,933	ヘルスケア	
STARBUCKS CORP	383.5	427.5	4,733	538,553	一般消費財・サービス	
PTC INC	37	40.2	443	50,455	情報技術	
PERRIGO CO PLC	42	—	—	—	ヘルスケア	
EVERSOURCE ENERGY	109.8	124.1	1,058	120,391	公益事業	
INTUIT INC	85.7	98.8	6,863	780,830	情報技術	
BORGWARNER INC	82	87.5	392	44,607	一般消費財・サービス	
BEST BUY CO INC	76	82.5	915	104,137	一般消費財・サービス	
BALL CORP	105.84	119.84	1,136	129,265	素材	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	470.97	517.97	1,998	227,408	ヘルスケア	
ELECTRONIC ARTS INC	95.7	105.7	1,319	150,174	コミュニケーション・サービス	
VULCAN MATERIALS CO	43.5	49	976	111,132	素材	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	85.5	93.5	1,777	202,229	ヘルスケア	
VF CORP	109	122.5	903	102,756	一般消費財・サービス	
VIACOMCBS INC - CLASS B	183.75	220.25	710	80,886	コミュニケーション・サービス	
MOHAWK INDUSTRIES INC	19	22	383	43,646	一般消費財・サービス	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	30.7	—	—	—	その他	
CARNIVAL CORP	153	300	544	61,981	一般消費財・サービス	
COMCAST CORP-CLASS A	1,490.9	1,660.9	8,558	973,713	コミュニケーション・サービス	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	72	—	—	—	その他	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	75	83	484	55,118	資本財・サービス	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	90	—	—	—	生活必需品	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	403	448	249	28,338	不動産	
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	102,065.16 591銘柄	114,614.26 598銘柄	1,496,632	170,271,878 <67.9%>	
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD	83	91	389	34,805	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	7	7	1,543	137,792	情報技術	
RESTAURANT BRANDS INTERN	92.87	96.87	706	63,085	一般消費財・サービス	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	149	161	868	77,530	素材	
INTACT FINANCIAL CORP	46.5	64.5	1,040	92,899	金融	
BCE INC	49.3	49.3	319	28,541	コミュニケーション・サービス	
FRANCO-NEVADA CORP	62	69	1,241	110,836	素材	
SUNCOR ENERGY INC	501.3	542.3	1,732	154,656	エネルギー	
METRO INC/CN	82	86	534	47,708	生活必需品	
NATIONAL BANK OF CANADA	110	120	1,222	109,114	金融	

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
BANK OF NOVA SCOTIA	399	435	3,542	316,177	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	146.5	159.5	2,322	207,276	金融
TORONTO-DOMINION BANK	594	652	6,102	544,670	金融
GREAT-WEST LIFE CO INC	91	98	367	32,759	金融
ROYAL BANK OF CANADA	467.5	510.5	6,622	591,143	金融
TC ENERGY CORP	310.5	352.5	2,150	191,994	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	178.29	197.29	760	67,886	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	586	633	1,546	138,033	素材
CAE INC	79	109	343	30,686	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	57.12	62.12	969	86,499	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	53	59	218	19,543	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	35	373	33,343	素材
BALLARD POWER SYSTEMS INC	—	78	152	13,625	資本財・サービス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	46.5	54.5	345	30,871	素材
HYDRO ONE LTD	105	113	351	31,388	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	59.6	59.6	577	51,528	生活必需品
NORTHLAND POWER INC	—	79	306	27,388	公益事業
WSP GLOBAL INC	37	43	781	69,793	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	—	28	310	27,727	資本財・サービス
PARKLAND CORP	44	51	174	15,555	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	53	60	174	15,531	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	77	90	534	47,678	公益事業
SSR MINING INC	72	—	—	—	素材
CANADIAN UTILITIES LTD-A	40	48	169	15,124	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	116	127	733	65,431	コミュニケーション・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	—	225	232	20,746	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	78	87	562	50,165	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	189	215	377	33,660	公益事業
B2GOLD CORP	347	347	177	15,858	素材
AIR CANADA	41	65	138	12,358	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	403	432	332	29,691	素材
BANK OF MONTREAL	211	231	3,164	282,501	金融
POWER CORP OF CANADA	181	201	840	75,048	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	35	41	8,200	731,932	情報技術
NUTRIEN LTD	188.19	203.19	1,773	158,261	素材
CANOPY GROWTH CORP	74	84	118	10,564	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	55	—	—	—	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	88	96	488	43,633	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	—	47	224	20,019	公益事業
CAMECO CORP	128	140	445	39,776	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	—	14	354	31,625	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	—	65	332	29,694	資本財・サービス
LIGHTSPEED COMMERCE INC	—	39	265	23,727	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	—	19	233	20,831	情報技術
TELUS CORP	108	108	318	28,428	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	151	170	576	51,425	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	18	22	382	34,178	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	389	420	2,244	200,304	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	9	10	566	50,587	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	92	102	1,023	91,382	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	25.37	27.37	373	33,342	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	70	70	228	20,381	素材
BLACKBERRY LTD	160	194	243	21,749	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	192.5	208.5	1,431	127,799	金融



外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	当 株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
ENBRIDGE INC	665	727	3,543	316,283	エネルギー	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	434.25	461.25	3,407	304,131	金融	
MANULIFE FINANCIAL CORP	638	691	1,652	147,535	金融	
BAUSCH HEALTH COS INC	105	105	333	29,794	ヘルスケア	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	45	240	2,194	195,886	資本財・サービス	
IA FINANCIAL CORP INC	33	37	258	23,078	金融	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	63	70	372	33,290	一般消費財・サービス	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	233.5	255.5	4,184	373,469	資本財・サービス	
CGI INC - CLASS A	79	79	848	75,754	情報技術	
ONEX CORPORATION	26	26	248	22,188	金融	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	151	160	595	53,184	コミュニケーション・サービス	
IGM FINANCIAL INC	24	31	151	13,522	金融	
TMX GROUP LTD	19	19	244	21,811	金融	
OPEN TEXT CORP	87	99	614	54,823	情報技術	
CI FINANCIAL CORP	70	—	—	—	金融	
SAPUTO INC	80	87	252	22,504	生活必需品	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	193	204	572	51,112	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	283	302	1,434	128,070	生活必需品	
YAMANA GOLD INC	323	323	166	14,876	素材	
FORTIS INC	150	166	928	82,916	公益事業	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	38	38	336	30,072	資本財・サービス	
LUNDIN MINING CORP	194	221	230	20,554	素材	
CENOVUS ENERGY INC	314	467	740	66,111	エネルギー	
DOLLARAMA INC	97	107	603	53,876	一般消費財・サービス	
ATCO LTD -CLASS I	22	29	123	11,011	公益事業	
ALTAGAS LTD	91	103	256	22,929	公益事業	
KEYERA CORP	74	74	213	19,016	エネルギー	
INTER PIPELINE LTD	128	—	—	—	エネルギー	
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,687.79 82銘柄	14,425.79 88銘柄	89,694	8,006,114 <3.2%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
MEDIBANK PRIVATE LTD	888	970	325	26,494	金融	
BHP GROUP LTD	957.5	1,034	3,988	324,195	素材	
SOUTH32 LTD	1,516	1,601	571	46,461	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	305.5	335.5	712	57,927	エネルギー	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	565	591	1,040	84,554	素材	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,024.5	1,159.5	3,153	256,375	金融	
WESTPAC BANKING CORP	1,173.48	1,289.48	2,697	219,287	金融	
SANTOS LTD	531	629	401	32,672	エネルギー	
AUSNET SERVICES	650	650	163	13,315	公益事業	
AUST AND NZ BANKING GROUP	924.5	1,008.5	2,684	218,233	金融	
RIO TINTO LTD	122.5	130	1,240	100,805	素材	
ORIGIN ENERGY LTD	535	590	290	23,596	公益事業	
AURIZON HOLDINGS LTD	600	600	204	16,631	資本財・サービス	
XERO LTD	—	47.5	670	54,525	情報技術	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	34	34	105	8,598	エネルギー	
COLES GROUP LTD	430.45	468.45	844	68,658	生活必需品	
WISETECH GLOBAL LTD	45	54	279	22,742	情報技術	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	250	370	357	29,054	素材	
EVOLUTION MINING LTD	530	595	245	19,927	素材	
AFTERPAY LTD	70	76	840	68,298	情報技術	
TPG TELECOM LTD	120	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
REECE LTD	—	105	246	20,024	資本財・サービス	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	—	473	324	26,338	生活必需品	
OIL SEARCH LTD	642	642	251	20,405	エネルギー	
SEEK LTD	107	117	401	32,622	コミュニケーション・サービス	
TREASURY WINE ESTATES LTD	235	256	305	24,805	生活必需品	
NEWCREST MINING LTD	260	285	689	56,019	素材	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	574.5	623.5	5,847	475,317	金融	
AMPOL LTD	79.5	79.5	229	18,696	エネルギー	
ORICA LTD	131	131	188	15,313	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	464.5	519.5	602	48,986	金融	
CIMIC GROUP LTD	28	—	—	—	資本財・サービス	
WOOLWORTHS GROUP LTD	413	441	1,768	143,754	生活必需品	
COCA-COLA AMATIL LTD	157	—	—	—	その他	
TABCORP HOLDINGS LTD	727.63	782.63	390	31,746	一般消費財・サービス	
CROWN RESORTS LTD	116	134	148	12,091	一般消費財・サービス	
QANTAS AIRWAYS LTD	305	305	149	12,148	資本財・サービス	
TELSTRA CORP LTD	1,345	1,435	574	46,660	コミュニケーション・サービス	
AMP LTD	1,020	—	—	—	金融	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	142.5	156.5	859	69,881	素材	
MACQUARIE GROUP LTD	110.84	119.84	2,325	189,000	金融	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	184.5	211.3	942	76,590	一般消費財・サービス	
CSL LTD	147.5	160	4,912	399,296	ヘルスケア	
WESFARMERS LTD	370	403	2,345	190,695	一般消費財・サービス	
COCHLEAR LTD	20.5	23.2	525	42,748	ヘルスケア	
BLUESCOPE STEEL LTD	163	178	361	29,416	素材	
SUNCORP GROUP LTD	412.57	436.57	464	37,795	金融	
ASX LTD	62.5	67	609	49,573	金融	
COMPUTERSHARE LTD	159	182	348	28,317	情報技術	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	709.36	861.36	376	30,598	金融	
SONIC HEALTHCARE LTD	143.5	159.5	681	55,363	ヘルスケア	
AGL ENERGY LTD	190	215	114	9,315	公益事業	
BRAMBLES LTD	504	504	509	41,379	資本財・サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	57.5	61.5	407	33,095	ヘルスケア	
REA GROUP LTD	16	18	289	23,557	コミュニケーション・サービス	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	38	44	143	11,670	金融	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	22	286	23,279	一般消費財・サービス	
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	21,308.83 53銘柄	22,384.83 53銘柄	49,438	4,018,864 <1.6%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	475	525	2,509	36,613	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	770	830	3,622	52,858	一般消費財・サービス	
MTR CORP	525	585	2,457	35,847	資本財・サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	445	510	4,934	71,990	不動産	
SINO LAND CO	1,040	1,260	1,215	17,739	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	956.69	1,046.69	5,285	77,119	資本財・サービス	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	155	185	814	11,889	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	560	620	4,761	69,471	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	485.07	555.07	1,834	26,765	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	3,773.58	4,224.75	5,002	72,980	公益事業	
HANG SENG BANK LTD	261	288	4,057	59,205	金融	
NEW WORLD DEVELOPMENT	525	585	1,848	26,971	不動産	
WH GROUP LTD	3,210	3,610	1,841	26,861	生活必需品	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	419	461	20,514	299,306	金融	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	660	780	1,248	18,208	不動産	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千香港・ドル	千円		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	108	—	—	—	情報技術	
KERRY PROPERTIES LTD	225	—	—	—	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	452.4	—	—	—	金融	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	260	—	—	—	ヘルスケア	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	—	690	1,337	19,510	資本財・サービス	
SJM HOLDINGS LTD	580	710	396	5,780	一般消費財・サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	382	450	873	12,737	不動産	
CK ASSET HOLDINGS LTD	911.69	911.69	4,129	60,256	不動産	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	200	235	1,092	15,943	公益事業	
PCCW LTD	1,470	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
AIA GROUP LTD	4,194	4,614	38,711	564,800	金融	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	—	540	1,555	22,690	資本財・サービス	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	570	630	2,535	36,996	不動産	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	609	679	1,371	20,011	生活必需品	
ESR CAYMAN LTD	—	750	1,938	28,286	不動産	
SANDS CHINA LTD	824	928	1,733	25,291	一般消費財・サービス	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	—	820	1,193	17,419	一般消費財・サービス	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	470	530	8,729	127,357	資本財・サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,255	1,415	3,396	49,547	金融	
WYNN MACAU LTD	540	540	388	5,664	一般消費財・サービス	
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	27,311.43 31銘柄	30,508.2 30銘柄	131,331	1,916,123 <0.8%>	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円		
CAPITALAND INVESTMENT LTD	—	1,024	345	28,714	不動産	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	420	452	1,199	99,781	金融	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	629	699	2,152	179,086	金融	
SINGAPORE AIRLINES LTD	436.75	484.75	238	19,804	資本財・サービス	
KEPPEL CORP LTD	513	563	293	24,407	資本財・サービス	
UOL GROUP LTD	140	171	117	9,775	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	161	161	112	9,377	不動産	
CAPITALAND LTD	829	—	—	—	不動産	
YANGZIJIAN SHIPBUILDING	913	—	—	—	資本財・サービス	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	27	—	—	—	一般消費財・サービス	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,164	1,293	1,466	122,007	金融	
GENTING SINGAPORE LTD	2,090	2,090	165	13,738	一般消費財・サービス	
VENTURE CORP LTD	86	99	186	15,495	情報技術	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,909.5	3,201.5	771	64,201	コミュニケーション・サービス	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	500	565	216	18,053	資本財・サービス	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	273	315	290	24,192	金融	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	659	744	311	25,939	生活必需品	
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,750.25 16銘柄	11,862.25 14銘柄	7,866	654,577 <0.3%>	
(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	415	475	213	16,535	公益事業	
MERCURY NZ LTD	230	260	152	11,792	公益事業	
A2 MILK CO LTD	262	262	162	12,593	生活必需品	
SPARK NEW ZEALAND LTD	620.89	727.89	316	24,576	コミュニケーション・サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	389	483	376	29,152	資本財・サービス	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	204	232	765	59,356	ヘルスケア	
RYMAN HEALTHCARE LTD	140	165	199	15,478	ヘルスケア	
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,260.89 7銘柄	2,604.89 7銘柄	2,186	169,486 <0.1%>	

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BP PLC	6,665	7,330	2,402	364,053	エネルギー
UNILEVER PLC	384.1	948.6	3,719	563,721	生活必需品
BARCLAYS PLC	5,688	6,223	1,140	172,861	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,795	3,005	368	55,791	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	849	951	1,231	186,580	金融
NATWEST GROUP PLC	1,597.91	2,102.91	442	67,058	金融
EVRAZ PLC	150	174	99	15,084	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	60.64	70.64	150	22,836	素材
BAE SYSTEMS PLC	1,065	1,170	643	97,493	資本財・サービス
AVIVA PLC	1,289.66	1,423.66	538	81,604	金融
AVEVA GROUP PLC	20	44	141	21,473	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,651	1,823	2,780	421,348	ヘルスケア
INFORMA PLC	499	527	249	37,859	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,565	1,595.4	233	35,314	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	319	350	256	38,850	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	31.5	34	191	29,032	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	152	175	320	48,643	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	24.5	27.5	435	66,019	資本財・サービス
HALMA PLC	122.5	137	414	62,893	情報技術
ENTAIN PLC	191	212	370	56,100	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	146	172	196	29,756	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	235	151	22,937	金融
M&G PLC	837	917	174	26,454	金融
RELX PLC	631.46	703.96	1,649	249,979	資本財・サービス
DIAGEO PLC	769	847	3,238	490,827	生活必需品
RIO TINTO PLC	370	407	1,880	285,076	素材
STANDARD CHARTERED PLC	868	970	401	60,892	金融
TESCO PLC	3,207	2,806.84	783	118,687	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	290.5	319.5	396	60,045	ヘルスケア
GLENCORE PLC	3,307.25	3,645.25	1,301	197,316	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	102.5	124.5	167	25,313	金融
SMITHS GROUP PLC	123.83	143.83	209	31,739	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	419.83	465.83	124	18,864	金融
PEARSON PLC	235.63	257.63	158	23,997	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	542.25	595.25	172	26,135	生活必需品
NEXT PLC	44.5	48.5	386	58,525	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	1,177	1,277	198	30,095	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	68.61	73.61	211	32,074	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	112.05	119.05	341	51,729	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	8,701.83	10,141.83	1,116	169,264	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	42.61	50.11	504	76,440	素材
KINGFISHER PLC	682.11	737.11	240	36,419	一般消費財・サービス
WPP PLC	409	429	454	68,952	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	228.27	248.27	270	40,957	公益事業
SEVERN TRENT PLC	78.33	90.83	264	40,018	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	612	673	416	63,097	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	234.5	260	1,602	242,896	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	165.5	194.5	303	46,060	金融
SCHRODERS PLC	41.5	41.5	145	22,121	金融
SSE PLC	339	376	585	88,785	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	340	367	254	38,535	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	431.5	561	4,693	711,405	ヘルスケア
FERGUSON PLC	74.87	80.87	934	141,625	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,955	2,152	613	92,922	金融
3I GROUP PLC	313.91	350.91	487	73,819	金融
ASHTED GROUP PLC	146.5	161.5	989	150,043	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	351.14	401.14	311	47,239	情報技術
NATIONAL GRID PLC	1,144.34	1,296.34	1,297	196,709	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	22,964.65	25,754.65	1,205	182,677	金融
RSA INSURANCE GROUP LTD	317.6	—	—	—	その他
IMPERIAL BRANDS PLC	304	341	532	80,778	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	41.5	38.32	165	25,118	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	753.6	790.6	2,020	306,268	生活必需品
BHP GROUP PLC	687.27	768.27	1,551	235,090	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	115	128.5	245	37,139	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	6,696.5	7,416.5	3,088	468,108	金融
ANGLO AMERICAN PLC	403.83	465.83	1,250	189,458	素材
MONDI PLC	156.5	176	307	46,627	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	734	—	—	—	生活必需品
COMPASS GROUP PLC	589.39	647.39	985	149,336	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	106	112	309	46,833	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	2,901	3,206	523	79,396	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	65.5	71.5	168	25,498	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	132.89	142.89	256	38,873	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	56.36	64.36	296	44,870	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	52	58.5	320	48,587	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	104.99	120.49	827	125,456	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,350	1,489	2,374	359,903	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,223.18	1,346.18	2,145	325,219	エネルギー
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	57	57	127	19,264	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	61.5	70.5	212	32,193	金融
ANTOFAGASTA PLC	128	141	197	29,875	素材
ABRDN PLC	708.62	778.62	183	27,826	金融
EXPERIAN PLC	296.54	336.54	1,138	172,553	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	95,671.55 105,587.01	64,194	9,729,339	<3.9%>
	百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
(イスラエル)					
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	345	443	874	31,507	金融
AZRIELI GROUP LTD	14	16.5	479	17,284	不動産
ICL GROUP LTD	236	281	801	28,859	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	9.5	9.5	447	16,113	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	357	441	1,355	48,818	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	512	562	1,744	62,819	金融
NICE LTD	22	24	2,123	76,461	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	41	54	632	22,771	金融
イスラエル・シェケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,536.5 8銘柄	1,831 8銘柄	8,459	304,635 <0.1%>
	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)					
UBS GROUP AG-REG	1,200	1,306	2,057	253,599	金融
ROCHE HOLDING AG-BR	—	11	421	51,925	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2.8	2.8	249	30,713	素材
ADECCO GROUP AG-REG	51.5	51.5	225	27,763	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	229.8	250	8,937	1,101,546	ヘルスケア
SIKA AG-REG	47.1	51	1,854	228,612	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.03	0.04	449	55,363	生活必需品

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
ABB LTD-REG	601	627	2,002	246,825	資本財・サービス	
SWISS RE AG	97.5	107	927	114,285	金融	
NESTLE SA-REG	972	1,027	12,334	1,520,198	生活必需品	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	5.9	8	1,260	155,295	金融	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	12.6	15	360	44,425	資本財・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	799.7	909.2	806	99,351	金融	
JULIUS BAER GROUP LTD	74	80	457	56,379	金融	
SGS SA-REG	2	2.1	597	73,661	資本財・サービス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	6.9	6.9	161	19,899	資本財・サービス	
VIFOR PHARMA AG	14.5	17.5	184	22,690	ヘルスケア	
TEMENOS AG - REG	21.2	23	278	34,385	情報技術	
ALCON INC	161.3	178	1,300	160,326	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	9.7	9.7	265	32,661	一般消費財・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	48.62	53.42	2,039	251,377	金融	
BALOISE HOLDING AG - REG	15.7	17	235	28,977	金融	
CLARIANT AG-REG	57	77	139	17,186	素材	
NOVARTIS AG-REG	726	791	5,872	723,771	ヘルスケア	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1.2	265	32,685	生活必需品	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	171.6	186	2,583	318,421	一般消費財・サービス	
SWISSCOM AG-REG	8.3	9	462	56,948	コミュニケーション・サービス	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	10.1	10.1	71	8,813	金融	
GEBERIT AG-REG	11.9	13	907	111,837	資本財・サービス	
GIVAUDAN-REG	3	3.3	1,492	184,002	素材	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	3.4	3.6	700	86,299	ヘルスケア	
SONOVA HOLDING AG-REG	18.22	19.92	685	84,505	ヘルスケア	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	55	62	467	57,647	情報技術	
LONZA GROUP AG-REG	24	26.9	1,964	242,158	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	15.2	19	100	12,422	一般消費財・サービス	
HOLCIM LTD	172.9	185.4	843	103,924	素材	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	10.4	11.1	582	71,769	金融	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	18	19.2	510	62,969	資本財・サービス	
SWISS PRIME SITE-REG	25.1	27	239	29,483	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.34	0.34	385	47,478	生活必需品	
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,705.31 39銘柄	6,218.22 40銘柄	55,680 <2.7%>	6,862,594	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円		
NOVO NORDISK A/S-B	595	648	46,377	800,937	ヘルスケア	
DANSKE BANK A/S	227	260	2,852	49,257	金融	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1.05	1.2	2,222	38,380	資本財・サービス	
H LUNDBECK A/S	23	—	—	—	ヘルスケア	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	68	386.5	8,560	147,848	資本財・サービス	
GN STORE NORD A/S	43	48.5	1,870	32,297	ヘルスケア	
CARLSBERG AS-B	36.5	39	4,145	71,596	生活必需品	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	72.5	78.5	3,835	66,239	素材	
COLOPLAST-B	40.5	45	4,835	83,504	ヘルスケア	
DSV PANALPINA A/S	71.6	79.1	11,291	195,004	資本財・サービス	
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	—	3	822	14,211	資本財・サービス	
DEMANT A/S	34.25	38.75	1,219	21,053	ヘルスケア	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2.2	2.3	4,521	78,091	資本財・サービス	
TRYG A/S	40	132	2,088	36,075	金融	
PANDORA A/S	35	38	3,203	55,322	一般消費財・サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	34.5	40.5	1,993	34,419	素材	
GENMAB A/S	22.9	25.2	6,426	110,977	ヘルスケア	

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	当 株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
ORSTED A/S	百株 66	百株 70.5	千デンマーク・クローネ 5,965	千円 103,027	公益事業	
AMBU A/S-B	56	63	1,203	20,780	ヘルスケア	
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,469 18銘柄	1,999.05 18銘柄	113,435	1,959,025 <0.8%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円		
DNB BANK	—	367.5	7,416	93,517	金融	
NORSK HYDRO ASA	417	507	3,067	38,679	素材	
DNB	331	—	—	—	金融	
ORKLA ASA	244.5	290.5	2,443	30,807	生活必需品	
TELENOR ASA	254	278	3,833	48,341	コミュニケーション・サービス	
EQUINOR ASA	338.23	382.23	8,682	109,484	エネルギー	
SCHIBSTED ASA-CL A	—	28	1,149	14,490	コミュニケーション・サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	57.1	66.6	2,966	37,405	素材	
MOWI ASA	141	166	3,492	44,042	生活必需品	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	73.5	73.5	1,523	19,213	金融	
SCHIBSTED ASA-B SHS	31	36.5	1,306	16,477	コミュニケーション・サービス	
ADEVINTA ASA	81	106	1,398	17,637	コミュニケーション・サービス	
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,968.33 10銘柄	2,301.83 11銘柄	37,279	470,097 <0.2%>	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円		
ICA GRUPPEN AB	35.2	38.7	2,067	25,903	生活必需品	
ERICSSON LM-B SHS	996.3	1,128.3	10,585	132,638	情報技術	
VOLVO AB-B SHS	508.5	556.5	11,036	138,287	資本財・サービス	
SKF AB-B SHARES	133	144	3,028	37,944	資本財・サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	76	86	1,751	21,950	一般消費財・サービス	
SWEDISH MATCH AB	56.5	613	4,105	51,446	生活必需品	
TELE2 AB-B SHS	168	188	2,465	30,894	コミュニケーション・サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	574	620	8,153	102,157	金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	528.5	548.5	5,284	66,211	金融	
SWEDBANK AB - A SHARES	318	341	6,259	78,430	金融	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	282	282	4,585	57,461	一般消費財・サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	207	229	3,451	43,241	素材	
SKANSKA AB-B SHS	115.5	128.5	2,702	33,860	資本財・サービス	
SANDVIK AB	384.5	431	9,887	123,885	資本財・サービス	
INVESTOR AB-B SHS	156	700	14,829	185,813	金融	
ATLAS COPCO AB-A SHS	229.5	254.5	14,190	177,812	資本財・サービス	
VOLVO AB-A SHS	—	80	1,616	20,248	資本財・サービス	
SECURITAS AB-B SHS	109.5	119.5	1,588	19,907	資本財・サービス	
TELIA CO AB	862	1,002	3,544	44,413	コミュニケーション・サービス	
ALFA LAVAL AB	110	119	4,303	53,917	資本財・サービス	
ATLAS COPCO AB-B SHS	132.5	149	7,081	88,737	資本財・サービス	
ASSA ABLOY AB-B	341.5	387.5	10,036	125,754	資本財・サービス	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	—	47.43	1,304	16,343	金融	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	—	40	2,739	34,322	不動産	
LUNDBERGS AB-B SHS	26	30	1,523	19,088	金融	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	52	57	1,948	24,418	資本財・サービス	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	104	543	6,901	86,476	資本財・サービス	
LUNDIN ENERGY AB	63.5	75.5	2,557	32,041	エネルギー	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	212	230	6,725	84,266	生活必需品	
EMBRACER GROUP AB	—	200	1,901	23,827	コミュニケーション・サービス	
LOLIDEN AB	93	104	3,186	39,927	素材	
EPIROC AB-A	222.5	249.5	5,444	68,214	資本財・サービス	

銘	柄	期 首		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
EPIROC AB-B		135	148	2,671	33,472	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		141.5	158.5	2,083	26,106	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP		1,111	1,250	13,405	167,964	金融
EQT AB		81	91	4,835	60,591	金融
EVOLUTION AB		44	65.5	6,572	82,350	一般消費財・サービス
SINCH AB		—	194	2,396	30,032	情報技術
KINNEVIK AB - B		83	93	3,055	38,285	金融
HEXAGON AB-B SHS		99	764	10,199	127,798	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		57	62	1,683	21,091	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	8,848.5 36 銘柄	12,548.43 41 銘柄	213,690	2,677,537 <1.1%>	
<b>ユーロ (アイルランド)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		75.5	86	394	50,655	素材
KINGSPAN GROUP PLC		50	54	539	69,327	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		51.5	56	606	77,914	生活必需品
CRH PLC		253.5	281	1,219	156,601	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		49.6	60.3	735	94,504	一般消費財・サービス
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	480.1 5 銘柄	537.3 5 銘柄	3,496	449,002 <0.2%>	
<b>ユーロ (オランダ)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV		—	278.91	697	89,572	コミュニケーション・サービス
QIAGEN N. V.		72.98	76.98	378	48,663	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		302.1	322.6	1,024	131,503	ヘルスケア
NN GROUP NV		90.5	99	434	55,795	金融
HEINEKEN NV		85.5	92	859	110,387	生活必需品
AEGON NV		582.44	642.44	253	32,495	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		362.33	373.83	1,131	145,234	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.		65.38	67.68	639	82,093	素材
KONINKLIJKE DSM NV		57	62	1,189	152,700	素材
WOLTERS KLUWER		89	96	962	123,643	資本財・サービス
ING GROEP NV		1,262.5	1,396	1,697	217,944	金融
KONINKLIJKE KPN NV		1,146.5	1,211.5	317	40,743	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		139.3	150.1	10,579	1,358,455	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA		130.5	151.5	191	24,652	金融
ADYEN NV		6	7	1,722	221,166	情報技術
UNILEVER NV		479.5	—	—	—	その他
JUST EAT TAKEAWAY		40	64.5	375	48,162	一般消費財・サービス
PROSUS NV		161	333.8	2,359	302,957	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV		—	26	65	8,363	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV		—	17	673	86,532	情報技術
VOPAK		23	23	76	9,799	エネルギー
RANDSTAD NV		37	43	241	30,976	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		37.5	39.5	305	39,208	生活必需品
ALTICE EUROPE NV		205	—	—	—	その他
STMICROELECTRONICS NV		210.5	244	1,049	134,806	情報技術
AIRBUS SE		194	211	2,103	270,105	資本財・サービス
ARGENX SE		14.5	16.4	411	52,837	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		195	195	255	32,764	生活必需品
EXOR NV		35.3	37.8	298	38,287	金融
CNH INDUSTRIAL NV		328	366	546	70,238	資本財・サービス



外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	当株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
STELLANTIS NV	百株 360	百株 732	千ユーロ 1,139	千円 146,333	一般消費財・サービス	
FERRARI NV	41.45	44.95	1,059	136,104	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,753.78 29銘柄	7,421.49 30銘柄	33,038	4,242,530 <1.7%>	
<b>ユーロ (ベルギー)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
GALAPAGOS NV	13.9	—	—	—	ヘルスケア	
UCB SA	41.3	45.3	439	56,447	ヘルスケア	
KBC GROUP NV	82.5	89	645	82,947	金融	
COLRUYT SA	16	16	66	8,495	生活必需品	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	36	40	387	49,730	金融	
SOLVAY SA	24.5	26	257	33,126	素材	
UMICORE	63.5	70	301	38,714	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	249	272	1,382	177,571	生活必需品	
AGEAS	57.9	62.9	291	37,404	金融	
PROXIMUS	49.5	49.5	79	10,189	コミュニケーション・サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	14.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
ELIA GROUP SA/NV	10.5	10.5	114	14,710	公益事業	
SOFINA	5.5	6	244	31,342	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	664.6 13銘柄	687.2 11銘柄	4,210	540,680 <0.2%>	
<b>ユーロ (ルクセンブルグ)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
AROUNDTOWN SA	370	325	179	23,036	不動産	
ARCELORMITTAL	233	257	628	80,655	素材	
INPOST SA	—	70	72	9,269	資本財・サービス	
EUROFINS SCIENTIFIC	44	47.5	536	68,911	ヘルスケア	
SES	110	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
TENARIS SA	133	157	140	17,987	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	890 5銘柄	856.5 5銘柄	1,556	199,860 <0.1%>	
<b>ユーロ (フランス)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA	27	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
TOTALENERGIES SE	810.5	893.5	3,681	472,705	エネルギー	
MICHELIN (CGDE)	57	60.5	776	99,712	一般消費財・サービス	
AIR LIQUIDE SA	155.77	169.77	2,501	321,247	素材	
KERING	25	27	1,846	237,078	一般消費財・サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	182	193.5	2,926	375,791	資本財・サービス	
BOUYGUES SA	74	82	245	31,494	資本財・サービス	
BNP PARIBAS	364.5	403	2,231	286,587	金融	
PEUGEOT SA	191.5	—	—	—	その他	
NATIXIS	295.5	—	—	—	金融	
THALES SA	35	38.5	284	36,524	資本財・サービス	
DANONE	200	234	1,271	163,250	生活必需品	
CARREFOUR SA	198	212	321	41,297	生活必需品	
SUEZ	112.25	126.25	249	32,050	公益事業	
VIVENDI	268.91	278.91	312	40,112	コミュニケーション・サービス	
L'OREAL	82.3	90.4	3,632	466,420	生活必需品	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	168.5	179	1,024	131,568	資本財・サービス	
LEGRAND SA	88.17	94.67	906	116,435	資本財・サービス	
PERNOD RICARD SA	69.37	74.87	1,546	198,626	生活必需品	
EURAZEO SE	12.54	12.54	92	11,827	金融	
SOCIETE GENERALE SA	269.5	290	797	102,351	金融	

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	91	99.1	6,909	887,217	一般消費財・サービス	
ACCOR SA	61.5	61.5	164	21,061	一般消費財・サービス	
CAPGEMINI SE	53.2	57.2	1,154	148,296	情報技術	
VALEO SA	77	77	189	24,293	一般消費財・サービス	
PUBLICIS GROUPE	70.5	80	463	59,541	コミュニケーション・サービス	
BUREAU VERITAS SA	97	106	300	38,534	資本財・サービス	
EIFFAGE	27.4	30.4	250	32,134	資本財・サービス	
SODEXO SA	27	29.5	221	28,463	一般消費財・サービス	
IPSEN	11.5	11.5	99	12,814	ヘルスケア	
ORPEA	18	18	150	19,323	ヘルスケア	
AMUNDI SA	19.5	22.5	168	21,683	金融	
TELEPERFORMANCE	19.2	21	750	96,376	資本財・サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT	30	30	134	17,292	コミュニケーション・サービス	
FAURECIA	22.5	38.57	143	18,394	一般消費財・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	9	10	513	65,900	ヘルスケア	
SEB SA	6.5	9.97	132	17,065	一般消費財・サービス	
ESSILORLUXOTTICA	92.5	101.5	1,830	235,100	一般消費財・サービス	
DASSAULT AVIATION SA	1	10	84	10,844	資本財・サービス	
WORLDLINE SA	78.14	85.14	404	51,898	情報技術	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	30	35	146	18,799	一般消費財・サービス	
AXA SA	638.5	694	1,681	215,973	金融	
EDENRED	79.5	88.5	358	46,025	情報技術	
RENAULT SA	58	64	186	23,952	一般消費財・サービス	
HERMES INTERNATIONAL	10.2	11.3	1,853	237,969	一般消費財・サービス	
REMY COINTREAU	7.5	7.5	160	20,552	生活必需品	
ATOS SE	32	32	119	15,351	情報技術	
DASSAULT SYSTEMES SE	43.6	234.5	1,252	160,889	情報技術	
WENDEL	7.8	9.3	96	12,360	金融	
ORANGE	659	714	685	88,054	コミュニケーション・サービス	
ALSTOM	63	114	369	47,385	資本財・サービス	
CNP ASSURANCES	48.5	58.5	126	16,210	金融	
SANOFI	370.75	407.25	3,486	447,697	ヘルスケア	
VINCI SA	170	188.5	1,586	203,711	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	175	197	556	71,438	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA	376	416	504	64,807	金融	
BIOMERIEUX	13.4	13.4	170	21,913	ヘルスケア	
ENGIE	602.23	646.23	833	106,997	公益事業	
EDF	202.5	202.5	249	32,100	公益事業	
SAFRAN SA	104.2	122	1,239	159,166	資本財・サービス	
ILIAD SA	4.9	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
ARKEMA	22.2	22.2	257	33,068	素材	
ADP	9.1	9.1	95	12,199	資本財・サービス	
SCOR SE	49.5	55.5	148	19,028	金融	
GETLINK SE	142	142	183	23,513	資本財・サービス	
BOLLORE	286	286	136	17,503	コミュニケーション・サービス	
国 小 計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,705.13 66銘柄	9,129.57 62銘柄	55,198	7,087,987 <2.8%>	
ユーロ (ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG	322.7	352.2	1,596	204,964	ヘルスケア	
EVONIK INDUSTRIES AG	65	70	186	23,999	素材	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	639.5	739	789	101,328	金融	
COMMERZBANK AG	329.35	329.35	205	26,368	金融	

## 外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
VOLKSWAGEN AG	10.1	11.1	283	36,403	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	61.2	65.5	1,077	138,375	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	250.5	273.5	3,953	507,696	資本財・サービス
E.ON SE	742	793	871	111,930	公益事業
UNIPER SE	66.5	66.5	257	33,029	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	110	117.5	1,007	129,426	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	50.5	50.5	225	28,902	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	35.9	39.6	369	47,417	一般消費財・サービス
BASF SE	301.2	328.7	1,905	244,724	素材
ALLIANZ SE-REG	134.7	147.4	2,831	363,561	金融
THYSSENKRUPP AG	114.5	—	—	—	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	58	64	455	58,431	生活必需品
RWE AG	212	227	794	102,080	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	96.5	96.5	53	6,816	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	11.8	—	—	—	資本財・サービス
BRENNTAG SE	50	53.5	408	52,445	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	135.5	148	499	64,197	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	33.2	33.2	109	14,077	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG	7.1	—	—	—	資本財・サービス
SAP SE	341.92	373.92	4,367	560,815	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	46.1	50.4	1,205	154,742	金融
ZALANDO SE	49.5	76.5	623	80,060	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	49	53.5	318	40,958	素材
KION GROUP AG	21	24	225	28,938	資本財・サービス
COVESTRO AG	56	67	339	43,602	素材
RATIONAL AG	—	1.9	154	19,801	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	12.1	12.1	701	90,118	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	50	53	397	51,042	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	41.5	58	691	88,852	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	12.5	14	248	31,909	ヘルスケア
METRO AG	50	—	—	—	生活必需品
BECHTLE AG	—	28.5	180	23,143	情報技術
NEMETSCHKE SE	20	20	215	27,620	情報技術
SCOUT24 AG	36	36	215	27,625	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	86	101	651	83,600	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	23	25	226	29,033	資本財・サービス
HELLOFRESH SE	—	57	538	69,168	生活必需品
TEAMVIEWER AG	44.5	53.5	66	8,484	情報技術
SIEMENS ENERGY AG	131.25	143.25	345	44,312	資本財・サービス
KION GROUP AG-RTS	21	—	—	—	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	32.9	36.1	322	41,377	生活必需品
FUCHS PETROLUB PREF	23.5	23.5	93	12,010	素材
MERCK KGAA	42.5	46	1,010	129,714	ヘルスケア
ADIDAS AG	61.7	68.1	1,731	222,378	一般消費財・サービス
PUMA SE	27.1	38.6	410	52,713	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	34	37.5	250	32,166	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,092.5	1,192	1,911	245,515	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	69.2	72.2	386	49,619	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	281	306.5	2,537	325,881	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	413	467	1,878	241,189	情報技術
HANNOVER RUECK SE	20	22	342	43,929	金融
DEUTSCHE POST AG-REG	324	354.5	1,899	243,903	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	62.6	67.1	954	122,523	金融

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
LANXESS AG	百株 25	百株 28	千ユーロ 143	千円 18,423	素材	
MTU AERO ENGINES AG	17.1	17.9	300	38,535	資本財・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN SE	110	—	—	—	不動産	
SYMRISE AG	42.2	44	553	71,134	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	338	338	79	10,229	コミュニケーション・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	19.5	19.5	137	17,653	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	170.5	195	958	123,121	不動産	
LEG IMMOBILIEN SE	23	25.5	316	40,652	不動産	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,158.42 62銘柄	8,653.62 59銘柄	45,811 <2.3%>	5,882,683	
<b>ユーロ (ポルトガル)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	77	85	165	21,283	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	883	992	482	61,984	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	150.5	167.5	140	18,045	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,110.5 3銘柄	1,244.5 3銘柄	788 <0.0%>	101,314	
<b>ユーロ (スペイン)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA	1,572.27	1,867.27	739	94,987	コミュニケーション・サービス	
ENDESA SA	103.5	103.5	208	26,780	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,205.12	2,367	1,136	145,970	金融	
IBERDROLA SA	1,944.34	2,119.34	2,101	269,858	公益事業	
BANKINTER SA	215	—	—	—	金融	
REPSOL SA	494	534	529	67,967	エネルギー	
GRIFOLS SA	98	98	163	21,053	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	5,477.5	6,199.5	1,725	221,588	金融	
AMADEUS IT GROUP SA	146	160.5	932	119,701	情報技術	
NATURGY ENERGY GROUP SA	94	103	253	32,576	公益事業	
MAPFRE SA	306.5	—	—	—	金融	
CAIXABANK SA	1,175	1,605	367	47,134	金融	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	88.76	88.76	191	24,550	資本財・サービス	
AENA SME SA	22.5	26	336	43,185	資本財・サービス	
CELLNEX TELECOM SA	104.55	180.05	958	123,092	コミュニケーション・サービス	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	360	390	1,157	148,587	一般消費財・サービス	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	77	85	199	25,628	資本財・サービス	
ENAGAS SA	79.5	79.5	159	20,539	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	139	157	290	37,337	公益事業	
FERROVIAL SA	162.7	176.7	443	56,952	資本財・サービス	
EDP RENOVAVEIS SA	—	110	247	31,724	公益事業	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	14,865.24 20銘柄	16,450.12 19銘柄	12,142 <0.6%>	1,559,214	
<b>ユーロ (イタリア)</b>		百株	百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA	78.5	88.5	294	37,831	資本財・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI	372.43	394.43	702	90,154	金融	
MEDIOBANCA SPA	188.65	223.65	217	27,926	金融	
UNICREDIT SPA	696.56	763.56	807	103,637	金融	
TELECOM ITALIA SPA	2,629.82	3,439.82	162	20,808	コミュニケーション・サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	1,719.5	2,039.5	90	11,667	コミュニケーション・サービス	
INTESA SANPAOLO	5,507.37	5,945.37	1,274	163,606	金融	
ATLANTIA SPA	172.57	172.57	278	35,810	資本財・サービス	
POSTE ITALIANE SPA	160	177	198	25,444	金融	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
MONCLER SPA	63	74	478	61,385	一般消費財・サービス	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	34.5	38.5	211	27,171	ヘルスケア	
ENI SPA	841	904	1,066	136,977	エネルギー	
PIRELLI & C SPA	110	—	—	—	一般消費財・サービス	
DIASORIN SPA	8.5	8.5	157	20,203	ヘルスケア	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	83	112	115	14,777	コミュニケーション・サービス	
NEXI SPA	120.5	158.5	218	28,076	情報技術	
AMPLIFON SPA	—	43	183	23,610	ヘルスケア	
LEONARDO SPA	131.75	—	—	—	資本財・サービス	
ENEL SPA	2,671.34	2,911.34	1,976	253,803	公益事業	
SNAM SPA	666	701	350	44,980	公益事業	
TERNA SPA	463	490	318	40,873	公益事業	
FINECOBANK SPA	197	219	340	43,743	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	16,914.99 21銘柄	18,904.24 20銘柄	9,442	1,212,490 <0.5%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (フィンランド)						
UPM-KYMMENE OYJ	175.5	191.5	626	80,410	素材	
NOKIA OYJ	1,864	1,913	960	123,290	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP	147	170	209	26,926	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS	188.5	197	304	39,058	素材	
ELISA OYJ	46	51	271	34,892	コミュニケーション・サービス	
SAMPO OYJ-A SHS	153	178	766	98,422	金融	
FORTUM OYJ	138.5	159	406	52,186	公益事業	
KESKO OYJ-B SHS	—	98	274	35,197	生活必需品	
KONE OYJ-B	112.5	121	715	91,920	資本財・サービス	
NESTE OYJ	139	151	648	83,337	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	32	36	132	17,071	ヘルスケア	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,996 10銘柄	3,265.5 11銘柄	5,316	682,716 <0.3%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オーストリア)						
VERBUND AG	20	24.3	218	28,005	公益事業	
OMV AG	44.5	53	250	32,157	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	94.5	100	387	49,771	金融	
VOESTALPINE AG	42.5	42.5	125	16,088	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	44	52.5	134	17,217	金融	
ANDRITZ AG	21	—	—	—	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	266.5 6銘柄	272.3 5銘柄	1,115	143,240 <0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	61,805.26 240銘柄	67,422.34 230銘柄	172,118	22,101,720 <8.8%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	354,388.8 1,214銘柄	394,308.1 1,220銘柄	—	229,141,995 <91.4%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘 柄	期 首		当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円
<b>(アメリカ)</b>				
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4.587	5.087	1,224	139,350
SIMON PROPERTY GROUP INC	10.137	11.857	1,896	215,754
BOSTON PROPERTIES INC	4.95	5.47	603	68,666
VORNADO REALTY TRUST	5.397	5.897	245	27,896
SBA COMMUNICATIONS CORP	3.65	4.04	1,436	163,430
EQUITY RESIDENTIAL	12.35	13.05	1,125	128,010
EQUINIX INC	2.918	3.288	2,696	306,742
AMERICAN TOWER CORP	14.5	16.45	4,391	499,582
HOST HOTELS & RESORTS INC	22.243	24.943	409	46,596
INVITATION HOMES INC	17.7	20.85	860	97,896
VICI PROPERTIES INC	15.4	19.8	556	63,366
VENTAS INC	12.2	13.8	677	77,119
WEYERHAEUSER CO	24.114	27.564	1,068	121,518
AGNC INVESTMENT CORP	18.1	19.6	310	35,299
CROWN CASTLE INTL CORP	13.75	15.75	2,926	332,984
IRON MOUNTAIN INC	9.71	10.26	480	54,698
VEREIT INC	33.5	—	—	—
SUN COMMUNITIES INC	3.25	4.1	806	91,775
PROLOGIS INC	24.402	26.952	4,131	470,006
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4.12	5.1	1,046	119,097
CAMDEN PROPERTY TRUST	3.2	3.45	582	66,274
DUKE REALTY CORP	12.15	13.8	820	93,338
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2.17	2.4	831	94,611
FEDERAL REALTY INVST TRUST	2.36	—	—	—
WELLTOWER INC	13.85	15.3	1,255	142,805
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	17.65	19.8	674	76,725
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3.75	4.25	892	101,539
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5.8	6.15	521	59,347
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	45.1	50.8	424	48,258
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	5.35	—	—	—
REALTY INCOME CORP	11.2	19.445	1,357	154,415
PUBLIC STORAGE	5.22	5.67	1,881	214,094
REGENCY CENTERS CORP	5.3	5.7	403	45,887
UDR INC	9.75	10.55	606	68,979
WP CAREY INC	5.8	6.4	504	57,340
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	7.6	8.3	230	26,213
DIGITAL REALTY TRUST INC	8.9	10.3	1,738	197,793
EXTRA SPACE STORAGE INC	4.25	4.9	994	113,194
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	17.25	21.65	465	52,932
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	443.628 39 銘柄	462.723 36 銘柄	41,078 <1.9%>
<b>(カナダ)</b>				
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	4.8	—	—	—
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2.1	—	—	—
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2.4	2.9	169	15,132
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4.7	5.8	128	11,451
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	14 4 銘柄	8.7 2 銘柄	297 <0.0%>

外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄	期 首 □ 数	当 期 □ 数	期 末 額	
			外 貨 建 金 額	評 価 額
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU	—	36.15	392	31,884
LENDLEASE GROUP	21.5	23.5	249	20,249
TRANSURBAN GROUP	89.5	95.4	1,306	106,166
SYDNEY AIRPORT	42.5	45.8	377	30,678
APA GROUP	38.1	41.4	401	32,644
SCENTRE GROUP	159.922	181.922	553	44,956
DEXUS	33.15	—	—	—
GPT GROUP	63.16	68.16	353	28,756
MIRVAC GROUP	126.1	136.1	394	32,084
STOCKLAND	78	83.8	364	29,632
GOODMAN GROUP	52.9	58.2	1,428	116,147
VICINITY CENTRES	123.273	137.273	232	18,914
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	828.105 11 銘柄	907.705 11 銘柄	6,053 <0.2%>
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円
LINK REIT	70.5	81.5	5,599	81,690
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	92	92	703	10,268
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	122	138	1,465	21,382
香港・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	284.5 3 銘柄	311.5 3 銘柄	7,768 <0.0%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	101	124.5	372	30,975
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	158.032	190.87	408	33,988
SUNTEC REIT	63	—	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	91.8	114.3	218	18,165
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST (非上場)	65.5	77.5	161	13,477
ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS	3.737	—	—	—
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	483.069 6 銘柄	507.17 4 銘柄	1,161 <0.0%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	21.662	23.562	176	26,818
SEGRO PLC	38.45	43.1	610	92,594
BRITISH LAND CO PLC	29.55	29.55	154	23,351
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	89.662 3 銘柄	96.212 3 銘柄	941 <0.1%>
(ユーロ (フランス))	千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4.2	4.6	276	35,441
ICADE	0.95	—	—	—
GECCINA SA	1.4	1.6	190	24,521
KLEPIERRE	6.25	7.15	136	17,494
COVIVIO	1.5	1.75	128	16,485
ユーロ通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	14.3 5 銘柄	15.1 4 銘柄	731 <0.0%>
合 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,157.264 71 銘柄	2,309.11 63 銘柄	— 5,638,901 <2.2%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

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

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

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

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1香港・ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.21円、1ニュージランド・ドル=77.53円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シェケル=36.011円、1スイス・フラン=123.25円、1デンマーク・クローネ=17.27円、1ノルウェー・クローネ=12.61円、1スウェーデン・クローネ=12.53円、1ユーロ=128.41円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (241,345,626千円) の投資信託財産総額 (250,978,162千円) に対する比率は、96.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

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

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

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額:

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

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は41,095円です。



# 外国株式インデックスマザーファンド

## ■損益の状況

当期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日

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

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

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

# ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)

## 運用報告書(全体版)

### 第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

#### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/債券/インデックス型		
信託期間	無期限(設定日:2017年2月16日)		
運用方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	日本債券インデックスマザーファンドの受益証券	
	日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の30%以下	
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

#### 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/>

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公社債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2 期末 (2018年 6 月15日)	10,124	0	0.6	525.468	0.7	99.4	—	279
3 期末 (2019年 6 月17日)	10,363	0	2.4	538.684	2.5	99.4	—	5,116
4 期末 (2020年 6 月15日)	10,235	0	△ 1.2	532.954	△ 1.1	99.4	—	18,594
5 期末 (2021年 6 月15日)	10,197	0	△ 0.4	532.014	△ 0.2	99.3	—	5,774
6 期末 (2022年 6 月15日)	9,848	0	△ 3.4	514.574	△ 3.3	99.4	—	18,663

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。

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

(注4) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

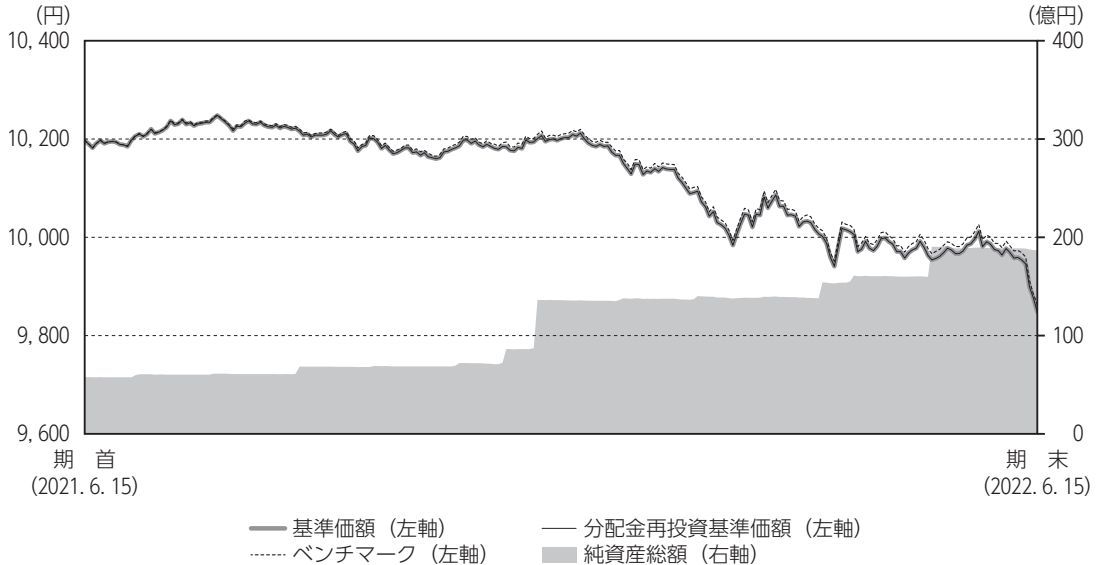
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率 - 売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

#### 基準価額・騰落率

期首：10,197円

期末：9,848円 (分配金0円)

騰落率：△3.4% (分配金込み)

#### 基準価額の主な変動要因

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

ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (D B I) 総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2021年 6月15日	円	%		%	%	%
	10,197	—	532.014	—	99.3	—
6月末	10,185	△ 0.1	531.421	△ 0.1	99.5	—
7月末	10,234	0.4	534.087	0.4	99.1	—
8月末	10,224	0.3	533.627	0.3	99.0	—
9月末	10,187	△ 0.1	531.730	△ 0.1	99.3	—
10月末	10,175	△ 0.2	531.186	△ 0.2	99.4	—
11月末	10,198	0.0	532.469	0.1	99.1	—
12月末	10,173	△ 0.2	531.310	△ 0.1	99.6	—
2022年 1月末	10,100	△ 1.0	527.510	△ 0.8	99.4	—
2月末	10,047	△ 1.5	524.780	△ 1.4	99.3	—
3月末	10,018	△ 1.8	523.357	△ 1.6	99.5	—
4月末	9,992	△ 2.0	522.056	△ 1.9	99.5	—
5月末	9,975	△ 2.2	521.104	△ 2.1	99.4	—
(期末)2022年 6月15日	9,848	△ 3.4	514.574	△ 3.3	99.4	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

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

### 国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇（債券価格は下落）しました。

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

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### 当ファンド

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

### 日本債券インデックスマザーファンド

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

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

## ポートフォリオについて

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

### 当ファンド

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

### 日本債券インデックスマザーファンド

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

\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

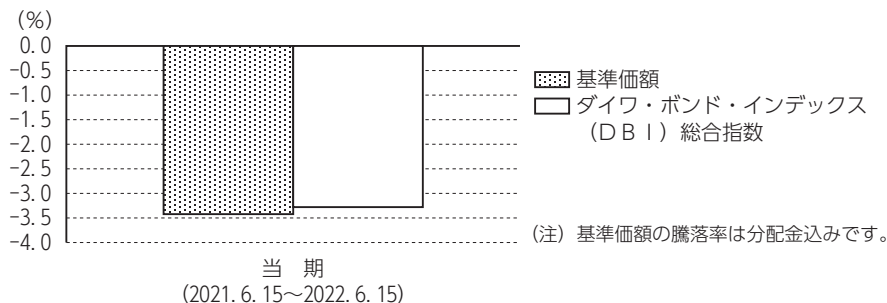
組入ファンド	ベンチマーク
日本債券インデックスマザーファンド	ダイワ・ボンド・インデックス (DB I) 総合指数

## ベンチマークとの差異について

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

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\* ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス (DB I) 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やポートフォリオの利回り水準等を勘案し、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### 分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（%）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	427

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



## 今後の運用方針

### 当ファンド

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

### 日本債券インデックスマザーファンド

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

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



## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	15円	0. 148%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10, 122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)	(6)	(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. 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. 006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	16	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。

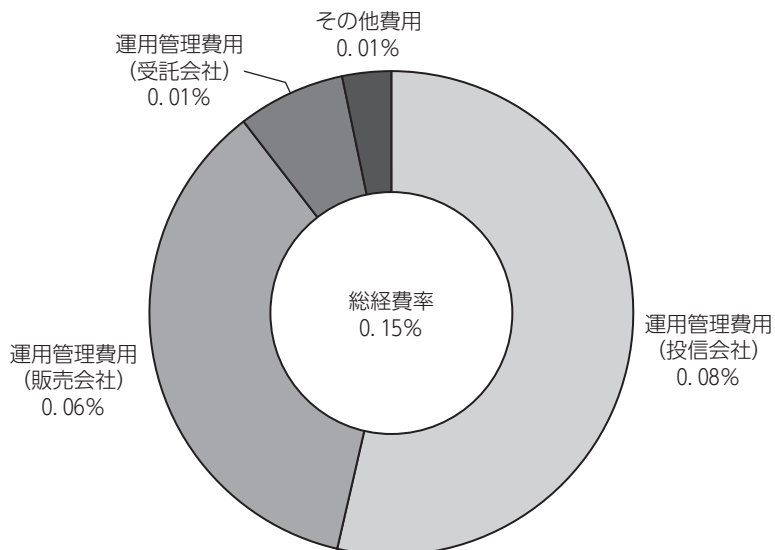
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。

## ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)

### ■売買および取引の状況

#### 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数 千口	金 額 千円	□ 数 千口	金 額 千円
日本債券 インデックス マザーファンド	10,131,896	14,264,442	611,153	858,685

(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

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
公社債	百万円 29,291	百万円 225	% 0.8	百万円 14,659	百万円 504	% 3.4
コール・ローン	94,348	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合11.4%

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

#### (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

(2021年6月16日から2022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
公社債	百万円 600	

(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、大和証券株式会社です。

### ■投信会社 (自社) による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首 保有額	当作成期中 設定額	当作成期中 解約額	当作成期末 保有額	取引の理由
百万円 1	百万円 —	百万円 —	百万円 1	当初設定時における取得

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

### ■組入資産明細表 親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数 千口	□ 数 千口	評 価 額 千円
日本債券インデックス マザーファンド	4,066,279	13,587,022	18,645,471

(注) 単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日本債券インデックス マザーファンド	千円 18,645,471	% 99.8
コール・ローン等、その他	30,100	0.2
投資信託財産総額	18,675,572	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>18,675,572,267円</b>
コール・ローン等	30,100,887
日本債券インデックス マザーファンド (評価額)	18,645,471,380
<b>(B) 負債</b>	<b>11,782,101</b>
未払信託報酬	11,361,399
その他未払費用	420,702
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>18,663,790,166</b>
元本	18,951,985,094
次期繰越損益金	△ 288,194,928
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>18,951,985,094口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	9,848円

\* 期首における元本額は5,663,399,869円、当作成期間中における追加設定元本額は14,231,839,472円、同解約元本額は943,254,247円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,848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288,194,928円です。

■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	64,156,295円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	713,199,327
(d) 分配準備積立金	31,955,955
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	809,311,577
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	809,311,577
(h) 受益権総口数	18,951,985,094口

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 2,868円</b>
受取利息	106
支払利息	△ 2,974
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 520,604,025</b>
売買益	8,958,269
売買損	△ 529,562,294
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 17,232,788</b>
<b>(D) 当期損益金 (A + B + C)</b>	<b>△ 537,839,681</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>△ 7,824,164</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>257,468,917</b>
(配当等相当額)	( 713,199,327)
(売買損益相当額)	(△ 455,730,410)
<b>(G) 合計 (D + E + F)</b>	<b>△ 288,194,928</b>
<b>次期繰越損益金 (G)</b>	<b>△ 288,194,928</b>
追加信託差損益金	257,468,917
(配当等相当額)	( 713,199,327)
(売買損益相当額)	(△ 455,730,410)
分配準備積立金	96,112,250
繰越損益金	△ 641,776,095

(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せん。

(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。

## 日本債券インデックスマザーファンド

### <補足情報>

当ファンド（ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用））が投資対象としている「日本債券インデックスマザーファンド」の決算日（2021年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在における日本債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

### ■日本債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄 公 社 債

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

### ■組入資産明細表

下記は、2022年6月15日現在における日本債券インデックスマザーファンド（73,960,042千円）の内容です。

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

作 成 期 区 分	2022年6月15日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	う ち B B 格 以 下 組 比	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	90,875,000	92,613,356	91.2	—	58.4	23.5	9.4
地方債証券	3,100,000	3,235,573	3.2	—	1.6	1.2	0.4
特殊債券（除く金融債券）	2,000,000	2,040,068	2.0	—	1.2	0.7	0.1
金融債券	100,000	99,471	0.1	—	—	0.1	—
普通社債券	3,000,000	3,011,147	3.0	—	1.3	1.5	0.2
合 計	99,075,000	100,999,617	99.5	—	62.5	26.9	10.1

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

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

2022年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国債証券	426 2年国債	0.0050	390,000	390,425	2023/07/01
	427 2年国債	0.0050	166,000	166,185	2023/08/01
	428 2年国債	0.0050	450,000	450,517	2023/09/01
	137 5年国債	0.1000	800,000	801,864	2023/09/20
	330 10年国債	0.8000	612,000	618,842	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	365,000	368,160	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	92,258	2023/09/20
	429 2年国債	0.0050	40,000	40,046	2023/10/01
	430 2年国債	0.0050	303,000	303,354	2023/11/01
	431 2年国債	0.0050	900,000	901,116	2023/12/01
	138 5年国債	0.1000	1,200,000	1,203,168	2023/12/20
	332 10年国債	0.6000	250,000	252,552	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	180,232	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	185,000	190,250	2023/12/20
	433 2年国債	0.0050	900,000	901,098	2024/02/01
	434 2年国債	0.0050	100,000	100,128	2024/03/01
	139 5年国債	0.1000	950,000	952,840	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	700,000	708,253	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	56,907	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	124,796	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	114,203	2024/03/20
	435 2年国債	0.0050	100,000	100,134	2024/04/01
	436 2年国債	0.0050	500,000	500,700	2024/05/01
	140 5年国債	0.1000	1,120,000	1,123,606	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	900,000	911,952	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	87,110	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	130,687	2024/06/20
	141 5年国債	0.1000	1,210,000	1,214,101	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	690,000	698,597	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	105,000	110,113	2024/09/20
	142 5年国債	0.1000	1,040,000	1,043,785	2024/12/20
	336 10年国債	0.5000	275,000	278,767	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	400,000	403,468	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	126,171	2024/12/20
74 20年国債	2.1000	73,000	76,938	2024/12/20	
143 5年国債	0.1000	800,000	802,976	2025/03/20	
338 10年国債	0.4000	580,000	586,965	2025/03/20	
75 20年国債	2.1000	80,000	84,716	2025/03/20	
76 20年国債	1.9000	51,000	53,724	2025/03/20	
77 20年国債	2.0000	130,000	137,304	2025/03/20	
144 5年国債	0.1000	1,090,000	1,094,098	2025/06/20	
339 10年国債	0.4000	590,000	597,552	2025/06/20	
78 20年国債	1.9000	61,000	64,538	2025/06/20	
79 20年国債	2.0000	50,000	53,050	2025/06/20	
80 20年国債	2.1000	53,000	56,393	2025/06/20	
145 5年国債	0.1000	1,250,000	1,254,687	2025/09/20	
340 10年国債	0.4000	760,000	770,290	2025/09/20	
82 20年国債	2.1000	87,000	93,006	2025/09/20	
146 5年国債	0.1000	780,000	782,870	2025/12/20	

日本債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	341 10年国債	0.3000	500,000	505,355	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	99,876	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	1,120,000	1,119,787	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	880,000	882,974	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	62,554	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	86,883	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	59,525	2026/03/20
	148 5年国債	0.0050	1,100,000	1,099,109	2026/06/20
	343 10年国債	0.1000	780,000	782,340	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	109,115	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	84,797	2026/06/20
	149 5年国債	0.0050	780,000	778,837	2026/09/20
	344 10年国債	0.1000	780,000	781,989	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	20,000	21,838	2026/09/20
	150 5年国債	0.0050	1,250,000	1,247,175	2026/12/20
	345 10年国債	0.1000	950,000	951,919	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	310,000	338,532	2026/12/20
	151 5年国債	0.0050	1,140,000	1,136,477	2027/03/20
	346 10年国債	0.1000	780,000	781,107	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	109,154	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	142,516	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	600,000	600,294	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	55,526	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	55,000	60,529	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	550,000	549,708	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	44,386	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	320,000	353,414	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	1,300,000	1,297,855	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	100,000	110,812	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	550,000	548,427	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	155,000	173,240	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	350,000	395,188	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	97,368	2028/04/20
	351 10年国債	0.1000	1,000,000	995,530	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	170,000	191,601	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	10,000	11,151	2028/06/20
	11 フィリピン共和国	0.9900	100,000	99,872	2028/08/15
	352 10年国債	0.1000	700,000	695,884	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	140,938	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	168,712	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	930,000	923,127	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	90,000	100,960	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	300,000	332,676	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	600,000	594,408	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	55,000	61,133	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	260,000	292,455	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	690,000	682,161	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	200,000	226,870	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	150,000	169,119	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	710,000	702,147	2029/09/20

2022年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	1 30年国債	2.8000	16,000	18,930	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	310,000	351,158	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	940,000	925,166	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	70,000	79,285	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	205,200	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	27,794	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	800,000	786,672	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	200,000	228,812	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	200,000	227,296	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	34,671	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	880,000	865,216	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	107,717	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	103,993	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	317,000	349,511	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	900,000	883,701	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	200,000	225,710	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	200,000	224,098	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	43,695	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	1,070,000	1,049,616	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	200,000	229,690	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	300,000	342,045	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	760,000	745,430	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	130,000	151,015	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	125,906	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	250,000	284,015	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	32,624	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	770,000	755,493	2031/06/20
	128 20年国債	1.9000	250,000	284,970	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	200,000	226,222	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	910,000	898,042	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	159,500	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	169,537	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	28,727	2031/11/20
	365 10年国債	0.1000	1,130,000	1,114,767	2031/12/20
	132 20年国債	1.7000	100,000	113,262	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	430,000	491,012	2031/12/20
	366 10年国債	0.2000	800,000	796,184	2032/03/20
	134 20年国債	1.8000	30,000	34,299	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	104,310	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	550,000	618,376	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	65,666	2032/05/20
	138 20年国債	1.5000	100,000	111,500	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	370,000	416,139	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	300,000	340,461	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	30,925	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	47,505	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	400,000	454,288	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	160,000	183,336	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	48,298	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	236,359	2033/03/20



日本債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在

区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	144 20年国債	1.5000	290,000	323,405	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	45,460	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	450,000	511,425	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	70,840	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	350,000	397,964	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	87,819	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	400,000	450,592	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	99,857	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	450,000	501,925	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	50,000	61,609	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	502,000	560,146	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	250,000	308,662	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	180,000	198,718	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	130,000	159,272	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	480,000	518,342	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	97,154	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	460,000	496,533	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	69,321	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	530,000	578,261	2035/06/20
	154 20年国債	1.2000	550,000	593,087	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	73,206	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	440,000	462,862	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	170,000	212,129	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	370,000	359,451	2036/03/20
	157 20年国債	0.2000	460,000	433,416	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	115,193	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	350,000	342,923	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	183,796	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	240,000	237,777	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	180,000	223,322	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	360,000	360,964	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	420,000	414,292	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	188,793	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	450,000	442,876	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	340,000	333,608	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	170,000	214,342	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	500,000	482,040	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	300,000	288,453	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	249,642	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	400,000	395,664	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	400,000	382,496	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	271,777	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	320,000	300,195	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	320,000	294,278	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	300,000	366,483	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	220,000	201,632	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	500,000	456,685	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	285,000	353,397	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	100,000	92,699	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	410,000	378,811	2040/06/20

2022年6月15日現在

区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	33 30年国債	2.0000	280,000	333,275	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	550,000	506,467	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	400,000	373,720	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	270,000	330,577	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	380,000	353,897	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	380,000	346,620	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	250,000	297,835	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	390,000	361,717	2041/09/20
	179 20年国債	0.5000	550,000	509,256	2041/12/20
	36 30年国債	2.0000	350,000	418,092	2042/03/20
	180 20年国債	0.8000	100,000	97,830	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	450,000	528,930	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	250,000	289,352	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	230,000	270,399	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	180,000	208,170	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	210,000	238,772	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	205,000	233,142	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	260,000	295,497	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	200,000	227,354	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	250,000	274,227	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	180,000	197,416	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	370,000	413,071	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	260,000	279,362	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	120,000	128,892	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	310,000	293,864	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	270,000	226,816	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	280,000	246,173	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	250,000	224,350	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	310,000	290,770	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	260,000	243,269	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	240,000	223,994	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	230,000	214,120	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	89,980	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	400,000	371,440	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	300,000	271,338	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	210,000	198,607	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	179,704	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	136,567	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	230,000	195,801	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	300,000	247,755	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	220,000	181,238	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	200,000	164,690	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	187,479	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	200,000	164,626	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	260,000	224,702	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	290,000	250,107	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	350,000	309,858	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	180,000	224,730	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	235,000	207,657	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	260,000	229,309	2051/06/20

日本債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	72 30年国債	0.7000	320,000	281,987	2051/09/20
	73 30年国債	0.7000	363,000	319,610	2051/12/20
	5 40年国債	2.0000	185,000	221,583	2052/03/20
	74 30年国債	1.0000	259,000	245,754	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	123,453	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	136,322	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	241,099	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	170,150	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	275,000	249,559	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	280,598	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	380,000	298,444	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	360,000	281,358	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	430,000	358,878	2061/03/20
	15 40年国債	1.0000	500,000	457,085	2062/03/20
種別小計	銘柄数 金 額	263銘柄		90,875,000	92,613,356
地方債証券	126 共同発行地方	0.8100	100,000	100,987	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	201,842	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	101,014	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	101,057	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	100,988	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	202,595	2025/04/16
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	105,332	2025/11/21
	27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	101,234	2025/11/27
	751 東京都公債	0.3700	100,000	100,884	2025/12/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,621	2026/06/19
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,010	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,138	2027/03/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	199,693	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,009	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	99,955	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	112,308	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	110,806	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	113,072	2029/06/20
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	112,452	2029/12/14
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	113,253	2030/05/24
	2-2 岡山県公債	0.1200	100,000	97,311	2031/01/29
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	97,498	2031/06/30
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	113,747	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	111,006	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	110,876	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	103,921	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	119,781	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	104,170	2045/12/20
種別小計	銘柄数 金 額	28銘柄		3,100,000	3,235,573
特殊債券 (除く金融債券)	51 地方公共団体	0.8410	100,000	100,977	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	101,090	2024/10/28

2022年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	100,825	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	101,058	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	202,373	2025/11/28
	127 都市再生	0.0750	100,000	99,551	2026/09/18
	80 住宅支援機構	1.5890	100,000	106,000	2026/09/18
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	105,792	2027/08/25
	1 地方公共団体15年	1.3340	100,000	105,927	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	111,941	2029/07/31
	47日本政策投資CO	1.0270	100,000	104,353	2029/09/20
	123 住宅支援機構	1.8010	100,000	113,370	2032/09/17
	31 地方公共団体20	1.7440	100,000	112,677	2033/09/28
	223 政保道路機構	1.4270	100,000	109,994	2034/07/31
	284 政保道路機構	0.1490	200,000	185,435	2036/07/31
	298 政保道路機構	0.5470	100,000	97,749	2036/12/26
	247 道路機構	0.3420	200,000	180,947	2040/03/19
種別小計	銘柄数	17銘柄			
	金額		2,000,000	2,040,068	
金融債券	19 利付商工債	0.1000	100,000	99,471	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄			
	金額		100,000	99,471	
普通社債券	175 オリックス	1.0640	100,000	101,319	2023/11/24
	21 西日本高速道	0.7540	100,000	101,045	2023/12/20
	1 三菱UFJFG 劣後	0.9400	100,000	100,901	2024/06/26
	482 九州電力	0.1700	100,000	99,920	2024/08/23
	5 野村不動産HD	0.9240	100,000	101,879	2025/05/30
	11日本たばこ産業	0.5990	100,000	101,389	2025/07/15
	63 中日本高速道	0.5760	100,000	101,495	2025/11/13
	4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	101,785	2025/12/18
	14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	99,846	2025/12/19
	16 NTT ファイナンス	0.1800	100,000	99,707	2025/12/19
	1 日生2021基金	0.2800	100,000	99,363	2026/08/03
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,644	2026/08/21
	17 パナソニック	0.4700	100,000	100,540	2026/09/18
	7 三井住友海上	0.1900	100,000	99,291	2026/11/13
	6 楽天カード	0.6200	100,000	98,264	2026/12/17
	509 関西電力	0.4700	100,000	99,804	2027/05/25
	12 アサヒグループHD	0.3300	100,000	99,909	2027/06/11
	15 デンソー	0.2450	100,000	99,580	2027/06/18
	78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	99,623	2027/07/23
	11 東京電力パワー	0.7900	100,000	100,016	2028/01/25
	20 ZHD	0.4600	100,000	98,102	2028/07/28
	15 ソフトバンク	0.4100	100,000	97,689	2028/10/12
	41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	110,908	2029/01/29
	13 NTT ファイナンス	1.0900	100,000	103,896	2029/09/20
	7 凸版印刷	1.1040	100,000	103,826	2029/12/12
	65 東京瓦斯	0.2250	100,000	96,986	2030/09/10
	18 楽天グループ	1.0500	100,000	96,399	2031/12/02
	332 北海道電力	0.9070	100,000	97,937	2036/04/25

# 日本債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	23 森ビル 107東日本旅客鉄	0.9700 % 1.4150	千円 100,000 100,000	千円 95,962 104,109	2038/05/17 2045/01/27
種別小計	銘柄数	30銘柄			
	金額		3,000,000	3,011,147	
合 計	銘柄数	339銘柄			
	金額		99,075,000	100,999,617	

(注) 単位未満は切捨て。

# 日本債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第22期 (決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日)

日本債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

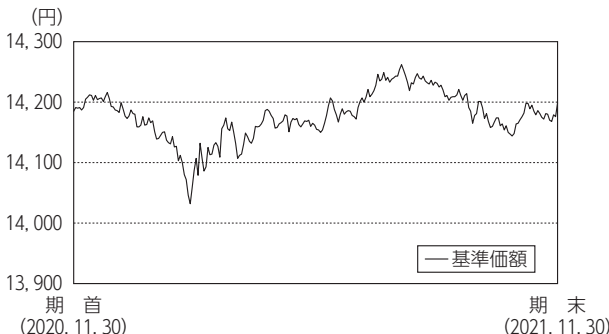
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		ダイワ・ポンド・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
	円	騰落率	総合指数	騰落率		
(期首) 2020年11月30日	14,185	—	531.781	—	99.6	—
12月末	14,186	0.0	531.946	0.0	99.6	—
2021年1月末	14,151	△ 0.2	530.582	△ 0.2	99.6	—
2月末	14,032	△ 1.1	526.155	△ 1.1	99.3	—
3月末	14,132	△ 0.4	529.811	△ 0.4	99.4	—
4月末	14,158	△ 0.2	530.887	△ 0.2	99.4	—
5月末	14,165	△ 0.1	531.127	△ 0.1	99.1	—
6月末	14,172	△ 0.1	531.421	△ 0.1	99.6	—
7月末	14,243	0.4	534.087	0.4	99.2	—
8月末	14,231	0.3	533.627	0.3	99.1	—
9月末	14,181	△ 0.0	531.730	△ 0.0	99.4	—
10月末	14,165	△ 0.1	531.186	△ 0.1	99.5	—
(期末) 2021年11月30日	14,199	0.1	532.469	0.1	99.2	—

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：14,185円 期末：14,199円 騰落率：0.1%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内債券市況

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

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

\*ベンチマークはダイワ・ポンド・インデックス (DBI) 総合指数です。

《今後の運用方針》

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

## ■ 1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■ 売買および取引の状況

## 公 社 債

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債券(転換社債券)は含まれておりません。

(注4) 単位未満は切捨て。

## ■ 主要な売買銘柄

## 公 社 債

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。



# 日本債券インデックスマザーファンド

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

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

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

区 分	当 期		年 利 率	末		償還年月日
	銘 柄	額 面 金 額		評 価 額	額 面 金 額	
<b>国債証券</b>		千円	%	千円	千円	
	134 5年国債	950,000	0.1000	952,251	952,251	2022/12/20
	326 10年国債	30,000	0.7000	30,258	30,258	2022/12/20
	327 10年国債	450,000	0.8000	454,360	454,360	2022/12/20
	59 20年国債	45,000	1.7000	45,862	45,862	2022/12/20
	60 20年国債	10,000	1.4000	10,160	10,160	2022/12/20
	421 2年国債	600,000	0.1000	601,614	601,614	2023/02/01
	135 5年国債	1,550,000	0.1000	1,554,526	1,554,526	2023/03/20
	328 10年国債	350,000	0.6000	353,300	353,300	2023/03/20
	61 20年国債	100,000	1.0000	101,463	101,463	2023/03/20
	423 2年国債	100,000	0.0050	100,180	100,180	2023/04/01
	424 2年国債	500,000	0.0050	500,955	500,955	2023/05/01
	425 2年国債	380,000	0.0050	380,767	380,767	2023/06/01
	136 5年国債	950,000	0.1000	953,391	953,391	2023/06/20
	329 10年国債	500,000	0.8000	507,185	507,185	2023/06/20
	62 20年国債	95,000	0.8000	96,365	96,365	2023/06/20
	63 20年国債	130,000	1.8000	133,887	133,887	2023/06/20
	426 2年国債	390,000	0.0050	390,830	390,830	2023/07/01
	427 2年国債	166,000	0.0050	166,373	166,373	2023/08/01
	137 5年国債	800,000	0.1000	803,392	803,392	2023/09/20
	330 10年国債	612,000	0.8000	622,281	622,281	2023/09/20
	331 10年国債	365,000	0.6000	369,814	369,814	2023/09/20
	64 20年国債	90,000	1.9000	93,301	93,301	2023/09/20
	429 2年国債	40,000	0.0050	40,099	40,099	2023/10/01
	138 5年国債	1,200,000	0.1000	1,205,676	1,205,676	2023/12/20
	332 10年国債	250,000	0.6000	253,727	253,727	2023/12/20
	65 20年国債	175,000	1.9000	182,290	182,290	2023/12/20
	66 20年国債	185,000	1.8000	192,326	192,326	2023/12/20
	139 5年国債	900,000	0.1000	904,770	904,770	2024/03/20
	333 10年国債	700,000	0.6000	711,697	711,697	2024/03/20

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
			%	千円	千円	
	67 20年国債		1.9000	55,000	57,560	2024/03/20
	68 20年国債		2.2000	120,000	126,416	2024/03/20
	69 20年国債		2.1000	110,000	115,628	2024/03/20
	140 5年国債		0.1000	700,000	704,025	2024/06/20
	334 10年国債		0.6000	900,000	916,695	2024/06/20
	70 20年国債		2.4000	83,000	88,362	2024/06/20
	71 20年国債		2.2000	125,000	132,436	2024/06/20
	141 5年国債		0.1000	1,120,000	1,127,078	2024/09/20
	335 10年国債		0.5000	690,000	702,123	2024/09/20
	72 20年国債		2.1000	105,000	111,555	2024/09/20
	142 5年国債		0.1000	850,000	855,856	2024/12/20
	336 10年国債		0.5000	275,000	280,263	2024/12/20
	337 10年国債		0.3000	400,000	405,208	2024/12/20
	73 20年国債		2.0000	120,000	127,792	2024/12/20
	74 20年国債		2.1000	73,000	77,964	2024/12/20
	143 5年国債		0.1000	700,000	705,215	2025/03/20
	338 10年国債		0.4000	580,000	589,987	2025/03/20
	75 20年国債		2.1000	80,000	85,881	2025/03/20
	76 20年国債		1.9000	51,000	54,411	2025/03/20
	77 20年国債		2.0000	130,000	139,126	2025/03/20
	144 5年国債		0.1000	890,000	896,977	2025/06/20
	339 10年国債		0.4000	590,000	600,938	2025/06/20
	78 20年国債		1.9000	61,000	65,381	2025/06/20
	79 20年国債		2.0000	50,000	53,770	2025/06/20
	80 20年国債		2.1000	53,000	57,185	2025/06/20
	145 5年国債		0.1000	1,100,000	1,109,031	2025/09/20
	340 10年国債		0.4000	760,000	775,093	2025/09/20
	82 20年国債		2.1000	87,000	94,341	2025/09/20
	146 5年国債		0.1000	480,000	484,099	2025/12/20
	341 10年国債		0.3000	500,000	508,445	2025/12/20
	83 20年国債		2.1000	93,000	101,365	2025/12/20
	147 5年国債		0.0050	840,000	843,981	2026/03/20
	342 10年国債		0.1000	880,000	887,981	2026/03/20
	85 20年国債		2.1000	58,000	63,536	2026/03/20
	86 20年国債		2.3000	80,000	88,326	2026/03/20
	87 20年国債		2.2000	55,000	60,487	2026/03/20
	148 5年国債		0.0050	1,000,000	1,005,020	2026/06/20
	343 10年国債		0.1000	780,000	787,488	2026/06/20
	88 20年国債		2.3000	100,000	110,996	2026/06/20
	89 20年国債		2.2000	78,000	86,220	2026/06/20
	149 5年国債		0.0050	220,000	221,060	2026/09/20
	344 10年国債		0.1000	780,000	787,527	2026/09/20
	90 20年国債		2.2000	20,000	22,219	2026/09/20
	345 10年国債		0.1000	900,000	909,135	2026/12/20
	92 20年国債		2.1000	310,000	344,627	2026/12/20
	346 10年国債		0.1000	780,000	788,307	2027/03/20
	93 20年国債		2.0000	100,000	111,186	2027/03/20
	94 20年国債		2.1000	130,000	145,234	2027/03/20
	347 10年国債		0.1000	600,000	606,528	2027/06/20
	95 20年国債		2.3000	50,000	56,682	2027/06/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
			%	千円	千円	
	96 20年国債		2.1000	55,000	61,736	2027/06/20
	348 10年国債		0.1000	550,000	556,253	2027/09/20
	97 20年国債		2.2000	40,000	45,343	2027/09/20
	98 20年国債		2.1000	320,000	360,876	2027/09/20
	349 10年国債		0.1000	1,050,000	1,062,453	2027/12/20
	99 20年国債		2.1000	100,000	113,326	2027/12/20
	350 10年国債		0.1000	500,000	506,015	2028/03/20
	100 20年国債		2.2000	155,000	177,426	2028/03/20
	101 20年国債		2.4000	350,000	405,076	2028/03/20
	27 メキシコ国債		1.0500	100,000	99,550	2028/04/20
	351 10年国債		0.1000	800,000	809,744	2028/06/20
	103 20年国債		2.3000	170,000	196,642	2028/06/20
	104 20年国債		2.1000	10,000	11,435	2028/06/20
	11 フイリピン共和国		0.9900	100,000	101,955	2028/08/15
	352 10年国債		0.1000	700,000	708,855	2028/09/20
	105 20年国債		2.1000	126,000	144,787	2028/09/20
	106 20年国債		2.2000	150,000	173,392	2028/09/20
	353 10年国債		0.1000	580,000	587,609	2028/12/20
	107 20年国債		2.1000	90,000	103,914	2028/12/20
	108 20年国債		1.9000	300,000	342,126	2028/12/20
	354 10年国債		0.1000	600,000	607,926	2029/03/20
	109 20年国債		1.9000	55,000	62,971	2029/03/20
	110 20年国債		2.1000	260,000	301,498	2029/03/20
	355 10年国債		0.1000	690,000	699,163	2029/06/20
	111 20年国債		2.2000	200,000	234,462	2029/06/20
	112 20年国債		2.1000	150,000	174,708	2029/06/20
	356 10年国債		0.1000	510,000	516,599	2029/09/20
	1 30年国債		2.8000	16,000	19,579	2029/09/20
	113 20年国債		2.1000	310,000	362,634	2029/09/20
	357 10年国債		0.1000	620,000	627,768	2029/12/20
	114 20年国債		2.1000	70,000	82,200	2029/12/20
	115 20年国債		2.2000	180,000	212,828	2029/12/20
	2 30年国債		2.4000	24,000	28,854	2030/02/20
	358 10年国債		0.1000	660,000	667,966	2030/03/20
	116 20年国債		2.2000	200,000	237,400	2030/03/20
	117 20年国債		2.1000	200,000	235,734	2030/03/20
	3 30年国債		2.3000	30,000	35,947	2030/05/20
	359 10年国債		0.1000	930,000	940,360	2030/06/20
	118 20年国債		2.0000	95,000	111,531	2030/06/20
	119 20年国債		1.8000	93,000	107,588	2030/06/20
	120 20年国債		1.6000	317,000	361,294	2030/06/20
	360 10年国債		0.1000	900,000	909,117	2030/09/20
	121 20年国債		1.9000	200,000	233,758	2030/09/20
	122 20年国債		1.8000	200,000	231,996	2030/09/20
	4 30年国債		2.9000	36,000	45,364	2030/11/20
	361 10年国債		0.1000	633,000	638,437	2030/12/20
	123 20年国債		2.1000	200,000	237,910	2030/12/20
	124 20年国債		2.0000	300,000	354,150	2030/12/20
	362 10年国債		0.1000	710,000	715,268	2031/03/20
	125 20年国債		2.2000	130,000	156,302	2031/03/20

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
			%	千円	千円	
	126 20年国債		2.0000	110,000	130,214	2031/03/20
	127 20年国債		1.9000	250,000	293,620	2031/03/20
	5 30年国債		2.2000	28,000	33,734	2031/05/20
	363 10年国債		0.1000	700,000	703,990	2031/06/20
	128 20年国債		1.9000	250,000	294,380	2031/06/20
	129 20年国債		1.8000	200,000	233,600	2031/06/20
	364 10年国債		0.1000	520,000	522,277	2031/09/20
	130 20年国債		1.8000	140,000	163,899	2031/09/20
	131 20年国債		1.7000	150,000	174,142	2031/09/20
	6 30年国債		2.4000	24,000	29,580	2031/11/20
	132 20年国債		1.7000	40,000	46,531	2031/12/20
	133 20年国債		1.8000	430,000	504,506	2031/12/20
	134 20年国債		1.8000	30,000	35,288	2032/03/20
	135 20年国債		1.7000	92,000	107,278	2032/03/20
	136 20年国債		1.6000	300,000	346,755	2032/03/20
	7 30年国債		2.3000	55,000	67,672	2032/05/20
	138 20年国債		1.5000	100,000	114,796	2032/06/20
	139 20年国債		1.6000	370,000	428,615	2032/06/20
	140 20年国債		1.7000	300,000	351,486	2032/09/20
	8 30年国債		1.8000	27,000	31,965	2032/11/22
	9 30年国債		1.4000	43,000	49,056	2032/12/20
	141 20年国債		1.7000	200,000	234,850	2032/12/20
	142 20年国債		1.8000	240,000	284,443	2032/12/20
	10 30年国債		1.1000	45,000	49,915	2033/03/20
	143 20年国債		1.6000	210,000	244,782	2033/03/20
	144 20年国債		1.5000	240,000	277,072	2033/03/20
	11 30年国債		1.7000	40,000	47,173	2033/06/20
	145 20年国債		1.7000	420,000	495,318	2033/06/20
	12 30年国債		2.1000	60,000	73,740	2033/09/20
	146 20年国債		1.7000	350,000	413,633	2033/09/20
	13 30年国債		2.0000	75,000	91,533	2033/12/20
	147 20年国債		1.6000	320,000	375,148	2033/12/20
	14 30年国債		2.4000	82,000	104,279	2034/03/20
	148 20年国債		1.5000	530,000	616,029	2034/03/20
	15 30年国債		2.5000	50,000	64,395	2034/06/20
	149 20年国債		1.5000	402,000	467,988	2034/06/20
	16 30年国債		2.5000	250,000	323,187	2034/09/20
	150 20年国債		1.4000	180,000	207,610	2034/09/20
	17 30年国債		2.4000	130,000	166,909	2034/12/20
	151 20年国債		1.2000	400,000	451,740	2034/12/20
	18 30年国債		2.3000	80,000	102,026	2035/03/20
	152 20年国債		1.2000	460,000	520,260	2035/03/20
	19 30年国債		2.3000	57,000	72,888	2035/06/20
	153 20年国債		1.3000	430,000	492,401	2035/06/20
	154 20年国債		1.2000	550,000	623,034	2035/09/20
	21 30年国債		2.3000	60,000	77,168	2035/12/20
	155 20年国債		1.0000	350,000	387,208	2035/12/20
	22 30年国債		2.5000	170,000	223,884	2036/03/20
	156 20年国債		0.4000	270,000	275,969	2036/03/20
	157 20年国債		0.2000	360,000	357,220	2036/06/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
	24 30年国債		2.5000	92,000	121,895	2036/09/20
	158 20年国債		0.5000	350,000	362,229	2036/09/20
	25 30年国債		2.3000	150,000	194,889	2036/12/20
	159 20年国債		0.6000	170,000	178,243	2036/12/20
	26 30年国債		2.4000	180,000	237,198	2037/03/20
	160 20年国債		0.7000	360,000	382,741	2037/03/20
	161 20年国債		0.6000	320,000	335,008	2037/06/20
	27 30年国債		2.5000	150,000	200,848	2037/09/20
	162 20年国債		0.6000	350,000	366,117	2037/09/20
	163 20年国債		0.6000	340,000	355,347	2037/12/20
	28 30年国債		2.5000	170,000	228,825	2038/03/20
	164 20年国債		0.5000	500,000	514,340	2038/03/20
	165 20年国債		0.5000	300,000	308,244	2038/06/20
	29 30年国債		2.4000	200,000	267,398	2038/09/20
	166 20年国債		0.7000	350,000	370,615	2038/09/20
	167 20年国債		0.5000	300,000	307,488	2038/12/20
	30 30年国債		2.3000	220,000	291,638	2039/03/20
	168 20年国債		0.4000	320,000	322,083	2039/03/20
	169 20年国債		0.3000	320,000	316,044	2039/06/20
	31 30年国債		2.2000	300,000	394,329	2039/09/20
	170 20年国債		0.3000	220,000	216,882	2039/09/20
	171 20年国債		0.3000	300,000	295,197	2039/12/20
	32 30年国債		2.3000	285,000	380,899	2040/03/20
	172 20年国債		0.4000	100,000	100,000	2040/03/20
	173 20年国債		0.4000	410,000	409,290	2040/06/20
	33 30年国債		2.0000	280,000	360,231	2040/09/20
	174 20年国債		0.4000	420,000	418,534	2040/09/20
	175 20年国債		0.5000	400,000	405,284	2040/12/20
	34 30年国債		2.2000	270,000	358,030	2041/03/20
	176 20年国債		0.5000	340,000	343,933	2041/03/20
	177 20年国債		0.4000	365,000	362,043	2041/06/20
	35 30年国債		2.0000	250,000	323,395	2041/09/20
	178 20年国債		0.5000	150,000	151,363	2041/09/20
	36 30年国債		2.0000	310,000	402,364	2042/03/20
	37 30年国債		1.9000	350,000	448,668	2042/09/20
	38 30年国債		1.8000	250,000	316,517	2043/03/20
	39 30年国債		1.9000	230,000	296,389	2043/06/20
	40 30年国債		1.8000	180,000	228,472	2043/09/20
	41 30年国債		1.7000	170,000	212,629	2043/12/20
	42 30年国債		1.7000	205,000	256,668	2044/03/20
	43 30年国債		1.7000	200,000	250,668	2044/06/20
	44 30年国債		1.7000	200,000	250,922	2044/09/20
	45 30年国債		1.5000	200,000	242,592	2044/12/20
	46 30年国債		1.5000	140,000	169,923	2045/03/20
	47 30年国債		1.6000	400,000	494,788	2045/06/20
	48 30年国債		1.4000	160,000	190,832	2045/09/20
	49 30年国債		1.4000	120,000	143,187	2045/12/20
	50 30年国債		0.8000	260,000	274,814	2046/03/20
	51 30年国債		0.3000	240,000	226,044	2046/06/20
	52 30年国債		0.5000	260,000	256,321	2046/09/20

区 分	当 期		末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	53 30年国債	0.6000	250,000	251,920	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	310,000	326,485	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	260,000	273,639	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	170,000	178,593	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	230,000	241,451	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	100,678	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	350,000	367,150	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	300,000	306,870	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	210,000	224,544	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	203,706	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	153,078	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	230,000	222,258	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	230,000	216,057	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	220,000	206,078	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	200,000	187,026	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	209,835	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	200,000	186,930	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	230,000	226,412	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	290,000	285,441	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	259,000	261,843	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	180,000	253,659	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	235,000	237,307	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	240,000	242,373	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	140,000	141,218	2051/09/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	141,153	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	156,797	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	279,128	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	200,910	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	275,000	293,053	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	330,697	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	380,000	354,897	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	430,000	400,394	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	300,000	298,161	2061/03/20
種 別 小 計	銘 柄 数	262銘柄			
	金 額		79,992,000	85,097,080	
地方債証券	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	100,888	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	100,639	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	101,485	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	202,723	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	101,460	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	101,504	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	101,447	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	203,686	2025/04/16
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	106,623	2025/11/21
	27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	101,874	2025/11/27
	751 東京都公債	0.3700	100,000	101,482	2025/12/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	100,259	2026/06/19

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当 期		末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,916	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	101,119	2027/03/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	201,625	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	101,039	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	101,351	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	115,199	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	113,930	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	116,763	2029/06/20
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	116,484	2029/12/14
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	117,498	2030/05/24
	2-2 岡山県公債	0.1200	100,000	100,154	2031/01/29
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	100,139	2031/06/30
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	117,121	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	115,382	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	115,827	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	109,600	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	130,694	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	115,929	2045/12/20
種別小計	銘柄数	30銘柄			
	金額		3,300,000	3,514,853	
特殊債券 (除く金融債券)	25 政保日本政策	0.8150	100,000	101,061	2023/02/24
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	100,916	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	100,927	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	101,190	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	100,960	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	101,467	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	101,524	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,108	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	101,547	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	203,284	2025/11/28
	127 都市再生	0.0750	100,000	100,191	2026/09/18
	80 住宅支援機構	1.5890	100,000	107,467	2026/09/18
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	107,540	2027/08/25
	1 地方公共団体15年	1.3340	100,000	107,919	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	115,190	2029/07/31
	47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	107,254	2029/09/20
	123 住宅支援機構	1.8010	100,000	116,970	2032/09/17
31 地方公共団体20	1.7440	100,000	117,162	2033/09/28	
223 政保道路機構	1.4270	100,000	114,844	2034/07/31	
284 政保道路機構	0.1490	200,000	195,373	2036/07/31	
298 政保道路機構	0.5470	100,000	103,238	2036/12/26	
247 道路機構	0.3420	200,000	195,749	2040/03/19	
種別小計	銘柄数	22銘柄			
	金額		2,500,000	2,602,888	

区 分		当 期	末			
銘 柄		年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千円	千円		
<b>金融債券</b>		19 利付商工債	0.1000	100,000	100,201	2026/09/18
種 別 小 計	銘 柄 数	1銘柄				
	金 額		100,000	100,201		
<b>普通社債券</b>		175 オリックス	1.0640	100,000	101,961	2023/11/24
		21 西日本高速道	0.7540	100,000	101,538	2023/12/20
		1 三菱 UFJFG 劣後	0.9400	100,000	101,659	2024/06/26
		482 九州電力	0.1700	100,000	100,233	2024/08/23
		5 野村不動産 HD	0.9240	100,000	102,551	2025/05/30
		11日本たばこ産業	0.5990	100,000	101,889	2025/07/15
		63 中日本高速道	0.5760	100,000	102,163	2025/11/13
		4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	102,699	2025/12/18
		14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	100,443	2025/12/19
		16 NTT ファイナンス	0.1800	100,000	100,241	2025/12/19
		1 日生2021基金	0.2800	100,000	100,018	2026/08/03
		20 成田国際空港	0.1050	100,000	100,249	2026/08/21
		17 パナソニック	0.4700	100,000	101,500	2026/09/18
		7 三井住友海上	0.1900	100,000	100,049	2026/11/13
		509 関西電力	0.4700	100,000	101,460	2027/05/25
		12 アサヒグループHD	0.3300	100,000	101,050	2027/06/11
		15 デンソー	0.2450	100,000	100,656	2027/06/18
		78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	100,754	2027/07/23
		11 東京電力パワー	0.7900	100,000	102,792	2028/01/25
		20 ZHD	0.4600	100,000	99,967	2028/07/28
		15 ソフトバンク	0.4100	100,000	99,989	2028/10/12
		41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	114,360	2029/01/29
		13 NTT ファイナンス	1.0900	100,000	106,692	2029/09/20
		7 凸版印刷	1.1040	100,000	106,876	2029/12/12
		65 東京瓦斯	0.2250	100,000	100,444	2030/09/10
		18 楽天グループ	1.0500	100,000	100,138	2031/12/02
		332 北海道電力	0.9070	100,000	104,791	2036/04/25
		23 森ビル	0.9700	100,000	102,592	2038/05/17
		107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	116,343	2045/01/27
種 別 小 計	銘 柄 数	29銘柄				
	金 額		2,900,000	2,976,109		
合 計	銘 柄 数	344銘柄				
	金 額		88,792,000	94,291,133		

(注) 単位未満は切捨て。



# 日本債券インデックスマザーファンド

## ■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

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

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

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

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

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

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

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,199円です。

## ■損益の状況

当期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日

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

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

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

# ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジあり) (ダイワSMA専用)

## 運用報告書(全体版)

### 第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

#### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2017年2月16日）		
運用方針	投資成果をFTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの受益証券	
	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	外国の公社債	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の10%以下	
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

#### 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/>

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2 期末 (2018年 6月15日)	9,966	0	△ 2.4	10,037	△ 1.9	95.4	2.1	1,398
3 期末 (2019年 6月17日)	10,418	0	4.5	10,544	5.1	97.3	1.4	12,750
4 期末 (2020年 6月15日)	10,992	0	5.5	11,190	6.1	97.5	—	22,300
5 期末 (2021年 6月15日)	10,724	0	△ 2.4	10,976	△ 1.9	98.5	—	8,180
6 期末 (2022年 6月15日)	9,122	120	△ 13.8	9,492	△ 13.5	101.6	0.2	16,292

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

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

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

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

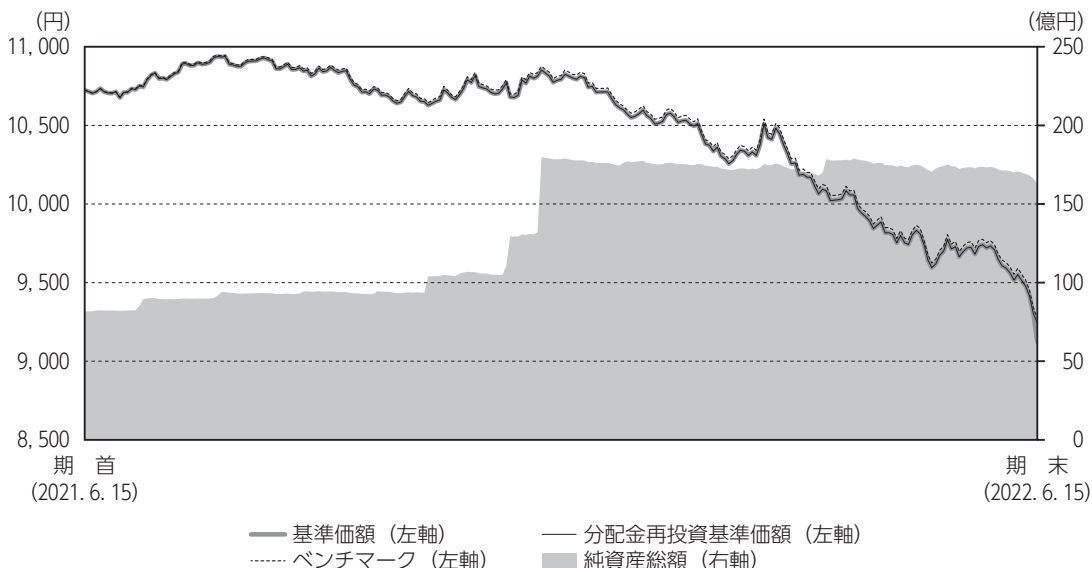
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注7) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：10,724円

期末：9,122円（分配金120円）

騰落率：△13.8%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」を通じて、日本を除く先進国国債に投資した結果、各国の金利が上昇（債券価格は下落）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。

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)

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		
(期首)2021年 6月15日	円 10,724	% —	10,976	% —	% 98.5	% —
6月末	10,709	△ 0.1	10,964	△ 0.1	97.5	—
7月末	10,891	1.6	11,155	1.6	96.4	—
8月末	10,889	1.5	11,158	1.7	97.7	—
9月末	10,714	△ 0.1	10,982	0.1	98.4	—
10月末	10,706	△ 0.2	10,976	△ 0.0	98.8	2.2
11月末	10,769	0.4	11,045	0.6	96.8	—
12月末	10,668	△ 0.5	10,946	△ 0.3	99.6	—
2022年 1月末	10,533	△ 1.8	10,811	△ 1.5	97.0	0.4
2月末	10,309	△ 3.9	10,583	△ 3.6	97.7	0.4
3月末	10,033	△ 6.4	10,302	△ 6.1	102.9	1.4
4月末	9,810	△ 8.5	10,077	△ 8.2	101.0	—
5月末	9,709	△ 9.5	9,971	△ 9.2	97.3	0.5
(期末)2022年 6月15日	9,242	△ 13.8	9,492	△ 13.5	101.6	0.2

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

（2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15）

### 海外債券市況

主要国の国債金利は上昇しました。

当作成期首より、主要国の国債金利は、米国などで将来の利上げ後の経済回復ペースや物価上昇圧力の鈍化が意識されたことで、長期ゾーンを中心に低下しましたが、2021年9月にF R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げ見通しが市場予想を上回ったことなどから、上昇に転じました。2022年に入ってから、ロシアがウクライナに侵攻したことで原油価格が高騰し、インフレ期待が上昇したことで、金利上昇が加速しました。その後も、インフレ率の上振れなどから各国で金融政策正常化が意識され、主要国の金利は上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに金利は上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### 当ファンド

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

### 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

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

### ■当ファンド

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

### ■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

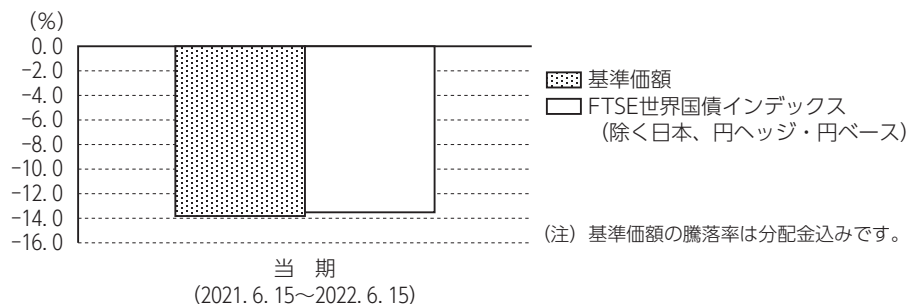
組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）

## ベンチマークとの差異について

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

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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

## 分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
<b>当期分配金（税込み）</b>	<b>（円）</b>	<b>120</b>
対基準価額比率	（％）	1.30
当期の収益	（円）	120
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	961

（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。

### ■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期	
(a) 経費控除後の配当等収益	✓	138.60円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益		0.00
(c) 収益調整金		850.42
(d) 分配準備積立金		92.18
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）		1,081.20
(f) 分配金		120.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）		961.20

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 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

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



## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	44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, 467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）	(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	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	2	0. 018	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）	(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. 002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	46	0. 436	

(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。

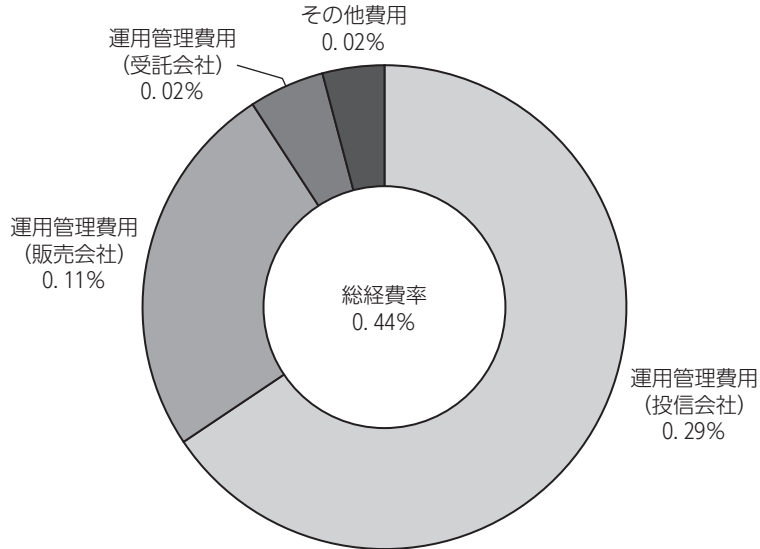
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。

## 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）

### ■売買および取引の状況

#### 親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2021年6月16日から2022年6月15日まで）

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス （為替ヘッジあり） マザーファンド	11,546,832	11,972,149	1,328,732	1,325,625

（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。

### ■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首 保有額	当作成期中 設定額	当作成期中 解約額	当作成期末 保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

（注1）金額は元本ベース。

（注2）単位未満は切捨て。

### ■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	7,844,177	18,062,277	16,243,405

（注）単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス （為替ヘッジあり）マザーファンド	16,243,405	98.2
コール・ローン等、その他	300,690	1.8
投資信託財産総額	16,544,096	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。

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

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

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	16,544,096,552円
コール・ローン等	300,690,562
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）	16,243,405,990
(B) 負債	251,364,009
未払収益分配金	214,320,791
未払信託報酬	36,326,334
その他未払費用	716,884
(C) 純資産総額（A－B）	16,292,732,543
元本	17,860,065,982
次期繰越損益金	△ 1,567,333,439
(D) 受益権総口数	17,860,065,982口
1万口当り基準価額（C/D）	9,122円

\* 期首における元本額は7,628,232,231円、当作成期間中における追加設定元本額は11,384,539,682円、同解約元本額は1,152,705,931円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,122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1,567,333,439円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 11,078円
受取利息	468
支払利息	△ 11,546
(B) 有価証券売買損益	△ 2,524,192,185
売買益	40,255,456
売買損	△ 2,564,447,641
(C) 信託報酬等	△ 58,507,710
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 2,582,710,973
(E) 前期繰越損益金	△ 100,721,117
(F) 追加信託差損益金	1,330,419,442
(配当等相当額)	( 1,518,860,275)
(売買損益相当額)	(△ 188,440,833)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 1,353,012,648
(H) 収益分配金	△ 214,320,791
次期繰越損益金 (G + H)	△ 1,567,333,439
追加信託差損益金	1,330,419,442
(配当等相当額)	( 1,518,860,275)
(売買損益相当額)	(△ 188,440,833)
分配準備積立金	197,858,674
繰越損益金	△ 3,095,611,555

- (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せん。
- (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	247,543,625円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	1,518,860,275
(d) 分配準備積立金	164,635,840
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,931,039,740
(f) 分配金	214,320,791
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,716,718,949
(h) 受益権総口数	17,860,065,982口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)	120円

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

# 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

## 運用報告書 第6期（決算日 2022年6月15日）

（作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日）

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

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

## 大和アセットマネジメント

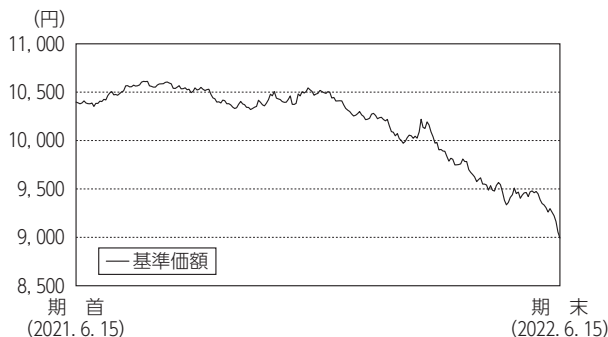
Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移

《運用経過》



◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,398円 期末：8,993円 騰落率：△13.5%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外債券市況

主要国の国債金利は、上昇しました。

当作成期首より、主要国の国債金利は、米国などで将来の利上げ後の経済回復ペースや物価上昇圧力の鈍化が意識されたことで、長期ゾーンを中心に低下しましたが、2021年9月にF R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げ見通しが市場予想を上回ったことなどから、上昇に転じました。2022年に入ってから、ロシアがウクライナに侵攻したことで原油価格が高騰し、インフレ期待が上昇したことで、金利上昇が加速しました。その後も、インフレ率の上振れなどから各国で金融政策正常化が意識され、主要国の金利は上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに金利は上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

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

《今後の運用方針》

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

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
	円	騰落率（ベンチマーク）	騰落率	騰落率		
(期首) 2021年6月15日	10,398	—	10,462	—	98.8	—
6月末	10,385	△ 0.1	10,450	△ 0.1	97.8	—
7月末	10,566	1.6	10,632	1.6	96.6	—
8月末	10,568	1.6	10,635	1.7	98.0	—
9月末	10,401	0.0	10,468	0.1	98.7	—
10月末	10,397	△ 0.0	10,461	△ 0.0	99.1	2.2
11月末	10,462	0.6	10,528	0.6	97.1	—
12月末	10,368	△ 0.3	10,433	△ 0.3	99.9	—
2022年1月末	10,240	△ 1.5	10,305	△ 1.5	97.2	0.4
2月末	10,025	△ 3.6	10,087	△ 3.6	98.0	0.4
3月末	9,759	△ 6.1	9,819	△ 6.1	103.2	1.4
4月末	9,545	△ 8.2	9,605	△ 8.2	101.3	—
5月末	9,450	△ 9.1	9,504	△ 9.2	97.6	0.5
(期末) 2022年6月15日	8,993	△13.5	9,048	△13.5	101.9	0.2

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

# 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

## ■ 1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■ 売買および取引の状況

### (1) 公 社 債

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカ・ドル 211,180	千アメリカ・ドル 148,074 ( — )
	カナダ	千カナダ・ドル 7,549	千カナダ・ドル 5,916 ( — )
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 1,269	千オーストラリア・ドル 5,764 ( — )
	シンガポール	千シンガポール・ドル 1,237	千シンガポール・ドル 1,024 ( — )
	イギリス	千イギリス・ポンド 11,119	千イギリス・ポンド 13,115 ( — )
	イスラエル	千イスラエル・シケル 2,574	千イスラエル・シケル 3,603 ( — )
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 4,851	千デンマーク・クローネ 5,617 ( — )
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 7,237	千ノルウェー・クローネ 1,612 ( — )
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 2,569	千スウェーデン・クローネ 7,192 ( — )
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 27,964	千メキシコ・ペソ 16,065 ( — )
中国	千オフショア・人民元 133,144	千オフショア・人民元 5,531 ( — )	

		買付額	売付額
外	マレーシア	千マレーシア・リンギット 4,569	千マレーシア・リンギット 1,120 ( — )
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 3,346	千ポーランド・ズロチ 4,236 ( — )
	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 782	千ユーロ 1,047 ( — )
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 4,038	千ユーロ 2,589 ( — )
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 3,985	千ユーロ 3,165 ( — )
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 21,144	千ユーロ 16,945 ( — )
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 16,619	千ユーロ 14,217 ( — )
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 13,500	千ユーロ 10,554 ( — )
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 20,956	千ユーロ 17,688 ( — )
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 1,172	千ユーロ 1,480 ( — )
国	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 3,269	千ユーロ 2,832 ( — )
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 85,469	千ユーロ 70,521 ( — )

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

### (2) 先物取引の種類別取引状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	当 期			組入比率	未 うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率			
		評 価 額		%			%	%	%	%
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額							
アメリカ	千アメリカ・ドル 500,462	千アメリカ・ドル 460,256	千円 62,139,230	% 51.7	% —	% 24.0	% 18.0	% 9.8		
カナダ	千カナダ・ドル 26,257	千カナダ・ドル 24,111	2,512,414	2.1	—	1.1	0.5	0.5		
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 22,874	千オーストラリア・ドル 20,474	1,906,160	1.6	—	1.1	0.4	0.1		
シンガポール	千シンガポール・ドル 6,122	千シンガポール・ドル 5,875	569,604	0.5	—	0.3	0.1	0.1		
イギリス	千イギリス・ポンド 37,977	千イギリス・ポンド 38,197	6,195,990	5.2	—	4.0	0.7	0.4		
イスラエル	千イスラエル・シケル 11,250	千イスラエル・シケル 10,897	424,355	0.4	—	0.2	0.1	0.1		
デンマーク	千デンマーク・クローネ 25,540	千デンマーク・クローネ 25,680	486,130	0.4	—	0.3	0.1	0.0		
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 21,380	千ノルウェー・クローネ 20,125	271,486	0.2	—	0.1	0.0	0.1		
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 25,320	千スウェーデン・クローネ 24,686	327,093	0.3	—	0.1	0.1	0.0		
メキシコ	千メキシコ・ペソ 158,730	千メキシコ・ペソ 146,498	961,839	0.8	—	0.4	0.4	0.0		
中国	千オフショア・人民元 124,500	千オフショア・人民元 127,855	2,558,941	2.1	—	1.0	0.8	0.3		
マレーシア	千マレーシア・リンギット 23,280	千マレーシア・リンギット 22,570	689,224	0.6	—	0.3	0.2	0.0		
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 22,395	千ポーランド・ズロチ 18,173	546,920	0.5	—	0.2	0.2	0.1		
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 6,218	千ユーロ 5,885	828,708	0.7	—	0.5	0.1	0.0		



## 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	額 面 金 額	当 期			未				
		評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 比	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 15,320	千ユーロ 15,155	千円 2,133,921	% 1.8	% —	% 1.3	% 0.4	% 0.1	
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 18,354	千ユーロ 17,576	2,474,729	2.1	—	1.5	0.4	0.1	
ユーロ (フランス)	千ユーロ 78,471	千ユーロ 76,884	10,825,331	9.0	—	5.5	2.7	0.8	
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 56,163	千ユーロ 58,046	8,173,016	6.8	—	4.2	1.6	1.0	
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 46,538	千ユーロ 45,613	6,422,322	5.3	—	3.1	1.6	0.7	
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 71,847	千ユーロ 69,510	9,787,137	8.1	—	4.6	2.6	1.0	
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 5,020	千ユーロ 4,553	641,137	0.5	—	0.3	0.2	0.0	
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 11,100	千ユーロ 10,649	1,499,450	1.2	—	0.7	0.5	0.0	
ユーロ (小計)	309,031	303,876	42,785,754	35.6	—	21.7	10.0	3.9	
合計	—	—	122,375,149	101.9	—	54.8	31.7	15.4	

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

## (2) 外国（外貨建）公社債（銘柄別）

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					未		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	13,310	13,205	1,782,930	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	27,905	27,704	3,740,366	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	15,000	14,848	2,004,736	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	16,580	16,300	2,200,680	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	3,300	3,421	461,924	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	8,950	10,032	1,354,463	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	3,700	4,050	546,873	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	1,400	1,661	224,378	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	630	716	96,784	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	300	354	47,837	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	430	428	57,790	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,410	1,555	209,994	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,390	1,581	213,569	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	2,270	2,611	352,609	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	600	602	81,391	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	670	614	82,922	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,500	1,287	173,877	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,500	3,921	529,463	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,100	1,080	145,912	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,532	2,536	342,405	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,000	982	132,614	

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					未		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	2,200	2,076	280,359	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,940	2,662	359,435	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	12,810	12,432	1,678,527	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,100	889	120,072	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	15,300	14,681	1,982,200	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	370	327	44,247	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	14,820	14,107	1,904,627	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	19,800	18,930	2,555,817	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,400	1,242	167,719	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	12,000	11,179	1,509,368	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,865	6,358	858,414	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,070	864	116,741	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	11,750	10,772	1,454,365	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	500	383	51,767	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	12,000	11,718	1,582,144	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	14,850	13,854	1,870,490	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,330	2,026	273,530	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,670	4,393	593,158	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	900	803	108,437	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	8,050	7,595	1,025,522	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	950	847	114,370	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	14,000	13,094	1,767,866	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	14,700	14,301	1,930,902	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,810	2,395	323,446	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	7,000	6,759	912,654	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	15,800	15,378	2,076,245	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,435	328,847	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,500	4,150	560,314	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	7,300	7,013	946,918	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	12,000	11,520	1,555,315	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,500	1,350	182,372	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	9,300	9,047	1,221,453	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	1,850	1,793	242,138	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	13,000	12,270	1,656,667	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,200	2,902	391,831	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	1,772	239,345	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,800	3,522	475,601	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	7,000	6,545	883,706	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,100	1,633	220,548	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,400	4,783	645,832	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,300	1,041	140,601	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,500	3,894	525,805	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	1,832	247,405	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,400	2,035	274,809	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	11,300	7,488	1,011,069	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,300	5,016	677,320	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,700	2,292	309,513	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	4,900	3,971	536,185	2030/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,800	2,520	340,246	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	4,500	3,832	517,409	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	5,300	4,528	611,347	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,100	2,903	391,951	2051/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	4,900	4,041	545,698	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,400	1,800	243,092	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,500	4,825	651,473	2028/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,600	3,946	532,764	2031/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,400	3,512	474,278	2051/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,600	1,275	172,220	2041/05/15

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	5,700	4,704	635,153	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	3,900	2,845	384,162	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	5,750	4,177	564,033	2041/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	6,700	5,570	752,057	2031/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	3,500	2,476	334,389	2051/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	2,000	1,517	204,939	2041/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	3,800	3,300	445,558	2032/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	1,000	777	105,032	2052/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	1,000	810	109,389	2042/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	2,400	2,278	307,644	2032/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	800	717	96,818	2052/05/15
通貨小計	銘柄数 金 額	90銘柄		500,462	460,256	62,139,230	
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	860	736	76,744	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	907	1,025	106,866	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,050	1,249	130,146	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	300	349	36,438	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	620	660	68,835	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	140	140	14,622	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,038	3,971	413,800	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	730	717	74,733	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	700	617	64,330	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,492	1,442	150,259	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,920	1,777	185,255	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	930	822	85,720	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	549	57,250	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,520	1,126	117,429	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	300	275	28,666	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,000	981	102,226	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,342	139,878	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,700	1,421	148,136	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	818	85,278	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,313	136,861	2030/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,000	1,676	174,662	2031/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	750	514	53,585	2053/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	700	582	60,684	2031/12/01
通貨小計	銘柄数 金 額	23銘柄		26,257	24,111	2,512,414	
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	889	931	86,751	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,156	1,149	107,002	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	320	308	28,736	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,800	1,790	166,686	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	359	375	34,958	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,398	2,453	228,388	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	725	697	64,958	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	800	695	64,749	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	684	611	56,895	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,300	1,238	115,266	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	658	605	56,329	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	575	470	43,829	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,250	1,174	109,362	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,100	1,901	177,024	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	510	416	38,743	2041/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,800	1,468	136,676	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,350	1,832	170,564	2032/05/21

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	千オーストラリア・ドル 2,300	千オーストラリア・ドル 1,816	千円 169,130	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	900	538	50,104	2051/06/21
通貨小計	銘柄数 金 額	19銘柄			22,874	20,474	1,906,160	
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 203	千シンガポール・ドル 206	20,027	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	150	150	14,605	2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	600	588	57,064	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	239	223	21,715	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	700	701	68,035	2023/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	420	427	41,411	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	500	494	47,893	2029/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	400	394	38,237	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	330	308	29,865	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	200	193	18,790	2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	260	231	22,448	2036/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	800	782	75,892	2028/05/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	500	494	47,982	2024/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	300	268	26,001	2039/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	350	274	26,569	2050/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	170	134	13,064	2051/10/01
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄			6,122	5,875	569,604	
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	千イギリス・ポンド 1,350	千イギリス・ポンド 1,342	217,779	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	810	806	130,860	2065/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,875	1,825	296,068	2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,150	893	144,862	2047/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	820	717	116,452	2037/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	900	721	117,103	2057/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	650	620	100,576	2027/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	800	770	124,965	2028/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	517	394	63,913	2071/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	1,500	1,470	238,514	2024/04/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	800	654	106,134	2049/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	660	107,150	2054/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	800	720	116,862	2029/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,200	929	150,814	2041/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	400	338	54,939	2030/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	850	422	68,493	2061/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	370	220	35,699	2050/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,450	1,114	180,836	2035/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	1,200	979	158,830	2031/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	500	338	54,895	2046/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	200	142	23,036	2051/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	100	75	12,264	2053/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	200	123	20,045	2073/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	963	1,175	190,752	2028/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,600	1,838	298,154	2032/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,275	1,367	221,861	2025/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	915	1,075	174,498	2036/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	550	697	113,094	2038/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	850	1,152	186,977	2055/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	770	974	158,094	2046/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,300	1,431	232,156	2027/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	911	1,157	187,713	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	907	1,069	173,539	2030/12/07

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分		当 期				末		償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	543	701	113,815	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,130	1,363	221,203	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	300	356	57,895	2034/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	527	709	115,038	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,000	1,214	196,987	2040/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	700	855	138,795	2052/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	675	728	118,108	2044/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,390	1,392	225,807	2023/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	638	809	131,377	2068/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,000	1,012	164,210	2024/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	740	831	134,808	2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	44銘柄			37,977	38,197	6,195,990	
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,200	1,507	58,691	2042/01/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	1,650	1,683	65,572	2024/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	500	481	18,769	2025/08/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	4,000	3,815	148,574	2027/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	1,200	1,194	46,505	2047/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	1,700	1,449	56,435	2030/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,000	765	29,807	2037/05/31
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄			11,250	10,897	424,355	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	6,740	9,008	170,528	2039/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	670	674	12,777	2023/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,830	2,840	53,773	2025/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,200	2,975	56,316	2027/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,700	4,226	80,002	2029/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	1,408	26,663	2052/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,651	31,253	2031/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,895	54,814	2024/11/15
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄			25,540	25,680	486,130	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	6,300	6,329	85,390	2024/03/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	150	145	1,956	2025/03/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,430	1,352	18,242	2026/02/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,000	2,826	38,125	2027/02/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	4,000	3,763	50,770	2028/04/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,000	1,822	24,588	2029/09/06
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	2,500	2,187	29,503	2030/08/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,000	1,698	22,908	2031/09/17
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄			21,380	20,125	271,486	
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,520	3,045	40,358	2039/03/30
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,150	4,142	54,888	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,820	3,874	51,336	2025/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,780	4,576	60,639	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,550	2,373	31,449	2028/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	500	513	6,802	2032/06/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,000	2,750	36,449	2029/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	4,000	3,409	45,169	2031/05/12
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄			25,320	24,686	327,093	



外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
通貨小計		銘柄数			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
		金 額			千メキシコ・ペソ	千円		
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	24,200	21,337	140,092	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	11,450	10,025	65,823	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,900	27,048	177,588	2024/09/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	6,740	6,594	43,298	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,340	6,399	42,016	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	20,800	19,263	126,475	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	2,750	2,922	19,190	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,500	6,241	40,977	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	5,000	4,685	30,763	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,700	20,701	135,912	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	14,050	12,082	79,329	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,300	9,195	60,371	2034/11/23	
	通貨小計		12銘柄		158,730	146,498	961,839	
中国	China Government Bond	国債証券	3.2500	6,500	6,711	134,324	2028/11/22	
	China Government Bond	国債証券	3.2900	3,000	3,110	62,261	2029/05/23	
	China Government Bond	国債証券	3.1300	2,800	2,862	57,283	2029/11/21	
	China Government Bond	国債証券	2.9400	14,000	14,204	284,286	2024/10/17	
	China Government Bond	国債証券	2.6800	3,000	2,969	59,424	2030/05/21	
	China Government Bond	国債証券	2.8800	19,000	19,193	384,156	2023/11/05	
	China Government Bond	国債証券	3.0200	4,000	4,072	81,505	2025/10/22	
	China Government Bond	国債証券	3.2800	8,500	8,780	175,729	2027/12/03	
	China Government Bond	国債証券	3.2700	4,000	4,136	82,787	2030/11/19	
	China Government Bond	国債証券	3.8100	3,000	3,255	65,154	2050/09/14	
	China Government Bond	国債証券	3.7200	1,600	1,713	34,286	2051/04/12	
	China Government Bond	国債証券	3.0200	1,800	1,823	36,502	2031/05/27	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	7,000	7,094	141,993	2026/05/05	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7400	10,000	10,075	201,661	2026/08/04	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5900	6,500	6,826	136,624	2027/08/03	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0800	3,400	3,841	76,876	2048/10/22	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8600	1,800	1,966	39,367	2049/07/22	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7700	10,000	10,419	208,546	2025/03/08	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	1,100	1,113	22,278	2050/03/16	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	3,500	3,532	70,695	2028/10/14	
CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	3,300	3,429	68,645	2051/10/18		
CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	5,300	5,323	106,549	2031/11/18		
CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	1,400	1,398	27,998	2032/05/15		
通貨小計		23銘柄		124,500	127,855	2,558,941		
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,760	1,773	54,146	2030/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,000	985	30,099	2031/06/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	1,950	1,937	59,152	2027/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,400	1,315	40,159	2033/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,500	1,460	44,594	2028/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,150	1,157	35,337	2025/09/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	500	478	14,599	2035/05/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,600	1,616	49,354	2023/08/17	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	1,420	1,361	41,561	2046/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	2,700	2,729	83,358	2024/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	500	493	15,082	2027/11/16	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,000	997	30,460	2037/04/07	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	1,500	1,498	45,773	2026/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,200	1,164	35,567	2029/08/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,187	36,264	2034/07/05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,216	37,149	2040/05/22	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分		当 期				末			
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	千マレーシア・リンギット 1,400	千マレーシア・リンギット 1,197	千円 36,562	2050/06/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	17銘柄			23,280	22,570	689,224		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	千ポーランド・ズロチ 2,640	千ポーランド・ズロチ 2,152	64,785	2026/07/25	
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,815	1,410	42,453	2027/07/25	
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,900	2,653	79,843	2024/04/25	
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	2,300	1,675	50,409	2029/10/25	
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	2,000	1,779	53,536	2024/10/25	
		Poland Government Bond	国債証券	1.2500	1,800	1,106	33,305	2030/10/25	
		Poland Government Bond	国債証券	0.2500	900	655	19,721	2026/10/25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	700	418	12,587	2032/04/25	
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	600	543	16,367	2029/04/25	
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	710	682	20,533	2023/10/25	
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	1,800	1,384	41,651	2028/04/25	
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,230	3,712	111,724	2025/07/25	
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄			22,395	18,173	546,920		
ユーロ（アイルランド）		IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	千ユーロ 688	千ユーロ 761	107,193	2025/03/13	
		IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	300	311	43,918	2024/03/18	
		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	680	697	98,172	2030/05/15	
		IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	410	366	51,553	2045/02/18	
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	520	507	71,493	2026/05/15	
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	570	515	72,539	2037/05/15	
		IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	752	105,933	2028/05/15	
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	150	133	18,823	2033/05/15	
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	1,100	1,026	144,555	2031/03/18	
		IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	300	282	39,770	2029/05/15	
		IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	300	230	32,431	2050/05/15	
		IRISH TREASURY	国債証券	—	200	161	22,713	2031/10/18	
		IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	200	139	19,609	2041/04/22	
	国小計	銘柄数 金 額	13銘柄			6,218	5,885	828,708	
ユーロ（オランダ）		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	千ユーロ 580	千ユーロ 694	97,728	2028/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,400	1,724	242,871	2037/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	980	1,224	172,365	2042/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	890	925	130,240	2033/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	750	758	106,737	2023/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	910	1,026	144,469	2047/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	980	994	140,044	2024/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	690	664	93,587	2025/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,670	1,596	224,792	2026/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,470	1,399	197,076	2027/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	393	55,382	2024/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	900	845	119,014	2028/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	624	87,929	2029/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	189	26,611	2040/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	750	642	90,486	2030/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	433	61,086	2052/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	754	106,178	2031/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	265	37,318	2029/01/15	
	国小計	銘柄数 金 額	18銘柄			15,320	15,155	2,133,921	
	ユーロ（ベルギー）		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	千ユーロ 1,170	千ユーロ 1,143	161,021	2025/06/22

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	300	269	37,974	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	460	419	58,995	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	595	578	81,488	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	614	484	68,265	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	470	390	54,975	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	400	396	55,826	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	730	694	97,716	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	500	490	69,014	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	310	272	38,315	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	400	344	48,519	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	880	823	116,005	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	500	448	63,198	2033/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,100	1,018	143,353	2029/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	350	276	38,980	2050/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	400	340	47,877	2030/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	600	406	57,278	2040/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	300	271	38,248	2027/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	1,800	1,453	204,698	2031/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	270	116	16,399	2071/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	200	163	23,021	2032/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	300	212	29,907	2053/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,000	1,201	169,100	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	750	956	134,670	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	965	1,180	166,235	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	700	773	108,975	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	300	344	48,479	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	500	507	71,506	2023/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	390	457	64,434	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	800	821	115,653	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	300	316	44,591	2034/06/22
国 小 計	銘柄数 金 額	31銘柄		18,354	17,576	2,474,729	
ユーロ（フランス）				千ユーロ	千ユーロ		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,415	3,906	550,057	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,600	3,418	481,296	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,210	1,520	214,043	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,232	1,565	220,400	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,265	1,516	213,591	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,200	1,255	176,743	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,143	2,739	385,670	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,000	1,291	181,865	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,640	3,886	547,198	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,910	4,082	574,833	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,340	1,481	208,614	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,500	3,567	502,311	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,986	2,048	288,400	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,360	3,387	477,019	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,400	4,269	601,194	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,250	2,124	299,081	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,400	3,240	456,287	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,150	1,837	258,755	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,100	832	117,233	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,070	1,933	272,240	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	1,614	227,323	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,343	189,176	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,800	1,586	223,437	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,500	2,333	328,532	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	1,580	222,489	2034/05/25



外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				千ユーロ	千ユーロ	千円	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,750	2,543	358,070	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,157	303,713	2024/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,650	1,279	180,199	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,400	3,065	431,685	2029/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,057	289,735	2029/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,100	666	93,883	2052/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,300	910	128,171	2040/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,497	351,673	2030/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	200	80	11,378	2072/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	1,780	250,645	2031/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	825	116,246	2027/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	300	177	24,978	2053/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	600	476	67,148	2032/05/25
国 小 計	銘柄数 金 額	38銘柄		78,471	76,884	10,825,331	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ドイツ）	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	455	564	79,451	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	800	973	137,064	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	800	947	133,370	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	2,096	2,785	392,192	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,660	2,170	305,550	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	3,270	4,340	611,156	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,090	1,394	196,365	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,020	1,378	194,153	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,810	2,613	368,010	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	656	814	114,619	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,098	1,240	174,648	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	760	772	108,723	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,300	4,356	613,347	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,575	1,801	253,704	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,990	2,005	282,338	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,000	1,991	280,344	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,165	164,132	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,800	3,758	529,229	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,883	1,822	256,599	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,850	3,625	510,514	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,550	1,464	206,193	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,100	2,939	413,852	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,460	1,298	182,830	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,050	989	139,311	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,800	1,659	233,681	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,800	1,648	232,130	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	967	136,229	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	618	87,109	2030/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	237	33,502	2035/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	1,401	197,302	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	954	134,449	2031/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	155	21,901	2036/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	243	34,218	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,115	157,132	2031/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	600	348	49,013	2052/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	991	139,532	2023/10/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	490	69,107	2024/04/05
国 小 計	銘柄数 金 額	37銘柄		56,163	58,046	8,173,016	
				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	1,714	241,470	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	3,100	3,064	431,416	2025/04/30

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千 円	千 円	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	910	854	120,300	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,565	2,566	361,397	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,400	1,382	194,650	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	989	909	128,047	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,480	1,387	195,305	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,049	1,961	276,177	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,100	2,008	282,773	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,320	1,227	172,888	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,170	1,107	155,902	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,650	1,545	217,644	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	850	745	104,898	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	740	104,226	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,400	1,195	168,293	2035/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	900	774	109,102	2029/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	842	118,564	2030/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	100	56	7,890	2050/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	1,589	223,815	2030/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	950	668	94,061	2040/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	800	626	88,200	2031/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	200	99	13,997	2071/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	866	122,039	2028/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	500	353	49,768	2037/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	719	101,246	2031/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	1,000	801	112,792	2032/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	680	844	118,907	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	900	1,003	141,348	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	800	977	137,685	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,043	1,248	175,748	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,000	1,141	160,704	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	2,188	2,281	321,175	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,700	1,950	274,629	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,090	1,400	197,199	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	3,700	3,849	542,017	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,084	1,108	156,032	2024/10/31
国 小 計	銘柄数 金 額	36銘柄		46,538	45,613	6,422,322	
ユーロ（イタリア）				千ユーロ	千ユーロ		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	2,700	3,153	443,996	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,135	1,310	184,531	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,100	3,087	434,786	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	905	780	109,955	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	920	884	124,506	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,500	1,218	171,538	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	900	870	122,501	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,400	1,087	153,093	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,250	996	140,321	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	3,700	3,650	514,036	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,000	727	102,457	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,700	1,448	203,886	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,700	1,611	226,937	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	950	840	118,313	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,550	1,451	204,418	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	700	600	84,521	2038/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,500	2,317	326,247	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,400	1,337	188,324	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,300	1,279	180,089	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	700	644	90,748	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	500	470	66,187	2049/09/01

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千 円	千 円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,100	1,051	148,031	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	1,400	1,341	188,909	2026/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	500	417	58,758	2030/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	150	106	15,033	2050/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	500	360	50,745	2036/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	1,591	224,024	2030/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	600	502	70,722	2030/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	600	415	58,439	2041/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,000	773	108,977	2031/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	100	58	8,275	2051/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	200	130	18,349	2037/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,600	1,186	167,047	2031/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	200	122	17,306	2045/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	450	268	37,872	2072/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	500	404	57,004	2029/02/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	500	321	45,277	2052/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	400	354	49,965	2038/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	1,540	1,698	239,150	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	1,488	1,719	242,135	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,300	1,482	208,764	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,650	1,786	251,574	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	1,270	1,250	176,094	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,140	1,252	176,320	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,870	1,937	272,869	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,900	3,071	432,447	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,714	1,883	265,172	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	4,250	4,465	628,762	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,080	2,215	311,976	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,025	1,106	155,819	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,830	2,946	414,805	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,110	2,166	305,058	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,370	1,349	190,044	2030/03/01
国 小 計	銘柄数 金 額	53銘柄		71,847	69,510	9,787,137	
ユーロ（フィンランド）	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	190	168	23,778	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	800	782	110,113	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	180	172	24,230	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	270	219	30,973	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	200	186	26,268	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	150	131	18,464	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	456	64,297	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	269	37,875	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	350	257	36,227	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	150	101	14,360	2040/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	200	104	14,739	2052/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	200	165	23,307	2031/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	371	52,263	2026/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	200	215	30,275	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	120	125	17,694	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	460	470	66,192	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	350	355	50,071	2024/04/15
国 小 計	銘柄数 金 額	17銘柄		5,020	4,553	641,137	
ユーロ（オーストリア）	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	540	534	75,197	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	490	469	66,165	2026/10/20

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千 円	千 円	
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	270	225	31,790	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	280	186	26,215	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,000	940	132,409	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	150	121	17,111	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	562	79,181	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	700	632	89,088	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	450	382	53,824	2030/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	393	55,403	2051/03/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.8500	100	40	5,729	2120/06/30
	Austria Government Bond	国債証券	—	500	412	58,095	2031/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	383	54,024	2025/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	200	147	20,728	2036/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	150	74	10,501	2071/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	200	177	24,957	2049/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	380	463	65,251	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	800	972	136,881	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	700	784	110,504	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	170	223	31,518	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	630	714	100,656	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	280	283	39,884	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	630	634	89,277	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	880	888	125,050	2024/10/21
国 小 計	銘柄数 金 額	24銘柄		11,100	10,649	1,499,450	
通貨小計	銘柄数 金 額	267銘柄		309,031	303,876	42,785,754	
合 計	銘柄数 金 額	554銘柄				122,375,149	

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

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

(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。

## 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

### ■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

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

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

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

(注3) 当期末における外貨建純資産（123,970,109千円）の投資信託財産総額（124,495,550千円）に対する比率は、99.6%です。

### ■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

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

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

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

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

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

\* 期首における元本額は113,403,229,819円、当作成期間中における追加設定元本額は33,395,160,755円、同解約元本額は13,223,960,983円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	108,109,338,430円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	4,161,900,030円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用）	1,564,129円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	3,239,349,686円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）	18,062,277,316円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は8,993円です。

\* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は13,453,638,368円です。

# 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)

## 運用報告書(全体版)

### 第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

#### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2017年2月16日）		
運用方針	投資成果をFTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券	
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の30%以下	
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

#### 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/>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2期末(2018年6月15日)	10,028	120	0.8	10,251	1.8	98.6	—	1
3期末(2019年6月17日)	10,184	100	2.6	10,530	2.7	98.5	—	11
4期末(2020年6月15日)	10,764	0	5.7	11,186	6.2	98.3	—	55
5期末(2021年6月15日)	11,309	20	5.2	11,807	5.6	98.7	—	5,570
6期末(2022年6月15日)	10,995	170	△ 1.3	11,667	△ 1.2	98.4	—	7,907

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

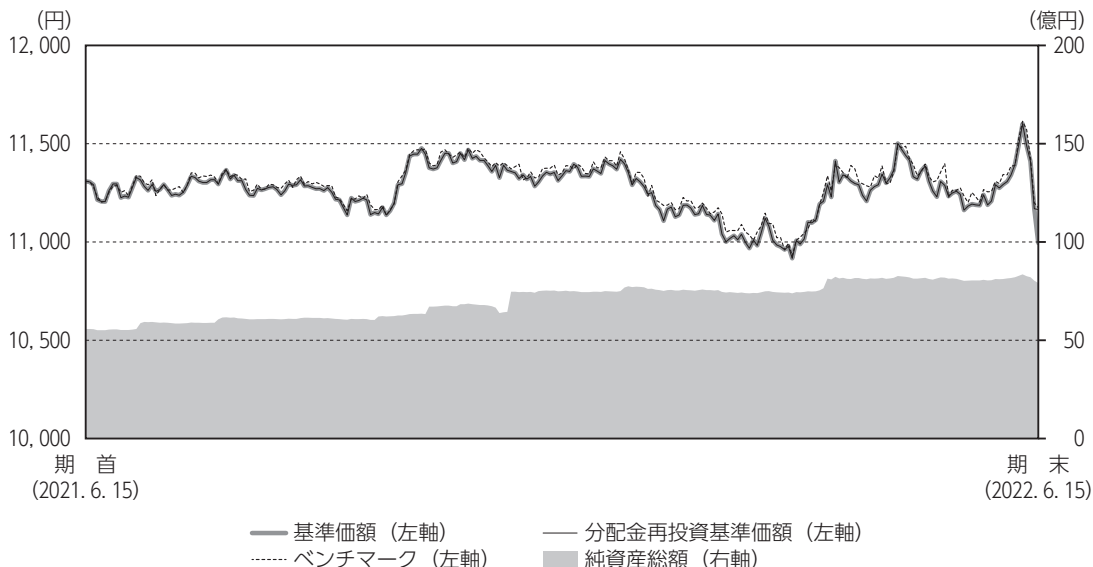
(注7) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。





## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

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

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

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：11,309円

期末：10,995円（分配金170円）

騰落率：△1.3%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

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



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)

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		
(期首)2021年 6月15日	円 11,309	% —	11,807	% —	% 98.7	% —
6月末	11,228	△ 0.7	11,730	△ 0.7	98.3	—
7月末	11,302	△ 0.1	11,832	0.2	98.4	—
8月末	11,294	△ 0.1	11,814	0.1	98.0	—
9月末	11,214	△ 0.8	11,737	△ 0.6	98.1	—
10月末	11,451	1.3	11,953	1.2	98.1	—
11月末	11,320	0.1	11,825	0.1	98.3	—
12月末	11,387	0.7	11,916	0.9	98.4	—
2022年 1月末	11,188	△ 1.1	11,702	△ 0.9	98.3	—
2月末	10,983	△ 2.9	11,539	△ 2.3	98.6	—
3月末	11,341	0.3	11,854	0.4	98.4	—
4月末	11,362	0.5	11,857	0.4	98.3	—
5月末	11,291	△ 0.2	11,807	△ 0.0	98.1	—
(期末)2022年 6月15日	11,165	△ 1.3	11,667	△ 1.2	98.4	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

（2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15）

### ■海外債券市況

主要国の国債金利は上昇しました。

当作成期首より、主要国の国債金利は、米国などで将来の利上げ後の経済回復ペースや物価上昇圧力の鈍化が意識されたことで、長期ゾーンを中心に低下しましたが、2021年9月にF R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げ見通しが市場予想を上回ったことなどから、上昇に転じました。2022年に入ってから、ロシアがウクライナに侵攻したことで原油価格が高騰し、インフレ期待が上昇したことで、金利上昇が加速しました。その後も、インフレ率の上振れなどから各国で金融政策正常化が意識され、主要国の金利は上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに金利は上昇しました。

### ■為替相場

為替相場は円安となりました。

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

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

### ■外国債券インデックスマザーファンド

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

## ポートフォリオについて

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

### 当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れました。

### 外国債券インデックスマザーファンド

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

\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

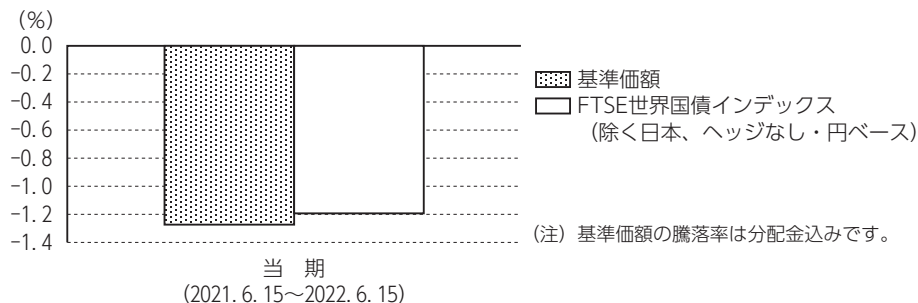
組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックスマザーファンド	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

## 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 $\Delta 1.2\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 1.3\%$ となりました。

当作成期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は $0.1\%$ 程度でした。ただし、これはファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正したものです。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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

## 分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記の「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。  
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■ 分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
<b>当期分配金（税込み）</b>	<b>（円）</b>	<b>170</b>
対基準価額比率	（％）	1.52
当期の収益	（円）	135
当期の収益以外	（円）	34
翌期繰越分配対象額	（円）	3,202

- (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。

### ■ 収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 135.72円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	3,049.69
(d) 分配準備積立金	✓ 187.38
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	3,372.80
(f) 分配金	170.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	3,202.80

- (注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 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

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	47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11,267円です。
（投 信 会 社）	(32)	(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）	(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	—	—	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	0.021	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(1)	(0.013)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	49	0.439	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

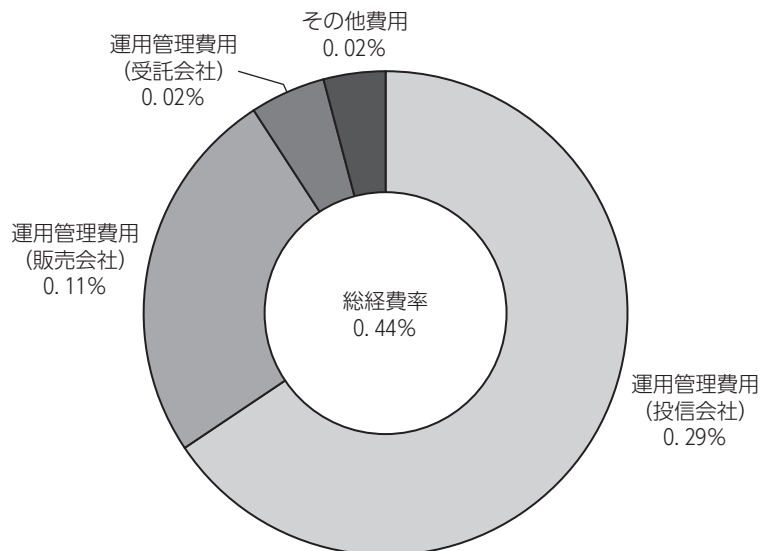
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.44%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

## 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）

### ■売買および取引の状況

#### 親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2021年6月16日から2022年6月15日まで）

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券 インデックス マザーファンド	1,139,364	3,575,541	371,547	1,166,693

（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。

### ■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首 保有額	当作成期中 設定額	当作成期中 解約額	当作成期末 保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

（注1）金額は元本ベース。

（注2）単位未満は切捨て。

### ■組入資産明細表

#### 親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	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	1,775,786	2,543,603	7,883,899	

（注）単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス マザーファンド	7,883,899	98.0
コール・ローン等、その他	162,571	2.0
投資信託財産総額	8,046,471	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。

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

（注3）外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（232,842,571千円）の投資信託財産総額（233,898,338千円）に対する比率は、99.5%です。

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	8,046,471,177円
コール・ローン等	162,571,454
外国債券インデックス マザーファンド（評価額）	7,883,899,723
(B) 負債	138,837,427
未払収益分配金	122,266,931
未払信託報酬	16,249,860
その他未払費用	320,636
(C) 純資産総額（A－B）	7,907,633,750
元本	7,192,172,427
次期繰越損益金	715,461,323
(D) 受益権総口数	7,192,172,427口
1万口当り基準価額（C/D）	10,995円

\* 期首における元本額は4,925,705,481円、当作成期間中における追加設定元本額は3,239,365,115円、同解約元本額は972,898,169円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,995円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 5,789円
受取利息	496
支払利息	△ 6,285
(B) 有価証券売買損益	△ 77,870,389
売買益	10,769,984
売買損	△ 88,640,373
(C) 信託報酬等	△ 30,006,856
(D) 当期繰越損益金 (A + B + C)	△ 107,883,034
(E) 前期繰越損益金	134,769,807
(F) 追加信託差損益金	810,841,481
(配当等相当額)	( 2,193,389,991)
(売買損益相当額)	(△ 1,382,548,510)
(G) 合計 (D + E + F)	837,728,254
(H) 収益分配金	△ 122,266,931
次期繰越損益金 (G + H)	715,461,323
追加信託差損益金	810,841,481
(配当等相当額)	( 2,193,389,991)
(売買損益相当額)	(△ 1,382,548,510)
分配準備積立金	110,121,472
繰越損益金	△ 205,501,630

- (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せん。
- (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	97,618,596円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	2,193,389,991
(d) 分配準備積立金	134,769,807
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,425,778,394
(f) 分配金	122,266,931
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,303,511,463
(h) 受益権総口数	7,192,172,427口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)	170円

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。



## 外国債券インデックスマザーファンド

### <補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（2021年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在における外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

### ■外国債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄 公 社 債

（2021年6月16日から2022年6月15日まで）

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.25% 2031/8/15	1,145,094	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 2023/4/14	790,367
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.375% 2031/11/15	1,022,248	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2022/11/15	777,091
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.875% 2032/2/15	897,130	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2022/11/30	736,251
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 0.375% 2024/9/15	848,795	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2023/5/15	630,327
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.25% 2028/9/30	785,770	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.125% 2022/6/30	604,766
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2% 2051/8/15	781,896	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.125% 2022/12/31	583,924
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2031/5/15	699,257	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 1.75% 2023/5/25	578,812
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.375% 2051/5/15	696,719	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2023/2/15	537,083
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.375% 2028/10/31	690,613	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.5% 2023/3/15	535,344
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 0.625% 2026/7/31	667,034	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2.25% 2022/10/25	487,862

(注1) 金額は受渡し代金（経過利分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

### ■組入資産明細表

下記は、2022年6月15日現在における外国債券インデックスマザーファンド（75,409,227千円）の内容です。

#### (1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	評 価 額		2022年6月15日現在		残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	組 入 比 率	うちBB格 以下組入 比 率	5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
アメリカ	千アメリカ・ドル 964,623	千アメリカ・ドル 872,910	千円 117,851,629	50.4	—	22.1	18.1	10.2
カナダ	千カナダ・ドル 49,221	千カナダ・ドル 44,650	4,652,632	2.0	—	1.0	0.5	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 42,534	千オーストラリア・ドル 37,820	3,521,107	1.5	—	1.1	0.4	0.0
シンガポール	千シンガポール・ドル 11,030	千シンガポール・ドル 10,470	1,015,081	0.4	—	0.2	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 70,612	千イギリス・ポンド 71,375	11,577,757	5.0	—	3.9	0.6	0.5
イスラエル	千イスラエル・シケル 24,300	千イスラエル・シケル 23,697	922,846	0.4	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 45,211	千デンマーク・クローネ 46,934	888,471	0.4	—	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 37,630	千ノルウェー・クローネ 34,905	470,872	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 48,205	千スウェーデン・クローネ 47,350	627,394	0.3	—	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 291,735	千メキシコ・ペソ 271,753	1,784,194	0.8	—	0.4	0.3	0.1

作成期		2022年6月15日現在							
区分	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
中国	千オフショア・人民元 225,900	千オフショア・人民元 231,967	千円 4,642,686	% 2.0	% —	% 0.9	% 0.8	% 0.2	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 40,255	千マレーシア・リンギット 39,008	1,191,192	0.5	—	0.3	0.2	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 39,450	千ポーランド・ズロチ 31,760	955,807	0.4	—	0.2	0.2	0.1	
ユーロ	アイルランド	千ユーロ 12,353	千ユーロ 11,379	1,602,218	0.7	—	0.5	0.2	0.0
	オランダ	千ユーロ 28,548	千ユーロ 27,831	3,918,735	1.7	—	1.2	0.4	0.2
	ベルギー	千ユーロ 34,826	千ユーロ 33,685	4,742,859	2.0	—	1.5	0.4	0.1
	フランス	千ユーロ 148,961	千ユーロ 144,067	20,284,741	8.7	—	5.3	2.5	0.8
	ドイツ	千ユーロ 108,055	千ユーロ 108,235	15,239,508	6.5	—	4.0	1.7	0.9
	スペイン	千ユーロ 88,003	千ユーロ 85,065	11,977,175	5.1	—	3.1	1.5	0.5
	イタリア	千ユーロ 139,978	千ユーロ 131,177	18,469,760	7.9	—	4.5	2.4	1.1
	フィンランド	千ユーロ 9,836	千ユーロ 8,847	1,245,772	0.5	—	0.3	0.1	0.1
	オーストリア	千ユーロ 22,679	千ユーロ 21,412	3,014,908	1.3	—	0.7	0.4	0.1
	小計	593,239	571,702	80,495,680	34.4	—	21.0	9.5	3.9
合計	—	—	230,597,354	98.7	—	51.8	31.2	15.6	

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国(外貨建)公社債(銘柄別)

2022年6月15日現在							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,568	4,532	611,902	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	4,984	673,011	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,176	698,851	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	4,829	651,974	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	678	91,544	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	924	124,775	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	794	107,297	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	807	109,079	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	847	114,433	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	2,720	367,321	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,324	178,865	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	1,000	135,061	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	607	82,031	2038/02/15

外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	583	78,779	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	1,044	140,982	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,222	164,990	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,189	160,584	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,334	180,207	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,149	155,183	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	1,847	249,412	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,123	151,645	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,583	213,854	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,442	194,789	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,493	201,694	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,524	205,785	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,331	179,735	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,487	200,870	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,212	163,758	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,231	1,915	258,613	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	1,395	188,378	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	2,389	322,542	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	2,002	270,379	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	3,157	426,328	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	2,084	281,416	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	3,248	438,557	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,207	3,140	423,979	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	6,021	813,013	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	1,746	235,833	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	5,746	775,844	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,746	2,430	328,187	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,515	744,619	2025/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	2,072	279,769	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,554	749,867	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,835	2,511	339,035	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,466	738,075	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,873	1,623	219,188	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,583	753,837	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	659	584	78,948	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,866	4,533	612,048	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,148	2,543	343,460	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,729	7,158	966,451	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,823	2,281	308,001	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,465	332,830	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,945	397,735	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	4,950	668,389	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,780	2,131	287,827	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,721	367,453	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,349	317,213	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,446	330,272	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	4,944	667,582	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,444	329,994	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,000	869	117,395	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,448	330,567	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,459	332,063	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,640	3,424	462,333	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,436	328,988	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,345	2,092	282,538	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,252	304,129	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,450	4,449	600,713	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	6,038	815,322	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	1,783	240,779	2047/05/15

2022年6月15日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	2,923	394,742	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,157	696,376	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,333	314,983	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,518	745,029	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,918	394,061	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,950	2,515	339,561	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,931	260,758	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,500	2,426	327,581	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,130	692,722	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,134	288,185	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,398	458,874	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,094	417,852	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	2,711	366,063	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,350	6,075	820,268	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,530	341,660	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,642	356,722	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,000	2,695	363,891	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	2,825	381,462	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,800	3,504	473,154	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	6,245	843,146	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	1,861	251,347	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,479	469,810	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,491	336,390	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,486	335,742	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	2,927	395,280	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,850	3,832	517,371	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	6,432	868,384	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,220	3,800	513,075	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,447	330,416	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,578	483,110	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,507	473,501	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,452	331,051	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	2,986	403,255	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,451	331,010	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	3,978	537,123	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,700	3,599	485,954	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,520	4,381	591,602	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	2,927	395,220	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	1,988	268,521	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,500	3,386	457,177	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,473	333,883	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	6,229	841,077	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	3,945	532,695	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,415	326,106	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	4,262	575,502	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,402	324,418	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,245	438,221	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,378	321,175	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	4,121	556,478	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	3,615	488,117	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,426	462,583	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,675	361,251	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,834	382,688	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,383	456,842	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	2,618	353,482	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,500	5,308	716,736	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,333	315,109	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,133	558,052	2029/08/15

外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	3,578	483,105	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,555	345,067	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,811	514,636	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,303	311,022	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,867	387,119	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	953	128,796	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	2,757	372,246	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,850	5,182	699,651	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	3,604	486,698	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	1,836	247,994	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,856	385,693	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,306	311,339	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,391	322,862	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,700	1,607	217,035	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,000	4,327	584,228	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	6,500	5,917	798,987	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	3,958	534,396	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	268	36,183	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	4,875	658,194	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,500	1,377	185,973	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,390	187,780	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,800	5,451	736,024	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,464	332,685	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,400	2,068	279,214	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	3,352	452,628	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	3,313	447,375	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,006	405,860	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,719	367,216	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,500	5,345	721,726	2023/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	5,875	793,231	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	2,998	404,863	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	967	130,684	2023/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,063	413,667	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,500	5,311	717,085	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	10,000	7,963	1,075,111	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,246	573,367	2027/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	6,700	4,151	560,469	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	6,000	3,946	532,800	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	2,982	402,647	2027/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,925	259,934	2023/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	5,823	786,236	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,375	455,739	2027/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,144	424,596	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,200	4,029	544,048	2023/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	7,700	7,376	995,873	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	9,800	7,942	1,072,370	2030/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,573	482,444	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,000	3,394	458,229	2027/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,800	4,509	608,862	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,100	3,497	472,139	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,100	4,566	616,521	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,258	574,899	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,859	386,074	2023/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,250	573,839	2027/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	1,000	892	120,527	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,000	3,801	513,286	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	7,000	5,980	807,439	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,900	4,177	564,027	2051/02/15



2022年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	10,700	8,826	1,191,627	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,000	4,739	639,873	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,452	601,105	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,365	589,345	2028/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,700	3,526	476,056	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,000	2,677	361,424	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,894	255,746	2024/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,509	473,798	2028/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,595	485,441	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	3,000	2,838	383,287	2024/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	8,700	7,463	1,007,619	2031/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,100	4,801	648,284	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,500	4,034	544,651	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,249	708,672	2028/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	5,109	689,860	2051/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,800	3,029	409,024	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	972	131,248	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,491	471,352	2028/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,400	3,935	531,295	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,877	253,448	2024/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,500	1,453	196,279	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	4,356	588,184	2028/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	5,000	4,484	605,486	2026/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	5,500	5,162	696,984	2024/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	3,000	2,806	378,889	2024/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	10,300	8,501	1,147,734	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	6,900	5,034	679,672	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	3,700	2,688	362,943	2041/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.1250	2,500	2,415	326,052	2023/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	6,000	5,315	717,591	2026/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	5,000	4,281	578,058	2028/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.1250	3,000	2,892	390,473	2023/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	5,000	4,305	581,332	2028/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	5,000	4,442	599,734	2026/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	7,500	6,995	944,459	2024/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	7,000	6,070	819,621	2028/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,500	3,120	421,331	2026/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,442	194,817	2023/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	2,000	1,871	252,719	2024/10/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	2,000	1,871	252,698	2024/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	9,000	7,482	1,010,225	2031/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,600	3,962	535,023	2051/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	4,000	3,035	409,879	2041/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	4,000	3,843	518,940	2023/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	6,000	5,240	707,465	2028/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	4,000	3,598	485,782	2026/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,612	487,677	2026/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.5000	5,000	4,800	648,095	2023/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	5,600	4,923	664,731	2028/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	2,200	2,066	279,037	2024/12/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	2,500	2,402	324,300	2023/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	4,000	3,489	471,141	2028/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,606	486,921	2026/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	1,000	940	126,929	2025/01/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,000	2,881	389,096	2024/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	7,400	6,426	867,665	2032/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	3,700	3,503	473,056	2025/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	4,300	3,836	517,948	2029/01/31

外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	3,900	3,034	409,626	2052/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	1,500	1,215	164,083	2042/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,000	4,498	607,274	2029/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	4,000	3,876	523,331	2024/02/29
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	1,000	925	124,967	2027/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	5,000	4,762	642,985	2025/03/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	3,000	2,781	375,519	2029/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	5,000	4,758	642,505	2027/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	2,000	1,959	264,543	2024/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	2,000	1,948	263,037	2025/04/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	3,000	2,848	384,555	2032/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,930	395,613	2025/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	2,000	1,792	242,045	2052/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	1,500	1,402	189,319	2042/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	4,500	4,424	597,386	2024/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	3,000	2,870	387,561	2029/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,886	389,667	2027/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	4,500	4,420	596,876	2024/05/31
通貨小計	銘柄数	263銘柄					
	金額			964,623	872,910	117,851,629	
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	605	518	53,988	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,111	115,821	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,328	138,451	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,179	122,919	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	913	972	101,365	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	961	963	100,375	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,232	128,403	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,380	143,836	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,179	122,872	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,117	116,421	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	897	93,496	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,096	114,293	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	650	595	62,021	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,300	1,279	133,307	2023/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,710	2,750	286,619	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,118	116,575	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,177	122,671	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,342	139,878	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	2,885	300,630	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	700	660	68,794	2025/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,628	273,839	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,000	1,545	161,014	2030/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,100	1,862	194,069	2026/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,134	118,207	2024/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	300	270	28,159	2026/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,400	2,849	296,925	2031/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	100	96	10,069	2023/08/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,000	940	98,027	2024/10/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,450	994	103,599	2053/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	961	100,178	2023/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	200	179	18,753	2027/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,000	2,873	299,452	2024/02/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,700	1,414	147,376	2031/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	200	189	19,737	2025/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	400	385	40,208	2024/05/01

2022年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	千カナダ・ドル 1,000	千カナダ・ドル 865	千円 90,226	2032/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	100	91	9,506	2029/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	383	40,011	2027/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	200	196	20,525	2024/08/01
通貨小計	銘柄数	39銘柄					
	金 額			49,221	44,650	4,652,632	
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	千オーストラリア・ドル 1,989	千オーストラリア・ドル 2,084	194,092	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	573	569	53,038	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,354	1,306	121,589	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,798	1,788	166,501	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,258	1,315	122,501	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,748	1,788	166,481	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,071	99,722	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,307	1,136	105,785	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	707	65,879	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,672	1,592	148,250	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,178	1,083	100,845	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	1,025	95,434	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,800	1,691	157,481	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,900	1,762	164,077	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,870	2,598	241,933	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,390	1,134	105,595	2041/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	2,316	215,645	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,700	1,325	123,387	2032/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,232	207,817	2024/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	1,974	183,837	2030/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,400	837	77,940	2051/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,429	133,097	2025/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	1,924	179,145	2031/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,051	97,919	2026/09/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,100	892	83,095	2032/11/21
	AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.0000	1,300	1,181	110,011	2033/11/21
通貨小計	銘柄数	26銘柄					
	金 額			42,534	37,820	3,521,107	
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 772	千シンガポール・ドル 785	76,162	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	923	926	89,869	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	809	793	76,942	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	374	36,343	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	671	672	65,216	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	577	56,003	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	617	59,866	2029/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	516	50,090	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	642	62,265	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	436	42,279	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	750	667	64,754	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	538	52,176	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	490	485	47,022	2024/02/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	312	30,335	2039/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	710	555	53,897	2050/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	750	692	67,135	2025/11/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	600	529	51,319	2031/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	200	158	15,369	2051/10/01



外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	千シンガポール・ドル 200	千シンガポール・ドル 185	千円 18,028	2026/11/01
通貨小計	銘柄数 金 額	19銘柄		11,030	10,470	1,015,081	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	千イギリス・ポンド 921	千イギリス・ポンド 915	148,573	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,582	1,575	255,582	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,426	231,328	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,760	1,366	221,702	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,450	1,269	205,921	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,810	1,451	235,508	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,410	1,345	218,174	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	2,300	2,268	368,020	2023/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,500	1,444	234,309	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,040	792	128,568	2071/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	1,800	1,764	286,217	2024/04/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,210	989	160,528	2049/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	660	107,150	2054/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	800	720	116,862	2029/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,900	1,818	294,989	2025/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,190	922	149,557	2041/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	2,300	1,947	315,904	2030/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	1,000	496	80,581	2061/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,394	226,275	2026/01/30
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,600	1,419	230,244	2028/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	654	106,132	2050/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,700	1,307	212,015	2035/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,300	1,258	204,160	2024/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	1,300	1,060	172,066	2031/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	500	338	54,895	2046/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	500	461	74,786	2026/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	300	213	34,554	2051/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.2500	100	94	15,369	2025/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	600	469	76,156	2039/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.5000	700	618	100,314	2029/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.8750	300	249	40,514	2033/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	300	226	36,792	2053/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.0000	100	86	14,049	2032/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	420	259	42,095	2073/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,158	187,978	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,240	2,573	417,416	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,579	256,141	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,662	1,953	316,957	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,357	1,720	279,033	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	2,316	375,713	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,366	1,729	280,463	2046/12/07
United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,356	220,012	2027/12/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,116	2,687	436,006	2042/12/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,600	1,886	305,964	2030/12/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	1,735	281,498	2049/12/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	1,745	283,061	2039/09/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,560	1,855	301,058	2034/09/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,174	1,579	256,271	2060/01/22	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	1,915	310,649	2040/12/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	1,897	307,729	2052/07/22	
United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,866	2,012	326,505	2044/01/22	
United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,582	1,584	256,998	2023/09/07	

2022年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	United Kingdom Gilt United Kingdom Gilt United Kingdom Gilt	国債証券 国債証券 国債証券	3.5000 2.7500 3.5000	千イギリス・ポンド 1,386 1,092 1,724	千イギリス・ポンド 1,757 1,105 1,936	千円 285,003 179,317 314,066	2068/07/22 2024/09/07 2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	55銘柄		70,612	71,375	11,577,757	
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed Israel Government Bond - Fixed Israel Government Bond - Fixed Israel Government Bond - Fixed Israel Government Bond - Fixed Israel Government Bond - Fixed Israel Government Bond - Fixed Israel Government Bond - Fixed Israel Government Bond - Fixed Israel Government Bond - Fixed Israel Government Bond - Fixed Israel Government Bond - Fixed ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券	6.2500 5.5000 3.7500 1.7500 2.0000 3.7500 2.2500 1.5000 1.0000 0.5000 1.5000 0.1500 0.5000 0.4000 1.3000	千イスラエル・シユケル 1,800 1,600 2,000 2,300 1,800 2,400 1,800 1,500 2,400 1,600 1,700 2,000 200 900 300	千イスラエル・シユケル 2,033 2,009 2,041 2,217 1,716 2,388 1,713 1,489 2,045 1,495 1,301 1,961 182 849 251	79,206 78,255 79,481 86,339 66,858 93,011 66,745 58,011 79,673 58,255 50,672 76,368 7,098 33,083 9,782	2026/10/30 2042/01/31 2024/03/31 2025/08/31 2027/03/31 2047/03/31 2028/09/28 2023/11/30 2030/03/31 2025/04/30 2037/05/31 2023/07/31 2026/02/27 2024/10/31 2032/04/30
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		24,300	23,697	922,846	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND DANISH GOVERNMENT BOND DANISH GOVERNMENT BOND DANISH GOVERNMENT BOND DANISH GOVERNMENT BOND DANISH GOVERNMENT BOND DANISH GOVERNMENT BOND DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券	4.5000 1.5000 1.7500 0.5000 0.5000 0.2500 — —	千デンマーク・クローネ 13,662 4,846 6,013 7,100 8,590 3,500 500 1,000	千デンマーク・クローネ 18,259 4,881 6,035 6,600 7,724 2,054 412 965	345,660 92,415 114,255 124,953 146,217 38,884 7,813 18,271	2039/11/15 2023/11/15 2025/11/15 2027/11/15 2029/11/15 2052/11/15 2031/11/15 2024/11/15
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄		45,211	46,934	888,471	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券	3.0000 1.7500 1.5000 1.7500 2.0000 1.7500 1.3750 1.2500 2.1250	千ノルウェー・クローネ 4,095 5,395 4,340 4,450 3,500 3,850 6,800 3,500 1,700	千ノルウェー・クローネ 4,114 5,215 4,104 4,192 3,293 3,508 5,948 2,971 1,556	55,503 70,360 55,364 56,553 44,424 47,332 80,250 40,090 20,992	2024/03/14 2025/03/13 2026/02/19 2027/02/17 2028/04/26 2029/09/06 2030/08/19 2031/09/17 2032/05/18
通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄		37,630	34,905	470,872	
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND SWEDISH GOVERNMENT BOND SWEDISH GOVERNMENT BOND SWEDISH GOVERNMENT BOND SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券	3.5000 1.5000 2.5000 1.0000 0.7500	千スウェーデン・クローネ 4,655 8,025 7,595 7,180 5,050	千スウェーデン・クローネ 5,626 8,010 7,703 6,874 4,700	74,551 106,139 102,068 91,086 62,282	2039/03/30 2023/11/13 2025/05/12 2026/11/12 2028/05/12

外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ	千円	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,300	3,388	44,896	2032/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	7,400	6,785	89,907	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	5,000	4,261	56,461	2031/05/12
通貨小計	銘柄数	8銘柄					
	金額			48,205	47,350	627,394	
メキシコ				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	37,290	32,879	215,869	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	21,300	18,650	122,449	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	23,800	23,073	151,491	2024/09/05
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	7,000	5,954	39,091	2027/03/04
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	1,000	891	5,853	2025/03/06
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	30,033	29,386	192,934	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	23,919	24,143	158,514	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	27,968	25,902	170,061	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	9,431	61,925	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,544	28,368	186,251	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	18,894	17,705	116,248	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	32,515	29,651	194,678	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	21,654	18,622	122,262	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,944	7,091	46,562	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金額			291,735	271,753	1,784,194	
中国				千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		
	China Government Bond	国債証券	3.2200	5,200	5,336	106,804	2025/12/06
	China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,162	103,326	2028/11/22
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,000	5,184	103,768	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,141	102,901	2026/06/06
	China Government Bond	国債証券	3.1200	12,000	12,281	245,804	2026/12/05
	China Government Bond	国債証券	3.1300	5,000	5,110	102,292	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2.8500	6,000	6,062	121,343	2027/06/04
	China Government Bond	国債証券	2.6800	6,500	6,433	128,753	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	2.8800	27,000	27,275	545,906	2023/11/05
	China Government Bond	国債証券	3.2700	6,500	6,721	134,529	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3.0300	7,000	7,130	142,706	2026/03/11
	China Government Bond	国債証券	3.8100	7,300	7,921	158,543	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	3.0100	5,000	5,077	101,619	2028/05/13
	China Government Bond	国債証券	3.7200	3,000	3,212	64,287	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.0200	5,800	5,876	117,619	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,522	90,512	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7400	5,000	5,037	100,830	2026/08/04
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5700	11,000	11,305	226,263	2024/06/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5900	5,500	5,776	115,605	2027/08/03
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	15,000	15,498	310,192	2024/09/21
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	5,000	5,305	106,188	2028/05/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6100	10,000	10,384	207,833	2025/06/07
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5400	4,500	4,730	94,686	2028/08/16
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0800	3,100	3,502	70,093	2048/10/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8600	3,300	3,606	72,174	2049/07/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7700	11,000	11,461	229,400	2025/03/08
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	6,500	6,577	131,646	2050/03/16
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	5,500	5,550	111,093	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	3,500	3,637	72,806	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	4,000	4,017	80,414	2031/11/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	5,000	4,955	99,174	2027/01/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	7,200	7,164	143,384	2032/02/17

2022年6月15日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	千オフショア・人民元 5,000	千オフショア・人民元 5,005	千円 100,179	2029/03/24
通貨小計	銘柄数 金額	33銘柄		225,900	231,967	4,642,686	
マレーシア				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,311	70,587	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,186	36,241	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,541	47,078	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,281	39,129	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	726	22,174	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,340	40,934	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,836	56,069	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	1,300	1,287	39,325	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,071	32,708	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,747	53,375	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,166	35,621	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,302	1,315	40,162	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	891	27,220	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,550	1,544	47,158	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,550	1,567	47,853	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,175	35,895	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,950	1,945	59,398	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,208	36,905	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,198	36,584	2033/11/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	600	597	18,259	2038/06/08
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	649	19,835	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,610	2,533	77,358	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,179	36,008	2048/07/06
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400	399	12,211	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,187	36,264	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,520	46,436	2040/05/22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	1,950	1,667	50,925	2050/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,800	1,568	47,882	2031/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	500	466	14,259	2032/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	400	390	11,926	2042/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5040	500	504	15,397	2029/04/30
通貨小計	銘柄数 金額	31銘柄		40,255	39,008	1,191,192	
ポーランド				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,377	3,569	107,411	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	2,463	74,147	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,870	2,625	79,017	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840	3,524	106,079	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,400	3,024	91,012	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	2,000	1,660	49,976	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,000	1,844	55,509	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	2,200	1,601	48,208	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	861	25,933	2024/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	900	537	16,184	2032/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	500	418	12,591	2027/05/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	749	22,559	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,125	2,042	61,455	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,650	2,806	84,459	2028/04/25

外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	千ポーランド・ズロチ 4,591	千ポーランド・ズロチ 4,029	千円 121,259	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		39,450	31,760	955,807	
				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	1,140	160,635	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	631	88,861	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	961	985	138,740	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	931	831	117,063	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,047	147,525	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	497	69,994	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	752	105,933	2028/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	750	668	94,117	2033/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	750	700	98,560	2031/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	950	894	125,939	2029/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	700	537	75,672	2050/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	350	270	38,113	2035/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	738	103,991	2027/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	679	95,614	2030/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	-	800	645	90,855	2031/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	400	278	39,218	2041/04/22
	IRISH TREASURY	国債証券	0.3500	100	80	11,382	2032/10/18
国小計	銘柄数 金 額	17銘柄		12,353	11,379	1,602,218	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,139	1,363	191,919	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,755	2,162	304,456	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,729	2,159	304,101	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,468	1,525	214,823	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,399	197,108	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,929	2,175	306,243	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,536	216,353	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,725	242,920	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,938	1,852	260,866	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,094	294,944	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,376	193,839	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,267	178,521	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,070	150,735	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	680	95,800	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,199	168,908	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	740	104,202	2027/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,150	623	87,812	2052/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,089	153,369	2031/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	641	90,339	2038/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	795	111,954	2029/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	94	13,288	2026/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	300	257	36,223	2032/07/15
国小計	銘柄数 金 額	22銘柄		28,548	27,831	3,918,735	
				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	1,660	233,824	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	1,594	224,553	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	963	135,690	2038/06/22



2022年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,863	1,812	255,149	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	982	138,309	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	740	614	86,556	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	940	931	131,191	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,100	1,045	147,244	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,029	144,930	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	580	509	71,686	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	600	516	72,778	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,490	1,395	196,417	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	650	583	82,157	2033/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,388	195,482	2029/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	700	553	77,960	2050/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,037	146,026	2030/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	860	583	82,098	2040/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,086	152,994	2027/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	1,600	1,292	181,954	2031/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	530	228	32,191	2071/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	400	327	46,043	2032/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	600	424	59,815	2053/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,048	288,485	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,904	2,428	341,883	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	1,962	276,312	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,106	155,835	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	895	126,047	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,359	191,351	2023/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	843	989	139,277	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,545	217,572	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	788	111,033	2034/06/22
国小計	銘柄数	31銘柄					
	金 額			34,826	33,685	4,742,859	
ユーロ (フランス)				千ユーロ	千ユーロ		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	3,460	487,239	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	4,062	571,967	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,227	4,242	597,362	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	3,340	470,365	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,764	2,241	315,572	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	2,846	400,843	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	4,997	5,227	735,991	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,664	4,683	659,401	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,717	2,217	312,263	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,646	3,892	548,100	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	5,699	5,950	837,846	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,588	2,861	402,906	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	5,086	5,184	729,929	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,087	5,246	738,718	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,899	4,939	695,511	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,388	477,129	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	4,993	703,095	2025/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,620	5,305	747,038	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,387	4,181	588,744	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	4,169	3,563	501,745	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,387	1,049	147,820	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,050	3,782	532,644	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	2,305	324,566	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,262	459,427	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,550	2,248	316,536	2048/05/25

外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,400	4,106	578,216	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	3,467	488,241	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	4,577	644,527	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,333	469,375	2024/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,150	2,443	344,016	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,350	3,922	552,303	2029/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,330	4,152	584,740	2025/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	3,601	507,037	2029/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,770	1,679	236,415	2052/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,820	397,089	2026/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	1,540	216,906	2040/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	3,330	468,897	2030/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	980	395	55,756	2072/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	98	13,829	2024/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	969	136,504	2044/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,600	3,722	524,076	2031/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,100	2,843	400,404	2027/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,300	768	108,240	2053/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	1,271	179,061	2032/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	95	13,508	2025/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	200	166	23,388	2038/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	300	280	39,429	2028/02/25
国小計	銘柄数	47銘柄					
	金 額			148,961	144,067	20,284,741	
ユーロ (ドイツ)				千ユーロ	千ユーロ		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,056	148,706	2024/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,447	203,780	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	2,630	370,417	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,124	158,377	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	2,592	365,060	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,048	3,984	561,034	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,305	3,059	430,799	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,571	4,569	643,323	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	1,791	252,208	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,739	2,511	353,574	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,274	2,821	397,323	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	3,172	446,641	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,624	228,748	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,581	222,659	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	3,064	431,539	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,606	226,154	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,042	4,023	566,575	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,149	302,610	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,134	3,099	436,475	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,368	2,291	322,691	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,279	320,894	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,200	3,968	558,716	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,180	307,052	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,770	2,463	346,876	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,790	252,086	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,100	2,858	402,452	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,015	283,715	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,675	376,721	2029/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,250	1,360	191,572	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,546	217,773	2030/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,665	234,515	2035/05/15

2022年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,839	258,998	2027/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,576	221,965	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,052	148,218	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	781	110,004	2031/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,088	153,312	2036/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,808	254,698	2028/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	668	94,101	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,600	3,090	435,136	2031/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	602	84,784	2031/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,273	179,298	2032/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	994	140,019	2023/06/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	99	13,951	2023/09/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	580	81,689	2052/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	4,150	584,458	2023/12/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	98	13,836	2024/03/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2000	100	98	13,808	2024/06/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,882	265,112	2023/10/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,884	265,372	2024/04/05
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,651	232,535	2024/10/18
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,313	325,683	2025/04/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,199	309,672	2025/10/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	95	13,489	2025/10/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,083	293,420	2026/04/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,220	171,779	2026/10/09
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	92	13,080	2027/04/16
国小計	銘柄数	56銘柄					
	金 額			108,055	108,235	15,239,508	
ユーロ (スペイン)				千ユーロ	千ユーロ		
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	3,202	450,972	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	2,021	284,595	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	1,926	271,271	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,193	308,843	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	2,698	379,984	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	1,794	252,727	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	1,452	204,543	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,630	2,517	354,488	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	1,817	255,842	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,750	1,627	229,208	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	1,940	273,163	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,400	2,248	316,573	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,500	1,314	185,114	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	2,400	2,384	335,737	2023/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,900	2,706	381,142	2028/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,480	208,453	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,850	1,579	222,387	2035/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,228	313,771	2024/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,410	339,428	2029/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,360	1,145	161,248	2030/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,375	334,505	2025/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	784	110,464	2050/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,206	310,616	2027/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,400	2,119	298,420	2030/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,300	914	128,715	2040/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	460	64,850	2026/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	2,200	1,722	242,551	2031/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	290	40,897	2024/05/31



外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	650	323	45,492	2071/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	433	61,019	2028/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	900	636	89,583	2037/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,518	213,743	2031/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	600	394	55,592	2042/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	803	113,100	2027/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	2,100	1,682	236,863	2032/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9000	600	415	58,447	2052/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	93	13,232	2025/05/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	100	87	12,333	2029/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,179	2,706	381,028	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	2,254	2,514	353,999	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	2,158	2,637	371,406	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	1,772	249,569	2024/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,973	2,361	332,455	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,789	3,001	422,575	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,242	315,785	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	1,981	279,047	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,030	285,937	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	1,669	235,100	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,049	288,587	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,143	301,844	2024/10/31
国小計	銘柄数	50銘柄					
	金額			88,003	85,065	11,977,175	
				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	995	140,129	2023/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,296	182,531	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	2,762	388,898	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,806	254,420	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	1,302	183,340	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,390	336,572	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	1,677	236,151	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,891	2,794	393,502	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	1,250	176,057	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,386	2,250	316,900	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	1,852	260,885	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	980	138,042	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	1,550	1,529	215,339	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	704	99,178	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,277	179,900	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,431	201,573	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,289	181,528	2024/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,850	1,636	230,399	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,700	2,529	356,084	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,553	218,701	2024/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,114	156,967	2038/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	1,946	274,048	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,248	175,723	2025/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,550	2,436	343,019	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	2,200	2,221	312,721	2023/10/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,525	214,721	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,169	164,643	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,650	1,551	218,420	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	1,815	255,690	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,200	2,170	305,621	2024/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	2,100	2,012	283,364	2026/07/15

外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	1,250	1,077	151,745	2040/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	1,585	223,282	2030/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,300	1,222	172,066	2025/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,107	296,776	2027/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,550	1,103	155,341	2050/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,081	152,235	2036/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,000	1,987	279,797	2023/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,300	2,226	313,425	2025/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	1,591	224,024	2030/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,100	1,758	247,528	2030/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3000	1,300	1,282	180,634	2023/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,200	1,940	273,270	2027/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,549	218,169	2026/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,500	1,037	146,097	2041/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,900	1,470	207,057	2031/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,065	150,041	2024/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	1,200	705	99,309	2051/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	700	456	64,223	2037/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,580	222,488	2028/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,300	1,705	240,130	2031/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	700	430	60,573	2045/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	975	137,336	2026/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,439	202,656	2024/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	460	274	38,713	2072/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	667	93,967	2028/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,443	203,202	2031/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	948	133,493	2024/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,160	163,438	2024/01/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	963	135,611	2026/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,700	1,270	178,861	2032/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	900	728	102,608	2029/02/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	280	39,455	2024/12/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	600	385	54,333	2052/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	194	27,384	2023/11/29
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1000	300	269	37,972	2027/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	500	472	66,523	2025/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	800	751	105,851	2029/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	300	258	36,357	2032/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	300	266	37,474	2038/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	3,254	3,588	505,321	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	3,292	463,604	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,058	289,861	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	2,488	350,374	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	2,698	379,920	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	2,245	316,140	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,332	328,464	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,243	315,835	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	2,464	347,013	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,175	306,244	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	2,567	361,472	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	1,957	275,610	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,283	321,583	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,260	318,215	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,318	2,283	321,550	2030/03/01
国小計	銘柄数	85銘柄					
	金 額			139,978	131,177	18,469,760	

外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	千ユーロ 364	千ユーロ 323	千円 45,555	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	272	38,402	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	775	109,173	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	700	693	97,603	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	293	41,298	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	746	105,075	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	670	585	82,474	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	456	64,297	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	448	63,126	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	194	27,373	2024/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	227	32,087	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	271	38,295	2040/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	500	419	59,083	2030/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	209	29,479	2052/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	496	69,922	2031/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	185	26,131	2026/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	169	23,817	2043/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	717	100,967	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	407	57,360	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	415	58,565	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	537	75,680	2024/04/15
国小計	銘柄数	21銘柄		9,836	8,847	1,245,772	
	金 額						
ユーロ (オーストリア)	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	千ユーロ 1,373	千ユーロ 1,357	191,195	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,079	152,045	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	655	92,310	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	159	22,470	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	—	900	892	125,672	2023/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,203	169,484	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	590	478	67,305	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	1,124	158,362	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	980	885	124,723	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,300	1,268	178,542	2024/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	—	980	832	117,217	2030/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	459	64,637	2051/03/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	254	35,840	2040/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.8500	350	142	20,051	2120/06/30
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,200	990	139,429	2031/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	480	460	64,829	2025/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	441	62,186	2036/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	300	149	21,003	2071/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	263	37,138	2028/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	500	439	61,818	2032/02/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	265	37,436	2049/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,006	141,665	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,373	1,668	234,922	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	981	138,130	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	445	62,666	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	723	820	115,515	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	970	136,605	2023/10/20
Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	775	109,259	2034/05/23	

2022年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500%	千ユーロ 932	千ユーロ 940	千円 132,439	2024/10/21
国小計	銘柄数	29銘柄					
	金 額			22,679	21,412	3,014,908	
通貨小計	銘柄数	358銘柄					
	金 額			593,239	571,702	80,495,680	
合 計	銘柄数	893銘柄					
	金 額					230,597,354	

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

# 外国債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第22期 (決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日)

外国債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

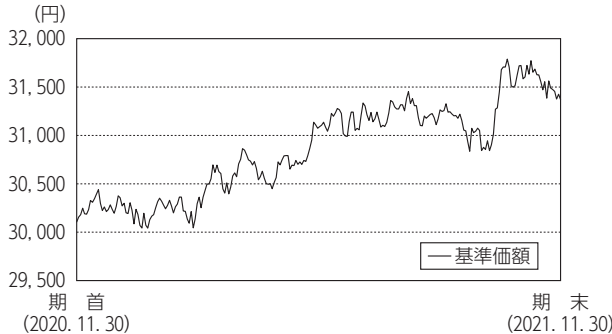
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：30,106円 期末：31,370円 騰落率：4.2%

【基準価額の主な変動要因】

日本を除く先進国国債に主に投資した結果、債券市場で金利は上昇（債券価格は下落）したものの、為替市場で円安が進んだため、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると上昇しました。

当作成期首より、米国の財政拡大観測の高まりなどから各国の金利は上昇しました。また、米国で今後の金融緩和策の後退が市場で意識されたことも、さらなる金利上昇要因となりました。その後はレンジ内で推移しましたが、2021年6月には、米国で将来の利上げ後の経済回復ペースや物価上昇圧力の鈍化が意識されたことで、長期ゾーンを中心に金利は低下しました。しかし9月には、F R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げ見通しが市場予想を上回ったことなどから、金利は上昇に転じました。10月に入っても、物資の供給制約の長期化を背景にインフレへの懸念が高まったことが、主要国の金利上昇圧力となりました。

○為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると円安が進みました。

対円為替相場は、当作成期首より、米国において民主党が大統領府および議会上下両院を制したこと、株価が上昇するなど市場のリスク選好姿勢が強まり、円安となりました。2021年3月には、米国での追加経済対策の成立や経済指標の改善により米国金利が上昇したことなどを背景に米ドルが買い進められ、全般的に円安が進行しました。7月以降は、新型コロナウイルスの新規感染者数の増加を受けた景気への懸念を受け、円高が進みました。9月以降は、日本以外の各国で利上げ観測が高まり、金融政策の方向性の違いを要因として、円安となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は4.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.2%となりました。

当作成期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.1%程度でした。なお、この値は、ファンドとベンチマークの為替評価レートの時間差による影響を修正したものです。

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

《今後の運用方針》

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

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率		
(期首) 2020年11月30日	30,106	—	30,435	—	98.5	—
12月末	30,356	0.8	30,690	0.8	98.5	—
2021年1月末	30,316	0.7	30,621	0.6	98.2	—
2月末	30,045	△ 0.2	30,493	0.2	98.5	—
3月末	30,706	2.0	30,924	1.6	98.4	—
4月末	30,696	2.0	31,035	2.0	98.5	—
5月末	31,109	3.3	31,499	3.5	98.8	—
6月末	31,058	3.2	31,389	3.1	98.6	—
7月末	31,273	3.9	31,662	4.0	98.7	—
8月末	31,264	3.8	31,613	3.9	98.3	—
9月末	31,051	3.1	31,407	3.2	98.4	—
10月末	31,722	5.4	31,985	5.1	98.4	—
(期末) 2021年11月30日	31,370	4.2	31,642	4.0	98.6	—

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

# 外国債券インデックスマザーファンド

## ■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	3 ( 3)
(その他)	( 0)
合 計	3

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

(注 2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■ 売買および取引の状況

### 公 社 債

(2020年12月 1 日から2021年11月30日まで)

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカ・ドル 290,158	千アメリカ・ドル 194,720 ( — )
	カナダ	千カナダ・ドル 12,555	千カナダ・ドル 12,968 ( — )
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 3,221	千オーストラリア・ドル 25,367 ( — )
	シンガポール	千シンガポール・ドル 1,966	千シンガポール・ドル 1,383 ( — )
	イギリス	千イギリス・ポンド 7,995	千イギリス・ポンド 14,829 ( — )
	イスラエル	千イスラエル・シケル 4,974	千イスラエル・シケル 3,106 ( — )
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 2,013	千デンマーク・クローネ 7,808 ( — )
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 5,487	千ノルウェー・クローネ — ( — )
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 5,442	千スウェーデン・クローネ 8,760 ( — )
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 44,370	千メキシコ・ペソ 68,282 ( — )
中国	千オフショア・人民元 26,878	千オフショア・人民元 — ( — )	

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

(注 1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注 2) ( ) 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注 3) 単位未満は切捨て。



■主要な売買銘柄

公 社 債

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2031/2/15	1,124,989	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2023/4/15	1,037,740
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.25% 2031/8/15	1,032,228	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.125% 2022/6/30	604,766
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.875% 2030/11/15	1,019,561	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.125% 2028/11/15	575,884
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2031/5/15	974,457	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2022/5/25	529,651
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 0.375% 2024/9/15	848,795	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 3% 2022/4/25	502,618
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2023/11/15	842,947	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2.25% 2022/10/25	487,862
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.25% 2028/9/30	785,770	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2022/7/31	474,174
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2% 2051/8/15	781,896	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2022/2/15	457,380
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2028/3/31	760,295	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/7/15	446,593
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.75% 2028/1/31	751,258	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2021/12/31	426,726

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■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				
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 比	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカ・ドル 922,829	千アメリカ・ドル 955,962	千円 108,759,849	% 46.6	% —	% 21.2	% 16.7	% 8.6
カナダ	千カナダ・ドル 48,671	千カナダ・ドル 50,556	4,512,686	1.9	—	0.9	0.6	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 46,852	千オーストラリア・ドル 49,050	3,987,292	1.7	—	1.2	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 10,980	千シンガポール・ドル 11,571	962,856	0.4	—	0.3	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 73,322	千イギリス・ポンド 93,472	14,166,718	6.1	—	4.8	0.8	0.5
イスラエル	千イスラエル・シユケル 27,300	千イスラエル・シユケル 30,584	1,101,379	0.5	—	0.2	0.2	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 50,511	千デンマーク・クローネ 63,327	1,093,665	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 42,134	千ノルウェー・クローネ 42,491	535,815	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 47,205	千スウェーデン・クローネ 52,123	653,106	0.3	—	0.2	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 282,935	千メキシコ・ペソ 286,643	1,505,707	0.6	—	0.4	0.2	0.0
中国	千オフショア・人民元 26,800	千オフショア・人民元 27,057	482,437	0.2	—	0.1	0.0	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 38,656	千マレーシア・リンギット 39,646	1,064,579	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 41,500	千ポーランド・ズロチ 40,366	1,108,694	0.5	—	0.2	0.2	0.1



## 外国債券インデックスマザーファンド

作成期		当 期				末			
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ユ ー ロ	アイルランド	千ユーロ 12,877	千ユーロ 14,293	千円 1,835,439	% 0.8	% —	% 0.6	% 0.2	% 0.0
	オランダ	千ユーロ 28,587	千ユーロ 33,774	千円 4,337,032	1.9	—	1.3	0.4	0.2
	ベルギー	千ユーロ 33,676	千ユーロ 40,353	千円 5,181,793	2.2	—	1.7	0.4	0.1
	フランス	千ユーロ 152,793	千ユーロ 178,981	千円 22,982,963	9.8	—	6.4	2.6	0.9
	ドイツ	千ユーロ 110,312	千ユーロ 130,913	千円 16,810,567	7.2	—	4.6	1.7	0.8
	スペイン	千ユーロ 90,321	千ユーロ 105,873	千円 13,595,192	5.8	—	3.7	1.6	0.6
	イタリア	千ユーロ 142,231	千ユーロ 162,937	千円 20,922,845	9.0	—	5.5	2.4	1.0
	フィンランド	千ユーロ 10,032	千ユーロ 10,846	千円 1,392,797	0.6	—	0.4	0.2	0.1
	オーストリア	千ユーロ 22,501	千ユーロ 26,075	千円 3,348,351	1.4	—	0.9	0.3	0.2
	小計	603,330	704,049	90,406,985	38.7	—	25.0	9.7	4.0
合 計	—	—	230,341,773	98.6	—	55.2	29.3	14.1	

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

### (2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ア メ リ カ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	千アメリカ・ドル 6,668	千アメリカ・ドル 6,758	千円 768,958	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,441	505,277	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,781	543,939	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,568	4,729	538,129	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,241	596,339	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,478	623,274	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	5,131	583,829	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	718	81,796	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,029	117,099	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	906	103,134	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	884	100,662	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	928	105,595	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	989	112,537	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	3,203	364,425	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,627	185,146	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	1,239	141,043	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	758	86,344	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	729	82,969	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	1,319	150,159	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,540	175,242	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,500	170,708	2039/08/15

区 分	銘 柄	種 類	当 期		未			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円					
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,688	192,123	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,453	165,314	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	2,352	267,640	2040/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,440	163,890	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	2,030	230,976	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,843	209,692	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,924	218,955	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,981	225,430	2041/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,742	198,294	2041/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,954	222,414	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,601	182,226	2042/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,231	2,541	289,137	2042/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	1,858	211,420	2042/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	3,168	360,471	2043/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	2,672	304,090	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	4,178	475,379	2043/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	2,758	313,793	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	4,315	490,989	2044/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	4,198	477,633	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	6,430	731,637	2024/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	2,348	267,142	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	6,169	701,917	2024/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,746	3,284	373,723	2044/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,946	676,504	2025/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	2,829	321,958	2045/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	6,019	684,886	2025/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,835	3,405	387,497	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,950	677,013	2025/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,873	2,209	251,396	2045/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	6,112	695,425	2025/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	659	795	90,461	2045/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,597	295,511	2022/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,287	6,399	728,039	2022/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,992	5,094	579,559	2022/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,866	4,970	565,540	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,605	296,428	2023/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,148	3,496	397,766	2046/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,962	3,006	342,105	2023/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,623	3,680	418,738	2023/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,729	7,896	898,556	2026/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,107	239,818	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,823	3,136	356,877	2046/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,547	289,789	2023/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	3,047	346,709	2023/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	5,485	624,052	2026/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,780	2,955	336,244	2046/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,819	320,774	2023/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,439	277,547	2023/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,547	289,824	2023/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,508	626,672	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,554	290,633	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,500	1,785	203,157	2046/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,570	292,437	2023/11/30	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	当 期		未			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,588	294,468	2023/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,640	3,831	435,876	2027/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,569	292,332	2024/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,845	3,466	394,350	2047/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,379	270,675	2024/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,550	4,706	535,507	2024/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	6,778	771,189	2027/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	2,445	278,183	2047/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	3,097	352,388	2024/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,473	622,692	2024/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,479	282,124	2024/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	6,212	706,745	2027/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,110	353,907	2024/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,950	3,458	393,435	2047/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	2,060	234,461	2024/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,500	2,594	295,210	2024/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,541	289,123	2022/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,797	659,612	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,500	4,104	467,007	2047/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,646	414,883	2024/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,324	378,196	2024/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	2,919	332,142	2024/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,586	408,038	2023/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,350	6,879	782,712	2028/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,396	386,452	2023/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,734	311,053	2025/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,862	325,655	2025/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,800	4,672	531,588	2048/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,900	2,984	339,534	2023/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	3,064	348,594	2025/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,200	5,290	601,917	2048/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	7,101	807,909	2028/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,585	294,123	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	2,024	230,330	2025/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,784	430,576	2025/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,589	294,621	2023/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,588	294,533	2023/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	3,187	362,693	2025/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,850	4,000	455,171	2023/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	7,335	834,612	2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,220	5,202	591,845	2048/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,670	303,845	2025/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,745	426,081	2023/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,829	435,710	2025/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,685	305,577	2025/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,132	356,361	2023/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,688	305,845	2025/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,182	475,822	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,700	4,121	468,928	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,520	5,962	678,391	2048/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,214	365,761	2025/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	2,094	238,250	2023/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,500	3,718	423,018	2025/12/31	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,607	296,700	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	7,141	812,476	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	4,166	474,011	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,656	302,244	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	5,824	662,671	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,644	300,890	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,431	390,353	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,620	298,176	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	5,646	642,354	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	4,155	472,783	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,634	413,453	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,951	335,777	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,132	356,399	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,593	408,846	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	2,892	329,055	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,500	5,650	642,867	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,583	293,910	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,767	542,381	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	4,961	564,429	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,828	321,827	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	4,053	461,173	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,555	290,710	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,060	348,228	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	1,020	116,085	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,066	348,829	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,850	5,988	681,334	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	4,988	567,559	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	2,045	232,675	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,061	348,269	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,043	346,282	2022/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,571	292,590	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,569	292,377	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	4,056	461,546	2023/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,700	1,726	196,474	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,250	2,280	259,481	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,000	5,016	570,755	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,200	3,250	369,808	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	5,533	629,520	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	298	33,978	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	5,241	596,271	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,200	4,209	478,971	2023/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,500	1,479	168,340	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,200	3,197	363,750	2023/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,551	176,512	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	7,800	7,272	827,435	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,488	396,900	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,649	301,440	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,400	2,306	262,445	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	4,799	546,068	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,370	497,254	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,360	382,267	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,926	332,910	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,500	5,489	624,583	2023/06/15

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					未		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	7,500	7,308	831,439	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,357	382,016	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	995	113,285	2023/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,308	376,435	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,500	5,472	622,625	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	10,000	9,301	1,058,186	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,760	541,647	2027/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	6,700	5,920	673,585	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	6,000	5,227	594,732	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,347	380,897	2027/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,988	226,277	2023/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	6,312	718,125	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,794	431,720	2027/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,400	386,870	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,200	4,173	474,809	2023/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	7,700	7,663	871,885	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	9,800	9,301	1,058,273	2030/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,498	397,975	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,877	441,140	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,000	3,815	434,064	2027/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,800	6,389	726,908	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,100	4,635	527,368	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,997	341,026	2022/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,100	4,960	564,381	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,799	546,004	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,975	338,494	2023/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,793	545,339	2027/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	1,000	971	110,565	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,700	1,697	193,173	2022/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,000	3,963	450,884	2024/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	7,000	6,755	768,516	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,900	5,879	668,933	2051/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	10,700	10,369	1,179,723	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,000	4,950	563,269	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,997	227,228	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,852	552,091	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,936	561,602	2028/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,700	4,648	528,869	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,000	2,924	332,695	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,996	227,121	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,983	225,662	2024/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,992	340,466	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	7,000	6,956	791,412	2028/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,937	447,967	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	3,000	2,980	339,053	2024/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	8,700	8,800	1,001,280	2031/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,100	5,046	574,175	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,500	4,426	503,625	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,400	3,390	385,684	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,956	677,711	2028/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,100	6,787	772,231	2051/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,800	3,990	453,972	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	996	113,369	2023/05/31



外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,968	451,484	2028/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	3,000	2,949	335,589	2026/05/31
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,977	224,987	2024/06/15
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,500	1,494	170,008	2023/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	4,955	563,827	2028/06/30
		United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	5,000	4,939	562,001	2026/06/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	5,500	5,450	620,134	2024/07/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	3,000	2,971	338,040	2024/08/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	9,300	9,076	1,032,635	2031/08/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	6,900	7,083	805,862	2051/08/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	3,000	2,901	330,135	2041/08/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.1250	2,500	2,488	283,102	2023/07/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	6,000	5,855	666,162	2026/07/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	5,000	4,871	554,270	2028/07/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.1250	3,000	2,984	339,548	2023/08/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	5,000	4,908	558,405	2028/08/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	5,000	4,904	557,979	2026/08/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	7,500	7,421	844,375	2024/09/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	7,000	6,926	788,051	2028/09/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,500	3,451	392,640	2026/09/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,494	170,061	2023/09/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	2,000	1,991	226,570	2024/10/15
通貨小計	銘柄数	255銘柄						
	金額				922,829	955,962	108,759,849	
					千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
カナダ		Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	405	487	43,542	2064/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,280	114,286	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,581	141,163	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,444	128,961	2037/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	913	1,226	109,472	2041/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	961	1,251	111,737	2045/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,265	112,953	2023/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,454	129,802	2024/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,566	139,843	2048/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,196	106,802	2025/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	974	87,022	2026/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,211	108,142	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	650	671	59,960	2028/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,300	4,352	388,485	2023/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,300	1,324	118,226	2023/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,710	3,760	335,701	2051/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,287	114,949	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,232	110,024	2024/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,414	126,263	2024/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	3,377	301,477	2030/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	700	701	62,587	2025/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,806	250,511	2025/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	697	62,243	2022/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,000	1,820	162,510	2030/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,100	2,004	178,924	2026/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,177	105,147	2024/04/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,491	133,114	2023/02/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,100	1,091	97,400	2023/05/01

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
通貨小計		銘柄数 金 額			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
				%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	300	294	26,272	2026/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,400	2,374	211,983	2031/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	100	98	8,832	2023/08/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,000	988	88,262	2024/10/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	700	663	59,225	2053/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	991	88,498	2023/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	200	197	17,649	2027/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	500	497	44,372	2024/02/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	300	295	26,331	2031/12/01
通貨小計		37銘柄			48,671	50,556	4,512,686	
オーストラリア					千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,168	1,251	101,734	2023/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,989	2,336	189,943	2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,973	2,071	168,357	2024/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,754	1,959	159,294	2029/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,798	1,928	156,732	2025/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,258	1,609	130,867	2033/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,748	3,098	251,855	2026/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,361	110,639	2037/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,307	1,433	116,498	2035/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	914	74,318	2039/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,672	1,795	145,980	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,178	1,232	100,194	2028/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	1,400	113,847	2047/03/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,800	1,943	158,008	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,350	1,377	111,954	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,900	2,060	167,482	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,870	3,061	248,900	2030/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,390	1,491	121,264	2041/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	2,784	226,364	2031/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,300	1,236	100,484	2032/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,353	191,356	2024/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,200	3,011	244,772	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,400	1,217	98,938	2051/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,540	125,213	2025/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,330	189,476	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,153	93,771	2026/09/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,100	1,095	89,038	2032/11/21
通貨小計		27銘柄			46,852	49,050	3,987,292	
シンガポール					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	850	70,758	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	923	973	81,010	2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	809	882	73,442	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	448	37,348	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	671	692	57,621	2023/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	655	54,518	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	678	56,478	2029/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	546	45,433	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	775	64,519	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	465	38,755	2026/06/01

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
通貨小計		銘柄数 金 額			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円		
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	750	779	64,825	2036/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	450	456	37,946	2023/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	585	48,740	2028/05/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	490	502	41,814	2024/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	370	30,827	2039/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	710	685	57,011	2050/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	750	729	60,710	2025/11/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	300	297	24,753	2031/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	200	196	16,342	2051/10/01
		19銘柄						
					10,980	11,571	962,856	
イギリス					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	921	971	147,252	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,682	2,767	419,439	2065/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,528	231,649	2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,940	2,161	327,604	2047/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,350	2,596	393,488	2037/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,810	2,303	349,090	2057/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,410	1,461	221,510	2027/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	3,000	3,017	457,376	2023/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,500	1,599	242,424	2028/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	940	1,325	200,886	2071/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	1,800	1,824	276,553	2024/04/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,210	1,435	217,549	2049/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	1,018	154,341	2054/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	800	809	122,721	2029/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,900	1,910	289,593	2025/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,190	1,232	186,728	2041/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	2,300	2,294	347,765	2023/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	2,300	2,219	336,418	2030/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	750	679	102,953	2061/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,474	223,457	2026/01/30
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,600	1,551	235,085	2028/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	1,014	153,753	2050/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,300	1,234	187,068	2035/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,300	1,289	195,504	2024/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	1,300	1,227	186,102	2031/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	500	483	73,323	2046/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	100	98	14,962	2026/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	300	322	48,837	2051/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.2500	100	99	15,011	2025/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	600	606	91,845	2039/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.5000	100	98	14,918	2029/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.8750	300	298	45,312	2033/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	300	348	52,812	2053/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,296	196,550	2028/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,240	3,000	454,762	2032/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,685	255,494	2025/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,662	2,386	361,660	2036/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,357	2,155	326,716	2038/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,908	3,794	575,079	2055/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,366	2,341	354,915	2046/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,494	226,560	2027/12/07



外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
						千円	千円	
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,416	4,009	607,628	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,600	2,155	326,678	2030/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	2,427	367,948	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	2,207	334,626	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,560	2,224	337,187	2034/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,174	2,403	364,198	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,454	372,045	2040/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	2,714	411,397	2052/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,166	3,124	473,503	2044/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,582	1,632	247,411	2023/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,386	2,889	437,971	2068/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,092	1,160	175,847	2024/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,724	2,607	395,192	2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	54銘柄			73,322	93,472	14,166,718	
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	2,000	2,567	92,447	2026/10/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	4.2500	1,800	1,901	68,481	2023/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,900	3,080	110,934	2042/01/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,000	2,168	78,085	2024/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,422	87,223	2025/08/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,941	69,928	2027/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.2500	1,000	1,012	36,478	2022/11/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,400	3,166	114,016	2047/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,800	1,987	71,563	2028/09/28	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,500	1,541	55,502	2023/11/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	2,400	2,413	86,922	2030/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.5000	1,600	1,611	58,044	2025/04/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,700	1,660	59,799	2037/05/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.1500	2,000	2,002	72,120	2023/07/31	
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.5000	200	200	7,234	2026/02/27		
ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.4000	900	905	32,594	2024/10/31		
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄			27,300	30,584	1,101,379	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	13,662	24,709	426,740	2039/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,053	87,265	2023/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	6,555	113,207	2025/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	7,900	8,302	143,377	2027/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	9,590	10,134	175,029	2029/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,300	4,338	74,924	2022/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,700	2,714	46,877	2052/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	502	8,681	2031/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,016	17,561	2024/11/15	
	通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄			50,511	63,327	1,093,665
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	8,204	8,311	104,811	2023/05/24	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,254	53,647	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	5,395	5,457	68,817	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,340	4,347	54,826	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,450	4,505	56,810	2027/02/17	

外国債券インデックスマザーファンド

		当 期			末			
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円		
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,600	45,401	2028/04/26	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	3,898	49,162	2029/09/06	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	4,800	4,721	59,540	2030/08/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,500	3,393	42,797	2031/09/17	
通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄		42,134	42,491	535,815		
<b>スウェーデン</b>				千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ			
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,655	7,006	87,785	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	8,025	8,305	104,072	2023/11/13	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,595	8,291	103,894	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	7,537	94,447	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,050	5,268	66,008	2028/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,300	3,991	50,009	2032/06/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	7,400	7,757	97,197	2029/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	4,000	3,965	49,690	2031/05/12	
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄		47,205	52,123	653,106		
<b>メキシコ</b>				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ			
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	31,290	29,442	154,660	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	19,300	18,949	99,541	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	23,800	24,233	127,298	2024/09/05	
	Mexican Bonos	国債証券	6.7500	17,200	17,281	90,776	2023/03/09	
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	3,000	2,747	14,430	2027/03/04	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	30,033	30,663	161,074	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	23,919	25,652	134,752	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	27,968	28,034	147,262	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	10,585	55,606	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,544	31,129	163,522	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	16,894	17,474	91,793	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	23,515	23,660	124,286	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	19,654	18,828	98,904	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,944	7,956	41,797	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄		282,935	286,643	1,505,707		
<b>中国</b>				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	3.7200	3,000	3,163	56,409	2051/04/12	
	China Government Bond	国債証券	3.0200	3,800	3,851	68,676	2031/05/27	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,504	80,324	2026/08/12	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5700	10,000	10,019	178,641	2023/05/20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	5,500	5,517	98,385	2028/10/14	
通貨小計	銘柄数 金 額	5銘柄		26,800	27,057	482,437		
<b>マレーシア</b>				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット			
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,401	64,488	2027/05/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,253	33,667	2030/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,595	42,836	2026/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,362	36,593	2031/06/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	754	20,265	2027/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	1,016	27,294	2023/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,432	38,470	2033/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,920	51,578	2028/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	800	864	23,208	2043/09/30	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					当 期	未		
					%	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	4.1810	1,057	1,098	29,508	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,803	48,426	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,265	33,984	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,302	1,332	35,781	2023/08/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	979	26,289	2046/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650	672	18,066	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,550	1,608	43,202	2024/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,226	32,945	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,950	2,080	55,856	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,241	33,347	2025/03/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,700	1,734	46,560	2023/04/20
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,284	34,484	2033/11/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	600	644	17,308	2038/06/08
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	672	18,069	2026/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,910	1,957	52,573	2029/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,297	34,830	2048/07/06
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400	407	10,946	2024/06/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,281	34,418	2034/07/05
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,658	44,535	2040/05/22
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	1,650	1,586	42,601	2050/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,300	1,207	32,436	2031/04/15
通貨小計	銘柄数 金 額	30銘柄			38,656	39,646	1,064,579	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,377	4,259	116,980	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	3,050	83,778	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,850	3,851	105,778	2023/01/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,870	2,845	78,148	2024/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840	4,701	129,116	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,400	3,332	91,538	2024/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.7500	2,000	1,853	50,896	2025/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,566	70,493	2030/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	—	1,000	961	26,417	2023/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.2500	1,300	1,126	30,942	2026/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	970	26,642	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,625	2,682	73,668	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,650	3,553	97,597	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,591	4,612	126,693	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄			41,500	40,366	1,108,694	
					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	1,235	158,692	2025/03/13
		IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	624	661	84,915	2023/03/20
		IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	664	85,337	2024/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	961	1,159	148,937	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	931	1,211	155,512	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,144	146,945	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	653	83,973	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	856	109,992	2028/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	750	838	107,664	2033/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	750	839	107,858	2031/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	950	1,033	132,648	2029/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	700	824	105,832	2050/05/15

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	350	351	45,186	2035/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	822	105,623	2027/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	811	104,176	2030/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	—	800	786	100,959	2031/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	400	398	51,181	2041/04/22
国 小 計	銘柄数	17銘柄						
	金 額				12,877	14,293	1,835,439	
ユーロ (オランダ)					千ユーロ	千ユーロ		
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	548	599	77,044	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,139	1,562	200,633	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,555	2,507	322,002	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	832	106,904	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,729	3,023	388,241	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,509	193,881	2033/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,443	185,388	2023/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,929	3,226	414,283	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,624	208,663	2024/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,850	237,606	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,938	2,038	261,732	2026/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,358	302,836	2027/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,422	182,675	2024/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,457	187,112	2028/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,253	160,990	2029/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	980	125,867	2040/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,431	183,793	2030/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	821	105,480	2027/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,050	1,002	128,710	2052/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,322	169,772	2031/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	892	114,575	2038/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	600	613	78,837	2029/01/15
国 小 計	銘柄数	22銘柄						
	金 額				28,587	33,774	4,337,032	
ユーロ (ベルギー)					千ユーロ	千ユーロ		
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,699	1,786	229,408	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	1,952	250,677	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	1,311	168,357	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,863	1,995	256,184	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	1,506	193,426	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	640	935	120,071	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	940	957	122,930	2023/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,100	1,176	151,113	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,087	139,634	2024/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	580	831	106,772	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	600	696	89,412	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,490	1,603	205,858	2028/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	650	737	94,713	2033/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,630	209,372	2029/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	700	870	111,814	2050/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,244	159,807	2030/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	660	644	82,824	2040/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,228	157,777	2027/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,600	1,594	204,704	2031/10/22

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	680	596	76,655	2071/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,357	302,698	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,904	3,103	398,469	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	2,705	347,415	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,226	157,496	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	1,103	141,758	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,401	180,020	2023/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	843	1,424	182,883	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,634	209,938	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	1,009	129,595	2034/06/22
国 小 計	銘柄数	29銘柄						
	金 額				33,676	40,353	5,181,793	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	1,985	2,243	288,101	2023/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	3,815	489,959	2025/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	4,758	611,022	2029/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,227	5,242	673,220	2032/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	4,263	547,451	2035/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,764	3,453	443,514	2055/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	3,808	489,063	2038/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	4,997	5,478	703,469	2023/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,664	6,425	825,044	2041/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,717	3,534	453,888	2060/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,646	4,298	551,978	2026/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	5,699	6,777	870,339	2027/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,588	4,121	529,197	2045/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,047	4,198	539,137	2023/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	5,086	5,462	701,487	2024/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,087	6,243	801,757	2030/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,899	5,255	674,877	2024/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,627	465,850	2025/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	5,421	696,207	2025/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,420	6,210	797,553	2031/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,787	3,959	508,487	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	4,169	4,724	606,616	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,387	1,838	236,106	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,050	4,196	538,912	2026/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	3,182	408,649	2039/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,668	471,041	2027/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,850	3,790	486,690	2048/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,424	311,339	2023/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,400	4,709	604,712	2028/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	4,454	571,986	2034/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	5,307	681,572	2028/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,456	443,789	2024/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,950	3,556	456,741	2050/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,350	4,586	588,892	2029/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,830	3,909	501,995	2025/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	4,253	546,219	2029/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,424	311,272	2023/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,770	2,769	355,592	2052/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,067	393,859	2026/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	2,203	282,976	2040/05/25	

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
銘柄数 金 額		47銘柄		千ユーロ	千ユーロ	千円		
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	4,024	516,788	2030/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	880	731	93,876	2072/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	13,041	2024/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	985	126,557	2044/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,700	3,684	473,140	2031/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	1,634	209,920	2027/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	700	693	89,060	2053/05/25
国 小 計					152,793	178,981	22,982,963	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (ドイツ)		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,120	143,912	2024/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,646	211,378	2027/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	3,008	386,344	2028/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,293	166,104	2028/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	3,049	391,545	2030/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,448	5,369	689,555	2031/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,305	3,819	490,479	2034/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,571	5,918	759,935	2037/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	2,394	307,518	2039/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,739	3,384	434,580	2040/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,574	4,431	569,108	2042/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	4,525	581,099	2044/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,450	186,220	2023/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,879	241,377	2023/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,677	215,388	2023/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,650	211,915	2024/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	4,435	569,540	2046/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,684	216,368	2024/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,042	4,239	544,336	2024/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,283	293,243	2025/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,134	3,336	428,490	2025/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,368	2,488	319,591	2026/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,497	320,721	2026/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,200	4,393	564,217	2027/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,446	314,171	2027/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,770	3,738	480,064	2048/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	2,028	260,437	2028/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,100	3,267	419,519	2028/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,323	298,378	2029/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,112	399,626	2029/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,250	2,261	290,335	2050/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,815	233,135	2030/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,946	249,971	2035/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,070	265,826	2027/11/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,867	239,805	2030/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,251	160,705	2030/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	931	119,606	2031/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	917	117,819	2036/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,553	199,510	2028/11/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,118	143,566	2050/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,600	2,682	344,469	2031/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	724	93,011	2031/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	12,947	2022/12/15



外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
銘 柄 数		56銘柄			千ユーロ	千ユーロ	千円	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,010	129,728	2023/03/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,012	130,042	2023/06/16
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	13,028	2023/09/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	696	89,486	2052/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,730	5,795	744,206	2023/04/14
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,929	247,802	2023/10/13
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,956	251,216	2024/04/05
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,738	223,178	2024/10/18
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,460	315,940	2025/04/11
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,364	303,639	2025/10/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	103	13,226	2025/10/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,266	291,047	2026/04/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,340	172,141	2026/10/09
国 小 計	銘 柄 数	56銘柄			110,312	130,913	16,810,567	
	金 額							
ユーロ (スペイン)		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	3,792	486,939	2029/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	2,189	281,145	2025/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	2,352	302,131	2030/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,411	309,661	2025/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	3,006	386,053	2026/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	2,715	348,693	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	2,433	312,457	2066/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,630	2,833	363,830	2026/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	2,073	266,317	2027/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,750	2,107	270,600	2033/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	2,237	287,324	2027/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,600	1,617	207,752	2022/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,400	2,617	336,154	2028/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,300	1,763	226,478	2048/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	2,400	2,439	313,272	2023/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,900	3,171	407,315	2028/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,760	226,067	2029/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,850	2,126	273,011	2035/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,346	301,288	2024/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,900	372,398	2029/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,360	1,391	178,706	2030/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,460	2,483	318,892	2023/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,536	325,737	2025/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,321	169,692	2050/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,521	323,845	2027/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,900	3,146	404,094	2030/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,300	1,350	173,378	2040/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	506	65,020	2026/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	2,200	2,148	275,908	2031/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	303	38,988	2024/05/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	650	594	76,295	2071/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	500	64,272	2028/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	900	898	115,415	2037/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,400	1,410	181,064	2031/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	600	600	77,080	2042/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	302	38,827	2027/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,179	3,393	435,771	2032/07/30

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
銘 柄 数		49銘柄	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	2,254	3,384	434,594	2037/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	2,158	3,666	470,871	2040/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	1,881	241,646	2024/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,973	3,321	426,539	2041/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,789	3,311	425,203	2025/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,537	325,845	2026/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	1,958	2,096	269,174	2023/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	2,087	268,044	2023/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,397	307,867	2028/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	2,399	308,119	2044/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,180	280,009	2024/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,300	295,387	2024/10/31
国 小 計	銘 柄 数	49銘柄						
	金 額			90,321	105,873	13,595,192		
ユーロ (イタリア)					千ユーロ	千ユーロ		
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	906	1,069	137,360	2023/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,495	192,048	2026/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,248	417,195	2027/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,957	251,402	2024/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	1,968	252,752	2046/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,621	336,690	2025/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	2,198	282,349	2032/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,891	2,040	261,957	2025/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	1,923	246,936	2047/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,359	1,384	177,746	2023/03/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,386	2,543	326,595	2026/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	2,617	336,145	2036/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	1,123	144,280	2026/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	1,550	1,580	203,010	2023/10/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	1,112	142,796	2067/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,719	220,752	2033/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,667	214,095	2027/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,367	175,565	2024/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,850	2,506	321,860	2048/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,700	2,959	380,035	2027/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,675	215,137	2024/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,597	205,142	2038/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	2,303	295,739	2028/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,933	248,343	2023/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,367	175,648	2025/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,550	2,947	378,471	2028/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	2,200	2,316	297,452	2023/10/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,702	218,594	2025/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,595	204,842	2035/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,650	2,388	306,644	2049/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	2,236	287,224	2029/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,200	2,311	296,830	2024/07/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	2,100	2,289	293,933	2026/07/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	1,250	1,565	201,072	2040/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	1,993	255,994	2030/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	740	744	95,648	2023/01/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,300	1,318	169,350	2025/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,421	310,949	2027/01/15



外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,550	1,764	226,597	2050/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,533	196,954	2036/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,000	2,034	261,211	2023/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,300	2,454	315,172	2025/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	2,025	260,058	2030/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,400	2,567	329,695	2030/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3000	1,300	1,316	169,054	2023/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,200	2,273	291,923	2027/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,729	222,080	2026/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,300	1,346	172,924	2041/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	2,300	2,302	295,685	2031/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,107	142,217	2024/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	1,200	1,167	149,857	2051/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	700	661	84,960	2037/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,874	240,741	2028/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,700	2,619	336,357	2031/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	700	677	86,947	2045/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,093	140,428	2026/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,508	193,680	2024/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	12,906	2022/11/29
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	460	446	57,300	2072/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	798	102,573	2028/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,895	243,369	2031/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,008	257,854	2024/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	502	64,561	2024/01/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,089	139,920	2026/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	3,254	4,421	567,748	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,184	537,331	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,707	347,707	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	3,331	427,771	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	3,734	479,488	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	3,162	406,138	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,448	314,472	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,470	317,174	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	3,523	452,392	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,460	315,934	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,960	2,068	265,624	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	3,089	396,666	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,029	260,607	2023/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	2,880	369,842	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,431	312,186	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,439	313,295	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,318	2,841	364,826	2030/03/01
国 小 計	銘柄数 金 額	81銘柄		142,231	162,937	20,922,845	
ユーロ (フィンランド)				千ユーロ	千ユーロ		
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	364	393	50,570	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	295	37,917	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	850	109,179	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	700	709	91,084	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	455	58,553	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	843	108,361	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	670	757	97,213	2034/04/15

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	千ユーロ 500	千ユーロ 528	千円 67,823	2028/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	529	67,996	2029/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	—	200	203	26,194	2024/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	307	39,438	2036/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	399	51,266	2040/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	—	500	506	64,988	2030/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	371	47,674	2052/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	610	78,380	2031/09/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	204	26,301	2026/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	781	100,334	2025/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	470	60,445	2028/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	460	59,108	2023/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	603	77,514	2042/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	564	72,448	2024/04/15
国 小 計	銘柄数 金 額	21銘柄			10,032	10,846	1,392,797	
ユーロ (オーストリア)		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	千ユーロ 1,373	千ユーロ 1,471	188,907	2025/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,196	153,672	2026/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	988	126,904	2047/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	325	41,782	2086/11/02
		Austria Government Bond	国債証券	—	900	911	117,017	2023/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,347	172,977	2027/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	894	114,873	2117/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	1,283	164,849	2028/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	980	1,033	132,720	2029/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	800	814	104,592	2024/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	—	980	991	127,339	2030/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	1,000	1,009	129,692	2023/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	747	96,037	2051/03/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	374	48,070	2040/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.8500	350	328	42,241	2120/06/30
		Austria Government Bond	国債証券	—	1,200	1,206	154,959	2031/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	480	489	62,891	2025/04/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	599	76,933	2036/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,144	146,949	2027/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,373	2,201	282,667	2037/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,082	138,967	2026/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	906	116,455	2022/11/22
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	723	92,859	2062/01/26
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	1,008	129,455	2044/06/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,005	129,096	2023/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	992	127,477	2034/05/23
		Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	996	127,958	2024/10/21
国 小 計	銘柄数 金 額	27銘柄			22,501	26,075	3,348,351	
通貨小計	銘柄数 金 額	349銘柄			603,330	704,049	90,406,985	
合 計	銘柄数 金 額	846銘柄					230,341,773	

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

# 外国債券インデックスマザーファンド

## ■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	230,341,773	98.5
コール・ローン等、その他	3,574,230	1.5
投資信託財産総額	233,916,004	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1シンガポール・ドル=83.21円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シケル=36.011円、1デンマーク・クローネ=17.27円、1ノルウェー・クローネ=12.61円、1スウェーデン・クローネ=12.53円、1メキシコ・ペソ=5.252円、1オフショア・人民元=17.83円、1マレーシア・リンギット=26.851円、1ポーランド・ズロチ=27.465円、1ユーロ=128.41円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(232,057,536千円)の投資信託財産総額(233,916,004千円)に対する比率は、99.2%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

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

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

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額:

ダイワ外国債券インデックスVA	498,388,691円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	10,756,510円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	79,498,163円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	22,023,940円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	312,397,465円
外国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	211,430,078円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	505,972,682円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)	2,311,980,333円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)	842,742,592円
D-1's 外国債券インデックス	744,003円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	7,190,607円

iFree 外国債券インデックス	1,686,822,876円
iFree 8資産バランス	1,443,360,479円
iFree 年金バランス	229,923,693円
DCダイワ外国債券インデックス	49,590,694,433円
ダイワ・ライフ・バランス30	964,870,268円
ダイワ・ライフ・バランス50	601,682,079円
ダイワ・ライフ・バランス70	393,993,399円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	578,219,728円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	439,097,748円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	160,496,213円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	28,543,954円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	10,558,255円
ダイワつみたてインデックス外国債券	599,439,774円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,367,466円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,453,811円
ダイワつみたてインデックスバランス70	1,909,053円
ダイワ先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ラップ専用)	317,987円
ダイワ世界バランスファンド40VA	163,610,849円
ダイワ世界バランスファンド60VA	135,308,646円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,912,241,392円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	231,133,046円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	143,219,876円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	43,309,779円
ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	2,367,106,464円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,825,688,039円
ダイワライフスタイル25	33,014,942円
ダイワライフスタイル50	65,372,616円
ダイワライフスタイル75	17,425,714円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は31,370円です。

## ■損益の状況

当期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日

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

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

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

# ダイワJ-REITインデックス (ダイワSMA専用)

## 運用報告書(全体版)

### 第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

#### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の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/>

#### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／不動産投信(リート)／インデックス型		
信託期間	無期限(設定日:2017年2月16日)		
運用方針	投資成果を東証REIT指数(配当込み)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

最近５期の運用実績

決算期	基準価額			東証ＲＥＩＴ指数 (配当込み)		投資信託 証券 組入比率	不動産投信 指数 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2 期末(2018年 6 月15日)	10,077	45	3.5	3,398.25	3.8	98.7	1.5	321
3 期末(2019年 6 月17日)	11,339	280	15.3	3,934.65	15.8	100.8	1.4	1,249
4 期末(2020年 6 月15日)	9,599	300	△ 12.7	3,448.87	△ 12.3	99.3	2.7	569
5 期末(2021年 6 月15日)	12,784	310	36.4	4,720.99	36.9	99.3	2.5	1,329
6 期末(2022年 6 月15日)	11,244	300	△ 9.7	4,278.73	△ 9.4	99.8	2.4	1,133

(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。

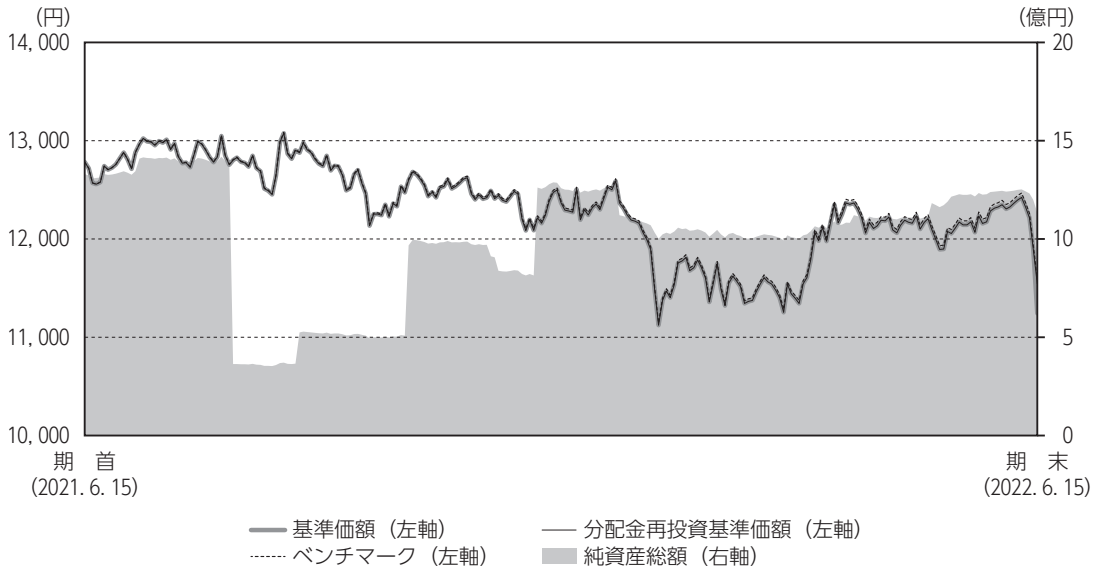
(注 4) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

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



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

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

\* ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。

#### 基準価額・騰落率

期首：12,784円

期末：11,244円（分配金300円）

騰落率：△9.7%（分配金込み）

#### 基準価額の主な変動要因

「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の受益証券を通じて、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、国内リート市況が下落したことを反映して、基準価額も下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワJ-REITインデックス (ダイワSMA専用)

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 先 物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2021年6月15日	円	%		%	%	%
	12,784	—	4,720.99	—	99.3	2.5
6月末	12,812	0.2	4,732.24	0.2	97.5	2.4
7月末	12,904	0.9	4,767.40	1.0	96.3	2.4
8月末	12,868	0.7	4,755.00	0.7	97.1	2.5
9月末	12,460	△ 2.5	4,605.71	△ 2.4	97.0	2.5
10月末	12,605	△ 1.4	4,660.54	△ 1.3	97.5	2.5
11月末	12,086	△ 5.5	4,470.13	△ 5.3	97.4	2.5
12月末	12,500	△ 2.2	4,624.94	△ 2.0	97.4	2.5
2022年1月末	11,812	△ 7.6	4,372.24	△ 7.4	97.4	2.5
2月末	11,463	△ 10.3	4,243.65	△ 10.1	97.4	2.5
3月末	12,249	△ 4.2	4,536.64	△ 3.9	97.5	2.5
4月末	12,101	△ 5.3	4,483.12	△ 5.0	97.5	2.5
5月末	12,313	△ 3.7	4,563.32	△ 3.3	97.5	2.4
(期末)2022年6月15日	11,544	△ 9.7	4,278.73	△ 9.4	99.8	2.4

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。



**投資環境について**

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

**国内リート市況**

国内リート市況は下落しました。

国内リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展による経済活動の正常化期待から上昇が続きました。その後は、国内外で長期金利が上昇したことや中国の大手不動産会社の資金繰り懸念などから投資家のリスク回避姿勢が強まり、下落が続きました。2021年末から2022年初めにかけては、新型コロナウイルスの新しい変異株であるオミクロン株が確認されたことやウクライナ情勢の悪化、米国金融政策の引き締めペース加速への懸念から、投資家のリスク選好姿勢が後退したことなどを背景に、軟調に推移しました。3月中旬以降は、ＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）の利上げ決定で悪材料出尽くし観測が強まったことや、ロシアとウクライナによる停戦協議の進展期待もあり、国内リート市況は一時反発しました。しかしその後は、ＦＲＢの利上げペースが一層加速するとの懸念などから、当作成期末にかけて下落しました。

**前作成期末における「今後の運用方針」****当ファンド**

「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

**ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド**

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

## ポートフォリオについて

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

### 当ファンド

国内リートへの投資は、「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券を通じて行いました。なお、当作成期末のリート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）は102.2%となっておりますが、翌営業日計上のマザーファンド解約金額を考慮したリート実質組入比率は100%程度となっております。

### ダイワJ-REITマザーファンド

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

\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

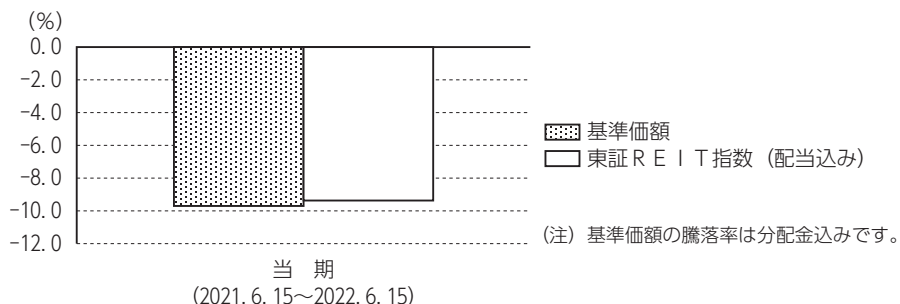
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワJ-REITマザーファンド	東証REIT指数（配当込み）

## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△9.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△9.7%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\* ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。

## 分配金について

当作成期の1万口当り分配金(税込み)は下記「分配原資の内訳(1万口当り)」の「当期分配金(税込み)」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程(1万口当り)」をご参照ください。  
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### 分配原資の内訳(1万口当り)

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
<b>当期分配金(税込み)</b>	<b>(円)</b>	<b>300</b>
対基準価額比率	(%)	2.60
当期の収益	(円)	300
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	2,098

- (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。

### 収益分配金の計算過程(1万口当り)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 302.32円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	1,881.91
(d) 分配準備積立金	214.34
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	2,398.57
(f) 分配金	300.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	2,098.57

- (注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 今後の運用方針

### 当ファンド

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

### ダイワJ-REITマザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16~2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	42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12,304円です。
(投 信 会 社)	(26)	(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)	(14)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.006	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)	(0.006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	43	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。

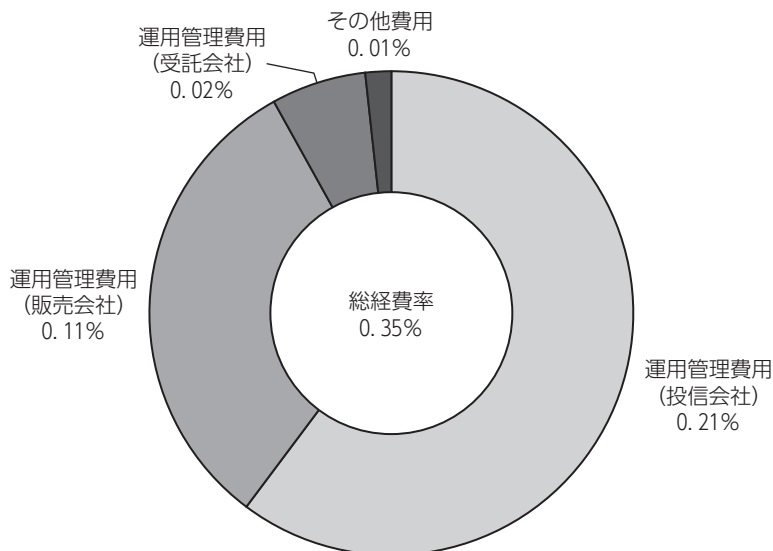
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。

## ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）

### ■売買および取引の状況

#### 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ Ｊ－ＲＥＩＴ マザーファンド	379,860	1,288,818	402,051	1,396,170

(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

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
投資信託証券	百万円 86,193	百万円 2,803	% 3.3	百万円 73,951	百万円 686	% 0.9
不動産投信 指数先物取引	48,457	—	—	48,862	—	—
コール・ローン	2,227,929	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.2%

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

#### (3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

種 類	当 期		
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド 買付額	売付額	作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
投資信託証券	2,442	2,072	13,083

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

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

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

種 類	当 期
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド 買付額
	百万円
投資信託証券	1,485

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

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

当作成期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

\*利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社、大和証券オフィス投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、大和証券リビング投資法人です。

### ■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首 保有額	当作成期中 設定額	当作成期中 解約額	当作成期末 保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

### ■組入資産明細表

#### 親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワＪ－ＲＥＩＴ マザーファンド	388,974	366,782	1,163,251

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワJ-REIT マザーファンド	1,163,251	99.8
コール・ローン等、その他	2,460	0.2
投資信託財産総額	1,165,711	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>1,165,711,160円</b>
コール・ローン等	2,460,034
ダイワJ-REITマザーファンド (評価額)	1,163,251,126
<b>(B) 負債</b>	<b>32,172,741</b>
未払収益分配金	30,243,392
未払信託報酬	1,898,811
その他未払費用	30,538
<b>(C) 純資産総額 (A-B)</b>	<b>1,133,538,419</b>
元本	1,008,113,072
次期繰越損益金	125,425,347
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>1,008,113,072口</b>
1万口当り基準価額 (C/D)	11,244円

\*期首における元本額は1,040,271,027円、当作成期間中における追加設定元本額は1,050,973,291円、同解約元本額は1,083,131,246円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は11,244円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 130円</b>
受取利息	48
支払利息	△ 178
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 84,468,826</b>
売買益	8,176,631
売買損	△ 92,645,457
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 3,535,079</b>
<b>(D) 当期損益金 (A+B+C)</b>	<b>△ 88,004,035</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>21,608,076</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>222,064,698</b>
(配当等相当額)	( 189,717,821)
(売買損益相当額)	( 32,346,877)
<b>(G) 合計 (D+E+F)</b>	<b>155,668,739</b>
<b>(H) 収益分配金</b>	<b>△ 30,243,392</b>
次期繰越損益金 (G+H)	125,425,347
追加信託差損益金	222,064,698
(配当等相当額)	( 189,717,821)
(売買損益相当額)	( 32,346,877)
分配準備積立金	21,842,011
繰越損益金	△ 118,481,362

(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	30,477,327円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	189,717,821
(d) 分配準備積立金	21,608,076
(e) 当期分配対象額 (a+b+c+d)	241,803,224
(f) 分配金	30,243,392
(g) 翌期繰越分配対象額 (e-f)	211,559,832
(h) 受益権総口数	1,008,113,072口



収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)	300円

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

<補足情報>

当ファンド（ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用））が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の決算日（2022年3月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの主要な売買銘柄  
投資信託証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
日本ビルファンド	8.445	5,801,317	686,952	インベスコ・オフィス・リート	264.318	6,012,934	22,748
ＧＬＰ投資法人	24.404	4,476,348	183,426	日本ビルファンド	6.676	4,640,954	695,169
日本プロロジスリート	12.144	4,455,172	366,862	ジャパンリアルエステイト	6.212	4,099,623	659,952
ジャパンリアルエステイト	6.303	4,096,537	649,934	ＧＬＰ投資法人	19.418	3,606,567	185,733
大和ハウスリート投資法人	12.155	3,960,229	325,810	日本プロロジスリート	9.725	3,565,867	366,670
野村不動産マスターＦ	20.383	3,364,783	165,077	野村不動産マスターＦ	20.089	3,317,831	165,156
日本都市ファンド投資法人	31.833	3,332,350	104,682	日本都市ファンド投資法人	28.716	2,954,606	102,890
アドバンス・レジデンス	7.815	2,816,234	360,362	大和ハウスリート投資法人	8.944	2,925,500	327,090
ユナイテッド・アーバン投資法人	17.598	2,619,604	148,858	オリックス不動産投資	12.38	2,313,124	186,843
日本プライムリアルティ	6.143	2,492,023	405,668	アドバンス・レジデンス	5.667	2,024,644	357,269

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2022年6月15日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（139,303,981千口）の内容です。

(1)国内投資信託証券

銘柄	2022年6月15日現在	
	口数	評価額
	千口	千円
エスコンジャパンリート	8.307	1,064,126
サンケイリアルエステイト	13.067	1,253,125
SOSILA 物流リート投	19.191	2,721,283
東海道リート投資法	3.159	365,180
日本アコモデーションファンド投資法人	14.244	9,130,404
森ヒルズリート	48.511	6,995,286
産業ファンド	58.566	10,073,352
アドバンス・レジデンス	41.247	13,797,121
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	29.519	5,965,789
ＡＰＩ投資法人	21.986	8,662,484
ＧＬＰ投資法人	133.61	20,602,662
コンフォリア・レジデンシャル	19.191	6,150,715
日本プロロジスリート	67.495	21,463,410
星野リゾート・リート	6.913	4,562,580
Oneリート投資法人	7.159	1,867,067
イオンリート投資	48.515	7,088,041

銘柄	2022年6月15日現在	
	口数	評価額
	千口	千円
ヒューリックリート投資法	38.485	5,918,993
日本リート投資法人	12.73	4,563,705
積水ハウス・リート投資	125.223	9,454,336
トーセイ・リート投資法人	8.619	1,097,198
ケネディクス商業リート	16.471	4,328,578
ヘルスケア&メディカル投資	10.106	1,516,910
サムティ・レジデンシャル	9.345	1,221,391
野村不動産マスターＦ	133.405	21,291,438
いちごホテルリート投資	6.834	610,276
ラサールロジポート投資	50.502	8,393,432
スターアジア不動産投	42.633	2,515,347
マリモ地方創生リート	4.831	645,421
三井不動産パーク	16.25	8,222,500
大江戸温泉リート	6.659	443,489
投資法人みらい	49.971	2,408,602
森トラスト・ホテルリート投	9.679	1,179,870

## ダイワJ-REITマザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在	
	口数	評価額
	千口	千円
三菱地所物流 REIT	11.985	5,177,520
CRE ロジスティクスファンド	15.977	3,027,641
ザイマックス・リート	6.658	814,939
タカラレーベン不動産投	16.268	1,830,150
アドバンス・ロジスティクス投資法人	16.085	2,380,580
日本ビルファンド	48.095	32,367,935
ジャパンリアルエステイト	41.254	24,876,162
日本都市ファンド投資法人	208.146	21,022,746
オリックス不動産投資	82.197	14,392,694
日本プライムリアルティ	28.189	10,937,332
NTT 都市開発リート投資法人	39.543	5,658,603
東急リアル・エステート	27.659	5,083,724
グローバル・ワン不動産投資法人	28.263	2,916,741
ユナイテッド・アーバン投資法人	92.869	12,537,315
森トラスト総合リート	29.484	3,992,133
インヴェンシブル投資法人	181.574	6,963,362
フロンティア不動産投資	14.462	7,288,848
平和不動産リート	28.123	3,900,660
日本ロジスティクスファンド投資法人	27.816	8,525,604
福岡リート投資法人	21.336	3,424,428
ケネディクス・オフィス投資法人	12.762	8,001,774
いちごオフィスリート投資法人	33.803	2,738,043
大和証券オフィス投資法人	8.722	5,651,856
阪急阪神リート投資法人	18.634	2,653,481
スターツプロシード投資法人	6.424	1,478,804
大和ハウスリート投資法人	61.942	17,963,180
ジャパン・ホテル・リート投資法人	126.383	7,709,363
大和証券リビング投資法人	55.743	6,209,770
ジャパンエクセレント投資法人	37.844	4,601,830
合計	2,410.663	429,701,345
	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	61銘柄 < 97.3% >

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

## (2)先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2022年6月15日現在	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
東証REIT	10,402	—

(注) 単位未満は切捨て。

# ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

## 運用報告書 第36期（決算日 2022年3月15日）

（作成対象期間 2021年9月16日～2022年3月15日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

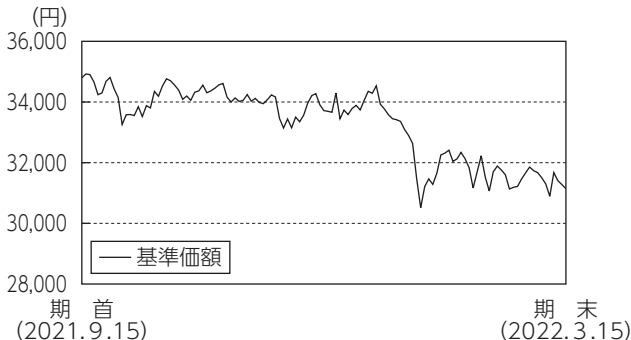
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

# ダイワJ-REITマザーファンド

## ■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数(配当込み)		投資信託	不動産投信
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	証券	指数先物
		%		%	組入比率	比率
(期首)2021年9月15日	34,797	-	4,692.90	-	96.7	2.5
9月末	34,150	△ 1.9	4,605.71	△ 1.9	97.1	2.5
10月末	34,555	△ 0.7	4,660.54	△ 0.7	97.5	2.5
11月末	33,143	△ 4.8	4,470.13	△ 4.7	97.5	2.5
12月末	34,288	△ 1.5	4,624.94	△ 1.4	97.5	2.5
2022年1月末	32,411	△ 6.9	4,372.24	△ 6.8	97.4	2.5
2月末	31,460	△ 9.6	4,243.65	△ 9.6	97.5	2.5
(期末)2022年3月15日	31,141	△10.5	4,200.48	△10.5	97.0	2.5

(注1) 騰落率は期首比。

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

(注3) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。

## 《運用経過》

### ◆ 基準価額等の推移について

#### 【基準価額・騰落率】

期首：34,797円 期末：31,141円 騰落率：△10.5%

#### 【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、新型コロナウイルスの新しい変異株であるオミクロン株が確認されたことなどを背景に国内リート市況が下落したことにより、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

### ◆ 投資環境について

#### ○ 国内リート市況

国内リート市況は下落しました。

国内リート市況は、当作成期首より、国内外で長期金利が上昇したことや、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念などから投資家のリスク回避姿勢が強まり、下落が続きました。その後は、割安感から買いが入り上昇に転じましたが、2021年11月に南アフリカにおいて新型コロナウイルスの新しい変異株であるオミクロン株が確認されたことが懸念され、軟調に推移しました。2022年に入ると、年初から公募増資の発表が相次ぎ、需給悪化から下落しました。加えて、米国金融政策の引き締めペース加速への懸念から投資家のリスク選好姿勢が悪化したことや、ウクライナ情勢の悪化などを背景に、軟調に推移しました。

### ◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

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

### ◆ ポートフォリオについて

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

### ◆ ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△10.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△10.5%となりました。

ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率の違い、先物取引の影響、売買等のコストなどが差異の要因となりました。

\* ベンチマークは東証REIT指数(配当込み)です。

## 《今後の運用方針》

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

## ■ 1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2021年9月16日から2022年3月15日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内	138.714	27,144,862	191.226 ( )	35,916,458 ( )

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 売付( )内は償還による減少分で、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

(2021年9月16日から2022年3月15日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	百万円	百万円	百万円	百万円
不動産投信指数先物取引	25,298	25,500	-	-

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託証券

(2021年9月16日から2022年3月15日まで)

当				期					
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		3.384	2,267,738	670,135	日本ビルファンド		3.69	2,524,525	684,153
日本プロロジスリート		5.049	1,890,675	374,465	ジャパンリアルエステイト		3.307	2,140,318	647,208
ジャパンリアルエステイト		1.923	1,239,860	644,753	ＧＬＰ投資法人		10.706	1,949,782	182,120
ＧＬＰ投資法人		6.225	1,147,436	184,327	日本プロロジスリート		5.23	1,899,349	363,164
野村不動産マスターＦ		6.216	992,103	159,604	野村不動産マスターＦ		10.69	1,717,991	160,710
日本都市ファンド投資法人		9.7	962,668	99,244	日本都市ファンド投資法人		16.68	1,638,533	98,233
大和ハウスリート投資法人		2.888	950,529	329,130	大和ハウスリート投資法人		4.965	1,617,214	325,723
三井不ロジパーク		1.596	919,736	576,275	オリックス不動産投資		6.589	1,164,804	176,780
三菱地所物流ＲＥＩＴ		1.92	855,871	445,766	アドバンス・レジデンス		3.306	1,155,348	349,470
日本プライムリアルティ		2.119	811,986	383,193	ユナイテッド・アーバン投資法人		7.441	1,015,159	136,427

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

# ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

## ■組入資産明細表

### (1) 国内投資信託証券

銘柄	期首		当期末	
	□数	□数	□数	評価額
	千口	千口	千口	千円
エスコンジャパンリート	8.096	7.818	1,029,630	
サンケイリアルエステート	12.735	12.297	1,301,022	
S O S I L A 物流リート投	16.867	18.061	2,709,150	
東海道リート投資法	3.079	2.973	325,543	
日本アコモデーションファンド投資法人	13.883	13.405	8,217,265	
森ヒルズリート	47.279	45.653	6,144,893	
産業ファンド	57.079	55.115	9,446,711	
アドバンス・レジデンス	40.201	38.817	12,518,482	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	27.461	27.781	5,422,851	
A P I 投資法人	21.428	20.691	8,038,453	
G L P 投資法人	130.219	125.738	21,790,395	
コンフォリア・レジデンシャル	18.103	18.06	5,508,300	
日本プロロジスリート	63.699	63.518	21,532,602	
星野リゾート・リート	6.203	6.506	4,176,852	
Oneリート投資法人	6.267	6.737	1,866,149	
イオンリート投資	47.284	45.657	6,419,374	
ヒューリックリート投資法	35.345	36.218	5,516,001	
日本リート投資法人	12.407	11.98	4,222,950	
積水ハウス・リート投資	118.257	117.845	8,732,314	
トーセイ・リート投資法人	8.401	8.112	1,027,790	
ケネディクス商業リート	16.053	15.501	4,100,014	
ヘルスケア&メディカル投資	8.576	9.51	1,383,705	
サムティ・レジデンシャル	9.108	8.794	1,019,224	
野村不動産マスターF	130.019	125.545	18,630,878	
いちごホテルリート投資	6.661	6.432	512,630	
ラサールロジポート投資	49.22	47.527	7,851,460	
スターアジア不動産投	41.551	40.121	2,335,042	
マリモ地方創生リート	3.767	4.547	576,559	
三井不ロジパーク	14.945	15.293	7,982,946	
大江戸温泉リート	6.49	6.266	409,796	
投資法人みらい	45.835	47.027	2,269,052	
森トラスト・ホテルリート投	9.433	9.109	1,069,396	
三菱地所物流 R E I T	10.218	11.279	4,900,725	
C R E ロジスティクスファンド	15.541	15.035	2,927,314	
ザイマックス・リート	5.836	6.266	721,843	
タカラレーベン不動産投	15.855	15.31	1,717,782	
伊藤忠アドバンスロジ	15.677	15.138	2,211,661	
日本ビルファンド	45.567	45.261	28,876,518	
ジャパンリアルエステイト	40.207	38.823	23,332,623	
日本都市ファンド投資法人	202.863	195.883	18,275,883	
オリックス不動産投資	80.111	77.354	12,546,818	
日本プライムリアルティ	26.423	26.528	9,841,888	
N T T 都市開発リート投資法人	36.315	37.213	5,418,212	

銘柄	期首		当期末		
	□数	□数	□数	評価額	
	千口	千口	千口	千円	
東急リアル・エステート	26.957	26.029	4,653,985		
グローバル・ワン不動産投資法人	27.919	26.959	2,890,004		
ユナイテッド・アーバン投資法人	90.512	87.397	10,811,008		
森トラスト総合リート	28.735	27.747	3,745,845		
インヴィンシブル投資法人	176.965	170.876	6,664,164		
フロンティア不動産投資	14.095	13.61	6,294,625		
平和不動産リート	26.047	25.151	3,337,537		
日本ロジスティクスファンド投資法人	26.27	26.177	7,709,126		
福岡リート投資法人	20.794	20.079	3,114,252		
ケネディクス・オフィス投資法人	12.438	12.01	8,106,750		
いちごオフィスリート投資法人	32.945	31.811	2,595,777		
大和証券オフィス投資法人	8.5	8.208	5,745,600		
阪急阪神リート投資法人	18.161	17.536	2,483,097		
スターツプロシード投資法人	6.261	6.046	1,347,653		
大和ハウスリート投資法人	60.37	58.293	17,866,804		
ジャパン・ホテル・リート投資法人	123.175	118.937	6,910,239		
大和証券リビング投資法人	52.589	52.459	5,828,194		
ジャパンエクセレント投資法人	37.308	36.024	4,463,373		
合 計	□数	金額	2,320,605	2,268,093	399,426,751
	銘柄	数<比率>	61銘柄	61銘柄	<97.0%>

(注1) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

### (2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期		未	
	買 建 額	売 建 額	買 建 額	売 建 額
国内	百万円		百万円	
東証 R E I T	10,337			-

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年3月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託証券	千円 399,426,751	% 96.4
コール・ローン等、その他	14,762,613	3.6
投資信託財産総額	414,189,365	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年3月15日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>419,218,740,625円</b>
コール・ローン等	6,638,010,617
投資信託証券(評価額)	399,426,751,850
未収入金	3,181,884,052
未収配当金	4,806,079,106
差入委託証拠金	5,166,015,000
<b>(B) 負債</b>	<b>7,276,441,000</b>
未払金	184,856,000
未払解約金	2,062,210,000
差入委託証拠金代用有価証券	5,029,375,000
<b>(C) 純資産総額(A－B)</b>	<b>411,942,299,625</b>
元本	132,282,348,763
次期繰越損益金	279,659,950,862
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>132,282,348,763口</b>
<b>1万口当り基準価額(C/D)</b>	<b>31,141円</b>

\* 期首における元本額は137,936,526,812円、当作成期間中における追加設定元本額は9,698,245,164円、同解約元本額は15,352,423,213円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	4,717,690,898円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン (毎月分配型)	115,809,276,949円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン (年1回決算型)	349,988,867円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	10,912,637円
iFree J－ＲＥＩＴインデックス	610,923,825円
iFree 8資産バランス	1,493,803,230円
DC・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	5,312,633,236円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,522,613円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	5,068,402円
ダイワ国内REITインデックス (投資一任専用)	313,398円
ダイワ・ノーロード J－ＲＥＩＴファンド	95,801,012円
ダイワファンドラップ J－ＲＥＩＴインデックス	2,074,049,260円
ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス (ダイワSMA専用)	321,257,153円
ダイワファンドラップオンライン J－ＲＥＩＴインデックス	530,113,475円
ダイワ・インデックスセレクト J－ＲＥＩＴ	943,993,808円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は31,141円です。

■損益の状況

当期 自2021年9月16日 至2022年3月15日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>7,977,261,954円</b>
受取配当金	7,978,262,875
受取利息	1,318
その他収益金	345
支払利息	△ 1,002,584
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>△ 55,710,936,011</b>
売買益	252,573,529
売買損	△ 55,963,509,540
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>△ 1,237,417,990</b>
取引損	△ 1,237,417,990
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>△ 48,971,092,047</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>342,046,097,462</b>
<b>(F) 解約差損益金</b>	<b>△ 35,919,608,889</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>22,504,554,336</b>
<b>(H) 合計(D+E+F+G)</b>	<b>279,659,950,862</b>
次期繰越損益金(H)	279,659,950,862

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

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

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



# ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジあり) (ダイワSMA専用)

## 運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）／インデックス型	
信託期間	無期限（設定日：2017年2月16日）	
運用方針	投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの受益証券
	先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	イ. 先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。） ロ. 先進国のリート指数との連動をめざすETF（上場投資信託証券） ハ. 先進国のリートを対象としたリート指数先物取引
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率 マザーファンドの株式組入上限比率	無制限
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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、先進国（日本を除きます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

### 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ヘッジ・円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	不動産投信 指数 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2期末(2018年6月15日)	9,848	110	△ 2.3	10,324	△ 0.1	0.8	100.0	1.0	279
3期末(2019年6月17日)	10,580	290	10.4	11,537	11.8	0.6	101.0	1.0	695
4期末(2020年6月15日)	8,945	0	△ 15.5	9,844	△ 14.7	2.2	94.5	3.2	134
5期末(2021年6月15日)	11,846	160	34.2	13,286	35.0	0.7	99.0	1.6	3,546
6期末(2022年6月15日)	9,973	220	△ 14.0	11,523	△ 13.3	3.7	101.0	2.4	2,194

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

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

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

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

(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

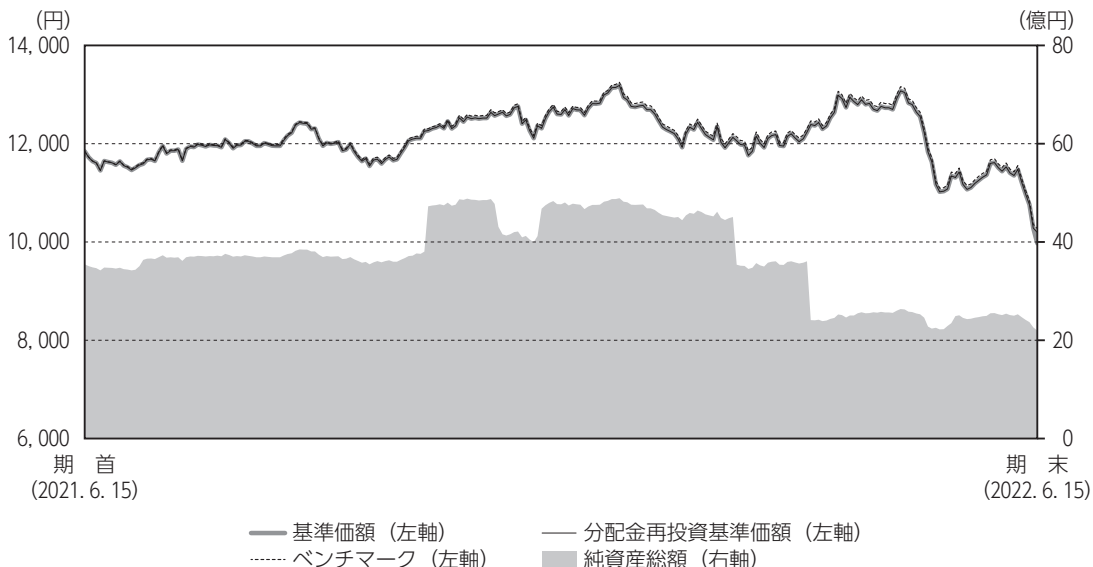
※当ファンドの約款変更に伴い、参考指数「S & P先進国REIT指数（除く日本）（現地通貨ベース）」からベンチマーク「S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）」に変更しました。

S & P先進国REIT指数（除く日本）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「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<sup>®</sup> およびS & P<sup>®</sup> はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones<sup>®</sup> はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P先進国REIT指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

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

\* ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）です。

#### 基準価額・騰落率

期首：11,846円

期末：9,973円（分配金220円）

騰落率：△14.0%（分配金込み）

#### 基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、海外リート市場の下落が主な要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

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）

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ヘッジ・円ベース)		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	不動産投信 指 先 物 比 率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
		%		%	%	%	%	%
(期首)2021年6月15日	11,846	—	13,286	—	—	0.7	99.0	1.6
6月末	11,523	△ 2.7	12,939	△ 2.6	△ 0.0	0.5	98.0	1.9
7月末	11,943	0.8	13,414	1.0	—	1.5	95.5	1.5
8月末	12,163	2.7	13,670	2.9	△ 0.0	1.5	97.2	1.8
9月末	11,696	△ 1.3	13,159	△ 1.0	—	0.5	98.4	2.4
10月末	12,457	5.2	14,012	5.5	△ 0.0	1.1	98.2	2.6
11月末	12,486	5.4	14,056	5.8	△ 0.0	0.7	96.2	1.9
12月末	13,141	10.9	14,797	11.4	—	1.5	97.9	2.3
2022年1月末	12,205	3.0	13,764	3.6	△ 0.0	1.3	96.1	2.4
2月末	12,158	2.6	13,728	3.3	△ 0.0	0.6	97.6	2.2
3月末	12,918	9.0	14,576	9.7	—	0.1	98.7	7.2
4月末	12,556	6.0	14,178	6.7	—	1.3	100.8	3.2
5月末	11,615	△ 2.0	13,116	△ 1.3	—	2.5	94.6	2.2
(期末)2022年6月15日	10,193	△ 14.0	11,523	△ 13.3	—	3.7	101.0	2.4

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

（2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15）

### 海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展により経済活動の正常化が順次進んだことや、好調な経済指標の発表などからおおむね上昇しました。しかし2021年9月に入ると、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念から世界的に市場心理が悪化したことに加え、世界的にインフレの長期化が懸念されて長期金利が急上昇したことで、売られる展開となりました。10月については、好調な決算発表や米国長期金利の低下に加え、中国の大手不動産会社に対する信用不安の後退などから上昇に転じたものの、11月からは新型コロナウイルスの新変異株であるオミクロン株への懸念などから下落に転じました。その後は、年末にかけてオミクロン株への過度の懸念の後退などから上昇する局面はあったものの、2022年に入ると、2021年12月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）議事録を受けて米国の金融引き締めに対する懸念が高まり、米国を中心に下落に転じました。2月以降は、欧米の中央銀行高官の金融政策に対する発言やロシアのウクライナへの侵攻、ロシアとウクライナの散発的な停戦協定による状況改善期待などから、一進一退の展開となりました。4月以降は、米国の金融引き締めの加速懸念などからリスク回避の展開となり、海外リート市場も米国を中心に軟調に推移し、当作成期末を迎えました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### 当ファンド

引き続き「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」および「先進国REITマザーファンド」の受益証券に投資します。また、マザーファンドの保有外貨建資産の当ファンド相当分については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

### 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。

### 先進国REITマザーファンド

日本を除く先進国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、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉え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）および不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

ポートフォリオについて

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

**当ファンド**

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」、[先進国REITマザーファンド] および「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の受益証券への投資を、90～110%の範囲で行いました。また、2022年3月に主要投資対象を「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」および「先進国REITマザーファンド」から「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」に変更しました。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」および「先進国REITマザーファンド」が保有する外貨建資産の当ファンド相当分については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。なお、マザーファンドの組入比率が100%程度にならないのは、為替の売りヘッジ予約による評価損益が発生する影響が主要因です。

**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。

**先進国REITマザーファンド**

海外リートの組入比率（ETF（外国投資信託証券）および不動産投信指数先物取引を含む。）は、当作成期を通じて原則として100%に近づけて運用を行いました。

海外リートポートフォリオにつきましては、S & P先進国REIT指数（除く日本）採用銘柄の中から流動性の高い海外リートを中心に通常50銘柄程度で組成し、結果として時価総額の大きい海外リートを主としたポートフォリオとなりました。なお、運用の効率化を図るため、ETFおよび不動産投信指数先物取引も利用しました。

**先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド**

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、保有する外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物を組み入れました。

\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

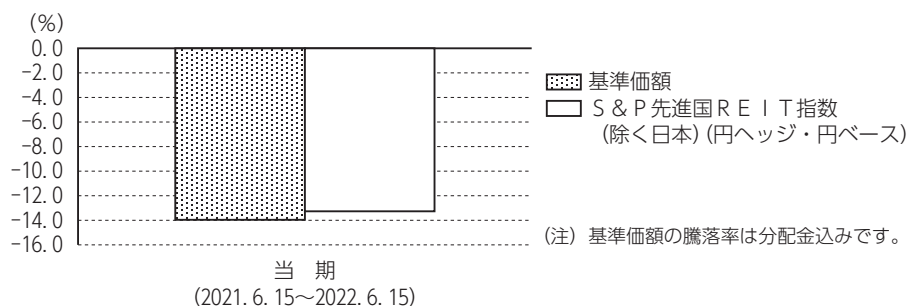
組入ファンド	ベンチマーク（参考指数）
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）
先進国REITマザーファンド	S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）（参考指数）
先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）

## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△13.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△14.0%となりました。

マザーファンドについては、配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のズレも、かい離要因としてあげられます。また、為替ヘッジを行う時に、通貨間の金利差等による損益（為替ヘッジコスト）が発生します。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



\*ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）です。

## 分配金について

当作成期の 1 万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1 万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1 万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### 分配原資の内訳（1 万口当り）

項 目	当 期	
	2021年 6 月16日 ～2022年 6 月15日	
<b>当期分配金（税込み）</b>	<b>（円）</b>	<b>220</b>
対基準価額比率	（％）	2.16
当期の収益	（円）	220
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	3,509

（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。

### 収益分配金の計算過程（1 万口当り）

項 目	当 期	
(a) 経費控除後の配当等収益	✓	239.43円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益		0.00
(c) 収益調整金		2,454.51
(d) 分配準備積立金		1,035.18
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)		3,729.12
(f) 分配金		220.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)		3,509.12

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 今後の運用方針

### 当ファンド

主として「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の受益証券に投資します。

### 先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場または店頭登録のリートに投資し、保有する外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、E T F（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。



## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16~2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	53円	0. 434%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12, 123円です。
（投 信 会 社）	(37)	(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）	(13)	(0. 110)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	3	0. 028	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. 003)	
（投資信託受益証券）	(0)	(0. 003)	
（投資信託証券）	(3)	(0. 022)	
有 価 証 券 取 引 税	4	0. 032	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）	(4)	(0. 032)	
そ の 他 費 用	2	0. 015	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(0)	(0. 004)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0. 006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(1)	(0. 005)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	62	0. 509	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

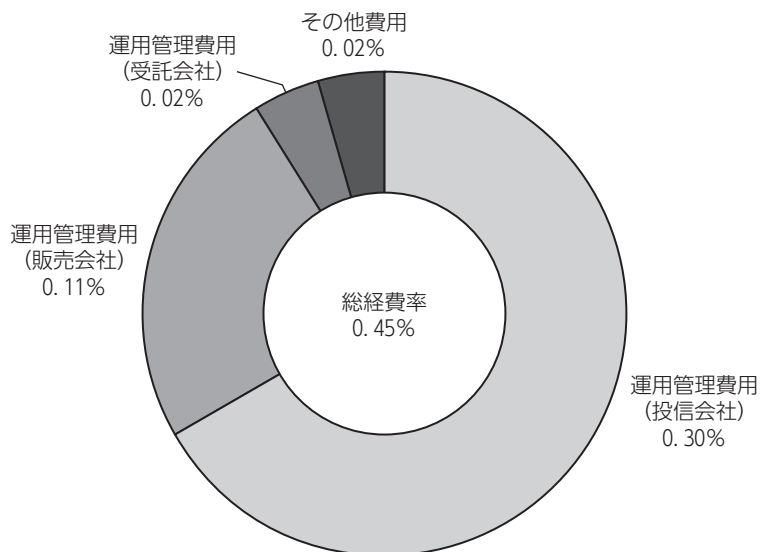
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.45%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

## 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）

### ■売買および取引の状況

#### 親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2021年6月16日から2022年6月15日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
先進国REIT マザーファンド	—	—	582,772	1,295,102
先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	2,689,425	2,850,380	133,653	141,218
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	688,964	2,127,650	1,521,284	4,937,696

（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。

### ■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首 保有額	当作成期中 設定額	当作成期中 解約額	当作成期末 保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
10	—	—	10	当初設定時における取得

（注1）金額は元本ベース。

（注2）単位未満は切捨て。

### ■組入資産明細表

#### 親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
先進国REIT マザーファンド	582,772	—	—	—	—	—
先進国リート・インデックス （為替ヘッジあり）マザーファンド	—	2,555,771	2,243,201	—	—	—
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	832,319	—	—	—	—	—

（注）単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
先進国リート・インデックス （為替ヘッジあり）マザーファンド	2,243,201	99.7
コール・ローン等、その他	7,270	0.3
投資信託財産総額	2,250,471	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。

（注2）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝135.01円、1カナダ・ドル＝104.20円、1オーストラリア・ドル＝93.10円、1香港・ドル＝17.20円、1シンガポール・ドル＝96.95円、1ニュージーランド・ドル＝83.95円、1イギリス・ポンド＝162.21円、1イスラエル・シケル＝38.942円、100韓国・ウォン＝10.46円、1ユーロ＝140.80円です。

（注3）先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（21,257,560千円）の投資信託財産総額（21,489,082千円）に対する比率は、98.9%です。

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,250,471,302円
コール・ローン等	7,270,244
先進国リート・インデックス （為替ヘッジあり）マザーファンド（評価額）	2,243,201,058
(B) 負債	55,921,483
未払収益分配金	48,409,926
未払信託報酬	7,417,750
その他未払費用	93,807
(C) 純資産総額（A－B）	2,194,549,819
元本	2,200,451,221
次期繰越損益金	△ 5,901,402
(D) 受益権総口数	2,200,451,221口
1万口当り基準価額（C/D）	9,973円

\* 期首における元本額は2,993,845,190円、当作成期間中における追加設定元本額は2,073,516,186円、同解約元本額は2,866,910,155円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,973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5,901,402円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,021円
受取利息	376
支払利息	△ 1,397
(B) 有価証券売買損益	△ 369,752,227
売買益	662,708,032
売買損	△ 1,032,460,259
(C) 信託報酬等	△ 16,304,997
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 386,058,245
(E) 前期繰越損益金	227,786,816
(F) 追加信託差損益金	200,779,953
(配当等相当額)	( 540,104,220)
(売買損益相当額)	(△ 339,324,267)
(G) 合計 (D + E + F)	42,508,524
(H) 収益分配金	△ 48,409,926
次期繰越損益金 (G + H)	△ 5,901,402
追加信託差損益金	200,779,953
(配当等相当額)	( 540,104,220)
(売買損益相当額)	(△ 339,324,267)
分配準備積立金	232,062,312
繰越損益金	△ 438,743,667

- (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せん。
- (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	52,685,422円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	540,104,220
(d) 分配準備積立金	227,786,816
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	820,576,458
(f) 分配金	48,409,926
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	772,166,532
(h) 受益権総口数	2,200,451,221口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)

220円

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

《お知らせ》

■投資対象ファンドの変更について

当ファンドの投資対象ファンドを「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」および「先進国REITマザーファンド」から「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」に変更しました。

## 先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

### <補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の第1期決算日が到来しておりませんので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在における先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

### ■先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの主要な売買銘柄

#### (1) 投資信託受益証券

（2021年6月16日から2022年6月15日まで）

買付				売付			
銘柄	□数	金額	平均単価	銘柄	□数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	107.449	1,400,753	13,036	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	43.937	575,901	13,107

（注1）金額は受渡し代金。

（注2）金額の単位未満は切捨て。

#### (2) 投資信託証券

（2021年6月16日から2022年6月15日まで）

買付				売付			
銘柄	□数	金額	平均単価	銘柄	□数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
PROLOGIS INC (アメリカ)	98.06	1,866,778	19,037	PROLOGIS INC (アメリカ)	12.507	258,005	20,628
EQUINIX INC (アメリカ)	11.929	1,048,731	87,914	EQUINIX INC (アメリカ)	1.519	142,322	93,694
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	20.215	900,173	44,529	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	2.577	125,134	48,558
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	43.546	704,404	16,176	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	5.555	89,621	16,133
WELLTOWER INC (アメリカ)	57.646	643,034	11,154	WELLTOWER INC (アメリカ)	7.323	87,822	11,992
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	37.583	634,199	16,874	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	4.774	87,699	18,370
REALTY INCOME CORP (アメリカ)	73.57	604,370	8,214	REALTY INCOME CORP (アメリカ)	9.518	84,301	8,857
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	18.509	544,810	29,434	GOODMAN GROUP (オーストラリア)	39.715	83,793	2,109
GOODMAN GROUP (オーストラリア)	249.655	508,682	2,037	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	2.351	72,336	30,768
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	45.257	483,169	10,676	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	5.749	63,807	11,098

（注1）金額は受渡し代金。

（注2）金額の単位未満は切捨て。

### ■組入資産明細表

下記は、2022年6月15日現在における先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド（23,434,151千口）の内容です。

#### (1) 外国投資信託受益証券

銘柄	□数	2022年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ) VANGUARD REAL ESTATE ETF	63.512	5,545	748,747
合計	63.512	5,545	748,747
	□数、金額 銘柄数 < 比率 >	1銘柄	<3.6%>

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

（注2）< >内は純資産総額に対する評価額の比率。

（注3）評価額の単位未満は切捨て。

## (2) 外国投資信託証券

銘柄	2022年6月15日現在		
	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
(シンガポール)			
MANULIFE US REAL ESTATE INV	203.4	118	16,064
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	95.4	65	8,822
PRIME US REIT	68.4	47	6,418
(アメリカ)			
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15.189	292	39,475
URBAN EDGE PROPERTIES	12.73	189	25,625
XENIA HOTELS & RESORTS INC	13.204	204	27,631
AVALONBAY COMMUNITIES INC	16.158	2,992	403,990
SIMON PROPERTY GROUP INC	37.991	3,666	495,015
BOSTON PROPERTIES INC	16.434	1,489	201,107
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	18.583	108	14,702
VORNADO REALTY TRUST	18.382	532	71,871
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	9.959	187	25,318
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9.474	432	58,326
NEXPOINT RESIDENTIAL	2.627	160	21,631
EQUITY RESIDENTIAL	39.508	2,717	366,870
APPLE HOSPITALITY REIT INC	24.552	363	49,124
EPR PROPERTIES	8.648	376	50,859
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.427	89	12,085
CITY OFFICE REIT INC	5.316	60	8,224
GLOBAL NET LEASE INC	11.978	157	21,233
EQUINIX INC	10.41	6,438	869,287
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8.943	220	29,762
CHATHAM LODGING TRUST	5.953	65	8,816
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6.366	507	68,517
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	14.038	216	29,262
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2.867	94	12,726
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6.929	35	4,789
HOST HOTELS & RESORTS INC	82.551	1,418	191,474
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	34.138	1,124	151,819
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17.628	286	38,698
RLJ LODGING TRUST	19.259	225	30,447
FARMLAND PARTNERS INC	3.465	48	6,483
PHYSICIANS REALTY TRUST	25.468	421	56,906
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8.218	104	14,168
KIMCO REALTY CORP	71.293	1,368	184,805
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7.367	79	10,761
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	25.532	690	93,277
WHITESTONE REIT	5.635	60	8,102
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	27.151	1,174	158,612
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14.352	186	25,131
PARK HOTELS & RESORTS INC	27.34	419	56,622
INVITATION HOMES INC	68.994	2,320	313,259
JBG SMITH PROPERTIES	13.198	305	41,250
ALEXANDER & BALDWIN INC	8.385	152	20,614

先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 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
CLIPPER REALTY INC	1.647	12	1,681
GLADSTONE LAND CORP	3.8	83	11,312
AMERICOLD REALTY TRUST	30.842	892	120,505
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7.984	110	14,972
VICI PROPERTIES INC	97.469	2,741	370,170
BRT APARTMENTS CORP	1.402	29	3,920
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3.145	359	48,524
SAFEHOLD INC	1.726	59	8,053
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	15.076	102	13,779
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	14.055	282	38,103
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4.224	75	10,179
STORE CAPITAL CORP	28.372	703	94,958
CREATIVE MEDIA AND COMMUNITY TRUST	1.854	12	1,739
BROADSTONE NET LEASE INC	18.644	360	48,605
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	12.994	97	13,174
LIFE STORAGE INC	9.483	971	131,128
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6.088	175	23,671
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	25.513	536	72,369
PARAMOUNT GROUP INC	18.985	138	18,659
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	16.35	109	14,767
NETSTREIT CORP	4.837	90	12,277
APARTMENT INCOME REIT CO	18.149	715	96,639
CTO REALTY GROWTH INC	0.728	41	5,653
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	18.528	1,073	144,909
STAG INDUSTRIAL INC	20.373	619	83,644
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1.311	22	3,090
INDUS REALTY TRUST INC	0.807	46	6,289
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2.085	29	4,031
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	13.116	419	56,683
ORION OFFICE REIT INC	6.912	80	10,815
VENTAS INC	46.15	2,235	301,753
CARETRUST REIT INC	11.218	187	25,277
INVENTRUST PROPERTIES CORP	7.776	202	27,295
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	34.434	686	92,746
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5.911	114	15,482
SABRA HEALTH CARE REIT INC	26.438	347	46,901
UMH PROPERTIES INC	5.564	94	12,762
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3.127	75	10,153
IRON MOUNTAIN INC	33.475	1,582	213,680
TERRENO REALTY CORP	8.728	478	64,668
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	14.764	534	72,216
SUN COMMUNITIES INC	13.407	2,024	273,394
ACADIA REALTY TRUST	10.226	164	22,214
ALEXANDER'S INC	0.262	56	7,675
PROLOGIS INC	85.553	9,467	1,278,179
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16.827	2,277	307,535
BRANDYWINE REALTY TRUST	19.784	188	25,401

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 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
SAUL CENTERS INC	1.591	67	9,141
VERIS RESIDENTIAL INC	9.253	130	17,564
CAMDEN PROPERTY TRUST	11.815	1,488	200,988
COUSINS PROPERTIES INC	17.19	507	68,557
SITE CENTERS CORP	20.756	260	35,140
DUKE REALTY CORP	44.031	2,254	304,364
EASTGROUP PROPERTIES INC	4.704	715	96,647
ESSEX PROPERTY TRUST INC	7.543	1,932	260,919
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	15.063	706	95,378
FEDERAL REALTY INVS TRUST	8.18	778	105,092
GETTY REALTY CORP	4.815	121	16,349
WELLTOWER INC	50.323	3,897	526,203
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	62.35	1,461	197,314
HIGHWOODS PROPERTIES INC	12.127	407	55,077
SERVICE PROPERTIES TRUST	19.087	106	14,353
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	17.058	424	57,344
EQUITY COMMONWEALTH	13.075	356	48,191
KILROY REALTY CORP	12.144	602	81,289
LTC PROPERTIES INC	4.552	162	21,939
LXP INDUSTRIAL TRUST	32.697	334	45,203
MID-AMERICA APARTMENT COMM	13.334	2,133	288,089
MACERICH CO/THE	24.63	228	30,792
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19.96	1,370	185,051
NATL HEALTH INVESTORS INC	5.301	299	40,422
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	20.305	804	108,640
REALTY INCOME CORP	65.408	4,106	554,481
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	12.986	333	45,023
PENN REAL ESTATE INVEST TST	7.636	2	298
PUBLIC STORAGE	17.638	5,253	709,248
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2.325	432	58,366
REGENCY CENTERS CORP	17.815	1,008	136,134
RPT REALTY	10.289	99	13,391
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	12.022	174	23,615
SL GREEN REALTY CORP	7.411	364	49,167
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	29.173	53	7,247
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3.682	58	7,918
UDR INC	34.575	1,463	197,548
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.565	77	10,515
WP CAREY INC	22.036	1,784	240,892
WASHINGTON REIT	9.785	216	29,182
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4.132	23	3,218
AGREE REALTY CORP	8.241	552	74,545
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	27.628	764	103,173
CUBESMART	25.297	983	132,754
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	25.358	262	35,399
DIGITAL REALTY TRUST INC	32.809	4,087	551,788
CEDAR REALTY TRUST INC	1.501	37	5,064



先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

銘柄		2022年6月15日現在		
		□ 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
EXTRA SPACE STORAGE INC		15.48	2,457	331,759
HERSHA HOSPITALITY TRUST		4.032	40	5,454
CENTERSPACE		1.734	133	18,059
KITE REALTY GROUP TRUST		25.32	440	59,481
ONE LIBERTY PROPERTIES INC		1.965	50	6,767
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES		16.088	1,036	139,922
GLADSTONE COMMERCIAL CORP		4.549	82	11,165
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO		24.35	216	29,192
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		68.999	1,030	139,174
FRANKLIN STREET PROPERTIES C		11.605	46	6,267
DOUGLAS EMMETT INC		20.288	459	62,095
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,922.589 149銘柄	113,621	15,340,028 <74.6%>
<b>(カナダ)</b>		千口	千カナダ・ドル	千円
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN		2	14	1,475
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T		4.6	16	1,754
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I		5.6	22	2,316
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS		3.6	36	3,833
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN		5.725	73	7,629
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		7.1	85	8,922
SLATE GROCERY REIT		3.6	51	5,326
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		6.7	113	11,847
SLATE OFFICE REIT		4.9	22	2,384
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		2.5	38	4,011
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		13	158	16,499
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI		11	185	19,370
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E		5.5	33	3,478
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E		2.4	31	3,261
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		4	316	33,014
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		14.6	178	18,636
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		8.1	99	10,415
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		13	185	19,303
CHOICE PROPERTIES REIT		19.8	271	28,244
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		2.4	40	4,251
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		6.2	98	10,284
PLAZA RETAIL REIT		6.3	27	2,822
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		8.8	239	24,913
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		10.5	463	48,337
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		17.1	216	22,575
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		18.7	376	39,185
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV		3	58	6,126
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		2.7	119	12,463
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		6.1	96	10,011
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		7.7	265	27,712
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	227.225 30銘柄	3,938	410,410 <2.0%>

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
<b>(オーストラリア)</b>	千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU	132.82	1,204	112,155
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	33.012	51	4,794
HOME CONSORTIUM LTD	21.693	98	9,189
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	46.291	38	3,555
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	39.378	123	11,474
CROMWELL PROPERTY GROUP	167.757	117	10,932
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	65.291	191	17,810
RURAL FUNDS GROUP	45.313	121	11,348
WAYPOINT REIT	87.433	196	18,315
CHARTER HALL LONG WALE REIT	75.404	327	30,467
CENTURIA OFFICE REIT	52.359	91	8,530
CENTURIA CAPITAL GROUP	75.235	145	13,553
IRONGATE GROUP	65.105	123	11,455
HOMECO DAILY NEEDS REIT	176.023	219	20,402
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	137.848	365	34,009
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	34.802	121	11,275
NATIONAL STORAGE REIT	133.591	287	26,740
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	26.502	70	6,563
GDI PROPERTY GROUP	64.299	61	5,746
SCENTRE GROUP	640.95	1,634	152,164
ARENA REIT	41.056	159	14,830
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	22.847	73	6,806
BWP TRUST	58.372	214	19,998
GPT GROUP	236.551	984	91,615
CHARTER HALL RETAIL REIT	64.281	244	22,741
MIRVAC GROUP	486.873	998	92,922
STOCKLAND	294.787	1,061	98,800
ABACUS PROPERTY GROUP	45.39	122	11,409
GOODMAN GROUP	209.94	3,760	350,058
VICINITY CENTRES	477.829	833	77,627
CHARTER HALL GROUP	57.635	658	61,277
INGENIA COMMUNITIES GROUP	43.391	154	14,421
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,160.058 32銘柄	14,854 <6.7%>
<b>(香港)</b>	千口	千香港・ドル	千円
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	289	884	15,210
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	128	483	8,322
FORTUNE REIT	183	1,237	21,277
PROSPERITY REIT	156	413	7,110
LINK REIT	255.7	17,489	300,825
CHAMPION REIT	241	845	14,549
香港・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,252.7 6銘柄	21,354 <1.8%>
<b>(シンガポール)</b>	千口	千シンガポール・ドル	千円
KEPPEL DC REIT	163.3	315	30,555

先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千シンガポール・ドル	千円
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	153.8	43	4,249
AIMS APAC REIT	57.8	78	7,565
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	355.3	454	44,091
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	66.4	52	5,085
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	203.2	159	15,464
EC WORLD REIT	32.9	19	1,881
IREIT GLOBAL	64.5	39	3,814
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRUST	414.7	1,140	110,564
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	628.4	1,332	129,157
SUNTEC REIT	265.6	438	42,487
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	390.1	631	61,268
KEPPEL REIT	243	274	26,621
ASCOTT RESIDENCE TRUST	238.7	269	26,150
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	621.4	248	24,097
CDL HOSPITALITY TRUSTS	103.4	129	12,530
FRASERS CENTREPOINT TRUST	132.4	295	28,624
STARHILL GLOBAL REIT	166.8	95	9,217
CAPITALAND CHINA TRUST	133.9	151	14,669
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	45.9	220	21,360
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	236.7	572	55,534
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	267.2	470	45,592
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	124.3	79	7,712
SPH REIT	113	106	10,298
OUÉ COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	284.1	109	10,604
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,506.8 25銘柄	7,727 <3.6%>
	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	107.307	126	10,584
KIWI PROPERTY GROUP LTD	199.256	189	15,891
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	54.226	145	12,222
GOODMAN PROPERTY TRUST	132.996	266	22,385
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	164.981	219	18,420
ニュージーランド・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	658.766 5銘柄	947 <0.4%>
	千口	千イギリス・ポンド	千円
(イギリス)			
ASSURA PLC	347.117	230	37,387
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	71.016	62	10,102
STANDARD LIFE INV PROP INC	51.354	40	6,630
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	100.969	81	13,249
PICTON PROPERTY INCOME LTD	64.471	61	9,903
REGIONAL REIT LTD	54.681	43	7,069
NEWRIVER REIT PLC	39.166	34	5,597
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES	101.897	151	24,528
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	73.284	58	9,521
CUSTODIAN REIT PLC	51.902	53	8,705
PRS REIT PLC/THE	64.664	69	11,202

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千□	千イギリス・ポンド	千円
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	45.413	55	8,987
LXI REIT PLC	109.114	155	25,239
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	46.825	40	6,630
AEW UK REIT PLC	20.041	24	3,933
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	94.111	108	17,555
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	117.956	149	24,204
HOME REIT PLC	66.127	75	12,206
LAND SECURITIES GROUP PLC	88.454	647	104,970
SEGRO PLC	141.566	1,351	219,254
HAMMERSON PLC	417.915	95	15,496
UNITE GROUP PLC/THE	46.99	497	80,719
BRITISH LAND CO PLC	110.429	559	90,745
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	29.888	185	30,058
DERWENT LONDON PLC	13.211	364	59,188
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	156.924	214	34,720
WORKSPACE GROUP PLC	16.231	106	17,297
SAFESTORE HOLDINGS PLC	24.82	251	40,864
SHAFTESBURY PLC	33.926	194	31,588
BIG YELLOW GROUP PLC	20.359	254	41,280
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	115.214	265	43,059
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	71.398	40	6,497
TRITAX BIG BOX REIT PLC	219.898	398	64,597
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	3,027,331 33銘柄	6,923 <5.5%>
		千□	千イスラエル・シェケル 千円
(イスラエル)			
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT REIT 1 LTD	26.7 25.897	243 458	9,494 17,850
イスラエル・シェケル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	52,597 2銘柄	702 <0.1%>
		千□	千韓国・ウォン 千円
(韓国)			
SK REITS LTD	7.476	50,238	5,254
D&D PLATFORM REIT LTD	6.865	35,698	3,734
JR GLOBAL	2.822	588	61
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	7.432	58,712	6,141
LOTTE REIT CO LTD	15.417	92,347	9,659
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	11.781	56,195	5,878
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	3.918	22,724	2,376
JR REIT XXVII	14.711	80,910	8,463
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5.393	33,868	3,542
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	18.659	116,991	12,237
韓国・ウォン通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	94,474 10銘柄	548,275 <0.3%>
		千□	千ユーロ 千円
ユーロ (アイルランド)			
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES HIBERNIA REIT PLC	53.167 76.097	68 121	9,686 17,121
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	129,264 2銘柄	190 <0.1%>

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

銘柄		2022年6月15日現在		
		□ 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
		千口	千ユーロ	千円
<b>ユーロ（オランダ）</b>				
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		4.541	101	14,245
WERELDHAVE NV		4.993	70	9,884
NSI NV		2.198	75	10,692
VASTNED RETAIL NV		2.242	50	7,055
国 小 計		13.974	297	41,877
		□ 数、金 額		
		銘柄 数 < 比 率 >		<0.2%>
<b>ユーロ（ベルギー）</b>				
AEDIFICA		4.175	396	55,786
COFINIMMO		3.389	381	53,729
BEFIMMO		2.813	132	18,615
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS		2.935	72	10,248
RETAIL ESTATES		1.308	80	11,289
WAREHOUSES DE PAUW SCA		16.147	496	69,932
CARE PROPERTY INVEST		3.339	77	10,883
XIOR STUDENT HOUSING NV		2.396	98	13,932
MONTEA NV		1.175	99	14,045
国 小 計		37.677	1,835	258,463
		□ 数、金 額		
		銘柄 数 < 比 率 >		<1.3%>
<b>ユーロ（フランス）</b>				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		13.386	716	100,834
ICADE		3.682	173	24,448
CARMILA		5.596	74	10,542
ALTAREA		0.528	66	9,411
GECINA SA		6.251	598	84,229
KLEPIERRE		22.429	422	59,433
COVIVIO		5.437	308	43,405
MERCIALYS		6.169	50	7,066
国 小 計		63.478	2,410	339,371
		□ 数、金 額		
		銘柄 数 < 比 率 >		<1.7%>
<b>ユーロ（ドイツ）</b>				
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		1.766	22	3,167
HAMBORNER REIT AG		8.773	72	10,240
国 小 計		10.539	95	13,407
		□ 数、金 額		
		銘柄 数 < 比 率 >		<0.1%>
<b>ユーロ（スペイン）</b>				
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		7.263	35	4,969
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		31.023	201	28,348
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		38.351	370	52,108
国 小 計		76.637	606	85,426
		□ 数、金 額		
		銘柄 数 < 比 率 >		<0.4%>
<b>ユーロ（イタリア）</b>				
COIMA RES SPA		2.686	26	3,728
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		6.703	23	3,317
国 小 計		9.389	50	7,046
		□ 数、金 額		
		銘柄 数 < 比 率 >		<0.0%>

銘柄		2022年6月15日現在		
		□ 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（その他） CROMWELL REIT EUR		38.3	77	10,947
国 小 計		38.3	77	10,947
		□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	1 銘柄	<0.1%>
ユ ー ロ 通 貨 計		379.258	5,563	783,349
		□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	31 銘柄	<3.8%>
合 計		18,281.798	—	20,320,475
		□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	323 銘柄	<98.8%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

### (3)先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別		2022年6月15日現在	
		買 建 額	売 建 額
		百万円	百万円
外	DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	379	—
国	STOXX 600 REAL (ドイツ)	95	—

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

(注2) 単位未満は切捨て。

# ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## 運用報告書 第17期（決算日 2021年11月30日）

（作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日）

ダイワ・グローバル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。

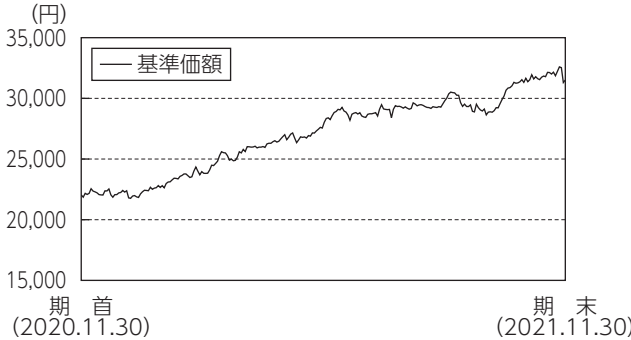
運用方針	S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

## 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/>

■ 当期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 先物比率	投資信託 証券比率	不動産 投信比率
	円	騰落率 (ベンチマーク)	円	騰落率			
(期首)2020年11月30日	22,044	-	25,605	-	0.5	97.0	2.5
12月末	22,276	1.1	25,887	1.1	0.7	97.1	2.2
2021年1月末	22,806	3.5	26,474	3.4	1.0	96.6	2.4
2月末	24,006	8.9	27,999	9.3	0.9	96.6	2.4
3月末	25,793	17.0	29,872	16.7	0.7	97.0	2.3
4月末	27,005	22.5	31,406	22.7	1.6	96.7	1.8
5月末	27,611	25.3	32,186	25.7	0.7	97.7	1.7
6月末	28,466	29.1	33,118	29.3	0.8	97.6	1.7
7月末	29,191	32.4	34,044	33.0	2.0	96.3	1.7
8月末	29,804	35.2	34,715	35.6	1.5	97.0	2.0
9月末	29,119	32.1	33,918	32.5	0.5	97.5	2.0
10月末	31,656	43.6	36,792	43.7	1.3	95.9	2.9
(期末)2021年11月30日	31,508	42.9	36,654	43.1	0.9	97.0	2.3

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) S & P先進国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：22,044円 期末：31,508円 騰落率：42.9%

【基準価額の主な変動要因】

米国を中心としたリート市況の上昇等を受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

◆ 投資環境について

○ 海外リート市況

海外リート市況は上昇しました。

海外リート市況は、当期中期首より、新型コロナウイルスのワクチン開発で高い効果を示す結果が報告され、経済活動正常化への期待が高まったことなどから、上昇しました。2021年に入っても、各国におけるワクチン接種の進展や渡航制限、行動規制の緩和などにより、上昇傾向が続きました。しかし9月に入ると、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念から世界的に市場心理が悪化したことに加えインフレの長期化が懸念されて長期金利が急上昇したことで、売られる展開となりました。10月以降は、好調な決算発表や米国長期金利の低下に加え、中国大手不動産会社に対する信用不安の後退などから、再度上昇に転じました。当期中期末にかけては、新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念から、不安定な相場展開となりました。

○ 為替相場

為替相場は上昇 (円安) しました。

対円為替相場は、当期中期首より、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展などで市場のリスク選好度が強まったことで、おおむね上昇しました。2021年に入っても、米国の追加経済対策への期待が高まったことや、世界的にワクチン接種が進み感染状況が改善基調にあったことなどから、おおむね円安傾向となりました。7月以降は、新型コロナウイルスの変異株の影響により世界的に感染が再拡大し、景気回復への不透明感が高まったことなどから、円高に転じました。しかし9月以降は、インフレ懸念から世界的に金利が上昇したことで日本との金利差拡大などが意識され、再度円安が進行しました。当期中期末にかけては、新たな変異株への懸念から、おおむね円高となりました。

◆ 前期中期末における「今後の運用方針」

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

また、運用の効率化を図るため、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

当期中期のベンチマークの騰落率は43.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は42.9%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。

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

\* ベンチマークはS & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) です。



# ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## 《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	4円
（先物・オプション）	( 1 )
（投資信託受益証券）	( 1 )
（投資信託証券）	( 2 )
有価証券取引税	3
（投資信託受益証券）	( 0 )
（投資信託証券）	( 3 )
その他費用	17
（保管費用）	( 7 )
（その他）	(10)
合計	23

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■ 売買および取引の状況

### (1) 投資信託受益証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	買 付		売 付	
	口数	金額	口数	金額
外 国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	716.6	70,733	700.15	69,035
	( - )	( - )	( - )	( - )

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は四捨五入。

## (2) 投資信託証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	買 付		売 付	
	口数	金額	口数	金額
外 国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	1,438.7	59,811	217.753	12,693
	(△ 249.81)	(△ 1,626)	( - )	( - )
カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
	119.6	2,136	15.2	327
	(△ 10.8)	(△ 198)	( - )	( - )
オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
	1,952.08	8,098	586.648	2,691
	( 4,741)	( 27)	( - )	( - )
香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	329.7	8,843	19	1,361
	( - )	( - )	( - )	( - )
シンガポール	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
	3,018.1	4,660	2,182.22	1,219
	( 891.885)	( 42)	( - )	( - )
ニュージーランド	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
	291.95	526	-	-
	( - )	( - )	( - )	( - )
イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
	1,536.61	3,619	128.23	616
	(△ 69.036)	(△ 65)	( - )	( - )
イスラエル	千口	千イスラエル・シケル	千口	千イスラエル・シケル
	20	349	-	-
	( - )	( - )	( - )	( - )
韓国	千口	千韓国ウォン	千口	千韓国ウォン
	93.93	577,802	-	-
	( 20,575)	( 34,813)	( - )	( - )
ユーロ (アイルランド)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	63	80	-	-
	( - )	( - )	( - )	( - )
ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	5.55	106	-	-
	( 0.457)	( - )	( - )	( - )
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	21.07	1,141	2.88	194
	( 0.68)	( 28)	( - )	( - )
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	37.9	1,661	9.98	613
	( 0.13)	( 17)	( - )	( - )
ユーロ (ドイツ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	16.94	226	2.6	46
	( - )	(△ 21)	( - )	( - )
ユーロ (スペイン)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	43.07	357	9.5	89
	( - )	(△ 37)	( - )	( - )
ユーロ (イタリア)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	12.19	62	-	-
	( - )	( - )	( - )	( - )
ユーロ (その他)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	70	54	-	-
	(△ 283.68)	( - )	( - )	( - )
ユーロ (ユーロ 通貨計)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	269.72	3,690	24.96	945
	(△ 282.413)	(△ 13)	( - )	( - )

(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) 金額の単位未満は四捨五入。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

種類別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 不動産投信指数先物取引	百万円 4,583	百万円 4,460	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当					期				
買			付		売			付	
銘柄	口数	金額	平均単価		銘柄	口数	金額	平均単価	
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 716.6	千円 7,762,024	円 10,831		VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 700.15	千円 7,590,754	円 10,841	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当					期				
買			付		売			付	
銘柄	口数	金額	平均単価		銘柄	口数	金額	平均単価	
PROLOGIS INC (アメリカ)	千口 36.6	千円 448,224	円 12,246		PROLOGIS INC (アメリカ)	千口 9.3	千円 126,652	円 13,618	
EQUINIX INC (アメリカ)	4.7	378,799	80,595		EQUINIX INC (アメリカ)	1.1	93,308	84,825	
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	16.8	259,246	15,431		GOODMAN GROUP (オーストラリア)	42.049	74,392	1,769	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT (アメリカ)	11.3	221,399	19,592		PUBLIC STORAGE (アメリカ)	2	65,114	32,557	
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	7.6	221,005	29,079		SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	4.4	61,403	13,955	
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	17.4	212,800	12,229		DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	3.6	59,690	16,580	
REALTY INCOME CORP (アメリカ)	28.2	199,312	7,067		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD (フランス)	6.46	56,998	8,823	
WELLTOWER INC (アメリカ)	21.1	172,105	8,156		UDR INC (アメリカ)	8.6	49,608	5,768	
GOODMAN GROUP (オーストラリア)	104.78	170,916	1,631		EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	5.7	49,572	8,696	
SUN COMMUNITIES INC (アメリカ)	9.5	167,703	17,653		AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	2	46,515	23,257	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国投資信託受益証券

銘柄	期首	当期		期末	
	口数	口数	評価額	評価額	評価額
(アメリカ) VANGUARD REAL ESTATE ETF	千口 17.5	千口 33.95	千アメリカ・ドル 3,693	千円 420,239	
合計	口数、金額 銘柄数<比率>	17.5 1銘柄	33.95 1銘柄	3,693 <0.9%>	420,239

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
MANULIFE US REAL ESTATE INV	320,562	364,562	258	29,448
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	151.4	193.4	152	17,382
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90	90	3	350
PRIME US REIT	99	147	121	13,797
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	29.5	33.2	714	81,246
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13.7	-	-	-
URBAN EDGE PROPERTIES	21,982	28,682	499	56,876
XENIA HOTELS & RESORTS INC	25.4	28.8	461	52,523
AVALONBAY COMMUNITIES INC	31.4	36	8,668	986,167
SIMON PROPERTY GROUP INC	71,847	84,847	13,570	1,543,907
BOSTON PROPERTIES INC	31.4	36.7	4,049	460,709
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	32,467	36,789	280	31,893
VORNADO REALTY TRUST	35,064	41,064	1,707	194,255
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	18	21.2	444	50,529
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13.9	21.1	1,307	148,761
NEXPOINT RESIDENTIAL	4.8	5.5	423	48,187
QTS REALTY TRUST INC-CL A	13.6	-	-	-
EQUITY RESIDENTIAL	76.5	88	7,587	863,213
APPLE HOSPITALITY REIT INC	43.8	54.8	843	95,950
EPR PROPERTIES	16.1	18.9	895	101,878
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.5	7.1	106	12,164
CITY OFFICE REIT INC	9.3	10.9	184	20,945
GLOBAL NET LEASE INC	19,833	25,933	374	42,603
EQUINIX INC	19.6	23.2	19,024	2,164,360
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	15,529	19,829	539	61,361
CHATHAM LODGING TRUST	7.4	10.8	133	15,137
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	7.1	8.8	129	14,697
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	12.3	14.2	1,153	131,213
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	25.7	31.4	558	63,516
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4.9	6	261	29,700
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	-	13.1	60	6,900
HOST HOTELS & RESORTS INC	157.6	184.3	3,026	344,291
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	59,008	70,708	2,874	327,006
CORESITE REALTY CORP	9.5	11.4	1,953	222,263
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	34.1	39.4	973	110,718
RLJ LODGING TRUST	35,871	41,871	540	61,498
FARMLAND PARTNERS INC	2.9	6.7	78	8,987
PHYSICIANS REALTY TRUST	46.1	56.1	1,015	115,587
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	14	15.7	224	25,506
CYRUSONE INC	25.9	32	2,860	325,400
KIMCO REALTY CORP	94.4	158,362	3,686	419,432
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9.8	15.6	256	29,142
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	48,85	56,55	1,923	218,874
WHITESTONE REIT	8.5	11.2	106	12,066
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	46,349	57,437	2,629	299,154
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	27.2	32.3	575	65,447
PARK HOTELS & RESORTS INC	51.68	61.08	1,097	124,874
DIGITALBRIDGE GROUP INC	105,011	126,711	1,046	119,075
INVITATION HOMES INC	125,297	148,797	6,140	698,644
JBG SMITH PROPERTIES	25,132	29,932	857	97,597
ALEXANDER & BALDWIN INC	16.5	18.7	417	47,507
CLIPPER REALTY INC	1.4	1.4	12	1,427

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
GLADSTONE LAND CORP	4.5	6.4	183	20,889
AMERICOLD REALTY TRUST	45.1	67.4	2,183	248,446
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	14.3	16.9	376	42,818
VICI PROPERTIES INC	118.2	157.4	4,427	503,735
RETAIL VALUE INC	2,815	4.49	27	3,075
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12.5	-	-	-
BRT APARTMENTS CORP	1.3	2.9	54	6,222
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10.1	-	-	-
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4.9	6.1	1,619	184,290
SAFEHOLD INC	3.2	3.3	233	26,599
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29.96	-	-	-
AMERICAN FINANCE TRUST INC	22.4	29.6	239	27,243
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	22.9	30.5	834	94,973
CORECIVIC INC	25,224	-	-	-
COREPOINT LODGING INC	6.7	10.7	165	18,832
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3.4	7.4	225	25,661
STORE CAPITAL CORP	50.5	63.1	2,128	242,215
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2.4	5.9	41	4,752
BROADSTONE NET LEASE INC	-	41	1,042	118,573
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	22.4	25.3	231	26,337
LIFE STORAGE INC	10.4	20.25	2,708	308,138
AMERICAN ASSETS TRUST INC	10.1	13.2	464	52,892
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	20,082	26,582	664	75,545
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	9.2	12.2	165	18,835
PARAMOUNT GROUP INC	36.4	40.2	332	37,869
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29.2	36.5	346	39,366
NETSTREIT CORP	-	9.9	216	24,655
APARTMENT INCOME REIT CO	-	40,489	2,100	238,935
CTO REALTY GROWTH INC	-	1.2	66	7,605
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	27.4	35.6	2,527	287,565
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	23.7	29.7	568	64,639
STAG INDUSTRIAL INC	32.5	41.8	1,816	206,630
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	-	2.6	46	5,324
INDUS REALTY TRUST INC	-	1.91	81	9,324
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	-	3.2	56	6,411
ORION OFFICE REIT INC	-	14,223	264	30,097
VENTAS INC	83,379	101,629	4,992	567,941
CARETRUST REIT INC	21,503	24,503	494	56,255
GEO GROUP INC/THE	27.4	31.6	269	30,630
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	64.3	76.7	1,794	204,104
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	10.6	11.8	284	32,313
SABRA HEALTH CARE REIT INC	44,987	56,987	742	84,478
UMH PROPERTIES INC	8.6	10.6	245	27,966
IRON MOUNTAIN INC	63.8	74.7	3,500	398,245
TERRENO REALTY CORP	15.2	18.2	1,389	158,049
VEREIT INC	240,908	-	-	-
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22.32	30.72	1,406	160,071
SUN COMMUNITIES INC	21.8	29.9	5,882	669,289
ACADIA REALTY TRUST	17,011	22,811	487	55,433
ALEXANDER'S INC	0.4	0.5	129	14,760
PROLOGIS INC	163,619	190,919	29,264	3,329,372
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26.2	35.8	7,348	836,017
BRANDYWINE REALTY TRUST	38.3	43.3	578	65,814
SAUL CENTERS INC	2.4	3.2	160	18,316

銘柄	期首		期末	
	□数	□数	評価額	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
MACK-CALI REALTY CORP	20.2	20.1	343	39,081
CAMDEN PROPERTY TRUST	21.8	26	4,390	499,461
COUSINS PROPERTIES INC	32,906	38,406	1,480	168,486
SITE CENTERS CORP	31,878	46,278	722	82,240
DUKE REALTY CORP	82.1	97.7	5,808	660,806
EASTGROUP PROPERTIES INC	8.7	10.4	2,128	242,202
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,467	16,767	5,809	660,977
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	27.8	33.3	2,032	231,290
FEDERAL REALTY INVS TRUST	15.4	18.1	2,280	259,443
GETTY REALTY CORP	7,703	9,803	302	34,440
WELLTOWER INC	93.2	109.1	8,950	1,018,305
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	120.3	139.2	4,741	539,400
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23.1	26.9	1,182	134,505
SERVICE PROPERTIES TRUST	36.5	41.7	372	42,413
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30.1	37.6	1,187	135,048
EQUITY COMMONWEALTH	27,375	31,475	804	91,563
KILROY REALTY CORP	23.2	27.1	1,762	200,560
LTC PROPERTIES INC	8.4	9.6	306	34,851
LEXINGTON REALTY TRUST	60	70.1	1,055	120,027
MID-AMERICA APARTMENT COMM	25,328	29,928	6,284	715,030
MACERICH CO/THE	21,979	54,979	1,089	123,910
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	37.5	44.1	3,740	425,563
NATL HEALTH INVESTORS INC	9.6	11.9	622	70,793
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	38.4	45.3	2,057	234,084
REALTY INCOME CORP	77,117	142,239	9,928	1,129,540
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	24	28.5	731	83,233
PENN REAL ESTATE INVEST TST	-	17	20	2,359
PUBLIC STORAGE	33.8	39.4	13,076	1,487,709
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4.3	5.1	892	101,586
REGENCY CENTERS CORP	34,92	39,52	2,796	318,150
RPT REALTY	17.8	21.1	276	31,471
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17.6	26.3	532	60,620
SL GREEN REALTY CORP	16.4	17,357	1,222	139,118
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	49	57,5	162	18,513
TAUBMAN CENTERS INC	13.3	-	-	-
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6	7.6	144	16,462
UDR INC	65.3	72	4,137	470,762
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2.6	3.1	173	19,753
WP CAREY INC	38.5	47.6	3,748	426,466
WASHINGTON REIT	17.8	21.6	553	62,934
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	25.9	-	-	-
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	-	7	78	8,903
AGREE REALTY CORP	11.7	17.8	1,236	140,684
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50,748	61,648	1,711	194,700
CUBESMART	43.3	52.1	2,862	325,711
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45,526	56,326	636	72,412
DIGITAL REALTY TRUST INC	59,778	72,978	12,317	1,401,413
CEDAR REALTY TRUST INC	-	3.1	68	7,783
EXTRA SPACE STORAGE INC	28.6	34.5	7,005	796,984
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,875	7,875	72	8,206
CENTERSPACE	2,46	3,66	377	42,930
KITE REALTY GROUP TRUST	18.95	55,741	1,133	128,925
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	21	24,9	517	58,838
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,233	3,633	120	13,726

銘柄	期首		期末	
	□数	□数	評価額	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
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	30.5	35.9	1,884	214,428
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6.3	8.8	193	22,025
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	42,342	54,342	498	56,693
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	117.1	153.8	3,305	376,028
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	2.1	2.1	124	14,167
DOUGLAS EMMETT INC	36.5	45.3	1,517	172,651
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	46.7	-	-	-
アメリカ・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	5,540,075 155銘柄	6,511,212 157銘柄	315,743 35,922,148 <73.9%>
<b>(カナダ)</b>	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
INOVALS REAL ESTATE INVESTMENT UN	-	4.2	39	3,557
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	-	9.4	38	3,431
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	-	11.4	50	4,477
NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT UNITS	-	4.3	52	4,694
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13.1	17.1	197	17,614
SLATE GROCERY REIT	8.1	7	93	8,335
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10.2	14.7	337	30,126
SLATE OFFICE REIT	5.1	5.1	25	2,262
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4.2	4.2	93	8,311
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	19.7	28	382	34,115
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	17.6	22.2	514	45,952
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11.2	11.2	81	7,277
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	8.5	-	-	-
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4.1	4.1	55	4,940
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6.2	8.5	858	76,622
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	18.3	27	452	40,416
INTERENT REAL ESTATE INVEST	16.2	17.5	298	26,617
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	24.7	27.6	508	45,379
CHOICE PROPERTIES REIT	36.8	43.2	628	56,143
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4.2	4.2	75	6,718
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11.9	14.1	244	21,785
PLAZA RETAIL REIT	11.1	11.1	51	4,587
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	16.3	19.1	592	52,850
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	19.5	22.8	1,332	118,973
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21.79	21.79	252	22,522
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	32,566	38,166	620	55,358
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	34.3	42	929	82,926
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5.4	7.2	162	14,460
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4.7	5.9	325	29,033
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9.5	12.3	216	19,355
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13.3	16.8	723	64,541
カナダ・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	388,556 27銘柄	482,156 30銘柄	10,232 913,388 <1.9%>
<b>(オーストラリア)</b>	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU	-	284,343	3,085	250,789
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	78.38	93.38	344	28,010
CROMWELL PROPERTY GROUP	435,284	371,284	317	25,805
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	95.11	144.87	533	43,337
AVENTUS GROUP	88	103	342	27,881
RURAL FUNDS GROUP	78,595	108,595	321	26,129
WAYPOINT REIT	177.83	202,491	532	43,291
CHARTER HALL LONG WALE REIT	98.668	149,458	720	58,560
CENTURIA OFFICE REIT	84.95	118.83	263	21,444
CENTURIA CAPITAL GROUP	97.59	166.05	524	42,654

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末	
	□数	□数	評価額	価額
	千口	千口	オーストラリア・ドル	千円
IRONGATE GROUP	119.63	149.63	235	19,157
HOME CONSORTIUM	35	48	363	29,537
HOMECO DAILY NEEDS REIT	17.5	130.34	183	14,939
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	241.86	291.52	816	66,353
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	70.547	79.167	323	26,256
NATIONAL STORAGE REIT	206.195	288.195	708	57,631
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	29.76	54.67	179	14,576
GDI PROPERTY GROUP	123.31	123.31	135	10,976
SCENTRE GROUP	1,194.91	1,372.159	4,171	339,090
ARENA REIT	79.89	93.89	415	33,811
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38.3	47.12	160	13,023
BWP TRUST	105.55	123.87	510	41,485
DEXUS	251.73	-	-	-
GPT GROUP	444	506.413	2,628	213,653
CHARTER HALL RETAIL REIT	120.4	139.51	574	46,723
MIRVAC GROUP	908.06	1,042.307	3,022	245,714
STOCKLAND	550.01	631.087	2,745	223,159
ABACUS PROPERTY GROUP	81.12	107.93	385	31,321
GOODMAN GROUP	381.71	444.441	10,911	886,957
VICINITY CENTRES	878.9	1,022.946	1,733	140,948
CHARTER HALL GROUP	105.06	123.136	2,335	189,884
INGENIA COMMUNITIES GROUP	68.66	94.74	582	47,363
オーストラリア・ドル 通貨計	7,286.509 31銘柄	8,656.682 31銘柄	40,109	3,260,470 < 6.7% >
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT	349	398	1,337	19,510
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193	250	1,135	16,559
FORTUNE REIT	311	378	3,046	44,451
PROSPERITY REIT	300	300	930	13,568
LINK REIT	476.9	564.6	38,788	565,917
CHAMPION REIT	431	481	1,972	28,772
香港ドル 通貨計	2,060.9 6銘柄	2,371.6 6銘柄	47,209	688,780 < 1.4% >
(シンガポール)	千口	千口	シンガポール・ドル	千円
KEPPEL DC REIT	293.783	331.683	786	65,410
FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	126.2	419.876	123	10,306
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	455	583.9	589	49,072
AIMS APAC REIT	89	119	166	13,862
FRASERS HOSPITALITY TRUST	121.8	-	-	-
FRASERS LOGISTICS & COMMERC	591.19	783.99	1,160	96,548
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86	134	119	9,923
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	208.9	208.9	181	15,122
EC WORLD REIT	57	57	46	3,889
IREIT GLOBAL	105.124	175.124	111	9,253
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	722.377	905.877	2,708	225,380
CAPITALAND INTEGRATED COMMERC	1,029.422	1,346.522	2,881	239,774
SUNTEC REIT	473.4	565.4	853	71,040
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	608.2	770.8	1,472	122,504
KEPPEL REIT	375.4	501.4	556	46,310
ASCOTT RESIDENCE TRUST	417.456	505.456	505	42,058
ESR-REIT	559.902	709.902	340	28,354
CDL HOSPITALITY TRUSTS	161.6	191.6	216	18,015
FRASERS CENTREPOINT TRUST	211.776	281.176	649	54,046
STARHILL GLOBAL REIT	308.8	383.8	247	20,598

銘柄	期首		期末	
	□数	□数	評価額	価額
	千口	千口	シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND CHINA TRUST	179.396	269.442	320	26,680
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	86.3	98.3	491	40,897
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	467.2	-	-	-
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	384.78	513.769	1,376	114,571
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	244.5	354.5	317	26,400
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	498.484	579.884	1,211	100,846
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182.1	248.1	145	12,076
SPH REIT	220.6	275.6	278	23,162
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	202.1	-	-	-
SABANA INDUSTRIAL REIT TRUST	219.4	-	-	-
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	541.063	651.063	289	24,107
(非上場)				
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	10.046	-	-	-
シンガポール・ドル 通貨計	10,238.299 32銘柄	11,966.064 27銘柄	18,149	1,510,218 < 3.1% >
(ニュージーランド)	千口	千口	ニュージーランド・ドル	千円
ARGOSY PROPERTY LTD	158.52	224.47	317	24,625
KIVI PROPERTY GROUP LTD	357.92	423.8	483	37,457
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	76.8	102.92	293	22,781
GOODMAN PROPERTY TRUST	248.22	299.22	725	56,256
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	245.82	328.82	506	39,259
ニュージーランド・ドル 通貨計	1,087.28 5銘柄	1,379.23 5銘柄	2,326	180,380 < 0.4% >
(イギリス)	千口	千口	イギリス・ポンド	千円
ASSURA PLC	594.52	707.1	483	73,249
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	129.57	159.57	129	19,613
STANDARD LIFE INV PROP INC	100	100	74	11,276
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	177.71	220.71	168	25,589
PICTON PROPERTY INCOME LTD	121.11	146.11	145	22,011
REGIONAL REIT LTD	81.31	111.31	100	15,166
NEWWRIVER REIT PLC	69.33	69.33	61	9,288
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	183.29	224.81	374	56,696
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	135.49	155.49	143	21,680
CUSTODIAN REIT PLC	89.42	109.42	106	16,086
GCP STUDENT LIVING PLC	96.86	112.86	237	36,006
PRS REIT PLC/THE	-	119.64	123	18,676
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	67.9	90.9	107	16,366
LXI REIT PLC	118.038	180.188	269	40,800
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	75.2	98.2	93	14,124
AEW UK REIT PLC	25.61	49.61	55	8,451
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	180	201.12	206	31,274
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	150	207	251	38,118
HOME REIT PLC	-	60	70	10,684
RDI REIT PLC	41.036	-	-	-
LAND SECURITIES GROUP PLC	166.381	198.461	1,490	225,891
SEGRO PLC	263.74	317.05	4,494	681,138
HAMMERSON PLC	811.984	1,076.984	332	50,453
UNITE GROUP PLC/THE	87.26	105.39	1,143	173,306
BRITISH LAND CO PLC	208.52	247.76	1,291	195,788
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	53.581	67.061	483	73,280
DERWENT LONDON PLC	24.39	29.63	1,014	153,807
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	283.37	346.37	519	78,796
WORKSPACE GROUP PLC	26.46	32.26	263	39,896
SAFESTORE HOLDINGS PLC	46.35	54.57	731	110,826

銘柄	期首		当期		期末	
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	評価額	評価額
	千口	千口	千円	千円	千円	千円
SHAFTESBURY PLC	53.85	75.77	484	73,495		
BIG YELLOW GROUP PLC	36.96	45.64	739	112,058		
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	203.15	237.15	645	97,763		
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121.6	121.6	63	9,657		
TRITAX BIG BOX REIT PLC	370.26	454.53	1,088	164,919		
イギリス・ポンド 通貨計	□数、金額 5,194.25 銘柄数<比率>	□数、金額 6,533.594 34銘柄	17,987	2,726,240	< 5.6%>	
(イスラエル) REIT 1 LTD	千口 28.84	千口 48.84	千イスラエル・シヤゲル 1,050	千円 37,813		
イスラエル・シヤゲル 通貨計	□数、金額 28.84 銘柄数<比率>	□数、金額 48.84 1銘柄	1,050	37,813	< 0.1%>	
(韓国) ESR KENDALL SQUARE REIT LTD	千口 -	千口 13.16	千韓国ウォン 987	千円 94		
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6	11.44	91,520	8,767		
LOTTE REIT CO LTD	17.96	34.375	192,500	18,441		
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	17.96	25.06	122,418	11,727		
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	-	5.6	32,704	3,133		
JR REIT XXVII	-	31.29	168,340	16,126		
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	-	8.5	55,760	5,341		
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	-	27	175,500	16,812		
韓国ウォン 通貨計	□数、金額 41.92 銘柄数<比率>	□数、金額 156.425 8銘柄	839,729	80,446	< 0.2%>	
ユーロ (アイルランド) IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	千口 82.05	千口 102.05	千ユーロ 156	千円 20,075		
HIBERNIA REIT PLC	116.24	159.24	207	26,582		
国小計	□数、金額 198.29 銘柄数<比率>	□数、金額 261.29 2銘柄	363	46,658	< 0.1%>	
ユーロ (オランダ) EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	千口 -	千口 9.887	千ユーロ 176	千円 22,725		
WERELDHAVE NV	6.47	8.97	107	13,833		
EUROCOMMERCIAL PROPRIETIE-CV	8.23	-	-	-		
NSI NV	3.231	4.131	141	18,115		
VASTNED RETAIL NV	3.75	4.7	105	13,609		
国小計	□数、金額 21.681 銘柄数<比率>	□数、金額 27.688 4銘柄	531	68,284	< 0.1%>	
ユーロ (ベルギー) AEDIFICA	千口 6.256	千口 8.886	千ユーロ 1,060	千円 136,127		
COFINIMMO	5.3	6.88	961	123,419		
BEFINIMMO	5.07	5.86	186	23,891		
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	4.61	5.48	148	19,034		
RETAIL ESTATES	1.94	2.54	175	22,537		
WAREHOUSES DE PAUW SCA	25.48	34.45	1,420	182,345		
CARE PROPERTY INVEST	4.9	6.1	156	20,052		
XIOR STUDENT HOUSING NV	2.7	4.58	224	28,817		
MONTEA NV	2.15	2.5	320	41,091		
国小計	□数、金額 58.406 銘柄数<比率>	□数、金額 77.276 9銘柄	4,651	597,318	< 1.2%>	
ユーロ (フランス) ALTAREA RIGHTS	千口 -	千口 0.01	千ユーロ 0	千円 2		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	26.77	28.68	1,720	220,967		
ICADE	5.94	7.67	488	62,689		
CARMILA	10	11.8	151	19,455		

銘柄	期首		当期		期末	
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	評価額	評価額
	千口	千口	千ユーロ	千円	千円	千円
ALTAREA	0.74	1.01	162	20,880		
GECINA SA	10.521	13.391	1,598	205,226		
KLEPIERRE	39.94	48.64	926	119,014		
COVIVIO	8.992	11.652	854	109,763		
MERCIALYS	4.03	12.13	102	13,138		
国小計	□数、金額 106.933 銘柄数<比率>	□数、金額 134.983 9銘柄	6,005	771,140	< 1.6%>	
ユーロ (ドイツ) ALSTRIA OFFICE REIT-AG	千口 34.82	千口 43.86	千ユーロ 853	千円 109,656		
HAMBORNER REIT AG	11.98	17.28	163	21,050		
国小計	□数、金額 46.8 銘柄数<比率>	□数、金額 61.14 2銘柄	1,017	130,707	< 0.3%>	
ユーロ (スペイン) LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	千口 10.53	千口 14.53	千ユーロ 68	千円 8,853		
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	50.033	63.533	522	67,101		
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	66.1	82.17	815	104,775		
国小計	□数、金額 126.663 銘柄数<比率>	□数、金額 160.233 3銘柄	1,407	180,730	< 0.4%>	
ユーロ (イタリア) COIMA RES SPA	千口 -	千口 5.19	千ユーロ 37	千円 4,818		
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6.24	13.24	46	5,993		
国小計	□数、金額 6.24 銘柄数<比率>	□数、金額 18.43 2銘柄	84	10,811	< 0.0%>	
ユーロ (その他) CROMWELL REIT EUR	千口 294.6	千口 80.92	千ユーロ 204	千円 26,289		
国小計	□数、金額 294.6 銘柄数<比率>	□数、金額 80.92 1銘柄	204	26,289	< 0.1%>	
ユーロ通貨計	□数、金額 859.613 銘柄数<比率>	□数、金額 821.96 30銘柄	14,266	1,831,939	< 3.8%>	
合計	□数、金額 32,726.242 銘柄数<比率>	□数、金額 38,927.763 331銘柄	-	47,151,826	< 97.0%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

### (3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄	別	当 期		末	
		買 建 額	売 建 額	買 建 額	売 建 額
外	DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	百万円 892		百万円 -	
国	STOXX 600 REAL (ドイツ)	210		-	

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

(注2) 単位未満は切捨て。



# ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

## ■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項目	当期		期末
	評価額	比率	
	千円	%	
投資信託受益証券	420,239	0.9	
投資信託証券	47,151,826	96.7	
コール・ローン等、その他	1,208,291	2.4	
投資信託財産総額	48,780,356	100.0	

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1香港ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.21円、1ニュージーランド・ドル=77.53円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シユケル=36.011円、100韓国ウォン=9.58円、1ユーロ=128.41円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(48,020,659千円)の投資信託財産総額(48,780,356千円)に対する比率は、98.4%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項目	当	期	末
(A) 資産	49,434,462,118円		
コール・ローン等	751,562,447		
投資信託受益証券(評価額)	420,239,075		
投資信託証券(評価額)	47,151,826,564		
未収入金	668,763,396		
未収配当金	56,716,807		
差入委託証拠金	385,353,829		
(B) 負債	805,521,183		
未払金	803,305,110		
未払株式払込金	2,215,073		
未払解約金	1,000		
(C) 純資産総額(A-B)	48,628,940,935		
元本	15,433,680,362		
次期繰越損益金	33,195,260,573		
(D) 受益権総口数	15,433,680,362口		
1万口当り基準価額(C/D)	31,508円		

\*期首における元本額は13,110,290,968円、当作成期間中における追加設定元本額は5,480,584,788円、同解約元本額は3,157,195,394円です。

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワファンドラップ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	6,291,808,323円
ダイワファンドラップ外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	1,162,934,430円
ダイワファンドラップオンライン外国REITインデックス(為替ヘッジあり)	333,980,799円
ダイワファンドラップオンライン外国REITインデックス(為替ヘッジなし)	289,623,388円
D-1's グローバルREITインデックス	2,223,608円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	8,326,903円
iFree 外国REITインデックス	632,249,938円
iFree 8資産バランス	1,462,352,614円
グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)	236,948,723円
グローバル・リート・インデックスファンド(毎月決算型)	113,742,003円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド	3,300,676,766円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,106,352円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	5,186,807円
ダイワバランスファンド2020-07(適格機関投資家専用)	183,749,014円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	184,925,099円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT	243,151,995円
ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド	59,517,654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)	912,182,345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)	3,993,601円

\*当期末の計算口数当りの純資産額は31,508円です。

## ■損益の状況

当期 自2020年12月1日 至2021年11月30日

項目	当	期
(A) 配当等収益	1,170,369,078円	
受取配当金	1,166,078,286	
受取利息	273	
その他収益金	4,393,512	
支払利息	△ 102,993	
(B) 有価証券売買損益	12,530,341,971	
売買益	12,953,251,906	
売買損	△ 422,909,935	
(C) 先物取引等損益	199,972,869	
取引益	211,186,295	
取引損	△ 11,213,426	
(D) その他費用	△ 24,978,913	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	13,875,705,005	
(F) 前期繰越損益金	15,789,555,929	
(G) 解約差損益金	△ 5,533,781,623	
(H) 追加信託差損益金	9,063,781,262	
(I) 合計(E+F+G+H)	33,195,260,573	
次期繰越損益金(I)	33,195,260,573	

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

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

# 先進国REITマザーファンド

## 運用報告書 第9期 (決算日 2022年5月9日)

(作成対象期間 2021年5月11日～2022年5月9日)

先進国REITマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	イ. 先進国（日本を除きます。以下同じ。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。） ロ. 先進国のリート指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券） ハ. 先進国のリートを対象としたリート指数先物取引 ニ. 国内の債券
株式組入制限	無制限

## 大和アセットマネジメント

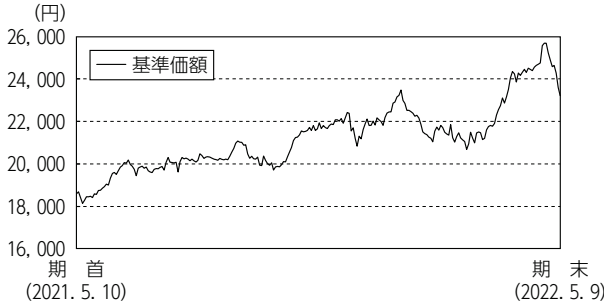
Daiwa Asset Management

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		S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、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	不動産投資 指数先物 比率
	円	%	参考指数	%	%	%	%
(期首)2021年5月10日	18,587	—	20,767	—	1.5	97.2	1.4
5月末	19,040	2.4	21,294	2.5	1.6	96.7	1.7
6月末	19,614	5.5	21,911	5.5	—	97.6	2.3
7月末	20,146	8.4	22,524	8.5	0.4	98.2	1.3
8月末	20,553	10.6	22,968	10.6	1.6	97.1	1.3
9月末	20,048	7.9	22,440	8.1	0.5	96.3	3.1
10月末	21,806	17.3	24,342	17.2	0.2	98.1	1.6
11月末	21,703	16.8	24,250	16.8	0.4	97.1	1.1
12月末	23,160	24.6	25,886	24.7	0.8	97.1	1.5
2022年1月末	21,543	15.9	24,031	15.7	0.8	97.6	1.7
2月末	21,496	15.7	24,122	16.2	0.3	97.9	1.2
3月末	24,250	30.5	27,011	30.1	2.7	93.2	2.9
4月末	24,647	32.6	27,408	32.0	0.4	96.5	2.0
(期末)2022年5月9日	23,218	24.9	25,851	24.5	0.4	96.0	3.6

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円ベース) は、S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、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。S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円ベース) 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) 不動産投資指数先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：18,587円 期末：23,218円 騰落率：24.9%

【基準価額の主な変動要因】

日本を除く先進国リートにはほぼ100%投資した結果、参考指数 (S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円ベース)) の上昇に伴い、当ファンドの基準価額も上昇しました。くわしくは

「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は、当作成期を通じて上昇しました。

海外リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展により経済活動の正常化が順次進んだことや、好調な経済指標の発表などからおおむね上昇して始まりました。2021年9月に入ると、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念から世界的に市場心理が悪化したことに加え、世界的にインフレの長期化が懸念され、長期金利が急上昇したことで、各国で売られる展開となりました。10月については、好調な決算発表や米国長期金利の低下に加え、中国大手不動産会社に対する信用不安の後退などから上昇に転じたものの、11月からはオミクロン株への懸念などから下落に転じました。その後は年末にかけてオミクロン株への過度の懸念の後退などから上昇する局面もあったものの、2022年に入ると、2021年12月のFOMC (米国連邦公開市場委員会) 議事録を受け、米国の金融引き締めに対する懸念が高まり、米国を中心に再度下落に転じました。2月以降は、欧米中央銀行高官の金融政策に対する発言や、ロシアのウクライナへの侵攻、ロシアとウクライナの散発的な停戦協定による状況改善期待などから一進一退の展開となりましたが、4月に入ると米国の金融引き締めの加速懸念などからリスク回避の展開となり、リートも米国を中心に軟調に推移し、当作成期末を迎えました。

○為替相場

為替相場は、円安となりました。

対円為替相場は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種が進む中で世界経済への楽観的な見方が広がったことで市場のリスク嗜好度が強まり、おおむね円安となりました。2021年9月には、F R B (米国連邦準備制度理事会) による金融引き締め観測等から、米国で金利が上昇したことで、米ドル高が進行しました。その後も、インフレ懸念から世界的に金利が上昇したことで、日本との金利差拡大などが意識され、おおむね円安となりました。2022年3月以降は、ウクライナ情勢などを受けて資源価格が高騰したことや、米国で早期の金融政策正常化が意識されたことから米国金利が上昇した一方で、日銀は金融緩和姿勢を継続したことから、金融政策の相違が意識され、円安が進行しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

日本を除く先進国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、S & P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円ベース) を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉え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) および不動産投資指数先物取引を利用することがあります。

◆ポートフォリオについて

海外リートの組入比率 (ETF (上場投資信託証券) および不動産投資指数先物取引を含む) は、当作成期を通じて原則として99%台で運用を行いました。

海外リートポートフォリオにつきましては、S & P先進国REIT指数 (除く日本) 採用銘柄の中から流動性の高い海外リートを中心に通常50銘柄程度で組成し、結果として時価総額の大きい海外リートを主としたポートフォリオとなりました。なお、運用の効率化を図るため、ETF および不動産投資指数先物取引も利用しました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

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

## 《今後の運用方針》

日本を除く先進国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、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、E T F（上場投資信託証券）および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
売買委託手数料 (先物・オプション)	9円 (1)
(投資信託受益証券)	(1)
(投資信託証券)	(8)
有価証券取引税 (投資信託受益証券)	5 (0)
(投資信託証券)	(5)
その他費用 (保管費用)	15 (11)
(その他)	(3)
合 計	29

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■ 売買および取引の状況

## (1) 投資信託受益証券

(2021年5月11日から2022年5月9日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 29.499 ( — )	千アメリカ・ドル 3,138 ( — )	千口 34.028 ( — )	千アメリカ・ドル 3,668 ( — )

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

## (2) 投資信託証券

(2021年5月11日から2022年5月9日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 94.299 (△ 1.005)	千アメリカ・ドル 4,051 ( — )	千口 384.178 ( — )	千アメリカ・ドル 21,811 ( — )
	カナダ	千口 22.8 ( — )	千カナダ・ドル 345 ( — )	千口 74.3 ( — )	千カナダ・ドル 1,120 ( — )
	オーストラリア	千口 64.71 ( — )	千オーストラリア・ドル 434 ( — )	千口 560.66 ( — )	千オーストラリア・ドル 2,972 ( — )
	香港	千口 4 ( — )	千香港・ドル 269 ( — )	千口 50.3 ( — )	千香港・ドル 3,349 ( — )
	シンガポール	千口 98.2 ( — )	千シンガポール・ドル 269 (△ 6)	千口 555.9 ( — )	千シンガポール・ドル 1,288 ( — )
	イギリス	千口 67.86 ( — )	千イギリス・ポンド 429 ( — )	千口 347.87 ( — )	千イギリス・ポンド 1,480 ( — )
	ユーロ (ベルギー)	千口 0.48 ( — )	千ユーロ 61 ( — )	千口 1.67 ( — )	千ユーロ 209 ( — )
	ユーロ (フランス)	千口 4.75 ( — )	千ユーロ 544 ( — )	千口 9.4 ( — )	千ユーロ 790 ( — )
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千口 5.23 ( — )	千ユーロ 606 ( — )	千口 11.07 ( — )	千ユーロ 999 ( — )

(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

(2021年5月11日から2022年5月9日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
不動産投信指数 先物取引	455	469	—	—

(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

(2021年5月11日から2022年5月9日まで)

当 期				当 期			
買 付		金 額		売 付		金 額	
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	29.499	367,332	12,452	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	34.028	429,782	12,630

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2021年5月11日から2022年5月9日まで)

当 期				当 期			
買 付		金 額		売 付		金 額	
銘 柄	□ 数	金 額	平均単価	銘 柄	□ 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
GECINA SA (フランス)	4.02	64,760	16,109	PROLOGIS INC (アメリカ)	13.545	234,671	17,325
KIMCO REALTY CORP (アメリカ)	20.811	51,861	2,492	EQUINIX INC (アメリカ)	1.661	143,402	86,334
LAND SECURITIES GROUP PLC (イギリス)	45.06	48,594	1,078	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	2.996	121,242	40,468
GLADSTONE COMMERCIAL CORP (アメリカ)	16.4	40,095	2,444	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	7.356	115,148	15,653
PARK HOTELS & RESORTS INC (アメリカ)	16.742	36,419	2,175	REALTY INCOME CORP (アメリカ)	13.598	108,071	7,947
CHOICE PROPERTIES REIT (カナダ)	22.8	31,830	1,396	CHOICE PROPERTIES REIT (カナダ)	74.3	106,794	1,437
PROLOGIS INC (アメリカ)	1.601	31,552	19,707	SEGRO PLC (イギリス)	54.75	104,588	1,910
BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)	2.044	27,471	13,439	WELLTOWER INC (アメリカ)	9.267	95,085	10,260
REALTY INCOME CORP (アメリカ)	2.634	21,552	8,182	TRITAX BIG BOX REIT PLC (イギリス)	262.49	91,161	347
EQUINIX INC (アメリカ)	0.201	18,096	90,033	GOODMAN GROUP (オーストラリア)	46.28	88,979	1,922

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国投資信託受益証券

銘 柄	期 首	当 期 末		
	□ 数	□ 数	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
VANGUARD REAL ESTATE ETF	4.89	0.361	36	4,716
合 計	□ 数、金 額	□ 数、金 額	36	4,716
	銘柄数 < 比率 >	1銘柄	1銘柄	<0.4%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (2)外国投資信託証券

銘柄	期首		当期末	
	□数	□数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
<b>(アメリカ)</b>				
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3.59	1.055	224	29,309
SIMON PROPERTY GROUP INC	9.092	2.591	314	41,143
BOSTON PROPERTIES INC	4.878	1.932	230	30,097
VORNADO REALTY TRUST	10.555	3.175	115	15,060
EQUITY RESIDENTIAL	9.092	2.608	199	26,081
EQUINIX INC	2.068	0.608	433	56,728
HOST HOTELS & RESORTS INC	31.373	8.157	165	21,591
KIMCO REALTY CORP	—	6.626	158	20,788
GAMING AND LEISURE PROPRTIE	10.263	2.993	132	17,379
PARK HOTELS & RESORTS INC	—	5.457	105	13,766
INVITATION HOMES INC	16.74	5.033	191	25,005
VICI PROPERTIES INC	21.872	6.724	194	25,431
PARAMOUNT GROUP INC	57.225	—	—	—
STAG INDUSTRIAL INC	8.995	—	—	—
ORION OFFICE REIT INC	—	0.419	5	718
VENTAS INC	12.136	3.52	200	26,225
IRON MOUNTAIN INC	10.594	2.799	151	19,854
VEREIT INC	12.237	—	—	—
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	10.185	3.034	125	16,450
SUN COMMUNITIES INC	2.985	0.986	162	21,279
PROLOGIS INC	16.799	4.855	683	89,449
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3.122	0.917	162	21,188
CAMDEN PROPERTY TRUST	3.98	1.009	150	19,636
DUKE REALTY CORP	9.833	2.889	143	18,800
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.912	0.55	172	22,544
WELLTOWER INC	11.472	3.29	290	38,048
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	18.048	5.21	159	20,883
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3.649	1.032	190	24,907
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6.673	1.766	129	16,913
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	9.599	2.887	125	16,367
REALTY INCOME CORP	10.477	5.561	367	48,086
PUBLIC STORAGE	3.649	0.974	328	42,911
UDR INC	10.321	3.027	151	19,813
WP CAREY INC	7.024	1.931	150	19,649
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	10.399	3.785	107	14,033
DIGITAL REALTY TRUST INC	6.224	1.874	264	34,576
EXTRA SPACE STORAGE INC	4.039	1.083	196	25,729
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	—	5.346	109	14,290
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	23.706	7.417	136	17,867

銘柄	期首		当期末	
	□数	□数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
DOUGLAS EMMETT INC	13.775	4.577	133	17,490
アメリカ・ドル □数、金額	408.581	117.697	7,264	950,103
通貨計 銘柄数<比率>	36銘柄	37銘柄		<73.9%>
<b>(カナダ)</b>	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
CHOICE PROPERTIES REIT	78.8	27.3	409	41,364
カナダ・ドル □数、金額	78.8	27.3	409	41,364
通貨計 銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		<3.2%>
<b>(オーストラリア)</b>	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU	—	25.2	274	25,165
SCENTRE GROUP	236.71	68.09	192	17,607
DEXUS	70.5	—	—	—
MIRVAC GROUP	299.32	58.19	131	12,059
GOODMAN GROUP	57.5	16.6	341	31,357
オーストラリア・ドル □数、金額	664.03	168.08	939	86,189
通貨計 銘柄数<比率>	4銘柄	4銘柄		<6.7%>
<b>(香港)</b>	千口	千口	千香港・ドル	千円
LINK REIT	58.5	12.2	817	13,617
香港・ドル □数、金額	58.5	12.2	817	13,617
通貨計 銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		<1.1%>
<b>(シンガポール)</b>	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	171.929	66.229	186	17,514
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	465.988	113.988	255	24,029
シンガポール・ドル □数、金額	637.917	180.217	441	41,543
通貨計 銘柄数<比率>	2銘柄	2銘柄		<3.2%>
<b>(イギリス)</b>	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	—	14.43	103	16,609
SEGRO PLC	64.64	14.73	163	26,290
TRITAX BIG BOX REIT PLC	299.15	54.62	111	17,932
イギリス・ポンド □数、金額	363.79	83.78	377	60,832
通貨計 銘柄数<比率>	2銘柄	3銘柄		<4.7%>
<b>ユーロ (ベルギー)</b>	千口	千口	千ユーロ	千円
COFINIMMO	1.87	0.68	85	11,726
ユーロ □数、金額	1.87	0.68	85	11,726
国小計 銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		<0.9%>

# 先進国REITマザーファンド

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
			千ユーロ	千円
<b>ユーロ (フランス)</b>	千口	千口		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4.75	—	—	—
GECINA SA	1.83	1.93	200	27,625
<b>国小計</b>	口数、金額	6.58	1.93	200
	銘柄数<比率>	2銘柄	1銘柄	<2.1%>
<b>ユーロ通貨計</b>	口数、金額	8.45	2.61	285
	銘柄数<比率>	3銘柄	2銘柄	<3.1%>
<b>合計</b>	口数、金額	2,220,068	591,884	—
	銘柄数<比率>	49銘柄	50銘柄	<96.0%>

(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
	百万円	百万円
<b>外国</b>		
DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	45	—
STOXX 600 REAL (ドイツ)	1	—

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

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2022年5月9日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	4,716	0.4
投資信託証券	1,233,003	95.9
コール・ローン等、その他	48,618	3.7
投資信託財産総額	1,286,338	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、5月9日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=130.78円、1カナダ・ドル=101.08円、1オーストラリア・ドル=91.70円、1香港・ドル=16.66円、1シンガポール・ドル=94.11円、1イギリス・ポンド=160.94円、1ユーロ=137.63円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (1,263,682千円) の投資信託財産総額 (1,286,338千円) に対する比率は、98.2%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年5月9日現在

項目	当期末
<b>(A) 資産</b>	<b>1,307,554,423円</b>
コール・ローン等	24,199,757
投資信託受益証券 (評価額)	4,716,437
投資信託証券 (評価額)	1,233,003,471
未収入金	21,785,249
未収配当金	1,149,908
差入委託証拠金	22,699,601
<b>(B) 負債</b>	<b>22,660,179</b>
未払金	22,660,179
<b>(C) 純資産総額 (A - B)</b>	<b>1,284,894,244</b>
元本	553,405,183
次期繰越損益金	731,489,061
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>553,405,183口</b>
1万口当り基準価額 (C / D)	23,218円

\* 期首における元本額は1,891,797,737円、当作成期間中における追加設定元本額は467,774,649円、同解約元本額は1,806,167,203円です。

\* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：  
 ダイナミック・アロケーション・ファンド (適格機関投資家専用) 90,349,141円  
 先進国REITファンド (適格機関投資家専用) 366,779,337円  
 海外リート資金拠出用ファンド (適格機関投資家専用) 14,048,628円  
 リソナダイナミック・アロケーション・ファンド 3,335,740円  
 堅実バランスファンド-ハジメの一步 3,721,955円  
 DCダイナミック・アロケーション・ファンド 9,857,367円  
 グロウ外国3資産アロケーション・ファンド (部分為替ヘッジあり) 65,313,015円  
 \* 当期末の計算口数当りの純資産額は23,218円です。

## ■損益の状況

当期 自2021年5月11日 至2022年5月9日

項目	当期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>85,897,929円</b>
受取配当金	85,648,498
受取利息	209
その他収益金	256,605
支払利息	△ 7,383
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>501,340,717</b>
売買益	637,231,579
売買損	△ 135,890,862
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>6,965,035</b>
取引益	14,713,252
取引損	△ 7,748,217
<b>(D) その他費用</b>	<b>△ 2,029,641</b>
<b>(E) 当期損益金 (A + B + C + D)</b>	<b>592,174,040</b>
<b>(F) 前期繰越損益金</b>	<b>1,624,455,985</b>
<b>(G) 解約差損益金</b>	<b>△ 2,061,242,015</b>
<b>(H) 追加信託差損益金</b>	<b>576,101,051</b>
<b>(I) 合計 (E + F + G + H)</b>	<b>731,489,061</b>
次期繰越損益金 (I)	731,489,061

(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。

# ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用)

★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（設定日：2017年2月16日）	
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	イ. 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 ロ. 先進国REIT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
	先進国REITマザーファンド	イ. 先進国（日本を除きます。以下同じ。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。） ロ. 先進国のリート指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券） ハ. 先進国のリートを対象としたリート指数先物取引 ニ. 国内の債券
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 ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの投資信託証券組入上限比率 先進国REITマザーファンドの株式組入上限比率	無制限
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、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

## 運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、海外の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。

## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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



最近5期の運用実績

決算期	基準価額			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	(参考指数)	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2期末(2018年6月15日)	9,694	330	1.3	10,224	2.9	0.8	101.1	1.0	9
3期末(2019年6月17日)	10,304	310	9.5	11,335	10.9	0.6	101.1	1.0	518
4期末(2020年6月15日)	8,440	300	△ 15.2	9,708	△ 14.4	2.3	98.0	3.3	424
5期末(2021年6月15日)	11,716	170	40.8	13,774	41.9	0.9	98.7	1.7	1,290
6期末(2022年6月15日)	11,992	115	3.3	14,345	4.1	4.0	95.7	1.8	11

(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<sup>®</sup>およびS & P<sup>®</sup>はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones<sup>®</sup>はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P先進国REIT指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。



## 運用経過

### 基準価額等の推移について



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

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

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

#### 基準価額・騰落率

期首：11,716円

期末：11,992円（分配金115円）

騰落率：3.3%（分配金込み）

#### 基準価額の主な変動要因

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券を通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、リート市況は下落したものの、為替相場が上昇したことを受けて、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。



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）

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 組入比率	不動産投信 指 先 物 比 率
	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率				
(期首)2021年6月15日	円 11,716	% —	13,774	% —	% 0.9	% 98.7	% 1.7
6月末	11,398	△ 2.7	13,415	△ 2.6	0.8	97.6	1.7
7月末	11,684	△ 0.3	13,790	0.1	2.0	96.3	1.7
8月末	11,916	1.7	14,061	2.1	1.5	97.0	2.0
9月末	11,638	△ 0.7	13,739	△ 0.3	0.5	97.5	2.0
10月末	12,648	8.0	14,903	8.2	1.3	95.9	2.9
11月末	12,585	7.4	14,847	7.8	0.9	97.0	2.3
12月末	13,409	14.5	15,848	15.1	1.7	95.8	2.6
2022年1月末	12,445	6.2	14,712	6.8	1.5	95.8	2.7
2月末	12,439	6.2	14,768	7.2	0.7	96.5	2.7
3月末	13,978	19.3	16,537	20.1	0.9	96.9	2.1
4月末	14,196	21.2	16,780	21.8	—	98.6	1.5
5月末	13,115	11.9	15,511	12.6	2.0	96.2	1.8
(期末)2022年6月15日	12,107	3.3	14,345	4.1	4.0	95.7	1.8

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

（2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15）

## ■海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展により経済活動の正常化が順次進んだことや、好調な経済指標の発表などからおおむね上昇しました。しかし2021年9月に入ると、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念から世界的に市場心理が悪化したことに加え、世界的にインフレの長期化が懸念されて長期金利が急上昇したことで、売られる展開となりました。10月については、好調な決算発表や米国長期金利の低下に加え、中国の大手不動産会社に対する信用不安の後退などから上昇に転じたものの、11月からは新型コロナウイルスの新変異株であるオミクロン株への懸念などから下落に転じました。その後は、年末にかけてオミクロン株への過度の懸念の後退などから上昇する局面はあったものの、2022年に入ると、2021年12月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）議事録を受けて米国の金融引き締めに対する懸念が高まり、米国を中心に下落に転じました。2月以降は、欧米の中央銀行高官の金融政策に対する発言やロシアのウクライナへの侵攻、ロシアとウクライナの断片的な停戦協定による状況改善期待などから、一進一退の展開となりました。4月以降は、米国の金融引き締めの加速懸念などからリスク回避の展開となり、海外リート市場も米国を中心に軟調に推移し、当作成期末を迎えました。

## ■為替相場

為替相場は上昇しました。

為替相場は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大を受け、おおむね対円で下落（円高）しました。2021年9月からは、FRB（米国連邦準備制度理事会）による金融引き締め観測等から米国金利が上昇したことで、米ドル高が進行しました。その後も、インフレ懸念から世界的に金利が上昇したことで、日本との金利差拡大などが意識され、おおむね円安となりました。2022年3月以降は、ウクライナ情勢などを受けて資源価格が高騰したことや、米国で早期の金融政策正常化が意識されたことから米国金利が上昇した一方で、日銀は金融緩和姿勢を継続したことから金融政策の相違が意識され、円安が進行しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

主として「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。ただし、「先進国REITマザーファンド」の受益証券に投資する場合があります。

### ■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。

### ■先進国REITマザーファンド

日本を除く先進国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、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉え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および不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

## ポートフォリオについて

（2021.6.16～2022.6.15）

### ■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ100%行いました。

### ■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

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

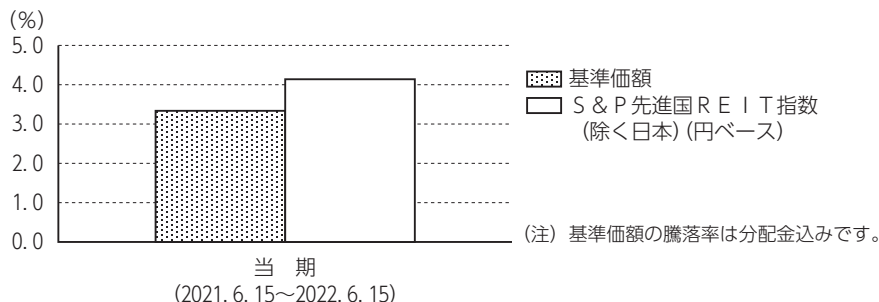
\* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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。

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。



## 分配金について

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### 分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
<b>当期分配金（税込み）</b>	<b>(円)</b>	<b>115</b>
対基準価額比率	(%)	0.95
当期の収益	(円)	115
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	2,221

(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。

### 収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 115.09円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	276.51
(c) 収益調整金	134.54
(d) 分配準備積立金	1,810.77
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,336.93
(f) 分配金	115.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,221.93

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 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。ただし、「先進国REITマザーファンド」の受益証券に投資する場合があります。

### ■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。

### ■先進国REITマザーファンド

日本を除く先進国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、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉え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）および不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2021. 6. 16～2022. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	54円	0.434%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12,506円です。
（投 信 会 社）	(38)	(0.302)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(14)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	1	0.010	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)	
（投資信託受益証券）	(0)	(0.003)	
（投資信託証券）	(1)	(0.005)	
有 価 証 券 取 引 税	1	0.006	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)	(0.006)	
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)	(0.022)	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）	(1)	(0.008)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	61	0.485	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

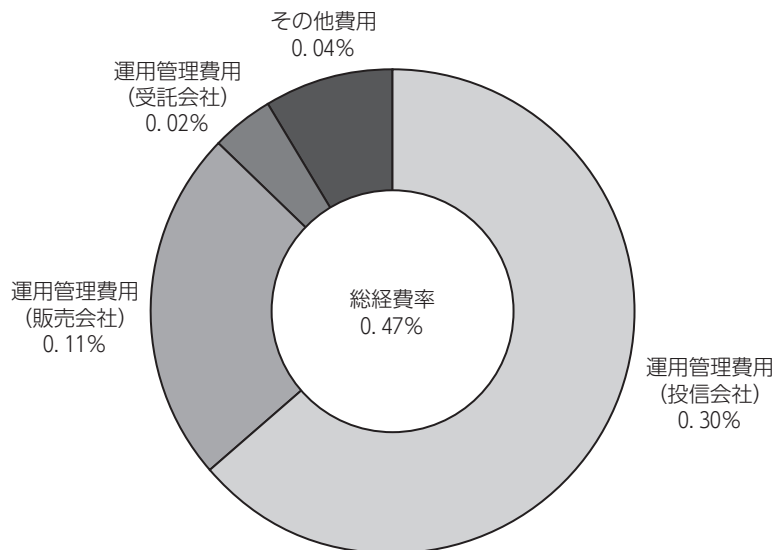
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.47%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2021年6月16日から2022年6月15日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 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	2	7	443,335	1,305,919

（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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首 保有額	当作成期中 設定額	当作成期中 解約額	当作成期末 保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
10	—	—	10	当初設定時における取得

（注1）金額は元本ベース。

（注2）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	当 期 末		
	期 首	□ 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	447,317	3,984	12,106

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	12,106	99.8
コール・ローン等、その他	29	0.2
投資信託財産総額	12,135	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。

（注2）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.01円、1カナダ・ドル=104.20円、1オーストラリア・ドル=93.10円、1香港・ドル=17.20円、1シンガポール・ドル=96.95円、1ニュージーランド・ドル=83.95円、1イギリス・ポンド=162.21円、1イスラエル・シケル=38.942円、100韓国・ウォン=10.46円、1ユーロ=140.80円です。

（注3）先進国REITマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（992,540千円）の投資信託財産総額（1,014,634千円）に対する比率は、97.8%です。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（25,085,971千円）の投資信託財産総額（25,549,246千円）に対する比率は、98.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	12,135,743円
コール・ローン等	29,027
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）	12,106,116
未収入金	600
(B) 負債	143,435
未払収益分配金	115,000
未払信託報酬	28,195
その他未払費用	240
(C) 純資産総額（A－B）	11,992,308
元本	10,000,000
次期繰越損益金	1,992,308
(D) 受益権総口数	10,000,000口
1万口当り基準価額（C/D）	11,992円

\* 期首における元本額は1,101,058,979円、当作成期間中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は1,091,058,979円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,992円です。



■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 19円
受取利息	28
支払利息	△ 47
(B) 有価証券売買損益	1,373,695
売買益	6,024,296
売買損	△ 4,650,601
(C) 信託報酬等	△ 982,062
(D) 当期損益金 (A + B + C)	391,614
(E) 前期繰越損益金	1,810,773
(F) 追加信託差損益金	△ 95,079
(配当等相当額)	( 134,546)
(売買損益相当額)	(△ 229,625)
(G) 合計 (D + E + F)	2,107,308
(H) 収益分配金	△ 115,000
次期繰越損益金 (G + H)	1,992,308
追加信託差損益金	△ 95,079
(配当等相当額)	( 134,546)
(売買損益相当額)	(△ 229,625)
分配準備積立金	2,087,387

(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	115,096円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	276,518
(c) 収益調整金	134,546
(d) 分配準備積立金	1,810,773
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,336,933
(f) 分配金	115,000
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,221,933
(h) 受益権総口数	10,000,000口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金 (税 込 み)	115円

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

★「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の第17期にかかる運用状況については349～357ページ、「先進国REITマザーファンド」の第9期にかかる運用状況については358～363ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（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））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（2021年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在におけるダイワ・グローバル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

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	694.09	8,502,428	12,249	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	642.43	7,906,750	12,307

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2)投資信託証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
PROLOGIS INC (アメリカ)	15.6	232,601	14,910	PROLOGIS INC (アメリカ)	98.606	1,879,113	19,056
VICI PROPERTIES INC (アメリカ)	61.765	220,757	3,574	EQUINIX INC (アメリカ)	12.01	1,059,530	88,220
EQUINIX INC (アメリカ)	2.097	193,347	92,201	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	20.655	918,442	44,465
GOODMAN GROUP (オーストラリア)	69.269	132,061	1,906	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	44.242	714,721	16,154
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT (アメリカ)	5.871	126,281	21,509	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	37.687	640,587	16,997
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	3.511	124,433	35,441	WELLTOWER INC (アメリカ)	56.5	633,755	11,216
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC (アメリカ)	29.069	113,149	3,892	REALTY INCOME CORP (アメリカ)	72.2	594,605	8,235
REALTY INCOME CORP (アメリカ)	14.686	113,043	7,697	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	18.811	551,516	29,318
WELLTOWER INC (アメリカ)	11.676	111,920	9,585	GOODMAN GROUP (オーストラリア)	252.169	515,656	2,044
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	6.305	110,257	17,487	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	46.649	494,904	10,609

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2022年6月15日におけるダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド（8,345,562千口）の内容です。

(1)外国投資信託受益証券

銘 柄	口 数	2022年6月15日現在	
		評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ) VANGUARD REAL ESTATE ETF	85.16	7,436	1,003,957
合 計	85.16	7,436	1,003,957
	口 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1 銘柄	<4.0%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	2022年6月15日現在		
	口数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
(シンガポール)			
MANULIFE US REAL ESTATE INV	247.362	144	19,536
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	110.2	75	10,191
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90	—	—
PRIME US REIT	79.1	54	7,422
(アメリカ)			
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	18.096	348	47,030
URBAN EDGE PROPERTIES	15.182	226	30,561
XENIA HOTELS & RESORTS INC	15.7	243	32,854
AVALONBAY COMMUNITIES INC	19.241	3,563	481,073
SIMON PROPERTY GROUP INC	45.189	4,361	588,804
BOSTON PROPERTIES INC	19.564	1,773	239,410
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	20.988	122	16,604
VORNADO REALTY TRUST	21.821	631	85,317
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11.878	223	30,196
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11.3	515	69,567
NEXPOINT RESIDENTIAL	3.126	190	25,740
EQUITY RESIDENTIAL	47.062	3,236	437,017
APPLE HOSPITALITY REIT INC	29.2	432	58,424
EPR PROPERTIES	10.284	447	60,480
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.9	101	13,753
CITY OFFICE REIT INC	6	68	9,283
GLOBAL NET LEASE INC	14.233	186	25,230
EQUINIX INC	12.387	7,661	1,034,376
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10.629	262	35,373
CHATHAM LODGING TRUST	6.665	73	9,871
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7.6	605	81,798
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16.7	257	34,812
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3.2	105	14,205
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7.8	39	5,391
HOST HOTELS & RESORTS INC	98.272	1,688	227,939
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	40.673	1,339	180,882
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	21	341	46,100
RLJ LODGING TRUST	22.921	268	36,237
FARMLAND PARTNERS INC	3.9	54	7,297
PHYSICIANS REALTY TRUST	30.3	501	67,702
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	9.3	118	16,033
KIMCO REALTY CORP	84.828	1,628	219,890
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8.3	89	12,124
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	30.395	822	111,044
WHITESTONE REIT	6.4	68	9,202
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	32.274	1,396	188,540
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17.1	221	29,943
PARK HOTELS & RESORTS INC	32.48	498	67,267
INVITATION HOMES INC	82.143	2,762	372,960
JBG SMITH PROPERTIES	15.732	364	49,170

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
ALEXANDER & BALDWIN INC	10	182	24,585
CLIPPER REALTY INC	1.89	14	1,929
GLADSTONE LAND CORP	4.251	93	12,655
AMERICOLD REALTY TRUST	36.695	1,061	143,374
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9	125	16,877
VICI PROPERTIES INC	115.665	3,253	439,276
BRT APARTMENTS CORP	1.6	33	4,473
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3.589	410	55,374
SAFEHOLD INC	1.957	67	9,131
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	16.943	114	15,486
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	16.743	336	45,390
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4.75	84	11,447
STORE CAPITAL CORP	33.77	837	113,024
CREATIVE MEDIA AND COMMUNITY TRUST	2.1	14	1,970
BROADSTONE NET LEASE INC	22.2	428	57,876
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14.668	110	14,872
LIFE STORAGE INC	11.313	1,158	156,433
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7.274	209	28,283
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	30.319	637	86,001
PARAMOUNT GROUP INC	22.593	164	22,206
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	19.5	130	17,612
NETSTREIT CORP	5.5	103	13,960
APARTMENT INCOME REIT CO	21.601	851	115,020
CTO REALTY GROWTH INC	0.86	49	6,678
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	22.079	1,279	172,682
STAG INDUSTRIAL INC	24.266	737	99,627
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1.5	26	3,535
INDUS REALTY TRUST INC	0.861	49	6,710
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2.3	32	4,446
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	15.569	498	67,284
ORION OFFICE REIT INC	7.823	90	12,241
VENTAS INC	54.913	2,659	359,050
CARETRUST REIT INC	13.304	222	29,978
INVENTRUST PROPERTIES CORP	9.5	247	33,347
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	41.01	818	110,458
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	6.654	129	17,428
SABRA HEALTH CARE REIT INC	31.443	413	55,780
UMH PROPERTIES INC	6.244	106	14,322
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3.6	86	11,689
IRON MOUNTAIN INC	39.886	1,885	254,603
TERRENO REALTY CORP	10.35	568	76,686
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17.593	637	86,054
SUN COMMUNITIES INC	15.994	2,415	326,148
ACADIA REALTY TRUST	12.211	196	26,526
ALEXANDER'S INC	0.3	65	8,789
PROLOGIS INC	101.813	11,266	1,521,107
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20.071	2,717	366,823

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
BRANDYWINE REALTY TRUST	23.542	223	30,226
SAUL CENTERS INC	1.8	76	10,342
VERIS RESIDENTIAL INC	11	154	20,880
CAMDEN PROPERTY TRUST	14.031	1,767	238,684
COUSINS PROPERTIES INC	20.455	604	81,578
SITE CENTERS CORP	24.678	309	41,780
DUKE REALTY CORP	52.4	2,682	362,215
EASTGROUP PROPERTIES INC	5.578	848	114,604
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8.934	2,288	309,035
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17.907	839	113,386
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9.707	923	124,711
GETTY REALTY CORP	5.403	135	18,345
WELLTOWER INC	59.876	4,637	626,094
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	74.221	1,739	234,882
HIGHWOODS PROPERTIES INC	14.4	484	65,401
SERVICE PROPERTIES TRUST	22.7	126	17,070
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	20.259	504	68,105
EQUITY COMMONWEALTH	15.575	425	57,405
KILROY REALTY CORP	14.409	714	96,450
LTC PROPERTIES INC	5.408	193	26,065
LXP INDUSTRIAL TRUST	38.895	398	53,772
MID-AMERICA APARTMENT COMM	15.878	2,540	343,054
MACERICH CO/THE	29.279	271	36,604
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	23.715	1,628	219,865
NATL HEALTH INVESTORS INC	6.3	355	48,039
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	24.12	955	129,052
REALTY INCOME CORP	77.825	4,886	659,744
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	15.41	395	53,427
PENN REAL ESTATE INVEST TST	17	4	665
PUBLIC STORAGE	20.956	6,241	842,669
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2.764	513	69,386
REGENCY CENTERS CORP	21.226	1,201	162,199
RPT REALTY	11.6	111	15,097
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	14.316	208	28,122
SL GREEN REALTY CORP	8.838	434	58,634
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	32.9	60	8,172
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4.1	65	8,817
UDR INC	41.167	1,742	235,212
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.8	89	12,095
WP CAREY INC	26.243	2,124	286,882
WASHINGTON REIT	11.6	256	34,595
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4.7	27	3,661
AGREE REALTY CORP	9.8	656	88,647
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	32.906	910	122,883
CUBESMART	30.158	1,172	158,264
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	30.126	311	42,055
DIGITAL REALTY TRUST INC	39.096	4,870	657,524

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
CEDAR REALTY TRUST INC	1.7	42	5,735
EXTRA SPACE STORAGE INC	18.429	2,925	394,960
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4.575	45	6,189
CENTERSPACE	2.06	158	21,454
KITE REALTY GROUP TRUST	30.169	524	70,872
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2.2	56	7,577
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	19.19	1,236	166,902
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5.121	93	12,569
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	28.942	257	34,698
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	82.122	1,226	165,644
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13.105	52	7,077
DOUGLAS EMMETT INC	24.186	548	74,025
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,561.29 150銘柄	135,027 <71.9%>
	千口	千カナダ・ドル	千円
<b>(カナダ)</b>			
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2.3	16	1,696
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	5.1	18	1,944
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	6.2	24	2,564
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	4.3	43	4,579
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	6.741	86	8,983
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8.4	101	10,555
SLATE GROCERY REIT	4	56	5,918
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8	135	14,146
SLATE OFFICE REIT	5.1	23	2,481
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2.8	43	4,493
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15.5	188	19,671
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12.2	206	21,483
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	6.1	37	3,858
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2.7	35	3,668
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4.5	356	37,141
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	16.2	198	20,678
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	9.7	119	12,472
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	15.2	216	22,569
CHOICE PROPERTIES REIT	22.6	309	32,238
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2.7	45	4,782
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	7.4	117	12,275
PLAZA RETAIL REIT	7	30	3,136
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10	271	28,311
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12	530	55,242
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	19.966	252	26,359
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	21.4	430	44,842
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3.3	64	6,739
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3.2	141	14,771
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	7.2	113	11,816
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8.8	303	31,671
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	260.607 30銘柄	4,521 <1.9%>

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU	155.65	1,411	131,433
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	38.4	59	5,577
HOME CONSORTIUM LTD	25.79	117	10,924
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	53.9	44	4,139
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	46.82	146	13,643
CROMWELL PROPERTY GROUP	199.444	139	12,997
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	76	222	20,731
RURAL FUNDS GROUP	53.875	144	13,492
WAYPOINT REIT	101.781	229	21,320
CHARTER HALL LONG WALE REIT	86.122	373	34,797
CENTURIA OFFICE REIT	62.25	108	10,142
CENTURIA CAPITAL GROUP	89.45	173	16,114
IRONGATE GROUP	77.4	146	13,619
HOMECO DAILY NEEDS REIT	204.898	255	23,749
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	165.43	438	40,814
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	41.377	143	13,405
NATIONAL STORAGE REIT	152.575	328	30,540
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	31.51	83	7,803
GDI PROPERTY GROUP	71.46	68	6,386
SCENTRE GROUP	760.116	1,938	180,455
ARENA REIT	48.81	189	17,631
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	27.16	86	8,091
BWP TRUST	67.951	250	23,280
GPT GROUP	277.21	1,153	107,362
CHARTER HALL RETAIL REIT	73.41	278	25,970
MIRVAC GROUP	570.551	1,169	108,892
STOCKLAND	350.431	1,261	117,450
ABACUS PROPERTY GROUP	53.96	145	13,563
GOODMAN GROUP	248.1	4,443	413,687
VICINITY CENTRES	556.686	971	90,438
CHARTER HALL GROUP	68.052	777	72,353
INGENIA COMMUNITIES GROUP	51.59	184	17,146
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,888.159 32銘柄	17,486 <6.4%>
(香港)	千口	千香港・ドル	千円
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	321	982	16,894
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	142	536	9,232
FORTUNE REIT	203	1,372	23,603
PROSPERITY REIT	174	461	7,930
LINK REIT	303.6	20,766	357,179
CHAMPION REIT	268	940	16,179
香港・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,411.6 6銘柄	25,059 <1.7%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円
KEPPEL DC REIT	186.483	359	34,893

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千シンガポール・ドル	千円
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	170.976	48	4,724
AIMS APAC REIT	64.3	86	8,415
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	411.29	526	51,039
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	73.8	58	5,652
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262.44	206	19,973
EC WORLD REIT	36.5	21	2,087
IREIT GLOBAL	71.624	43	4,235
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	483.177	1,328	128,821
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	732.122	1,552	150,475
SUNTEC REIT	307.4	507	49,174
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	460.6	746	72,341
KEPPEL REIT	277.6	313	30,412
ASCOTT RESIDENCE TRUST	272.656	308	29,870
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	730.702	292	28,336
CDL HOSPITALITY TRUSTS	127.7	159	15,475
FRASERS CENTREPOINT TRUST	151.176	337	32,684
STARHILL GLOBAL REIT	198.4	113	10,963
CAPITALAND CHINA TRUST	159.142	179	17,434
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	54.6	262	25,408
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	285.969	692	67,093
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	309.284	544	52,773
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	147.8	94	9,170
SPH REIT	134.4	126	12,248
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	337.763	130	12,607
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	6,447.904 25銘柄	9,038 <3.5%>
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランド・ドル	千円
ARGOSY PROPERTY LTD	119.25	140	11,762
KIWI PROPERTY GROUP LTD	221.44	210	17,660
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	60.26	161	13,582
GOODMAN PROPERTY TRUST	147.8	296	24,877
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	183.35	243	20,471
ニュージーランド・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	732.1 5銘柄	1,052 <0.3%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円
ASSURA PLC	407.27	270	43,866
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	83.32	73	11,852
STANDARD LIFE INV PROP INC	56.2	44	7,256
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	118.46	95	15,545
PICTON PROPERTY INCOME LTD	75.64	71	11,619
REGIONAL REIT LTD	59.84	47	7,736
NEWRIVER REIT PLC	42.86	37	6,124
CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	117.59	174	28,306
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	85.98	68	11,171
CUSTODIAN REIT PLC	60.9	62	10,214
PRS REIT PLC/THE	75.872	81	13,144



ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千イギリス・ポンド	千円
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	53.28	65	10,543
LXI REIT PLC	125.918	179	29,126
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	51.24	44	7,256
AEW UK REIT PLC	21.93	26	4,304
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	110.42	126	20,597
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	136.123	172	27,931
HOME REIT PLC	77.587	88	14,322
LAND SECURITIES GROUP PLC	105.957	775	125,742
SEGRO PLC	170.889	1,631	264,669
HAMMERSON PLC	482.269	110	17,883
UNITE GROUP PLC/THE	56.29	596	96,695
BRITISH LAND CO PLC	132.28	670	108,701
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	35.071	217	35,270
DERWENT LONDON PLC	15.83	437	70,922
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	184.12	251	40,737
WORKSPACE GROUP PLC	20.759	136	22,123
SAFESTORE HOLDINGS PLC	29.124	295	47,950
SHAFTESBURY PLC	39.8	228	37,057
BIG YELLOW GROUP PLC	23.89	298	48,439
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	135.177	311	50,519
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	78.138	43	7,110
TRITAX BIG BOX REIT PLC	263.418	477	77,382
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,533.442 33銘柄	8,212 <5.3%>
(イスラエル)	千口	千イスラエル・シケル	千円
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	31.07	283	11,047
REIT 1 LTD	26.1	461	17,990
イスラエル・シケル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	57.17 2銘柄	745 <0.1%>
(韓国)	千口	千韓国・ウォン	千円
SK REITS LTD	8.7	58,464	6,115
D&D PLATFORM REIT LTD	8	41,600	4,351
JR GLOBAL	3.137	653	68
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8.26	65,254	6,825
LOTTE REIT CO LTD	17.135	102,638	10,736
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	13.09	62,439	6,531
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5.6	32,480	3,397
JR REIT XXVII	16.35	89,925	9,406
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5.99	37,617	3,934
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	20.74	130,039	13,602
韓国・ウォン通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	107.002 10銘柄	621,111 <0.3%>
ユーロ (アイルランド)	千口	千ユーロ	千円
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	54.94	71	10,009

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

銘柄		2022年6月15日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
HIBERNIA REIT PLC		千口 84.78	千ユーロ 135	千円 19,075
国	小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	206	29,085 <0.1%>
ユーロ (オランダ)		千口	千ユーロ	千円
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		5.057	112	15,863
WERELDHAVE NV		5.16	72	10,214
NSI NV		2.271	78	11,047
VASTNED RETAIL NV		2.32	51	7,300
国	小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	315	44,427 <0.2%>
ユーロ (ベルギー)		千口	千ユーロ	千円
AEDIFICA		4.776	453	63,816
COFINIMMO		3.882	437	61,545
BEFIMMO		3.13	147	20,713
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS RETAIL ESTATES		3.03	75	10,580
RETAIL ESTATES		1.457	89	12,575
WAREHOUSES DE PAUW SCA		18.468	568	79,985
CARE PROPERTY INVEST		3.45	79	11,245
XIOR STUDENT HOUSING NV		2.67	110	15,526
MONTEA NV		1.31	111	15,659
国	小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,071	291,647 <1.2%>
ユーロ (フランス)		千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		15.315	819	115,364
ICADE		4.098	193	27,211
CARMILA		5.78	77	10,888
ALTAREA		0.55	69	9,803
GECINA SA		7.153	684	96,383
KLEPIERRE		25.657	482	67,987
COVIVIO		6.222	352	49,672
MERCIALYS		6.37	51	7,296
国	小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,731	384,608 <1.5%>
ユーロ (ドイツ)		千口	千ユーロ	千円
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		1.82	23	3,264
HAMBORNER REIT AG		9.07	75	10,586
国	小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	98	13,851 <0.1%>
ユーロ (スペイン)		千口	千ユーロ	千円
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		7.5	36	5,132
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		34.559	224	31,579
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		43.87	423	59,607
国	小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	684	96,318 <0.4%>

# ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	口数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
<b>ユーロ (イタリア)</b>	千口	千ユーロ	千円
COIMA RES SPA	2.77	27	3,845
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6.93	24	3,429
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	51	7,275
	2銘柄		<0.0%>
<b>ユーロ (その他)</b>	千口	千ユーロ	千円
CROMWELL REIT EUR	43.52	88	12,439
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	88	12,439
	1銘柄		<0.0%>
<b>ユーロ通貨計</b>	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,247	879,652
	31銘柄		<3.5%>
<b>合計</b>	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	—	24,030,593
	324銘柄		<94.8%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2022年6月15日現在	
	買建額	売建額
外	百万円	百万円
DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	329	—
国		
STOXX 600 REAL (ドイツ)	134	—

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

(注2) 単位未満は切捨て。