ダイワＴＯＰＩＸ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－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）
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）
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）

運用報告書（全体版）

第８期

（決算日　2024年６月17日）

（作成対象期間　2023年６月16日～2024年６月17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>

◇SUZ0466020240617◇

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8期

（決算日　2024年6月17日）

（作成対象期間　2023年6月16日～2024年6月17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、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）（配当込み）に連動する投資成果をあげることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／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）（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	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。		

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>

最近５期の運用実績

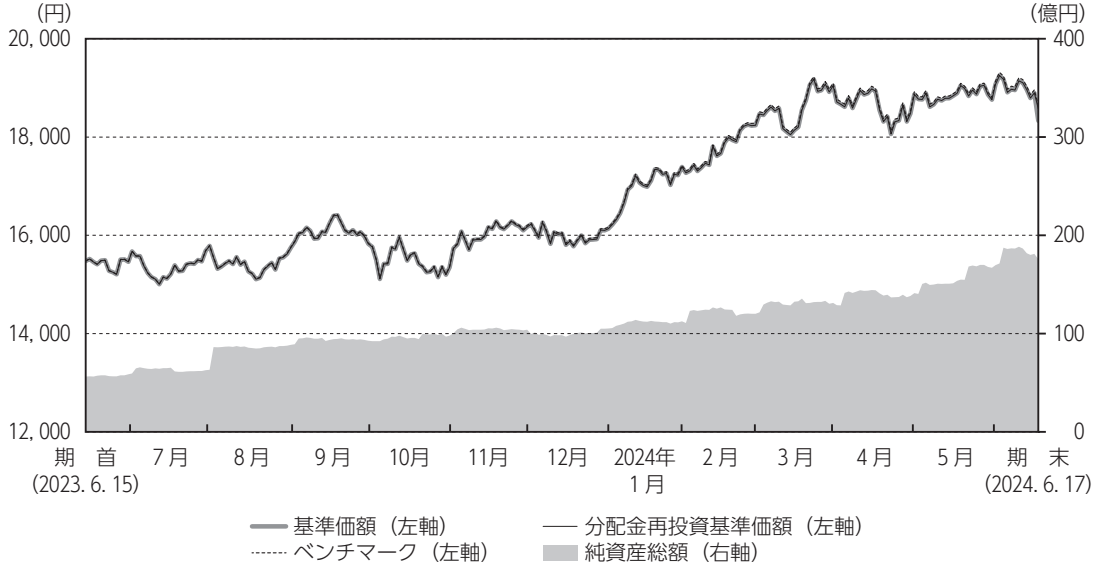
決算期	基準価額			ＴＯＰＩＸ（配当込み）		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
４期末(2020年６月15日)	10,189	200	1.7	2,364.73	2.0	100.2	1.7	5,083
５期末(2021年６月15日)	13,209	190	31.5	3,117.60	31.8	98.8	2.6	2,958
６期末(2022年６月15日)	12,400	270	△ 4.1	2,999.04	△ 3.8	100.3	1.9	2,264
７期末(2023年６月15日)	15,478	210	26.5	3,809.16	27.0	98.9	2.4	5,633
８期末(2024年６月17日)	18,333	240	20.0	4,587.01	20.4	99.0	2.3	17,564

（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）株式組入比率は新株予約権証券を含みます。
（注５）株式先物比率は買建比率－売建比率です。

配当込みＴＯＰＩＸ（本書類における「ＴＯＰＩＸ（配当込み）」をいう。）の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）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・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有する。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。当ファンドは、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負わない。

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（配当込み）です。

■基準価額・騰落率

期　首：15,478円
期　末：18,333円（分配金240円）
騰落率：20.0％（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

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

年　月　日	基準価額		ＴＯＰＩＸ（配当込み）		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率		
	円	%		%	%	%
（期首）2023年６月15日	15,478	—	3,809.16	—	98.9	2.4
６月末	15,459	△ 0.1	3,805.00	△ 0.1	96.6	3.3
７月末	15,685	1.3	3,861.80	1.4	98.6	1.3
８月末	15,747	1.7	3,878.51	1.8	96.5	3.5
９月末	15,826	2.2	3,898.26	2.3	96.8	2.9
10月末	15,346	△ 0.9	3,781.64	△ 0.7	95.9	4.0
11月末	16,173	4.5	3,986.65	4.7	97.9	1.9
12月末	16,134	4.2	3,977.63	4.4	96.7	3.3
2024年１月末	17,389	12.3	4,288.36	12.6	98.2	1.8
２月末	18,239	17.8	4,499.61	18.1	97.3	2.6
３月末	19,041	23.0	4,699.20	23.4	97.4	2.6
４月末	18,867	21.9	4,656.27	22.2	96.8	3.2
５月末	19,077	23.3	4,710.15	23.7	96.5	3.4
（期末）2024年６月17日	18,573	20.0	4,587.01	20.4	99.0	2.3

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■国内株式市況

国内株式市況は大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇などから上値の重い展開となりました。2023年８月半ばに発表された2023年４－６月期ＧＤＰ（国内総生産）成長率が予想を上回る高い伸びとなったことが好感されて上昇する局面もありましたが、米国における長期金利の上昇や景気の先行き不透明感、パレスチナ情勢の悪化などが懸念され、保ち合い相場が継続しました。11月以降も、欧米の金利低下や良好な企業決算、株主還元拡充の発表などが好感された一方、円高進行などが懸念され、狭いレンジでの推移となりました。2024年１月以降は、新ＮＩＳＡ（少額投資非課税制度）を通じた資金流入や海外投資家による日本株投資の積極化、円安進行などが好感され、急上昇しました。３月下旬以降は、米国の利下げ開始の後ずれ観測、市場予想を下回る企業業績見通しの発表、国内長期金利の上昇などが上値を抑え、高値圏での保ち合いとなり、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

「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 （2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

当作成期中、資金変動への対応、新規上場等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。

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

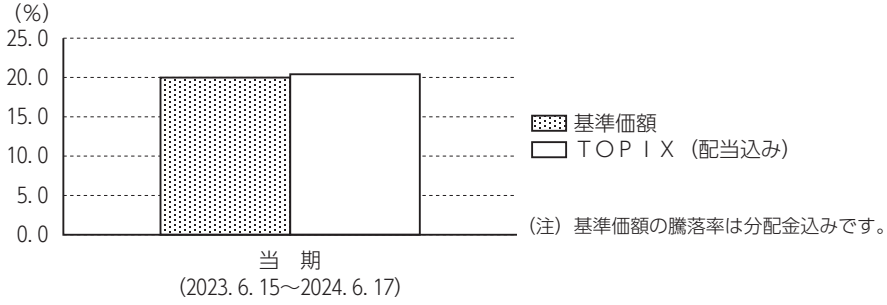
組入ファンド	ベンチマーク
トピックス・インデックス・マザーファンド	ＴＯＰＩＸ（配当込み）

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20. 4％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は20. 0％となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

＊ベンチマークはＴＯＰＩＸ（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
		2023年６月16日～2024年６月17日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**240**
対基準価額比率	（％）	1.29
当期の収益	（円）	240
当期の収益以外	（円）	―
翌期繰越分配対象額	（円）	8,333

（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。

（注４）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。

■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	✓ 252.35円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	1,285.20
（ｃ）収益調整金	6,529.01
（ｄ）分配準備積立金	506.74
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	8,573.31
（ｆ）分配金	240.00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	8,333.31

（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

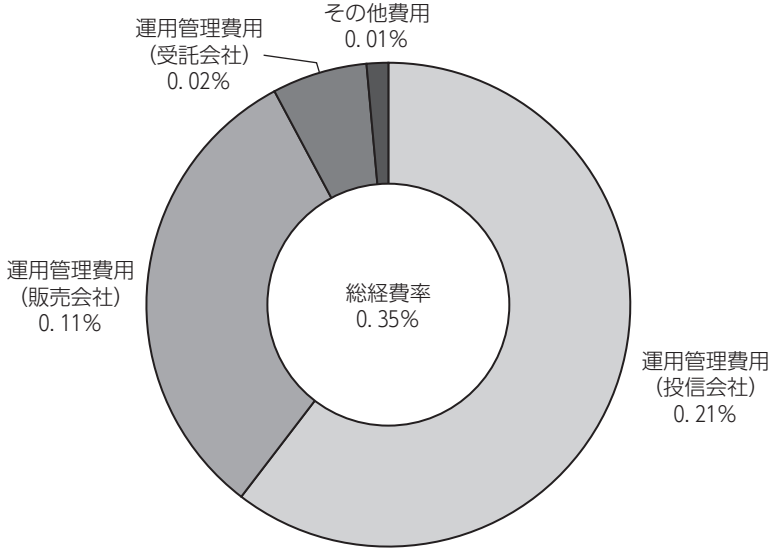
項　　目	当　期 (2023. 6. 16～2024. 6. 17)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	58円	0. 343%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は16, 859円です。**
（投 信 会 社）	(35)	(0. 210)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(19)	(0. 111)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(4)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0. 004	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株　　式）	(0)	(0. 003)	
（新株予約権証券）	(0)	(0. 000)	
（先物・オプション）	(0)	(0. 001)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 006	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（監 査 費 用）	(1)	(0. 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	59	0. 352	

（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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	8,468,378	15,389,970	2,899,505	5,249,460

（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

（2023年６月16日から2024年６月17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	70,329,147千円
（b）期中の平均組入株式時価総額	289,951,277千円
（c）売買高比率　（a）／（b）	0.24

（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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	59,340	31,858	53.7	10,988	16	0.2
新株予約権証券	—	—	—	5	5	100.0
株式先物取引	77,141	51,912	67.3	76,637	50,429	65.8
コール・ローン	3,089,159	—	—	—	—	—

（注）平均保有割合3.5％
※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

種類	当期		
	トピックス・インデックス・マザーファンド		
	買付額	売付額	作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	158	1	838

（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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

種類	当期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
	買付額
	百万円
株式	64

（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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

項目	当期
売買委託手数料総額（A）	424千円
うち利害関係人への支払額（B）	86千円
（B）／（A）	20.4％

（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、サムティ株式会社、サムティホールディングス株式会社です。

■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	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
トピックス・インデックス・マザーファンド	3, 507, 075	9, 075, 948	17, 793, 397

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年６月17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	17, 793, 397	99. 9
コール・ローン等、その他	24, 659	0. 1
投資信託財産総額	17, 818, 056	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

2024年６月17日現在

項　　目	当　期　末
（Ａ）資産	**17, 818, 056, 993円**
コール・ローン等	23, 859, 673
トピックス・インデックス・マザーファンド（評価額）	17, 793, 397, 320
未収入金	800, 000
（Ｂ）負債	**253, 333, 261**
未払収益分配金	229, 938, 446
未払信託報酬	23, 023, 559
その他未払費用	371, 256
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）	**17, 564, 723, 732**
元本	9, 580, 768, 591
次期繰越損益金	7, 983, 955, 141
（Ｄ）受益権総口数	**9, 580, 768, 591口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）	**18, 333円**

＊期首における元本額は3, 639, 859, 036円、当作成期間中における追加設定元本額は9, 114, 805, 565円、同解約元本額は3, 173, 896, 010円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は18, 333円です。

■損益の状況

当期　自 2023年６月16日　至 2024年６月17日

項　　目	当　　期
（Ａ）配当等収益	**3, 019円**
受取利息	4, 091
支払利息	△　1, 072
（Ｂ）有価証券売買損益	**1, 511, 482, 136**
売買益	1, 928, 719, 112
売買損	△　417, 236, 976
（Ｃ）信託報酬等	**△　38, 384, 566**
（Ｄ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	**1, 473, 100, 589**
（Ｅ）前期繰越損益金	**485, 498, 008**
（Ｆ）追加信託差損益金	**6, 255, 294, 990**
（配当等相当額）	(　2, 327, 381, 809)
（売買損益相当額）	(　3, 927, 913, 181)
（Ｇ）合計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	**8, 213, 893, 587**
（Ｈ）収益分配金	**△　229, 938, 446**
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	**7, 983, 955, 141**
追加信託差損益金	6, 255, 294, 990
（配当等相当額）	(　2, 327, 381, 809)
（売買損益相当額）	(　3, 927, 913, 181)
分配準備積立金	1, 728, 660, 151

（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	241, 773, 915円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	1, 231, 326, 674
（ｃ）収益調整金	6, 255, 294, 990
（ｄ）分配準備積立金	485, 498, 008
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	8, 213, 893, 587
（ｆ）分配金	229, 938, 446
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	7, 983, 955, 141
（ｈ）受益権総口数	9, 580, 768, 591口

収　益　分　配　金　の　お　知　ら　せ	
１万口当り分配金（税込み）	240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（2023年９月19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（2024年６月17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

（2023年６月16日から2024年６月17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
トヨタ自動車	834.3	2,440,739	2,925	東芝	151.4	699,468	4,620
ソニーグループ	106.2	1,378,504	12,980	ＪＳＲ	93.7	407,562	4,349
三菱UFJフィナンシャルＧ	920.5	1,244,515	1,351	日本電信電話	1,923.8	337,412	175
ゆうちょ銀行	772.6	1,096,086	1,418	ローソン	22.1	219,430	9,928
キーエンス	15.1	988,985	65,495	みずほフィナンシャルＧ	80.4	207,402	2,579
三菱商事	203	973,530	4,795	日本郵政	142.4	206,490	1,450
三井物産	158	940,369	5,951	ＨＯＹＡ	13.8	203,687	14,759
信越化学	183.7	921,108	5,014	三菱UFJフィナンシャルＧ	154.2	189,864	1,231
伊藤忠	150.8	899,471	5,964	伊藤忠テクノソリュー	41.9	181,217	4,325
東京エレクトロン	32.1	877,584	27,339	三井住友フィナンシャルＧ	22.7	180,201	7,938

（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、2024年６月17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（179,077,569千口）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
水産・農林業（0.1%）		
極洋	5.2	20,098
ニッスイ	126.4	107,351
マルハニチロ	18.7	58,007
雪国まいたけ	10.8	10,605
カネコ種苗	3.6	5,036
サカタのタネ	14.4	48,312
ホクト	10.1	18,816
ホクリヨウ	0.7	696
鉱業（0.3%）		
住石ホールディングス	16.1	21,268
日鉄鉱業	5.1	25,704
三井松島HLDGS	7.5	35,137
ＩＮＰＥＸ	424.7	963,219
石油資源開発	14.7	93,345
K&Oエナジーグループ	5.7	23,769
建設業（2.0%）		
ショーボンドＨＤ	17.2	98,865
ミライト・ワン	38.2	76,877
タマホーム	7.9	29,822
サンヨーホームズ	0.5	376
日本アクア	1.7	1,575
ファーストコーポレーション	1.2	891
ベステラ	1	1,005
キャンディル	0.7	432
ダイセキ環境ソリューション	0.8	775
第一カッター興業	3.6	5,547
安藤・間	73.2	79,861
東急建設	39.5	29,704
コムシスホールディングス	40.4	124,714
ビーアールホールディングス	18.5	6,604
高松コンストラクションGP	9.4	27,081
東建コーポレーション	3.2	38,816
ソネック	0.4	376
ヤマウラ	6.4	8,160
オリエンタル白石	46.6	15,937
大成建設	81	466,074
大林組	316.4	560,977
清水建設	250.9	209,752
飛島建設	9.1	13,122
長谷工コーポレーション	81.1	138,721
松井建設	8.3	6,872
錢高組	0.5	2,110
鹿島建設	196.1	523,390
不動テトラ	6.1	15,500
大末建設	1.2	2,028
鉄建建設	6.3	15,844
西松建設	16.9	73,988
三井住友建設	65.8	25,793
大豊建設	3.1	10,462
佐田建設	1.8	1,301
ナカノフドー建設	2	1,004
奥村組	14.3	69,212
東鉄工業	11	34,210
イチケン	0.7	1,751
富士ピー・エス	1.3	587
淺沼組	6.5	23,400
戸田建設	119.8	124,711
熊谷組	14.6	51,319
北野建設	0.5	1,790
植木組	0.8	1,291
矢作建設	12	18,540
ピーエス三菱	11.2	11,032
日本ハウスHLDGS	18.9	5,953
新日本建設	12.4	19,629
東亜道路	17.3	20,760
日本道路	10.4	17,981
東亜建設	26.7	27,180
日本国土開発	25.4	11,353
若築建設	3.1	10,772
東洋建設	22.2	30,680
五洋建設	125.4	78,914

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
世紀東急	11.3	18,758
福田組	3.3	18,249
住友林業	76.4	411,032
日本基礎技術	1.8	1,267
巴コーポレーション	3.7	2,982
大和ハウス	244.7	978,800
ライト工業	17.6	35,851
積水ハウス	268.3	918,390
日特建設	8.4	9,156
北陸電気工事	6.1	7,094
ユアテック	19.5	30,205
日本リーテック	6.9	8,183
四電工	3.7	13,098
中電工	13.8	42,642
関電工	55.4	92,795
きんでん	61.5	206,025
東京エネシス	8.3	11,072
トーエネック	2.9	17,110
住友電設	8.4	32,718
日本電設工業	16.6	31,274
エクシオグループ	86.5	135,718
新日本空調	5.7	23,113
九電工	19.1	110,398
三機工業	19.1	40,167
日揮ホールディングス	87.5	106,881
中外炉工業	2.9	9,323
ヤマト	2.5	2,407
太平電業	5.5	30,360
高砂熱学	23.7	145,755
三晃金属	0.4	1,734
朝日工業社	8.3	11,271
明星工業	17.1	21,375
大氣社	10.2	51,918
ダイダン	11.6	37,004
日比谷総合設備	6.4	22,624
フィル・カンパニー	1.4	960
テスホールディングス	19.1	7,964
インフロニアＨＤ	102	126,786
東洋エンジニア	13	11,596
レイズネクスト	12.8	22,784
食料品（3.2%）		
ニップン	26.6	59,796
日清製粉Ｇ本社	82.1	147,041
日東富士製粉	1.6	12,112
昭和産業	8.6	26,617
鳥越製粉	2.7	1,844
中部飼料	12.4	18,947
フィード・ワン	13	12,168
東洋精糖	0.5	800
日本甜菜糖	5.2	10,987
DM三井製糖ホールディ	8.8	29,656
塩水港精糖	3.9	1,060
ウェルネオシュガー	4.4	10,291
森永製菓	37.5	93,675
中村屋	2.2	7,106
江崎グリコ	25.4	106,832

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
名糖産業	3.5	6,562
井村屋グループ	5.3	12,942
不二家	6.1	15,640
山崎製パン	59.4	204,336
第一屋製パン	0.6	406
モロゾフ	2.9	13,209
亀田製菓	5.1	20,935
寿スピリッツ	42	78,855
カルビー	40.7	125,152
森永乳業	31	100,688
六甲バター	6.5	9,652
ヤクルト	126.9	357,223
明治ホールディングス	108.9	378,100
雪印メグミルク	21.5	53,277
プリマハム	12	28,536
日本ハム	38.2	177,018
林兼産業	1	530
丸大食品	9	15,120
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	9.8	27,959
柿安本店	3.4	8,653
伊藤ハム米久HLDGS	13.6	56,576
サッポロホールディングス	29.2	163,958
アサヒグループホールディン	205.2	1,155,276
キリンＨＤ	370	765,160
宝ホールディングス	60	63,780
オエノンホールディングス	26.6	9,762
養命酒	2.9	6,600
コカ・コーラボトラーズJHD	69.6	134,154
サントリー食品インター	62.5	355,250
ダイドーグループHD	10.1	27,017
伊藤園	30.1	102,911
キーコーヒー	9.9	20,334
ユニカフェ	1	918
ジャパンフーズ	0.5	996
日清オイリオグループ	12.5	59,562
不二製油グループ	20.7	58,632
かどや製油	0.4	1,460
Ｊ－オイルミルズ	10.2	19,757
キッコーマン	294.3	532,977
味の素	211.1	1,212,558
ブルドックソース	4.7	9,150
キユーピー	47.7	150,541
ハウス食品Ｇ本社	30.6	88,342
カゴメ	38.2	127,588
アリアケジャパン	8.9	46,013
ピエトロ	0.4	717
エバラ食品工業	2.1	6,085
やまみ	0.4	1,356
ニチレイ	40.7	147,171
東洋水産	44.9	432,746
イートアンドHLDGS	4.2	8,841
大冷	0.4	764
ヨシムラ・フード・HLDGS	4	7,188
日清食品ＨＤ	93.7	391,947
永谷園ホールディングス	4.3	13,308
一正蒲鉾	1.3	997

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
フジッコ	9.1	16,835
ロックフィールド	10.8	15,292
日本たばこ産業	539.6	2,417,947
ケンコーマヨネーズ	6.1	11,876
わらべや日洋ＨＤ	5.9	13,463
なとり	5.6	11,877
イフジ産業	0.6	829
ファーマフーズ	11.8	11,505
ユーグレナ	55.4	30,137
紀文食品	7.7	9,686
ビックルスホールディングス	5.2	6,032
ミヨシ油脂	1.1	1,455
理研ビタミン	7.7	19,819
繊維製品（0.4%）		
片倉工業	8.3	17,064
グンゼ	6.4	36,544
東洋紡	39.2	40,376
ユニチカ	29.4	8,085
富士紡ホールディングス	4	19,380
倉敷紡績	6.4	31,072
シキボウ	5.8	6,287
日本毛織	23.2	30,484
ダイトウボウ	4.7	479
トーア紡コーポレーション	1.1	474
ダイドーリミテッド	3.7	2,693
帝国繊維	10.2	23,949
帝人	86.8	121,303
東レ	605.5	443,104
住江織物	0.6	1,494
日本フエルト	1.6	760
イチカワ	0.4	709
日東製網	0.3	442
アツギ	2.1	1,365
ダイニック	1	814
セーレン	17.4	42,490
ソトー	0.9	646
東海染工	0.3	249
小松マテーレ	13.1	9,484
ワコールホールディングス	18.5	81,233
ホギメディカル	11.9	46,707
クラウディアHLDGS	0.8	340
ＴＳＩホールディングス	27.1	24,932
マツオカコーポレーション	0.9	1,491
ワールド	12.7	25,450
三陽商会	3.8	9,241
ナイガイ	1	262
オンワードホールディングス	53.3	32,459
ルックホールディングス	2.8	7,602
ゴールドウイン	16	136,720
デサント	15.6	52,182
キング	1.2	861
ヤマトインターナショナル	2.3	793
パルプ・紙（0.1%）		
特種東海製紙	4.9	17,615
王子ホールディングス	376.5	230,041
日本製紙	51	48,654

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
三菱製紙	4.1	3,308
北越コーポレーション	44.4	50,305
中越パルプ	1.2	1,834
大王製紙	40	34,656
阿波製紙	0.8	421
レンゴー	82.3	82,258
トーモク	5.2	14,076
ザ・パック	6.7	23,852
化学（5.7%）		
北の達人コーポ	38.3	6,970
クラレ	131.6	238,985
旭化成	611.3	610,383
共和レザー	1.8	1,378
巴川コーポレーション	0.8	782
レゾナック・ホールディング	87.3	301,185
住友化学	670.8	207,210
住友精化	4.3	21,930
日産化学	42.1	193,533
ラサ工業	3.5	10,475
クレハ	19.8	54,073
多木化学	3.5	14,525
テイカ	7.4	12,291
石原産業	15	22,950
片倉コープアグリ	0.7	798
日本曹達	10.7	53,607
東ソー	120.6	245,360
トクヤマ	29.2	85,278
セントラル硝子	9.6	33,840
東亞合成	43.5	64,358
大阪ソーダ	6.3	67,221
関東電化	17.5	16,257
デンカ	32.9	68,662
信越化学	810.3	4,815,612
日本カーバイド	4.3	8,290
堺化学	6.9	18,843
第一稀元素化学工	9.9	7,910
エア・ウォーター	85.3	182,925
日本酸素HLDGS	87.7	398,421
日本化学工業	3.3	8,312
東邦アセチレン	3.2	1,158
日本パーカライジング	40.3	49,286
高圧ガス	13.3	12,502
チタン工業	0.4	402
四国化成ホールディング	10.2	20,818
戸田工業	2.1	4,269
ステラ ケミファ	4.9	20,506
保土谷化学	2.8	15,484
日本触媒	52.6	80,872
大日精化	6.3	20,065
カネカ	22.3	93,280
三菱瓦斯化学	66	200,574
三井化学	74.5	323,106
東京応化工業	43.1	192,872
大阪有機化学	7.6	26,942
三菱ケミカルグループ	660.6	531,650
ＫＨネオケム	13.8	30,567

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ダイセル	116.2	178,889
住友ベークライト	25.3	118,808
積水化学	181.5	401,296
日本ゼオン	61.9	85,638
アイカ工業	22.8	78,865
ＵＢＥ	43	115,433
積水樹脂	13.5	31,320
タキロンシーアイ	23	15,617
旭有機材	6	28,890
ニチバン	4.9	9,212
リケンテクノス	16.9	16,545
大倉工業	4.2	11,701
積水化成品	12.8	5,772
群栄化学	2.1	6,667
タイガース ポリマー	1.3	1,080
ミライアル	1	1,546
ダイキアクシス	1.2	872
ダイキョーニシカワ	20.1	13,467
竹本容器	1.1	958
森六ホールディングス	4.7	12,835
恵和	6.5	10,842
日本化薬	69.1	83,369
カーリットホールディングス	9.7	12,707
日本精化	6	15,204
扶桑化学工業	9.6	36,480
トリケミカル	10.9	42,564
ＡＤＥＫＡ	31.5	100,138
日油	81.8	166,872
新日本理化	4.4	792
ハリマ化成グループ	6.2	5,499
花王	204.3	1,380,250
第一工業製薬	3.6	13,284
石原ケミカル	4	8,140
日華化学	1.2	1,328
ニイタカ	0.6	1,137
三洋化成	5.6	21,868
有機合成薬品	2.3	687
大日本塗料	10	12,660
日本ペイント HOLD	479.8	500,431
関西ペイント	78.1	200,170
神東塗料	3	384
中国塗料	18.5	36,796
日本特殊塗料	2.2	2,664
藤倉化成	10.4	5,969
太陽ホールディングス	15.7	50,397
ＤＩＣ	35.3	111,618
サカタインクス	20.1	36,742
ARTIENCE	19.6	65,856
富士フイルム HLDGS	503.5	1,832,740
資生堂	188.9	945,066
ライオン	115.1	147,040
高砂香料	6.8	24,922
マンダム	19.5	23,575
ミルボン	12.3	41,623
ファンケル	39.6	109,870
コーセー	18.4	204,516

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
コタ	9.1	13,367
シーボン	0.4	557
ポーラ・オルビスHD	46.4	62,872
ノエビアホールディングス	8.1	43,740
アジュバンホールディング	0.7	606
新日本製薬	5.2	8,684
アクシージア	5.9	5,976
エステー	7	10,801
アグロカネショウ	3.6	4,276
コニシ	26.2	31,754
長谷川香料	17.3	53,370
小林製薬	26.3	147,516
荒川化学工業	7.8	8,814
メック	7.4	32,745
日本高純度化学	2	6,310
タカラバイオ	24.4	24,790
ＪＣＵ	10	37,100
新田ゼラチン	2	1,574
ＯＡＴアグリオ	3.3	5,230
デクセリアルズ	22.3	163,503
アース製薬	8.2	39,073
北興化学	9.1	13,631
大成ラミック	2.6	7,311
クミアイ化学	35.8	27,780
日本農薬	16.6	12,914
アキレス	5.7	9,068
有沢製作所	15.8	24,569
日東電工	58.1	712,596
レック	11.6	17,086
三光合成	11.3	7,616
きもと	5.1	1,096
藤森工業	7.2	30,240
前澤化成工業	5.8	10,440
未来工業	3.2	13,536
ウェーブロック HLDGS	1.1	701
ジェイ エス ピー	6.3	13,916
エフピコ	17.1	39,364
天馬	6.6	17,707
信越ポリマー	19.5	27,865
東リ	6.5	2,528
ニフコ	27.1	100,188
バルカー	7.6	27,094
ユニ・チャーム	188.5	986,232
ショーエイコーポ	1	582
医薬品（4.3%）		
協和キリン	109.3	297,022
武田薬品	800.7	3,336,516
アステラス製薬	793.5	1,197,788
住友ファーマ	67.2	23,452
塩野義製薬	110	676,170
わかもと製薬	3.2	828
日本新薬	23.7	76,124
中外製薬	283.2	1,399,574
科研製薬	15.5	58,218
エーザイ	110.1	701,887
ロート製薬	87.6	274,363

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
小野薬品	185.1	396,576
久光製薬	20.1	74,932
持田製薬	10.1	30,017
参天製薬	159.6	253,285
扶桑薬品	3.2	7,286
日本ケミファ	0.4	627
ツムラ	28.5	115,795
キッセイ薬品工業	15	47,175
生化学工業	15.4	12,951
栄研化学	15.6	32,510
鳥居薬品	4.9	17,542
ＪＣＲファーマ	30.7	18,020
東和薬品	13.9	42,047
富士製薬工業	6.7	9,802
ゼリア新薬工業	12.5	25,725
ネクセラファーマ	39.6	60,667
第一三共	788.2	4,256,280
杏林製薬	19.6	33,222
大幸薬品	18.8	7,482
ダイト	6.9	15,462
大塚ホールディングス	188.2	1,177,567
ペプチドリーム	43.9	99,082
セルソース	3.3	4,438
あすか製薬ＨＤ	9.3	22,310
サワイグループ HD	20.7	116,955
石油・石炭製品（0.6%）		
日本コークス工業	91.9	11,579
ニチレキ	11.7	28,395
ユシロ化学	4.7	8,619
ビーピー・カストロール	1.1	1,075
富士石油	26.3	14,228
ＭＯＲＥＳＣＯ	1.1	1,475
出光興産	469.8	497,518
ENEOS ホールディングス	1,432.4	1,155,946
コスモエネルギーHLDGS	26.8	208,477
ゴム製品（0.7%）		
横浜ゴム	45.7	161,960
TOYO TIRE	51.9	133,097
ブリヂストン	264.8	1,707,430
住友ゴム	88.7	143,560
藤倉コンポジット	7.8	10,826
オカモト	4.3	20,833
フコク	4.7	11,421
ニッタ	9.2	35,374
住友理工	14	18,592
三ツ星ベルト	10.4	45,344
バンドー化学	13.4	24,589
ガラス・土石製品（0.7%）		
日東紡績	11.5	75,095
ＡＧＣ	80.7	419,962
日本板硝子	43.2	18,057
石塚硝子	0.5	1,428
日本山村硝子	1.1	1,834
日本電気硝子	36.9	134,168
オハラ	4.3	5,611
住友大阪セメント	15.1	60,218

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
太平洋セメント	53.5	213,358
日本ヒューム	7.9	9,993
日本コンクリート	17.5	6,317
三谷セキサン	3.8	22,306
アジアパイルＨＤ	12.8	12,825
東海カーボン	83.5	76,653
日本カーボン	4.8	25,776
東洋炭素	6.4	44,544
ノリタケ	10	38,600
ＴＯＴＯ	59.7	219,576
日本碍子	105.2	209,716
日本特殊陶業	75.8	349,438
ダントーホールディングス	2	1,602
ＭＡＲＵＷＡ	3.3	124,740
品川リフラクトリーズ	11.1	22,066
黒崎播磨	7.4	20,919
ヨータイ	5.3	9,540
東京窯業	3.2	1,376
ニッカトー	1.4	778
フジミインコーポレーテッド	24.3	69,449
クニミネ工業	0.9	1,023
エーアンドエーマテリアル	0.6	792
ニチアス	22.9	108,088
ニチハ	11.3	38,137
鉄鋼（0.9%）		
日本製鉄	417.2	1,378,428
神戸製鋼所	187.2	364,384
中山製鋼所	21.3	19,809
合同製鐵	5.2	27,040
ＪＦＥホールディングス	258.9	584,078
東京製鐵	26.2	43,518
共英製鋼	10.6	21,698
大和工業	17.5	133,157
東京鐵鋼	4.1	21,566
大阪製鐵	4.3	10,152
淀川製鋼所	10.6	57,452
中部鋼鈑	6.1	17,964
丸一鋼管	28.3	105,191
モリ工業	2.1	10,584
大同特殊鋼	58.6	85,643
日本高周波	1.2	543
日本冶金工	6.8	30,872
山陽特殊製鋼	9.2	19,145
愛知製鋼	5.4	19,521
日本金属	0.8	591
大平洋金属	7.9	9,930
新日本電工	46.3	13,056
栗本鉄工所	4.3	20,016
虹技	0.4	465
日本鋳鉄管	0.3	462
三菱製鋼	6.9	10,232
日亜鋼業	3.3	1,059
日本精線	7.3	8,730
エンビプロＨＤ	8.2	4,346
シンニッタン	3.9	908
新家工業	0.7	3,689

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
非鉄金属（0.8%）		
大紀アルミニウム	11.8	14,773
日本軽金属ＨＤ	27.2	48,715
三井金属	27.1	129,619
東邦亜鉛	5.9	4,560
三菱マテリアル	66.5	189,724
住友鉱山	107.9	505,835
DOWA ホールディングス	23	124,154
古河機金	12.3	22,459
エス・サイエンス	17.9	411
大阪チタニウム	16.1	45,144
東邦チタニウム	19.2	25,401
ＵＡＣＪ	13	51,025
ＣＫサンエツ	2.3	8,406
古河電工	31	129,673
住友電工	348.2	887,561
フジクラ	109.8	359,375
ＳＷＣＣ	10.4	49,660
タツタ電線	16.4	12,611
カナレ電気	0.5	772
平河ヒューテック	5.9	8,560
リョービ	9.9	22,720
アーレステイ	3.4	2,346
ARE ホールディングス	35	69,895
金属製品（0.5%）		
稲葉製作所	5.2	10,108
宮地エンジニアリングＧ	4.7	22,113
トーカロ	26.8	51,161
アルファ CO	1.1	1,509
ＳＵＭＣＯ	165.3	387,876
川田テクノロジーズ	6.6	17,457
RS TECHNOLOGIES	6.2	21,886
ジェイテックコーポレーション	0.5	808
信和	2	1,482
東洋製罐グループ HD	53.4	132,298
ホッカンホールディングス	4.6	7,893
コロナ	5.2	4,830
横河ブリッジ HLDGS	14.6	38,091
駒井ハルテック	0.6	1,077
高田機工	0.2	732
三和ホールディングス	92.7	264,287
文化シヤッター	24.3	40,581
三協立山	11.7	9,207
アルインコ	7	7,490
東洋シヤッター	0.7	660
ＬＩＸＩＬ	145.3	240,980
日本フイルコン	2	1,034
ノーリツ	14.7	26,254
長府製作所	9.3	19,995
リンナイ	44.5	165,762
ダイニチ工業	1.6	1,076
日東精工	13.4	7,691
三洋工業	0.3	976
岡部	16.5	12,457
ジーテクト	11.8	22,101
東プレ	16.4	35,506

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
高周波熱錬	13.7	14,933
東京製綱	6	7,752
サンコール	9.4	4,230
モリテックスチル	2.8	641
パイオラックス	11.5	25,587
エイチワン	9.6	8,832
日本発条	82.4	126,937
中央発條	6.9	9,163
アドバネクス	0.4	445
立川ブラインド	4.2	5,560
三益半導体	8.4	30,870
機械（5.8%）		
日本ドライケミカル	0.7	1,803
日本製鋼所	25.1	107,854
三浦工業	38.1	120,662
タクマ	30.8	49,742
ツガミ	20.2	31,148
オークマ	8	52,992
芝浦機械	9.1	32,851
アマダ	138.1	235,391
アイダエンジニア	21	18,039
ＦＵＪＩ	42.9	105,534
牧野フライス	10.1	65,145
オーエスジー	40.1	75,448
ダイジェット	0.3	254
旭ダイヤモンド	21	18,963
DMG 森精機	62.2	258,565
ソディツク	22	15,620
ディスコ	43.9	2,804,332
日東工器	4.4	10,230
日進工具	8.5	8,143
パンチ工業	2.9	1,342
冨士ダイス	6.1	4,800
豊和工業	1.6	1,300
石川製作所	0.8	1,357
リケンＮＰＲ	9.9	26,393
東洋機械金属	2.5	1,795
津田駒工業	0.5	204
エンシュウ	0.7	491
島精機製作所	14.5	24,229
オプトラン	14.9	30,217
NC ホールディングス	0.7	1,545
イワキポンプ	6.1	15,237
フリュー	8.6	9,245
ヤマシンフィルタ	21.7	7,877
日阪製作所	9.9	10,127
やまびこ	14.8	32,116
野村マイクロ・サイエンス	12.3	53,935
平田機工	4.4	28,908
ＰＥＧＡＳＵＳ	10	5,540
マルマエ	4	8,412
タツモ	5.5	19,580
ナブテスコ	57.2	154,039
三井海洋開発	11.5	30,383
レオン自動機	10.5	16,296
ＳＭＣ	27.3	2,088,450

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ホソカワミクロン	6.3	25,011
ユニオンツール	4	23,920
瑞光	6.5	6,857
オイレス工業	12.3	28,167
日精エーエスビー	3.1	16,492
サトーホールディングス	13	26,858
技研製作所	8.6	16,477
日本エアーテック	4.2	4,960
カワタ	0.9	801
日精樹脂工業	6.6	6,672
オカダアイヨン	1	2,385
ワイエイシイホールディングス	3.8	9,351
小松製作所	427.1	1,870,270
住友重機械	53.9	221,475
日立建機	36.3	145,018
日工	13.6	10,036
巴工業	3.5	16,152
井関農機	8.5	8,772
ＴＯＷＡ	10.1	113,322
丸山製作所	0.5	1,165
北川鉄工所	3.6	5,094
ローツェ	4.8	147,120
タカキタ	1	458
クボタ	476.3	1,049,050
荏原実業	4.8	17,496
三菱化工機	3.2	13,328
月島ホールディングス	12.3	16,998
帝国電機製作所	6.2	14,917
東京機械	0.8	321
新東工業	18.4	19,191
渋谷工業	8.5	32,470
アイチ コーポレーション	12.6	14,842
小森コーポレーション	22.4	28,851
鶴見製作所	7	28,945
日本ギア工業	1.1	618
酒井重工業	1.6	9,280
荏原製作所	37.4	445,434
石井鉄工所	0.3	846
酉島製作所	7.8	26,325
北越工業	9.2	22,540
ダイキン工業	108.8	2,498,048
オルガノ	10.9	91,451
トーヨーカネツ	3.1	11,811
栗田工業	51	341,700
椿本チエイン	12.5	75,875
大同工業	1.3	1,138
木村化工機	6.9	4,850
アネスト岩田	14	20,664
ダイフク	153.8	446,020
サムコ	2.2	8,327
加藤製作所	1.6	2,016
油研工業	0.5	1,166
タダノ	52.4	56,958
フジテック	21.3	88,757
ＣＫＤ	25.2	81,396
平和	27	54,702

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
理想科学工業	7.3	23,287
ＳＡＮＫＹＯ	87.7	146,283
日本金銭機械	11	14,608
マースグループ HLDGS	4.5	16,830
フクシマガリレイ	6	38,340
オーイズミ	1.1	392
ダイコク電機	4.5	18,022
竹内製作所	16.5	92,730
アマノ	25.9	103,341
ＪＵＫＩ	14	7,014
サンデン	4.3	709
ジャノメ	9.2	6,200
マックス	12.8	49,280
グローリー	21.9	59,381
新晃工業	9.2	34,730
大和冷機工業	14	20,818
セガサミーホールディングス	81.4	194,546
ＴＰＲ	11.6	28,327
ツバキ・ナカシマ	18.2	13,795
ホシザキ	53.8	272,443
大豊工業	8	6,160
日本精工	168.7	126,390
ＮＴＮ	197.5	58,124
ジェイテクト	81.1	85,560
不二越	6.7	22,947
日本トムソン	24.7	14,696
ＴＨＫ	52.6	149,647
ユーシン精機	7.1	5,069
前澤給装工業	6.5	8,599
イーグル工業	10.1	18,977
前澤工業	1.9	2,726
日本ピラー工業	8.4	44,268
キッツ	30.5	34,007
マキタ	103.9	458,510
三井Ｅ＆Ｓ	45.2	62,059
日立造船	80.4	82,651
三菱重工業	1,593.2	2,370,681
ＩＨＩ	67.8	254,792
サノヤスホールディングス	4.3	838
スター精密	16.6	35,291
電気機器（17.8%）		
日清紡ホールディングス	68.4	74,692
イビデン	47.5	314,925
コニカミノルタ	203.4	90,167
ブラザー工業	121.7	338,021
ミネベアミツミ	158.5	503,871
日立	437.9	7,323,877
三菱電機	1,014.1	2,565,673
富士電機	55.4	496,217
東洋電機製造	1.1	1,175
安川電機	99	579,150
シンフォニア テクノロジー	10	34,050
明電舎	16.9	68,698
オリジン	0.7	927
山洋電気	3.9	26,442
デンヨー	6.9	18,774

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
PHCホールディングス	17	19,431
KOKUSAI ELECTRIC	47.3	236,500
ソシオネクスト	66.4	267,592
東芝テック	11.7	37,089
芝浦メカトロニクス	5.2	40,664
マブチモーター	44.8	107,990
ニデック	201.1	1,458,980
ユーエムシーエレクトロニクス	5.8	2,302
トレックス・セミコンダクター	4.7	8,695
東光高岳	5.5	10,978
ダブル・スコープ	26	13,884
ダイヘン	8.6	70,090
ヤーマン	17.7	16,089
ＪＶＣケンウッド	71.9	63,847
ミマキエンジニアリング	8.5	18,173
Ｉ－ＰＥＸ	6.3	12,423
大崎電気	20	13,080
オムロン	69.6	356,769
日東工業	12.3	41,082
ＩＤＥＣ	13.4	38,752
正興電機製作所	1	1,558
不二電機工業	0.6	673
ジーエス・ユアサ コーポ	35.6	115,023
サクサホールディングス	0.7	1,822
メルコホールディングス	2.8	9,758
テクノメディカ	2.2	3,920
ダイヤモンドエレクトリクHD	3.4	2,363
日本電気	119.6	1,476,462
富士通	838.4	1,992,457
沖電気	40.5	39,852
岩崎通信機	1.4	2,241
電気興業	3.6	7,470
サンケン電気	8.5	55,496
ナカヨ	0.5	583
アイホン	4.9	14,655
ルネサスエレクトロニクス	567.9	1,784,909
セイコーエプソン	116.9	280,676
ワコム	66.3	47,139
アルバック	20	211,100
アクセル	4.1	6,322
ＥＩＺＯ	6.6	31,119
ジャパンディスプレイ	61.7	863
日本信号	20.8	20,675
京三製作所	19	12,578
能美防災	12.3	27,588
ホーチキ	6.8	15,116
星和電機	1.3	721
エレコム	21.3	33,270
パナソニック ホールディングス	1,076.3	1,355,061
シャープ	153.6	151,004
アンリツ	64.2	73,412
富士通ゼネラル	25.8	54,141
ソニーグループ	631.7	8,019,431
ＴＤＫ	144.3	1,278,930
帝国通信工業	3.9	7,663
タムラ製作所	36.3	25,918

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
アルプスアルパイン	81.4	124,338
池上通信機	0.9	692
日本電波工業	10.9	12,077
鈴木	4.8	7,185
メイコー	9	66,960
日本トリム	2.1	7,098
ローランド ディー．ジー．	4.7	25,098
フオスター電機	6.7	11,952
ＳＭＫ	2.4	5,724
ヨコオ	8	16,848
ティアック	4.8	456
ホシデン	20.7	41,917
ヒロセ電機	13.4	239,994
日本航空電子	21.8	53,955
ＴＯＡ	10.3	11,124
マクセル	20.2	37,551
古野電気	11.7	23,388
スミダコーポレーション	12.2	14,164
アイコム	3.4	10,251
リオン	3.7	10,356
横河電機	99.7	376,866
新電元工業	3.5	10,395
アズビル	62.1	256,286
東亜ディーケーケー	1.4	1,192
日本光電工業	38.7	181,038
チノー	3.7	9,102
共和電業	2.7	1,196
日本電子材料	5.5	19,497
堀場製作所	17.2	202,100
アドバンテスト	258.4	1,379,080
小野測器	1.2	823
エスペック	7.2	22,572
キーエンス	90.2	6,114,658
日置電機	4.2	28,350
シスメックス	233.5	590,521
日本マイクロニクス	16.2	95,418
メガチップス	7.1	30,068
OBARA GROUP	5.6	23,520
澤藤電機	0.3	365
原田工業	1.3	748
コーセル	9.6	12,787
イリソ電子工業	8.2	24,140
オプテックスグループ	16.5	25,707
千代田インテグレ	3.5	11,305
レーザーテック	41.3	1,493,821
スタンレー電気	57.8	161,233
ウシオ電機	39.8	81,291
岡谷電機	2.2	539
ヘリオステクノＨ	2.9	2,552
エノモト	0.8	1,198
日本セラミック	7.3	18,483
遠藤照明	1.3	1,952
古河電池	6.7	8,817
山一電機	8.1	28,066
図研	7.4	28,527
日本電子	22.6	147,058

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
カシオ	65.1	76,232
ファナック	439.9	1,876,173
日本シイエムケイ	21.2	12,804
エンプラス	2.6	20,852
大真空	13.4	9,272
ローム	166.8	354,199
浜松ホトニクス	72.4	321,745
三井ハイテック	8	50,224
新光電気工業	31.9	181,479
京セラ	560.5	1,015,345
太陽誘電	43.9	178,102
村田製作所	820.8	2,657,750
双葉電子工業	17.4	10,440
北陸電気工業	1.1	1,508
ニチコン	23.7	27,397
日本ケミコン	9.6	15,158
ＫＯＡ	13.6	19,910
市光工業	16.3	8,818
小糸製作所	93.5	200,697
ミツバ	16.9	18,353
SCREENホールディングス	30.8	453,530
キヤノン電子	10	22,790
キヤノン	449.9	1,961,114
リコー	226.2	307,179
象印マホービン	24.5	35,917
MUTOHホールディングス	0.4	1,050
東京エレクトロン	190.9	6,505,872
イノテック	6	10,266
輸送用機器（8.3%）		
トヨタ紡織	38	78,774
芦森工業	0.6	1,455
ユニプレス	16.2	21,934
豊田自動織機	76.9	995,086
モリタホールディングス	15.8	29,119
三桜工業	13.8	13,524
デンソー	744.3	1,742,406
東海理化電機	25.4	52,476
川崎重工業	73.6	415,177
名村造船所	25.3	53,205
日本車輌	3	7,050
三菱ロジスネクスト	14.4	19,684
近畿車輌	0.4	772
日産自動車	1,187	617,002
いすゞ自動車	253.3	501,280
トヨタ自動車	4,953.2	15,037,915
日野自動車	135.8	56,479
三菱自動車工業	352	144,883
エフテック	2.1	1,302
レシップホールディングス	1.3	852
ＧＭＢ	0.6	858
ファルテック	0.5	270
武蔵精密工業	22	40,986
日産車体	9.2	9,108
新明和工業	26	35,646
極東開発工業	14.9	36,281
トピー工業	7.3	17,359

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ティラド	2	6,930
タチエス	16.7	31,629
ＮＯＫ	35	73,500
フタバ産業	24.2	20,352
カヤバ	8.5	45,135
大同メタル工業	17.8	10,626
プレス工業	35.8	22,410
ミクニ	3.7	1,468
太平洋工業	20.8	30,908
河西工業	4.6	883
アイシン	69.6	375,631
マツダ	298.4	429,994
今仙電機製作所	1.9	1,153
本田技研	2,137.4	3,510,679
スズキ	662.7	1,184,576
SUBARU	279.7	912,381
安永	1.3	773
ヤマハ発動機	389.8	573,006
ＴＢＫ	3.1	936
エクセディ	14.8	42,402
豊田合成	25.9	69,981
愛三工業	15	19,635
盟和産業	0.4	401
日本プラスト	2.5	1,042
ヨロズ	8.4	9,374
エフ・シー・シー	16	36,256
シマノ	36.4	915,642
テイ・エス テック	32.1	59,368
ジャムコ	4.9	6,982
精密機器（2.2%）		
テルモ	502.9	1,294,716
クリエートメディック	1	984
日機装	21	24,171
日本エム・ディ・エム	7.2	4,514
島津製作所	119.9	469,648
ＪＭＳ	8.4	4,460
クボテック	0.8	169
長野計器	6.5	19,922
ブイ・テクノロジー	4.7	14,664
東京計器	6.9	23,425
愛知時計	3.9	8,771
インターアクション	5.4	8,580
オーバル	2.6	1,177
東京精密	18.5	218,762
マニー	36	67,716
ニコン	130.4	198,142
トプコン	43.8	74,679
オリンパス	516.4	1,342,640
理研計器	12.8	48,704
タムロン	5.5	46,530
ＨＯＹＡ	177.6	3,211,008
シード	1.8	991
ノーリツ鋼機	8.5	38,080
A&Dホロンホールディングス	13.1	36,326
朝日インテック	109.9	240,131
シチズン時計	83	83,332

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
リズム	0.7	2,607
大研医器	2.5	1,330
メニコン	31	39,246
シンシア	0.3	135
松風	4.1	17,363
セイコーグループ	12.6	61,173
ニプロ	75.2	91,104
その他製品（2.5%）		
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	4.3	709
中本パックス	1	1,616
パラマウントベッドHD	18.7	51,107
トランザクション	6	11,610
粧美堂	0.8	444
ニホンフラッシュ	8.5	7,658
前田工繊	8	25,280
永大産業	3.4	819
アートネイチャー	8	6,512
フルヤ金属	2.9	37,874
パンダイナムコHLDGS	247.1	738,581
アイフィスジャパン	0.8	475
ＳＨＯＥＩ	25.3	51,207
フランスベッドHLDGS	11.7	13,665
パイロットコーポレーション	12.7	54,991
萩原工業	6	9,012
フジシールインターナショナル	18.3	44,340
タカラトミー	41	126,239
広済堂ホールディングス	26.2	15,458
エステールホールディングス	0.7	455
タカノ	1.1	974
プロネクサス	9.4	11,778
ホクシン	2.2	257
ウッドワン	1.1	1,002
TOPPANホールディングス	110.9	489,734
大日本印刷	93.5	490,501
共同印刷	2.6	9,243
ＮＩＳＳＨＡ	15.4	31,570
光村印刷	0.2	322
TAKARA & COMPANY	5.3	15,693
アシックス	76.9	697,559
ツツミ	2.1	4,418
ローランド	6.6	26,961
小松ウオール工業	3.7	11,710
ヤマハ	56.9	209,505
河合楽器	2.7	8,734
クリナップ	8.7	6,220
ピジョン	57.4	86,501
キングジム	8	7,168
リンテック	18.1	59,006
イトーキ	17.2	28,878
任天堂	569.5	4,790,064
三菱鉛筆	12.8	32,051
タカラスタンダード	18.4	30,856
コクヨ	36.9	96,678
ナカバヤシ	9.8	5,252
グローブライド	8.1	17,301
オカムラ	27.2	58,616

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
美津濃	9	73,620
電気・ガス業（1.5%）		
東京電力ＨＤ	813.1	695,200
中部電力	332.4	634,884
関西電力	348.3	958,695
中国電力	156.7	167,120
北陸電力	92.2	97,593
東北電力	237.5	346,750
四国電力	84	119,784
九州電力	207.9	358,315
北海道電力	87.1	123,290
沖縄電力	23.1	25,433
電源開発	74.1	185,620
エフオン	6.7	2,747
イーレックス	16.1	10,867
レノバ	24.1	24,292
東京瓦斯	175.6	623,028
大阪瓦斯	179.8	631,997
東邦瓦斯	39.1	157,768
北海道瓦斯	5.4	18,441
広島ガス	19.1	7,258
西部ガス HLDGS	9.4	18,621
静岡ガス	18	16,830
メタウォーター	10.8	20,541
陸運業（2.2%）		
SBSホールディングス	8	21,432
東武鉄道	99.1	258,849
相鉄ホールディングス	32.3	75,291
東急	253	443,635
京浜急行	111.7	126,276
小田急電鉄	149.2	224,993
京王電鉄	43.4	153,679
京成電鉄	58.2	310,904
富士急行	11.1	30,747
東日本旅客鉄道	497.2	1,245,734
西日本旅客鉄道	214	618,460
東海旅客鉄道	347.5	1,142,927
西武ホールディングス	109.1	238,765
鴻池運輸	15.4	36,421
西日本鉄道	24.1	60,527
ハマキョウレックス	7.7	32,263
サカイ引越センター	10	24,490
近鉄グループHLDGS	90	293,130
阪急阪神 HLDGS	120.1	474,635
南海電鉄	40.2	101,846
京阪ホールディングス	49.6	137,689
神戸電鉄	2.4	6,537
名古屋鉄道	92.9	156,397
山陽電鉄	6.7	13,708
アルプス物流	7.2	41,112
ヤマトホールディングス	109.5	182,755
山九	21.7	116,702
丸運	1.7	634
丸全昭和運輸	5.6	28,448
センコーグループHLDGS	47.8	52,962
トナミホールディングス	2	10,980

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ニッコンホールディングス	27.7	82,767
日石輸送	0.3	909
福山通運	10.3	41,818
セイノーホールディングス	50.6	104,362
エスライングループ本社	0.8	1,172
神奈川中央交通	2.6	7,865
AZ-COM丸和ホールディ	23.1	27,096
C&Fロジホールディングス	8.3	47,559
九州旅客鉄道	63.7	211,866
SGホールディングス	151.3	221,124
NIPPON EXPRESS	30.6	222,615
海運業（0.8%）		
日本郵船	233.3	1,091,144
商船三井	195.6	948,660
川崎汽船	217	492,590
NSユナイテッド海運	4.8	22,944
明海グループ	3.3	2,267
飯野海運	33	41,877
共栄タンカー	0.6	763
乾汽船	10.5	11,602
空運業（0.4%）		
日本航空	221.1	544,348
ANAホールディングス	245	707,682
パスコ	0.6	1,054
倉庫・運輸関連業（0.1%）		
トランコム	2.6	16,458
日新	6.8	30,634
三菱倉庫	21.5	111,004
三井倉庫 HOLD	8.4	37,674
住友倉庫	24	60,816
渋沢倉庫	4.1	12,382
東陽倉庫	0.8	1,194
日本トランスシティ	18.2	17,453
ケイヒン	0.5	1,170
中央倉庫	4.8	5,808
川西倉庫	0.6	714
安田倉庫	6.2	10,062
ファイズホールディングス	0.4	418
東洋埠頭	0.9	1,222
上組	41.6	136,572
サンリツ	0.7	620
キムラユニティー	1.4	2,387
キユーソー流通システム	4.6	7,562
東海運	1.7	498
エーアイテイー	5.6	10,164
内外トランスライン	3.6	9,727
日本コンセプト	3.2	6,083
情報・通信業（7.1%）		
NECネッツエスアイ	35.3	81,507
クロスキャット	5.7	7,786
システナ	137.1	40,307
デジタルアーツ	5.7	21,916
日鉄ソリューションズ	15.4	79,002
キューブシステム	4.8	5,409
コア	4	7,492
手間いらず	1.5	4,500

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ラクーンホールディングス	6.7	3,752
ソリトンシステムズ	4.7	5,353
ソフトクリエイトHD	7.4	14,814
ＴＩＳ	95.6	271,551
テクミラホールディングス	1.3	513
グリー	30.2	16,006
GMOペパボ	1.1	1,598
コーエーテクモＨＤ	56.7	77,565
三菱総合研究所	4.4	20,856
ボルテージ	0.8	205
電算	0.4	592
ＡＧＳ	1.2	1,195
ファインデックス	7.2	7,632
ブレインパッド	7.5	7,875
ＫＬａｂ	16.6	3,784
ポールトゥウィンホールディン	15.4	7,607
ネクソン	198.5	576,841
アイスタイル	30.2	15,220
エムアップホールディングス	11.1	14,874
エイチーム	5.9	4,236
エニグモ	11.6	3,712
テクノスジャパン	2.7	1,717
ｅｎｉｓｈ	3.2	867
コロプラ	30.7	19,064
オルトプラス	2.8	369
ブロードリーフ	42.9	22,994
クロス・マーケティングG	1.4	855
デジタルハーツHLDGS	5.6	5,964
メディアドゥ	4.1	5,981
じげん	26.4	16,288
ブイキューブ	10.9	2,681
エンカレッジ・テクノロジ	0.7	438
サイバーリンクス	1.2	904
ディー・エル・イー	4.3	705
フィックスターズ	9.1	17,244
CARTA HOLDINGS	4.2	6,682
オプティム	9.3	5,952
セレス	3.7	7,222
ＳＨＩＦＴ	6	91,470
ティーガイア	9.5	18,705
セック	1.2	5,376
テクマトリックス	16.5	31,581
プロシップ	4.3	6,015
ガンホー・オンライン・エンター	23.5	64,954
GMOペイメントゲートウェイ	20.7	166,138
ザッパラス	0.7	303
システムリサーチ	6.2	9,529
インターネットイニシアティブ	43.3	94,155
さくらインターネット	10.1	49,995
GMOグローバルサインHD	2.8	8,428
SRAホールディングス	4.6	18,377
システムインテグレータ	0.9	333
朝日ネット	9.7	6,227
ｅＢＡＳＥ	12.8	8,998
アバントグループ	11.5	15,375
アドソル日進	3.8	6,843

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ODKソリューションズ	0.6	343
フリービット	3.9	4,629
コムチュア	13.1	23,422
アステリア	7.1	3,777
アイル	5.1	12,449
マークラインズ	4.9	14,508
メディカル・データ・ビジ	10.8	6,177
ｇｕｍｉ	14.7	4,733
ショーケース	0.7	209
モバイルファクトリー	0.6	395
テラスカイ	3.9	7,605
デジタル・インフォメーション	4.7	8,629
PCIホールディングス	1.2	1,160
アイビーシー	0.5	228
ネオジャパン	3	4,938
ＰＲＴＩＭＥＳ	1.8	3,310
ラクス	42.8	81,084
ランドコンピュータ	1.4	1,127
ダブルスタンダード	2.8	4,706
オープンドア	5.3	3,317
マイネット	0.9	306
アカツキ	4.4	10,128
ベネフィットジャパン	0.2	240
UBICOMホールディングス	2.8	3,530
カナミックネットワーク	11.3	6,542
ノムラシステムコーポレーション	3.2	419
チェンジホールディングス	19.7	22,792
シンクロ・フード	1.9	963
オークネット	3.3	8,514
キャピタル・アセット・プラン	0.6	504
セグエグループ	2.7	1,636
エイトレッド	0.4	626
マクロミル	17.8	15,592
ビーグリー	0.6	639
オロ	3.3	8,124
ユーザーローカル	3.8	7,482
テモナ	0.7	149
ニーズウェル	3.2	1,206
マネーフォワード	20.2	103,585
サインポスト	1.2	834
SUN ASTERISK	6.4	5,542
電算システムＨＤ	4	10,596
APPIER GROUP	31	39,308
ビジョナル	10.6	75,790
ソルクシーズ	2.3	740
フェイス	0.8	348
プロトコーポレーション	9.9	13,860
ハイマックス	2.8	3,757
野村総合研究所	195.9	826,893
ＣＥホールディングス	1.4	812
日本システム技術	7.5	11,782
インテージホールディングス	10.2	14,392
東邦システムサイエンス	3.8	6,099
ソースネクスト	41.4	8,031
インフォコム	11.7	67,158
シンプレクスＨＤ	13.7	38,236

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ＨＥＲＯＺ	3.6	4,399
ラクスル	21.9	21,024
メルカリ	44.1	92,345
ＩＰＳ	2.6	5,686
ＦＩＧ	3.4	1,122
システムサポート	3.5	5,995
イーソル	6.5	5,915
東海ソフト	0.5	645
ウイングアーク1ST	9.4	25,577
ヒト・コミュニケーションズHD	3	2,643
サーバーワークス	1.9	6,108
東名	0.3	716
ヴィッツ	0.3	242
トビラシステムズ	0.9	706
Ｓａｎｓａｎ	29.7	49,985
LINK-Uグループ	0.6	357
ギフティ	7.9	8,761
メドレー	12.2	44,530
ベース	3.2	8,844
ＪＭＤＣ	15.4	51,959
フォーカスシステムズ	6	6,846
クレスコ	7.4	17,242
フジ・メディア・HD	86.9	157,202
オービック	30.2	614,721
ジャストシステム	13	37,700
ＴＤＣソフト	16.9	17,576
ＬＩＮＥヤフー	1,288.2	469,677
トレンドマイクロ	42.8	281,067
IDホールディングス	6.1	8,649
日本オラクル	17.3	203,275
アルファシステムズ	2.4	7,200
フューチャー	19.3	28,892
CAC HOLDINGS	4.8	9,273
トーセ	0.8	557
オービックビジネスC	12.7	79,006
アイティフォー	11.6	16,240
東計電算	2.5	9,287
エックスネット	0.4	595
大塚商会	89.7	258,829
サイボウズ	12.5	22,850
電通総研	11	58,630
ＡＣＣＥＳＳ	9.4	13,103
デジタルガレージ	14.5	31,624
イーエムシステムズ	15.1	9,467
ウェザーニューズ	2.8	12,544
ＣＩＪ	22.5	10,170
ビジネスエンジニアリング	1.9	6,612
日本エンタープライズ	3	408
WOWOW	6.9	7,417
スカラ	8.2	5,863
インテリジェント ウェイブ	1.6	1,635
IMAGICA GROUP	8.8	4,734
ネットワンシステムズ	35.1	92,102
システムソフト	31.4	1,946
アルゴグラフィックス	8.2	37,105
マーベラス	14.6	9,212

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
エイベックス	15.4	18,480
ＢＩＰＲＯＧＹ	29.6	123,580
都築電気	4.7	10,824
TBSホールディングス	45.5	179,907
日本テレビHLDS	80.1	177,421
朝日放送グループHD	8.5	5,610
テレビ朝日ＨＤ	22	45,518
スカパーJSATHD	70.3	60,317
テレビ東京ＨＤ	6.5	21,937
日本ＢＳ放送	1.1	994
ビジョン	13.5	15,795
スマートバリュー	0.8	310
U-NEXT HOLDINGS	10.1	47,470
ワイヤレスゲート	1.3	297
日本通信	88.8	16,605
クロップス	0.4	456
日本電信電話	26,911.6	3,899,490
ＫＤＤＩ	699.1	2,918,742
ソフトバンク	1,444.5	2,810,274
光通信	9.1	253,435
エムティーアイ	6.2	5,108
GMOインターネットグループ	33.2	79,215
ファイバーゲート	4.9	5,130
アイドママーケティングコミュ	0.8	184
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	47.8	136,301
学研ホールディングス	16.6	16,268
ゼンリン	15.4	13,952
昭文社ホールディングス	1.2	430
インプレスホールディングス	2.9	464
アイネット	5.5	11,638
松竹	4.7	44,029
東宝	50.3	230,826
東映	14.9	54,683
NTTデータグループ	236.5	522,901
ピー・シー・エー	5.2	11,679
ビジネスＢ太田昭和	3.5	7,521
ＤＴＳ	19	78,565
スクウェア・エニックス・HD	41.3	186,304
シーイーシー	11.4	24,339
カプコン	161.8	462,343
アイ・エス・ビー	4.6	6,371
ジャステック	5.2	10,056
ＳＣＳＫ	63.3	194,204
ＮＳＷ	4	12,540
アイネス	7.1	11,878
ＴＫＣ	16.2	52,569
富士ソフト	18.2	125,034
ＮＳＤ	31.9	97,135
コナミグループ	33.9	365,103
福井コンピュータHLDS	5.6	13,238
JBCCホールディングス	6	19,410
ミロク情報サービス	8.2	15,063
ソフトバンググループ	446.3	4,516,556
卸売業（7.7%）		
リョーサン菱洋HD	17.1	52,497
高千穂交易	3.4	12,920

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
オルバヘルスケアHLDGS	0.5	1,067
伊藤忠食品	2.2	15,928
エレマテック	8.5	16,864
あらた	14.6	49,275
トーメンデバイス	1.4	10,752
東京エレクトロンデバイス	9.5	39,330
円谷フィールズホールディ	16.4	28,208
双日	106.2	407,595
アルフレッサホールディングス	95.8	203,096
横浜冷凍	24	24,384
神栄	0.5	913
ラサ商事	4.3	7,486
アルコニックス	12.6	18,585
神戸物産	73.8	255,274
ハイパー	0.7	218
あい ホールディングス	15.3	36,750
ディーブイエックス	0.9	900
ダイワボウＨＤ	42.1	112,785
マクニカホールディングス	22.6	145,137
ラクト・ジャパン	3.7	10,826
グリムス	4	10,060
バイタルＫＳＫ HD	14.4	19,166
八洲電機	7.7	12,266
メディアスホールディングス	5.5	5,318
レスター	8.1	25,353
ジオリーブグループ	0.7	833
大光	1.7	1,035
OCHIホールディングス	0.7	1,008
TOKAIホールディングス	51.7	49,425
黒谷	0.9	615
Ｃｏｍｉｎｉｘ	0.6	528
三洋貿易	9.7	14,782
ビューティガレージ	3	4,776
ウイン・パートナーズ	6.1	7,210
ミタチ産業	0.9	965
シップヘルスケアHD	34.3	78,255
明治電機工業	3.5	6,016
デリカフーズHLDGS	1.4	796
スターティアホールディングス	0.8	1,682
コメダホールディングス	23.4	63,601
ピーバンドットコム	0.4	151
アセンテック	3.7	2,068
富士興産	0.9	1,541
協栄産業	0.3	838
フルサト・マルカHD	8.5	18,054
ヤマエグループHD	8.4	20,109
小野建	9.6	15,196
南陽	1.3	1,424
佐鳥電機	5.9	11,929
エコートレーディング	0.6	787
伯東	5.5	28,160
コンドーテック	7.3	9,949
中山福	1.8	669
ナガイレーベン	12.1	30,032
三菱食品	8.8	47,256
松田産業	7.3	20,184

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
第一興商	37	59,810
メディパルHD	97	227,416
ＳＰＫ	4.2	9,227
萩原電気HLDGS	4.1	16,810
アズワン	29.6	77,344
スズデン	3.3	6,385
尾家産業	0.8	1,627
シモジマ	6.4	8,243
ドウシシャ	8.9	19,891
小津産業	0.7	1,131
高速	5.7	12,773
たけびし	3.6	7,722
リックス	2.2	6,534
丸文	8.5	10,693
ハピネット	8.1	30,456
橋本総業HLDGS	3.8	5,126
日本ライフライン	25.6	27,315
タカショー	8.3	4,233
ＩＤＯＭ	25.2	34,675
進和	5.8	16,176
エスケイジャパン	0.8	696
ダイトロン	3.8	11,331
シークス	13.6	17,707
田中商事	0.9	719
オーハシテクニカ	5	8,565
白銅	2.6	7,579
ダイコー通産	0.3	354
伊藤忠	641.6	4,734,366
丸紅	791.6	2,360,551
高島	2.1	2,179
長瀬産業	43.7	130,968
蝶理	6	20,850
豊田通商	83.6	736,683
三共生興	13.2	9,543
兼松	39.9	103,261
ツカモトコーポレーション	0.5	593
三井物産	714.9	5,311,707
日本紙パルプ	4.5	26,595
カメイ	10.2	22,021
東都水産	0.2	1,292
OUGホールディングス	0.5	1,361
スターゼン	6.6	18,183
山善	28.9	41,384
椿本興業	5.9	12,673
住友商事	577.6	2,252,062
内田洋行	3.9	29,406
三菱商事	1,832.6	5,644,408
第一実業	9	20,979
キヤノンマーケティングJPN	22.1	97,483
西華産業	3.7	16,409
佐藤商事	6.6	10,718
東京産業	8.7	5,794
ユアサ商事	7.5	41,100
神鋼商事	2.4	17,448
トルク	2.3	510
阪和興業	17.1	101,403

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
正栄食品	6.4	29,536
カナデン	7.2	11,311
ＲＹＯＤＥＮ	7.7	20,089
岩谷産業	21.7	200,573
ナイス	2.5	4,650
ニチモウ	1	2,104
極東貿易	5.7	9,752
アステナホールディングス	18	8,730
三愛オブリ	22.3	47,119
稲畑産業	18.8	63,544
ＧＳＩクレオス	5.1	10,995
明和産業	11.2	7,974
クワザワホールディングス	1.1	932
ワキタ	15.8	26,891
東邦ホールディングス	25.8	99,123
サンゲツ	22	66,880
ミツウロコグループ	12.2	19,190
シナネンホールディングス	2.6	12,298
伊藤忠エネクス	23.7	35,668
サンリオ	77.5	214,791
サンワ テクノス	4.9	11,093
新光商事	12.8	12,224
トーホー	3.7	13,838
三信電気	3.9	8,209
東陽テクニカ	8.8	14,044
モスフード サービス	14	50,400
加賀電子	8.7	48,372
ソーダニッカ	9.1	10,019
立花エレテック	6.3	19,404
フオーバル	3.7	5,287
ＰＡＬＴＡＣ	12.9	55,998
三谷産業	16.8	5,880
太平洋興発	1.2	936
西本WISMETTAC HD	2.4	10,452
ヤマシタヘルスケアHLDGS	0.2	526
コーア商事HLDGS	6.7	4,623
KPPグループホールディン	24.7	19,685
ヤマタネ	4.2	11,991
丸紅建材リース	0.2	604
泉州電業	5.9	30,857
トラスコ中山	20.1	47,777
オートバックスセブン	33.2	50,281
モリト	6.8	9,615
加藤産業	11.8	49,796
北恵	0.8	688
イエローハット	15.1	32,027
JKホールディングス	7.3	7,321
日伝	6.3	22,869
北沢産業	1.9	710
杉本商事	4.6	11,007
因幡電機産業	24.8	94,240
東テク	9.5	23,702
ミスミグループ本社	144.2	378,813
アルテック	1.6	424
タキヒヨー	0.8	936
蔵王産業	0.6	1,538

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
スズケン	34.1	157,848
ジェコス	5.7	5,568
小売業（4.1%）		
サンエー	7.3	35,332
カワチ薬品	7.5	21,075
エービーシー・マート	41.8	117,437
ハードオフコーポレーション	3.8	8,143
アスクル	23	50,025
ゲオホールディングス	10.7	16,724
アダストリア	11.5	40,020
ジーフット	2.5	717
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	0.4	254
くら寿司	11.2	48,160
キャンドゥ	3.4	10,761
IKホールディングス	1.1	424
パルグループHLDGS	18.7	33,323
エディオン	37.8	59,648
サーラコーポレーション	20.1	16,080
ワッツ	1.4	961
ハローズ	4.3	18,275
フジオフードＧ本社	10.7	15,825
あみやき亭	2.3	13,984
ひらまつ	7.3	1,533
大黒天物産	2.9	24,389
ハニーズホールディングス	8.5	13,447
ファーマライズHD	0.7	448
アルペン	7.9	16,179
ハブ	1	869
クオールホールディングス	13.1	18,746
ジンズホールディングス	7.3	28,360
ビックカメラ	57.1	92,102
DCMホールディングス	49.4	72,519
ペッパーフードサービス	24.1	3,060
ＭｏｎｏｔａＲＯ	135.3	251,522
東京一番フーズ	0.9	460
ＤＤグループ	2	2,424
きちりホールディングス	0.9	822
J.フロントリテイリング	109.5	179,634
ドトール・日レスＨＤ	16.9	36,825
マツキヨココカラ＆カンパニー	173.6	373,326
ブロンコビリー	5.6	21,952
ＺＯＺＯ	60.8	232,012
トレジャー・ファクトリー	5.9	10,448
物語コーポレーション	15.9	54,537
三越伊勢丹ＨＤ	158	495,804
Ｈａｍｅｅ	3.8	4,294
マーケットエンタープライズ	0.3	273
ウエルシアＨＤ	49.5	98,678
クリエイトＳＤＨ	13.5	47,857
丸善CHI HD	3.9	1,318
ミサワ	0.7	434
ティーライフ	0.4	570
エー・ピーホールディングス	0.8	761
チムニー	1	1,314
シュッピン	8.6	11,481
オイシックス・ラ・大地	12.8	15,142

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ネクステージ	21.8	52,690
ジョイフル本田	27.7	58,973
エターナルホスピタリティグル	3.5	12,862
ホットランド	7.3	18,476
すかいらーくHD	130.5	296,365
SFPホールディングス	4.6	9,632
綿半ホールディングス	7.3	12,125
ヨシックスホールディングス	2.2	6,237
ユナイテッド・スーパーマーケ	26.8	23,369
ゴルフダイジェスト・オン	4.3	2,360
ＢＥＥＮＯＳ	5.7	13,110
あさひ	8.8	13,024
日本調剤	6.3	8,851
コスモス薬品	8.1	103,032
トーエル	1.4	1,139
セブン＆アイ・HLDGS	977	1,951,557
クリエイト・レストランツ・ホール	64.6	72,222
ツルハホールディングス	20	180,980
サンマルクホールディングス	7.7	16,547
フェリシモ	0.8	741
トリドールホールディングス	26.7	95,505
TOKYO BASE	10.2	3,294
ウイルプラスHLDGS	0.6	681
JMホールディングス	7.2	19,936
サツドラホールディングス	1.3	1,157
アレンザホールディングス	7.1	7,795
串カツ田中HLDGS	2.5	4,162
バロックジャパン	7.3	5,818
クスリのアオキHLDGS	28.7	88,826
力の源HD	5.5	8,035
FOOD&LIFE COMPAN	50.9	132,314
メディカルシステムネットワーク	10.3	5,963
一家ホールディングス	0.8	545
ジャパンクラフトホールディ	2.7	423
はるやまHLDGS	1.5	888
ノジマ	27.7	43,461
カッパ・クリエイト	15	25,500
ライトオン	2.3	894
良品計画	113.6	307,174
パリミキホールディングス	4	1,576
アドヴァングループ	8.1	7,735
アルビス	3.1	8,066
コナカ	3.7	1,002
ハウス ローゼ	0.4	635
G-7ホールディングス	10.4	15,662
イオン北海道	28.3	25,724
コジマ	18.4	16,817
ヒマラヤ	1.1	1,003
コーナン商事	11.7	47,736
エコス	3.5	7,819
ワタミ	10	8,970
マルシェ	1.1	273
パンパシフィックHD	192.8	714,902
西松屋チェーン	18.8	40,908
ゼンショーホールディングス	48.6	295,293
幸楽苑ホールディングス	7	9,282

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ハークスレイ	1	790
サイゼリヤ	14.1	73,884
ＶＴホールディングス	37.2	18,079
魚力	3.3	8,045
ポプラ	0.8	203
フジ・コーポレーション	4.5	9,427
ユナイテッドアローズ	11.2	21,313
ハイデイ日高	14.1	43,146
YU-WA CREATION H	2	264
コロワイド	41	82,533
壱番屋	37.7	42,638
トップカルチャー	1.5	249
ＰＬＡＮＴ	0.7	1,078
スギホールディングス	57.7	134,758
薬王堂ホールディングス	4.7	13,174
ヴィア・ホールディングス	4.7	517
スクロール	14.3	15,100
ヨンドシーホールディングス	9	17,172
木曽路	14.4	36,547
SRS ホールディングス	15.7	19,986
千趣会	17.7	5,681
タカキユー	2.1	195
リテールパートナーズ	14.2	22,649
上新電機	9.5	24,310
日本瓦斯	50.6	119,593
ロイヤルホールディングス	16.8	43,596
東天紅	0.3	273
いなげや	9.3	11,550
チヨダ	9.3	8,314
ライフコーポレーション	10	39,500
リンガーハット	12.3	29,101
ＭｒＭａｘＨＤ	12.1	7,949
テンアライド	4.3	1,277
AOKI ホールディングス	20.5	25,256
オークワ	13.8	12,944
コメリ	14.7	51,303
青山商事	20.4	29,702
しまむら	22.4	160,540
はせがわ	1.5	535
高島屋	60.8	158,201
松屋	16.2	16,945
エイチ・ツー・オーリテイリング	42.2	96,173
近鉄百貨店	4.1	9,409
丸井グループ	63.3	141,507
アクシアル リテイリング	26	26,104
井筒屋	1.5	682
イオン	323.5	1,107,664
イズミ	16.9	52,947
平和堂	15.9	36,061
フジ	14.6	29,360
ヤオコー	11.3	110,344
ゼビオホールディングス	13	15,600
ケーズホールディングス	64.1	90,348
OLYMPIC グループ	1.5	823
日産東京販売ＨＤ	4.7	2,321
シルバーライフ	2.6	2,519

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
GENKY DRUGSTORES	4.2	23,730
ナルミヤ・インターナショナル	0.5	660
ブックオフＧＨＤ	6.2	9,833
ギフトホールディングス	4	10,504
アインホールディングス	13.1	74,971
元気寿司	5.4	17,307
ヤマダホールディングス	293.9	124,701
アークランズ	28.4	53,818
ニトリホールディングス	34.7	581,572
グルメ杵屋	7.7	8,500
愛眼	2.5	447
ケーユーホールディングス	4.5	5,643
吉野家ホールディングス	35.2	106,233
松屋フーズ HLDGS	4.5	25,785
サガミホールディングス	14.3	23,065
関西フードマーケット	6.5	15,424
王将フードサービス	7.1	61,770
ミニストップ	6.9	11,854
アークス	17.5	50,085
バローホールディングス	18.2	43,079
ベルク	4.7	34,216
大庄	5.1	6,273
ファーストリテイリング	53.7	2,119,002
サンドラッグ	32.2	126,320
サックスバーホールディング	8.1	6,253
ヤマザワ	0.7	885
やまや	0.7	2,152
ベルーナ	23	17,066
銀行業（7.8%）		
いよぎんホールディング	105.7	146,817
しずおかフィナンシャルグ	197.4	282,183
ちゅうぎんフィナンシャ	74.8	118,894
楽天銀行	41.2	111,487
京都フィナンシャルＧ	111.8	285,928
島根銀行	0.8	439
じもとホールディングス	2.6	910
めぶきフィナンシャルＧ	411.6	241,156
東京きらぼし FG	11.4	51,300
九州フィナンシャルＧ	171.9	159,987
ゆうちょ銀行	976.3	1,429,791
富山第一銀行	28.2	32,401
コンコルディア・フィナンシャル	472.6	416,455
西日本フィナンシャル HD	49.7	93,286
33ＦＧ	7.9	16,076
第四北越フィナンシャルＧ	13.9	68,110
ひろぎん HLDGS	126.4	149,468
おきなわＦＧ	7.6	18,665
十六ＦＧ	11.5	50,772
北國ＦＨＤ	9.4	49,256
プロクレアホールディングス	10.2	18,421
あいちフィナンシャルグル	18.2	49,285
あおぞら銀行	63.8	165,561
三菱 UFJ フィナンシャルＧ	5,410.4	8,356,362
りそなホールディングス	1,027.5	998,319
三井住友トラスト HD	319.3	1,124,574
三井住友フィナンシャルＧ	622.2	6,134,892

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
千葉銀行	247.6	336,612
群馬銀行	172.3	166,614
武蔵野銀行	12.4	38,812
千葉興業銀行	18.9	18,465
筑波銀行	39	11,856
七十七銀行	25.8	109,263
秋田銀行	5.9	15,281
山形銀行	9.9	11,276
岩手銀行	5.6	15,612
東邦銀行	70.3	22,214
東北銀行	1.4	1,650
ふくおかフィナンシャルＧ	77.4	313,470
スルガ銀行	63	65,016
八十二銀行	190.6	189,627
山梨中央銀行	10	18,750
大垣共立銀行	16.9	36,064
福井銀行	8	16,056
清水銀行	3.6	5,832
富山銀行	0.5	861
滋賀銀行	14.8	62,826
南都銀行	13.4	45,158
百五銀行	83.5	54,776
紀陽銀行	31.8	59,466
ほくほくフィナンシャルＧ	55	112,447
山陰合同銀行	55.6	74,893
鳥取銀行	1	1,370
百十四銀行	8.8	28,776
四国銀行	13.1	14,396
阿波銀行	12.5	33,337
大分銀行	5.3	17,649
宮崎銀行	5.3	17,781
佐賀銀行	5.2	13,171
琉球銀行	18.9	22,566
セブン銀行	278.5	72,215
みずほフィナンシャルＧ	1,199.2	3,626,380
高知銀行	1	898
山口フィナンシャルＧ	87.1	148,941
名古屋銀行	5.6	40,488
北洋銀行	134.6	71,203
大光銀行	1	1,578
愛媛銀行	12	14,784
トマト銀行	1.1	1,346
京葉銀行	36.6	31,256
栃木銀行	44.4	15,717
北日本銀行	2.9	7,363
東和銀行	16.4	11,234
福島銀行	3.1	840
大東銀行	1.3	965
トモニホールディングス	84.1	33,387
フィデアホール	9.2	14,480
池田泉州ＨＤ	123.1	47,762
証券、商品先物取引業（0.9%）		
ＦＰＧ	33	69,102
ジャパンインベストメントＡ	14.4	20,980
マーキュリアホールディングス	1.5	1,378
SBI ホールディングス	142.6	560,703

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
日本アジア投資	2.1	501
ジャフコ グループ	26.5	49,753
大和証券Ｇ本社	688.3	804,622
野村ホールディングス	1,494.2	1,341,791
岡三証券グループ	78	60,216
丸三証券	29.5	29,234
東洋証券	23.6	8,873
東海東京ＨＤ	105.5	60,029
光世証券	0.7	423
水戸証券	26.2	14,017
いちよし証券	16.6	13,562
松井証券	43.7	34,828
マネックスＧ	87	62,205
極東証券	12.1	17,145
岩井コスモホールディング	10.1	21,816
アイザワ証券グループ	12.8	28,364
マネーパートナーズ GP	3	738
スパークス・グループ	9.9	16,255
小林洋行	1.2	342
保険業（3.0%）		
かんぽ生命保険	90.5	264,486
SOMPO ホールディングス	400.9	1,268,046
アニコム ホールディングス	30.1	19,264
ＭＳ＆ＡＤ	596.8	1,825,611
第一生命 HLDGS	417.7	1,613,992
東京海上ＨＤ	867.4	4,565,126
T&D ホールディングス	238.6	617,974
アドバンスクリエイト	6.9	7,286
その他金融業（1.2%）		
NEXYZ. GROUP	1	604
全国保証	23.2	131,729
あんしん保証	1.2	262
ジェイリース	5.9	7,451
イントラスト	1.1	880
日本モーゲージサービス	1.6	665
Ｃａｓａ	1.1	971
ＳＢＩアルヒ	8.6	7,404
プレミアグループ	15	30,720
ネットプロＨＤ	29.6	5,890
クレディセゾン	56.3	186,690
芙蓉総合リース	8.2	96,596
みずほリース	74.4	82,137
東京センチュリー	66.5	95,394
日本証券金融	32.7	51,927
アイフル	130.8	49,180
リコーリース	8.4	42,168
イオンフィナンシャルサービス	51	65,790
アコム	158.8	60,185
ジャックス	9.4	44,415
オリコ	29.1	29,507
オリックス	532.8	1,792,339
三菱 HC キャピタル	396	403,128
九州 リースサービス	1.2	1,239
日本取引所グループ	229.1	818,574
イー・ギャランティ	14.5	19,691
アサックス	1.3	1,063

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
NECキャピタルソリューション	4.3	16,490
不動産業（1.9%）		
大東建託	32.5	534,137
サムティホールディングス	13.8	34,127
いちご	90.2	34,095
日本駐車場開発	105.7	20,928
スター・マイカ・HLDGS	10.3	6,252
SRE ホールディングス	3.8	17,632
AD ワークスグループ	7.4	1,687
ヒューリック	207.3	299,963
野村不動産 HLDGS	49.5	195,030
三重交通グループ HD	18.9	11,132
地主	6.8	15,572
プレサンスコーポレーション	11.8	22,195
ハウスコム	0.5	519
ＪＰＭＣ	5.1	6,120
サンセイランディック	0.9	906
エストラスト	0.3	212
フージャース HD	13.7	15,659
オープンハウスグループ	32.6	153,774
東急不動産ＨＤ	267.1	280,722
飯田ＧＨＤ	85.1	178,837
イーグランド	0.4	617
ビーロット	2	1,802
ファーストブラザーズ	0.6	711
AND DO ホールディングス	5.3	6,063
シーアールイー	4	5,808
ケイアイスター不動産	4.3	14,469
アグレ都市デザイン	0.5	783
ジェイ・エス・ビー	4.4	12,887
ロードスターキャピタル	5.8	16,060
テンポイノベーション	0.9	785
グロバルリンクマネジメント	0.6	1,288
フェイスネットワーク	0.8	1,368
霞ヶ関キャピタル	3.6	50,472
パーク24	57.7	86,434
パラカ	2.8	5,633
ミガロホールディングス	0.4	1,984
宮越ホールディングス	4	7,280
三井不動産	1,232.5	1,745,220
三菱地所	580.8	1,440,384
平和不動産	14.4	56,088
東京建物	77.6	186,317
京阪神ビルディング	16.6	28,435
住友不動産	128.5	599,324
テーオーシー	15.8	10,759
スターツコーポレーション	12.8	43,392
フジ住宅	11.2	8,265
空港施設	12.5	7,450
明和地所	5.7	5,244
ゴールドクレスト	7.3	19,155
エスリード	4.2	18,543
日神グループ HLDGS	14.2	7,369
日本エスコン	16.6	17,313
MIRARTH ホールディング	40.8	19,951
ＡＶＡＮＴＩＡ	1.6	1,337

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
イオンモール	46	89,516
毎日コムネット	1.1	815
ファースト住建	1.2	1,279
ランド	491.4	4,422
カチタス	23.9	40,104
トーセイ	14.8	33,906
穴吹興産	0.7	1,547
サンフロンティア不動産	13.2	25,344
インテリックス	0.7	375
ランドビジネス	1	238
サンネクスタグループ	1	1,059
グランディハウス	7.4	4,351
日本空港ビルデング	31.4	169,685
サービス業（4.4%）		
明豊ファシリティワークス	1.5	1,320
ＬＩＦＵＬＬ	22.4	3,673
ＭＩＸＩ	19.9	56,953
ジェイエイシーリクルートメント	33.4	21,543
日本M&A センターホールデ	147.8	117,634
メンバーズ	3.2	2,793
中広	0.5	243
ＵＴグループ	12.1	34,351
アイティメディア	3.5	6,674
ケアネット	19	10,222
E・Jホールディングス	5.4	9,666
オープンアップグループ	27.9	54,293
コシダカホールディングス	27.8	23,657
アルトナー	1.3	2,479
パソナグループ	11.2	24,416
ＣＤＳ	0.8	1,445
リンクアンドモチベーション	26.7	12,282
エス・エム・エス	32.5	66,397
サニーサイドアップＧ	1.1	721
パーソルホールディングス	944	198,523
リニカル	1.9	748
クックパッド	25.4	4,876
エスクリ	1.2	337
アイ・ケイ・ケイホールディンク	1.5	1,177
学情	4.7	8,784
スタジオアリス	4.6	9,821
エプコ	0.8	654
ＮＪＳ	2	7,800
綜合警備保障	155	145,979
カカクコム	60.2	120,911
アイロムグループ	3.7	10,319
セントケア・ホールディング	6.8	5,623
サイネックス	0.5	365
ルネサンス	7.2	6,912
ディップ	14.2	37,118
デジタルホールディングス	4.8	5,006
新日本科学	8.4	11,373
キャリアデザインセンター	0.6	1,054
エムスリー	183.3	270,642
ツカダ・グローバル HOLD	1.9	877
プラス	0.4	272
ウェルネット	2.7	1,714

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
ワールドホールディングス	4.2	8,941
ディー・エヌ・エー	32.9	50,517
博報堂ＤＹ HLDGS	118.3	129,420
ぐるなび	17.2	5,538
タカミヤ	12.5	6,087
ファンコミュニケーションズ	12.8	5,273
ライク	3.4	5,117
Ａｏｂａ－ＢＢＴ	1.1	382
エスプール	26.7	8,383
WDB ホールディングス	4.7	8,652
ティア	2	918
ＣＤＧ	0.3	396
アドウェイズ	12.7	4,927
バリューコマース	8.2	9,963
インフォマート	96.3	29,756
JP ホールディングス	23.7	12,798
エコナックホールディングス	2.6	330
CL ホールディングス	2.2	2,833
プレステージ・インター	43.4	28,296
アミューズ	5.7	9,262
ドリームインキュベータ	3.2	6,966
クイック	6.4	13,408
ＴＡＣ	1.5	270
電通グループ	91.1	356,747
テイクアンドギヴニーズ	4	3,744
ぴあ	3.1	9,424
イオンファンタジー	3.3	7,590
シーティーエス	11.5	9,085
ＨＵグループＨＤ	27.2	67,782
アルプス技研	8.8	21,920
サニックス	14.8	4,395
日本空調サービス	10	10,460
オリエンタルランド	490.7	2,151,719
ダスキン	20.2	74,315
明光ネットワークジャパン	11.2	8,243
ファルコホールディングス	4.1	9,409
秀英予備校	0.7	210
田谷	0.5	193
ラウンドワン	87.4	69,308
リゾートトラスト	40.3	94,745
ビー・エム・エル	11.4	31,543
リソー教育	47.3	11,919
早稲田アカデミー	5.1	8,083
ユー・エス・エス	208.1	261,789
東京個別指導学院	11	4,488
サイバーエージェント	205	199,731
楽天グループ	795.9	625,577
クリーク・アンド・リバー社	4.7	8,253
SBI グローバルアセット	18.1	11,710
テー・オー・ダブリュー	18.1	6,570
山田コンサルティング GP	4	7,716
セントラルスポーツ	3.5	8,694
フルキャストホールディングス	8.9	13,350
エン・ジャパン	15.1	38,807
リソルホールディングス	0.3	1,416
テクノプロ・ホールディング	54.3	139,551

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
アトラグループ	0.9	145
アイ・アールジャパンHD	4.8	5,904
ＫｅｅＰｅｒ技研	5.7	23,199
ファーストロジック	0.9	464
三機サービス	0.5	556
Ｇｕｎｏｓｙ	7.3	5,642
デザインワン・ジャパン	1	149
イー・ガーディアン	4.4	8,500
リブセンス	1.4	303
ジャパンマテリアル	28.4	55,323
ベクトル	11.1	13,752
ウチヤマホールディングス	1.3	445
チャームケアコーポレーション	7.7	12,312
キャリアリンク	3.4	8,364
ＩＢＪ	7.1	4,153
アサンテ	4.5	7,713
バリューＨＲ	8.1	12,077
M&A キャピタルパートナー	7.5	15,742
ライドオンエクスプレスHD	3.7	3,825
ERI ホールディングス	0.9	2,043
アビスト	0.5	1,630
シグマクシス・ホールディンク	12.2	18,519
ウィルグループ	7.6	7,204
エスクローＡＪ	3.6	500
メドピア	7.4	4,425
レアジョブ	0.6	255
リクルートホールディングス	667.9	5,266,391
エラン	12.3	10,996
土木管理総合試験	1.4	456
日本郵政	969.4	1,429,865
ベルシステム24HLDGS	10	14,380
鎌倉新書	7.9	3,515
ＳＭＮ	0.6	181
一蔵	0.4	228
グローバルキッズ COMP	0.6	405
エアトリ	6.8	9,091
アトラエ	7	5,551
ストライク	4.6	19,389
ソラスト	25.7	11,616
セラク	2.9	3,384
インソース	20.1	17,909
ペイカレントコンサルティング	68.2	212,852
ORCHESTRA HLDGS	2	2,924
アイモバイル	11.7	5,955
キャリアインデックス	1	175
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3.8	3,978
船場	0.6	728
ジャパンエレベーターSHD	30	72,720
フルテック	0.4	458
グリーンズ	1.1	2,095
ツナググループ HLDGS	0.9	576
GAMEWITH	1.2	313
MS&CONSULTING	0.4	244
エル・ティー・エス	1.1	2,294
ミダックホールディングス	5.6	8,512
キュービーネット HLDGS	5.3	5,607

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
オープングループ	12.7	3,441
スプリックス	0.9	700
マネジメントソリューションズ	4	5,620
プロレド・パートナーズ	2.3	1,658
AND FACTORY	0.9	288
テノ．ホールディングス	0.4	164
フロンティア・マネジメント	2.3	2,925
ピアラ	0.6	162
コプロ・ホールディングス	1	1,655
ギークス	0.4	188
アンビスホールディングス	19.8	46,827
カーブスホールディングス	25.4	19,024
フォーラムエンジニアリング	12.6	10,483
FAST FITNESS JAP	3.2	4,406
ダイレクトマケティングミクス	9.6	2,217
ポピンズ	1.4	1,685
LITALICO	7.2	12,974
コンフィデンス・インターワーク	0.3	551
アドバンテッジリスクマネ	1.6	804
リログループ	46.5	77,980
東祥	6.5	4,569
ID&E ホールディングス	5.6	23,800
ビーウィズ	1.9	3,475
TRE ホールディングス	17.7	20,779
人・夢・技術グループ	3.8	6,444
ＮＩＳＳＯＨＤ	8	6,528
大栄環境	16.8	42,016
日本管財ホールディンク	9.7	25,210
エイチ・アイ・エス	27	45,495
ラックランド	4.2	8,794
共立メンテナンス	29.1	86,805
イチネンホールディングス	9.8	15,866
建設技術研究所	4.8	23,280
スペース	6.1	6,886
燦ホールディングス	8.6	9,915
スバル興業	3.2	8,099
東京テアトル	1.1	1,225
タナベコンサルティンググル	3.6	3,776
ナガワ	2.9	22,504
東京都競馬	7.8	31,278
常磐興産	1.1	1,328
カナモト	14.4	42,940
ニシオホールディングス	7.7	31,223
アゴーラ ホスピタリティーG	19.2	825
トランス・コスモス	11.5	37,720
乃村工藝社	40.5	33,412
藤田観光	3.7	22,644
KNT-CT ホールディングス	5.6	7,453
トーカイ	8.2	17,621
白洋舎	0.5	1,223
セコム	94.4	874,144
セントラル警備保障	5	14,745
丹青社	18	17,082
メイテックグループホールデ	31.6	95,684
応用地質	8.6	22,592
船井総研ホールディン	18.6	41,757
進学会ホールディングス	0.8	188
オオバ	2	2,140
いであ	0.8	1,844
学究社	3.7	7,684
イオンディライト	10	38,150
ナック	7.8	4,422
ダイセキ	18.9	61,992
ステップ	3.4	6,429
	千株	千円
合計 株数、金額	144,971.3	343,000,160
合計 銘柄数<比率>	2,119銘柄	<97.7%>

（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		2024年6月17日現在 買建額	売建額
		百万円	百万円
国内	ＴＯＰＩＸ	7,838	—

（注）単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入状況

区分	2024年6月17日現在 貸付	借入
	株	株
株式	4,868,400 (19,600)	— (—)

（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19,600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35期　（決算日　2023年９月19日）

（作成対象期間　2022年９月21日～2023年９月19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。

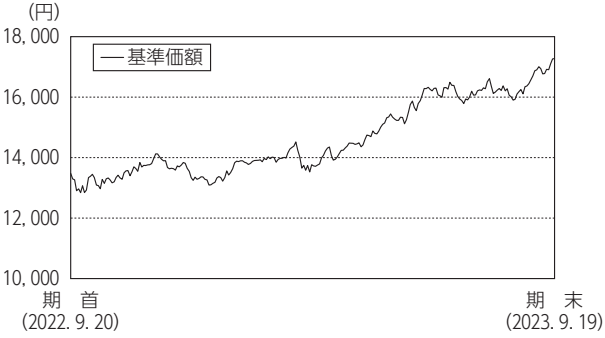
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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（配当込み）をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	東京証券取引所上場株式（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（配当込み）(ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2022年9月20日	13,480	—	3,152.37	—	96.6	3.4
9月末	12,844	△ 4.7	3,003.39	△ 4.7	96.2	3.9
10月末	13,497	0.1	3,156.44	0.1	96.7	3.2
11月末	13,895	3.1	3,249.61	3.1	97.1	2.8
12月末	13,261	△ 1.6	3,101.25	△ 1.6	97.3	2.7
2023年1月末	13,846	2.7	3,238.48	2.7	96.8	3.2
2月末	13,976	3.7	3,269.12	3.7	98.2	1.9
3月末	14,214	5.4	3,324.74	5.5	97.2	2.7
4月末	14,597	8.3	3,414.45	8.3	97.5	2.5
5月末	15,120	12.2	3,537.93	12.2	97.2	2.8
6月末	16,263	20.6	3,805.00	20.7	96.6	3.3
7月末	16,506	22.4	3,861.80	22.5	98.6	1.3
8月末	16,576	23.0	3,878.51	23.0	96.5	3.5
(期末)2023年9月19日	17,276	28.2	4,042.16	28.2	98.5	1.4

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：13,480円　期末：17,276円　騰落率：28.2%

【基準価額の主な変動要因】

わが国の株式に投資した結果、国内株式市況の上昇を反映して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、一進一退で推移した後、大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、英国の財政悪化や欧米の金利上昇などが嫌気され、2022年９月末にかけて下落しました。11月下旬にかけては、欧米の金利上昇が一服したことや国内で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。12月には、世界的な景況感の悪化や日銀の政策変更による急速な円高などで下落しましたが、2023年１月以降は、中国のゼロコロナ政策見直しにより景気回復期待が高まったことや、日銀総裁人事への不透明感が解消して円安が進んだことなどが好感され、３月上旬にかけて上昇しました。３月半ばにかけては、米国地方銀行の経営破綻や欧州金融機関の破綻懸念などで金融不安が高まり下落しましたが、その後は、欧州金融機関の破綻回避などを受けて金融不安が一定程度後退したことにより、上昇に転じました。４月以降は、経済活動正常化や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたこと、日銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調したこと、米国著名投資家の強気見通しにより日本株見直しの動きが強まったことなどから、大幅に上昇しました。７月に入り、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇、中国の不動産大手の債務不履行懸念などから下落する場面もありましたが、８月半ばに発表された2023年４－６月期ＧＤＰ（国内総生産）成長率が予想を上回る高い伸びとなったことなどが好感され、当作成期末にかけて再び上昇しました。

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

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は28.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は28.2%となりました。

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（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、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■１万口当りの費用の明細

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

（2022年９月21日から2023年９月19日まで）

	買　付		売　付	
	株　数	金　額	株　数	金　額
	千株	千円	千株	千円
国内	19,029.2 (26,020.281)	42,766,074 (—)	4,695.88	9,449,161

（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

（2022年９月21日から2023年９月19日まで）

種　類　別		買　建		売　建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	株式先物取引	47,963	52,286	—	—

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

(3)新株予約権証券

（2022年９月21日から2023年９月19日まで）

	買　付		売　付	
	証 券 数	金　額	証 券 数	金　額
	証券	千円	証券	千円
国内	— (8,000)	— (—)	8,000 (—)	2,423 (—)

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

■主要な売買銘柄

株　　式

（2022年９月21日から2023年９月19日まで）

当　期							
買　付				売　付			
銘　柄	株　数	金　額	平均単価	銘　柄	株　数	金　額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	908.5	1,892,409	2,083	ソフトバンクグループ	115.3	634,454	5,502
ソニーグループ	91	1,074,921	11,812	三菱商事	51	229,413	4,498
日本電信電話	1,620.7	753,361	464	日立	31.4	205,035	6,529
キーエンス	11.4	701,411	61,527	伊藤忠テクノソリュー	41.9	181,217	4,325
三菱UFJフィナンシャルＧ	723.1	693,305	958	三菱UFJフィナンシャルＧ	205.3	177,900	866
第一三共	144.5	636,177	4,402	日立金属	71.5	155,941	2,181
三井住友フィナンシャルＧ	89.3	498,599	5,583	キヤノン	37.1	134,110	3,614
武田薬品	114.4	484,771	4,237	スズキ	26.3	126,757	4,819
東京海上ＨＤ	154.6	460,532	2,978	ＳＢＩ新生銀行	51.1	124,569	2,437
みずほフィナンシャルＧ	235.9	457,270	1,938	日立物流	13.3	118,542	8,913

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業（0.1%）			
極洋	3.3	4.3	17,479
ニッスイ	96.7	112.2	85,698
マルハニチロ	13.8	16.7	44,255
雪国まいたけ	7.5	9.6	8,889
カネコ種苗	3	3.5	5,327
サカタのタネ	11.3	12.8	57,088
ホクト	7.9	9.9	18,354
ホクリョウ	1.3	1.1	1,196
鉱業（0.4%）			
住石ホールディングス	18.6	11.6	5,278
日鉄鉱業	2	4.5	25,110
三井松島 HLDGS	4.4	5.1	15,045
ＩＮＰＥＸ	329.6	414.5	977,391
石油資源開発	12.3	13	76,830
K&O エナジーグループ	4	5.1	13,673
建設業（2.1%）			
ショーボンドＨＤ	12.1	15.3	90,576
ミライト・ワン	33.5	37.1	76,277
タマホーム	6.3	7	25,270
サンヨーホームズ	1.8	0.9	656
日本アクア	4.2	3	3,123
ファーストコーポレーション	2.6	1.9	1,508
ベステラ	2.1	1.7	1,671
キャンディル	1.5	1.4	872
ダイセキ環境ソリューション	2	1.5	1,893
第一カッター興業	2.2	2.8	3,645
安藤・間	47.2	64.6	82,042
東急建設	28	31.1	26,341
コムシスホールディングス	33.4	35.5	115,907
ビーアールホールディングス	12.8	18.2	7,007
高松コンストラクション GP	6.9	7.2	19,944
東建コーポレーション	2.9	3.2	25,760
ソネック	1.1	0.8	810
ヤマウラ	4.8	5.5	6,979
オリエンタル白石	35	39.2	13,210
大成建設	66.6	73.3	392,888
大林組	222.6	279.8	395,357
清水建設	205.9	221.8	233,999
飛島建設	6.2	8.6	12,323
長谷工コーポレーション	64.3	80.7	159,301
松井建設	8	7.1	5,644
錢高組	0.9	0.6	2,421
鹿島建設	163.1	173.6	450,665
不動テトラ	5	5.5	11,297
大末建設	2.6	1.9	2,962
鉄建建設	4.7	5.5	12,358
西松建設	14.5	13.2	51,453
三井住友建設	53.5	62.3	26,602
大豊建設	3.5	3.2	13,232
佐田建設	4.9	3.3	1,679
ナカノフドー建設	5.4	3.6	1,508
奥村組	11.8	12.6	59,283
東鉄工業	9.5	10.8	32,778
イチケン	1.7	1.1	2,365
富士ピー・エス	3.5	2.3	1,099
淺沼組	5.2	6.1	22,600
戸田建設	91.8	96.1	81,214
熊谷組	11.8	12.9	45,085
北野建設	1.4	1	3,045
植木組	2.1	1.5	2,370
矢作建設	10.1	10.5	14,343
ピーエス三菱	7.8	10.3	9,012
日本ハウス HLDGS	12.6	16.3	6,145
新日本建設	10.5	10.9	13,853
東亜道路	1.3	3.1	16,430
日本道路	2.1	1.6	15,584
東亜建設	5.3	6.7	25,560
日本国土開発	18.8	21.9	14,607
若築建設	3.8	3.5	11,095
東洋建設	27.1	25.3	29,929
五洋建設	88.2	111.1	105,545
世紀東急	10.8	10.1	17,250
福田組	2.4	2.9	14,239
住友林業	47.8	67.7	289,079
日本基礎技術	5.9	3.1	1,590
巴コーポレーション	9.6	6	3,492
大和ハウス	189.7	216.6	909,936
ライト工業	13.2	14.6	30,251
積水ハウス	227.6	237.6	742,262
日特建設	5.1	7.6	8,732
北陸電気工事	4.1	5.5	5,841
ユアテック	13.9	17.5	17,780
日本リーテック	4.6	6.9	9,584
四電工	2.3	3.3	9,966
中電工	9.2	12.3	31,119
関電工	39.1	43.2	59,356
きんでん	48.8	55.4	124,317
東京エネシス	7	7.6	7,850
トーエネック	2.4	2.6	11,453
住友電設	5.9	7.5	21,780
日本電設工業	10.2	12.9	30,160
エクシオグループ	33	36.2	115,984
新日本空調	5.2	4.2	10,542
九電工	15.2	19.1	89,006
三機工業	15.6	17.6	29,233
日揮ホールディングス	67.9	77.4	174,188
中外炉工業	2.2	2.5	5,555
ヤマト	5.9	4.4	4,364
太平電業	4.3	4.8	19,608
高砂熱学	18.2	19	56,126
三晃金属	1	0.6	2,598
朝日工業社	2.9	3.3	8,454
明星工業	12	13.6	14,443
大氣社	10	9.1	43,771
ダイダン	4.4	5.3	16,377
日比谷総合設備	6.4	6.4	15,097
フィル・カンパニー	1.1	1.3	949
テスホールディングス	6.7	16.9	8,534
インフロニアＨＤ	83.6	81.8	132,761
東洋エンジニア	10.1	10.1	7,029
レイズネクスト	10.3	11	17,050
食料品（3.3%）			
ニップン	18.6	21.3	46,434
日清製粉Ｇ本社	72.3	72.8	143,088
日東富士製粉	1.1	1.4	7,000
昭和産業	6	6.9	21,562
鳥越製粉	5.4	4.8	3,297
中部飼料	7.8	11	12,848
フィード・ワン	8.9	11.6	9,593
東洋精糖	1	1	2,233
日本甜菜糖	3.9	4.6	8,993
DM 三井製糖ホールディ	6.1	7.8	24,375
塩水港精糖	7.9	6.4	1,702
ウェルネオシュガー	3.5	4.1	8,708
森永製菓	15.5	14	75,348
中村屋	1.6	1.9	5,947
江崎グリコ	17.9	22.5	92,002
名糖産業	2.8	3.1	5,177
井村屋グループ	3.8	4.3	9,997
不二家	4.4	5.4	13,635
山崎製パン	42	52.7	150,326
第一屋製パン	0.6	1	438
モロゾフ	2.3	2.5	9,287
亀田製菓	4	5	21,750
寿スピリッツ	6.7	8.4	98,616
カルビー	35	36	107,244
森永乳業	13	14.3	83,812
六甲バター	4.5	5.8	8,056
ヤクルト	48.8	56.2	426,052
明治ホールディングス	42.3	96.5	360,620
雪印メグミルク	16.9	19.1	44,483
プリマハム	9.6	10.6	26,712
日本ハム	26.9	30.8	141,526
林兼産業	1.7	1.6	891
丸大食品	6.8	7.9	13,453
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	6.9	8.7	29,884
柿安本店	2.7	3.2	7,990
伊藤ハム米久 HLDGS	48.5	60.3	49,446
サッポロホールディングス	20.7	25.9	122,144
アサヒグループホールディン	144.4	181.9	1,078,121
キリンＨＤ	282.1	327.9	700,722
宝ホールディングス	42.7	53.8	67,626
オエノンホールディングス	17.5	23.5	10,598
養命酒	2	2.6	4,973
コカ・コーラボトラーズ JHD	48.9	61.7	127,533
サントリー食品インター	44	55.4	260,823
ダイドーグループ HD	3.9	4.5	25,920
伊藤園	23.3	26.7	130,990
キーコーヒー	7	8.8	17,890
ユニカフェ	2	1.7	1,621
ジャパンフーズ	1.1	0.8	897
日清オイリオグループ	8.7	11.1	48,562
不二製油グループ	16.6	18.3	42,639
かどや製油	0.7	0.6	2,112

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
Ｊ－オイルミルズ	6.8	8.1	14,928
キッコーマン	46	52.2	441,612
味の素	152.9	190	1,111,500
ブルドックソース	2.8	4.2	8,820
キユーピー	33.6	42.3	104,206
ハウス食品Ｇ本社	24	24.1	76,300
カゴメ	29.2	33.9	112,480
焼津水産化工	3.1	2	2,486
アリアケジャパン	7	6.9	35,121
ピエトロ	0.9	0.7	1,305
エバラ食品工業	1.7	2.1	6,384
やまみ	0.7	0.5	973
ニチレイ	28.6	36.1	128,516
東洋水産	34.3	39.8	236,690
イートアンド HLDGS	3	3.5	7,455
大冷	0.6	0.7	1,430
ヨシムラ・フード・HLDGS	3.8	5	6,590
日清食品ＨＤ	24.8	27.7	345,557
永谷園ホールディングス	3.3	3.9	9,063
一正蒲鉾	3	2.2	1,720
フジッコ	7.1	8.1	15,876
ロックフィールド	7.7	8.8	14,396
日本たばこ産業	411.2	478.3	1,618,567
ケンコーマヨネーズ	3.9	5.4	7,878
わらべや日洋 HD	4.7	5.8	16,918
なとり	4.3	4.9	9,790
イフジ産業	1.2	0.9	1,454
ファーマフーズ	9.7	11.3	17,571
ユーグレナ	40.2	49	39,690
紀文食品	5.9	6.2	7,551
ピックルスホールディングス	3.7	4.6	5,906
ミヨシ油脂	2.3	2	2,390
理研ビタミン	5.3	6.8	15,830
繊維製品（0.4%）			
片倉工業	6	7.3	13,227
グンゼ	4.4	5.7	26,476
東洋紡	29.4	34.7	38,811
ユニチカ	20.9	24.1	5,133
富士紡ホールディングス	3	3.1	11,671
倉敷紡績	5.3	6	15,432
シキボウ	4.2	2.9	3,224
日本毛織	18.6	21.1	29,012
ダイトウボウ	16.5	8.5	807
トーア紡コーポレーション	2.3	2	924
ダイドーリミテッド	12.6	7.6	2,371
帝国繊維	7.2	9	17,712
帝人	66.1	77	124,124
東レ	464.9	536.4	449,235
住江織物	1.3	1.1	2,543
日本フエルト	4.1	2.9	1,276
イチカワ	0.9	0.7	1,082
日東製網	0.7	0.5	767
アツギ	5.3	3	1,347
ダイニック	2.1	1.3	1,075
セーレン	13.8	15.4	36,374
ソトー	2.8	1.6	1,260
東海染工	0.8	0.5	547
小松マテーレ	11.3	11.5	8,866

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ワコールホールディングス	15.3	14.6	48,326
ホギメディカル	9.3	10.7	34,828
クラウディア HLDGS	2	1.3	720
ＴＳＩホールディングス	22.8	26.9	22,192
マツオカコーポレーション	2.1	1.4	2,277
ワールド	9.9	10.4	17,815
三陽商会	3.4	2	4,242
ナイガイ	2.3	1.7	491
オンワードホールディングス	41.6	51.9	28,545
ルックホールディングス	2.1	1.7	3,530
ゴールドウイン	12.4	14.2	153,928
デサント	12.8	13.8	52,647
キング	3.7	2.3	1,557
ヤマトインターナショナル	5.5	4.1	1,189
パルプ・紙（0.2%）			
特種東海製紙	3.9	3.6	12,780
王子ホールディングス	289.1	333.7	226,115
日本製紙	30	41.7	59,380
三菱製紙	9.6	6.4	3,699
北越コーポレーション	44.6	50.6	54,293
中越パルプ	2.3	2.2	3,337
巴川製紙	2.3	1.7	1,157
大王製紙	31.9	35.3	46,225
阿波製紙	1.4	1.3	685
レンゴー	58.3	72.9	76,945
トーモク	3.6	4.6	11,665
ザ・パック	4.8	6	19,710
化学（5.8%）			
北の達人コーポ	27.1	34	8,364
クラレ	101.2	116.7	202,591
旭化成	463	499.7	500,949
共和レザー	4.1	3	2,031
レゾナック・ホールディング	61.4	77.4	197,253
住友化学	510.7	594	257,796
住友精化	3	3.4	16,354
日産化学	33.7	37.8	252,730
ラサ工業	2.6	3.1	6,572
クレハ	5.4	6.4	55,744
多木化学	2.5	3.1	11,795
テイカ	4.3	5.4	7,614
石原産業	13.4	14.5	22,634
片倉コープアグリ	1.7	1.1	1,322
日本曹達	8.2	8.6	49,536
東ソー	92.7	106.9	216,793
トクヤマ	22.3	25.9	64,607
セントラル硝子	11.3	12.9	40,312
東亞合成	32.6	40.2	55,797
大阪ソーダ	5.8	4.8	31,488
関東電化	13.7	15.5	14,136
デンカ	25.2	29.1	84,186
信越化学	118.7	665.6	3,093,043
日本カーバイド	2.9	2	3,568
堺化学	4.8	6.1	13,102
第一稀元素化学工	6.3	7.3	7,154
エア・ウォーター	59.9	75.6	144,055
日本酸素 HLDGS	61.6	77.7	280,341
日本化学工業	2.1	2.7	5,386
東邦アセチレン	1.5	1.1	1,797

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本パーカライジング	31.5	39.7	47,004
高圧ガス	10.6	11.7	9,231
チタン工業	0.9	0.6	847
四国化成ホールディング	8.5	10.2	15,575
戸田工業	1.6	1.8	3,641
ステラ ケミファ	3.8	4.7	15,134
保土谷化学	2	2.3	7,521
日本触媒	10.7	12.2	69,174
大日精化	5.4	5.6	13,501
カネカ	16.1	18.3	77,262
三菱瓦斯化学	58.9	59.8	128,570
三井化学	58.2	66	261,294
ＪＳＲ	69.7	74.7	302,385
東京応化工業	11.1	12.7	116,497
大阪有機化学	4.8	6.7	17,198
三菱ケミカルグループ	464.6	540.4	530,024
ＫＨネオケム	10.6	12.2	29,316
ダイセル	100.3	111.6	147,591
住友ベークライト	10.6	11.9	77,659
積水化学	143	162.2	368,437
日本ゼオン	56.3	48	82,728
アイカ工業	17.6	20.1	69,445
ＵＢＥ	35.1	41.3	111,282
積水樹脂	10.4	11	26,059
タキロンシーアイ	16.4	17.1	10,071
旭有機材	4.3	5.3	20,378
ニチバン	4	4.9	9,398
リケンテクノス	15.2	17.3	13,113
大倉工業	3	3.7	9,760
積水化成品	7.7	11.3	5,514
群栄化学	1.5	1.9	6,631
タイガース ポリマー	4.1	2.4	1,860
ミライアル	2.4	1.6	2,235
ダイキアクシス	2.3	2.2	1,621
ダイキョーニシカワ	15.7	17.7	15,310
竹本容器	2.5	2	1,630
森六ホールディングス	3.7	4.1	9,872
恵和	2.1	5.8	7,534
日本化薬	52.5	61.2	80,080
カーリットホールディングス	6.4	7.2	7,178
日本精化	4.8	4.6	11,932
扶桑化学工業	5.9	7.4	29,526
トリケミカル	7.7	10.7	32,849
ＡＤＥＫＡ	29.5	27.9	77,729
日油	21.6	24.8	163,109
新日本理化	10.7	7.2	1,677
ハリマ化成グループ	5	3.8	3,294
花王	157.9	181.1	1,018,325
第一工業製薬	2.5	2.9	5,089
石原ケミカル	3.5	3.6	6,159
日華化学	2.9	2.1	1,900
ニイタカ	1.4	1	2,005
三洋化成	4.5	4.9	20,580
有機合成薬品	5	3.8	1,132
大日本塗料	8.4	9.8	9,809
日本ペイント HOLD	281.3	425.2	474,735
関西ペイント	64.7	64.2	142,395
神東塗料	4.7	4.3	576

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
中国塗料	15.9	13.2	19,008
日本特殊塗料	4.6	3.4	4,987
藤倉化成	9.3	10.8	5,400
太陽ホールディングス	10.9	12.2	32,098
ＤＩＣ	24.8	31.4	78,876
サカタインクス	14	17.8	24,759
東洋インキSCホールディン	12.3	17.5	42,297
Ｔ＆Ｋ ＴＯＫＡ	6.1	7.2	10,296
富士フイルムHLDGS	134.3	153.8	1,401,579
資生堂	132.9	167.4	954,514
ライオン	76.5	104.9	154,307
高砂香料	4.3	5.4	16,443
マンダム	14.9	17.3	24,860
ミルボン	9.4	10.9	51,393
ファンケル	30.9	35.1	85,503
コーセー	12.9	16.3	194,296
コタ	5.3	7.3	11,899
シーボン	1	0.7	1,082
ポーラ・オルビスHD	32.7	41.1	74,658
ノエビアホールディングス	5.6	7.1	40,470
アジュバンホールディング	1.7	1.3	1,225
新日本製薬	3.7	4.6	7,281
アクシージア	—	4.1	4,887
エステー	4.8	6.1	9,375
アグロカネショウ	2.6	3.2	4,560
コニシ	11.6	13.4	35,402
長谷川香料	13.2	15.3	52,555
星光ＰＭＣ	3.5	3.2	3,414
小林製薬	19.5	23.3	161,841
荒川化学工業	5.4	6.8	7,310
メック	5.2	6.6	24,882
日本高純度化学	1.7	2	5,222
タカラバイオ	20	21.6	30,628
ＪＣＵ	7.8	9	29,340
新田ゼラチン	4.4	3.3	2,369
ＯＡＴアグリオ	2.9	2	3,640
デクセリアルズ	19.9	21.9	81,774
アース製薬	5.8	7.3	36,025
北興化学	6.5	8.1	7,865
大成ラミック	2	2.5	8,050
クミアイ化学	25.4	31.9	36,142
日本農薬	13.5	14.7	10,216
アキレス	4.8	5	7,550
有沢製作所	10.3	13	14,027
日東電工	46.2	58.2	591,312
レック	8.8	11.4	11,023
三光合成	8.7	10.1	7,130
きもと	11.5	7.7	1,478
藤森工業	5.9	6.3	24,979
前澤化成工業	4.3	5	7,675
未来工業	2.7	2.8	9,282
ウェーブロックHLDGS	3	1.7	1,147
ジェイ エス ピー	4.5	5.6	11,575
エフピコ	14.1	15.2	39,634
天馬	5.9	6.5	17,049
信越ポリマー	13.8	14.8	20,216
東リ	17.2	11.7	4,001
ニフコ	25.5	28.9	121,813
バルカー	6.2	6.7	28,944
ユニ・チャーム	132.6	167	919,335
ショーエイコーポ	2	1.9	1,172
医薬品（5.0%）			
協和キリン	76.9	96.8	261,553
武田薬品	600.8	709.5	3,426,175
アステラス製薬	653.6	757.3	1,664,545
住友ファーマ	47.3	59.5	32,873
塩野義製薬	88.8	101.1	681,818
わかもと製薬	7.6	4.9	1,122
日本新薬	16.7	18.9	125,628
中外製薬	199.2	251	1,118,958
科研製薬	11	13.7	49,539
エーザイ	84.5	97.5	871,065
ロート製薬	36.5	77.7	318,026
小野薬品	147.4	154.7	452,729
久光製薬	16.2	17.8	94,909
持田製薬	8.6	9.2	31,602
参天製薬	133.2	146.1	209,069
扶桑薬品	2.5	2.5	5,102
日本ケミファ	0.8	0.5	960
ツムラ	21.8	25.2	70,131
日医工	22	—	—
キッセイ薬品工業	11.1	11.8	40,828
生化学工業	13.7	15.3	12,729
栄研化学	11.4	13	18,538
鳥居薬品	3.4	4.3	16,598
ＪＣＲファーマ	21.5	27.1	39,349
東和薬品	11	12.3	35,596
富士製薬工業	4	5.9	7,192
ゼリア新薬工業	11.3	11.1	26,329
そーせいグループ	—	25.8	41,434
第一三共	554.6	698.4	2,832,012
杏林製薬	13.8	17.4	31,911
大幸薬品	11.6	15.9	5,644
ダイト	4.8	6	14,544
大塚ホールディングス	145.6	166.8	929,076
大正製薬ＨＤ	14.2	17.8	110,947
ペプチドリーム	30.9	38.9	64,457
あすか製薬ＨＤ	7.2	8.2	13,603
サワイグループHD	14.6	18.3	84,198
石油・石炭製品（0.5%）			
日本コークス工業	64.7	72.4	9,339
ニチレキ	8.5	9.5	19,560
ユシロ化学	3.2	4.2	7,207
ビーピー・カストロール	2.6	2	1,836
富士石油	16.7	16.3	6,210
ＭＯＲＥＳＣＯ	2.7	1.7	2,060
出光興産	77.8	89.1	325,660
ENEOSホールディングス	1,149.6	1,360.2	867,263
コスモエネルギーHLDGS	30.2	31.7	184,811
ゴム製品（0.7%）			
横浜ゴム	36.3	40.6	134,101
TOYO TIRE	36.7	46.1	111,354
ブリヂストン	203.3	234.7	1,434,251
住友ゴム	62.5	78.6	134,209
藤倉コンポジット	6.3	3.8	4,537
オカモト	3.5	4.3	21,801
フコク	3.5	4.2	6,468
ニッタ	7.2	8.2	28,946
住友理工	14.9	15.6	18,454
三ツ星ベルト	9.4	11.7	58,500
バンドー化学	12.5	11.9	20,456
ガラス・土石製品（0.7%）			
日東紡績	9.5	9	32,175
ＡＧＣ	64.8	74.8	402,424
日本板硝子	34.7	40.9	34,110
石塚硝子	1.2	0.8	2,193
日本山村硝子	2.2	2	3,558
日本電気硝子	26	32.8	88,543
オハラ	3	3.8	4,784
住友大阪セメント	11.5	11.3	44,194
太平洋セメント	43.5	51.1	144,791
日本ヒューム	7.1	7.1	6,411
日本コンクリート	13.6	15.7	5,447
三谷セキサン	3.1	3.4	17,476
アジアパイルＨＤ	11.3	12.6	8,782
東海カーボン	53.3	74	90,206
日本カーボン	3.7	4.3	19,758
東洋炭素	4.1	5.7	32,433
ノリタケ	3.9	4	26,280
ＴＯＴＯ	46.2	52.8	209,352
日本碍子	75.3	93.2	189,522
日本特殊陶業	53.4	61	218,807
ダントーホールディングス	5.1	3.5	2,982
ＭＡＲＵＷＡ	2.6	3	72,420
品川リフラクトリーズ	1.8	2.3	19,481
黒崎播磨	1.3	1.6	16,352
ヨータイ	4.9	4.3	6,677
東京窯業	8	5	1,750
ニッカトー	3.5	2.4	1,538
フジミインコーポレーテッド	6.1	19.2	59,808
クニミネ工業	2.4	1.6	1,740
エーアンドエーマテリアル	1.2	1	1,200
ニチアス	16.1	20.1	62,712
ニチハ	9.8	9.9	31,036
鉄鋼（1.0%）			
日本製鉄	315.7	369.3	1,384,875
神戸製鋼所	131.9	165.9	358,344
中山製鋼所	10.9	17	16,796
合同製鐵	3.6	4.1	21,033
ＪＦＥホールディングス	175	220.4	510,115
東京製鐵	22.2	23.2	41,876
共英製鋼	7.4	9.4	20,736
大和工業	12.4	13.6	101,401
東京鐵鋼	2.9	3.9	15,424
大阪製鐵	4.1	3.8	7,174
淀川製鋼所	8.2	9.4	37,083
中部鋼鈑	—	6.8	15,334
丸一鋼管	21.9	25.1	95,455
モリ工業	1.9	1.3	5,336
大同特殊鋼	10.3	10.4	67,215
日本高周波	2.9	1.8	1,260
日本冶金工	5.2	6	30,480
山陽特殊製鋼	6.5	8.1	24,988
愛知製鋼	4.2	4.8	21,000
日立金属	71.5	—	—
日本金属	2	1.2	1,120
大平洋金属	4.7	5.8	8,711

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
新日本電工	42	40.9	12,474
栗本鉄工所	3	3.9	11,111
虹技	1	0.6	961
日本鋳鉄管	0.8	0.5	603
三菱製鋼	4.8	5.2	8,460
日亜鋼業	8.7	5.4	1,706
日本精線	1.2	1.1	5,489
エンビプロＨＤ	5	3.9	2,496
シンニッタン	8.7	5.8	1,467
新家工業	1.5	1.2	3,440
非鉄金属（0.7%）			
大紀アルミニウム	9.3	11.7	17,842
日本軽金属ＨＤ	19.2	22.2	39,893
三井金属	20.4	24	97,656
東邦亜鉛	3.9	4.9	8,545
三菱マテリアル	43.6	55.1	145,023
住友鉱山	82.9	95.6	453,908
DOWA ホールディングス	17.6	18.5	92,426
古河機金	11.1	12.1	21,937
エス・サイエンス	37.2	32.2	740
大阪チタニウム	8.8	12.1	39,264
東邦チタニウム	13.6	14.9	29,055
ＵＡＣＪ	10.3	11.6	38,860
ＣＫサンエツ	1.4	2	7,610
古河電工	21.8	27.5	72,132
住友電工	263.8	284.8	531,152
フジクラ	84.5	88.5	110,580
ＳＷＣＣ	6.6	9.2	20,120
東京特殊電線	1	—	—
タツタ電線	13.6	16.8	11,776
カナレ電気	1.1	0.9	1,320
平河ヒューテック	4.3	4.7	6,890
リョービ	7.1	8.8	28,864
アーレステイ	8	6.1	5,532
ARE ホールディングス	30.2	33.4	65,363
金属製品（0.5%）			
稲葉製作所	3.9	4.2	6,631
宮地エンジニアリングＧ	2.2	2.3	14,444
トーカロ	19.3	21.9	31,382
アルファ CO	2.7	2	3,170
ＳＵＭＣＯ	124.7	146.6	290,927
川田テクノロジーズ	1.5	1.9	11,989
RS TECHNOLOGIES	2.1	5.5	13,673
ジェイテックコーポレーション	1	0.7	1,887
信和	4.7	3	2,400
東洋製罐グループ HD	38.5	49.2	137,858
ホッカンホールディングス	3.3	4.4	7,031
コロナ	3.4	4.5	4,248
横河ブリッジ HLDGS	10.8	10.4	29,993
駒井ハルテック	1.2	0.9	1,734
高田機工	0.6	0.5	1,677
三和ホールディングス	71.2	75.7	160,938
文化シヤッター	22.4	23.2	26,842
三協立山	9.1	9.3	8,807
アルインコ	5.5	6.1	6,661
東洋シヤッター	1.6	1.2	784
ＬＩＸＩＬ	119	120	220,560
日本フイルコン	4.8	3.5	1,708

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ノーリツ	9.7	13.3	21,532
長府製作所	6.7	8.1	17,220
リンナイ	13.1	44.7	126,568
ダイニチ工業	3.8	2.7	2,011
日東精工	9.6	12	6,804
三洋工業	0.8	0.6	1,300
岡部	10.7	14.4	10,944
ジーテクト	8.4	9.2	17,645
東プレ	11.6	14.5	26,781
高周波熱錬	11.4	12.8	13,747
東京製綱	4.7	4.9	6,781
サンコール	6.6	4.8	2,448
モリテックスチル	5.9	4	1,280
パイオラックス	10	11.4	28,146
エイチワン	6.8	8.4	7,459
日本発条	63.9	73	86,395
中央発條	3.6	6.1	4,690
アドバネクス	1	0.7	769
立川ブラインド	2.9	3.6	5,302
三益半導体	5.9	6.4	17,875
機械（5.4%）			
日本ドライケミカル	1.7	1.3	2,967
日本製鋼所	19.4	22.2	67,288
三浦工業	29.7	33.7	108,884
タクマ	21.7	24.6	39,729
ツガミ	15.4	17.9	21,855
オークマ	7.2	8.1	57,534
芝浦機械	8.6	8.1	33,777
アマダ	119.3	128.9	208,882
アイダエンジニア	16.5	16.6	17,197
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	2.3	1.4	3,628
ＦＵＪＩ	30.1	35.1	87,030
牧野フライス	7.7	8.9	61,944
オーエスジー	30.7	35.6	65,895
ダイジェット	0.9	0.5	475
旭ダイヤモンド	18.9	22.5	20,925
DMG 森精機	38.9	49	134,897
ソディツク	17.8	19.7	15,149
ディスコ	11.1	38.9	1,024,626
日東工器	3.7	3.9	8,034
日進工具	6	6.7	7,296
パンチ工業	6.4	4.8	2,208
冨士ダイス	3.9	2.5	1,652
豊和工業	4	2.9	2,334
ニデックオーケーケー	2.9	—	—
石川製作所	2.1	1.3	1,666
東洋機械金属	5	3.7	2,723
津田駒工業	1.2	1	437
エンシュウ	1.9	1.1	896
島精機製作所	11.1	12.8	24,896
オプトラン	9.5	13.3	24,751
NC ホールディングス	2.1	1.1	1,809
イワキポンプ	4.9	5.4	10,638
フリュー	6.8	8.4	14,170
ヤマシンフィルタ	11.8	19.3	6,928
日阪製作所	7.5	7.8	7,846
やまびこ	10.5	13.2	20,156
野村マイクロ・サイエンス	2.4	2.7	16,605

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
平田機工	3.3	3.9	29,913
ＰＥＧＡＳＵＳ	7.7	8.9	5,607
マルマエ	3.1	3.5	6,051
タツモ	3.5	4.9	14,567
ナブテスコ	40.3	50.7	140,439
三井海洋開発	8	10.1	21,109
レオン自動機	8.1	8.5	11,925
ＳＭＣ	22.4	26.2	1,822,210
ホソカワミクロン	4.9	5.2	22,880
ユニオンツール	2.8	3.5	12,950
瑞光	—	5.8	7,917
オイレス工業	9.7	11.3	23,605
日精エーエスビー	2.9	3.2	14,912
サトーホールディングス	9.9	11.5	24,564
技研製作所	6.7	7.6	15,716
日本エアーテック	3.2	3.8	4,940
カワタ	2.4	1.5	1,659
日精樹脂工業	4.6	6	6,390
オカダアイヨン	2.4	1.7	3,564
ワイエイシイホールディングス	3	2.3	6,467
小松製作所	346.5	378.3	1,705,754
住友重機械	40.9	47.8	188,140
日立建機	30.6	32.2	158,230
日工	9.3	12.1	8,433
巴工業	2.7	3.1	9,594
井関農機	6	7.6	9,226
ＴＯＷＡ	6.6	8.2	28,864
丸山製作所	1.2	0.9	2,152
北川鉄工所	3	3.2	4,998
ローツェ	3.8	4.2	44,352
タカキタ	2.5	1.5	753
クボタ	341.8	423.7	1,019,210
荏原実業	3.2	4.1	12,222
三菱化工機	2.2	2.5	7,137
月島ホールディングス	11.9	10.7	14,958
帝国電機製作所	4.9	5.7	15,390
東京機械	3.1	1.2	489
新東工業	14.2	16.3	18,842
渋谷工業	6	7.6	19,904
アイチ コーポレーション	10.7	11.3	11,300
小森コーポレーション	17.4	18.7	21,318
鶴見製作所	5.4	6.2	20,305
住友精密	1.2	—	—
日本ギア工業	3.4	1.8	720
酒井重工業	1.2	0.9	4,896
荏原製作所	26.2	33.1	243,781
石井鉄工所	1	0.6	1,842
酉島製作所	6.3	6.9	13,848
北越工業	6.5	8.1	17,568
ダイキン工業	83.5	96.4	2,401,806
オルガノ	2.2	11.1	44,011
トーヨーカネツ	2.6	3	10,605
栗田工業	38.6	45.1	247,824
椿本チエイン	10	11.5	46,690
大同工業	3	2.1	1,621
木村化工機	5.9	6	4,632
アネスト岩田	11.8	13.7	16,782
ダイフク	36.1	124.9	356,901

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
サムコ	2.1	2.2	9,823
加藤製作所	3.5	2.6	3,343
油研工業	1.2	0.8	1,867
タダノ	36.9	46.5	61,752
フジテック	23.5	28.3	104,030
ＣＫＤ	19.3	22.4	47,488
キトー	5.8	—	—
平和	21.3	26.8	60,836
理想科学工業	6.4	6.4	15,667
ＳＡＮＫＹＯ	15.8	15.9	104,987
日本金銭機械	7.9	8.9	9,069
マースグループHLDGS	4.9	4.6	13,606
フクシマガリレイ	4.7	5.9	30,680
オーイズミ	2.8	2	838
ダイコク電機	3.5	4.4	25,432
竹内製作所	11.7	14.7	75,411
アマノ	20.1	22.9	77,814
ＪＵＫＩ	10	12.5	7,987
サンデン	11.1	7.8	1,521
ジャノメ	6.6	8.1	5,856
マックス	9	9.9	27,531
グローリー	18.1	19.4	62,351
新晃工業	7.1	8.2	17,203
大和冷機工業	9.8	12.4	18,277
セガサミーホールディングス	68.7	64.9	180,324
日本ピストンリング	2.9	1.8	3,241
リケン	2.9	3.2	11,360
ＴＰＲ	8.6	9.2	17,829
ツバキ・ナカシマ	15.8	16.2	13,267
ホシザキ	41.2	47.7	275,467
大豊工業	6.2	6.9	6,693
日本精工	130.8	148.4	130,784
ＮＴＮ	139.7	159.4	47,070
ジェイテクト	65.2	71.9	108,281
不二越	4.7	6	25,350
日本トムソン	17.5	19.8	11,464
ＴＨＫ	37	46.6	126,985
ユーシン精機	5.7	6.3	4,428
前澤給装工業	4.9	5.5	6,842
イーグル工業	8.4	8.9	16,358
前澤工業	4.6	3	3,132
日本ピラー工業	6.5	7.5	30,825
キッツ	23.4	27.1	29,593
マキタ	86.4	100.4	403,106
三井Ｅ＆Ｓ	21.7	21.7	13,692
日立造船	60.7	65.8	59,220
三菱重工業	112.2	141.2	1,241,006
ＩＨＩ	47.8	50.9	164,610
サノヤスホールディングス	9.7	7.4	1,058
スター精密	12.4	15.3	29,360
電気機器（16.6%）			
日清紡ホールディングス	52.2	60.6	66,872
イビデン	36.8	46.3	372,252
コニカミノルタ	155.2	180.3	90,384
ブラザー工業	87.2	107.9	273,526
ミネベアミツミ	121.6	140.5	348,791
日立	367.7	392.6	3,905,192
東芝	133.6	151.4	695,380
三菱電機	713.3	834.4	1,610,809
富士電機	42.5	49.1	341,392
東洋電機製造	2.3	1.8	1,868
安川電機	75.9	95.7	551,327
シンフォニア テクノロジー	7.7	8.9	14,613
明電舎	10.9	12.3	27,933
オリジン	1.9	1.2	1,561
山洋電気	2.8	3.5	24,220
デンヨー	5.3	6.2	13,516
PHC ホールディングス	11.8	11.3	17,707
ソシオネクスト	—	11.6	172,028
東芝テック	8.2	11.7	40,833
芝浦メカトロニクス	1.4	1.4	29,540
マブチモーター	15.9	20	92,560
ニデック	169.8	196.4	1,440,201
ユーエムシーエレクトロニクストレックス・セミコンダクター	2.6	5.9	3,050
東光高岳	3.3	3.8	8,500
ダブル・スコープ	4.3	4.9	10,740
ダイヘン	21	23.1	25,918
ヤーマン	7	7.3	38,398
ＪＶＣケンウッド	12.5	13.9	14,775
ミマキエンジニアリング	62.6	73.5	49,024
Ｉ－ＰＥＸ	6.8	7.6	6,057
日新電機	3.7	5.6	8,988
大崎電気	17.8	—	—
オムロン	12.5	19.2	13,459
日東工業	63.6	74	510,970
ＩＤＥＣ	9.7	10.9	42,292
正興電機製作所	9.5	11.9	36,830
不二電機工業	2.6	1.8	2,041
ジーエス・ユアサ コーポ	1.5	1	1,128
サクサホールディングス	23	26.5	71,934
メルコホールディングス	1.7	1.1	2,758
テクノメディカ	2.1	2	6,420
ダイヤモンドエレクトリクHD	1.7	1.9	4,020
日本電気	2.1	2.7	2,330
富士通	90.7	114.2	959,280
沖電気	68.8	80.4	1,500,666
岩崎通信機	29.1	36.5	40,880
電気興業	2.9	2.3	1,925
サンケン電気	3.7	3.2	8,089
ナカヨ	6.6	7.5	70,275
アイホン	1.2	0.8	1,031
ルネサスエレクトロニクス	3.4	4.8	15,048
セイコーエプソン	417.2	526.9	1,193,165
ワコム	85.4	103.6	248,899
アルバック	58.6	61.4	38,006
アクセル	15.2	19.2	105,100
ＥＩＺＯ	3	2	3,764
ジャパンディスプレイ	5.2	5.9	30,503
日本信号	61.7	61.7	2,468
京三製作所	16.3	18.5	17,982
能美防災	15.1	17.1	8,601
ホーチキ	8.7	10.9	20,230
星和電機	4.8	6.1	10,168
エレコム	3.1	2.4	1,195
パナソニック ホールディング	17.5	19.3	34,759
シャープ	815.4	953.6	1,701,222
アンリツ	72.6	97.2	91,222
富士通ゼネラル	48.4	56.9	62,732
ソニーグループ	20.7	22.9	64,520
ＴＤＫ	478.9	565.4	7,239,947
帝国通信工業	110.7	127.8	725,648
タムラ製作所	3.3	3.6	6,908
アルプスアルパイン	27.6	34.6	20,137
池上通信機	62.6	72.1	93,513
日本電波工業	2.3	1.7	1,346
鈴木	7.7	9.7	13,744
メイコー	3.8	4.3	5,043
日本トリム	8.3	8.8	30,888
ローランド ディー．ジー．	1.5	1.8	5,607
フオスター電機	3.6	4.4	15,312
ＳＭＫ	7.2	7.5	7,327
ヨコオ	1.7	1.9	4,837
ティアック	5.2	6.4	10,598
ホシデン	12.6	8.1	923
ヒロセ電機	17	18.8	36,791
日本航空電子	10.6	13	228,020
ＴＯＡ	15.4	16.5	50,572
マクセル	8.3	9.2	11,224
古野電気	14	16.4	28,060
スミダコーポレーション	9.2	10.5	14,616
アイコム	5.8	10.8	16,264
リオン	2.4	3.1	10,648
本多通信工業	2.7	3.3	7,593
横河電機	2.8	—	—
新電元工業	70.2	88.3	264,811
アズビル	2.7	3.1	9,811
東亜ディーケーケー	44.3	55.9	269,438
日本光電工業	3.9	2.4	2,112
チノー	29.4	36.9	142,544
共和電業	2.4	3.3	6,850
日本電子材料	7	4.9	1,813
堀場製作所	3.6	5.3	7,865
アドバンテスト	14.1	15.3	122,017
小野測器	56.8	63	1,005,165
エスペック	2.7	2.1	970
キーエンス	5.7	6.4	15,584
日置電機	69.3	80	4,608,800
シスメックス	3.3	3.8	28,196
日本マイクロニクス	54.7	69	530,058
メガチップス	10.5	14.4	28,598
OBARA GROUP	6.8	6.6	27,225
澤藤電機	3	4.4	18,238
原田工業	1	0.6	766
コーセル	3.6	2.3	1,941
イリソ電子工業	8.5	9.6	12,355
オプテックスグループ	6.4	7.3	31,609
千代田インテグレ	11.7	14.7	24,901
レーザーテック	2.6	3.1	8,828
スタンレー電気	31.3	36.6	791,841
岩崎電気	49.3	56.3	139,764
ウシオ電機	2.5	—	—
岡谷電機	36.3	40.6	74,988
ヘリオステクノＨ	5.3	4	1,296
	7.2	4.9	2,077

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エノモト	2.1	1.3	2,247
日本セラミック	6.4	6.5	16,952
遠藤照明	3.5	2.4	3,064
古河電池	5.4	5.9	5,894
双信電機	3.8	2.1	730
山一電機	5	6.5	11,472
図研	5	6.9	28,842
日本電子	14.7	20	92,820
カシオ	47.3	59.6	76,377
ファナック	67.1	389.8	1,578,300
日本シイエムケイ	13.6	16.9	11,272
エンプラス	1.9	2.3	23,092
大真空	9.5	9.7	7,585
ローム	31.8	36.9	420,106
浜松ホトニクス	50.9	64.1	423,124
三井ハイテック	6.6	8.3	67,147
新光電気工業	22.5	28.3	165,470
京セラ	107.5	124.2	961,929
太陽誘電	34	38.9	166,103
村田製作所	208.5	242.4	2,004,163
双葉電子工業	12.7	15.1	8,425
北陸電気工業	2.8	2	3,010
ニチコン	20.3	16.3	22,200
日本ケミコン	7.2	7.9	11,549
ＫＯＡ	10.6	12.1	22,324
市光工業	9.6	14.4	8,496
小糸製作所	38.2	96.1	225,546
ミツバ	11.7	15	12,165
SCREEN ホールディングス	12.1	13.7	190,909
キヤノン電子	7	8.8	16,588
キヤノン	348.3	398.7	1,468,810
リコー	181.9	200.4	268,435
象印マホービン	18.9	21.7	39,993
MUTOH ホールディングス	1	0.7	1,414
東京エレクトロン	48.5	169.2	3,510,900
イノテック	4.4	5.3	8,745
輸送用機器（9.0%）			
トヨタ紡織	26.8	33.7	97,915
芦森工業	1.6	1	2,258
ユニプレス	12.7	14.3	18,418
豊田自動織機	54.1	58.4	735,548
モリタホールディングス	12.3	14	23,660
三桜工業	10.7	12.2	12,248
デンソー	149.6	164.9	1,695,996
東海理化電機	20.3	22.5	55,417
川崎重工業	51.9	60.2	235,863
名村造船所	20	13.7	13,275
日本車輌	2.4	3.1	6,813
三菱ロジスネクスト	10.1	12.8	18,048
近畿車輌	1.2	0.8	1,658
日産自動車	901.8	1,135.6	806,389
いすゞ自動車	221.4	232.4	470,261
トヨタ自動車	3,485.1	4,389.2	12,640,896
日野自動車	95.4	103	63,036
三菱自動車工業	283.5	311.9	206,664
エフテック	4.7	3.7	3,267
レシップホールディングス	2.9	2.1	1,192
GMB	1.4	1	2,160

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ファルテック	1.6	0.8	468
武蔵精密工業	17	19.5	33,208
日産車体	11.4	14.1	13,014
新明和工業	20	25.1	33,307
極東開発工業	12.4	13.2	24,789
トピー工業	5.9	6.5	17,621
ティラド	2.1	2	4,642
タチエス	12.6	12.6	23,448
ＮＯＫ	28.9	31	66,154
フタバ産業	17.1	21.4	17,120
ＫＹＢ	6.7	7.7	39,424
大同メタル工業	14.7	15.5	9,067
プレス工業	34.7	35.7	25,811
ミクニ	9.3	6.1	3,123
太平洋工業	14.7	18.3	28,584
河西工業	9.2	7	2,086
アイシン	56	61.6	363,932
マツダ	225.1	264.4	489,801
今仙電機製作所	5.2	3.3	2,240
本田技研	558.9	649.8	3,513,468
スズキ	151.5	146.8	923,518
SUBARU	201	252.9	782,472
安永	3.1	2.3	1,978
ヤマハ発動機	99.7	115.2	475,430
ＴＢＫ	7.3	5.1	2,412
エクセディ	11.6	13.1	36,706
豊田合成	21.7	23.3	80,967
愛三工業	12.2	13.2	18,519
盟和産業	1.1	0.7	728
日本プラスト	5.4	4.1	2,086
ヨロズ	5.9	7.5	7,425
エフ・シー・シー	12.8	14.2	28,087
シマノ	26	32.4	663,228
テイ・エス テック	32.5	36.6	65,349
ジャムコ	4.6	2.9	4,758
精密機器（2.3%）			
テルモ	216.3	245.9	1,063,517
クリエートメディック	2.5	1.7	1,577
日機装	15.8	18.6	19,306
日本エム・ディ・エム	4.4	4.7	3,595
島津製作所	91.3	97.3	403,989
ＪＭＳ	5.9	7.3	4,051
クボテック	2	1.2	321
長野計器	5.1	5.8	15,265
ブイ・テクノロジー	3.3	3.9	8,704
東京計器	4.9	6.1	9,375
愛知時計	2.8	3	5,307
インターアクション	3.8	3.8	3,967
オーバル	7.4	4.6	1,945
東京精密	11.9	17.6	129,184
マニー	28	32	60,704
ニコン	107.9	115.6	190,104
トプコン	36	42.1	74,222
オリンパス	366.2	492	1,024,344
理研計器	5.1	5	29,500
タムロン	4.8	4.9	21,535
ＨＯＹＡ	147.6	169.4	2,726,493
シード	3.6	2.6	2,116

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ノーリツ鋼機	6	7.6	24,890
A&D ホロンホールディングス	8.7	11.7	20,393
朝日インテック	83.9	89.3	260,309
シチズン時計	74.9	73.5	70,045
リズム	2.5	1.6	2,902
大研医器	6.1	3.9	2,145
メニコン	23.6	27.5	56,608
シンシア	0.7	0.6	330
松風	2.6	3.6	8,042
セイコーグループ	10.9	12.4	34,211
ニプロ	53	66.6	81,718
その他製品（2.2%）			
ＫＹＯＲＩＴＳＵ	—	7.7	1,547
中本パックス	2.2	1.8	2,977
スノーピーク	10.9	11.4	15,732
パラマウントベッド HD	14.7	18.4	44,601
トランザクション	4.8	5.3	10,292
粧美堂	1.5	1.5	786
ニホンフラッシュ	6	7.3	6,628
前田工繊	6.8	6.7	20,535
永大産業	7.5	5.5	1,270
アートネイチャー	6.4	8	6,712
バンダイナムコ HLDGS	63.2	219	714,816
アイフィスジャパン	2.2	1.4	858
共立印刷	10.1	—	—
ＳＨＯＥＩ	6.7	18	44,262
フランスベッド HLDGS	10	9	11,205
パイロットコーポレーション	10	11.2	56,806
萩原工業	4.1	5.3	9,863
フジシールインターナショナル	15.8	16.2	29,289
タカラトミー	31.6	36.4	83,829
広済堂ホールディングス	4.8	3.6	10,292
エステールホールディングス	1.4	1.2	774
タカノ	2.8	1.9	1,746
プロネクサス	5.8	6.9	8,031
ホクシン	5.6	4	528
ウッドワン	2.3	1.7	1,849
大建工業	3.8	4.7	14,311
凸版印刷	99.6	98.3	377,177
大日本印刷	82.8	87.4	355,193
共同印刷	1.9	2.3	7,728
ＮＩＳＳＨＡ	12.1	13.8	23,680
光村印刷	0.4	0.6	837
TAKARA & COMPANY	4.4	5.2	13,124
アシックス	58.6	68.1	386,263
ツツミ	1.9	1.4	3,421
ローランド	4.6	5.9	23,777
小松ウオール工業	2.3	2.9	8,932
ヤマハ	44.4	50.4	217,476
河合楽器	1.9	2.2	7,854
クリナップ	7.3	8.7	6,394
ピジョン	40.5	50.9	86,199
兼松サステック	0.4	—	—
キングジム	5.6	6.9	6,092
リンテック	14.6	16.1	39,879
イトーキ	12.7	16.4	24,009
任天堂	43.2	504.7	3,255,819
三菱鉛筆	9.3	11.3	22,374

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
タカラスタンダード	12.3	14.3	27,270
コクヨ	30.6	34.6	83,593
ナカバヤシ	5.5	8.5	4,513
グローブライド	5.7	6.4	13,241
オカムラ	21.5	24	55,656
美津濃	6.3	7.9	38,394
電気・ガス業（1.4%）			
東京電力ＨＤ	572.5	720.6	503,627
中部電力	215.8	294.6	617,923
関西電力	267.2	308.7	723,592
中国電力	110.2	127.3	132,264
北陸電力	64.6	75.5	69,701
東北電力	167.1	195.4	216,991
四国電力	63.7	68.2	75,872
九州電力	146.6	184.3	197,753
北海道電力	66.1	77.2	55,777
沖縄電力	16.1	18.7	23,300
電源開発	56.5	60.2	155,556
エフオン	4.6	5.3	2,703
イーレックス	9.9	14.2	12,027
レノバ	15	21.3	26,710
東京瓦斯	136.1	169	601,978
大阪瓦斯	128.6	161.9	415,273
東邦瓦斯	30	31.5	87,806
北海道瓦斯	3.7	4.8	11,740
広島ガス	12.7	16.8	6,938
西部ガス HLDGS	7.4	7.5	15,847
静岡ガス	14.5	15.9	17,060
メタウォーター	7.8	9.4	18,104
陸運業（2.9%）			
SBS ホールディングス	5.6	7.1	20,334
東武鉄道	69.8	87.8	360,506
相鉄ホールディングス	22.9	26.4	78,434
東急	178	224.2	412,528
京浜急行	85.3	90.6	123,034
小田急電鉄	96.2	121.2	283,244
京王電鉄	33.6	42.3	226,008
京成電鉄	46.5	51.5	294,683
富士急行	7.8	9.8	51,058
東日本旅客鉄道	116.6	135.6	1,196,805
西日本旅客鉄道	81.1	102.1	670,797
東海旅客鉄道	53.8	61.6	1,196,580
西武ホールディングス	92.4	96.6	148,039
鴻池運輸	10.7	13.6	27,376
西日本鉄道	18.3	21.4	55,607
ハマキョウレックス	5	6.2	26,009
サカイ引越センター	3.5	3.8	19,722
近鉄グループ HLDGS	68	79.8	354,391
阪急阪神 HLDGS	84.4	106.4	567,537
南海電鉄	30.3	38.1	113,557
京阪ホールディングス	28.3	44	182,644
神戸電鉄	1.7	2.1	6,468
名古屋鉄道	70	88.2	209,210
山陽電鉄	5.2	6	13,380
アルプス物流	5.1	6.3	10,193
ヤマトホールディングス	99.1	102.2	260,047
山九	17.6	20.3	109,254
丸運	3	2.5	670

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
丸全昭和運輸	4.9	4.9	19,967
センコーグループ HLDGS	33.4	42.2	46,757
トナミホールディングス	1.4	1.8	8,937
ニッコンホールディングス	21.8	25.5	86,037
日石輸送	0.8	0.5	1,404
福山通運	9.3	6.1	23,363
セイノーホールディングス	39.5	44.9	96,602
エスライングループ本社	2	1.5	1,329
神奈川中央交通	1.8	2.2	7,315
日立物流	13.3	—	—
AZ-COM 丸和ホールディ	12.2	19.3	41,379
C&F ロジホールディングス	6.1	7.7	11,157
九州旅客鉄道	48.7	56.4	183,751
SG ホールディングス	121.5	153.1	313,089
NIPPON EXPRESS	23.6	27.1	210,567
海運業（0.7%）			
日本郵船	60.6	213.5	935,557
商船三井	111.7	140.7	635,260
川崎汽船	22.3	60	333,600
NS ユナイテッド海運	3.4	4.3	18,834
明治海運	6.9	5.1	4,498
飯野海運	28.6	29.3	33,196
共栄タンカー	1.3	0.9	789
乾汽船	4.4	10.1	13,008
空運業（0.5%）			
日本航空	155.7	196	590,156
ANA ホールディングス	172.3	217.1	709,048
パスコ	1.4	1.2	2,073
倉庫・運輸関連業（0.1%）			
トランコム	2	2.3	17,434
日新	5.3	6.1	17,531
三菱倉庫	17.5	17.2	70,967
三井倉庫 HOLD	7.1	7.4	32,560
住友倉庫	21.3	21.5	55,190
渋沢倉庫	3.5	3.2	10,912
東陽倉庫	10.1	6.9	2,042
日本トランスシティ	12.8	16	11,184
ケイヒン	1.2	0.9	1,798
中央倉庫	3.6	3.8	4,183
川西倉庫	1.3	0.9	1,008
安田倉庫	4.9	5.4	5,891
ファイズホールディングス	1.6	1	1,153
東洋埠頭	1.8	1.5	2,212
上組	34.4	38.3	124,245
サンリツ	1.6	1.2	895
キムラユニティー	3.8	2.6	3,637
キューソー流通システム	4.2	2.7	2,605
東海運	4.1	3	870
エーアイテイー	4.5	5	8,930
内外トランスライン	2.3	3.2	8,272
日本コンセプト	2	2.9	5,521
情報・通信業（7.9%）			
NEC ネッツエスアイ	24.8	26.8	53,519
クロスキャット	4.1	4.6	4,669
システナ	107	134.7	37,446
デジタルアーツ	4	5.1	24,148
日鉄ソリューションズ	13	13.7	58,773
キューブシステム	3.9	4.7	5,649

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
WOW WORLD	1	—	—
コア	3.1	3.5	6,230
手間いらず	1.1	1.3	3,693
ラクーンホールディングス	6.4	6.6	4,903
ソリトンシステムズ	3.3	4.1	4,751
ソフトクリエイト HD	3.3	6.6	11,272
ＴＩＳ	65.6	87.7	302,828
JNS ホールディングス	3.6	2.4	1,063
グリー	34.3	21.4	12,540
GMOペパボ	0.9	1	1,360
コーエーテクモＨＤ	23.9	50.2	111,770
三菱総合研究所	3.1	4	20,280
ボルテージ	2.1	1.5	432
電算	0.7	0.6	953
ＡＧＳ	3	2.2	1,628
ファインデックス	5.1	6.3	4,636
ブレインパッド	6.4	6	5,274
ＫＬａｂ	12	14.7	4,145
ポールトゥウィンホールディン	10.9	13.8	7,907
ネクソン	171.3	178.8	521,380
アイスタイル	19.4	23.7	11,565
エムアップホールディングス	8.7	9.8	11,995
エイチーム	4.7	4.6	2,792
エニグモ	8.1	10.4	3,962
テクノスジャパン	5.8	4.5	3,240
ｅｎｉｓｈ	5.6	4.2	974
コロプラ	24.8	31.1	20,557
オルトプラス	5.6	4.4	954
ブロードリーフ	37.2	38	19,380
クロス・マーケティング G	2.9	3.3	2,382
デジタルハーツ HLDGS	3.4	5	5,340
システム情報	5.6	6.3	4,788
メディアドゥ	2.5	3.1	3,620
じげん	21.4	23.5	13,066
ブイキューブ	7.6	9.5	3,876
エンカレッジ・テクノロジ	1.7	1.2	615
サイバーリンクス	2.3	2	1,614
ディー・エル・イー	4.3	4.3	1,087
フィックスターズ	7.3	9	10,800
CARTA HOLDINGS	3.1	3.7	4,669
オプティム	5.2	6.6	5,629
セレス	2.5	3.3	3,197
ＳＨＩＦＴ	4.7	5.3	143,232
ティーガイア	6.6	8.5	15,444
セック	1.1	0.7	2,443
テクマトリックス	12.7	14.6	22,805
プロシップ	2.5	3.5	4,508
ガンホー・オンライン・エンター	19.5	20.9	49,888
GMO ペイメントゲートウェイ	14.5	16	134,832
ザッパラス	2.4	1.4	667
システムリサーチ	2.1	2.5	6,740
インターネットイニシアティブ	20	43.7	106,824
さくらインターネット	7.8	9	11,781
ヴィンクス	2.2	1.3	1,693
GMO グローバルサイン HD	2	2.4	6,698
SRA ホールディングス	3.6	4.1	14,903
システムインテグレータ	2.4	1.5	642
朝日ネット	6.6	8.4	5,367

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ｅＢＡＳＥ	8.9	11.3	7,695
アバントグループ	8	10.1	13,352
アドソル日進	2.6	3.3	5,768
ODK ソリューションズ	1.5	1.1	664
フリービット	3.8	4.2	5,254
コムチュア	8.4	10.6	25,736
サイバーコム	1.2	0.8	1,074
アステリア	5.5	6.2	4,674
アイル	3.6	3.7	13,523
マークラインズ	3.4	4.4	13,398
メディカル・データ・ビジ	9.5	9.5	7,685
ｇｕｍｉ	10.5	11.8	6,171
ショーケース	1.6	1.2	446
モバイルファクトリー	1.6	1.1	883
テラスカイ	2.7	3.5	7,073
デジタル・インフォメーション	3.3	4.6	8,326
PCI ホールディングス	2.8	2	2,200
アイビーシー	1.2	0.8	484
ネオジャパン	2.1	2.7	2,754
ＰＲ ＴＩＭＥＳ	1.6	2	3,580
ラクス	34.4	37.9	83,512
ランドコンピュータ	1.7	1.3	1,596
ダブルスタンダード	2.3	3.3	4,689
オープンドア	4.5	5.6	5,723
マイネット	2.3	1.7	603
アカツキ	3.4	3.8	8,804
ベネフィットジャパン	0.6	0.3	367
UBICOM ホールディングス	2	2.5	3,242
カナミックネットワーク	9.3	8.6	4,360
ノムラシステムコーポレーション	7	5.7	666
チェンジホールディングス	15.6	19.6	37,200
シンクロ・フード	4.1	3.3	2,026
オークネット	3.3	3.1	5,598
キャピタル・アセット・プラン	1.4	1	888
セグエグループ	1.6	1.7	1,630
エイトレッド	1	0.8	1,178
マクロミル	14.4	15.9	12,386
ビーグリー	1.2	1.1	1,222
オロ	1.9	2.9	5,585
ユーザーローカル	2.2	2.9	5,338
テモナ	1.3	1.2	358
ニーズウェル	2.3	2.9	2,070
マネーフォワード	15.3	17.8	91,456
サインポスト	2.5	2.2	1,062
SUN ASTERISK	—	5.7	8,105
電算システムＨＤ	3.1	3.5	10,535
APPIER GROUP	—	27.4	46,717
ソルクシーズ	6	4.2	1,785
フェイス	1.9	1.5	751
プロトコーポレーション	8.1	10	12,230
ハイマックス	2	2.5	3,632
野村総合研究所	130.4	159.7	682,557
サイバネットシステム	5.3	5.7	4,343
ＣＥホールディングス	3.7	2.7	1,579
日本システム技術	1.4	2.2	4,912
インテージホールディングス	8.6	9.1	19,974
東邦システムサイエンス	1.9	2.1	2,914
ソースネクスト	32.7	40.6	7,795

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
インフォコム	8.1	10.3	29,581
シンプレクスＨＤ	11.9	13.7	37,647
ＨＥＲＯＺ	2.2	2.7	4,109
ラクスル	8.9	19.3	26,981
メルカリ	28.5	48.5	154,521
ＩＰＳ	2.1	2.6	6,445
ＦＩＧ	8.3	6.1	1,872
システムサポート	2.6	3.1	6,723
イーソル	4.1	5.8	4,384
アルテリア・ネットワークス	7	—	—
東海ソフト	1.2	0.8	874
ウイングアーク1ST	5.7	8.3	21,696
ヒト・コミュニケーションズHD	1.7	2.2	3,080
サーバーワークス	1.3	1.6	5,984
東名	0.6	0.4	967
ヴィッツ	0.7	0.5	576
トビラシステムズ	1.9	1.5	1,455
Ｓａｎｓａｎ	23.7	26.2	34,885
Ｌｉｎｋ－Ｕ	1.3	1.2	1,034
ギフティ	6.8	7	10,241
メドレー	—	10.8	53,460
ベース	1.1	2.7	12,190
ＪＭＤＣ	9.4	13.3	72,884
フォーカスシステムズ	4.5	5.8	5,753
クレスコ	5.5	6.2	11,600
フジ・メディア・HD	66.2	77.1	124,979
オービック	23.6	26.8	645,880
ジャストシステム	10.7	11.5	33,574
ＴＤＣソフト	5.9	6.7	11,959
Ｚホールディングス	1,081.4	1,140.7	502,706
トレンドマイクロ	36.8	37.9	223,382
ID ホールディングス	4.5	5.4	7,641
日本オラクル	12.2	15.3	150,781
アルファシステムズ	2	2.5	7,437
フューチャー	15.9	17.1	25,154
CAC HOLDINGS	4.1	4.3	7,679
ＳＢテクノロジー	3.2	3.4	7,820
トーセ	2	1.5	1,105
オービックビジネスＣ	7.2	15.8	94,326
伊藤忠テクノソリュー	34.1	—	—
アイティフォー	9.2	10.5	11,644
東計電算	0.9	1.1	7,183
エックスネット	1.1	0.7	764
大塚商会	36.1	39.8	245,048
サイボウズ	8.7	11	22,528
電通国際情報Ｓ	7.7	9.7	54,611
ＡＣＣＥＳＳ	8.6	9.4	7,585
デジタルガレージ	12.4	14.2	53,179
イーエムシステムズ	10.7	13.3	9,975
ウェザーニューズ	2.3	2.5	16,075
ＣＩＪ	5.6	13.2	7,431
ビジネスエンジニアリング	1.7	1.1	3,883
日本エンタープライズ	7.3	5.4	712
WOWOW	2.8	6	6,954
スカラ	6.2	7.3	5,679
インテリジェント ウェイブ	4	2.8	2,466
IMAGICA GROUP	5.4	6.6	3,946
ネットワンシステムズ	27.7	29.9	83,406

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
システムソフト	22.6	27.2	2,094
アルゴグラフィックス	5.8	7.3	25,732
マーベラス	11.8	12.8	9,356
エイベックス	13	13.6	20,386
ＢＩＰＲＯＧＹ	23.4	29.5	113,250
兼松エレクトロニクス	4.1	—	—
都築電気	3.4	4.2	9,828
TBS ホールディングス	36.6	41.1	108,709
日本テレビ HLDS	62.8	71	100,358
朝日放送グループ HD	6.1	7.3	5,124
テレビ朝日ＨＤ	18	19.5	33,852
スカパー JSATHD	63.5	71	52,824
テレビ東京ＨＤ	4.6	5.8	17,835
日本ＢＳ放送	2.4	1.9	1,729
ビジョン	8.4	12	18,600
スマートバリュー	1.7	1.3	546
USEN-NEXT HLDGS	5.7	9	29,970
ワイヤレスゲート	3.2	2.3	499
コネクシオ	5.3	—	—
日本通信	62.6	73.9	16,258
クロップス	1.6	0.9	999
日本電信電話	840.9	25,680.6	4,648,188
ＫＤＤＩ	546.9	619.5	2,930,235
ソフトバンク	1,135.7	1,288.5	2,267,760
光通信	8.6	9.4	224,660
エムティーアイ	5.9	5.4	3,315
GMO インターネットグループ	23.6	29.6	72,549
ファイバーゲート	3.4	4.3	6,183
アイドママーケティングコミュ	1.7	2.1	539
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	40.4	42.4	135,044
学研ホールディングス	10.6	13.3	11,730
ゼンリン	12.5	13.6	12,539
昭文社ホールディングス	3.3	2.2	706
インプレスホールディングス	6.2	4.6	855
アイネット	3.5	4.8	8,452
松竹	4.3	4.6	50,577
東宝	44.3	50.1	272,694
東映	2.1	2.2	44,044
NTT データグループ	199.7	251.5	542,485
ピー・シー・エー	4.4	4.6	5,823
ビジネスＢ太田昭和	2.5	3.4	7,306
ＤＴＳ	13.9	17.1	57,370
スクウェア・エニックス・HD	34.9	40.3	213,630
シーイーシー	8.1	11.2	18,849
カプコン	70.7	79.7	449,268
アイ・エス・ビー	3.2	4.1	5,924
ジャステック	3.8	4.9	7,276
ＳＣＳＫ	51.8	65.4	173,931
ＮＳＷ	2.9	3.1	8,952
アイネス	6.4	5.6	9,312
ＴＫＣ	11.4	12.8	46,912
富士ソフト	7.2	16.1	77,280
ＮＳＤ	23.3	28.6	73,873
コナミグループ	27.3	34.3	286,816
福井コンピュータ HLDS	3.4	5.6	15,204
JBCC ホールディングス	5	5.8	16,083
ミロク情報サービス	6.7	7.3	11,767
ソフトバンクグループ	449.8	395.5	2,569,563

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
卸売業（6.9%）			
高千穂交易	2.7	2	6,630
オルバヘルスケア HLDGS	1.2	0.8	1,420
伊藤忠食品	1.5	1.9	12,578
エレマテック	5.9	7.6	14,706
あらた	5.5	6.5	38,090
トーメンデバイス	1.1	1.2	6,096
東京エレクトロンデバイス	2.2	3.1	32,395
円谷フィールズホールディ	6.6	14.5	30,537
双日	77.2	84.3	296,904
アルフレッサホールディングス	78.1	84.9	220,867
横浜冷凍	18.7	23	31,142
神栄	1.1	0.7	1,152
ラサ商事	3	2.5	4,070
アルコニックス	9.7	11	15,554
神戸物産	51.9	65.5	238,944
ハイパー	1.5	1.2	429
あい ホールディングス	10.7	13.6	33,469
ディーブイエックス	2.4	1.5	1,533
ダイワボウＨＤ	32	34.6	103,471
マクニカホールディングス	17.8	20	131,400
ラクト・ジャパン	2.6	3.3	7,137
グリムス	3.3	3.6	8,150
バイタルＫＳＫ HD	11.8	10.5	10,552
八洲電機	5.5	6.9	9,059
メディアスホールディングス	4.1	5.4	4,195
レスターホールディングス	7.1	8.1	20,476
ジオリーブグループ	1.6	1.3	1,656
大光	3.3	2.3	1,547
OCHI ホールディングス	1.5	1.2	1,748
TOKAI ホールディングス	36.3	41.6	39,145
黒谷	2.1	1.5	913
Ｃｏｍｉｎｉｘ	0.8	1.1	971
三洋貿易	7	9.5	13,480
ビューティガレージ	1.2	1.3	6,890
ウイン・パートナーズ	5.3	6.1	6,844
ミタチ産業	2.1	1.4	1,624
シップヘルスケア HD	21.6	30.4	71,348
明治電機工業	2.2	3.2	4,896
デリカフーズ HLDGS	2.8	2.2	1,496
スターティアホールディングス	1.7	1.1	1,867
コメダホールディングス	16.3	20.8	61,755
ピーバンドットコム	1.1	0.8	364
アセンテック	2.5	2.8	1,509
富士興産	1.9	1.3	2,531
協栄産業	0.9	0.5	1,162
フルサト・マルカ HD	6.7	7.6	21,204
ヤマエグループ HD	4.3	4.8	18,120
小野建	6.9	8.3	14,823
南陽	1.4	1	2,288
佐鳥電機	4.8	3.5	6,314
エコートレーディング	1	1.1	1,531
伯東	4.4	4.8	26,256
コンドーテック	5.5	6.3	7,560
中山福	3.3	2.9	1,044
ナガイレーベン	9.1	10.7	24,684
三菱食品	7.3	7.8	32,253
松田産業	5.5	6.4	14,937
第一興商	14.3	32.7	86,001
メディパル HD	69.7	80.9	213,899
ＳＰＫ	2.9	3.7	7,733
萩原電気 HLDGS	2.4	3.5	14,822
アズワン	10.8	12.1	70,555
スズデン	2.3	2.9	6,803
尾家産業	1.7	1.3	2,627
シモジマ	4.4	5.8	7,145
ドウシシャ	7.2	8.9	20,986
小津産業	1.7	1.2	1,963
高速	3.8	4.4	9,235
たけびし	2.6	3.3	6,444
リックス	1.6	1.2	3,996
丸文	5.9	7.6	9,446
ハピネット	5.5	7.2	18,691
橋本総業 HLDGS	1.3	3.3	3,877
日本ライフライン	22.4	24.8	30,479
タカショー	5.9	7.3	4,737
ＩＤＯＭ	22.9	25.6	18,944
進和	4.5	5.2	12,724
エスケイジャパン	1.9	1.3	925
ダイトロン	2.6	3.3	10,246
シークス	9.6	12.1	19,009
田中商事	1.9	1.5	1,090
オーハシテクニカ	3.6	4.1	7,093
白銅	2.4	3	7,338
ダイコー通産	0.9	0.6	726
伊藤忠	451.3	521.1	2,999,972
丸紅	652.2	660	1,675,740
高島	1	0.9	3,618
長瀬産業	34.2	38.8	98,940
蝶理	4.2	4.6	14,191
豊田通商	67.1	74.1	680,682
三共生興	10.1	11.7	9,430
兼松	26	32.8	73,176
ツカモトコーポレーション	1.1	0.8	1,030
三井物産	545.6	600.2	3,500,366
日本紙パルプ	3.6	4.5	23,220
カメイ	8	9	14,031
東都水産	0.4	0.3	1,971
OUG ホールディングス	1	0.8	2,020
スターゼン	5	6.5	17,225
山善	27.2	22.8	28,158
椿本興業	1.2	1.4	7,616
住友商事	445.5	511.8	1,645,948
内田洋行	3	3.4	23,290
三菱商事	493.7	515.6	3,963,932
第一実業	2.9	3	17,850
キヤノンマーケティング JPN	15.5	19.6	75,460
西華産業	3.1	3.2	7,040
佐藤商事	5	5.9	9,434
菱洋エレクトロ	4.4	7.2	24,012
東京産業	6.3	7.5	6,630
ユアサ商事	6	7.3	31,536
神鋼商事	1.7	2.1	12,957
トルク	1.9	2.9	814
阪和興業	13	15.2	76,912
正栄食品	4.5	5.6	28,728
カナデン	6.1	5.6	7,761
ＲＹＯＤＥＮ	5.8	6.8	16,435
岩谷産業	16.7	19.2	152,121
ナイス	2.5	2.5	3,807
ニチモウ	0.9	0.7	2,992
極東貿易	4.4	5	9,880
アステナホールディングス	11.6	15.8	7,647
三愛オブリ	16.8	22.4	40,947
稲畑産業	15.1	16.7	54,776
ＧＳＩクレオス	3.6	4.9	11,456
明和産業	7	11.2	7,604
クワザワホールディングス	2.6	1.8	1,026
ワキタ	13.7	15.6	22,635
東邦ホールディングス	20.4	21.1	66,169
サンゲツ	18.1	21.2	66,144
ミツウロコグループ	8.4	10.8	14,979
シナネンホールディングス	2.5	2.7	11,137
伊藤忠エネクス	16.5	21	33,138
サンリオ	21.2	24	173,688
サンワ テクノス	3.8	4.3	9,877
リョーサン	7.7	9	39,240
新光商事	9.8	11.4	14,375
トーホー	2.9	3.6	12,906
三信電気	2.8	3.4	7,667
東陽テクニカ	7.3	8.5	11,381
モスフード サービス	9.9	12.5	41,812
加賀電子	6.1	6.9	46,506
ソーダニツカ	5.8	4.1	4,464
立花エレテック	4.8	6.2	18,203
フオーバル	2.7	3.3	4,101
ＰＡＬＴＡＣ	10.6	13.3	64,584
三谷産業	11.5	14.4	4,881
太平洋興発	2.6	2	1,640
西本 WISMETTAC HD	1.7	2.2	11,308
ヤマシタヘルスケア HLDGS	0.7	0.4	808
コーア商事 HLDGS	4.8	4.6	3,321
KPP グループホールディン	14.1	19.7	14,282
ヤマタネ	3.1	3.7	7,699
丸紅建材リース	0.6	0.6	1,692
日鉄物産	4.5	—	—
泉州電業	1.7	4.2	13,860
トラスコ中山	14.1	17.8	45,318
オートバックスセブン	23.4	29.7	47,326
モリト	5	6	8,250
加藤産業	8.1	10.5	44,782
北恵	1.5	1.4	1,271
イエローハット	12	15.1	29,188
JK ホールディングス	5.2	6.3	6,369
日伝	5	5	13,140
北沢産業	3.6	2.9	907
杉本商事	3.5	3.7	8,473
因幡電機産業	18.5	22	73,370
東テク	2.2	2.8	15,204
ミスミグループ本社	94.5	127.7	313,631
アルテック	4.2	2.9	759
タキヒヨー	1.8	1.4	1,741
蔵王産業	1.3	0.9	2,358
スズケン	26.9	24.8	111,550

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ジェコス	5.1	4.9	4,802
グローセル	8.1	6.8	2,978
小売業（4.2%）			
ローソン	16.7	21	142,863
サンエー	5.1	6.4	31,296
カワチ薬品	5.8	6.6	15,364
エービーシー・マート	11.8	37.1	102,321
ハードオフコーポレーション	3.2	2.3	3,509
アスクル	16.2	17.5	33,127
ゲオホールディングス	9.1	8.3	20,808
アダストリア	8.2	10.2	29,355
ジーフット	4.9	3.7	1,065
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	0.8	0.8	691
くら寿司	7.9	9.9	34,303
キャンドゥ	2.4	3	8,199
IKホールディングス	2.3	1.7	664
パルグループHLDGS	6.7	16.6	33,415
エディオン	34.4	33.7	50,550
サーラコーポレーション	14.4	17.8	13,866
ワッツ	3.6	2.7	1,641
ハローズ	3.4	3.8	16,169
フジオフードG本社	5.7	9.6	13,488
あみやき亭	1.8	2.1	7,654
ひらまつ	15.5	12.2	3,318
大黒天物産	2.4	2.6	17,576
ハニーズホールディングス	6.1	6.7	11,061
ファーマライズHD	1.3	1.2	784
アルペン	5.5	7.1	13,717
ハブ	2.4	1.9	1,613
クオールホールディングス	9.3	11.6	22,364
ジンズホールディングス	4	5	15,825
ビックカメラ	44.5	45.2	49,132
DCMホールディングス	44.5	49.3	61,526
ペッパーフードサービス	14.1	18.4	2,116
ＭｏｎｏｔａＲＯ	95.1	120	190,920
東京一番フーズ	1.1	1.4	777
ＤＤグループ	4.1	3.7	6,549
きちりホールディングス	1.8	1.4	1,239
アークランドサービスHD	5.5	—	—
J. フロント リテイリング	83.6	105.1	166,478
ドトール・日レスＨＤ	11.9	15.1	35,726
マツキヨココカラ＆カンパニー	44.1	51.3	423,173
ブロンコビリー	3.5	5	15,175
ＺＯＺＯ	51.8	55.9	161,886
トレジャー・ファクトリー	2.2	3.5	4,669
物語コーポレーション	3.7	14.1	61,405
三越伊勢丹ＨＤ	113.2	142.4	246,494
Ｈａｍｅｅ	2.7	2.9	2,682
マーケットエンタープライズ	0.8	0.6	736
ウエルシアＨＤ	39.8	43.8	116,026
クリエイトＳＤＨ	11	13.9	48,858
丸善CHI HD	8.2	7.3	2,518
ミサワ	1.4	1	610
ティーライフ	1	0.8	1,127
エー・ピーホールディングス	1.3	1.2	1,222
チムニー	2.4	1.8	2,728
シュッピン	6.2	6.3	7,037
オイシックス・ラ・大地	10.8	11.4	18,946

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ネクステージ	15.3	19.3	40,568
ジョイフル本田	21.5	24.7	43,447
鳥貴族ホールディングス	2.5	3.1	10,354
ホットランド	5	6.5	10,965
すかいらーくHD	91.9	115.7	236,317
SFPホールディングス	3.8	4.7	10,673
綿半ホールディングス	5.2	6.5	8,931
ヨシックスホールディングス	1.5	1.1	3,088
ユナイテッド・スーパーマーケ	22	27.4	30,633
ゴルフダイジェスト・オン	3	3.8	2,758
ＢＥＥＮＯＳ	3.8	3.5	5,600
あさひ	6.2	7.3	9,431
日本調剤	4.7	5.7	8,584
コスモス薬品	7.6	8.4	132,636
トーエル	3.4	2.4	1,848
セブン＆アイ・HLDGS	252.4	291.5	1,769,696
クリエイト・レストランツ・ホール	50.6	63.7	74,337
ツルハホールディングス	16.4	17.8	184,497
サンマルクホールディングス	6	6.9	13,165
フェリシモ	1.6	1.4	1,411
トリドールホールディングス	18.7	21.1	80,707
TOKYO BASE	7	8.8	2,974
ウイルプラスHLDGS	1.5	0.9	1,103
JMホールディングス	5.6	6.4	12,505
サツドラホールディングス	3.1	2.7	2,211
アレンザホールディングス	4.8	6.6	6,652
串カツ田中HLDGS	1.8	2.3	3,749
パロックジャパン	5.2	5.4	4,595
クスリのアオキHLDGS	6.7	7.6	66,986
力の源HD	4.4	3.3	7,372
FOOD&LIFE COMPAN	38.5	45.1	120,101
メディカルシステムネットワーク	6.5	7.5	3,022
一家ホールディングス	1.8	1.3	920
ジャパンクラフトホールディ	2.4	3.4	771
はるやまHLDGS	3.1	2.6	1,372
ノジマ	12.2	27.6	36,238
カッパ・クリエイト	10.6	13.4	21,145
ライトオン	5.7	4.4	2,257
良品計画	86.7	92.4	180,411
パリミキホールディングス	9.1	7.3	2,825
アドヴァングループ	6.3	7.8	8,213
アルビス	2.1	2.9	7,134
コナカ	7.9	6.5	3,003
ハウス ローゼ	0.8	0.8	1,295
G-7ホールディングス	8.3	10.6	13,801
イオン北海道	9.8	12.4	10,800
コジマ	12.9	14.3	9,080
ヒマラヤ	2.4	2	1,892
コーナン商事	10.7	11.5	41,342
エコス	2.5	3.1	6,466
ワタミ	9	10.2	11,791
マルシェ	2.1	1.9	564
パンパシフィックHD	150.5	170.7	529,340
西松屋チェーン	14.9	18.8	31,001
ゼンショーホールディングス	36.8	46.3	305,533
幸楽苑ホールディングス	4.4	5.6	5,812
ハークスレイ	3.1	2	1,542
サイゼリヤ	11.2	12.5	58,187

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＶＴホールディングス	28.8	32	16,928
魚力	2	2.7	5,980
ポプラ	1.8	1.4	313
フジ・コーポレーション	4.1	4.2	8,639
ユナイテッドアローズ	8	9.1	18,609
ハイデイ日高	11	12.6	36,237
YU-WA CREATION H	3.9	4	740
コロワイド	31	39	98,065
ピーシーデポコーポ	8.4	—	—
壱番屋	5.3	6.7	36,783
トップカルチャー	1.5	2.2	420
ＰＬＡＮＴ	1.8	1.3	1,053
スギホールディングス	15	17	107,253
薬王堂ホールディングス	3.8	4.8	13,238
ヴィア・ホールディングス	9.5	9	936
スクロール	11.6	12.6	13,091
ヨンドシーホールディングス	6.4	7.2	13,478
木曽路	10.2	12.9	32,778
SRSホールディングス	10.9	14.1	15,030
千趣会	12.2	16	6,560
タカキユー	3.9	4.2	390
リテールパートナーズ	10	12.5	21,837
ケーヨー	13.7	13.9	12,106
上新電機	7.2	7.7	18,018
日本瓦斯	36	44.8	103,577
ロイヤルホールディングス	12.8	14.9	39,991
東天紅	0.5	0.5	425
いなげや	7.3	8.2	12,308
チヨダ	6.6	8.3	7,959
ライフコーポレーション	5.9	7.4	27,528
リンガーハット	8.7	11	25,839
ＭｒＭａｘＨＤ	9.3	12.2	7,771
テンアライド	7.2	6.7	2,197
AOKIホールディングス	14.9	15.6	16,411
オークワ	10.5	13.4	12,180
コメリ	11.6	13.1	40,937
青山商事	14.6	18.1	30,697
しまむら	8.8	9.9	148,054
はせがわ	3.4	2.9	1,023
高島屋	50.6	63.7	140,617
松屋	12.7	14.3	15,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	32.8	41.1	74,925
近鉄百貨店	2.1	3.6	10,558
丸井グループ	54.4	62.3	162,883
アクシアル リテイリング	5	5.8	22,011
井筒屋	3.7	2.6	993
イオン	248.2	286.7	870,134
イズミ	11.9	12.8	51,379
平和堂	11.1	14.1	35,250
フジ	16.5	13	23,725
ヤオコー	8.5	9.6	75,379
ゼビオホールディングス	10.3	11.6	11,832
ケーズホールディングス	64	60	84,570
OLYMPICグループ	3.5	2	1,070
日産東京販売ＨＤ	12.5	7.2	3,441
シルバーライフ	1.6	1.6	1,907
GENKY DRUGSTORES	3.3	3.7	20,017
ナルミヤ・インターナショナル	1.7	0.9	1,069

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ブックオフＧＨＤ	4.5	3.8	4,750
ギフトホールディングス	1.4	3.6	8,614
アインホールディングス	9.3	11.6	53,371
元気寿司	2.1	2.4	12,360
ヤマダホールディングス	267.2	347.5	162,560
アークランズ	11.9	25.4	41,071
ニトリホールディングス	29.9	34.2	590,976
グルメ杵屋	6.1	7	7,938
愛眼	6.9	4.8	883
ケーユーホールディングス	4	4.9	6,227
吉野家ホールディングス	26.3	33.2	96,047
松屋フーズ HLDGS	3.6	4.1	17,466
サガミホールディングス	11	13.7	18,495
関西フードマーケット	6.1	7.6	11,552
王将フードサービス	5	5.6	39,144
プレナス	8.4	—	—
ミニストップ	5.5	6.1	8,857
アークス	13.3	15.5	42,346
バローホールディングス	15.3	16.1	35,436
ベルク	3.3	4.2	28,938
大庄	3.8	3.1	3,571
ファーストリテイリング	10.1	38.1	1,323,594
サンドラッグ	28.3	32.1	136,489
サックスバーホールディング	7.4	8.1	7,638
ヤマザワ	1.2	1	1,287
やまや	1.7	1.3	4,030
ベルーナ	16.2	20.6	15,450
銀行業（7.1%）			
いよぎんホールディンク	—	93.7	104,990
しずおかフィナンシャルク	—	175	223,212
ちゅうぎんフィナンシャ	—	66.4	77,422
楽天銀行	—	27.3	58,722
島根銀行	2.1	1.8	1,071
じもとホールディングス	4.9	4.6	2,097
めぶきフィナンシャルＧ	311.1	390.8	169,802
東京きらぼしFG	8.8	10.1	47,722
九州フィナンシャルＧ	132.1	138.6	111,933
ゆうちょ銀行	177.8	216.3	285,732
富山第一銀行	17.2	25	25,950
コンコルディア・フィナンシャル	373.2	422.5	306,861
西日本フィナンシャルHD	39.7	48.9	84,841
33ＦＧ	5.9	7	13,860
第四北越フィナンシャルＧ	10.6	12.4	49,910
ひろぎん HLDGS	96.5	102.7	101,313
おきなわＦＧ	6.3	7.2	18,381
十六ＦＧ	8.8	10.2	41,259
北國ＦＨＤ	6.3	8.3	48,887
プロクレアホールディングス	7.9	9.6	20,054
あいちフィナンシャルグル	—	11	29,128
ＳＢＩ新生銀行	49.2	—	—
あおぞら銀行	42	49.5	158,103
三菱UFJフィナンシャルＧ	4,412.5	4,930.3	6,530,182
りそなホールディングス	797.9	988.5	867,309
三井住友トラストHD	124.7	141.4	848,541
三井住友フィナンシャルＧ	489.1	559.5	4,252,200
千葉銀行	213	219.4	253,297
群馬銀行	121.2	152.8	113,667
武蔵野銀行	9.5	10.1	29,502

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
千葉興業銀行	16.1	12.3	11,328
筑波銀行	29.8	34.5	10,005
七十七銀行	20.1	25.2	85,176
秋田銀行	4.4	5.3	11,384
山形銀行	7	8.7	10,587
岩手銀行	4.7	5.4	15,309
東邦銀行	55.1	62.3	18,253
東北銀行	3.3	2.5	3,067
ふくおかフィナンシャルＧ	54.4	62.9	239,397
静岡銀行	155.4	—	—
スルガ銀行	63	63	41,076
八十二銀行	139.4	166.3	150,634
山梨中央銀行	7.6	8.1	13,956
大垣共立銀行	12.9	15	33,465
福井銀行	5.7	7	11,725
清水銀行	2.5	3.1	5,297
富山銀行	1.2	0.8	1,532
滋賀銀行	12.3	13.1	46,898
南都銀行	10.2	11.9	34,283
百五銀行	63	74.1	42,903
京都銀行	23.4	24.9	216,306
紀陽銀行	22.3	28.2	45,289
ほくほくフィナンシャルＧ	42.8	50	80,725
山陰合同銀行	41.7	49.3	50,483
中国銀行	53.1	—	—
鳥取銀行	2.4	1.7	2,446
伊予銀行	84.8	—	—
百十四銀行	7	7.2	18,806
四国銀行	9.5	12.5	13,162
阿波銀行	10	11.1	26,873
大分銀行	4	4.7	13,225
宮崎銀行	4.1	5.1	14,983
佐賀銀行	3.7	4.6	9,747
琉球銀行	15.9	18	21,006
セブン銀行	225	282.1	91,964
みずほフィナンシャルＧ	903.8	1,138.5	3,054,595
高知銀行	2.4	1.8	2,050
山口フィナンシャルＧ	75.5	77.3	107,794
長野銀行	2.3	—	—
名古屋銀行	4.6	5.2	26,936
北洋銀行	95.3	119.3	47,004
愛知銀行	2.4	—	—
中京銀行	2.4	—	—
大光銀行	2.2	1.5	2,100
愛媛銀行	9.9	10.6	10,939
トマト銀行	2	1.7	2,213
京葉銀行	32.3	36.1	25,847
栃木銀行	34	36	12,420
北日本銀行	2.1	2.7	6,620
東和銀行	12.4	14.4	9,460
福島銀行	8.2	5.4	1,393
大東銀行	3.2	2	1,512
トモニホールディングス	55.5	63.9	30,544
フィデアホール	6.8	8.1	13,834
池田泉州ＨＤ	78.8	100.7	33,130
証券、商品先物取引業（0.8%）			
ＦＰＧ	25.5	26.6	39,953
ジャパンインベストメントＡ	5.1	6.4	11,961

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
マーキュリアホールディングス	4.5	2.7	2,154
SBI ホールディングス	93.1	114.1	382,919
日本アジア投資	6.6	4.1	1,127
ジャフコ グループ	26.1	26.2	46,780
大和証券Ｇ本社	483.6	548.4	500,963
野村ホールディングス	1,151.1	1,418.8	925,483
岡三証券グループ	53.9	69.1	48,162
丸三証券	22.2	26.1	16,965
東洋証券	23	26	9,672
東海東京ＨＤ	73.5	85.7	43,021
光世証券	1.6	1.2	805
水戸証券	17.5	21	10,143
いちよし証券	12.6	14.4	11,217
松井証券	36.9	46.6	40,076
マネックスＧ	63.5	84.8	49,523
極東証券	8.5	9.7	8,827
岩井コスモホールディング	7	9	16,785
アイザワ証券グループ	10	11.3	11,752
マネーパートナーズ GP	8.5	5.3	1,590
スパークス・グループ	35.7	8.8	13,675
小林洋行	2.4	2.2	525
保険業（2.4%）			
かんぽ生命保険	75.8	91.7	240,712
SOMPO ホールディングス	107.3	135.1	930,298
アニコム ホールディングス	23.2	26.8	17,420
ＭＳ＆ＡＤ	155.1	160.3	930,220
第一生命 HLDGS	367.2	384.7	1,223,346
東京海上ＨＤ	209.8	778.2	2,789,847
T&D ホールディングス	167.7	211.3	548,217
アドバンスクリエイト	3.7	4.6	5,313
その他金融業（1.2%）			
全国保証	18	20.6	103,103
あんしん保証	3.4	2.5	742
ジェイリース	2.6	1.7	3,695
イントラスト	3.3	2	1,820
日本モーゲージサービス	4.2	2.8	1,610
Ｃａｓａ	2.7	2	1,762
アルヒ	11.1	9.7	9,185
プレミアグループ	11.4	13.2	20,974
ネットプロＨＤ	22.9	26	10,192
クレディセゾン	44.2	49.9	124,226
芙蓉総合リース	6.5	7.2	93,096
みずほリース	9.2	11.7	59,904
東京センチュリー	11.7	14.7	92,977
日本証券金融	29.6	28.9	45,459
アイフル	126.7	130.1	48,006
リコーリース	6.7	7.4	34,669
イオンフィナンシャルサービス	41.1	45.2	60,477
アコム	149.5	140.1	51,921
ジャックス	7.5	8.4	45,108
オリコ	204.1	20.3	24,380
オリックス	447.8	516.8	1,542,648
三菱 HC キャピタル	243.2	306.6	329,595
九州 リースサービス	3.3	2.4	2,212
日本取引所グループ	175.5	221.2	586,511
イー・ギャランティ	11.2	12.7	24,739
アサックス	3.5	2.3	1,575
NEC キャピタルソリューション	3.1	3.8	13,262

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
不動産業（1.9%）			
大東建託	24.6	28.8	469,296
いちご	84.4	90.7	29,658
日本駐車場開発	75.8	83.2	17,472
スター・マイカ・HLDGS	3.4	9.2	6,044
SRE ホールディングス	1.9	3.9	12,304
AD ワークスグループ	21.2	13.4	3,430
ヒューリック	147	183.7	255,067
三栄建築設計	3.3	3.7	7,481
野村不動産 HLDGS	39.3	49.3	195,277
三重交通グループ HD	15.8	16.8	10,248
サムティ	10.4	12.6	30,466
地主	5.1	6	11,550
プレサンスコーポレーション	8.4	12.5	24,750
ハウスコム	2	0.8	750
ＪＰＭＣ	3.8	4.5	5,247
サンセイランディック	3.2	1.6	1,713
エストラスト	2.8	0.7	454
フージャース HD	10	12.2	14,347
オープンハウスグループ	24	28.8	150,652
東急不動産ＨＤ	205.3	236.7	232,415
飯田ＧＨＤ	61.8	67.1	178,217
イーグランド	1.3	0.8	1,282
ビーロット	6	3.6	3,189
ファーストブラザーズ	1.5	1	1,213
AND DO ホールディングス	4.2	4.7	4,850
シーアールイー	3	4.4	6,846
プロパティエージェント	0.9	0.7	1,025
ケイアイスター不動産	3.4	3.8	18,601
アグレ都市デザイン	1.3	0.9	1,415
ジェイ・エス・ビー	1.7	1.9	10,659
ロードスターキャピタル	2.8	5.1	9,465
テンポイノベーション	2.6	1.6	1,963
グロバルリンクマネジメント	1.6	1	2,063
フェイスネットワーク	1.2	1.4	2,053
パーク24	48.7	51.1	103,349
パラカ	2	2.7	5,656
宮越ホールディングス	3.1	3.6	4,352
三井不動産	294.6	336	1,159,200
三菱地所	429.9	475.1	987,970
平和不動産	12.1	12.8	54,464
東京建物	60	68.8	150,018
京阪神ビルディング	10.2	13.2	18,585
住友不動産	135.8	142.3	581,295
テーオーシー	12.2	14.2	9,301
東京楽天地	1.3	1.3	5,473
スターツコーポレーション	10.5	11.3	34,860
フジ住宅	9.6	11.1	8,535
空港施設	8.7	9.4	5,593
明和地所	4.1	2.5	3,020
ゴールドクレスト	6.6	7.5	16,560
エスリード	3.4	3.7	12,043
日神グループ HLDGS	13.5	12.3	6,863
日本エスコン	14.7	14.8	14,104
MIRARTH ホールディング	32.8	39.9	19,950
ＡＶＡＮＴＩＡ	4.2	3	2,664
イオンモール	38.6	40.8	74,908
毎日コムネット	3.4	1.9	1,470
ファースト住建	3.4	2.2	2,708
ランド	437.9	473.6	4,262
カチタス	18.8	21.2	47,424
トーセイ	10.8	13.1	26,606
穴吹興産	1.8	1	2,052
サンフロンティア不動産	11.3	13.2	20,512
インテリックス	2.5	1.3	700
ランドビジネス	3.7	1.9	646
サンネクスタグループ	3	1.5	1,465
グランディハウス	5.8	4.5	2,947
日本空港ビルデング	24.4	27.8	183,063
サービス業（4.7%）			
明豊ファシリティワークス	3.4	3	2,229
日本工営	4.6	—	—
ＬＩＦＵＬＬ	22.5	27.9	6,584
ＭＩＸＩ	16.7	18.6	45,198
ジェイエイシーリクルートメント	6	7.5	18,682
日本 M&A センターホールデ	119.8	141.1	108,294
メンバーズ	1.9	2.4	2,964
中広	1.1	1.1	489
ＵＴグループ	10.5	12.1	27,418
アイティメディア	3.4	3	3,615
Ｅ・Ｊホールディングス	4.2	5	8,870
オープンアップグループ	23.9	24.7	46,436
コシダカホールディングス	19.5	24.6	30,996
アルトナー	1.9	1.4	2,535
パソナグループ	7.9	10.1	16,998
ＣＤＳ	1.9	1.4	2,454
リンクアンドモチベーション	18.9	23.8	10,971
エス・エム・エス	24.9	31.5	81,096
サニーサイドアップＧ	2.5	1.7	1,388
パーソルホールディングス	73.1	90.7	227,112
リニカル	4.2	3.2	2,252
クックパッド	17.7	21.9	3,306
エスクリ	3.5	2.2	743
アイ・ケイ・ケイホールディンク	3.7	2.6	1,820
学情	3	4.2	8,282
スタジオアリス	3.3	4	8,372
シミックホールディングス	3.7	4.1	7,306
エプコ	1.6	1.8	1,346
ＮＪＳ	1.3	1.9	5,700
綜合警備保障	26.7	152.8	141,294
カカクコム	53.6	60.3	97,776
アイロムグループ	2.7	3	5,718
セントケア・ホールディング	4.8	5.1	4,233
サイネックス	1.2	0.9	627
ルネサンス	5.1	5.6	5,208
ディップ	12.9	14.4	53,640
デジタルホールディングス	5.1	4.2	4,405
新日本科学	9	8.7	16,225
キャリアデザインセンター	1.6	1.2	2,496
ベネフィット・ワン	26.4	38.1	43,091
エムスリー	128.9	162.3	456,793
ツカダ・グローバル HOLD	4.6	3.4	1,479
ブラス	1	0.6	430
アウトソーシング	38.9	52.8	62,436
ウェルネット	6.7	4.4	2,543
ワールドホールディングス	2.9	3.8	9,211
ディー・エヌ・エー	27.9	32.8	50,544
博報堂ＤＹ HLDGS	92.4	104.9	137,943
ぐるなび	10.6	15	4,965
タカミヤ	8.8	11.4	5,962
ジャパンベストレスキューＳ	4.1	4.2	3,087
ファンコミュニケーションズ	12.8	12.4	4,984
ライク	2.4	3.1	4,817
ビジネス・ブレークスルー	2.5	2	798
エスプール	18.8	23.7	11,067
WDB ホールディングス	3.4	4.3	9,077
ティア	4.1	3.1	1,457
ＣＤＧ	0.6	0.7	924
アドウェイズ	9	11.2	6,238
バリューコマース	4.9	7.1	8,938
インフォマート	67.8	85.3	40,346
JP ホールディングス	17.9	23.5	7,943
エコナックホールディングス	13.9	9.2	763
CL ホールディングス	1.8	2.1	1,749
プレステージ・インター	27.5	34.9	22,056
アミューズ	4	4.4	7,132
ドリームインキュベータ	2.3	2.5	7,550
クイック	4.6	6.3	13,494
ＴＡＣ	3.9	2.6	522
電通グループ	68.4	80.8	356,974
テイクアンドギヴニーズ	3.5	2.1	2,100
ぴあ	2.2	2.7	10,462
イオンファンタジー	2.9	3.5	11,130
シーティーエス	8.3	9.3	6,491
ネクシィーズグループ	2.2	1.8	1,467
ＨＵグループＨＤ	19.1	24	63,360
アルプス技研	5.7	7.9	20,856
サニックス	12.8	13.3	4,468
ダイオーズ	1.6	—	—
日本空調サービス	7.2	9.4	7,567
オリエンタルランド	77.7	434.8	2,217,914
ダスキン	15.7	18.2	61,370
明光ネットワークジャパン	8.5	9.7	6,285
ファルコホールディングス	3.3	3.7	7,366
秀英予備校	1.6	1.2	489
田谷	1.3	0.9	431
ラウンドワン	20.5	68.6	40,131
リゾートトラスト	31	32.5	75,676
ビー・エム・エル	9.3	10.2	29,192
りらいあコミュニケーショ	10.7	—	—
リソー教育	33.8	37.1	9,126
早稲田アカデミー	4.1	4.4	6,661
ユー・エス・エス	81.8	84.6	211,584
東京個別指導学院	6.6	9.5	4,655
サイバーエージェント	155.9	181.5	150,390
楽天グループ	301.2	703.2	436,054
クリーク・アンド・リバー社	3.9	4.9	10,760
SBI グローバルアセット	12.5	13.8	7,921
テー・オー・ダブリュー	13.1	17.4	5,446
山田コンサルティング GP	3.9	4.2	6,993
セントラルスポーツ	2.7	3	7,425
フルキャストホールディングス	6.3	7.9	15,649
エン・ジャパン	13	14.9	36,341
リソルホールディングス	0.8	0.5	2,430

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
テクノプロ・ホールディング	43.8	48.7	157,495
アトラグループ	1.9	1.6	390
インターワークス	2.5	—	—
アイ・アールジャパンHD	3.4	4.3	10,320
ＫｅｅＰｅｒ技研	4.7	5.1	29,733
ファーストロジック	1.1	1.2	636
三機サービス	1.2	0.8	861
Ｇｕｎｏｓｙ	4.1	6.5	3,978
デザインワン・ジャパン	2.3	1.3	218
イー・ガーディアン	2.5	3	7,932
リブセンス	3.7	2.5	867
ジャパンマテリアル	22.5	25.1	59,110
ベクトル	10.2	13	16,848
ウチヤマホールディングス	3.7	2.3	860
チャームケアコーポレーション	5.5	6.8	7,602
キャリアリンク	2.7	3	7,494
ＩＢＪ	3.9	6.2	3,856
アサンテ	3.1	4.3	7,069
バリューＨＲ	5.7	7.1	9,045
M&Aキャピタルパートナー	6	6.6	18,440
ライドオンエクスプレスHD	2.9	3	3,012
ERIホールディングス	2.1	1.4	3,246
アビスト	1.1	0.9	3,213
シグマクシス・ホールディング	8.8	12.5	19,250
ウィルグループ	5.4	7	7,826
エスクローＡＪ	8.1	6.7	978
メドピア	5.1	7.2	7,286
レアジョブ	1.4	1	1,031
リクルートホールディングス	523.3	608.4	3,079,720
エラン	8.6	10.8	9,104
土木管理総合試験	3.2	3.2	1,094
ネットマーケティング	3.6	—	—
日本郵政	797.5	988.9	1,252,936
ベルシステム24HLDGS	10.5	11.2	18,368
鎌倉新書	8.4	9.3	6,082
ＳＭＮ	1.7	1.3	539
一蔵	1	0.7	412
グローバルキッズCOMP	1.1	1	697
エアトリ	4.2	6	13,002
アトラエ	5.1	4.9	5,443
ストライク	3.2	3.5	12,040
ソラスト	18	22.5	14,310
セラク	2.3	2.5	3,247
インソース	8.1	17.9	18,204
ベイカレントコンサルティング	5.2	65.1	323,547
ORCHESTRA HLDGS	1.4	1.7	1,791
アイモバイル	3.6	3.6	4,701
キャリアインデックス	2.5	1.8	531
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3	1.9	2,270
船場	0.9	1.2	1,123
ジャパンエレベーターSHD	23.1	29.3	63,200
フルテック	1.1	0.8	973
グリーンズ	2.7	1.8	3,072
ツナググループHLDGS	2.3	1.5	1,282
GAMEWITH	2.2	1.6	523
MS&CONSULTING	1.2	0.8	556
ウェルビー	4.8	6	3,516
エル・ティー・エス	0.8	0.9	3,429

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ミダックホールディングス	3.3	5	9,175
日総工産	5.7	6.3	4,819
キュービーネットHLDGS	3.4	3.9	5,970
RPAホールディングス	10.2	11.1	3,774
スプリックス	2.5	1.5	1,275
マネジメントソリューションズ	3.6	3.5	10,885
プロレド・パートナーズ	1.6	2.1	1,016
AND FACTORY	1.7	1.6	587
テノ．ホールディングス	0.8	0.7	431
フロンティア・マネジメント	2.2	2.1	2,816
ピアラ	1.2	1.1	462
コプロ・ホールディングス	1.5	0.9	2,253
ギークス	1.3	0.7	509
アンビスホールディングス	—	8.8	25,212
カーブスホールディングス	20	22.5	16,582
フォーラムエンジニアリング	4.5	4.9	6,389
FAST FITNESS JAP	1.3	2.8	3,819
ダイレクトマケティングミクス	7.4	8.5	4,437
ポピンズ	0.9	1.2	1,527
LITALICO	5.9	6.4	13,600
コンフィデンス・インターワーク	—	0.3005	485
アドバンテッジリスクマネ	3.9	2.5	1,200
リログループ	40.1	45.7	75,382
東祥	5.5	5.7	6,874
ID&Eホールディングス	—	4.9	17,493
ビーウィズ	2	2.1	4,790
TREホールディングス	13.7	17.4	22,028
人・夢・技術グループ	2.9	3	5,265
大栄環境	—	21	46,977
日本管財ホールディング	—	8.6	22,721
エイチ・アイ・エス	17.1	23.8	42,268
ラックランド	2.1	3.8	11,514
共立メンテナンス	13	14.1	89,365
イチネンホールディングス	7.4	8.9	12,504
建設技術研究所	3.3	4.3	20,081
スペース	4.7	5.2	4,872
燦ホールディングス	3.2	3.4	7,279
スバル興業	0.4	0.3	3,576
東京テアトル	3	2	2,284
タナベコンサルティンググル	2.6	2.2	2,580
ナガワ	2.1	2.2	15,752
東京都競馬	5.5	6.9	27,393
常磐興産	2.5	1.8	2,453
カナモト	11.9	12.8	33,766
ニシオホールディングス	6.1	7.6	27,398
アゴーラホスピタリティーG	42.7	34.5	897
トランス・コスモス	9.2	10.2	32,640
乃村工藝社	31.3	36.1	32,273
藤田観光	2.9	3.3	16,929
KNT-CTホールディングス	4.5	4.9	6,683
日本管財	7.7	—	—
トーカイ	5.8	7.4	14,467
白洋舎	0.6	0.8	2,067
セコム	72	83.7	869,224
セントラル警備保障	3.6	4.5	14,422
丹青社	13.7	15.7	14,726
メイテツク	26	32.2	83,285
応用地質	6.3	7.7	19,735

銘柄		期首	当期末	
		株数	株数	評価額
		千株	千株	千円
船井総研ホールディン		13.7	17.2	47,196
進学会ホールディングス		2.1	1.8	527
オオバ		4.5	3.6	3,394
いであ		1.6	1.6	2,720
学究社		2.2	3.2	6,608
ベネッセホールディングス		24.3	30.6	57,665
イオンディライト		8.3	9.2	30,314
ナック		4.1	3.9	3,837
ダイセキ		13.3	16.8	71,736
ステップ		2.7	2.9	5,153
		千株	千株	千円
合計	株数、金額	78,099	118,452.6005	275,855,624
	銘柄数<比率>	2,156銘柄	2,141銘柄	<98.5%>

（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	ＴＯＰＩＸ	百万円 4,004	百万円 —

（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	株
株式	3,576,600	—
	(16,400)	(—)

（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16,400株を貸付けています。

■投資信託財産の構成

2023年９月19日現在

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　　率
	千円	%
株式	275,855,624	95.8
コール・ローン等、その他	12,087,682	4.2
投資信託財産総額	287,943,307	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

2023年９月19日現在

項　　目	当　期　末
（Ａ）資産	**288,634,027,304円**
コール・ローン等	11,709,990,572
株式（評価額）	275,855,624,477
未収入金	269,496,200
未収配当金	104,117,646
未収利息	307,903
その他未収収益	3,770,506
差入委託証拠金	690,720,000
（Ｂ）負債	**8,667,292,595**
未払解約金	205,524,850
差入委託証拠金代用有価証券	767,800,000
受入担保金	7,693,967,745
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）	**279,966,734,709**
元本	162,050,849,324
次期繰越損益金	117,915,885,385
（Ｄ）受益権総口数	**162,050,849,324口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）	**17,276円**

＊期首における元本額は146,161,636,928円、当作成期間中における追加設定元本額は30,161,540,525円、同解約元本額は14,272,328,129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：

トピックス・インデックスファンド	2,794,966,122円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドＶＡ	4,428,862,186円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドＶＡ2	912,624円
ダイワ国内重視バランスファンド30ＶＡ（一般投資家私募）	15,316,355円
ダイワ国内重視バランスファンド50ＶＡ（一般投資家私募）	195,111,007円
ダイワ国際分散バランスファンド30ＶＡ（一般投資家私募）	13,274,124円
ダイワ国際分散バランスファンド50ＶＡ（一般投資家私募）	424,964,925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）	622,708,014円
Ｄ－Ｉ’ｓ ＴＯＰＩＸインデックス	13,696,084円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	240,356,411円
ｉＦｒｅｅ ＴＯＰＩＸインデックス	6,974,634,748円
ｉＦｒｅｅ 8資産バランス	4,552,782,635円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	936,907,657円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	760,330円
ＤＣダイワ日本株式インデックス	70,157,904,335円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,126,510,144円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,815,356,904円
ダイワ・ライフ・バランス70	5,437,485,538円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,253,536,469円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	52,146,342円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	73,459,968円
ダイワつみたてインデックス日本株式	4,348,979,651円
ダイワつみたてインデックスバランス30	13,296,558円
ダイワつみたてインデックスバランス50	11,248,003円
ダイワつみたてインデックスバランス70	27,586,525円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	9,143,218,019円
ダイワ世界バランスファンド40ＶＡ	57,636,044円
ダイワ世界バランスファンド60ＶＡ	22,132,245円
ダイワ・バランスファンド35ＶＡ	3,969,119,137円
ダイワ・バランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家専用）	388,963,668円
ダイワ国内バランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家専用）	51,746,439円
ダイワ国内バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家専用）	77,438,203円
ダイワ・ノーロード ＴＯＰＩＸファンド	212,211,578円
ダイワファンドラップ ＴＯＰＩＸインデックス	12,214,211,018円
ダイワＴＯＰＩＸインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	5,470,175,649円
ダイワファンドラップオンライン ＴＯＰＩＸインデックス	3,439,985,992円
ダイワ・インデックスセレクト ＴＯＰＩＸ	1,173,613,678円
ダイワライフスタイル25	111,863,051円
ダイワライフスタイル50	498,094,602円
ダイワライフスタイル75	412,932,475円
ＤＣ・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	8,274,743,867円

＊当期末の計算口数当りの純資産額は17,276円です。

■損益の状況

当期　自 2022年９月21日　至 2023年９月19日

項　　目	当　　期
（A）配当等収益	**5, 434, 982, 690円**
受取配当金	5, 299, 111, 418
受取利息	6, 700, 487
その他収益金	134, 029, 823
支払利息	△　4, 859, 038
（B）有価証券売買損益	**52, 182, 334, 089**
売買益	56, 645, 997, 706
売買損	△　4, 463, 663, 617
（C）先物取引等損益	**1, 625, 757, 000**
取引益	1, 758, 297, 950
取引損	△　132, 540, 950
（D）当期損益金（A＋B＋C）	**59, 243, 073, 779**
（E）前期繰越損益金	**50, 857, 579, 661**
（F）解約差損益金	**△　6, 805, 182, 031**
（G）追加信託差損益金	**14, 620, 413, 976**
（H）合計（D＋E＋F＋G）	**117, 915, 885, 385**
次期繰越損益金（H）	**117, 915, 885, 385**

（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。

《お知らせ》
■ベンチマークの変更について
ベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。
変更前：東証株価指数
変更後：東証株価指数（配当込み）

配当込みＴＯＰＩＸ（本書類における「ＴＯＰＩＸ（配当込み）」をいう。）の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）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・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有する。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。当ファンドは、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負わない。

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８期
（決算日　2024年６月17日）
（作成対象期間　2023年６月16日～2024年６月17日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2017年２月16日）		
運用方針	投資成果を日経平均トータルリターン・インデック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	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トータルリターン・インデックスに採用された銘柄	
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、分配を行なわないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の株式に投資し、日経平均トータルリターン・インデックスに連動する投資成果をあげ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/

<4661>

最近5期の運用実績

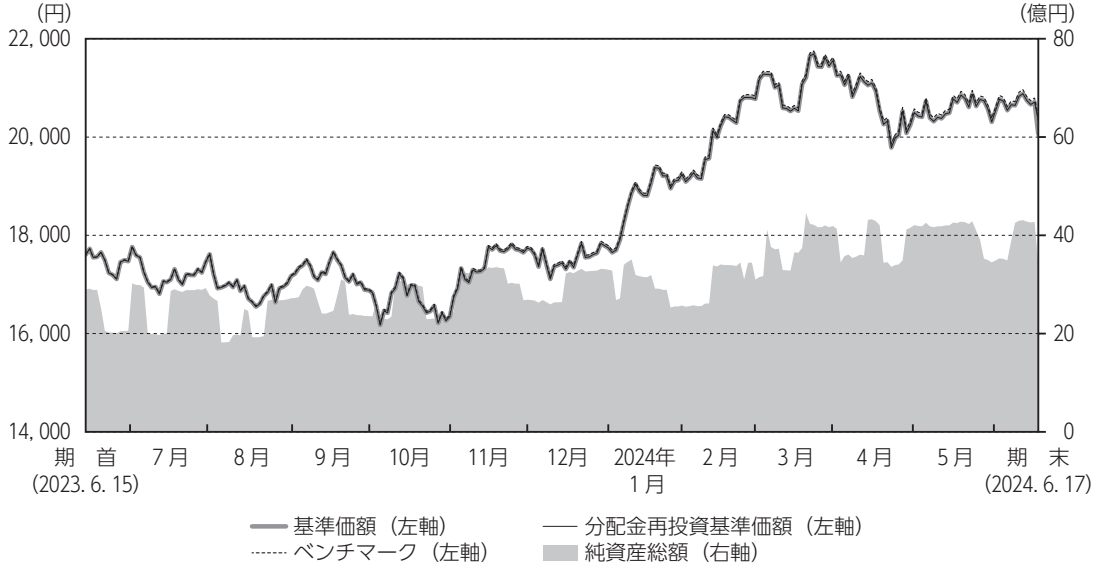
決算期	基準価額			日経平均トータルリターン・インデックス		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
4期末(2020年6月15日)	11,262	120	3.7	35,258.98	4.2	99.2	1.9	376
5期末(2021年6月15日)	15,388	220	38.6	48,974.74	38.9	99.3	2.2	439
6期末(2022年6月15日)	13,812	160	△ 9.2	44,639.75	△ 8.9	98.7	2.4	1,748
7期末(2023年6月15日)	17,609	290	29.6	58,102.64	30.2	100.4	1.2	2,895
8期末(2024年6月17日)	20,059	270	15.4	67,342.13	15.9	98.8	2.5	3,408

（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。

「日経平均トータルリターン・インデックス」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「日経平均トータルリターン・インデックス」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トータルリターン・インデックスです。

■基準価額・騰落率

期　首：17,609円
期　末：20,059円（分配金270円）
騰落率：15.4％（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、国内株式市況が上昇したことを受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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		日経平均トータルリターン・インデックス		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2023年6月15日	17,609	—	58,102.64	—	100.4	1.2
6月末	17,469	△ 0.8	57,670.18	△ 0.7	98.1	1.9
7月末	17,455	△ 0.9	57,645.38	△ 0.8	97.8	2.2
8月末	17,168	△ 2.5	56,720.29	△ 2.4	97.9	2.0
9月末	16,882	△ 4.1	55,787.13	△ 4.0	95.8	4.2
10月末	16,347	△ 7.2	54,040.84	△ 7.0	95.6	4.4
11月末	17,737	0.7	58,651.09	0.9	97.2	2.8
12月末	17,745	0.8	58,704.41	1.0	98.6	1.4
2024年1月末	19,240	9.3	63,659.32	9.6	97.4	2.5
2月末	20,778	18.0	68,747.00	18.3	97.5	2.4
3月末	21,552	22.4	71,346.41	22.8	98.2	1.8
4月末	20,499	16.4	67,877.75	16.8	95.8	4.2
5月末	20,540	16.6	68,023.40	17.1	97.1	2.9
(期末)2024年6月17日	20,329	15.4	67,342.13	15.9	98.8	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

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■国内株式市況

国内株式市況は大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇などから上値の重い展開となりました。2023年８月半ばに発表された2023年４－６月期ＧＤＰ（国内総生産）成長率が予想を上回る高い伸びとなったことが好感されて上昇する局面もありましたが、米国における長期金利の上昇や景気の先行き不透明感、パレスチナ情勢の悪化などが懸念され、保ち合い相場が継続しました。11月以降も、欧米の金利低下や良好な企業決算、株主還元拡充の発表などが好感された一方、円高進行などが懸念され、狭いレンジでの推移となりました。2024年１月以降は、新ＮＩＳＡ（少額投資非課税制度）を通じた資金流入や海外投資家による日本株投資の積極化、円安進行などが好感され、急上昇しました。３月下旬以降は、米国の利下げ開始の後ずれ観測、市場予想を下回る企業業績見通しの発表、国内長期金利の上昇などが上値を抑え、高値圏での保ち合いとなり、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、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

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■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. 3％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。

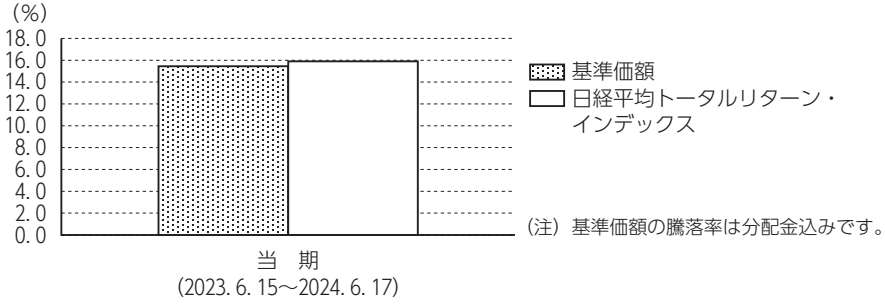
＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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	日経平均トータルリターン・インデックス

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15. 9％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は15. 4％となりました。先物取引の影響、運用管理費用、売買等のコストなど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。



＊ベンチマークは日経平均トータルリターン・インデックスです。

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 2023年６月16日 ～2024年６月17日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**270**
対基準価額比率	（％）	1.33
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）	10,058

（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。
（注４）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。

■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	✓ 281.64円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	89.91
（ｃ）収益調整金	9,935.17
（ｄ）分配準備積立金	21.83
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	10,328.56
（ｆ）分配金	270.00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	10,058.56

（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

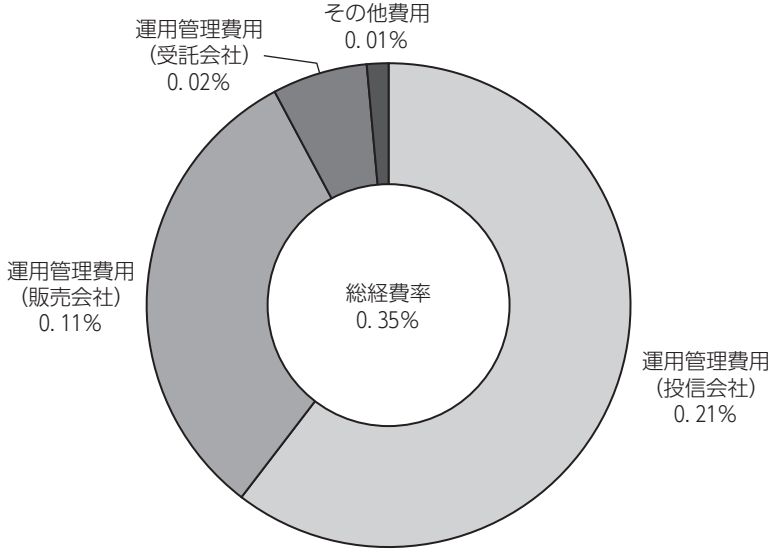
項目	当期 (2023. 6. 16～2024. 6. 17) 金額	比率	項目の概要
信託報酬	64円	0. 343%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は18, 595円です。**
（投信会社）	(39)	(0. 210)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販売会社）	(21)	(0. 111)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(4)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0. 001	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(0)	(0. 000)	
（先物・オプション）	(0)	(0. 001)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0. 006	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（監査費用）	(1)	(0. 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	65	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

（2023年6月16日から2024年6月17日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ストックインデックス225・マザーファンド	2,613,462	12,486,710	2,605,045	12,461,480

（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

（2023年6月16日から2024年6月17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	64,808,320千円
（b）期中の平均組入株式時価総額	279,702,024千円
（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

(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

（2023年6月16日から2024年6月17日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	47,823	17,442	36.5	16,984	6,356	37.4
株式先物取引	135,032	118,399	87.7	131,168	113,200	86.3
コール・ローン	2,165,072	—	—	—	—	—

（注）平均保有割合1.0%
※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

（2023年6月16日から2024年6月17日まで）

種類	当期		
	ストックインデックス225・マザーファンド		
	買付額	売付額	作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	33	15	321

（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

（2023年6月16日から2024年6月17日まで）

項目	当期
売買委託手数料総額（A）	44千円
うち利害関係人への支払額（B）	38千円
（B）／（A）	85.7%

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

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社、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
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
ストックインデックス225・マザーファンド	649,105	657,522	3,453,636

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年6月17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	3,453,636	82.0
コール・ローン等、その他	758,284	18.0
投資信託財産総額	4,211,921	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

2024年6月17日現在

項　　目	当　期　末
（A）資産	**4,211,921,911円**
コール・ローン等	6,784,991
ストックインデックス225・マザーファンド（評価額）	3,453,636,920
未収入金	751,500,000
（B）負債	**803,568,038**
未払収益分配金	45,878,436
未払解約金	751,429,955
未払信託報酬	6,160,366
その他未払費用	99,281
（C）純資産総額（A－B）	**3,408,353,873**
元本	1,699,201,340
次期繰越損益金	1,709,152,533
（D）受益権総口数	**1,699,201,340口**
1万口当り基準価額（C／D）	**20,059円**

＊期首における元本額は1,644,514,833円、当作成期間中における追加設定元本額は6,758,588,320円、同解約元本額は6,703,901,813円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は20,059円です。

■損益の状況

当期　自 2023年6月16日　至 2024年6月17日

項　　目	当　　期
（A）配当等収益	**577円**
受取利息	1,169
支払利息	△ 592
（B）有価証券売買損益	**73,908,138**
売買益	439,207,175
売買損	△ 365,299,037
（C）信託報酬等	△ **10,773,992**
（D）当期損益金（A＋B＋C）	**63,134,723**
（E）前期繰越損益金	**3,710,007**
（F）追加信託差損益金	**1,688,186,239**
（配当等相当額）	(751,356,846)
（売買損益相当額）	(936,829,393)
（G）合計（D＋E＋F）	**1,755,030,969**
（H）収益分配金	△ **45,878,436**
次期繰越損益金（G＋H）	**1,709,152,533**
追加信託差損益金	1,688,186,239
（配当等相当額）	(751,356,846)
（売買損益相当額）	(936,829,393)
分配準備積立金	20,966,294

（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	47,857,037円
（b）経費控除後の有価証券売買等損益	15,277,686
（c）収益調整金	1,688,186,239
（d）分配準備積立金	3,710,007
（e）当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	1,755,030,969
（f）分配金	45,878,436
（g）翌期繰越分配対象額（e－f）	1,709,152,533
（h）受益権総口数	1,699,201,340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。

＜補足情報＞

当ファンド（ダイワ日経２２５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２２５・マザーファンド」の決算日（2023年９月19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（2024年６月17日）現在におけるストックインデックス２２５・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ストックインデックス２２５・マザーファンドの主要な売買銘柄

株　　式

（2023年６月16日から2024年６月17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	108	3, 896, 100	36, 075	ファーストリテイリング	48	1, 745, 160	36, 357
ディスコ	55	3, 132, 201	56, 949	東京エレクトロン	48	1, 162, 470	24, 218
東京エレクトロン	108	2, 769, 510	25, 643	ソフトバンクグループ	96	611, 592	6, 370
レーザーテック	114. 8	2, 765, 562	24, 090	アドバンテスト	104	602, 008	5, 788
ニトリホールディングス	141. 1	2, 745, 607	19, 458	ＫＤＤＩ	96	455, 208	4, 741
ソフトバンクグループ	216	1, 488, 552	6, 891	信越化学	80	419, 240	5, 240
アドバンテスト	228	1, 372, 920	6, 021	ダイキン工業	16	386, 810	24, 175
ソシオネクスト	275	1, 168, 218	4, 248	ファナック	80	330, 350	4, 129
ＺＯＺＯ	275	1, 042, 747	3, 791	ＴＤＫ	48	310, 788	6, 474
ＫＤＤＩ	216	951, 012	4, 402	テルモ	64	304, 224	4, 753

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2024年６月17日現在におけるストックインデックス２２５・マザーファンド（62, 582, 339千口）の内容です。

(1) 国内株式

銘　　柄	2024年６月17日現在 株　数	評価額
	千株	千円
水産・農林業（0. 1%）		
ニッスイ	275	233, 557
鉱業（0. 1%）		
ＩＮＰＥＸ	110	249, 480
建設業（1. 5%）		
コムシスホールディングス	275	848, 925
大成建設	55	316, 470
大林組	275	487, 575
清水建設	275	229, 900
長谷工コーポレーション	55	94, 077
鹿島建設	137. 5	366, 987
大和ハウス	275	1, 100, 000
積水ハウス	275	941, 325
日揮ホールディングス	275	335, 912

銘　　柄	2024年６月17日現在 株　数	評価額
	千株	千円
食料品（3. 0%）		
日清製粉Ｇ本社	275	492, 525
明治ホールディングス	110	381, 920
日本ハム	137. 5	637, 175
サッポロホールディングス	55	308, 825
アサヒグループホールディン	275	1, 548, 250
キリンＨＤ	275	568, 700
キッコーマン	1, 375	2, 490, 125
味の素	275	1, 579, 600
ニチレイ	137. 5	497, 200
日本たばこ産業	275	1, 232, 275
繊維製品（0. 1%）		
帝人	55	76, 862
東レ	275	201, 245

銘　　柄	2024年６月17日現在 株　数	評価額
	千株	千円
パルプ・紙（0. 1%）		
王子ホールディングス	275	168, 025
日本製紙	27. 5	26, 235
化学（6. 6%）		
クラレ	275	499, 400
旭化成	275	274, 587
レゾナック・ホールディング	27. 5	94, 875
住友化学	275	84, 947
日産化学	275	1, 264, 175
東ソー	137. 5	279, 743
トクヤマ	55	160, 627
デンカ	55	114, 785
信越化学	1, 375	8, 171, 625
三井化学	55	238, 535

ストックインデックス２２５・マザーファンド

銘柄	2024年６月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
三菱ケミカルグループ	137.5	110,660
ＵＢＥ	27.5	73,823
花王	275	1,857,900
ＤＩＣ	27.5	86,955
富士フイルム HLDGS	825	3,003,000
資生堂	275	1,375,825
日東電工	275	3,372,875
医薬品（5.5%）		
協和キリン	275	747,312
武田薬品	275	1,145,925
アステラス製薬	1,375	2,075,562
住友ファーマ	275	95,975
塩野義製薬	275	1,690,425
中外製薬	825	4,077,150
エーザイ	275	1,753,125
第一三共	825	4,455,000
大塚ホールディングス	275	1,720,675
石油・石炭製品（0.3%）		
出光興産	550	582,450
ENEOS ホールディングス	275	221,925
ゴム製品（0.7%）		
横浜ゴム	137.5	487,300
ブリヂストン	275	1,773,200
ガラス・土石製品（0.6%）		
ＡＧＣ	55	286,220
日本電気硝子	82.5	299,970
太平洋セメント	27.5	109,670
東海カーボン	275	252,450
ＴＯＴＯ	137.5	505,725
日本碍子	275	548,212
鉄鋼（0.1%）		
日本製鉄	27.5	90,860
神戸製鋼所	27.5	53,528
ＪＦＥホールディングス	27.5	62,040
非鉄金属（0.9%）		
三井金属	27.5	131,532
三菱マテリアル	27.5	78,457
住友鉱山	137.5	644,600
DOWA ホールディングス	55	296,890
古河電工	27.5	115,032
住友電工	275	700,975
フジクラ	275	900,075

銘柄	2024年６月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
金属製品（0.0%）		
ＳＵＭＣＯ	27.5	64,528
機械（5.6%）		
日本製鋼所	55	236,335
オークマ	55	364,320
アマダ	275	468,737
ディスコ	55	3,513,400
ＳＭＣ	27.5	2,103,750
小松製作所	275	1,204,225
住友重機械	55	225,995
日立建機	275	1,098,625
クボタ	275	605,687
荏原製作所	55	655,050
ダイキン工業	275	6,314,000
日本精工	275	206,030
ＮＴＮ	275	80,932
ジェイテクト	275	290,125
日立造船	55	56,540
三菱重工業	275	409,200
ＩＨＩ	27.5	103,345
電気機器（27.4%）		
コニカミノルタ	275	121,907
ミネベアミツミ	275	874,225
日立	55	919,875
三菱電機	275	695,750
富士電機	55	492,635
安川電機	275	1,608,750
ソシオネクスト	275	1,108,250
ニデック	220	1,596,100
オムロン	275	1,409,650
ジーエス・ユアサ コーポ	55	177,705
日本電気	27.5	339,487
富士通	275	653,537
ルネサスエレクトロニクス	275	864,325
セイコーエプソン	550	1,320,550
パナソニック ホールディング	275	346,225
シャープ	275	270,352
ソニーグループ	275	3,491,125
ＴＤＫ	825	7,311,975
アルプスアルパイン	275	420,062
横河電機	275	1,039,500
アドバンテスト	2,200	11,741,400

銘柄	2024年６月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
キーエンス	27.5	1,864,225
レーザーテック	110	3,978,700
カシオ	275	322,025
ファナック	1,375	5,864,375
京セラ	2,200	3,985,300
太陽誘電	275	1,115,675
村田製作所	660	2,137,080
SCREEN ホールディングス	110	1,619,750
キヤノン	412.5	1,798,087
リコー	275	373,450
東京エレクトロン	825	28,116,000
輸送用機器（4.5%）		
デンソー	1,100	2,575,100
川崎重工業	27.5	155,127
日産自動車	275	142,945
いすゞ自動車	137.5	272,112
トヨタ自動車	1,375	4,174,500
日野自動車	275	114,372
三菱自動車工業	27.5	11,319
マツダ	55	79,255
本田技研	1,650	2,710,125
スズキ	1,100	1,966,250
SUBARU	275	897,050
ヤマハ発動機	825	1,212,750
精密機器（3.7%）		
テルモ	2,200	5,663,900
ニコン	275	417,862
オリンパス	1,100	2,860,000
ＨＯＹＡ	137.5	2,486,000
シチズン時計	275	276,100
その他製品（2.2%）		
バンダイナムコ HLDGS	825	2,465,925
TOPPAN ホールディングス	137.5	607,200
大日本印刷	137.5	721,325
ヤマハ	275	1,012,550
任天堂	275	2,313,025
電気・ガス業（0.2%）		
東京電力ＨＤ	27.5	23,512
中部電力	27.5	52,525
関西電力	27.5	75,693
東京瓦斯	55	195,140
大阪瓦斯	55	193,325

銘柄	2024年６月17日現在 株数	評価額
	千株	千円
陸運業（0.9%）		
東武鉄道	55	143,660
東急	137.5	241,106
小田急電鉄	137.5	207,350
京王電鉄	55	194,755
京成電鉄	137.5	734,525
東日本旅客鉄道	82.5	206,703
西日本旅客鉄道	55	158,950
東海旅客鉄道	137.5	452,237
ヤマトホールディングス	275	458,975
NIPPON EXPRESS	27.5	200,062
海運業（0.4%）		
日本郵船	82.5	385,852
商船三井	82.5	400,125
川崎汽船	247.5	561,825
空運業（0.2%）		
日本航空	275	677,050
ANA ホールディングス	27.5	79,433
倉庫・運輸関連業（0.2%）		
三菱倉庫	137.5	709,912
情報・通信業（10.8%）		
ネクソン	550	1,598,300
メルカリ	275	575,850
ＬＩＮＥヤフー	110	40,106
トレンドマイクロ	275	1,805,925
日本電信電話	2,750	398,475
ＫＤＤＩ	1,650	6,888,750
ソフトバンク	275	535,012
東宝	27.5	126,197
NTT データグループ	1,375	3,040,125
コナミグループ	275	2,961,750
ソフトバンクグループ	1,650	16,698,000
卸売業（3.4%）		
双日	27.5	105,545
伊藤忠	275	2,029,225
丸紅	275	820,050
豊田通商	275	2,423,300
三井物産	275	2,043,250
住友商事	275	1,072,225
三菱商事	825	2,541,000
小売業（12.7%）		
J. フロント リテイリング	137.5	225,568
ＺＯＺＯ	275	1,049,400
三越伊勢丹ＨＤ	275	862,950
セブン＆アイ・HLDGS	825	1,647,937
高島屋	137.5	357,775
丸井グループ	275	614,762
イオン	275	941,600
ニトリホールディングス	137.5	2,304,500
ファーストリテイリング	825	32,554,500
銀行業（0.7%）		
しずおかフィナンシャルク	275	393,112
コンコルディア・フィナンシャル	275	242,330
あおぞら銀行	27.5	71,362
三菱UFJフィナンシャルＧ	275	424,737
りそなホールディングス	27.5	26,719
三井住友トラスト HD	55	193,710
三井住友フィナンシャルＧ	27.5	271,150
千葉銀行	275	373,862
ふくおかフィナンシャルＧ	55	222,750
みずほフィナンシャルＧ	27.5	83,160
証券、商品先物取引業（0.2%）		
大和証券Ｇ本社	275	321,475
野村ホールディングス	275	246,950
保険業（1.2%）		
SOMPO ホールディングス	165	521,895
ＭＳ＆ＡＤ	247.5	757,102
第一生命 HLDGS	27.5	106,260
東京海上ＨＤ	412.5	2,170,987
T&D ホールディングス	55	142,450
その他金融業（0.9%）		
クレディセゾン	275	911,900
オリックス	275	925,100
日本取引所グループ	275	982,575
不動産業（1.2%）		
東急不動産ＨＤ	275	289,025
三井不動産	825	1,168,200
三菱地所	275	682,000
東京建物	137.5	330,137
住友不動産	275	1,282,600
サービス業（4.1%）		
エムスリー	660	974,490
ディー・エヌ・エー	82.5	126,678
電通グループ	275	1,076,900
オリエンタルランド	275	1,205,875
サイバーエージェント	220	214,346
楽天グループ	275	216,150
リクルートホールディングス	825	6,505,125
日本郵政	275	405,625
セコム	275	2,546,500
	千株	千円
合計 株数、金額	73,480	320,521,492
合計 銘柄数＜比率＞	225銘柄	＜97.5%＞

（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		2024年６月17日現在 買建額	売建額
		百万円	百万円
国内	日経平均	8,208	—

（注）単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入状況

区分	2024年６月17日現在 貸付	借入
株式	株 354,700 (—)	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22期　（決算日　2023年9月19日）

（作成対象期間　2022年9月21日～2023年9月19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。

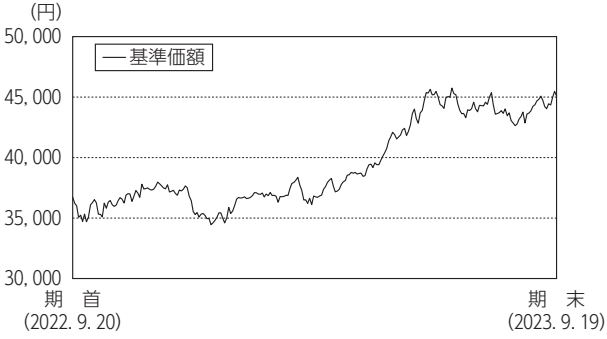
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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、日経平均トータルリターン・インデックスをモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均トータルリターン・インデックスに採用された銘柄
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		日経平均トータルリターン・インデックス(ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2022年9月20日	36,718	—	44,470.21	—	97.1	2.9
9月末	34,692	△ 5.5	44,470.99	△ 5.5	93.1	7.0
10月末	36,894	0.5	47,302.96	0.5	96.5	3.5
11月末	37,412	1.9	47,968.16	1.9	98.2	1.8
12月末	34,959	△ 4.8	44,827.29	△ 4.8	97.3	2.7
2023年1月末	36,609	△ 0.3	46,947.81	△ 0.3	98.4	1.6
2月末	36,790	0.2	47,178.76	0.2	98.1	1.9
3月末	37,936	3.3	48,651.96	3.3	96.5	3.5
4月末	39,043	6.3	50,068.10	6.4	97.2	2.8
5月末	41,819	13.9	53,593.44	13.8	97.5	2.5
6月末	44,986	22.5	57,670.18	22.5	98.1	1.9
7月末	44,962	22.5	57,645.38	22.5	97.9	2.2
8月末	44,236	20.5	56,720.29	20.5	98.0	2.0
(期末)2023年9月19日	45,082	22.8	57,804.91	22.8	97.5	1.6

(注1) 基準価額の騰落率は期首比。
(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。
※ベンチマークを「日経平均株価」から「日経平均トータルリターン・インデックス」に変更しました。

《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：36,718円　期末：45,082円　騰落率：22.8%
【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、一進一退で推移した後、大幅に上昇しました。
国内株式市況は、当作成期首より、英国の財政悪化や欧米の金利上昇などが嫌気され、2022年9月末にかけて下落しました。11月下旬にかけては、欧米の金利上昇が一服したことや国内で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。12月には、世界的な景況感の悪化や日銀の政策変更による急速な円高などで下落しましたが、2023年1月以降は、中国のゼロコロナ政策見直しにより景気回復期待が高まったことや、日銀総裁人事への不透明感が解消して円安が進んだことなどが好感され、3月上旬にかけて上昇しました。3月半ばにかけては、米国地方銀行の経営破綻や欧州金融機関の破綻懸念などで金融不安が高まり下落しましたが、その後は、欧州金融機関の破綻回避などを受けて金融不安が一定程度後退したことにより、上昇に転じました。4月以降は、経済活動正常化や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたこと、日銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調したこと、米国著名投資家の強気見通しにより日本株見直しの動きが強まったことなどから、大幅に上昇しました。7月に入り、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇、中国の不動産大手の債務不履行懸念などから下落する場面もありましたが、8月半ばに発表された2023年4－6月期GDP（国内総生産）成長率が予想を上回る高い伸びとなったことなどが好感され、当作成期末にかけて再び上昇しました。

◆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22.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は22.8%となりました。
資金の流出入に伴う現物株式および株式先物の売買等によるコスト負担等が、マイナス要因となりました。
＊ベンチマークは日経平均トータルリターン・インデックスです。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

（2022年9月21日から2023年9月19日まで）

	買　　付		売　　付	
	株　数	金　額	株　数	金　額
	千株	千円	千株	千円
国内	8,758.2 (　7,088.1)	39,086,418 (　　—)	9,922.4	41,653,312

（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

（2022年9月21日から2023年9月19日まで）

種　類　別		買　建		売　建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	株式先物取引	127,174	131,143	—	—

（注1）金額は受渡し代金。
（注2）単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株　　式

（2022年9月21日から2023年9月19日まで）

当　期							
買　付				売　付			
銘　柄	株　数	金　額	平均単価	銘　柄	株　数	金　額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ファーストリテイリング	58	3,218,700	55,494	ファーストリテイリング	124	4,499,270	36,284
ＨＯＹＡ	151.5	2,112,132	13,941	東京エレクトロン	112	2,440,900	21,793
ニデック	242.4	2,102,738	8,674	ソフトバンクグループ	288	1,573,008	5,461
ＳＭＣ	30.3	1,781,113	58,782	ＫＤＤＩ	288	1,236,708	4,294
東京エレクトロン	58	1,753,920	30,240	アドバンテスト	96	1,196,320	12,461
ソフトバンクグループ	228	1,354,188	5,939	ダイキン工業	48	1,192,810	24,850
オリエンタルランド	293	1,334,346	4,554	ファナック	176	1,094,870	6,220
ＫＤＤＩ	228	944,388	4,142	信越化学	176	965,890	5,488
ダイキン工業	38	872,600	22,963	テルモ	192	775,840	4,040
アドバンテスト	76	832,280	10,951	ＴＤＫ	144	717,858	4,985

（注1）金額は受渡し代金。
（注2）金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
(1)国内株式

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業（0.1%）			
ニッスイ	271	261	199,351
マルハニチロ	27.1	—	—
鉱業（0.1%）			
ＩＮＰＥＸ	108.4	104.4	246,175
建設業（1.8%）			
コムシスホールディングス	271	261	852,165
大成建設	54.2	52.2	279,792
大林組	271	261	368,793
清水建設	271	261	275,355
長谷工コーポレーション	54.2	52.2	103,042
鹿島建設	135.5	130.5	338,778
大和ハウス	271	261	1,096,461
積水ハウス	271	261	815,364
日揮ホールディングス	271	261	587,380
食料品（3.6%）			
日清製粉Ｇ本社	271	261	512,995
明治ホールディングス	54.2	104.4	390,142
日本ハム	135.5	130.5	599,647
サッポロホールディングス	54.2	52.2	246,175
アサヒグループホールディン	271	261	1,546,947
キリンＨＤ	271	261	557,757
宝ホールディングス	271	261	328,077
キッコーマン	271	261	2,208,060
味の素	271	261	1,526,850
ニチレイ	135.5	130.5	464,580
日本たばこ産業	271	261	883,224
繊維製品（0.1%）			
東洋紡	27.1	—	—
ユニチカ	27.1	—	—
帝人	54.2	52.2	84,146
東レ	271	261	218,587
パルプ・紙（0.1%）			
王子ホールディングス	271	261	176,853
日本製紙	27.1	26.1	37,166
化学（6.9%）			
クラレ	271	261	453,096
旭化成	271	261	261,652
レゾナック・ホールディング	27.1	26.1	66,515
住友化学	271	261	113,274
日産化学	271	261	1,745,046
東ソー	135.5	130.5	264,654
トクヤマ	54.2	52.2	130,212
デンカ	54.2	52.2	151,014
信越化学	271	1,305	6,064,335
三井化学	54.2	52.2	206,659
三菱ケミカルグループ	135.5	130.5	127,994
ＵＢＥ	27.1	26.1	70,326
花王	271	261	1,467,603
ＤＩＣ	27.1	26.1	65,563
富士フイルム HLDGS	271	261	2,378,493
資生堂	271	261	1,488,222
日東電工	271	261	2,651,760
医薬品（6.7%）			
協和キリン	271	261	705,222
武田薬品	271	261	1,260,369
アステラス製薬	1,355	1,305	2,868,390
住友ファーマ	271	261	144,202
塩野義製薬	271	261	1,760,184
中外製薬	813	783	3,490,614
エーザイ	271	261	2,331,774
第一三共	813	783	3,175,065
大塚ホールディングス	271	261	1,453,770
石油・石炭製品（0.2%）			
出光興産	108.4	104.4	381,582
ENEOS ホールディングス	271	261	166,413
ゴム製品（0.8%）			
横浜ゴム	135.5	130.5	431,041
ブリヂストン	271	261	1,594,971
ガラス・土石製品（0.8%）			
ＡＧＣ	54.2	52.2	280,836
日本板硝子	27.1	26.1	21,767
日本電気硝子	81.3	78.3	211,370
住友大阪セメント	27.1	26.1	102,077
太平洋セメント	27.1	26.1	73,954
東海カーボン	271	261	318,159
ＴＯＴＯ	135.5	130.5	517,432
日本碍子	271	261	530,743
鉄鋼（0.1%）			
日本製鉄	27.1	26.1	97,875
神戸製鋼所	27.1	26.1	56,376
ＪＦＥホールディングス	27.1	26.1	60,408
大平洋金属	27.1	26.1	39,202
非鉄金属（0.8%）			
日本軽金属ＨＤ	27.1	—	—
三井金属	27.1	26.1	106,200
東邦亜鉛	27.1	—	—
三菱マテリアル	27.1	26.1	68,695
住友鉱山	135.5	130.5	619,614
DOWA ホールディングス	54.2	52.2	260,791
古河電工	27.1	26.1	68,460
住友電工	271	261	486,765
フジクラ	271	261	326,119
金属製品（0.0%）			
ＳＵＭＣＯ	27.1	26.1	51,795
機械（5.5%）			
日本製鋼所	54.2	52.2	158,218
オークマ	54.2	52.2	370,776
アマダ	271	261	422,950
ＳＭＣ	—	26.1	1,815,255
小松製作所	271	261	1,176,849
住友重機械	54.2	52.2	205,459
日立建機	271	261	1,282,554
クボタ	271	261	627,835
荏原製作所	54.2	52.2	384,453
ダイキン工業	271	261	6,502,815
日本精工	271	261	230,019
ＮＴＮ	271	261	77,073
ジェイテクト	271	261	393,066
三井Ｅ＆Ｓ	27.1	26.1	16,469
日立造船	54.2	52.2	46,980
三菱重工業	27.1	26.1	229,392
ＩＨＩ	27.1	26.1	84,407
電気機器（23.6%）			
コニカミノルタ	271	261	130,839
ミネベアミツミ	271	261	647,932
日立	54.2	52.2	519,233
三菱電機	271	261	503,860
富士電機	54.2	52.2	362,946
安川電機	271	261	1,503,621
ニデック	—	208.8	1,531,130
オムロン	271	261	1,802,205
ジーエス・ユアサ コーポ	54.2	52.2	141,696
日本電気	27.1	26.1	219,240
富士通	27.1	26.1	487,156
沖電気	27.1	—	—
ルネサスエレクトロニクス	—	261	591,034
セイコーエプソン	542	522	1,254,105
パナソニック ホールディング	271	261	465,624
シャープ	271	261	244,948
ソニーグループ	271	261	3,342,105
ＴＤＫ	813	783	4,445,874
アルプスアルパイン	271	261	338,517
横河電機	271	261	782,739
アドバンテスト	542	522	8,328,510
キーエンス	27.1	26.1	1,503,621
カシオ	271	261	334,471
ファナック	271	1,305	5,283,945

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額
	千株	千株	千円
京セラ	542	522	4,042,890
太陽誘電	271	261	1,114,470
村田製作所	216.8	208.8	1,726,358
SCREENホールディングス	54.2	52.2	727,407
キヤノン	406.5	391.5	1,442,286
リコー	271	261	349,609
東京エレクトロン	271	783	16,247,250
輸送用機器（5.3%）			
デンソー	271	261	2,684,385
川崎重工業	27.1	26.1	102,259
日産自動車	271	261	185,336
いすゞ自動車	135.5	130.5	264,066
トヨタ自動車	1,355	1,305	3,758,400
日野自動車	271	261	159,732
三菱自動車工業	27.1	26.1	17,293
マツダ	54.2	52.2	96,700
本田技研	542	522	2,822,454
スズキ	271	261	1,641,951
SUBARU	271	261	807,534
ヤマハ発動機	271	261	1,077,147
精密機器（3.7%）			
テルモ	1,084	1,044	4,515,300
ニコン	271	261	429,214
オリンパス	1,084	1,044	2,173,608
ＨＯＹＡ	—	130.5	2,100,397
シチズン時計	271	261	248,733
その他製品（2.5%）			
バンダイナムコHLDGS	271	783	2,555,712
凸版印刷	135.5	130.5	500,728
大日本印刷	135.5	130.5	530,352
ヤマハ	271	261	1,126,215
任天堂	27.1	261	1,683,711
電気・ガス業（0.2%）			
東京電力ＨＤ	27.1	26.1	18,241
中部電力	27.1	26.1	54,744
関西電力	27.1	26.1	61,178
東京瓦斯	54.2	52.2	185,936
大阪瓦斯	54.2	52.2	133,893
陸運業（1.4%）			
東武鉄道	54.2	52.2	214,333
東急	135.5	130.5	240,120
小田急電鉄	135.5	130.5	304,978
京王電鉄	54.2	52.2	278,904
京成電鉄	135.5	130.5	746,721
東日本旅客鉄道	27.1	26.1	230,358
西日本旅客鉄道	27.1	26.1	171,477
東海旅客鉄道	27.1	26.1	506,992
ヤマトホールディングス	271	261	664,114
NIPPON EXPRESS	27.1	26.1	202,797
海運業（0.4%）			
日本郵船	27.1	78.3	343,110
商船三井	81.3	78.3	353,524
川崎汽船	27.1	78.3	435,348
空運業（0.3%）			
日本航空	—	261	785,871
ANAホールディングス	27.1	26.1	85,242
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
三菱倉庫	135.5	130.5	538,443
情報・通信業（10.5%）			
ネクソン	542	522	1,522,152
Ｚホールディングス	108.4	104.4	46,009
トレンドマイクロ	271	261	1,538,334
日本電信電話	108.4	2,610	472,410
ＫＤＤＩ	1,626	1,566	7,407,180
ソフトバンク	271	261	459,360
東宝	27.1	26.1	142,062
NTTデータグループ	1,355	1,305	2,814,885
コナミグループ	271	261	2,182,482
ソフトバンクグループ	1,626	1,566	10,174,302
卸売業（3.5%）			
双日	27.1	26.1	91,924
伊藤忠	271	261	1,502,577
丸紅	271	261	662,679
豊田通商	271	261	2,397,546
三井物産	271	261	1,522,152
住友商事	271	261	839,376
三菱商事	271	261	2,006,568
小売業（12.2%）			
J. フロント リテイリング	135.5	130.5	206,712
三越伊勢丹ＨＤ	271	261	451,791
セブン＆アイ・HLDGS	271	261	1,584,531
高島屋	135.5	130.5	288,078
丸井グループ	271	261	682,384
イオン	271	261	792,135
ファーストリテイリング	271	783	27,201,420
銀行業（0.7%）			
しずおかフィナンシャルク	—	261	332,905
ｺﾝｺﾙﾃﾞｨｱ・ﾌｨﾅﾝｼｬﾙ	271	261	189,564
あおぞら銀行	27.1	26.1	83,363
三菱UFJフィナンシャルG	271	261	345,694
りそなホールディングス	27.1	26.1	22,900
三井住友トラストHD	27.1	26.1	156,626
三井住友フィナンシャルG	27.1	26.1	198,360
千葉銀行	271	261	301,324
ふくおかフィナンシャルG	54.2	52.2	198,673
静岡銀行	271	—	—
みずほフィナンシャルG	27.1	26.1	70,026
証券、商品先物取引業（0.2%）			
大和証券G本社	271	261	238,423
野村ホールディングス	271	261	170,250
松井証券	271	261	224,460
保険業（1.0%）			
SOMPOホールディングス	54.2	52.2	359,449
ＭＳ＆ＡＤ	81.3	78.3	454,374
第一生命HLDGS	27.1	26.1	82,998
東京海上ＨＤ	135.5	391.5	1,403,527
T&Dホールディングス	54.2	52.2	135,432
その他金融業（0.8%）			
クレディセゾン	271	261	649,759
オリックス	271	261	779,085
日本取引所グループ	271	261	692,041
不動産業（1.2%）			
東急不動産ＨＤ	271	261	256,275
三井不動産	271	261	900,450
三菱地所	271	261	542,749
東京建物	135.5	130.5	284,555
住友不動産	271	261	1,066,185
サービス業（4.6%）			
エムスリー	650.4	626.4	1,763,002
ディー・エヌ・エー	81.3	78.3	120,660
電通グループ	271	261	1,153,098
オリエンタルランド	—	261	1,331,361
サイバーエージェント	216.8	208.8	173,011
楽天グループ	271	261	161,846
リクルートホールディングス	813	783	3,963,546
日本郵政	271	261	330,687
セコム	271	261	2,710,485
	千株	千株	千円
合計 株数、金額	50,948	56,871.9	256,026,501
合計 銘柄数<比率>	225銘柄	225銘柄	<97.5%>

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

(2)先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当期末 買建額	当期末 売建額
		百万円	百万円
国内	日経平均	4,163	—

（注）単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

区　　分	当　期　末	
	貸　付	借　入
株式	株 457,900 (　　—)	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

2023年9月19日現在

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
株式	256,026,501	96.2
コール・ローン等、その他	10,112,948	3.8
投資信託財産総額	266,139,450	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

2023年9月19日現在

項　　目	当　期　末
(A)資産	**269,794,495,004円**
コール・ローン等	5,909,012,041
株式(評価額)	256,026,501,450
未収入金	3,993,576,526
未収配当金	177,462,500
未収利息	35,872
その他未収収益	27,115
差入委託証拠金	3,687,879,500
(B)負債	**7,269,849,586**
未払金	24,278,150
未払解約金	2,315,480,000
差入委託証拠金代用有価証券	3,729,792,000
受入担保金	1,200,299,436
(C)純資産総額(A－B)	**262,524,645,418**
元本	58,232,518,725
次期繰越損益金	204,292,126,693
(D)受益権総口数	**58,232,518,725口**
1万口当り基準価額(C／D)	**45,082円**

＊期首における元本額は59,868,190,359円、当作成期間中における追加設定元本額は23,471,368,539円、同解約元本額は25,107,040,173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：

ストック インデックス ファンド225	22,198,598,732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225VA	223,891,129円
大和 ストック インデックス225ファンド	7,047,147,476円
D－I's 日経225インデックス	56,114,408円
ｉＦｒｅｅ 日経225インデックス	11,579,271,452円
DC・ダイワ・ストックインデックス225(確定拠出年金専用ファンド)	5,496,204,063円
ダイワ・ノーロード 日経225ファンド	400,026,336円
ダイワファンドラップ 日経225インデックス	4,490,255,503円
ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)	616,476,132円
ダイワ・インデックスセレクト 日経225	6,124,533,494円

＊当期末の計算口数当りの純資産額は45,082円です。

■損益の状況

当期　自 2022年9月21日　至 2023年9月19日

項　　目	当　期
(A)配当等収益	**4,976,897,260円**
受取配当金	4,880,180,312
受取利息	2,876,001
その他収益金	98,780,531
支払利息	△ 4,939,584
(B)有価証券売買損益	**45,079,541,525**
売買益	50,519,026,803
売買損	△ 5,439,485,278
(C)先物取引等損益	**1,791,456,390**
取引益	2,646,169,890
取引損	△ 854,713,500
(D)当期損益金(A＋B＋C)	**51,847,895,175**
(E)前期繰越損益金	**159,958,130,884**
(F)解約差損益金	**△ 74,594,714,827**
(G)追加信託差損益金	**67,080,815,461**
(H)合計(D＋E＋F＋G)	**204,292,126,693**
次期繰越損益金(H)	**204,292,126,693**

(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。

「日経平均トータルリターン・インデックス」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「日経平均トータルリターン・インデックス」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、「ストック インデックス225・マザーファンド」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。

《お知らせ》
■ベンチマークの変更について
ベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。
変更前：日経平均株価
変更後：日経平均トータルリターン・インデックス

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８期

（決算日　2024年６月17日）

（作成対象期間　2023年６月16日～2024年６月17日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型		
信託期間	無期限（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（配当込み、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、分配を行なわないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、外国の株式（ＤＲ（預託証券）を含みます。）に投資し、ＭＳＣＩコクサイ指数（配当込み、円ヘッジ・ベース）に連動する投資成果をあげ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/

<5694>

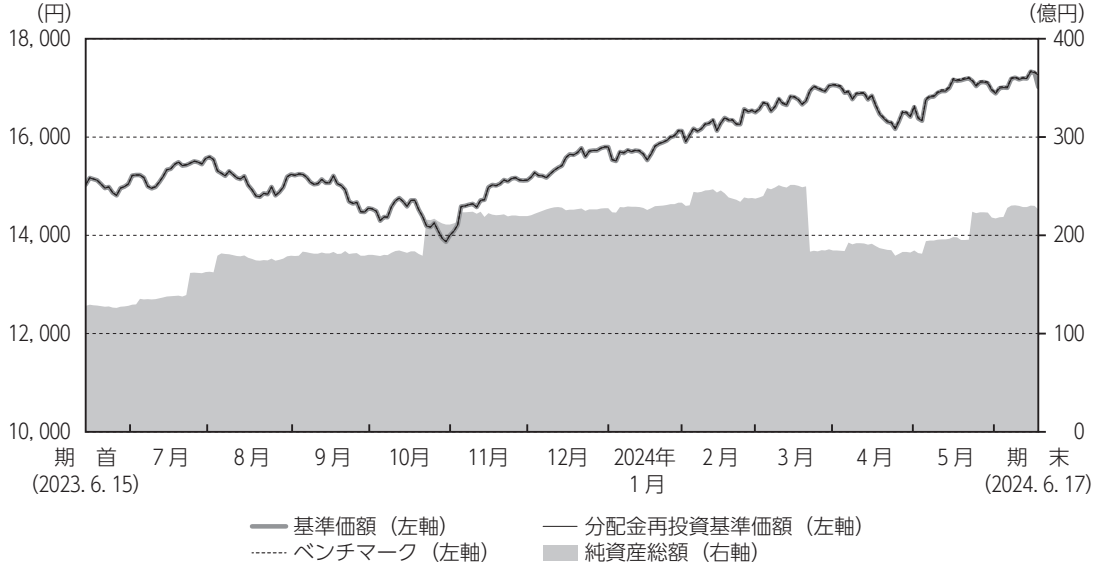
最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ＭＳＣＩコクサイ指数（税引後配当込み、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
4期末（2020年6月15日）	11,475	160	1.4	12,082	1.6	96.4	2.0	—	2.7	7,959
5期末（2021年6月15日）	15,732	210	38.9	16,834	39.3	95.5	3.7	—	2.4	11,208
6期末（2022年6月15日）	13,560	160	△ 12.8	14,719	△ 12.6	97.1	6.1	—	2.5	9,983
7期末（2023年6月15日）	15,031	180	12.2	16,519	12.2	95.3	4.8	—	2.1	12,818
8期末（2024年6月17日）	17,021	240	14.8	18,993	15.0	93.1	6.6	—	1.8	22,623

（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（税引後配当込み、円ヘッジ・ベース）は、ＭＳＣＩ Ｉｎｃ.（「ＭＳＣＩ」）の承諾を得て、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。ＭＳＣＩコクサイ指数（税引後配当込み、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（税引後配当込み、円ヘッジ・ベース）です。

■基準価額・騰落率

期　首：15,031円
期　末：17,021円（分配金240円）
騰落率：14.8%（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、海外株式市況が上昇したことを受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年　月　日	基準価額		ＭＳＣＩコクサイ指数（税引後配当込み、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	投資証券組入比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率				
	円	%		%	%	%	%	%
（期首）2023年６月15日	15,031	—	16,519	—	95.3	4.8	—	2.1
６月末	15,043	0.1	16,533	0.1	96.6	5.8	—	2.1
７月末	15,565	3.6	17,113	3.6	89.1	7.2	—	1.9
８月末	15,238	1.4	16,749	1.4	93.8	7.2	—	2.0
９月末	14,553	△ 3.2	15,997	△ 3.2	93.3	7.4	—	1.9
10月末	14,002	△ 6.8	15,393	△ 6.8	93.1	5.6	—	1.9
11月末	15,122	0.6	16,623	0.6	92.8	3.8	—	2.0
12月末	15,798	5.1	17,359	5.1	90.9	4.1	—	2.0
2024年１月末	16,121	7.3	17,729	7.3	96.9	5.6	—	2.0
２月末	16,503	9.8	18,148	9.9	96.3	4.9	—	2.0
３月末	17,060	13.5	18,756	13.5	94.9	3.0	—	1.9
４月末	16,612	10.5	18,279	10.7	97.6	4.5	—	1.9
５月末	16,887	12.3	18,582	12.5	92.2	6.3	—	1.8
（期末）2024年６月17日	17,261	14.8	18,993	15.0	93.1	6.6	—	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

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より、米国のインフレ警戒感の後退や中国の経済対策への期待から、上昇しました。2023年８月以降は、米国国債の増発やＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）の政策金利見通しの引き上げ、米国政府機関の閉鎖懸念などから長期金利が大幅に上昇したことを受け、株価は下落しました。10月に入ると、つなぎ予算の成立により政府機関の閉鎖が回避され一時的に反発しましたが、景気の先行き不透明感や企業業績の伸びの鈍化、パレスチナ情勢の悪化、長期金利のさらなる上昇などが嫌気され、続落しました。11月以降は、欧米のインフレ率が予想以上に鈍化し金利が低下したことや、ＦＲＢ議長の発言を受けて利下げ観測が高まったことなどが好感され、急上昇しました。2024年１月に入ると、台湾の半導体企業が強気見通しを出したことが好感され、株価は続伸しました。４月以降は、米国の利下げ期待が後退したことや、中東情勢への懸念が高まったことなどの影響により株価は下落しましたが、米国の半導体関連株の買い戻しや中東情勢への懸念の後退を主因に下げ幅を縮小しました。６月に入ると、欧米の経済指標の下振れにより利下げ期待が高まったため、株価は上昇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」の受益証券の組入比率を高位に維持します。

■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

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

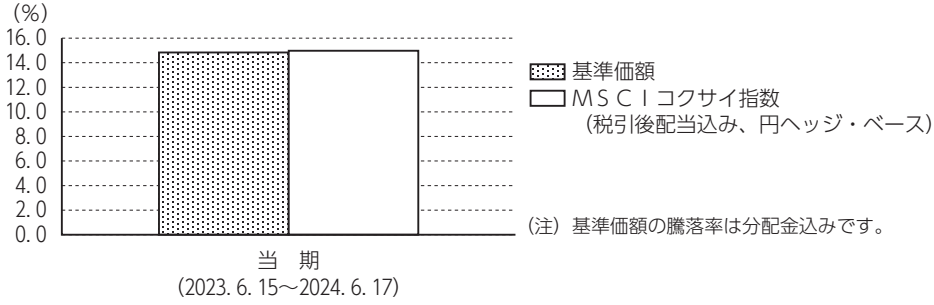
組入ファンド	ベンチマーク
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	ＭＳＣＩコクサイ指数（税引後配当込み、円ヘッジ・ベース）

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15.0％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は14.8％となりました。

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、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ＭＳＣＩコクサイ指数（税引後配当込み、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
		2023年６月16日 ～2024年６月17日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**240**
対基準価額比率	（％）	1.39
当期の収益	（円）	240
当期の収益以外	（円）	―
翌期繰越分配対象額	（円）	7,021

（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。
（注４）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。

■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	✓ 256.94円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	1,416.22
（ｃ）収益調整金	5,268.98
（ｄ）分配準備積立金	319.22
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	7,261.38
（ｆ）分配金	240.00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	7,021.38

（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」の受益証券の組入比率を高位に維持します。

■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

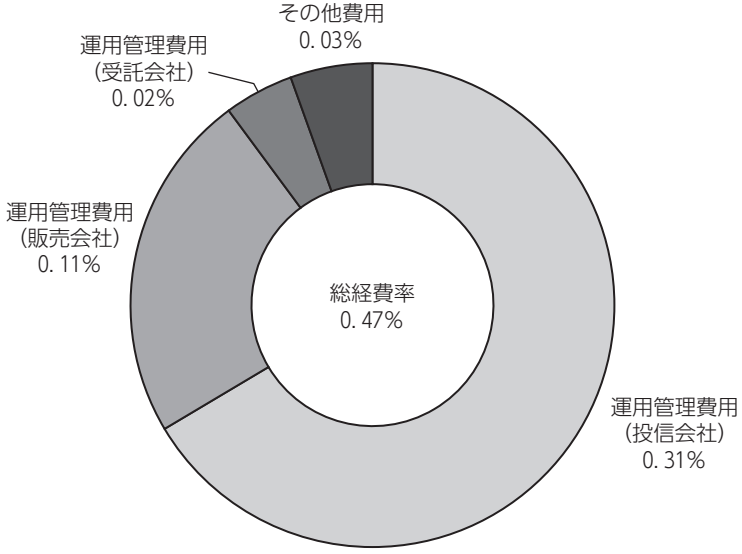
項　　目	当　期 (2023. 6. 16～2024. 6. 17)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	70円	0. 448%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は15, 717円です。**
(投 信 会 社)	(50)	(0. 315)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(17)	(0. 111)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0. 022)	受託会社分は、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. 007	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. 005)	
(先物・オプション)	(0)	(0. 002)	
(投 資 証 券)	(0)	(0. 000)	
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
(株　　式)	(1)	(0. 006)	
(投 資 証 券)	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	4	0. 026	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. 020)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(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)	(0)	(0. 001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	76	0. 487	

(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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	6, 941, 397	19, 715, 453	4, 402, 358	12, 990, 169

（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

（2023年６月16日から2024年６月17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	35, 322, 096千円
（ｂ）期中の平均組入株式時価総額	100, 712, 663千円
（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

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
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	4, 764, 611	7, 303, 650	22, 938, 575

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年６月17日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	22, 938, 575	99. 8
コール・ローン等、その他	53, 479	0. 2
投資信託財産総額	22, 992, 055	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17日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝157. 53円、１カナダ・ドル＝114. 69円、１オーストラリア・ドル＝104. 17円、１香港・ドル＝20. 16円、１シンガポール・ドル＝116. 47円、１ニュージーランド・ドル＝96. 66円、１イギリス・ポンド＝199. 87円、１イスラエル・シュケル＝42. 35円、１スイス・フラン＝176. 84円、１デンマーク・クローネ＝22. 60円、１ノルウェー・クローネ＝14. 77円、１スウェーデン・クローネ＝14. 97円、１ユーロ＝168. 64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（116, 001, 513千円）の投資信託財産総額（121, 421, 534千円）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

2024年６月17日現在

項目	当期末
（Ａ）資産	**22, 992, 055, 164円**
コール・ローン等	53, 479, 973
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）	22, 938, 575, 191
（Ｂ）負債	**368, 659, 187**
未払収益分配金	318, 987, 932
未払信託報酬	49, 065, 600
その他未払費用	605, 655
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）	**22, 623, 395, 977**
元本	13, 291, 163, 863
次期繰越損益金	9, 332, 232, 114
（Ｄ）受益権総口数	**13, 291, 163, 863口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）	**17, 021円**

＊期首における元本額は8, 528, 354, 682円、当作成期間中における追加設定元本額は12, 945, 394, 819円、同解約元本額は8, 182, 585, 638円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は17, 021円です。

■損益の状況

当期　自 2023年６月16日　至 2024年６月17日

項　　目	当　　期
（Ａ）配当等収益	**6, 464円**
受取利息	9, 813
支払利息	△ 3, 349
（Ｂ）有価証券売買損益	**2, 314, 166, 401**
売買益	3, 244, 046, 351
売買損	△ 929, 879, 950
（Ｃ）信託報酬等	△ **90, 331, 193**
（Ｄ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	**2, 223, 841, 672**
（Ｅ）前期繰越損益金	**424, 286, 786**
（Ｆ）追加信託差損益金	**7, 003, 091, 588**
（配当等相当額）	(5, 324, 797, 018)
（売買損益相当額）	(1, 678, 294, 570)
（Ｇ）合計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	**9, 651, 220, 046**
（Ｈ）収益分配金	△ **318, 987, 932**
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	**9, 332, 232, 114**
追加信託差損益金	7, 003, 091, 588
（配当等相当額）	(5, 324, 797, 018)
（売買損益相当額）	(1, 678, 294, 570)
分配準備積立金	2, 329, 140, 526

（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	341, 508, 141円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	1, 882, 333, 531
（ｃ）収益調整金	7, 003, 091, 588
（ｄ）分配準備積立金	424, 286, 786
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	9, 651, 220, 046
（ｆ）分配金	318, 987, 932
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	9, 332, 232, 114
（ｈ）受益権総口数	13, 291, 163, 863口

収　益　分　配　金　の　お　知　ら　せ	
１万口当り分配金（税込み）	240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（2024年１月10日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2024年６月17日）現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの主要な売買銘柄

株　　式

（2023年６月16日から2024年６月17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）	24. 362	650, 947	26, 719	APPLE INC（アメリカ）	46. 785	1, 265, 447	27, 048
MICROSOFT CORP（アメリカ）	11. 3	580, 939	51, 410	MICROSOFT CORP（アメリカ）	15. 5	928, 556	59, 906
NVIDIA CORP（アメリカ）	4. 348	344, 870	79, 316	NVIDIA CORP（アメリカ）	5. 447	616, 117	113, 111
AMAZON. COM INC（アメリカ）	16. 299	329, 016	20, 186	AMAZON. COM INC（アメリカ）	20. 083	499, 624	24, 877
ALPHABET INC-CL A（アメリカ）	9. 026	174, 385	19, 320	META PLATFORMS INC CLASS A（アメリカ）	5. 167	342, 196	66, 227
META PLATFORMS INC CLASS A（アメリカ）	3. 638	171, 936	47, 261	ALPHABET INC-CL C（アメリカ）	13. 7	302, 023	22, 045
TESLA INC（アメリカ）	4. 678	155, 731	33, 290	ALPHABET INC-CL A（アメリカ）	13. 3	290, 198	21, 819
ALPHABET INC-CL C（アメリカ）	7. 717	150, 328	19, 480	ELI LILLY & CO（アメリカ）	1. 752	185, 324	105, 778
BROADCOM INC（アメリカ）	1. 025	139, 750	136, 341	JOHNSON & JOHNSON（アメリカ）	7. 633	182, 615	23, 924
CRH PUBLIC LIMITED PLC（アイルランド）	8. 5	109, 490	12, 881	TESLA INC（アメリカ）	6. 233	182, 380	29, 260

（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、2024年６月17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（38, 512, 369千口）の内容です。

(1)外国株式

銘柄	2024年６月17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	13. 66	266	41, 989	資本財・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	37. 24	1, 181	186, 147	情報技術
FIRST SOLAR INC	11. 58	316	49, 911	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	20. 16	274	43, 184	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	14. 94	224	35, 401	資本財・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	47. 06	196	30, 906	金融
ABBOTT LABORATORIES	198. 62	2, 059	324, 400	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	44. 51	351	55, 350	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	16. 35	432	68, 091	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	43. 59	188	29, 698	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	138. 3	944	148, 735	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	6. 19	499	78, 649	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	66. 23	507	79, 887	金融
QORVO INC	11. 47	128	20, 305	情報技術
AFLAC INC	63. 41	551	86, 944	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	2024年6月17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	
DARDEN RESTAURANTS INC	13.7	203	32,109	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	18.95	168	26,493	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	51.94	2,728	429,814	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	22.24	162	25,666	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	12.73	389	61,365	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	17.84	284	44,833	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	26.4	726	114,425	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	74.61	1,555	245,091	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	25.12	196	30,925	金融
AUTOZONE INC	1.89	535	84,431	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	23.8	252	39,752	生活必需品
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	134.65	231	36,398	ヘルスケア
CELANESE CORP	13.16	183	28,896	素材
DR HORTON INC	33.56	479	75,483	一般消費財・サービス
AUTODESK INC	24.59	555	87,494	情報技術
MOODY'S CORP	19.3	787	124,081	金融
DEVON ENERGY CORP	73.16	333	52,507	エネルギー
ALBEMARLE CORP	13.89	143	22,648	素材
ATMOS ENERGY CORP	16.83	195	30,794	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	30.69	152	24,095	公益事業
CITIGROUP INC	221.36	1,313	206,888	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	46.69	1,132	178,448	資本財・サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	60.35	531	83,661	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	4.07	212	33,430	一般消費財・サービス
HESS CORP	32.3	463	72,990	エネルギー
DAVITA INC	6.09	85	13,542	ヘルスケア
DANAHER CORP	81.49	2,076	327,153	ヘルスケア
FORTIVE CORP	40.57	295	46,481	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	66.35	900	141,803	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	57.06	339	53,482	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	36.11	532	83,818	情報技術
APPLE INC	1,689.63	35,902	5,655,791	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	29.19	356	56,099	金融
BOEING CO/THE	67.42	1,195	188,272	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	19.13	214	33,833	金融
BECTON DICKINSON AND CO	32.77	765	120,657	ヘルスケア
LEIDOS HOLDINGS INC	14.82	212	33,548	資本財・サービス
NISOURCE INC	53.11	149	23,568	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14.04	117	18,489	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	86.84	503	79,370	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	481.67	1,910	301,005	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	150.59	6,107	962,039	金融
ANSYS INC	9.67	312	49,228	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	152.86	541	85,267	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	81.32	986	155,325	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	232.75	958	151,060	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	330.69	6,408	1,009,469	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	26.55	305	48,056	金融
LKQ CORP	32.87	132	20,862	一般消費財・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	19.98	87	13,741	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	31.28	976	153,788	情報技術

銘柄	2024年6月17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	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11.52	488	76,919	金融
DOLLAR GENERAL CORP	24.77	311	49,083	生活必需品
SERVICENOW INC	24.3	1,770	278,898	情報技術
CATERPILLAR INC	57.18	1,838	289,566	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	28.73	258	40,768	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	33.06	122	19,337	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	5.74	120	18,940	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	34.33	204	32,258	公益事業
MOSAIC CO/THE	38.41	104	16,433	素材
DELTA AIR LINES INC	20.19	98	15,495	資本財・サービス
CORNING INC	94.7	352	55,569	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	465.8	2,127	335,188	情報技術
MORGAN STANLEY	140.88	1,345	211,941	金融
DECKERS OUTDOOR CORP	3.5	358	56,444	一般消費財・サービス
MSCI INC	8.8	422	66,614	金融
FAIR ISAAC CORP	2.99	415	65,498	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	3.7	197	31,124	資本財・サービス
MANHATTAN ASSOCIATES INC	7	160	25,234	情報技術
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	26.98	163	25,794	資本財・サービス
BROADCOM INC	50.98	8,845	1,393,389	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	5	144	22,689	ヘルスケア
CNH INDUSTRIAL NV	99	102	16,219	資本財・サービス
DICK'S SPORTING GOODS INC	7	151	23,849	一般消費財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	15.05	241	38,025	ヘルスケア
DTE ENERGY COMPANY	24.9	279	43,986	公益事業
CENTENE CORP	60.64	417	65,846	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	11.82	198	31,207	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	54.65	186	29,330	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	25.2	650	102,514	金融
GARTNER INC	9.23	398	62,843	情報技術
DOMINION ENERGY INC	96.28	485	76,487	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	91.56	439	69,275	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	14	115	18,185	資本財・サービス
DEERE & CO	30.09	1,137	179,174	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC	17.26	471	74,306	資本財・サービス
POOL CORP	3.8	129	20,431	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	30.94	291	45,898	金融
BURLINGTON STORES INC	6.66	151	23,922	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	47.41	277	43,765	金融
TARGA RESOURCES CORP	25.31	301	47,446	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7.74	96	15,136	金融
WESTLAKE CORP	4.24	63	10,007	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	39.76	361	56,915	公益事業
TELEFLEX INC	5.45	113	17,882	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	10.28	161	25,466	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7.94	264	41,682	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	2.41	68	10,715	ヘルスケア
CATALENT INC	22.63	125	19,778	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	18.06	333	52,546	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	6.83	209	33,035	ヘルスケア
CARLISLE COS INC	5	202	31,923	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	2024年6月17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	
IDEX CORP	8.6	170	26,855	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	89.81	849	133,866	生活必需品
ROLLINS INC	33.6	162	25,671	資本財・サービス
AECOM	17	147	23,188	資本財・サービス
WATSCO INC	4	191	30,119	資本財・サービス
GRACO INC	19	150	23,732	資本財・サービス
AMETEK INC	26.65	445	70,117	資本財・サービス
TORO CO	13	125	19,784	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	29.47	317	49,998	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	20.47	95	15,078	資本財・サービス
HEICO CORP	5.35	120	18,977	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4.21	169	26,643	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	31.06	290	45,768	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	5.14	242	38,201	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	51.2	4,381	690,143	生活必需品
EPAM SYSTEMS INC	6.63	117	18,546	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	16.36	182	28,681	素材
RELIANCE INC	7	193	30,554	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3.34	1,092	172,141	一般消費財・サービス
CUMMINS INC	15.95	425	66,955	資本財・サービス
CDW CORP/DE	15.87	354	55,797	情報技術
COSTAR GROUP INC	47.63	352	55,470	不動産
OLD DOMINION FREIGHT LINE	22.56	389	61,389	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	5.09	805	126,860	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7.9	127	20,107	金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	28.87	607	95,651	一般消費財・サービス
DEXCOM INC	44.35	514	81,007	ヘルスケア
NORDSON CORP	5.72	130	20,609	資本財・サービス
COPART INC	99.36	528	83,285	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	20.5	381	60,056	エネルギー
ALIGN TECHNOLOGY INC	7.62	195	30,730	ヘルスケア
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	9.38	259	40,955	金融
TRANSDIGM GROUP INC	6.1	789	124,417	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	17.64	133	21,082	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	11.26	152	24,025	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	229.43	449	70,802	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	23.45	791	124,664	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4.2	84	13,247	金融
COTERRA ENERGY INC	85.77	229	36,115	エネルギー
T-MOBILE US INC	62.16	1,093	172,330	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	17.86	85	13,504	不動産
EMCOR GROUP INC	6	226	35,652	資本財・サービス
COCA-COLA CO/THE	473.33	2,960	466,395	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	25.75	190	30,037	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	17.25	212	33,529	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	33.73	73	11,599	金融
CSX CORP	227.31	731	115,230	資本財・サービス
EXPEDIA GROUP INC	14.96	186	29,366	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	1,078.85	19,814	3,121,324	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	69.44	606	95,485	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	516.29	5,633	887,404	エネルギー

銘柄	2024年6月17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	
AES CORP	81.21	157	24,741	公益事業
EVEREST GROUP LTD	4.96	182	28,719	金融
EOG RESOURCES INC	66.52	786	123,902	エネルギー
EQT CORP	46.03	181	28,525	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	17.1	152	23,998	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1.34	218	34,446	金融
CENCORA INC	20.62	479	75,531	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	34.15	443	69,854	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	450.78	527	83,154	一般消費財・サービス
EXACT SCIENCES CORP	21.47	89	14,164	ヘルスケア
ENTEGRIS INC	16.93	226	35,710	情報技術
MICROSTRATEGY INC-CL A	2	299	47,118	情報技術
AERCAP HOLDINGS NV	24.01	213	33,673	資本財・サービス
FORTINET INC	74.69	453	71,513	情報技術
MARKEL CORP	1.5	231	36,485	金融
NEXTERA ENERGY INC	236.93	1,731	272,686	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC	164.5	791	124,670	素材
INSULET CORP	8.09	162	25,545	ヘルスケア
US BANCORP	179.2	695	109,614	金融
UNITED RENTALS INC	7.96	490	77,268	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	6.59	110	17,396	情報技術
SUPER MICRO COMPUTER INC	6	506	79,824	情報技術
FASTENAL CO	67.42	425	66,963	資本財・サービス
FISERV INC	68.03	1,013	159,615	金融
GENERAL ELECTRIC CO	126.12	1,965	309,697	資本財・サービス
AXON ENTERPRISE INC	8	233	36,840	資本財・サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP	5	69	10,966	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	131.42	614	96,826	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	26.62	776	122,356	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	36.89	1,646	259,450	金融
ALPHABET INC-CL A	678.68	11,998	1,890,105	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	588.4	10,495	1,653,323	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	9.83	173	27,343	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	65.35	428	67,429	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	64.03	248	39,105	公益事業
GENUINE PARTS CO	15.54	212	33,464	一般消費財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	80.2	282	44,496	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	22.13	481	75,813	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	103.33	340	53,585	エネルギー
REPLIGEN CORP	6	75	11,873	ヘルスケア
HOME DEPOT INC	113.54	3,938	620,356	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	6.02	99	15,698	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	166.48	205	32,441	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4.97	118	18,669	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	17.15	320	50,515	生活必需品
HUMANA INC	14.08	505	79,611	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	29.09	782	123,201	情報技術
HENRY SCHEIN INC	14.91	98	15,454	ヘルスケア
HP INC	113.05	401	63,238	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	153.38	331	52,189	情報技術
ARCH CAPITAL GROUP LTD	42.63	414	65,314	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	2024年6月17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	
KRAFT HEINZ CO/THE	104. 98	339	53, 548	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	17. 38	216	34, 116	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	106. 33	1, 799	283, 429	情報技術
HUBBELL INC	6. 39	239	37, 721	資本財・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	38. 24	171	27, 041	素材
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	15	100	15, 909	資本財・サービス
ZOETIS INC	52. 98	903	142, 339	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	26. 32	867	136, 674	資本財・サービス
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	17	102	16, 126	情報技術
CHENIERE ENERGY INC	26. 78	417	65, 760	エネルギー
HYATT HOTELS CORP - CL A	5	73	11, 615	一般消費財・サービス
ALLEGION PLC	10. 42	121	19, 100	資本財・サービス
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	14	209	32, 982	資本財・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	30. 42	512	80, 798	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	39. 98	141	22, 332	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	12. 25	136	21, 532	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	277. 94	4, 045	637, 230	ヘルスケア
ABBVIE INC	203. 59	3, 432	540, 693	ヘルスケア
HOLOGIC INC	26. 73	191	30, 229	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	38. 77	540	85, 192	生活必需品
KROGER CO	77. 92	392	61, 840	生活必需品
KLA CORP	16. 48	1, 359	214, 136	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	25. 41	1, 164	183, 466	資本財・サービス
CORPAY INC	8. 4	209	33, 036	金融
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	25. 72	111	17, 527	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	65. 53	1, 463	230, 562	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	92. 65	8, 138	1, 282, 111	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	15. 09	1, 563	246, 265	情報技術
LOEWS CORP	22. 28	164	25, 898	金融
MCDONALD'S CORP	83. 09	2, 106	331, 915	一般消費財・サービス
3M CO	63. 08	636	100, 264	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	251. 67	12, 688	1, 998, 771	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	37. 06	1, 609	253, 605	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6. 55	371	58, 488	素材
PHILLIPS 66	49. 33	674	106, 275	エネルギー
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	17. 89	286	45, 116	情報技術
MGM RESORTS INTERNATIONAL	26. 67	106	16, 742	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	29. 88	202	31, 908	生活必需品
METLIFE INC	72. 21	494	77, 977	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	98. 68	723	113, 898	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	30. 6	1, 005	158, 350	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18. 61	698	110, 056	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2. 32	337	53, 166	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	115. 17	358	56, 405	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	13	330	52, 096	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	291. 71	3, 777	595, 000	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	49. 19	391	61, 727	素材
MASCO CORP	25. 87	178	28, 176	資本財・サービス
M & T BANK CORP	19. 43	276	43, 518	金融
MARSH & MCLENNAN COS	56. 54	1, 181	186, 044	金融
HEICO CORP-CLASS A	9. 47	167	26, 436	資本財・サービス

銘柄	2024年6月17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	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	28.09	672	105,957	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	24	502	79,198	情報技術
BLOCK INC CLASS A	64.7	402	63,344	金融
TRANSUNION	22.57	162	25,524	資本財・サービス
VISTRA CORP	38.57	337	53,219	公益事業
NETAPP INC	23.97	302	47,641	情報技術
NIKE INC -CL B	139.53	1,303	205,272	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	26.19	575	90,724	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	61.72	563	88,817	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	22.96	265	41,836	金融
ALLY FINANCIAL INC	33.09	128	20,214	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	15.53	658	103,751	資本財・サービス
APTIV PLC	30.76	216	34,064	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	132.04	538	84,906	素材
MCKESSON CORP	14.56	858	135,313	ヘルスケア
XYLEM INC	27.66	381	60,139	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	178.45	1,823	287,296	生活必需品
NUCOR CORP	27.79	429	67,719	素材
GODADDY INC - CLASS A	16.3	224	35,314	情報技術
EVERGY INC	26.23	138	21,792	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	75.24	450	70,925	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	94	14,823	金融
OKTA INC	17.95	161	25,381	情報技術
WIX.COM LTD	6.85	112	17,654	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	38.93	154	24,334	金融
KKR & CO INC	71.54	781	123,042	金融
PAYCHEX INC	37.23	454	71,545	資本財・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	6.69	673	106,157	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	197.02	873	137,554	生活必需品
P G & E CORP	232.48	424	66,836	公益事業
PFIZER INC	648.11	1,784	281,072	ヘルスケア
CIGNA CORP	32.53	1,084	170,792	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	29.76	401	63,279	情報技術
XCEL ENERGY INC	63.2	339	53,532	公益事業
STERIS PLC	10.93	238	37,585	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	45.47	338	53,306	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	15.3	47	7,457	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	29.95	99	15,654	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	39.46	1,361	214,444	ヘルスケア
DOW INC	79.6	437	68,991	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	11.67	121	19,176	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	29.13	168	26,496	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	15.26	768	120,988	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	216.24	1,514	238,654	資本財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	271.48	4,528	713,298	生活必需品
EXELON CORP	116.53	414	65,240	公益事業
INGERSOLL-RAND INC	46.26	423	66,649	資本財・サービス
NVR INC	0.39	296	46,706	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	136.1	1,488	234,530	エネルギー
TWILIO INC - A	20.53	111	17,541	情報技術
DOCUSIGN INC	23.33	118	18,684	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	2024年6月17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	
PAYCOM SOFTWARE INC	6	85	13,495	資本財・サービス
DAYFORCE INC	19.44	98	15,461	資本財・サービス
PURE STORAGE INC - CLASS A	38	257	40,514	情報技術
PEPSICO INC	158.5	2,596	409,009	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	5	126	19,874	情報技術
MONGODB INC	7.96	180	28,464	情報技術
SNAP INC - A	120.1	187	29,495	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	80.49	411	64,894	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	40.96	463	72,983	金融
AMCOR PLC	175.45	174	27,528	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	26.01	1,002	157,926	情報技術
ROKU INC	16.27	88	13,970	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21.9	283	44,607	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	71.98	2,063	325,100	情報技術
PENTAIR PLC	20.22	156	24,631	資本財・サービス
QUALCOMM INC	128.51	2,767	435,917	情報技術
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	26.95	206	32,545	金融
DATADOG INC - CLASS A	30.9	364	57,360	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	66.96	291	45,895	コミュニケーション・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	11.82	1,225	193,000	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	25.18	474	74,826	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	3.96	1,528	240,737	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	39.01	569	89,677	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	9.98	182	28,720	素材
RESMED INC	16.97	359	56,601	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	13.27	182	28,816	ヘルスケア
MODERNA INC	37.82	529	83,426	ヘルスケア
HUBSPOT INC	5.76	336	53,054	情報技術
REVVITY INC	13.76	149	23,551	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	93.28	600	94,558	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	47.59	462	72,816	資本財・サービス
AVANTOR INC	79.8	173	27,253	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	24.73	96	15,212	金融
DYNATRACE INC	32.05	147	23,179	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	50.72	485	76,431	コミュニケーション・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	108.97	203	32,014	金融
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	43.3	116	18,362	ヘルスケア
MATCH GROUP INC	35.49	111	17,638	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	201.58	3,075	484,484	エネルギー
ZSCALER INC	10.18	187	29,542	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	45.11	330	52,024	公益事業
ETSY INC	14.09	82	13,066	一般消費財・サービス
TESLA INC	330.46	5,882	926,673	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	34.56	439	69,234	情報技術
GEN DIGITAL INC	66.05	161	25,377	情報技術
UNITY SOFTWARE INC	29.42	48	7,600	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	18.45	154	24,283	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	17.63	1,040	163,916	情報技術
CLOUDFLARE INC - CLASS A	33.52	253	39,914	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	10.96	302	47,697	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	136.81	139	21,918	ヘルスケア

銘柄	2024年6月17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	
DOORDASH INC - A	33.38	374	58,919	一般消費財・サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	54.7	191	30,245	コミュニケーション・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	50.97	744	117,203	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	34.73	301	47,543	不動産
SOUTHERN CO/THE	124.74	981	154,549	公益事業
SYSCO CORP	56.74	401	63,184	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	25.61	527	83,046	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6	42	6,716	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	14	90	14,209	金融
STEEL DYNAMICS INC	17.27	208	32,834	素材
SCHLUMBERGER LTD	163.64	703	110,846	エネルギー
AT&T INC	820.23	1,446	227,927	コミュニケーション・サービス
APA CORP	43.32	120	18,984	エネルギー
SOUTHWEST AIRLINES CO	20.08	56	8,977	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	48.83	351	55,360	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	27.88	100	15,824	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	28.29	840	132,354	素材
SEMPRA ENERGY	71.78	545	85,903	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	17.96	90	14,199	情報技術
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	214.48	505	79,636	情報技術
UIPATH INC - CLASS A	45	51	8,180	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	23.38	242	38,252	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	21.64	529	83,348	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC	105.28	2,041	321,578	情報技術
SALESFORCE. COM INC	111.74	2,591	408,270	情報技術
WESTROCK CO	30.4	150	23,781	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	45.86	531	83,708	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	77.92	540	85,223	資本財・サービス
TERADYNE INC	18.46	267	42,183	情報技術
UNION PACIFIC CORP	70.09	1,556	245,226	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	69.22	188	29,768	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	40.5	688	108,504	エネルギー
RTX CORP	151.71	1,581	249,097	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	84.24	1,142	180,011	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	20.53	436	68,805	ヘルスケア
AMEREN CORPORATION	30.19	211	33,347	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	105.69	5,254	827,672	ヘルスケア
APPLOVIN CORP CLASS A	21	162	25,644	情報技術
TOAST INC CLASS A	42.72	97	15,289	金融
VERISIGN INC	10.16	183	28,858	情報技術
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	85.97	93	14,734	一般消費財・サービス
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	61	136	21,544	金融
VALERO ENERGY CORP	37.88	568	89,550	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	6.13	239	37,739	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	145	22,877	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6.67	125	19,737	ヘルスケア
ELEVANCE HEALTH INC	27.36	1,463	230,504	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	209.75	2,096	330,320	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	407.05	2,336	368,063	金融
WASTE MANAGEMENT INC	46.44	945	148,976	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	143.02	588	92,755	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	2024年6月17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	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	12. 18	341	53, 771	一般消費財・サービス
WALMART INC	509. 67	3, 415	538, 092	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	24. 39	261	41, 184	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	11. 45	101	16, 017	一般消費財・サービス
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	255	91	14, 461	資本財・サービス
CELSIUS HOLDINGS INC	16. 71	100	15, 783	生活必需品
WABTEC CORP	19. 69	315	49, 727	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	130. 65	1, 417	223, 307	一般消費財・サービス
WATERS CORP	6. 59	194	30, 618	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5. 97	179	28, 342	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	85. 98	133	21, 061	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11. 54	294	46, 407	金融
WILLIAMS-SONOMA INC	7	211	33, 259	一般消費財・サービス
WESTERN DIGITAL CORP	38. 44	300	47, 305	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	37. 2	293	46, 212	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	56. 86	413	65, 064	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	181. 6	4, 915	774, 289	金融
PPL CORP	86. 76	243	38, 377	公益事業
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	36. 2	777	122, 548	公益事業
PULTEGROUP INC	23. 62	269	42, 451	一般消費財・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	273. 48	197	31, 190	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC	26. 58	338	53, 310	素材
NORTHERN TRUST CORP	22. 67	185	29, 158	金融
FERGUSON PLC	22. 71	457	72, 076	資本財・サービス
NVIDIA CORP	2, 880. 1	37, 982	5, 983, 423	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	45. 63	689	108, 604	金融
DRAFTKINGS INC CLASS A	49	190	30, 034	一般消費財・サービス
ASPEN TECHNOLOGY CORP	3	59	9, 341	情報技術
TYSON FOODS INC-CL A	35. 33	190	30, 037	生活必需品
NETFLIX INC	49. 53	3, 315	522, 281	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	43. 97	2, 515	396, 235	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	25. 11	197	31, 106	公益事業
TEXTRON INC	21. 88	186	29, 383	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	43. 49	117	18, 552	コミュニケーション・サービス
TEXAS PACIFIC LAND CORP	1. 97	147	23, 275	エネルギー
OMNICOM GROUP	23. 11	204	32, 185	コミュニケーション・サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	14. 45	199	31, 458	資本財・サービス
ORACLE CORP	189. 2	2, 613	411, 691	情報技術
MASTERCARD INC - A	95. 98	4, 267	672, 268	金融
ONEOK INC	67. 25	525	82, 738	エネルギー
ROPER TECHNOLOGIES INC	11. 66	640	100, 922	情報技術
U HAUL NON VOTING SERIES N	11. 37	68	10, 854	資本財・サービス
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	21. 28	282	44, 460	金融
CHESAPEAKE ENERGY CORP	14. 13	120	18, 951	エネルギー
HF SINCLAIR CORP	19	99	15, 632	エネルギー
OVINTIV INC	30	137	21, 649	エネルギー
YUM! BRANDS INC	32. 18	440	69, 343	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	18. 74	297	46, 926	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	21. 76	107	16, 978	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	821. 49	3, 223	507, 802	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5. 04	196	30, 932	情報技術

銘柄	2024年6月17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	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	21.86	182	28,757	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	66.08	1,485	234,028	金融
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	50.47	386	60,813	ヘルスケア
LINDE PLC	55.17	2,410	379,750	素材
ANALOG DEVICES INC	56.8	1,313	206,861	情報技術
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	45	90	14,184	生活必需品
MONDAYCOM LTD	5.11	115	18,239	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	186.27	2,973	468,404	情報技術
COREBRIDGE FINANCIAL INC	28	79	12,504	金融
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	22.69	164	25,889	コミュニケーション・サービス
CONFLUENT INC CLASS A	21	58	9,186	情報技術
KENVUE INC	221.96	401	63,182	生活必需品
GLOBAL E ONLINE LTD	12	38	6,049	一般消費財・サービス
VERALTO CORP	28.32	285	44,947	資本財・サービス
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	77.28	567	89,380	金融
BUNGE GLOBAL LTD	15.84	162	25,658	生活必需品
VERTIV HOLDINGS CLASS A	42	384	60,525	資本財・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	18.29	190	30,071	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	27.83	413	65,103	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	8.7	197	31,046	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	56.82	365	57,518	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	64.7	688	108,506	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	23.41	691	108,933	金融
AMGEN INC	62.04	1,852	291,846	ヘルスケア
SAMSARA INC CLASS A	23	64	10,170	情報技術
EATON CORP PLC	46.36	1,478	232,983	資本財・サービス
COOPER INC	23.92	223	35,220	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	18.51	469	73,917	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	95.98	2,275	358,382	情報技術
CME GROUP INC	41.37	815	128,469	金融
ECOLAB INC	30.24	725	114,352	素材
EQUIFAX INC	13.76	332	52,371	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	142.93	929	146,487	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	125.46	427	67,275	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	34.8	106	16,709	生活必需品
CHORD ENERGY CORP	8	129	20,468	エネルギー
STATE STREET CORP	34.52	244	38,560	金融
SOLVENTUM CORP	16.77	91	14,413	ヘルスケア
GE VERNOVA	32.03	545	85,862	資本財・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	172.96	1,266	199,579	金融
CRH PUBLIC LIMITED PLC	85	650	102,500	素材
LABCORP HOLDINGS	9.71	194	30,573	ヘルスケア
BAXTER INTERNATIONAL INC	60.28	203	32,077	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	23.16	101	16,049	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	13.92	108	17,143	素材
CARDINAL HEALTH INC	27.73	277	43,770	ヘルスケア
FEDEX CORP	27.02	665	104,891	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	44.14	590	92,966	金融
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	28.94	273	43,100	素材
INTEL CORP	491.41	1,496	235,718	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	43.22	127	20,030	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	2024年6月17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	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	34.28	340	53,715	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	34.43	809	127,550	資本財・サービス
ILLUMINA INC	18.93	205	32,402	ヘルスケア
INTUITIVE SURGICAL INC	40.76	1,735	273,390	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	11.39	178	28,078	情報技術
SNAP-ON INC	6.23	163	25,736	資本財・サービス
CARMAX INC	18.49	129	20,362	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP	88.07	901	142,010	公益事業
TARGET CORP	52.69	743	117,166	生活必需品
DOVER CORP	15.84	280	44,228	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	4.66	422	66,566	資本財・サービス
JABIL INC	15	179	28,232	情報技術
CINTAS CORP	10.99	764	120,441	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	56.99	161	25,442	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	17	147	23,234	生活必需品
CLOROX COMPANY	14.27	190	30,055	生活必需品
ENTERGY CORP	24.23	259	40,849	公益事業
MICROSOFT CORP	812.66	35,965	5,665,707	情報技術
INCYTE CORP	23.69	147	23,178	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	144.64	871	137,212	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	152.89	1,239	195,182	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	128.26	1,813	285,615	情報技術
BLACKROCK INC	16.52	1,270	200,210	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	73.72	227	35,826	公益事業
KELLOGG CO	32.42	186	29,376	生活必需品
KEYCORP	112.65	150	23,708	金融
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	156.05	1,027	161,876	生活必需品
CHUBB LTD	46.58	1,208	190,385	金融
ALLSTATE CORP	29.64	465	73,338	金融
EBAY INC	59.02	307	48,467	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	117.1	710	111,851	金融
EASTMAN CHEMICAL CO	13.92	138	21,820	素材
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	27.31	311	49,001	生活必需品
TRIMBLE INC	28.99	158	25,030	情報技術
LENNAR CORP-A	27.58	427	67,385	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	67.96	1,385	218,311	金融
PACCAR INC	60.17	642	101,155	資本財・サービス
BIOGEN INC	17.19	398	62,740	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	9.58	482	76,060	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	129.62	1,032	162,637	一般消費財・サービス
PTC INC	13.84	240	37,826	情報技術
EVERSOURCE ENERGY	40.18	237	37,350	公益事業
INTUIT INC	32.2	1,918	302,166	情報技術
BEST BUY CO INC	23.16	201	31,817	一般消費財・サービス
BALL CORP	36.5	240	37,954	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	167.74	1,287	202,831	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	28.8	391	61,692	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	14.56	367	57,946	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	29.84	1,434	225,976	ヘルスケア
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	63.18	64	10,121	コミュニケーション・サービス
CARNIVAL CORP	118.74	182	28,693	一般消費財・サービス

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千アメリカ・ドル	千円	
CLEVELAND-CLIFFS INC		63.74	95	14,971	素材
COMCAST CORP-CLASS A		456.35	1,708	269,151	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		19	69	10,972	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		131	42	6,644	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	41,874.78	537,077	84,605,829	
	銘柄数<比率>	580銘柄		<69.9%>	
		百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)					
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT		88.13	668	76,716	生活必需品
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING		41.76	218	25,010	金融
IMPERIAL OIL LTD		20.95	184	21,170	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC		2.31	877	100,674	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN		33.04	312	35,866	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		52.69	383	43,932	素材
INTACT FINANCIAL CORP		20.31	451	51,804	金融
BCE INC		6.68	30	3,461	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP		22.56	359	41,266	素材
SUNCOR ENERGY INC		147.87	743	85,236	エネルギー
METRO INC/CN		24.5	181	20,790	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA		37.89	403	46,250	金融
BANK OF NOVA SCOTIA		139.03	885	101,571	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE		106.8	697	79,997	金融
TORONTO-DOMINION BANK		199.37	1,485	170,418	金融
GREAT-WEST LIFECO INC		33.35	130	14,997	金融
MEG ENERGY CORP		31	85	9,851	エネルギー
ROYAL BANK OF CANADA		159.9	2,284	262,008	金融
TOURMALINE OIL CORP		38.56	243	27,918	エネルギー
TC ENERGY CORP		115.54	615	70,563	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		64.94	330	37,925	エネルギー
BARRICK GOLD CORP		196.52	432	49,608	素材
CAE INC		37.52	92	10,658	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP		17.97	412	47,330	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'		18	57	6,628	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD		6.31	69	7,941	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B		18.6	135	15,504	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR		47	113	13,050	資本財・サービス
HYDRO ONE LTD		40.66	160	18,382	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD		18.61	290	33,371	生活必需品
STANTEC INC		14	158	18,187	資本財・サービス
NORTHLAND POWER INC		26.32	62	7,208	公益事業
WSP GLOBAL INC		13.57	280	32,191	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD		9.74	114	13,132	資本財・サービス
PARKLAND CORP		16.21	62	7,196	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B		19.49	56	6,509	コミュニケーション・サービス
EMERA INC		35.24	161	18,514	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC		9.24	174	20,018	資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A		15.93	48	5,565	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B		40.43	209	24,079	コミュニケーション・サービス
BRP INC/CA- SUB VOTING		4.03	34	3,916	一般消費財・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A		74.02	129	14,839	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD		56.83	501	57,532	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		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千カナダ・ドル	千円	
AIR CANADA		17	29	3, 345	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP		147. 57	150	17, 246	素材
BANK OF MONTREAL		83. 35	957	109, 799	金融
POWER CORP OF CANADA		64. 72	248	28, 540	金融
SHOPIFY INC - CLASS A		134. 61	1, 251	143, 484	情報技術
NUTRIEN LTD		57. 74	406	46, 567	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A		15. 32	63	7, 256	公益事業
CAMECO CORP		50. 02	356	40, 897	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP		5. 22	109	12, 535	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT		24. 82	129	14, 836	資本財・サービス
TELUS CORP		6	13	1, 494	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B		53. 74	352	40, 438	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A		6. 23	84	9, 656	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES		244. 18	1, 138	130, 559	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		2. 44	372	42, 719	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC		31. 47	182	20, 923	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD		7	132	15, 199	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP		44. 23	120	13, 853	素材
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE		10	129	14, 817	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC		66. 2	432	49, 609	金融
ENBRIDGE INC		239. 08	1, 153	132, 301	エネルギー
BROOKFIELD CORP		156. 42	879	100, 893	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP		202. 67	699	80, 192	金融
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY		105. 26	1, 111	127, 507	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC		12. 09	102	11, 811	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC		18. 64	96	11, 035	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO		61. 99	1, 037	118, 937	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A		24. 06	329	37, 765	情報技術
ONEX CORPORATION		8. 04	75	8, 696	金融
IGM FINANCIAL INC		13. 18	48	5, 574	金融
TMX GROUP LTD		34. 9	129	14, 865	金融
OPEN TEXT CORP		32. 1	126	14, 545	情報技術
SAPUTO INC		29	85	9, 768	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		77. 81	128	14, 715	素材
FORTIS INC		55. 38	297	34, 101	公益事業
RB GLOBAL INC		19. 96	219	25, 124	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP		84	123	14, 161	素材
CENOVUS ENERGY INC		158. 31	396	45, 500	エネルギー
DOLLARAMA INC		33. 34	412	47, 357	一般消費財・サービス
ALTAGAS LTD		32. 01	97	11, 186	公益事業
KEYERA CORP		29. 7	108	12, 463	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		68. 34	163	18, 771	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額	4, 691. 56	29, 818	3, 419, 863	
	銘柄数<比率>	85 銘柄		<2. 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		291. 2	151	15, 743	一般消費財・サービス
TELSTRA GROUP LTD		521. 64	182	19, 018	コミュニケーション・サービス
ANZ GROUP HOLDINGS LTD		358. 73	1, 031	107, 435	金融
SEVEN GROUP HOLDINGS LTD		21. 96	86	9, 022	資本財・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD		360. 06	132	13, 840	金融

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
BHP GROUP LTD		604.81	2,606	271,480	素材
SOUTH32 LTD		558.15	204	21,280	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD		224.76	612	63,824	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD		206.37	478	49,874	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		370.11	1,296	135,017	金融
WESTPAC BANKING CORP		409.68	1,097	114,329	金融
SANTOS LTD		371.59	277	28,915	エネルギー
RIO TINTO LTD		42.86	515	53,666	素材
ORIGIN ENERGY LTD		222.47	224	23,360	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD		196.19	71	7,459	資本財・サービス
PILBARA MINERALS LTD		374.17	121	12,628	素材
XERO LTD		18.61	243	25,384	情報技術
PRO MEDICUS LTD		7.09	92	9,687	ヘルスケア
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		27.48	89	9,271	金融
COLES GROUP LTD		163.86	278	29,000	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD		19.8	190	19,831	情報技術
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		141.64	190	19,815	素材
REECE LTD		23.22	60	6,250	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI		187.89	94	9,884	生活必需品
SEEK LTD		48.13	110	11,561	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		106.17	128	13,338	生活必需品
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		199.58	2,500	260,522	金融
AMPOL LTD		25.96	85	8,951	エネルギー
ORICA LTD		59.78	107	11,209	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		182.05	333	34,723	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD		150.84	491	51,208	生活必需品
QANTAS AIRWAYS LTD		111.39	68	7,089	資本財・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		53.64	259	26,988	素材
MACQUARIE GROUP LTD		43.41	828	86,253	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD		71.53	333	34,782	一般消費財・サービス
CSL LTD		57.62	1,665	173,525	ヘルスケア
WESFARMERS LTD		135.44	912	95,093	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD		8.2	265	27,634	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD		50.24	103	10,749	素材
SUNCORP GROUP LTD		145.89	239	24,908	金融
ASX LTD		22.6	127	13,289	金融
COMPUTERSHARE LTD		70.33	186	19,392	資本財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		283.61	186	19,469	金融
SONIC HEALTHCARE LTD		59.15	149	15,613	ヘルスケア
BRAMBLES LTD		178.12	258	26,941	資本財・サービス
CARSALES.COM LTD		47.61	166	17,393	コミュニケーション・サービス
MINERAL RESOURCES LTD		22.98	143	14,930	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD		20.64	99	10,382	ヘルスケア
REA GROUP LTD		6.08	116	12,165	コミュニケーション・サービス
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額	7,885.33	20,199	2,104,139	
	銘柄数<比率>	49銘柄		<1.7%>	
		百株	千香港・ドル	千円	
(香港)					
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		175	745	15,029	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		270	1,054	21,255	一般消費財・サービス
MTR CORP		190	473	9,537	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		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千香港・ドル	千円	
SUN HUNG KAI PROPERTIES		175	1,253	25,260	不動産
SINO LAND CO		540	443	8,948	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		325.52	1,199	24,182	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD		140	324	6,533	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		50	350	7,066	不動産
CLP HOLDINGS LTD		210	1,373	27,687	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		185.65	398	8,028	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		1,380.27	818	16,500	公益事業
HANG SENG BANK LTD		94	1,007	20,314	金融
WH GROUP LTD		1,120	579	11,673	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		147	3,786	76,340	金融
SWIRE PROPERTIES LTD		100	131	2,657	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD		235.52	692	13,959	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		85	371	7,479	公益事業
AIA GROUP LTD		1,384	7,681	154,852	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS		170	351	7,094	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		200	431	8,688	不動産
SANDS CHINA LTD		322	573	11,554	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		170	1,625	32,764	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		455	1,110	22,381	金融
香港・ドル通貨計	株数、金額	8,123.96	26,775	539,792	
	銘柄数<比率>	23銘柄		<0.4%>	
		百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)					
CAPITALAND INVESTMENT LTD		304	79	9,312	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD		154	470	54,831	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD		246.1	873	101,697	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD		200.5	134	15,716	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD		173	112	13,157	資本財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		418	591	68,839	金融
GENTING SINGAPORE LTD		812	70	8,227	一般消費財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		1,006	256	29,878	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING		210	83	9,734	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		114	57	6,691	公益事業
SINGAPORE EXCHANGE LTD		118	112	13,097	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD		278	85	9,940	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額	4,033.6	2,928	341,124	
	銘柄数<比率>	12銘柄		<0.3%>	
		百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
(ニュージーランド)					
MERIDIAN ENERGY LTD		150	95	9,235	公益事業
MERCURY NZ LTD		88.96	59	5,752	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD		236.35	95	9,229	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		178.24	133	12,878	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		72.38	222	21,527	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額	725.93	606	58,624	
	銘柄数<比率>	5銘柄		<0.0%>	
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)					
SHELL PLC		758.45	2,056	410,964	エネルギー
HALEON PLC		814.64	264	52,803	生活必需品

銘柄	2024年6月17日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
WISE PLC CLASS A	78.05	55	11,130	金融
BP PLC	2,009.85	924	184,786	エネルギー
UNILEVER PLC	296.96	1,321	264,122	生活必需品
BARCLAYS PLC	1,778.43	359	71,801	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	987.73	452	90,377	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	322.68	225	45,145	金融
NATWEST GROUP PLC	778.4	239	47,793	金融
BAE SYSTEMS PLC	363.38	485	96,959	資本財・サービス
AVIVA PLC	335.61	159	31,929	金融
GSK	491.4	788	157,587	ヘルスケア
INFORMA PLC	164.45	138	27,688	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	155.96	93	18,721	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	105.87	86	17,330	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	12.76	70	14,154	資本財・サービス
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	20.77	287	57,433	一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	9.48	80	16,077	資本財・サービス
HALMA PLC	48.86	129	25,830	情報技術
ENTAIN PLC	82.73	54	10,847	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	333.88	40	8,057	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	98.71	47	9,481	金融
M&G PLC	259.64	52	10,404	金融
ENDEAVOUR MINING PLC	23.57	37	7,584	素材
RELX PLC	221.37	787	157,424	資本財・サービス
DIAGEO PLC	262.48	676	135,299	生活必需品
RIO TINTO PLC	132.23	690	137,931	素材
STANDARD CHARTERED PLC	260.87	188	37,759	金融
TESCO PLC	828.01	256	51,336	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	112.75	112	22,526	ヘルスケア
GLENCORE PLC	1,217.69	553	110,628	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	46.76	49	9,822	金融
SMITHS GROUP PLC	40.8	68	13,708	資本財・サービス
PEARSON PLC	71.94	68	13,645	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	176.31	45	9,119	生活必需品
NEXT PLC	14.5	130	26,106	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	456.76	67	13,538	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	24.65	71	14,346	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	40.88	119	23,874	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	2,819.97	194	38,867	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	17.04	70	14,055	素材
KINGFISHER PLC	247.03	61	12,274	一般消費財・サービス
WPP PLC	130.21	95	19,138	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	85	17,078	公益事業
SEVERN TRENT PLC	34.76	85	17,188	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	301.92	134	26,980	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	83.77	368	73,552	生活必需品
SCHRODERS PLC	105.96	39	7,852	金融
SSE PLC	128.19	226	45,272	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	60	12,085	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	183.74	2,298	459,418	ヘルスケア
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	731.48	164	32,851	金融
3I GROUP PLC	114.23	347	69,406	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		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
ASHTEAD GROUP PLC		51.35	278	55,647	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE		122.1	128	25,782	情報技術
NATIONAL GRID PLC		574.37	506	101,253	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC		7,460.03	404	80,784	金融
IMPERIAL BRANDS PLC		100.15	200	40,023	生活必需品
CENTRICA PLC		632	83	16,673	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC		13.89	69	13,964	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		236.33	565	112,986	生活必需品
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		39.95	99	19,826	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC		2,249.42	1,522	304,283	金融
ANGLO AMERICAN PLC		149.12	356	71,188	素材
MONDI PLC		57.78	84	16,895	素材
COMPASS GROUP PLC		204.77	453	90,736	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC		39.69	56	11,264	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC		755.78	105	21,080	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI		25.74	69	13,849	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC		45.08	44	8,831	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		19.38	158	31,685	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC		18.91	89	17,930	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		54.11	510	102,028	金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		20.39	39	7,979	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC		33.72	86	17,192	金融
ANTOFAGASTA PLC		46.21	94	18,850	素材
EXPERIAN PLC		107.83	399	79,893	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額	32,402.78	22,978	4,592,739	
	銘柄数<比率>	77銘柄		<3.8%>	
		百株	千イスラエル・シュケル	千円	
(イスラエル)					
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		143.35	268	11,358	金融
AZRIELI GROUP LTD		5.3	118	5,032	不動産
ICL GROUP LTD		82.94	136	5,792	素材
ELBIT SYSTEMS LTD		3	202	8,573	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM		154.82	511	21,643	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL		185.58	565	23,963	金融
NICE LTD		7.72	479	20,326	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		18.83	245	10,414	金融
イスラエル・シュケル通貨計	株数、金額	601.54	2,529	107,105	
	銘柄数<比率>	8銘柄		<0.1%>	
		百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)					
SANDOZ GROUP AG		49.77	158	28,067	ヘルスケア
AVOLTA AG		12.51	45	7,990	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG		376.77	1,014	179,362	金融
ROCHE HOLDING AG-BR		4	109	19,353	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		0.89	65	11,528	素材
ADECCO GROUP AG-REG		20.49	63	11,268	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		80.48	1,992	352,386	ヘルスケア
SIKA AG-REG		17.44	446	78,921	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.01	109	19,346	生活必需品
ABB LTD-REG		183.25	914	161,673	資本財・サービス
SWISS RE AG		34.51	375	66,458	金融

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千スイス・フラン	千円	
NESTLE SA-REG		307.23	2,927	517,661	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG		2.6	300	53,082	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		4.75	111	19,773	資本財・サービス
JULIUS BAER GROUP LTD		24.01	121	21,484	金融
SGS SA-REG		17.12	140	24,764	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		2.88	66	11,739	資本財・サービス
TEMENOS AG - REG		7.93	47	8,400	情報技術
HELVETIA HOLDING AG-REG		4.71	55	9,820	金融
VAT GROUP AG		3.08	153	27,097	資本財・サービス
BKW AG		2.5	35	6,220	公益事業
ALCON INC		57.17	459	81,324	ヘルスケア
SIG GROUP N AG		34	54	9,656	素材
SWATCH GROUP AG/THE-BR		3.77	69	12,350	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		16.77	790	139,798	金融
BALOISE HOLDING AG - REG		5.5	85	15,104	金融
CLARIANT AG-REG		25.52	34	6,092	素材
NOVARTIS AG-REG		226.42	2,151	380,421	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.41	63	11,259	生活必需品
BACHEM HOLDING AG-REG B		3.9	30	5,465	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG		61.58	885	156,649	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG		3.02	149	26,489	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		3.57	33	5,972	金融
GEBERIT AG-REG		3.9	211	37,394	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG		1.08	463	82,048	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG		13.03	144	25,484	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG		6.13	169	30,016	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		17.85	157	27,897	情報技術
LONZA GROUP AG-REG		8.52	409	72,365	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG		4.5	16	2,912	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD		59.64	477	84,416	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		3.53	223	39,464	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		5.51	141	24,993	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG		9.46	78	13,952	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.12	129	22,812	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額	1,731.83	16,685	2,950,745	
	銘柄数<比率>	45銘柄		<2.4%>	
		百株	千デンマーク・クローネ	千円	
(デンマーク)					
NOVO NORDISK A/S-B		402.69	39,906	901,888	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S		84.06	1,701	38,451	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A		0.39	433	9,801	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		123.07	2,240	50,635	資本財・サービス
CARLSBERG AS-B		12	1,125	25,443	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES		46.07	1,876	42,417	素材
COLOPLAST-B		15.37	1,308	29,581	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S		20.51	2,218	50,130	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS		0.98	269	6,090	資本財・サービス
DEMANT A/S		13.52	441	9,973	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		0.58	661	14,943	資本財・サービス
TRYG A/S		40.74	582	13,175	金融
PANDORA A/S		10.3	1,084	24,500	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		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千デンマーク・クローネ	千円	
GENMAB A/S		8.05	1,475	33,338	ヘルスケア
ORSTED A/S		22.75	877	19,835	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額	801.08	56,203	1,270,206	
	銘柄数<比率>	15銘柄		<1.1%>	
		百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
(ノルウェー)					
DNB BANK		104.69	2,153	31,806	金融
NORSK HYDRO ASA		178.07	1,154	17,053	素材
ORKLA ASA		94.08	848	12,533	生活必需品
TELENOR ASA		75.73	930	13,746	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA		109.79	3,180	46,977	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		21.12	629	9,302	素材
MOWI ASA		62.46	1,183	17,477	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		20	378	5,583	金融
AKER BP ASA		42.41	1,081	15,979	エネルギー
KONGSBERG GRUPPEN ASA		12.03	1,048	15,485	資本財・サービス
SALMAR ASA		7.28	440	6,505	生活必需品
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額	727.66	13,029	192,450	
	銘柄数<比率>	11銘柄		<0.2%>	
		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)					
SAGAX CLASS B		25.26	672	10,073	不動産
VOLVO CAR CLASS B		71.77	231	3,459	一般消費財・サービス
ERICSSON LM-B SHS		331.89	2,050	30,694	情報技術
VOLVO AB-B SHS		196.01	5,166	77,347	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES		40	828	12,401	資本財・サービス
TELE2 AB-B SHS		70.26	733	10,980	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS		28.69	524	7,851	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		195.81	2,991	44,789	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		177.75	1,781	26,675	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		108.21	2,322	34,763	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		70.84	1,336	20,000	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B		73.2	1,134	16,990	素材
SKANSKA AB-B SHS		45.66	856	12,819	資本財・サービス
SANDVIK AB		129.93	2,802	41,954	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS		213.58	6,060	90,723	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		331.45	6,635	99,335	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS		26.88	722	10,816	資本財・サービス
HOLMEN AB-B SHARES		11.14	474	7,100	素材
SECURITAS AB-B SHS		66.01	686	10,276	資本財・サービス
TELIA CO AB		290.88	778	11,652	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB		35.7	1,658	24,829	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS		190.21	3,289	49,246	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		124.52	3,765	56,369	資本財・サービス
TRELLEBORG AB-B SHS		26.57	1,072	16,053	資本財・サービス
SAAB AB-B		43	1,036	15,513	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		17.1	607	9,087	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		87.5	599	8,977	不動産
INDUTRADE AB		36	979	14,669	資本財・サービス
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB		26.16	706	10,573	ヘルスケア
LUNDBERGS AB-B SHS		9.48	489	7,329	金融

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		20.48	606	9,074	資本財・サービス
LIFCO AB-B SHS		29.24	828	12,405	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		184.68	872	13,065	資本財・サービス
BEIJER REF AB		51.66	850	12,725	資本財・サービス
ESSITY AKTIEBOLAG-B		77.92	2,170	32,497	生活必需品
BOLIDEN AB		31.71	1,076	16,111	素材
EPIROC AB-A		80.31	1,700	25,463	資本財・サービス
EPIROC AB-B		52.34	1,007	15,082	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		54	477	7,146	資本財・サービス
EQT AB		45.51	1,422	21,290	金融
EVOLUTION AB		22.33	2,358	35,299	一般消費財・サービス
HEXAGON AB-B SHS		253.01	2,947	44,125	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		20.2	714	10,695	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額	4,024.85	70,029	1,048,341	
	銘柄数<比率>	43銘柄		<0.9%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（アイルランド）					
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		29.55	124	20,999	素材
AIB GROUP PLC		201.72	96	16,281	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC		126.91	123	20,802	金融
KINGSPAN GROUP PLC		17.69	143	24,179	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		19.37	145	24,597	生活必需品
国小計	株数、金額	395.24	633	106,859	
	銘柄数<比率>	5銘柄		<0.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オランダ）					
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV		97.09	277	46,876	コミュニケーション・サービス
EXOR NV		11.62	112	18,978	金融
FERROVIAL		60.05	219	37,084	資本財・サービス
QIAGEN N. V.		26.72	106	17,889	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		94.88	228	38,577	ヘルスケア
NN GROUP NV		33.55	138	23,389	金融
HEINEKEN NV		34.03	322	54,426	生活必需品
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		112.78	316	53,405	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.		19.73	114	19,331	素材
WOLTERS KLUWER		28.32	432	72,927	資本財・サービス
ING GROEP NV		378.67	580	97,908	金融
KONINKLIJKE KPN NV		459.31	160	27,079	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		46.07	4,390	740,409	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA		55.93	85	14,379	金融
IMCD NV		7.15	97	16,464	資本財・サービス
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES		8.91	136	23,079	情報技術
ASR NEDERLAND NV		20.47	89	15,033	金融
ADYEN NV		2.48	297	50,086	金融
PROSUS NV		166.68	565	95,331	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV		14.76	28	4,871	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV		5.35	361	60,972	情報技術
RANDSTAD NV		12.26	55	9,390	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		15.33	117	19,790	生活必需品
OCI NV		11.97	27	4,689	素材
EURONEXT NV		9.18	81	13,824	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		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
STMICROELECTRONICS NV		77.87	306	51,746	情報技術
AIRBUS SE		68.76	988	166,769	資本財・サービス
ARGENX SE		6.99	252	42,542	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		78.62	75	12,754	生活必需品
STELLANTIS NV		257.21	484	81,633	一般消費財・サービス
FERRARI NV		14.36	545	91,950	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額	2,237.1	11,999	2,023,596	
	銘柄数<比率>	31銘柄		<1.7%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ベルギー）					
LOTUS BAKERIES NV		0.05	49	8,423	生活必需品
SYENSQO SA		9.02	79	13,436	素材
UCB SA		14.38	198	33,429	ヘルスケア
KBC GROUP NV		30.11	193	32,578	金融
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		10.67	71	12,010	金融
UMICORE		22.7	30	5,217	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		104.2	577	97,455	生活必需品
AGEAS		18.87	79	13,429	金融
D'IETEREN GROUP		2.96	56	9,484	一般消費財・サービス
ELIA GROUP SA/NV		3.58	32	5,451	公益事業
SOFINA		1.46	31	5,303	金融
国小計	株数、金額	218	1,400	236,220	
	銘柄数<比率>	11銘柄		<0.2%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ルクセンブルグ）					
ARCELORMITTAL		53.61	116	19,727	素材
INPOST SA		24.68	41	6,933	資本財・サービス
EUROFINS SCIENTIFIC		15.8	82	13,887	ヘルスケア
TENARIS SA		57.05	81	13,772	エネルギー
国小計	株数、金額	151.14	322	54,320	
	銘柄数<比率>	4銘柄		<0.0%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フランス）					
TOTALENERGIES SE		247.59	1,520	256,450	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		80.35	296	50,000	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		66.78	1,063	179,377	素材
KERING		8.82	266	44,993	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		62.96	1,392	234,860	資本財・サービス
BOUYGUES SA		22.38	68	11,624	資本財・サービス
BNP PARIBAS		117.8	688	116,036	金融
THALES SA		10.76	161	27,272	資本財・サービス
DANONE		73.37	431	72,753	生活必需品
CARREFOUR SA		69.92	100	16,985	生活必需品
VIVENDI		75.75	71	12,135	コミュニケーション・サービス
L'OREAL		27.84	1,226	206,788	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		51.94	375	63,328	資本財・サービス
LEGRAND SA		31.28	292	49,300	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA		23.3	307	51,827	生活必需品
EURAZEO SE		4	28	4,853	金融
REXEL SA		25.79	63	10,699	資本財・サービス

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
SOCIETE GENERALE SA		83.68	185	31,257	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		31.9	2,269	382,705	一般消費財・サービス
ACCOR SA		22.57	83	14,094	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		17.7	322	54,415	情報技術
PUBLICIS GROUPE		27.06	264	44,611	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA		37.25	99	16,747	資本財・サービス
EIFFAGE		9.45	80	13,539	資本財・サービス
SODEXO SA		10.85	91	15,369	一般消費財・サービス
IPSEN		4.6	55	9,347	ヘルスケア
AMUNDI SA		7.51	45	7,630	金融
TELEPERFORMANCE		6.15	57	9,676	資本財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		3.69	65	11,123	ヘルスケア
SEB SA		2.16	22	3,744	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA		33.65	676	114,062	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA		2.2	38	6,462	資本財・サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		12.87	39	6,728	一般消費財・サービス
AXA SA		207.17	609	102,820	金融
EDENRED		30.07	121	20,557	金融
RENAULT SA		23.73	114	19,264	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL		3.61	762	128,576	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU		2.53	20	3,417	生活必需品
DASSAULT SYSTEMES SE		79.17	282	47,677	情報技術
ORANGE		215.7	200	33,800	コミュニケーション・サービス
ALSTOM		36.68	56	9,590	資本財・サービス
SANOFI		131.7	1,138	191,960	ヘルスケア
VINCI SA		57.05	559	94,419	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		81.56	227	38,401	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		121.41	158	26,688	金融
BIOMERIEUX		4.57	41	6,997	ヘルスケア
ENGIE		208.11	276	46,571	公益事業
SAFRAN SA		39.54	777	131,126	資本財・サービス
ARKEMA		6.5	54	9,174	素材
ADP		3.5	39	6,657	資本財・サービス
GETLINK SE		41.14	63	10,777	資本財・サービス
BOLLORE		85.29	48	8,256	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額	2,692.95	18,308	3,087,546	
	銘柄数<比率>	52銘柄		<2.6%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ドイツ）					
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		63.34	231	38,956	資本財・サービス
DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)		13.2	93	15,720	一般消費財・サービス
BAYER AG-REG		111.94	302	51,092	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		24.31	44	7,477	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		220.84	318	53,681	金融
COMMERZBANK AG		119.8	164	27,809	金融
VOLKSWAGEN AG		3.41	38	6,463	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		24.41	255	43,017	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG		87.93	1,457	245,767	資本財・サービス
E. ON SE		265.12	329	55,574	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		36.33	315	53,240	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		19.08	71	12,117	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		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
CONTINENTAL AG		12.72	69	11,798	一般消費財・サービス
BASF SE		101.7	453	76,466	素材
ALLIANZ SE-REG		45.32	1,148	193,667	金融
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		19.59	162	27,440	生活必需品
RHEINMETALL AG		5.15	246	41,618	資本財・サービス
RWE AG		74.83	248	41,845	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		66.13	38	6,575	資本財・サービス
BRENNTAG SE		15.41	100	16,891	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		51.74	152	25,792	ヘルスケア
SAP SE		120.81	2,111	356,086	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		15.84	723	122,023	金融
ZALANDO SE		25.14	55	9,390	一般消費財・サービス
HEIDELBERG MATERIALS AG		15.08	143	24,225	素材
COVESTRO AG		23.08	115	19,554	素材
RATIONAL AG		0.58	45	7,751	資本財・サービス
CTS EVENTIM AG & CO KGAA		7.7	61	10,297	コミュニケーション・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG		3.11	76	12,886	ヘルスケア
TALANX AG		8.04	57	9,707	金融
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		17.4	73	12,459	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE		20.56	57	9,652	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		5.6	47	7,965	ヘルスケア
BECHTLE AG		8.19	36	6,140	情報技術
NEMETSCHEK SE		6.59	59	10,079	情報技術
SCOUT24 AG		8.77	61	10,411	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		32.06	171	29,000	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG		9.26	65	10,993	資本財・サービス
SIEMENS ENERGY AG		69.69	161	27,312	資本財・サービス
BEIERSDORF AG		11.67	170	28,821	生活必需品
MERCK KGAA		14.97	257	43,422	ヘルスケア
ADIDAS AG		18.46	415	70,013	一般消費財・サービス
PUMA SE		12.95	58	9,840	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		13.11	96	16,283	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		369.72	836	141,097	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		23.41	90	15,250	ヘルスケア
MERCEDES-BENZ GROUP N AG		93.15	588	99,279	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		148.81	543	91,597	情報技術
HANNOVER RUECK SE		6.86	155	26,214	金融
DHL GROUP		112.94	426	71,899	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		21.65	394	66,540	金融
MTU AERO ENGINES AG		6.12	137	23,159	資本財・サービス
SYMRISE AG		15.1	169	28,622	素材
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		7.33	59	10,062	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		84.94	229	38,646	不動産
LEG IMMOBILIEN SE		8.69	67	11,313	不動産
国小計	株数、金額	2,749.68	15,067	2,541,021	
	銘柄数<比率>	56銘柄		<2.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ポルトガル）					
JERONIMO MARTINS		35.91	70	11,881	生活必需品

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		369.39	135	22,868	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		52.62	98	16,616	エネルギー
国小計	株数、金額	457.92	304	51,365	
	銘柄数<比率>	3銘柄		<0.0%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（スペイン）					
TELEFONICA SA		529.44	217	36,696	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA		37.6	70	11,806	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		665.93	600	101,296	金融
IBERDROLA SA		666.06	807	136,193	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		671.3	116	19,720	金融
REPSOL SA		140.51	200	33,896	エネルギー
GRIFOLS SA		27.95	25	4,330	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		1,846.11	808	136,314	金融
AMADEUS IT GROUP SA		51.33	329	55,573	一般消費財・サービス
CAIXABANK SA		426.7	208	35,079	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		26.19	102	17,322	資本財・サービス
AENA SME SA		8.68	160	27,021	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA		57.5	186	31,407	コミュニケーション・サービス
ACCIONA SA		2.91	33	5,672	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		126.63	581	98,147	一般消費財・サービス
RED ELECTRICA CORPORACION SA		49.66	84	14,287	公益事業
EDP RENOVAVEIS SA		30.29	41	7,028	公益事業
国小計	株数、金額	5,364.79	4,576	771,796	
	銘柄数<比率>	17銘柄		<0.6%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（イタリア）					
AMPLIFON		14.4	0	7	ヘルスケア
PRYSMIAN SPA		30.4	172	29,037	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		119.63	270	45,573	金融
MEDIOBANCA SPA		57.35	77	13,080	金融
UNICREDIT SPA		174.69	568	95,847	金融
TELECOM ITALIA SPA		1,085.03	24	4,095	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO		1,666.57	554	93,589	金融
POSTE ITALIANE SPA		53.56	65	10,996	金融
MONCLER SPA		24.35	142	24,079	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		12.85	61	10,423	ヘルスケア
ENI SPA		250.04	337	56,958	エネルギー
BANCO BPM SPA		139.87	82	13,869	金融
DIASORIN SPA		2.77	27	4,576	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		33.08	32	5,455	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA		65.11	36	6,212	金融
AMPLIFON SPA		14.4	49	8,412	ヘルスケア
LEONARDO SPA		47.67	100	17,026	資本財・サービス
ENEL SPA		926.78	587	99,042	公益事業
SNAM SPA		243	104	17,555	公益事業
TERNA SPA		172.34	129	21,774	公益事業
FINECOBANK SPA		70.48	98	16,622	金融
国小計	株数、金額	5,204.37	3,523	594,238	
	銘柄数<比率>	21銘柄		<0.5%>	

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		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フィンランド）					
UPM-KYMMENE OYJ		61.83	202	34,085	素材
NOKIA OYJ		606.84	205	34,661	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		57.59	109	18,418	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		68.4	84	14,286	素材
ELISA OYJ		17.49	74	12,570	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		52.29	205	34,646	金融
FORTUM OYJ		57.03	80	13,656	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		34.7	57	9,623	生活必需品
KONE OYJ-B		39.36	185	31,356	資本財・サービス
NESTE OYJ		48.91	87	14,673	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		13.15	49	8,333	ヘルスケア
METSO CORPORATION		71.04	73	12,459	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP		361.83	408	68,951	金融
国小計	株数、金額	1,490.46	1,824	307,724	
	銘柄数＜比率＞	13銘柄		＜0.3%＞	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オーストリア）					
VERBUND AG		8.76	64	10,865	公益事業
OMV AG		17.27	67	11,375	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		39.08	164	27,693	金融
VOESTALPINE AG		13.23	32	5,492	素材
国小計	株数、金額	78.34	328	55,427	
	銘柄数＜比率＞	4銘柄		＜0.0%＞	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（その他）					
DSM FIRMENICH AG		21.54	213	36,048	素材
AEGON LTD		156.06	88	14,943	金融
国小計	株数、金額	177.6	302	50,992	
	銘柄数＜比率＞	2銘柄		＜0.0%＞	
ユーロ通貨計	株数、金額	21,217.59	58,592	9,881,111	
	銘柄数＜比率＞	219銘柄		＜8.2%＞	
ファンド合計	株数、金額	128,842.49	—	111,112,073	
	銘柄数＜比率＞	1,172銘柄		＜91.9%＞	

（注1）邦貨換算金額は、2024年6月17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) 外国新株予約権証券

銘柄	2024年6月17日現在 証券数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額
	証券	千カナダ・ドル	千円
（カナダ）			
CONSTELLATION SOFTWARE IN-28	261	—	—

(3)外国投資証券

銘柄		2024年6月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
AVALONBAY COMMUNITIES INC		1.56	314	49,613
SIMON PROPERTY GROUP INC		3.792	564	88,904
BOSTON PROPERTIES INC		1.658	102	16,099
SBA COMMUNICATIONS CORP		1.265	247	39,050
EQUITY RESIDENTIAL		3.926	261	41,257
EQUINIX INC		1.086	832	131,089
AMERICAN TOWER CORP		5.357	1,055	166,271
HOST HOTELS & RESORTS INC		8.687	154	24,386
AMERICAN HOMES 4 RENT- A		3.867	137	21,588
KIMCO REALTY CORP		7.871	147	23,248
GAMING AND LEISURE PROPERTIE		3.1	134	21,198
INVITATION HOMES INC		7.188	255	40,197
VICI PROPERTIES INC		11.788	333	52,533
VENTAS INC		4.594	230	36,257
WEYERHAEUSER CO		8.411	243	38,424
CROWN CASTLE INTL CORP		5.083	503	79,351
IRON MOUNTAIN INC		3.272	288	45,368
SUN COMMUNITIES INC		1.387	161	25,485
PROLOGIS INC		10.636	1,194	188,140
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		1.837	213	33,660
CAMDEN PROPERTY TRUST		1.345	145	22,891
ESSEX PROPERTY TRUST INC		0.708	197	31,061
WELLTOWER INC		6.455	671	105,793
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		8.252	162	25,543
MID-AMERICA APARTMENT COMM		1.326	184	29,101
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		2.166	135	21,400
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		6.113	123	19,471
REALTY INCOME CORP		9.986	532	83,956
PUBLIC STORAGE		1.801	510	80,361
REGENCY CENTERS CORP		1.961	121	19,081
UDR INC		3.58	144	22,716
WP CAREY INC		2.562	143	22,637
DIGITAL REALTY TRUST INC		3.623	543	85,564
EXTRA SPACE STORAGE INC		2.389	374	58,923
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額	148.632	11,366	1,790,633
	銘柄数<比率>	34銘柄		<1.5%>
		千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)				
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		0.831	36	4,163
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		1.925	32	3,686
カナダ・ドル通貨計	口数、金額	2.756	68	7,850
	銘柄数<比率>	2銘柄		<0.0%>
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)				
DEXUS/AU		12.537	81	8,475
TRANSURBAN GROUP		35.685	446	46,466

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		2024年6月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
APA GROUP		16.458	137	14,315
SCENTRE GROUP		64.017	199	20,806
GPT GROUP		21.774	88	9,231
MIRVAC GROUP		43.513	82	8,544
STOCKLAND		30.751	136	14,222
GOODMAN GROUP		20.135	720	75,026
VICINITY CENTRES		50.371	93	9,759
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額	295.241	1,985	206,848
	銘柄数<比率>	9銘柄		<0.2%>
		千口	千香港・ドル	千円
(香港)				
LINK REIT		33	1,075	21,688
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		51	445	8,975
香港・ドル通貨計	口数、金額	84	1,521	30,663
	銘柄数<比率>	2銘柄		<0.0%>
		千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)				
CAPITALAND ASCENDAS REIT		47.5	122	14,218
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		71.526	138	16,161
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	119.026	260	30,379
	銘柄数<比率>	2銘柄		<0.0%>
		千口	千イギリス・ポンド	千円
(イギリス)				
LAND SECURITIES GROUP PLC		7.946	49	9,878
SEGRO PLC		15.12	137	27,470
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	23.066	186	37,348
	銘柄数<比率>	2銘柄		<0.0%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ(ベルギー)				
WAREHOUSES DE PAUW SCA		1.846	46	7,876
国小計	口数、金額	1.846	46	7,876
	銘柄数<比率>	1銘柄		<0.0%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ(フランス)				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		1.341	97	16,395
GECINA SA		0.578	52	8,923
KLEPIERRE		2.394	61	10,311
COVIVIO		0.652	29	4,923
国小計	口数、金額	4.965	240	40,554
	銘柄数<比率>	4銘柄		<0.0%>
ユーロ通貨計	口数、金額	6.811	287	48,430
	銘柄数<比率>	5銘柄		<0.0%>
合計	口数、金額	679.532	—	2,152,155
	銘柄数<比率>	56銘柄		<1.8%>

(注1) 邦貨換算金額は、2024年6月17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。

(4) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別		2024年6月17日現在	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
外国	S&P500 EMINI FUT（アメリカ）	6,467	—
	S&P/TSX 60 IX FUT（カナダ）	296	—
	SPI 200 FUTURES（オーストラリア）	80	—
	FTSE 100 IDX FUT（イギリス）	179	—
	SWISS MKT IX FUTR（ドイツ）	213	—
	EURO STOXX 50（ドイツ）	685	—

（注1）外貨建の評価額は、2024年6月17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16期（決算日　2024年１月10日）

（作成対象期間　2023年１月11日～2024年１月10日）

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

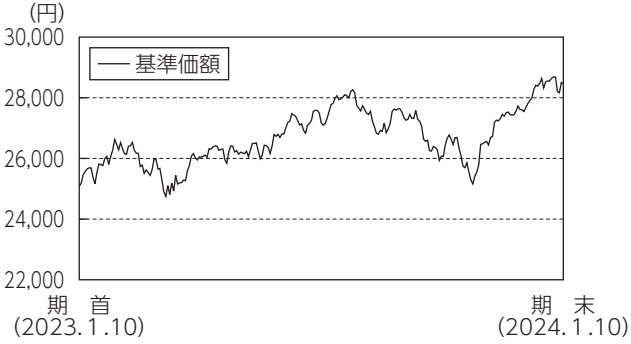
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。）
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（税引後配当込み、円ヘッジ・ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資証券組入比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
	円	%		%	%	%	%
(期首)2023年1月10日	25,080	－	24,521	－	91.2	6.9	2.2
1月末	25,804	2.9	25,223	2.9	89.6	7.8	2.3
2月末	25,621	2.2	25,039	2.1	95.1	7.3	2.3
3月末	25,774	2.8	25,180	2.7	93.3	3.5	2.2
4月末	26,222	4.6	25,590	4.4	92.9	6.4	2.1
5月末	26,367	5.1	25,726	4.9	92.8	7.7	2.0
6月末	27,251	8.7	26,574	8.4	96.6	5.8	2.1
7月末	28,208	12.5	27,506	12.2	89.1	7.2	1.9
8月末	27,626	10.2	26,921	9.8	93.9	7.2	2.0
9月末	26,393	5.2	25,712	4.9	93.4	7.4	1.9
10月末	25,404	1.3	24,741	0.9	93.1	5.6	1.9
11月末	27,446	9.4	26,718	9.0	92.8	3.8	2.0
12月末	28,683	14.4	27,900	13.8	90.9	4.1	2.0
(期末)2024年1月10日	28,459	13.5	27,703	13.0	92.9	7.5	2.0

（注１）騰落率は期首比。
（注２）ＭＳＣＩコクサイ指数（税引後配当込み、円ヘッジ・ベース）は、ＭＳＣＩ Inc.（「ＭＳＣＩ」）の承諾を得て、同指数をもとに、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（税引後配当込み、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）株式先物比率は買建比率－売建比率です。
※ベンチマークを「ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）」から「ＭＳＣＩコクサイ指数（税引後配当込み、円ヘッジ・ベース）」に変更しました。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：25,080円　期末：28,459円　騰落率：13.5％

【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、米国の利上げ打ち止め観測などを背景に海外株式市況が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○海外株式市況

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、ＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）が今後利上げ幅を縮小させるのではないかとの期待を背景に上昇しました。2023年２月には、米国の利上げ長期化への懸念から軟調な展開となり、３月には、米国の地方銀行の経営破綻やスイスの金融大手の株価急落により信用不安が高まり、続落しました。経営破綻した米国の地方銀行の預金保護やＦＲＢによる金融機関への流動性供給、スイスの金融大手の救済合併の決定などにより信用不安が後退したことから、３月下旬には上昇に転じました。その後レンジでの推移をはさみ、６月以降は、米国の債務上限問題の解決や、米国のインフレ警戒感の後退、中国の経済対策への期待から、欧米株ともに上昇しました。８月以降は、米国で堅調な経済指標が追加利上げ観測からの米国金利上昇を招いたことや、欧州で弱い経済指標が欧州経済への先行き懸念を強めたことから、株価は下落しました。11月に入ると、米国の利上げ打ち止め観測などを背景に米国金利の下落傾向が続き、当作成期末にかけて株価は上昇しました。

◆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

当作成期のベンチマークの騰落率は13.0％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は13.5％となりました。

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（税引後配当込み、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。

■１万口当りの費用の明細

項　　目	当　期
売買委託手数料	2円
（株式）	(1)
（先物・オプション）	(1)
（投資証券）	(0)
有価証券取引税	2
（株式）	(2)
（投資証券）	(0)
その他費用	5
（保管費用）	(5)
（その他）	(0)
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

（2023年１月11日から2024年１月10日まで）

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
外国	アメリカ	百株 9,227.49 (53.34)	千アメリカ・ドル 90,679 (△ 1,797)	百株 5,371.44	千アメリカ・ドル 53,249
	カナダ	百株 830.7 (△ 32.44)	千カナダ・ドル 4,968 (△ 280)	百株 498.79	千カナダ・ドル 3,364
	オーストラリア	百株 1,567.14 (9.11)	千オーストラリア・ドル 3,888 (－)	百株 669.44	千オーストラリア・ドル 2,014
	香港	百株 1,844 (－)	千香港ドル 6,913 (－)	百株 1,240	千香港ドル 4,832
	シンガポール	百株 7,044 (3,301.71)	千シンガポール・ドル 741 (△ 4)	百株 252	千シンガポール・ドル 295
	ニュージーランド	百株 141.85 (－)	千ニュージーランド・ドル 182 (－)	百株 －	千ニュージーランド・ドル －
	イギリス	百株 8,278.06 (△ 81.47)	千イギリス・ポンド 4,481 (187)	百株 5,329.73	千イギリス・ポンド 2,395
	イスラエル	百株 7 (－)	千イスラエル・シュケル 90 (－)	百株 259.79	千イスラエル・シュケル 352
	スイス	百株 337.32 (71.85)	千スイス・フラン 3,154 (△ 34)	百株 682.41	千スイス・フラン 2,150
	デンマーク	百株 124.53 (209.43)	千デンマーク・クローネ 8,497 (－)	百株 47.39	千デンマーク・クローネ 5,069
	ノルウェー	百株 194.77 (－)	千ノルウェー・クローネ 2,375 (△ 4)	百株 105.37	千ノルウェー・クローネ 1,236
	スウェーデン	百株 856.34 (50.82)	千スウェーデン・クローネ 14,872 (－)	百株 1,205.47	千スウェーデン・クローネ 15,716
	ユーロ（アイルランド）	百株 30.81 (△ 79.19)	千ユーロ 263 (△ 323)	百株 28.64	千ユーロ 205
	ユーロ（オランダ）	百株 571.96 (172.05)	千ユーロ 2,109 (－)	百株 511.49	千ユーロ 1,882
	ユーロ（ベルギー）	百株 47.13 (12.8)	千ユーロ 390 (－)	百株 39.41	千ユーロ 250
	ユーロ（ルクセンブルグ）	百株 67.31 (－)	千ユーロ 152 (－)	百株 161.59	千ユーロ 105
	ユーロ（フランス）	百株 645.6 (－)	千ユーロ 3,653 (△ 8)	百株 584.36	千ユーロ 3,037
	ユーロ（ドイツ）	百株 624.6 (－)	千ユーロ 2,914 (△ 40)	百株 474.4	千ユーロ 1,927
	ユーロ（ポルトガル）	百株 102.89 (－)	千ユーロ 47 (－)	百株 －	千ユーロ －
	ユーロ（スペイン）	百株 1,151.1 (1,350.03)	千ユーロ 809 (40)	百株 2,349.19	千ユーロ 730
	ユーロ（イタリア）	百株 715.4 (－)	千ユーロ 448 (△ 0)	百株 421.51	千ユーロ 317
	ユーロ（フィンランド）	百株 599.5 (58.26)	千ユーロ 648 (－)	百株 201.31	千ユーロ 115
	ユーロ（オーストリア）	百株 － (－)	千ユーロ － (－)	百株 15.29	千ユーロ 49
	ユーロ（その他）	百株 23 (－)	千ユーロ 273 (－)	百株 －	千ユーロ －
	ユーロ（ユーロ通貨計）	百株 4,579.3 (1,513.95)	千ユーロ 11,713 (△ 332)	百株 4,787.19	千ユーロ 8,622

（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

(2023年１月11日から2024年１月10日まで)

		買付		売付	
		証券数	金額	証券数	金額
外国	カナダ	証券 261	千カナダ・ドル 1	証券 － (－)	千カナダ・ドル － (－)

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

(3) 投資証券

(2023年１月11日から2024年１月10日まで)

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	**アメリカ**	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.715	123	0.275	52
	SBA COMMUNICATIONS CORP	0.39	97	0.254	65
	EQUITY RESIDENTIAL	0.793	51	－	－
	EQUINIX INC	0.304	221	0.165	118
	AMERICAN TOWER CORP	1.453	278	0.926	182
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	3.327	99	2.115	66
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	－	－	5.382	82
	VICI PROPERTIES INC	2.1	64	1.579	52
	VENTAS INC	0.993	50	－	－
	NET LEASE OFFICE PROPERTIES	－ (0.17)	－ (－)	0.17	2
	CROWN CASTLE INTL CORP	0.984	117	0.463	52
	IRON MOUNTAIN INC	0.912	53	－	－
	SUN COMMUNITIES INC	1.277	168	0.851	116
	PROLOGIS INC	2.345	270	1.374	170
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.638	77	0.421	51
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.304	74	－	－
	WELLTOWER INC	0.644	53	－	－
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1.864	49	－	－
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.716	51	－	－
	REALTY INCOME CORP	2.823	166	1.869	116
	PUBLIC STORAGE	0.215	51	－	－
	UDR INC	2.741	104	1.221	52
	WP CAREY INC	1.278	98	0.847	63
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.439	48	－	－
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1.203	164	0.339	53
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	－	－	6.944	57
	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
	LENDLEASE GROUP	－	－	6.942	46
	APA GROUP	10.722	87	－	－
	GOODMAN GROUP	－	－	3.95	78
	香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	－ (5)	－ (△ 25)	5	21
	LINK REIT	23 (－)	1,164 (25)	11	556
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	－	－	33	165

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	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
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
CAPITALAND ASCENDAS REIT	– (–)	– (△ 1)	–	–
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	71 (–)	137 (△ 0)	45	91
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	– (–)	– (△ 0)	–	–
KEPPEL REIT	– (3.46)	– (2)	3.46	2
CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	– (1.733)	– (1)	1.733	1
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	– (–)	– (△ 0)	–	–
イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
BRITISH LAND CO PLC	–	–	9.799	31
ユーロ(フランス)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
KLEPIERRE	– (–)	– (△ 2)	–	–

（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）金額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の種類別取引状況

（2023年１月11日から2024年１月10日まで）

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 59,853	百万円 58,114	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

（2023年１月11日から2024年１月10日まで）

当期							
買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC（アメリカ）	37.045	868,379	23,441	APPLE INC（アメリカ）	24.824	602,744	24,280
MICROSOFT CORP（アメリカ）	17.3	725,806	41,954	MICROSOFT CORP（アメリカ）	9.6	409,941	42,702
AMAZON.COM INC（アメリカ）	24.573	388,986	15,829	AMAZON.COM INC（アメリカ）	12.704	197,656	15,558
NVIDIA CORP（アメリカ）	5.802	278,689	48,033	ALPHABET INC-CL C（アメリカ）	10.3	165,081	16,027
TESLA INC（アメリカ）	9.143	270,038	29,535	NVIDIA CORP（アメリカ）	3.454	154,909	44,849
ALPHABET INC-CL A（アメリカ）	13.655	213,722	15,651	JOHNSON & JOHNSON（アメリカ）	5.86	135,623	23,143
ALPHABET INC-CL C（アメリカ）	12.592	194,967	15,483	ALPHABET INC-CL A（アメリカ）	8.208	124,072	15,116
META PLATFORMS INC CLASS A（アメリカ）	5.459	190,596	34,914	META PLATFORMS INC CLASS A（アメリカ）	3.696	122,255	33,077
BROADCOM INC（アメリカ）	1.512	162,830	107,692	TESLA INC（アメリカ）	3.857	110,066	28,536
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B（アメリカ）	3.5	159,514	45,575	EXXON MOBIL CORP（アメリカ）	5.828	88,927	15,258

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
(1) 外国株式

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	12.28	16.66	333	48,210	資本財・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	35.55	38.45	1,155	167,133	情報技術
FIRST SOLAR INC	11	14.58	243	35,211	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	22.16	22.16	335	48,550	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	15.94	15.94	202	29,350	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7.46	11.5	140	20,363	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	56.06	56.06	215	31,228	金融
ABBOTT LABORATORIES	203.51	220.37	2,484	359,443	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	39.5	53.51	287	41,584	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	19.87	19.35	454	65,715	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	38.8	51.59	258	37,330	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	70.88	75.15	720	104,222	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4.74	6.19	367	53,178	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	72.42	83.13	516	74,778	金融
QORVO INC	11.47	11.47	119	17,259	情報技術
AFLAC INC	66.22	74.41	599	86,723	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	13.57	15.7	253	36,709	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	18.35	18.95	173	25,074	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	55.23	58.11	3,406	492,873	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	27.24	27.24	213	30,892	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	14.42	16.03	778	112,654	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	17.24	15.43	188	27,210	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	25.23	28.4	761	110,163	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	78.53	84.82	1,710	247,452	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	23.12	23.12	166	24,162	金融
AUTOZONE INC	2.32	2.39	602	87,188	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	27.8	27.8	383	55,524	生活必需品
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	123.65	145.65	166	24,024	ヘルスケア
CELANESE CORP	12.11	12.11	178	25,862	素材
DR HORTON INC	42.53	37.76	573	82,913	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	－	－	－	ヘルスケア
AUTODESK INC	26.02	27.59	651	94,195	情報技術
MOODY'S CORP	18.7	20.78	775	112,169	金融
DEVON ENERGY CORP	75.99	87.16	390	56,460	エネルギー
ALBEMARLE CORP	14.89	14.89	199	28,798	素材
ATMOS ENERGY CORP	14.65	21.23	251	36,357	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	26.92	33.69	175	25,455	公益事業
CITIGROUP INC	224.18	244.22	1,306	188,977	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	47.45	51.97	1,222	176,874	資本財・サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	62.88	65.35	549	79,549	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	4.07	4.07	166	24,152	一般消費財・サービス
HESS CORP	33.73	33.73	472	68,408	エネルギー
DAVITA INC	6.09	6.09	66	9,556	ヘルスケア
DANAHER CORP	80.81	89.22	2,059	298,035	ヘルスケア
FORTIVE CORP	43.39	44.57	320	46,347	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	64.86	71.05	902	130,599	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	67.06	67.06	473	68,570	生活必需品
BUNGE LTD	16.93	－	－	－	生活必需品

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TE CONNECTIVITY LTD	38.99	40.11	534	77,279	情報技術
APPLE INC	1,883.58	2,005.79	37,135	5,373,091	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	35.15	30.19	336	48,670	金融
BOEING CO/THE	65.35	73.02	1,648	238,521	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	16.11	19.13	203	29,481	金融
BECTON DICKINSON AND CO	32.89	35.49	844	122,131	ヘルスケア
LEIDOS HOLDINGS INC	14	19.82	218	31,608	資本財・サービス
NISOURCE INC	41.11	41.11	111	16,143	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14.04	14.04	121	17,596	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	95.21	95.21	504	72,943	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	487.47	540.23	2,109	305,159	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	150.59	167.59	6,148	889,681	金融
ANSYS INC	9.56	11.67	413	59,765	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	154.57	169.86	640	92,606	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	88.62	91.32	1,104	159,878	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	249.11	267.92	1,373	198,788	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	341.4	372.66	6,359	920,201	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	28.55	28.55	303	43,882	金融
LKQ CORP	29.16	29.16	136	19,770	一般消費財・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	33.84	43.98	244	35,355	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	32.99	34.43	901	130,395	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13.37	13.52	508	73,535	金融
DOLLAR GENERAL CORP	26.86	30.77	420	60,855	生活必需品
SERVICENOW INC	24.64	25.46	1,778	257,376	情報技術
CATERPILLAR INC	62.56	65.57	1,916	277,304	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	34.67	34.73	249	36,115	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	25.58	24.56	94	13,603	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	5.74	5.74	123	17,871	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	39.28	30.93	183	26,569	公益事業
MOSAIC CO/THE	38.41	38.41	131	19,001	素材
DELTA AIR LINES INC	20.19	20.19	85	12,362	資本財・サービス
CORNING INC	101.7	101.7	311	45,013	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	477.48	520.71	2,598	376,029	情報技術
MORGAN STANLEY	147.7	160.88	1,481	214,294	金融
DECKERS OUTDOOR CORP	－	4.31	300	43,460	一般消費財・サービス
MSCI INC	9.69	10.8	582	84,344	金融
FAIR ISAAC CORP	2.99	2.99	346	50,169	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	4.7	4.7	208	30,142	資本財・サービス
MANHATTAN ASSOCIATES INC	－	8	163	23,614	情報技術
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	29.98	29.98	180	26,113	資本財・サービス
BROADCOM INC	47.15	56.96	6,165	892,138	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	－	6	134	19,477	ヘルスケア
CNH INDUSTRIAL NV	－	133	158	22,996	資本財・サービス
DICK'S SPORTING GOODS INC	－	8	112	16,324	一般消費財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	16.05	16.05	318	46,027	ヘルスケア
ARAMARK	28.58	－	－	－	一般消費財・サービス
DTE ENERGY COMPANY	20.31	24.9	276	39,972	公益事業
CENTENE CORP	68.47	71.64	558	80,861	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	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	11.19	11.82	207	30,014	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	65.65	65.65	218	31,659	金融
DARLING INGREDIENTS INC	19	19	88	12,799	生活必需品
ARTHUR J GALLAGHER & CO	23.91	27.2	615	88,998	金融
GARTNER INC	8.69	10.23	447	64,680	情報技術
SPLUNK INC	19.21	22.66	345	49,960	情報技術
DOMINION ENERGY INC	99.15	96.76	467	67,592	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	47.72	95.44	560	81,115	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	14	14	111	16,172	資本財・サービス
DEERE & CO	34.17	36.09	1,419	205,334	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC	15.39	19.26	393	56,877	資本財・サービス
POOL CORP	4.38	4.38	167	24,179	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	35.12	34.94	458	66,398	金融
VMWARE INC-CLASS A	28.61	–	–	–	情報技術
BURLINGTON STORES INC	7.66	7.66	150	21,799	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	36.72	45.41	255	37,037	金融
VAIL RESORTS INC	4.48	4.48	94	13,705	一般消費財・サービス
TARGA RESOURCES CORP	24.31	24.31	203	29,405	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	8.74	104	15,066	金融
WESTLAKE CORP	4.24	4.24	57	8,286	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	43.19	45.76	428	62,038	公益事業
COGNEX CORP	19.94	–	–	–	情報技術
WEBSTER FINANCIAL CORP	22	–	–	–	金融
TELEFLEX INC	5.02	6.45	159	23,129	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8.61	11.28	215	31,241	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	7.97	9.94	347	50,242	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	2.41	2.41	76	11,080	ヘルスケア
CATALENT INC	18.63	18.63	92	13,318	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17.36	20.06	387	56,017	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	6.1	7.83	297	43,103	ヘルスケア
CARLISLE COS INC	6	6	184	26,713	資本財・サービス
IDEX CORP	8.01	9.6	201	29,166	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	92.44	99.81	806	116,716	生活必需品
ROLLINS INC	23.37	40.6	174	25,295	資本財・サービス
AECOM	–	17	150	21,731	資本財・サービス
WATSCO INC	–	4	161	23,416	資本財・サービス
GRACO INC	–	21	174	25,289	資本財・サービス
AMETEK INC	28.47	29.65	483	69,927	資本財・サービス
TORO CO	–	13	118	17,160	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	32.72	33.47	321	46,480	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	25.64	28.47	160	23,278	資本財・サービス
HEICO CORP	5.35	5.35	91	13,206	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	6.84	–	–	–	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3.99	5.21	236	34,262	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	27.6	33.06	314	45,524	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	4.67	6.14	253	36,661	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	51.38	56.4	3,762	544,453	生活必需品
EPAM SYSTEMS INC	6.24	7.63	227	32,981	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	14.57	20.36	215	31,143	素材
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	–	7	194	28,105	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3.32	3.52	785	113,677	一般消費財・サービス

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
UGI CORP	29.07	–	–	–	公益事業
CUMMINS INC	15.22	17.27	413	59,823	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	90.49	–	–	–	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	14.26	16.87	368	53,255	情報技術
SIGNATURE BANK	6.92	–	–	–	金融
COSTAR GROUP INC	49.57	49.57	415	60,046	不動産
SVB FINANCIAL GROUP	8.5	–	–	–	金融
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11.4	12.78	499	72,256	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	5.51	6.09	958	138,636	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7.78	9.9	165	23,948	金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	33.86	33.87	615	89,020	一般消費財・サービス
DEXCOM INC	44.56	51.35	666	96,364	ヘルスケア
NORDSON CORP	5.47	7.72	193	27,960	資本財・サービス
COPART INC	52.7	105.4	498	72,103	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	21.5	21.5	328	47,521	エネルギー
SEAGEN INC	17.45	–	–	–	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	10.3	8.62	239	34,613	ヘルスケア
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	9.04	10.38	241	34,971	金融
TRANSDIGM GROUP INC	6.44	7.1	710	102,742	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	17.2	21.64	155	22,540	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	10.79	10.79	144	20,874	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	29.45	–	–	–	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	220.51	253.43	457	66,187	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	27.8	26.45	738	106,901	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4.2	4.2	114	16,552	金融
COTERRA ENERGY INC	86.37	105.13	270	39,168	エネルギー
T-MOBILE US INC	73.69	66.17	1,079	156,249	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	17.86	17.86	99	14,326	不動産
COCA-COLA CO/THE	476.08	523.98	3,143	454,887	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	25.75	25.75	167	24,258	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.25	19.25	236	34,217	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	33.73	33.73	98	14,211	金融
CSX CORP	250.87	252.34	873	126,364	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10.01	12.71	290	41,964	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	15.63	19.96	304	44,108	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	1,073.28	1,191.97	18,042	2,610,619	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	74.53	80.44	609	88,257	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	484.49	515.53	5,138	743,458	エネルギー
AES CORP	70.37	90.21	170	24,616	公益事業
EVEREST GROUP LTD	5.86	4.48	165	23,887	金融
EOG RESOURCES INC	66.87	74.16	860	124,545	エネルギー
EQT CORP	38.28	51.03	194	28,109	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	16.76	22.1	255	36,996	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1.34	1.34	186	26,960	金融
CENCORA INC	19.76	22.62	483	69,915	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	35.92	35.92	469	67,917	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	437.56	497.08	588	85,156	一般消費財・サービス
EXACT SCIENCES CORP	19.59	26.47	184	26,648	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	–	–	–	コミュニケーション・サービス

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ENTEGRIS INC	18.93	18.93	213	30,843	情報技術
AERCAP HOLDINGS NV	17	28.01	204	29,637	資本財・サービス
FORTINET INC	83.51	85.69	508	73,647	情報技術
MARKEL CORP	1.7	1.7	240	34,771	金融
NEXTERA ENERGY INC	228.48	260.13	1,613	233,394	公益事業
MASIMO CORP	6.23	–	–	–	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	177.14	180.38	752	108,833	素材
INSULET CORP	9.68	8.09	165	23,958	ヘルスケア
US BANCORP	164.78	193.61	841	121,746	金融
UNITED RENTALS INC	8.49	8.49	465	67,319	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	6.59	6.59	114	16,598	情報技術
SUPER MICRO COMPUTER INC	–	6	206	29,840	情報技術
FASTENAL CO	71.58	74.42	465	67,331	資本財・サービス
FISERV INC	72.08	76.98	1,039	150,477	金融
GENERAL ELECTRIC CO	130.95	138.8	1,787	258,628	資本財・サービス
AXON ENTERPRISE INC	–	9	224	32,438	資本財・サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP	5	5	81	11,766	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	162.65	180.42	659	95,387	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	27.76	29.62	744	107,674	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	40.03	42.67	1,637	236,918	金融
FIRST HORIZON CORP	64	–	–	–	金融
ALPHABET INC-CL A	703.73	758.2	10,686	1,546,277	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	647.04	669.96	9,550	1,381,926	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	10.83	10.83	163	23,685	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	68.57	69.78	449	65,001	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	72.24	58.98	227	32,872	公益事業
GENUINE PARTS CO	15.39	19.54	268	38,789	一般消費財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	72.3	86.2	304	44,039	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	23.3	23.3	474	68,605	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	106.52	117.33	404	58,585	エネルギー
REPLIGEN CORP	6	6	103	15,030	ヘルスケア
HOME DEPOT INC	119.54	128	4,431	641,154	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	5.32	9.02	148	21,421	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	153.52	187.48	241	34,993	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4.31	4.31	109	15,792	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	16.64	18.15	350	50,707	生活必需品
HUMANA INC	14.61	16.08	738	106,861	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	31.34	33.09	700	101,362	情報技術
HENRY SCHEIN INC	14.91	14.91	111	16,192	ヘルスケア
HP INC	128.71	124.05	374	54,133	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	141.15	182.38	294	42,591	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6.81	–	–	–	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22.62	–	–	–	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20.28	–	–	–	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	42.74	46.63	355	51,377	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	90.63	114.98	443	64,133	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	15.07	17.38	203	29,437	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	106.13	114.7	1,836	265,667	情報技術

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
HUBBELL INC	6	7.39	242	35,044	資本財・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	34.57	47.24	177	25,748	素材
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	15	15	115	16,737	資本財・サービス
ZOETIS INC	54.41	59.98	1,175	170,046	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	28.49	29.32	716	103,720	資本財・サービス
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	–	17	113	16,433	情報技術
CHENIERE ENERGY INC	28.18	32.78	548	79,368	エネルギー
HYATT HOTELS CORP - CL A	–	6	77	11,161	一般消費財・サービス
ALLEGION PLC	9.42	9.42	116	16,907	資本財・サービス
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	–	18	297	43,064	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	29.12	–	–	–	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	30.14	34.42	506	73,348	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	35.3	35.3	129	18,800	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	12.25	12.25	160	23,256	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	305.02	306.2	4,949	716,086	ヘルスケア
PLUG POWER INC	62.51	–	–	–	資本財・サービス
ABBVIE INC	205.39	224.38	3,641	526,948	ヘルスケア
HOLOGIC INC	26.13	34.73	250	36,240	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	38.06	43.77	541	78,302	生活必需品
KROGER CO	85.32	88.92	411	59,491	生活必需品
KLA CORP	17.24	17.04	948	137,166	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	28.18	29.41	1,341	194,166	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8.4	8.4	238	34,479	金融
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	28.72	28.72	129	18,699	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	71.24	75.53	1,639	237,157	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	94.32	102.82	6,431	930,528	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	16.03	17.09	1,285	185,955	情報技術
LOEWS CORP	22.28	22.28	158	22,884	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	17.41	–	–	–	金融
MCDONALD'S CORP	85.62	92.14	2,680	387,780	一般消費財・サービス
3M CO	64.79	71.08	775	112,204	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	267.54	285.17	10,192	1,474,800	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	39.14	41.97	1,805	261,226	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7.55	7.55	375	54,327	素材
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	5.75	–	–	–	情報技術
ALCOA CORP	20.93	–	–	–	素材
PHILLIPS 66	56.46	58.33	777	112,426	エネルギー
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	–	21.89	515	74,525	情報技術
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38.67	38.67	172	24,960	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	26.63	36.88	249	36,088	生活必需品
METLIFE INC	75.75	85.21	589	85,341	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	102.39	115.68	734	106,234	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	30.3	33.6	823	119,206	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	20.12	21.61	674	97,557	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.82	2.82	321	46,547	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	125.17	125.17	395	57,266	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	14.8	15	454	65,755	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	294.86	322.96	3,824	553,412	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	55.61	60.19	459	66,457	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	
MASCO CORP	25.41	25.41	170	24,713	資本財・サービス
M & T BANK CORP	22.56	18.06	246	35,668	金融
MARSH & MCLENNAN COS	56.9	63.54	1,214	175,680	金融
BLACK KNIGHT INC	16.44	–	–	–	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	7.54	11.47	154	22,303	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	33.13	33.09	749	108,433	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	24.48	28	772	111,743	情報技術
BLOCK INC CLASS A	63.04	73.7	512	74,144	金融
TRANSUNION	25.57	25.57	168	24,388	資本財・サービス
VISTRA CORP	40.57	40.57	160	23,239	公益事業
NOVOCURE LTD	10.54	–	–	–	ヘルスケア
NETAPP INC	23.7	30.97	266	38,568	情報技術
NIKE INC -CL B	148.48	158.04	1,623	234,933	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	27.42	29.19	664	96,148	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	65.76	70.72	603	87,323	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	20.12	24.96	276	39,989	金融
ALLY FINANCIAL INC	37.09	37.09	126	18,310	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	17.05	18.53	875	126,609	資本財・サービス
APTIV PLC	31.76	34.76	285	41,372	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	96.04	146.04	564	81,732	素材
MCKESSON CORP	17.07	17.56	844	122,225	ヘルスケア
XYLEM INC	19.72	29.66	332	48,112	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	179.67	196.66	1,879	271,998	生活必需品
NUCOR CORP	31.83	32.79	547	79,283	素材
WESTERN UNION CO	43.5	–	–	–	金融
GODADDY INC - CLASS A	19.3	19.3	199	28,910	情報技術
NEWELL BRANDS INC	40.58	–	–	–	一般消費財・サービス
EVERGY INC	23.17	29.23	158	22,926	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	113.24	88.24	507	73,361	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	2.69	88	12,753	金融
OKTA INC	19.95	19.95	167	24,244	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	20.88	14.45	110	16,025	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	48.77	–	–	–	ヘルスケア
LINDE PLC	52.85	–	–	–	素材
WIX.COM LTD	7.85	7.85	95	13,880	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	42.93	42.93	140	20,262	金融
KKR & CO INC	68.86	80.75	657	95,105	金融
PAYCHEX INC	39.74	39.74	471	68,235	資本財・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7.63	7.46	692	100,156	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	207.58	231.02	967	139,922	生活必需品
P G & E CORP	164.82	258.48	466	67,543	公益事業
PFIZER INC	653.42	720.91	2,119	306,666	ヘルスケア
CIGNA CORP	35.53	38.19	1,194	172,882	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	32.76	32.76	252	36,550	情報技術
XCEL ENERGY INC	65.41	75.2	475	68,842	公益事業
STERIS PLC	10.54	12.93	287	41,528	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	41	41	156	22,625	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	15.3	15.3	43	6,236	コミュニケーション・サービス

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
FOX CORP - CLASS A	34.95	34.95	105	15,302	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	38.84	42.84	1,299	187,970	ヘルスケア
DOW INC	87.6	90.6	488	70,709	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	11.3	17.93	167	24,204	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	27.51	36.26	247	35,838	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	15.55	15.55	711	102,925	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	178.23	247.81	1,494	216,209	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	27.01	29.92	667	96,595	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	276.49	300.4	4,484	648,930	生活必需品
EXELON CORP	110.97	123.53	450	65,131	公益事業
INGERSOLL-RAND INC	51.87	52.26	396	57,399	資本財・サービス
NVR INC	0.33	0.39	274	39,696	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	149.02	154.07	1,737	251,368	エネルギー
TWILIO INC - A	20.53	20.53	149	21,639	情報技術
DOCUSIGN INC	23.33	23.33	130	18,933	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	5.5	7	142	20,562	資本財・サービス
CERIDIAN HCM HOLDING INC	14.7	22.44	147	21,386	資本財・サービス
PEPSICO INC	159.1	174.82	2,922	422,851	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4.09	4.09	89	12,946	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	29.5	29.5	87	12,664	情報技術
MONGODB INC	8.21	9.96	377	54,579	情報技術
SNAP INC - A	129.1	129.1	220	31,848	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	86.53	93.49	434	62,914	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	40.84	45.96	474	68,680	金融
AMCOR PLC	152.31	195.45	190	27,629	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	24.06	31.01	848	122,836	情報技術
ROKU INC	14.17	23.2	212	30,748	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	22.9	22.9	303	43,982	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	74.3	80.25	2,750	397,979	情報技術
PENTAIR PLC	13.48	22.22	154	22,312	資本財・サービス
QUALCOMM INC	131.16	141.43	1,978	286,263	情報技術
INVESCO LTD	37	–	–	–	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	6.64	–	–	–	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	28.95	28.95	227	32,927	金融
DATADOG INC - CLASS A	34.87	35.9	435	62,945	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	67.63	78.96	298	43,174	コミュニケーション・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	12.2	13.82	1,247	180,503	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	27.89	28.18	461	66,791	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	4.67	4.64	1,619	234,253	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	42.54	44.01	598	86,538	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	9.98	9.98	166	24,135	素材
RESMED INC	17.97	17.97	319	46,237	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	13.27	13.27	188	27,285	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	12.09	12.09	99	14,351	資本財・サービス
MODERNA INC	39.31	42.82	471	68,263	ヘルスケア
HUBSPOT INC	5.18	6.76	381	55,194	情報技術
REVVITY INC	17.35	18.76	208	30,200	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	103.3	105.28	597	86,523	資本財・サービス

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
OTIS WORLDWIDE CORP	52.62	54.59	474	68,639	資本財・サービス
BILL HOLDINGS INC	11.59	11.59	88	12,877	情報技術
AVANTOR INC	97.8	97.8	215	31,216	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	27.73	27.73	108	15,744	金融
DYNATRACE INC	23.39	35.05	188	27,284	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	51.91	61.72	422	61,127	コミュニケーション・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	99.16	126.97	242	35,125	金融
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	29.96	–	–	–	コミュニケーション・サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	41.76	61.3	173	25,127	ヘルスケア
MATCH GROUP INC	30.49	30.49	119	17,222	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	216.17	231	3,365	486,978	エネルギー
ZSCALER INC	9.85	13.18	298	43,148	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	44.6	44.6	325	47,121	公益事業
ETSY INC	14.09	14.09	108	15,659	一般消費財・サービス
TESLA INC	311.56	364.42	8,562	1,238,895	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	29.65	33.83	666	96,379	情報技術
GEN DIGITAL INC	62.72	85.05	191	27,762	情報技術
UNITY SOFTWARE INC	22.39	35.42	127	18,383	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	17.45	17.45	170	24,627	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	17.14	19.22	964	139,567	情報技術
CHEWY INC - CLASS A	8.56	–	–	–	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	29.25	35.52	289	41,952	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	14.13	12.96	477	69,121	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	126.23	180.81	209	30,347	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	34.38	34.38	354	51,261	一般消費財・サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	39.7	52.7	222	32,239	コミュニケーション・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	47.55	54.97	766	110,976	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	33.79	39.73	344	49,851	不動産
SOUTHERN CO/THE	126.76	142.74	1,025	148,433	公益事業
SYSCO CORP	56.63	65.74	496	71,891	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	28.26	29.61	569	82,343	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6	6	29	4,249	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	10.11	16	99	14,464	金融
STEEL DYNAMICS INC	21.56	23.59	266	38,572	素材
SCHLUMBERGER LTD	162.24	182.64	886	128,325	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	17.49	–	–	–	資本財・サービス
AFFIRM HOLDINGS INC	20.35	–	–	–	金融
AT&T INC	837.16	916.97	1,554	224,886	コミュニケーション・サービス
APA CORP	36.32	36.32	119	17,326	エネルギー
SOUTHWEST AIRLINES CO	10.08	10.08	29	4,276	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	49.63	55.83	430	62,225	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	23.88	23.88	109	15,810	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	28.51	31.29	930	134,693	素材
SEMPRA ENERGY	37.08	82.78	632	91,447	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	22.64	35.96	170	24,667	情報技術
CLARIVATE PLC	33.77	–	–	–	資本財・サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	185.93	244.48	400	57,977	情報技術

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
UIPATH INC - CLASS A	–	45	101	14,662	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	22.4	22.4	179	25,964	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	13.35	21.64	328	47,589	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC	106.13	115.21	1,942	281,101	情報技術
SALESFORCE.COM INC	118.93	124.34	3,249	470,170	情報技術
WESTROCK CO	27.54	38.4	161	23,435	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	50.86	50.86	486	70,395	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	82.84	93.92	541	78,355	資本財・サービス
TERADYNE INC	17.18	20.46	215	31,154	情報技術
UNION PACIFIC CORP	73.49	77.25	1,833	265,360	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	76.22	76.22	176	25,596	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	57.69	55.42	855	123,736	エネルギー
RTX CORP	173.5	182.43	1,565	226,475	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	85.64	92.23	1,475	213,436	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	22.88	22.88	507	73,410	ヘルスケア
AMEREN CORPORATION	26.9	36.19	267	38,759	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	108.56	118.42	6,375	922,453	ヘルスケア
TOAST INC CLASS A	29	59.72	112	16,244	金融
VERISIGN INC	10.8	14.16	279	40,478	情報技術
LUCID GROUP INC	51	153.08	55	8,017	一般消費財・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	45.41	85.97	165	23,945	一般消費財・サービス
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	–	55	67	9,708	金融
VALERO ENERGY CORP	47.23	46.88	596	86,260	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	6.68	7.13	345	50,040	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	30.08	146	21,230	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7.67	7.67	118	17,121	ヘルスケア
ELEVANCE HEALTH INC	28.26	30.04	1,451	210,039	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	214.39	234.51	2,102	304,261	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	440.35	471.2	2,322	336,049	金融
WASTE MANAGEMENT INC	49.65	52.44	934	135,232	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	146.97	146.97	520	75,320	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	11.9	14.18	313	45,305	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	6.36	–	–	–	一般消費財・サービス
WALMART INC	174.41	188.82	3,008	435,240	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	22.26	26.39	321	46,534	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	11.45	11.45	109	15,781	一般消費財・サービス
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	139	339	112	16,333	資本財・サービス
CELSIUS HOLDINGS INC	–	7	40	5,882	生活必需品
WABTEC CORP	18.98	23.69	299	43,274	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	133.5	146.61	1,364	197,450	一般消費財・サービス
WATERS CORP	6.51	7.59	229	33,229	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5.71	6.97	178	25,861	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	92.98	92.98	235	34,117	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	11.84	14.54	348	50,463	金融
WESTERN DIGITAL CORP	32.64	44.44	219	31,783	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	33.66	39.2	334	48,397	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	53.5	64.86	400	58,015	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	191.15	206.62	5,440	787,247	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	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
PPL CORP	96.77	77.43	215	31,167	公益事業
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	41.2	41.2	479	69,442	公益事業
PULTEGROUP INC	25.92	25.92	267	38,745	一般消費財・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	255.42	288.48	318	46,039	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC	29.29	30.58	447	64,701	素材
NORTHERN TRUST CORP	21.31	26.67	224	32,541	金融
FERGUSON PLC	25	28.71	537	77,738	資本財・サービス
NVIDIA CORP	291.47	314.95	16,736	2,421,595	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	48.58	48.58	750	108,605	金融
DRAFTKINGS INC CLASS A	–	53	181	26,257	一般消費財・サービス
ASPEN TECHNOLOGY CORP	3	3	60	8,820	情報技術
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	9.4	–	–	–	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	38.33	38.33	212	30,685	生活必需品
NETFLIX INC	52.38	56.85	2,740	396,549	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	45.64	49.1	2,660	384,945	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	24.11	24.11	124	18,042	公益事業
GLOBE LIFE INC	10.11	10.11	120	17,427	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	20.41	–	–	–	金融
TEXTRON INC	23.88	23.88	186	27,033	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	37.49	37.49	90	13,154	コミュニケーション・サービス
TEXAS PACIFIC LAND CORP	0.7	0.99	151	21,943	エネルギー
OMNICOM GROUP	23.11	23.11	204	29,555	コミュニケーション・サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	13.61	17.45	228	33,093	資本財・サービス
ORACLE CORP	187.81	207.36	2,148	310,920	情報技術
MASTERCARD INC - A	100.94	107.91	4,560	659,826	金融
ONEOK INC	47.73	73.25	515	74,603	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	102.99	–	–	–	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	12.57	13.66	726	105,053	情報技術
U HAUL NON VOTING SERIES N	8.82	8.82	57	8,307	資本財・サービス
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	18	23.28	269	38,999	金融
CHESAPEAKE ENERGY CORP	12	18.13	142	20,553	エネルギー
HF SINCLAIR CORP	19	19	100	14,531	エネルギー
OVINTIV INC	30	30	125	18,200	エネルギー
YUM! BRANDS INC	34.86	36.18	463	67,121	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	17.15	21.74	346	50,083	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	19.61	29.76	186	27,041	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	842.88	918.78	3,089	447,071	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	6.35	6.49	284	41,153	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	21.2	25.86	248	35,968	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	73.46	81.08	1,514	219,108	金融
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	41.28	55.47	425	61,526	ヘルスケア
LINDE PLC	–	62.34	2,535	366,833	素材
ANALOG DEVICES INC	62.02	63.64	1,207	174,732	情報技術
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	–	36	83	12,032	生活必需品
MONDAYCOM LTD	–	2	38	5,557	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	191.32	205.36	3,065	443,504	情報技術

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LIBERTY MEDIA LIBERTY SIRIUSXM COR	–	28.4	86	12,508	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	–	30.69	190	27,571	コミュニケーション・サービス
CONFLUENT INC CLASS A	–	21	47	6,860	情報技術
KENVUE INC	–	190	415	60,068	生活必需品
GLOBAL E ONLINE LTD	–	12	47	6,816	一般消費財・サービス
VERALTO CORP	–	28.32	217	31,445	資本財・サービス
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	92.94	94.28	639	92,529	金融
BUNGE GLOBAL LTD	–	21.84	211	30,548	生活必需品
VERTIV HOLDINGS CLASS A	–	46	226	32,732	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL LTD CLASS C	–	29.12	58	8,460	コミュニケーション・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	17.34	20.29	212	30,702	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	26.09	32.83	405	58,697	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	8.69	10.7	209	30,251	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	65.37	67.82	496	71,790	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	68.07	72.7	687	99,530	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	24.75	26.41	776	112,337	金融
AMGEN INC	62.88	68.05	2,090	302,532	ヘルスケア
EATON CORP PLC	45.88	52.36	1,253	181,429	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	19.51	21.51	545	78,908	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	99.37	107.38	1,621	234,652	情報技術
CME GROUP INC	41.67	45.42	895	129,523	金融
ECOLAB INC	31.35	31.35	614	88,874	素材
EQUIFAX INC	15.76	15.76	383	55,473	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	149.45	159.53	1,372	198,647	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	100.21	121.04	387	56,007	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	38.8	38.8	125	18,093	生活必需品
STATE STREET CORP	46.67	39.52	305	44,212	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	170.89	194.54	1,298	187,887	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	65.28	65.28	265	38,404	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	27.16	27.16	121	17,605	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	13.92	13.92	127	18,485	素材
CARDINAL HEALTH INC	29.73	29.73	307	44,465	ヘルスケア
FEDEX CORP	29.42	31.02	766	110,972	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46.93	46.93	623	90,263	金融
FMC CORP	13.6	13.6	82	11,922	素材
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	33.1	35.94	287	41,627	素材
INTEL CORP	483.62	532.88	2,560	370,477	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	43.18	43.18	142	20,561	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	35.56	43.35	354	51,351	金融
WOLFSPEED INC	15	–	–	–	情報技術
ILLINOIS TOOL WORKS	36.13	38.73	993	143,688	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	102.27	102.27	55	7,990	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	19.93	19.93	278	40,296	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	14.5	–	–	–	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	42.68	45.05	1,489	215,468	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	12.39	12.39	190	27,510	情報技術
SNAP-ON INC	6.23	6.23	175	25,324	資本財・サービス
CARMAX INC	17.49	17.49	126	18,354	一般消費財・サービス

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DUKE ENERGY CORP	92.59	101.07	1,001	144,907	公益事業
TARGET CORP	54.06	59.69	858	124,167	生活必需品
DOVER CORP	15.26	17.84	263	38,094	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	5.41	5.41	445	64,499	資本財・サービス
JABIL INC	–	17	218	31,575	情報技術
CINTAS CORP	10.92	11.99	700	101,402	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	64.69	51.09	149	21,673	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	17	17	182	26,419	生活必需品
CLOROX COMPANY	13.13	18.27	258	37,360	生活必需品
ENTERGY CORP	26.23	26.23	273	39,610	公益事業
MICROSOFT CORP	828.66	905.66	34,033	4,924,350	情報技術
INCYTE CORP	20.06	18.56	119	17,288	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	154.46	159.17	1,279	185,071	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	158.34	170.06	1,473	213,235	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	129.03	138.8	1,156	167,351	情報技術
BLACKROCK INC	17.23	19.32	1,535	222,100	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	66.06	66.79	195	28,247	公益事業
HASBRO INC	13.48	22.89	114	16,591	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	30.95	41.42	233	33,794	生活必需品
KEYCORP	99.4	125.65	183	26,525	金融
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	156.02	171.73	1,266	183,226	生活必需品
COOPER COS INC/THE	6.86	5.51	204	29,603	ヘルスケア
CHUBB LTD	48.09	51.96	1,170	169,390	金融
ARROW ELECTRONICS INC	7.37	–	–	–	情報技術
ALLSTATE CORP	33.64	33.64	507	73,487	金融
EBAY INC	62.11	74.02	311	45,131	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	126.92	141.25	862	124,770	金融
EASTMAN CHEMICAL CO	13.92	13.92	122	17,683	素材
DISH NETWORK CORP-A	29.84	–	–	–	コミュニケーション・サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	26.98	28.49	396	57,410	生活必需品
TRIMBLE INC	26.36	35.99	184	26,630	情報技術
LENNAR CORP-A	27.44	33.58	497	71,986	一般消費財・サービス
LEAR CORP	8.28	8.28	111	16,191	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	67.06	75.21	1,253	181,372	金融
PACCAR INC	42.64	63.96	606	87,749	資本財・サービス
BIOGEN INC	17.87	19.19	490	71,036	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	10.36	10.58	585	84,660	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	135.96	145.88	1,357	196,488	一般消費財・サービス
PTC INC	12	16.84	282	40,841	情報技術
EVERSOURCE ENERGY	43.18	43.18	250	36,236	公益事業
INTUIT INC	32.03	35.6	2,154	311,726	情報技術
BORGWARNER INC	27.41	27.41	93	13,472	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	23.16	23.16	174	25,186	一般消費財・サービス
BALL CORP	33.59	45.5	259	37,571	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	171.74	189.74	1,123	162,606	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	33.8	33.8	465	67,352	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	17.57	17.56	392	56,765	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	30.32	32.04	1,348	195,174	ヘルスケア
VF CORP	54.42	54.42	93	13,511	一般消費財・サービス
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	67.79	50.18	71	10,331	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	5.64	–	–	–	一般消費財・サービス
CARNIVAL CORP	99.86	111.16	193	27,953	一般消費財・サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC	76.74	76.74	143	20,741	素材
COMCAST CORP-CLASS A	518.73	532.55	2,304	333,492	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	19	19	77	11,188	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	131	131	44	6,501	不動産
アメリカ・ドル通貨計 株数、金額	39,749.32	43,658.71	526,442	76,170,925	
アメリカ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	601銘柄	588銘柄		<69.4%>	
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	103.76	102.13	813	87,894	生活必需品
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	41.76	41.76	216	23,417	金融
IMPERIAL OIL LTD	30.68	33.95	264	28,593	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2.37	2.61	901	97,395	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	40.3	33.05	344	37,277	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	50.69	50.69	323	34,989	素材
INTACT FINANCIAL CORP	22.97	23.31	471	50,971	金融
BCE INC	6.68	6.68	36	3,927	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	24.14	24.56	351	38,020	素材
SUNCOR ENERGY INC	170.98	168.87	739	79,967	エネルギー
METRO INC/CN	35.84	23.77	161	17,412	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	45.89	48.01	483	52,293	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	146.37	151.03	960	103,858	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	112.45	116.8	744	80,471	金融
TORONTO-DOMINION BANK	219.89	231.37	1,921	207,747	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	33.35	33.35	145	15,688	金融
MEG ENERGY CORP	–	38	88	9,615	エネルギー
ROYAL BANK OF CANADA	169.23	175.37	2,373	256,528	金融
TOURMALINE OIL CORP	36.56	36.56	225	24,421	エネルギー
TC ENERGY CORP	122.58	137.54	729	78,808	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	81.11	64.94	294	31,846	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	232.77	239.52	558	60,400	素材
CAE INC	37.52	37.52	105	11,444	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	19.68	18.97	367	39,686	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	18	18	63	6,834	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6.31	6.31	72	7,886	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	15.6	15.6	89	9,651	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	47	47	102	11,085	資本財・サービス
HYDRO ONE LTD	48.66	48.66	189	20,533	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	18.61	18.61	235	25,462	生活必需品
STANTEC INC	–	14	149	16,182	資本財・サービス
NORTHLAND POWER INC	26.32	26.32	65	7,081	公益事業
WSP GLOBAL INC	18.52	14.57	268	29,026	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9.74	9.74	112	12,148	資本財・サービス
PARKLAND CORP	16.21	16.21	71	7,721	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	19.49	19.49	62	6,705	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	35.24	35.24	180	19,552	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	千カナダ・ドル	千円	
TFI INTERNATIONAL INC	9.24	9.24	165	17,886	資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A	21.93	21.93	70	7,658	公益事業
ROGER'S COMMUNICATIONS INC-B	39.56	50.43	318	34,461	コミュニケーション・サービス
BRP INC/CA- SUB VOTING	4.03	4.03	38	4,113	一般消費財・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	74.02	74.02	98	10,681	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	50.27	59.83	413	44,687	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	69.97	69.97	61	6,663	公益事業
AIR CANADA	17	17	32	3,546	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	147.57	147.57	110	11,979	素材
BANK OF MONTREAL	81.17	89.23	1,158	125,238	金融
POWER CORP OF CANADA	57.3	69.72	266	28,825	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	143.55	152.86	1,640	177,271	情報技術
NUTRIEN LTD	63.64	61.74	440	47,621	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	15.32	15.32	62	6,802	公益事業
CAMECO CORP	44.72	58.02	347	37,584	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	4.22	4.22	90	9,833	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	18.65	38.82	169	18,303	資本財・サービス
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	7.72	–	–	–	金融
TELUS CORP	6	6	14	1,573	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	53.74	53.74	281	30,379	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	6.23	6.23	88	9,568	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	137.89	141.09	1,231	133,075	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2.74	2.74	351	37,963	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	31.67	39.47	297	32,142	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	8	8	132	14,301	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	26.15	71.23	144	15,652	素材
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	10	10	108	11,675	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	64.2	79.2	540	58,418	金融
ENBRIDGE INC	242.33	264.73	1,301	140,726	エネルギー
BROOKFIELD CORP	167.07	181.42	951	102,833	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	210.36	210.41	607	65,636	金融
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	108.6	117.19	1,232	133,194	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	11	16.09	141	15,329	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	23.64	23.64	99	10,762	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	69.6	69.99	1,159	125,363	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	29.56	24.57	344	37,199	情報技術
ONEX CORPORATION	11.04	11.04	98	10,645	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	51.72	–	–	–	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	13.18	13.18	46	5,007	金融
TMX GROUP LTD	6.98	34.9	111	12,011	金融
OPEN TEXT CORP	32.1	32.1	175	18,996	情報技術
SAPUTO INC	29	29	77	8,363	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63	77.81	97	10,563	素材
FORTIS INC	59.38	59.38	331	35,878	公益事業
RB GLOBAL INC	13.55	28.96	251	27,224	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	66	66	69	7,512	素材
CENOVUS ENERGY INC	153.73	182.31	394	42,663	エネルギー
DOLLARAMA INC	30.74	41.34	398	43,089	一般消費財・サービス
ALTAGAS LTD	32.01	32.01	91	9,937	公益事業
KEYERA CORP	22	22	70	7,609	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	77.34	77.34	157	16,995	エネルギー
カナダ・ドル通貨計 株数、金額	4,807.7	5,107.17	32,176	3,478,002	
カナダ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	86銘柄	86銘柄		<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	
THE LOTTERY GROUP LTD	237.27	237.27	110	10,657	一般消費財・サービス
TELSTRA GROUP LTD	423.51	666.09	260	25,210	コミュニケーション・サービス
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	359.69	390.09	1,009	97,762	金融
MEDIBANK PRIVATE LTD	301.36	301.36	112	10,910	金融
BHP GROUP LTD	605.13	660.49	3,234	313,091	素材
SOUTH32 LTD	488.03	645	217	21,040	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	219.27	246.78	767	74,292	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	183.91	217.22	609	59,001	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	378.89	426.89	1,319	127,687	金融
WESTPAC BANKING CORP	415.63	481.48	1,112	107,662	金融
SANTOS LTD	452.11	450.95	341	33,044	エネルギー
RIO TINTO LTD	47.51	47.51	626	60,660	素材
ORIGIN ENERGY LTD	182.8	275.78	232	22,477	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD	196.19	196.19	75	7,330	資本財・サービス
PILBARA MINERALS LTD	300.83	300.83	116	11,240	素材
XERO LTD	14.26	22.78	247	24,000	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	27.48	27.48	88	8,594	金融
COLES GROUP LTD	163.86	163.86	266	25,775	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	16.45	16.45	118	11,425	情報技術
IDP EDUCATION LTD	20.88	20.88	43	4,179	一般消費財・サービス
IGO LTD	80.81	80.81	68	6,609	素材
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	107.16	163.2	210	20,347	素材
REECE LTD	23.22	23.22	51	4,947	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	139.06	139.06	76	7,363	生活必需品
SEEK LTD	48.13	48.13	125	12,136	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	86.16	86.16	87	8,482	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	96.62	–	–	–	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	204.9	222.25	2,511	243,148	金融
AMPOL LTD	46.05	51.98	189	18,375	エネルギー
ORICA LTD	47.83	47.83	77	7,458	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	153.48	209.61	316	30,597	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD	140.42	164.86	611	59,189	生活必需品
QANTAS AIRWAYS LTD	63.73	63.73	34	3,343	資本財・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	47.96	47.96	261	25,269	素材
MACQUARIE GROUP LTD	45.72	51.01	915	88,637	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	64.62	77.93	309	29,925	一般消費財・サービス
CSL LTD	56.3	62.28	1,806	174,892	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	140.07	140.07	796	77,108	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	6.97	11.33	335	32,458	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	50.24	50.24	111	10,830	素材
SUNCORP GROUP LTD	145.04	145.04	198	19,262	金融
ASX LTD	22.6	22.6	141	13,688	金融
COMPUTERSHARE LTD	60.54	60.54	149	14,474	資本財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	270.97	157	15,265	金融

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
SONIC HEALTHCARE LTD	52.23	52.23	166	16,113	ヘルスケア
BRAMBLES LTD	150.68	157.35	217	21,095	資本財・サービス
CARSALES.COM LTD	－	47.61	144	14,005	コミュニケーション・サービス
MINERAL RESOURCES LTD	18.81	18.81	126	12,219	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20.64	20.64	106	10,317	ヘルスケア
REA GROUP LTD	6.08	6.08	108	10,507	コミュニケーション・サービス
オーストラリア・ドル 通貨計 株数、金額	7,432.1	8,338.91	21,323	2,064,121	
銘柄数<比率>	49銘柄	49銘柄		< 1.9%>	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	175	175	780	14,447	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	270	270	1,108	20,515	一般消費財・サービス
MTR CORP	285	235	653	12,092	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	220	180	1,427	26,421	不動産
SINO LAND CO	340	540	446	8,256	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	335.52	485.52	1,993	36,891	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	－	140	313	5,804	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	50	50	328	6,075	不動産
CLP HOLDINGS LTD	190	230	1,458	26,991	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	185.65	185.65	419	7,766	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,380.27	1,380.27	817	15,124	公益事業
HANG SENG BANK LTD	90	90	778	14,410	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT	155	155	167	3,104	不動産
WH GROUP LTD	895	895	439	8,134	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	149	159	3,898	72,164	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	270	270	278	5,157	不動産
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	220	220	170	3,155	資本財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	320	100	153	2,846	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	235.52	235.52	872	16,151	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	55	236	4,372	公益事業
AIA GROUP LTD	1,500	1,634	10,392	192,360	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120	120	161	2,994	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	200	200	490	9,069	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	192	192	261	4,833	生活必需品
ESR CAYMAN LTD	220	220	238	4,414	不動産
SANDS CHINA LTD	290	530	1,197	22,171	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	170	170	1,462	27,077	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	430	430	864	15,998	金融
香港ドル 通貨計 株数、金額	8,942.96	9,546.96	31,810	588,803	
銘柄数<比率>	27銘柄	28銘柄		< 0.5%>	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
CAPITALAND INVESTMENT LTD	304	304	92	10,080	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD	149	179	510	55,482	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	213	243	798	86,839	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	117.5	137.5	88	9,612	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	173	173	120	13,071	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	30	30	18	2,031	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	52	33	3,657	不動産
SEATRIUM	－	9,631.71	108	11,832	資本財・サービス

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	12	12	34	3,796	資本財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	407	447	575	62,594	金融
GENTING SINGAPORE LTD	1,300	1,300	130	14,133	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	32	－	－	－	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,124	1,124	268	29,206	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	401	153	16,653	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	－	114	62	6,841	公益事業
SINGAPORE EXCHANGE LTD	118	118	115	12,521	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD	278	278	97	10,608	生活必需品
シンガポール・ドル 通貨計 株数、金額	4,450.5	14,544.21	3,209	348,964	
銘柄数<比率>	15銘柄	16銘柄		< 0.3%>	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	150	150	85	7,725	公益事業
MERCURY NZ LTD	123.8	123.8	83	7,492	公益事業
EBOS GROUP LTD	－	20.56	75	6,778	ヘルスケア
SPARK NEW ZEALAND LTD	236.35	236.35	122	11,085	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	132.89	254.18	218	19,694	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	72.38	72.38	174	15,734	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル 通貨計 株数、金額	715.42	857.27	759	68,510	
銘柄数<比率>	5銘柄	6銘柄		< 0.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
SHELL PLC	856.73	862.5	2,139	393,649	エネルギー
HALEON PLC	545.52	723.27	244	45,031	生活必需品
WISE PLC CLASS A	－	78.05	67	12,385	金融
BP PLC	2,236.18	2,307.34	1,059	194,974	エネルギー
UNILEVER PLC	303.04	329.3	1,271	233,831	生活必需品
BARCLAYS PLC	2,049.26	2,127.09	328	60,369	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	912.45	1,104.96	341	62,769	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	339.07	339.07	286	52,757	金融
NATWEST GROUP PLC	560.2	698.35	154	28,378	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	30.8	－	－	－	素材
BAE SYSTEMS PLC	398.54	413.95	474	87,306	資本財・サービス
AVIVA PLC	319.64	319.64	138	25,496	金融
AVEVA GROUP PLC	11.4	－	－	－	情報技術
GSK	474.15	547.97	863	158,888	ヘルスケア
INFORMA PLC	162	162	126	23,215	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	447.76	173.08	100	18,498	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	105.87	105.87	75	13,812	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	7.26	16.37	93	17,165	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	51.49	51.49	36	6,706	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7.4	7.4	73	13,504	資本財・サービス
HALMA PLC	39.78	39.78	86	15,843	情報技術
ENTAIN PLC	58.23	97.75	95	17,550	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	218.08	453.96	51	9,549	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	68.57	68.57	35	6,607	金融
M&G PLC	259.64	259.64	58	10,808	金融
ENDEAVOUR MINING PLC	－	23.57	35	6,551	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 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
RELX PLC	228.21	244.68	762	140,255	資本財・サービス
DIAGEO PLC	263	288.96	799	147,112	生活必需品
RIO TINTO PLC	129.26	143.18	797	146,763	素材
STANDARD CHARTERED PLC	274.61	336.16	214	39,392	金融
TESCO PLC	1,017.41	1,035.14	311	57,222	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	92.37	92.37	100	18,411	ヘルスケア
GLENCORE PLC	1,129.4	1,401.66	633	116,496	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	32	23	4,257	金融
SMITHS GROUP PLC	40.8	40.8	68	12,688	資本財・サービス
PEARSON PLC	82.71	82.71	80	14,883	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	176.31	176.31	53	9,921	生活必需品
NEXT PLC	14.56	14.56	122	22,568	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	578.08	84	15,531	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	37.22	24.65	87	16,088	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	37.03	37.03	118	21,757	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	3,095.88	2,814.52	197	36,248	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	14.09	24.98	116	21,432	素材
KINGFISHER PLC	247.03	247.03	55	10,274	一般消費財・サービス
WPP PLC	130.21	130.21	98	18,080	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	82.44	86	15,992	公益事業
SEVERN TRENT PLC	26.81	44.6	116	21,471	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	303.37	303.37	125	23,115	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	89.36	91.94	512	94,274	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	88.44	88.44	56	10,301	金融
SCHRODERS PLC	72.17	72.17	30	5,619	金融
SSE PLC	119.27	136.72	257	47,371	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	123.68	67	12,395	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	184.98	200.64	2,187	402,389	ヘルスケア
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	682.32	807.41	202	37,236	金融
3I GROUP PLC	126.75	131.04	298	54,961	金融
ASHTEAD GROUP PLC	56.56	56.56	281	51,836	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	115.48	115.48	132	24,430	情報技術
NATIONAL GRID PLC	415.45	504.62	541	99,699	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,515.44	8,778.58	417	76,869	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	98.22	122.15	227	41,896	生活必需品
CRH PLC	–	98.73	530	97,677	素材
CENTRICA PLC	–	721.84	113	20,867	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	11.55	11.55	55	10,168	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	249.79	273.89	649	119,563	生活必需品
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34.83	34.83	81	15,057	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	2,400.27	2,549.97	1,617	297,639	金融
ANGLO AMERICAN PLC	149.72	168.86	307	56,653	素材
MONDI PLC	52.48	52.48	78	14,490	素材
COMPASS GROUP PLC	203.36	228.46	496	91,325	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	39.69	39.69	55	10,159	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	755.78	755.78	91	16,823	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	25.74	25.74	60	11,070	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	45.08	45.08	62	11,452	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	20.78	20.78	146	27,003	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	17.13	17.13	71	13,222	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	40.9	57.5	518	95,410	金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	20.39	20.39	38	7,106	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	39.77	108	19,914	金融
ANTOFAGASTA PLC	60.56	60.56	96	17,780	素材
ABRDN PLC	277.75	277.75	47	8,719	金融
EXPERIAN PLC	114.6	114.6	357	65,775	資本財・サービス
イギリス・ポンド 通貨計 株数、金額	33,464.36	36,331.22	24,096	4,432,782	
銘柄数<比率>	78銘柄	80銘柄		< 4.0%>	
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シュケル	千円	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	143.35	143.35	258	10,004	金融
AZRIELI GROUP LTD	5.3	5.3	127	4,957	不動産
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12.79	–	–	–	情報技術
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	240	–	–	–	コミュニケーション・サービス
ICL GROUP LTD	82.94	82.94	151	5,868	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	3	3	228	8,872	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	151.6	151.6	489	18,980	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	240.49	240.49	681	26,409	金融
NICE LTD	7.42	7.42	572	22,190	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	18.83	18.83	261	10,142	金融
イスラエル・シュケル 通貨計 株数、金額	905.72	652.93	2,772	107,424	
銘柄数<比率>	10銘柄	8銘柄		< 0.1%>	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
SANDOZ GROUP AG	–	49.77	146	24,839	ヘルスケア
AVOLTA AG	–	12.51	40	6,863	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	382.38	419.58	1,065	180,847	金融
ROCHE HOLDING AG-BR	3.24	5.15	140	23,849	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.89	0.89	58	9,971	素材
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	31.78	125	21,304	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	81.68	87.98	2,219	376,747	ヘルスケア
SIKA AG-REG	18.55	18.95	480	81,581	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	0.01	104	17,655	生活必需品
ABB LTD-REG	179.76	198.5	718	121,984	資本財・サービス
SWISS RE AG	37.23	37.23	359	61,052	金融
NESTLE SA-REG	325.69	341.64	3,376	573,124	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3.1	2.56	297	50,498	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2.61	5.6	117	19,878	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	487.04	–	–	–	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	26.84	26.84	126	21,405	金融
SGS SA-REG	0.78	24.72	177	30,097	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	4.67	4.67	92	15,641	資本財・サービス
TEMENOS AG - REG	7.93	7.93	62	10,688	情報技術
HELVETIA HOLDING AG-REG	–	4.71	55	9,410	金融
VAT GROUP AG	3.39	3.39	131	22,380	資本財・サービス
BKW AG	2.5	2.5	38	6,501	公益事業
ALCON INC	55.5	62.3	412	70,098	ヘルスケア
SIG GROUP N AG	34	34	64	10,908	素材
SWATCH GROUP AG/THE-BR	3.77	3.77	82	14,041	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	17.76	19.17	841	142,863	金融

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
BALOISE HOLDING AG - REG	5.5	5.5	71	12,147	金融
CLARIANT AG-REG	25.52	25.52	29	5,047	素材
NOVARTIS AG-REG	249.16	255.41	2,327	395,168	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.41	0.41	55	9,347	生活必需品
BACHEM HOLDING AG-REG B	3.9	3.9	23	4,065	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	63.09	66.41	748	127,111	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	3.24	3.24	164	27,941	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3.57	3.57	38	6,599	金融
GEBERIT AG-REG	4.33	4.91	256	43,559	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	1.06	1.24	419	71,212	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	12.71	17.09	223	37,933	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	6.13	6.13	169	28,835	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	17.3	17.97	144	24,532	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	8.77	10.05	358	60,822	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	4.5	18	3,216	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD	67.54	67.54	439	74,640	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3.29	4.16	244	41,581	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	6.4	6.4	187	31,844	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	9.46	84	14,340	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.14	0.08	82	14,001	生活必需品
スイス・フラン通貨計 株数、金額	2,192.88	1,919.64	17,425	2,958,189	
スイス・フラン通貨計 銘柄数<比率>	43銘柄	45銘柄		< 2.7%>	
(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	206.2	440.3	31,838	675,285	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	80.02	103.51	1,958	41,548	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0.39	0.39	506	10,736	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	133.4	133.4	2,755	58,441	資本財・サービス
CARLSBERG AS-B	11.32	12.06	1,035	21,957	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	24.64	24.64	905	19,195	素材
COLOPLAST-B	14	19.22	1,512	32,074	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	23.04	26.86	3,306	70,130	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	0.98	0.98	189	4,022	資本財・サービス
DEMANT A/S	6.14	18.14	540	11,469	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.58	0.58	766	16,262	資本財・サービス
TRYG A/S	40.74	40.74	587	12,468	金融
PANDORA A/S	11.28	11.28	1,101	23,365	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	12.62	12.62	706	14,989	素材
GENMAB A/S	8.77	8.77	1,941	41,182	ヘルスケア
ORSTED A/S	22.46	29.66	1,125	23,873	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計 株数、金額	596.58	883.15	50,778	1,077,005	
デンマーク・クローネ通貨計 銘柄数<比率>	16銘柄	16銘柄		< 1.0%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
DNB BANK	110.49	144.64	3,124	43,676	金融
NORSK HYDRO ASA	152.84	208.13	1,385	19,366	素材
ORKLA ASA	116.18	116.18	949	13,272	生活必需品
TELENOR ASA	87.46	87.46	1,068	14,935	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	113.82	113.78	3,614	50,534	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	21.12	21.12	744	10,407	素材
MOWI ASA	46.77	46.77	882	12,338	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	20	362	5,071	金融
AKER BP ASA	36.55	36.55	1,056	14,772	エネルギー
KONGSBERG GRUPPEN ASA	12.03	12.03	595	8,331	資本財・サービス
SALMAR ASA	7.28	7.28	432	6,047	生活必需品
ADEVINTA ASA	33.82	33.82	379	5,309	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	758.36	847.76	14,596	204,064	
ノルウェー・クローネ通貨計 銘柄数<比率>	12銘柄	12銘柄		< 0.2%>	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
SAGAX CLASS B	20.2	20.2	528	7,458	不動産
INVESTOR CLASS A	62.56	–	–	–	金融
VOLVO CAR CLASS B	71.77	71.77	219	3,106	一般消費財・サービス
ERICSSON LM-B SHS	376.89	376.89	2,359	33,319	情報技術
VOLVO AB-B SHS	183.33	189.42	4,700	66,370	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES	40	40	792	11,191	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	26	–	–	–	一般消費財・サービス
TELE2 AB-B SHS	70.26	70.26	627	8,867	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS	28.69	28.69	653	9,224	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	187.67	215.49	3,065	43,282	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	165.57	196.35	2,152	30,400	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	108.21	108.21	2,221	31,368	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	81.12	84.85	1,420	20,060	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	73.2	73.2	1,094	15,457	素材
SKANSKA AB-B SHS	37.09	37.09	655	9,248	資本財・サービス
SANDVIK AB	154.4	177.46	3,737	52,770	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	214.46	264.19	6,048	85,406	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	337.12	372.73	6,081	85,864	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS	19.23	43.59	1,107	15,633	資本財・サービス
HOLMEN AB-B SHARES	11.14	11.14	471	6,663	素材
SECURITAS AB-B SHS	109.99	49.05	476	6,731	資本財・サービス
TELIA CO AB	290.88	290.88	798	11,270	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	38.03	38.03	1,454	20,539	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	203.29	203.29	2,875	40,602	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	113.69	141.8	4,017	56,722	資本財・サービス
SAAB AB-B	–	8	516	7,297	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	26.38	26.38	862	12,172	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	64.2	64.2	434	6,131	不動産
INDUTRADE AB	36	36	917	12,957	資本財・サービス
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	19.11	19.11	532	7,517	ヘルスケア
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	9.48	510	7,209	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	20.48	20.48	521	7,359	資本財・サービス
LIFCO AB-B SHS	29.24	29.24	716	10,115	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	167.16	212.51	1,411	19,924	資本財・サービス
BEIJER REF AB	–	35	446	6,305	資本財・サービス
ESSITY AKTIEBOLAG-B	85.03	85.03	2,175	30,723	生活必需品
EMBRACER GROUP AB	70.9	–	–	–	コミュニケーション・サービス
BOLIDEN AB	31.71	31.71	928	13,109	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	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
EPIROC AB-A		79.13	99.3	1,877	26,514	資本財・サービス
EPIROC AB-B		40.15	40.15	670	9,467	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		54	54	431	6,087	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP		420.96	–	–	–	金融
EQT AB		33.65	63.18	1,641	23,176	金融
EVOLUTION AB		20.64	26.38	3,099	43,767	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B		30.03	–	–	–	金融
HEXAGON AB-B SHS		277.67	277.67	3,248	45,872	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		12.16	12.16	397	5,605	金融
スウェーデン・クローネ 通貨計	株数、金額	4,552.87	4,254.56	68,900	972,876	
	銘柄数<比率>	45銘柄	42銘柄		< 0.9%>	
ユーロ（アイルランド）		百株	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		26.93	26.93	95	15,179	素材
AIB GROUP PLC		126.8	126.8	51	8,152	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC		126.91	126.91	110	17,559	金融
KINGSPAN GROUP PLC		17.44	22.72	169	26,892	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		18.22	25.25	197	31,173	生活必需品
CRH PLC		90.13	–	–	–	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		20.28	21.08	326	51,606	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額	426.71	349.69	951	150,564	
	銘柄数<比率>	7銘柄	6銘柄		< 0.1%>	
ユーロ（オランダ）		百株	百株	千ユーロ	千円	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV		84.9	100.23	253	40,037	コミュニケーション・サービス
EXOR NV		13	13	116	18,365	金融
FERROVIAL		–	71.27	241	38,165	資本財・サービス
QIAGEN N.V.		25.21	25.21	105	16,626	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		129.22	99.52	219	34,723	ヘルスケア
NN GROUP NV		38.6	38.6	141	22,429	金融
HEINEKEN NV		35.44	36.89	334	52,990	生活必需品
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		124.07	124.86	336	53,283	生活必需品
AKZO NOBEL N.V.		21.68	21.68	152	24,104	素材
KONINKLIJKE DSM NV		20.14	–	–	–	素材
WOLTERS KLUWER		35.82	36.04	465	73,635	資本財・サービス
ING GROEP NV		402.48	406.74	529	83,778	金融
KONINKLIJKE KPN NV		376.07	538.93	168	26,609	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		46.19	48.58	3,179	503,006	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA		40.3	40.3	54	8,590	金融
IMCD NV		7.15	7.15	107	17,063	資本財・サービス
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES		–	9.87	129	20,439	情報技術
ASR NEDERLAND NV		–	20.47	87	13,827	金融
ADYEN NV		2.39	2.26	259	41,008	金融
JUST EAT TAKEAWAY		23.81	–	–	–	一般消費財・サービス
PROSUS NV		91.52	175.56	474	74,988	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV		14.76	14.76	36	5,697	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV		5.55	6.97	310	49,156	情報技術
RANDSTAD NV		14.9	14.9	79	12,549	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		11.53	22.85	173	27,400	生活必需品
OCI NV		11.97	11.97	30	4,775	素材
EURONEXT NV		9.29	9.29	72	11,412	金融

銘柄		期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
STMICROELECTRONICS NV		85.7	99.21	403	63,878	情報技術
AIRBUS SE		65.21	72.31	1,034	163,721	資本財・サービス
ARGENX SE		7.68	7.69	286	45,304	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		55.46	55.46	55	8,708	生活必需品
CNH INDUSTRIAL NV		116.91	–	–	–	資本財・サービス
STELLANTIS NV		256.3	273.2	561	88,839	一般消費財・サービス
FERRARI NV		15.99	15.99	501	79,278	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額	2,189.24	2,421.76	10,900	1,724,398	
	銘柄数<比率>	31銘柄	31銘柄		< 1.6%>	
ユーロ（ベルギー）		百株	百株	千ユーロ	千円	
LOTUS BAKERIES NV		–	0.05	39	6,185	生活必需品
SYENSQO SA		–	12.8	117	18,546	素材
UCB SA		15.5	15.5	128	20,259	ヘルスケア
KBC GROUP NV		30.11	30.11	182	28,837	金融
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		11.39	15.79	111	17,630	金融
SOLVAY SA		8.73	–	–	–	素材
UMICORE		22.7	22.7	49	7,900	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		93	105	625	99,001	生活必需品
AGEAS		18.87	18.87	74	11,815	金融
D'IETEREN GROUP		2.96	2.96	51	8,180	一般消費財・サービス
ELIA GROUP SA/NV		5.02	5.02	58	9,228	公益事業
SOFINA		1.46	1.46	31	5,039	金融
国小計	株数、金額	209.74	230.26	1,470	232,626	
	銘柄数<比率>	10銘柄	11銘柄		< 0.2%>	
ユーロ（ルクセンブルグ）		百株	百株	千ユーロ	千円	
AROUNDTOWN SA		104.12	–	–	–	不動産
ARCELORMITTAL		69.75	75.58	187	29,634	素材
EUROFINS SCIENTIFIC		14.8	25.89	149	23,706	ヘルスケア
TENARIS SA		47	39.92	59	9,473	エネルギー
国小計	株数、金額	235.67	141.39	397	62,814	
	銘柄数<比率>	4銘柄	3銘柄		< 0.1%>	
ユーロ（フランス）		百株	百株	千ユーロ	千円	
TOTALENERGIES SE		283.59	287.99	1,731	273,906	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		85.84	85.84	271	42,966	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		60.69	61.41	1,049	166,108	素材
KERING		8.55	8.27	317	50,239	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		59.11	63.33	1,101	174,247	資本財・サービス
BOUYGUES SA		27.21	27.21	96	15,333	資本財・サービス
BNP PARIBAS		123.98	122.31	766	121,185	金融
THALES SA		12.35	16.05	220	34,836	資本財・サービス
DANONE		77.15	80.82	493	77,992	生活必需品
CARREFOUR SA		66.41	85.63	142	22,541	生活必需品
VIVENDI		89.3	89.3	88	14,011	コミュニケーション・サービス
L'OREAL		27.75	28.76	1,266	200,420	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		68.26	69.56	449	71,110	資本財・サービス
LEGRAND SA		30.52	37.91	339	53,736	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA		23.64	25.69	381	60,373	生活必需品
EURAZEO SE		4	4	28	4,480	金融
SOCIETE GENERALE SA		114.36	90.02	222	35,246	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		31.37	34.12	2,322	367,427	一般消費財・サービス

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千ユーロ	千円	
ACCOR SA	18.5	18.5	64	10,138	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	19.19	22.23	410	64,884	情報技術
VALEO SA	22.45	－	－	－	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	29.18	29.18	247	39,229	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA	32.27	32.27	74	11,711	資本財・サービス
EIFFAGE	9.45	9.45	92	14,647	資本財・サービス
SODEXO SA	10.85	10.85	111	17,679	一般消費財・サービス
IPSEN	6.4	6.4	68	10,843	ヘルスケア
AMUNDI SA	10.05	10.05	62	9,952	金融
TELEPERFORMANCE	7.45	7.45	96	15,315	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	9.77	－	－	－	コミュニケーション・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3.14	3.14	76	12,031	ヘルスケア
SEB SA	2.16	2.16	24	3,799	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA	32.58	35.54	653	103,373	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA	2.2	2.2	40	6,407	資本財・サービス
WORLDLINE SA	26.41	46.29	68	10,856	金融
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8.78	17	56	8,869	一般消費財・サービス
AXA SA	210.14	205.77	609	96,470	金融
EDENRED	30.07	30.07	164	25,983	金融
RENAULT SA	20.44	28.61	103	16,350	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	3.48	3.8	693	109,783	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	2.53	2.53	24	3,859	生活必需品
DASSAULT SYSTEMES SE	92.7	95.65	404	63,924	情報技術
WENDEL	3.31	－	－	－	金融
ORANGE	225.8	271.56	285	45,237	コミュニケーション・サービス
ALSTOM	36.68	36.68	43	6,908	資本財・サービス
SANOFI	131.38	135.98	1,294	204,773	ヘルスケア
VINCI SA	60.17	61.15	704	111,463	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	96.57	101.37	293	46,490	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	146.09	146.09	194	30,779	金融
BIOMERIEUX	4.57	4.57	46	7,334	ヘルスケア
ENGIE	209.6	255.91	423	67,002	公益事業
EDF	67.6	－	－	－	公益事業
SAFRAN SA	41.16	37.77	611	96,667	資本財・サービス
ARKEMA	6.5	6.5	64	10,149	素材
ADP	3.5	3.5	41	6,555	資本財・サービス
GETLINK SE	49.73	49.73	80	12,788	資本財・サービス
BOLLORE	143.02	143.02	81	12,964	コミュニケーション・サービス
国小計 株数、金額	3,029.95	3,091.19	19,604	3,101,390	
国小計 銘柄数<比率>	56銘柄	52銘柄		< 2.8%>	
ユーロ（ドイツ）	百株	百株	千ユーロ	千円	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	50.55	65.57	214	33,961	資本財・サービス
DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	13.2	13.2	102	16,183	一般消費財・サービス
BAYER AG-REG	109.61	121.76	433	68,564	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	24.31	24.31	43	6,816	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	234.78	279.96	355	56,247	金融
COMMERZBANK AG	148.3	148.3	174	27,543	金融

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千ユーロ	千円	
VOLKSWAGEN AG	3.41	3.41	41	6,603	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	22.9	24.61	278	44,126	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	88.64	90.57	1,443	228,391	資本財・サービス
E.ON SE	288.8	335.59	429	67,875	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	39.13	39.13	394	62,411	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	19.08	19.08	69	10,935	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	12.72	12.72	95	15,060	一般消費財・サービス
BASF SE	105.67	102.78	467	73,998	素材
ALLIANZ SE-REG	45.12	46.49	1,132	179,124	金融
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	19.95	26.9	198	31,389	生活必需品
RHEINMETALL AG	5.02	5.02	153	24,229	資本財・サービス
RWE AG	86.49	90.74	373	59,099	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	66.13	66.13	52	8,296	資本財・サービス
BRENNTAG SE	17.73	22.59	186	29,461	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	48.35	68.57	194	30,785	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9.59	－	－	－	コミュニケーション・サービス
SAP SE	120.01	130.28	1,814	287,060	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	16.25	15.35	578	91,500	金融
ZALANDO SE	25.14	25.14	48	7,632	一般消費財・サービス
HEIDELBERG MATERIALS AG	15.7	16.41	136	21,635	素材
COVESTRO AG	19.45	31.61	162	25,653	素材
RATIONAL AG	0.74	0.74	49	7,802	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	2.79	2.79	90	14,287	ヘルスケア
TALANX AG	－	8.04	52	8,331	金融
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	17.4	17.4	81	12,819	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	18.32	26.66	63	10,052	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	5.6	5.6	56	8,956	ヘルスケア
BECHTLE AG	8.19	8.19	35	5,629	情報技術
NEMETSCHEK SE	7.89	7.89	59	9,341	情報技術
SCOUT24 AG	10.83	10.83	71	11,355	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	32.3	32.3	170	27,051	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	9.26	9.26	54	8,610	資本財・サービス
HELLOFRESH SE	18.14	18.14	24	3,874	生活必需品
SIEMENS ENERGY AG	47.32	87.67	105	16,664	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	11.47	11.47	157	24,850	生活必需品
MERCK KGAA	14.9	17.52	250	39,676	ヘルスケア
ADIDAS AG	19.21	19.21	342	54,124	一般消費財・サービス
PUMA SE	12.95	12.95	60	9,591	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	13.11	13.11	86	13,692	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	375.11	384.29	865	136,848	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	23.41	23.41	87	13,776	ヘルスケア
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	95.27	92.97	593	93,836	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	142.28	158	556	87,984	情報技術
HANNOVER RUECK SE	9.39	9.42	210	33,232	金融
DHL GROUP	105.96	122.71	549	86,862	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	22.78	23.81	442	70,023	金融
MTU AERO ENGINES AG	6.19	7.63	153	24,237	資本財・サービス
WACKER CHEMIE AG	－	2.32	24	3,828	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	
SYMRISE AG		15.09	20.68	205	32,506	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		141.05	－	－	－	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		7.33	7.33	67	10,650	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		96.44	108.39	294	46,640	不動産
LEG IMMOBILIEN SE		8.69	8.69	64	10,186	不動産
国小計	株数、金額	2,955.44	3,105.64	15,498	2,451,919	
	銘柄数<比率>	57銘柄	57銘柄		< 2.2%>	
ユーロ（ポルトガル）		百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS		29	29	63	10,111	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		317.72	420.61	192	30,475	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		61.35	61.35	85	13,456	エネルギー
国小計	株数、金額	408.07	510.96	341	54,043	
	銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		< 0.0%>	
ユーロ（スペイン）		百株	百株	千ユーロ	千円	
CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV		7.81	7.81	19	3,128	公益事業
DERECHOS DE IBERDROLA S.A. SA		683.12	－	－	－	公益事業
DERECHOS DE IBERDROLA S A SA		－	693.76	13	2,200	公益事業
TELEFONICA SA		674.94	674.94	251	39,827	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA		37.6	37.6	72	11,402	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		663.5	726.7	611	96,730	金融
IBERDROLA SA		683.12	693.76	807	127,752	公益事業
REPSOL SA		192.2	202.98	265	42,033	エネルギー
GRIFOLS SA		27.95	27.95	29	4,664	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		1,904.26	1,888.91	735	116,287	金融
AMADEUS IT GROUP SA		62.73	55.29	352	55,700	一般消費財・サービス
NATURGY ENERGY GROUP SA		16.68	16.68	45	7,124	公益事業
CAIXABANK SA		503.78	632.59	248	39,309	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		29.53	29.53	116	18,471	資本財・サービス
AENA SME SA		8.66	8.66	142	22,502	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA		68.12	86.85	304	48,171	コミュニケーション・サービス
ACCIONA SA		2.91	2.91	37	5,858	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		129.87	115.47	436	69,068	一般消費財・サービス
ENAGAS SA		32.18	32.18	50	8,010	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		66.58	66.58	99	15,662	公益事業
FERROVIAL SA		53.67	－	－	－	資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA		30.29	30.29	52	8,256	公益事業
国小計	株数、金額	5,879.5	6,031.44	4,691	742,165	
	銘柄数<比率>	21銘柄	20銘柄		< 0.7%>	
ユーロ（イタリア）		百株	百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA		29.49	29.49	120	19,081	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		129.44	123.17	242	38,347	金融
MEDIOBANCA SPA		74.65	74.65	84	13,327	金融
UNICREDIT SPA		238.87	213.13	544	86,164	金融
TELECOM ITALIA SPA		1,085.03	1,085.03	31	4,983	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO		1,956.59	2,007.12	553	87,542	金融
POSTE ITALIANE SPA		64.65	64.65	66	10,503	金融
MONCLER SPA		24.35	24.35	131	20,855	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		12.85	12.85	62	9,944	ヘルスケア
ENI SPA		288.95	285.03	425	67,294	エネルギー
BANCO BPM SPA		－	161.17	78	12,419	金融
DIASORIN SPA		2.77	2.77	25	3,985	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		82.39	33.08	38	6,018	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA		65.11	65.11	47	7,550	金融
AMPLIFON SPA		14.4	14.4	45	7,210	ヘルスケア
LEONARDO SPA		－	53.81	88	14,011	資本財・サービス
ENEL SPA		954.39	997.75	668	105,739	公益事業
SNAM SPA		243	243	117	18,533	公益事業
TERNA SPA		158.15	228.41	176	27,852	公益事業
FINECOBANK SPA		80.77	80.77	109	17,313	金融
国小計	株数、金額	5,505.85	5,799.74	3,657	578,678	
	銘柄数<比率>	18銘柄	20銘柄		< 0.5%>	
ユーロ（フィンランド）		百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ		61.24	79.36	276	43,677	素材
NOKIA OYJ		672.62	646.81	207	32,779	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		82.27	82.27	109	17,258	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		59.11	79.11	99	15,712	素材
ELISA OYJ		22.12	22.12	94	14,896	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		58.26	63.26	249	39,520	金融
FORTUM OYJ		44	44	60	9,647	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		34.7	34.7	63	10,098	生活必需品
KONE OYJ-B		45.41	45.41	206	32,614	資本財・サービス
NESTE OYJ		49.41	54.41	174	27,673	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		13.15	13.15	55	8,724	ヘルスケア
METSO CORPORATION		－	84.14	75	11,937	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP		－	350	401	63,575	金融
国小計	株数、金額	1,142.29	1,598.74	2,074	328,118	
	銘柄数<比率>	11銘柄	13銘柄		< 0.3%>	
ユーロ（オーストリア）		百株	百株	千ユーロ	千円	
VERBUND AG		8.76	8.76	75	11,980	公益事業
OMV AG		20.56	20.56	79	12,564	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		53.26	37.97	145	22,940	金融
VOESTALPINE AG		13.23	13.23	35	5,630	素材
国小計	株数、金額	95.81	80.52	335	53,115	
	銘柄数<比率>	4銘柄	4銘柄		< 0.0%>	
ユーロ（その他）		百株	百株	千ユーロ	千円	
DSM FIRMENICH AG		－	23	202	32,088	素材
AEGON LTD		261.33	261.33	137	21,803	金融
国小計	株数、金額	261.33	284.33	340	53,892	
	銘柄数<比率>	1銘柄	2銘柄		< 0.0%>	
ユーロ通貨計	株数、金額	22,339.6	23,645.66	60,263	9,533,727	
	銘柄数<比率>	223銘柄	222銘柄		< 8.7%>	
ファンド合計	株数、金額	130,908.37	150,588.15	－	102,005,400	
	銘柄数<比率>	1,210銘柄	1,198銘柄		<92.9%>	

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

(2) 外国新株予約権証券

銘柄	当期末		
	証券数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(カナダ)	証券	千カナダ・ドル	千円
CONSTELLATION SOFTWARE IN-28	261	–	–

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

(3) 外国投資証券

銘柄		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC		1.52	1.96	358	51,928
SIMON PROPERTY GROUP INC		4.043	4.043	574	83,155
BOSTON PROPERTIES INC		1.658	1.658	118	17,109
SBA COMMUNICATIONS CORP		1.229	1.365	335	48,502
EQUITY RESIDENTIAL		3.833	4.626	284	41,184
EQUINIX INC		1.047	1.186	947	137,057
AMERICAN TOWER CORP		5.53	6.057	1,283	185,671
HOST HOTELS & RESORTS INC		7.895	7.895	156	22,663
AMERICAN HOMES 4 RENT- A		3.155	4.367	157	22,734
KIMCO REALTY CORP		7.054	7.054	146	21,168
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS		5.382	–	–	–
GAMING AND LEISURE PROPERTIE		3	3	143	20,700
INVITATION HOMES INC		7.588	7.588	257	37,219
VICI PROPERTIES INC		11.867	12.388	392	56,730
VENTAS INC		4.401	5.394	260	37,641
WEYERHAEUSER CO		9.311	9.311	314	45,454
CROWN CASTLE INTL CORP		5.062	5.583	635	91,895
IRON MOUNTAIN INC		3.16	4.072	273	39,557
SUN COMMUNITIES INC		1.461	1.887	254	36,878
PROLOGIS INC		10.966	11.937	1,588	229,833
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		2.02	2.237	287	41,540
CAMDEN PROPERTY TRUST		1.049	1.049	102	14,889
ESSEX PROPERTY TRUST INC		0.704	1.008	249	36,152
WELLTOWER INC		5.911	6.555	587	84,971
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		5.888	7.752	154	22,320
MID-AMERICA APARTMENT COMM		1.236	1.236	163	23,676
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		1.95	2.666	187	27,079
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		5.245	5.245	102	14,813
REALTY INCOME CORP		7.332	8.286	491	71,082
PUBLIC STORAGE		1.886	2.101	623	90,255
REGENCY CENTERS CORP		1.761	1.761	113	16,442
UDR INC		3.36	4.88	186	26,923
WP CAREY INC		2.131	2.562	171	24,766
DIGITAL REALTY TRUST INC		3.233	3.672	490	70,992
EXTRA SPACE STORAGE INC		1.825	2.689	424	61,484
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		6.944	–	–	–
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額	151.637	155.07	12,816	1,854,476
	銘柄数<比率>	36銘柄	34銘柄		<1.7%>
(カナダ)		千口	千口	千カナダ・ドル	千円
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		0.831	0.831	39	4,266
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		0.925	0.925	17	1,892
カナダ・ドル通貨計	口数、金額	1.756	1.756	56	6,159
	銘柄数<比率>	2銘柄	2銘柄		<0.0%>
(オーストラリア)		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU		12.537	12.537	95	9,211
LENDLEASE GROUP		6.942	–	–	–
TRANSURBAN GROUP		40.11	40.11	553	53,541
APA GROUP		13.286	24.008	207	20,055
SCENTRE GROUP		64.017	64.017	188	18,280
GPT GROUP		21.774	21.774	98	9,526
MIRVAC GROUP		43.513	43.513	88	8,550
STOCKLAND		40.622	40.622	177	17,223
GOODMAN GROUP		23.536	19.586	474	45,957
VICINITY CENTRES		50.371	50.371	102	9,898
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額	316.708	316.538	1,986	192,245
	銘柄数<比率>	10銘柄	9銘柄		<0.2%>
(香港)		千口	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT		25	37	1,581	29,278
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		33	–	–	–
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		36	36	336	6,230
香港ドル通貨計	口数、金額	94	73	1,918	35,508
	銘柄数<比率>	3銘柄	2銘柄		<0.0%>
(シンガポール)		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND ASCENDAS REIT		47.5	47.5	139	15,131
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		56.826	82.826	166	18,099
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		30	30	50	5,446
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS		37.6	37.6	56	6,172
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	171.926	197.926	412	44,850
	銘柄数<比率>	4銘柄	4銘柄		<0.0%>
(イギリス)		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC		7.946	7.946	55	10,191
SEGRO PLC		17.001	17.001	147	27,190
BRITISH LAND CO PLC		9.799	–	–	–
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	34.746	24.947	203	37,381
	銘柄数<比率>	3銘柄	2銘柄		<0.0%>
ユーロ (ベルギー)		千口	千口	千ユーロ	千円
WAREHOUSES DE PAUW SCA		1.846	1.846	50	7,937
国小計	口数、金額	1.846	1.846	50	7,937
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		<0.0%>
ユーロ (フランス)		千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		1.507	1.507	98	15,658
GECINA SA		0.578	0.578	60	9,601
KLEPIERRE		2.394	2.394	59	9,377
COVIVIO		0.353	0.353	16	2,628
国小計	口数、金額	4.832	4.832	235	37,265
	銘柄数<比率>	4銘柄	4銘柄		<0.0%>
ユーロ通貨計	口数、金額	6.678	6.678	285	45,202
	銘柄数<比率>	5銘柄	5銘柄		<0.0%>
合計	口数、金額	777.451	775.915	–	2,215,824
	銘柄数<比率>	63銘柄	58銘柄		<2.0%>

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

(4) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当期末 買建額	当期末 売建額
		百万円	百万円
外国	S&P500 EMINI FUT(アメリカ)	6,171	－
	S&P/TSX 60 IX FUT(カナダ)	357	－
	SPI 200 FUTURES(オーストラリア)	145	－
	FTSE 100 IDX FUT(イギリス)	282	－
	SWISS MKT IX FUTR(ドイツ)	266	－
	EURO STOXX 50(ドイツ)	1,037	－

（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

2024年１月10日現在

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
株式	102,005,400	91.4
投資証券	2,215,824	2.0
コール・ローン等、その他	7,348,031	6.6
投資信託財産総額	111,569,257	100.0

（注１）評価額の単位未満は切捨て。
（注２）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、１月10日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝144.69円、１カナダ・ドル＝108.09円、１オーストラリア・ドル＝96.80円、１香港ドル＝18.51円、１シンガポール・ドル＝108.72円、１ニュージーランド・ドル＝90.20円、１イギリス・ポンド＝183.96円、１イスラエル・シュケル＝38.749円、１スイス・フラン＝169.76円、１デンマーク・クローネ＝21.21円、１ノルウェー・クローネ＝13.98円、１スウェーデン・クローネ＝14.12円、１ユーロ＝158.20円です。
（注３）当期末における外貨建純資産（107,054,799千円）の投資信託財産総額（111,569,257千円）に対する比率は、96.0％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年１月10日現在

項目	当期末
(A) 資産	**217,713,657,824円**
コール・ローン等	2,858,290,255
株式(評価額)	102,005,400,837
投資証券(評価額)	2,215,824,657
未収入金	108,596,187,574
未収配当金	94,128,372
差入委託証拠金	1,943,826,129
(B) 負債	**107,896,667,487**
未払金	107,287,488,983
未払解約金	609,167,500
その他未払費用	11,004
(C) 純資産総額(A－B)	**109,816,990,337**
元本	38,587,545,398
次期繰越損益金	71,229,444,939
(D) 受益権総口数	**38,587,545,398口**
１万口当り基準価額(C／D)	**28,459円**

＊期首における元本額は31,688,848,448円、当作成期間中における追加設定元本額は13,270,148,149円、同解約元本額は6,371,451,199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）	26,007,321,453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）	1,232,029,212円
ｉＦｒｅｅ　外国株式インデックス（為替ヘッジあり）	3,317,753,079円
ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）	607,356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）	8,029,834,298円

＊当期末の計算口数当りの純資産額は28,459円です。

■損益の状況

当期　自2023年１月11日　至2024年１月10日

項目	当期
(A) 配当等収益	**1,816,901,257円**
受取配当金	1,735,048,634
受取利息	17,747,900
その他収益金	65,208,642
支払利息	△ 1,103,919
(B) 有価証券売買損益	**10,013,615,923**
売買益	34,635,486,585
売買損	△24,621,870,662
(C) 先物取引等損益	**338,412,046**
取引益	1,164,832,217
取引損	△ 826,420,171
(D) その他費用	**△ 18,475,421**
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	**12,150,453,805**
(F) 前期繰越損益金	**47,785,450,698**
(G) 解約差損益金	**△10,728,379,688**
(H) 追加信託差損益金	**22,021,920,124**
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	**71,229,444,939**
次期繰越損益金(I)	**71,229,444,939**

（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。

《お知らせ》
■ベンチマークの変更について
ベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。
変更前：ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）
変更後：ＭＳＣＩコクサイ指数（配当込み、円ヘッジ・ベース）

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８期

（決算日　2024年６月17日）

（作成対象期間　2023年６月16日～2024年６月17日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型		
信託期間	無期限（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（配当込み、円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券	
	外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式（預託証書を含みます。）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	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。		

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、ＭＳＣＩコクサイ指数（配当込み、円ベース）に連動する投資成果をあげ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/

<5695>

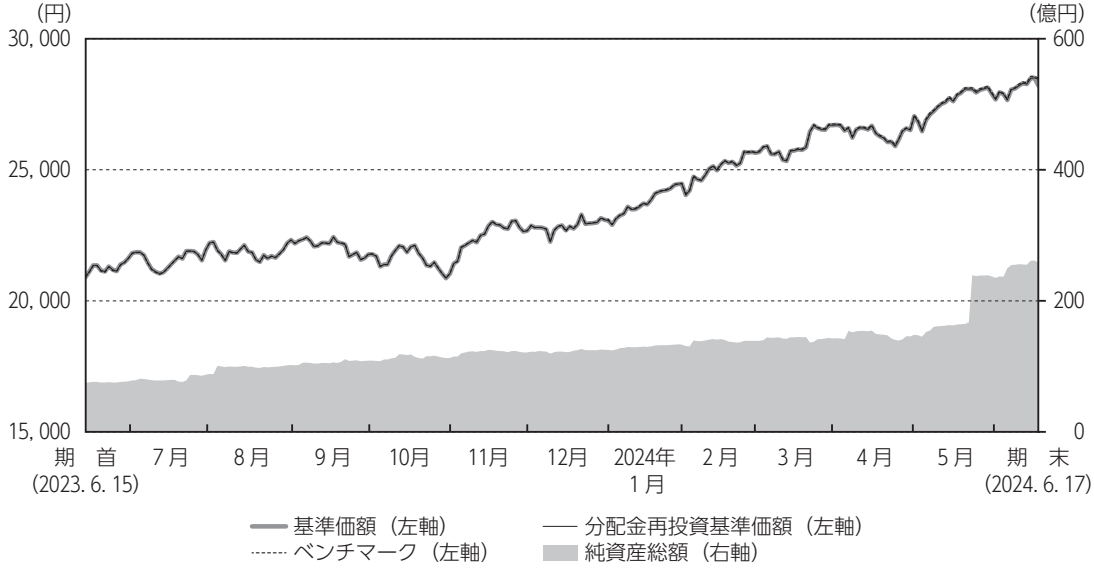
最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ＭＳＣＩコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資証券組入比率	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
4期末（2020年6月15日）	11,489	0	1.6	11,937	1.8	96.5	0.6	2.7	223
5期末（2021年6月15日）	16,693	140	46.5	17,530	46.9	92.6	5.9	2.3	10,845
6期末（2022年6月15日）	17,240	190	4.4	18,327	4.5	95.1	3.4	2.5	6,056
7期末（2023年6月15日）	20,912	220	22.6	22,523	22.9	94.7	4.3	2.1	7,477
8期末（2024年6月17日）	28,215	250	36.1	30,700	36.3	94.4	4.6	1.8	25,879

（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（税引後配当込み、円ベース）は、ＭＳＣＩ Ｉｎｃ.（「ＭＳＣＩ」）の承諾を得て、ＭＳＣＩコクサイ指数（税引後配当込み、米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日の前営業日を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（税引後配当込み、米ドルベース）は、ＭＳＣＩが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はＭＳＣＩに帰属します。またＭＳＣＩは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。本ファンドは、ＭＳＣＩによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、ＭＳＣＩは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html]
（注３）海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
（注４）指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
（注５）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（税引後配当込み、円ベース）です。

■基準価額・騰落率

期　首：20,912円
期　末：28,215円（分配金250円）
騰落率：36.1%（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、海外株式市況が上昇し、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（税引後配当込み、円ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資証券組入比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率			
	円	%		%	%	%	%
（期首）2023年６月15日	20,912	—	22,523	—	94.7	4.3	2.1
６月末	21,624	3.4	23,283	3.4	92.8	5.1	2.0
７月末	21,945	4.9	23,636	4.9	91.9	6.3	2.0
８月末	22,320	6.7	24,037	6.7	90.3	7.8	1.9
９月末	21,775	4.1	23,451	4.1	92.2	6.0	1.9
10月末	21,034	0.6	22,664	0.6	90.7	7.6	1.9
11月末	22,675	8.4	24,430	8.5	89.8	8.2	1.9
12月末	23,071	10.3	24,885	10.5	92.3	5.6	2.0
2024年１月末	24,472	17.0	26,373	17.1	91.2	6.9	1.9
２月末	25,646	22.6	27,647	22.8	90.3	8.0	1.8
３月末	26,703	27.7	28,803	27.9	93.4	4.7	1.9
４月末	27,049	29.3	29,177	29.5	94.2	4.2	1.8
５月末	27,679	32.4	29,864	32.6	91.7	6.5	1.8
（期末）2024年６月17日	28,465	36.1	30,700	36.3	94.4	4.6	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

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より、米国のインフレ警戒感の後退や中国の経済対策への期待から、上昇しました。2023年８月以降は、米国国債の増発やＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）の政策金利見通しの引き上げ、米国政府機関の閉鎖懸念などから長期金利が大幅に上昇したことを受け、株価は下落しました。10月に入ると、つなぎ予算の成立により政府機関の閉鎖が回避され一時的に反発しましたが、景気の先行き不透明感や企業業績の伸びの鈍化、パレスチナ情勢の悪化、長期金利のさらなる上昇などが嫌気され、続落しました。11月以降は、欧米のインフレ率が予想以上に鈍化し金利が低下したことや、ＦＲＢ議長の発言を受けて利下げ観測が高まったことなどが好感され、急上昇しました。2024年１月に入ると、台湾の半導体企業が強気見通しを出したことが好感され、株価は続伸しました。４月以降は、米国の利下げ期待が後退したことや、中東情勢への懸念が高まったことなどの影響により株価は下落しましたが、米国の半導体関連株の買い戻しや中東情勢への懸念の後退を主因に下げ幅を縮小しました。６月に入ると、欧米の経済指標の下振れにより利下げ期待が高まったため、株価は上昇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、ＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）が政策金利の据え置きを発表したものの、金融引き締め環境の長期化や底堅い米国経済見通しを示唆したこと、米国国債の需給悪化などが嫌気されたことで長期金利が上昇したことなどから、投資対象通貨は対円で上昇（円安）しました。しかし2023年11月以降は、米国金利の大幅な低下を背景に日米金利差の縮小が意識され、対円で下落（円高）しました。2024年に入ると、米国金利の上昇を背景に日米金利差の拡大が意識され、対円で上昇しました。３月には、日銀がマイナス金利の解除など大規模な金融緩和の終了を発表したものの、他国・地域に比べて緩和的な環境が続く見通しなどから、投資対象通貨は対円で上昇しました。５月に入ると、日銀が為替介入を行ったことなどから一時的に円が強含む場面も見られましたが、引き続き日銀の相対的に緩和的な金融政策が意識され、円安基調が継続したまま当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■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

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

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

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

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

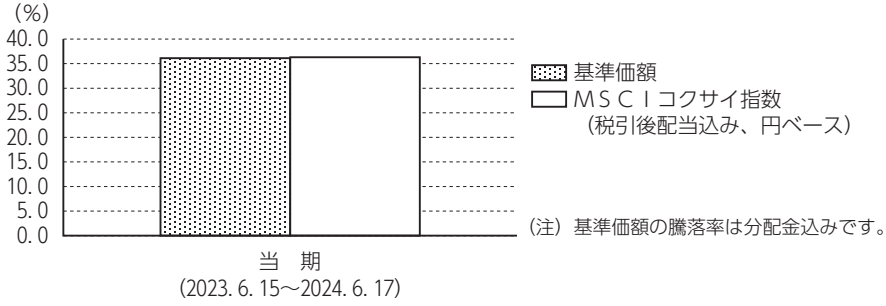
組入ファンド	ベンチマーク
外国株式インデックスマザーファンド	ＭＳＣＩコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）

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36. 3％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は36. 1％となりました。

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ＭＳＣＩコクサイ指数（税引後配当込み、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
		2023年６月16日 ～2024年６月17日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**250**
対基準価額比率	（％）	0.88
当期の収益	（円）	250
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	18,214

（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。
（注４）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。

■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	✓ 266.24円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	3,508.27
（ｃ）収益調整金	14,060.28
（ｄ）分配準備積立金	629.72
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	18,464.53
（ｆ）分配金	250.00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	18,214.53

（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

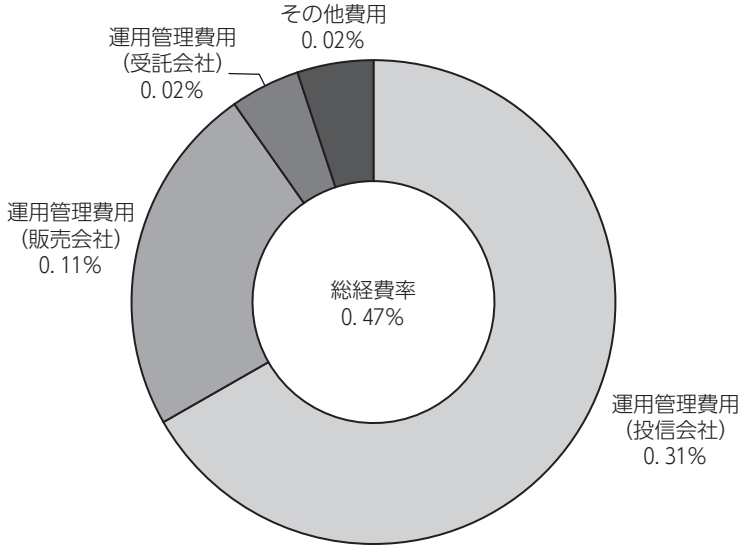
項　　目	当　期 (2023. 6. 16～2024. 6. 17)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	107円	0. 448%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は23, 846円です。**
(投 信 会 社)	(75)	(0. 315)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(26)	(0. 111)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(5)	(0. 022)	受託会社分は、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. 005	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. 001)	
(投 資 証 券)	(0)	(0. 000)	
有価証券取引税	2	0. 007	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株　　式)	(2)	(0. 007)	
(投 資 証 券)	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	6	0. 024	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(4)	(0. 018)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0. 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)	(0)	(0. 000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	115	0. 484	

(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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックスマザーファンド	3, 326, 218	19, 791, 070	950, 829	5, 396, 361

（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

（2023年６月16日から2024年６月17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	94, 594, 994千円
（ｂ）期中の平均組入株式時価総額	407, 627, 998千円
（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	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国株式インデックスマザーファンド	1, 555, 615	3, 931, 003	26, 105, 793

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年６月17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	26, 105, 793	99. 9
コール・ローン等、その他	37, 854	0. 1
投資信託財産総額	26, 143, 648	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17日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝157. 53円、１カナダ・ドル＝114. 69円、１オーストラリア・ドル＝104. 17円、１香港・ドル＝20. 16円、１シンガポール・ドル＝116. 47円、１ニュージーランド・ドル＝96. 66円、１イギリス・ポンド＝199. 87円、１イスラエル・シュケル＝42. 35円、１スイス・フラン＝176. 84円、１デンマーク・クローネ＝22. 60円、１ノルウェー・クローネ＝14. 77円、１スウェーデン・クローネ＝14. 97円、１ユーロ＝168. 64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（571, 269, 286千円）の投資信託財産総額（583, 500, 901千円）に対する比率は、97. 9％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年６月17日現在

項目	当期末
（Ａ）資産	**26, 143, 648, 114円**
コール・ローン等	36, 545, 362
外国株式インデックスマザーファンド（評価額）	26, 105, 793, 752
未収入金	1, 309, 000
（Ｂ）負債	**264, 546, 115**
未払収益分配金	229, 306, 510
未払信託報酬	34, 809, 947
その他未払費用	429, 658
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）	**25, 879, 101, 999**
元本	9, 172, 260, 424
次期繰越損益金	16, 706, 841, 575
（Ｄ）受益権総口数	**9, 172, 260, 424口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）	**28, 215円**

＊期首における元本額は3, 575, 653, 475円、当作成期間中における追加設定元本額は7, 956, 911, 859円、同解約元本額は2, 360, 304, 910円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は28, 215円です。

■損益の状況

当期　自 2023年６月16日　至 2024年６月17日

項　　目	当　　期
（Ａ）配当等収益	**4, 570円**
受取利息	6, 452
支払利息	△ 1, 882
（Ｂ）有価証券売買損益	**3, 520, 489, 619**
売買益	4, 101, 862, 581
売買損	△ 581, 372, 962
（Ｃ）信託報酬等	**△ 58, 409, 362**
（Ｄ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	**3, 462, 084, 827**
（Ｅ）前期繰越損益金	**577, 601, 314**
（Ｆ）追加信託差損益金	**12, 896, 461, 944**
（配当等相当額）	(6, 256, 410, 673)
（売買損益相当額）	(6, 640, 051, 271)
（Ｇ）合計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	**16, 936, 148, 085**
（Ｈ）収益分配金	**△ 229, 306, 510**
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	**16, 706, 841, 575**
追加信託差損益金	12, 896, 461, 944
（配当等相当額）	(6, 256, 410, 673)
（売買損益相当額）	(6, 640, 051, 271)
分配準備積立金	3, 810, 379, 631

（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	244, 206, 416円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	3, 217, 878, 411
（ｃ）収益調整金	12, 896, 461, 944
（ｄ）分配準備積立金	577, 601, 314
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	16, 936, 148, 085
（ｆ）分配金	229, 306, 510
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	16, 706, 841, 575
（ｈ）受益権総口数	9, 172, 260, 424口

収　益　分　配　金　の　お　知　ら　せ	
１万口当り分配金（税込み）	250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（2023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（2024年６月17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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
MICROSOFT CORP（アメリカ）	74	4, 415, 376	59, 667	CRH PLC（アイルランド）	37. 808	462, 179	12, 224
NVIDIA CORP（アメリカ）	27. 9	3, 307, 935	118, 564	APPLE INC（アメリカ）	14	383, 118	27, 365
APPLE INC（アメリカ）	114. 8	3, 160, 860	27, 533	NORDEA BANK ABP（フィンランド）	167. 488	279, 388	1, 668
AMAZON. COM INC（アメリカ）	105	2, 635, 489	25, 099	JOHNSON & JOHNSON（アメリカ）	8. 8	215, 291	24, 464
META PLATFORMS INC CLASS A（アメリカ）	22. 1	1, 401, 669	63, 423	FERROVIAL SA（スペイン）	23. 057	104, 629	4, 537
ALPHABET INC-CL A（アメリカ）	59. 3	1, 307, 593	22, 050	NEWCREST MINING LTD（オーストラリア）	40. 32	89, 555	2, 221
BROADCOM INC（アメリカ）	5. 8	966, 446	166, 628	BLACK KNIGHT INC（アメリカ）	7. 65	86, 679	11, 330
TESLA INC（アメリカ）	30. 5	936, 092	30, 691	BORGWARNER INC（アメリカ）	13. 1	73, 566	5, 615
ALPHABET INC-CL C（アメリカ）	41. 6	934, 208	22, 456	CNH INDUSTRIAL NV（オランダ）	47. 963	73, 378	1, 529
ELI LILLY & CO（アメリカ）	8. 6	913, 318	106, 199	INVESTOR CLASS A（スウェーデン）	23. 863	68, 354	2, 864

（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、2024年６月17日現在における外国株式インデックスマザーファンド（87, 815, 492千口）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	2024年６月17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	68	1, 326	209, 024	資本財・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	185	5, 870	924, 738	情報技術
FIRST SOLAR INC	59	1, 614	254, 300	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	100	1, 359	214, 209	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	75	1, 128	177, 717	資本財・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	233	971	153, 021	金融
ABBOTT LABORATORIES	991. 66	10, 281	1, 619, 649	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	221. 83	1, 751	275, 854	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	82	2, 167	341, 498	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	213	921	145, 120	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	688	4, 696	739, 914	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	28	2, 258	355, 765	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	329	2, 519	396, 842	金融
QORVO INC	54. 2	609	95, 951	情報技術
AFLAC INC	313	2, 724	429, 167	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	69	1, 026	161, 717	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	92	816	128, 623	コミュニケーション・サービス

銘柄	2024年6月17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	
ADOBE INC	256.2	13,458	2,120,108	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	108	791	124,638	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	66	2,019	318,157	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	88	1,403	221,150	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	128	3,521	554,787	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	373	7,778	1,225,294	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	117.42	917	144,555	金融
AUTOZONE INC	10.2	2,892	455,661	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	118.71	1,258	198,280	生活必需品
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	679	1,165	183,548	ヘルスケア
CELANESE CORP	64.5	899	141,629	素材
DR HORTON INC	171.16	2,443	384,975	一般消費財・サービス
AUTODESK INC	123	2,778	437,650	情報技術
MOODY'S CORP	94	3,836	604,336	金融
DEVON ENERGY CORP	363	1,653	260,527	エネルギー
ALBEMARLE CORP	68	703	110,880	素材
ATMOS ENERGY CORP	87	1,010	159,184	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	147	732	115,414	公益事業
CITIGROUP INC	1,095.73	6,500	1,024,097	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	235	5,701	898,168	資本財・サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	301	2,648	417,265	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	20.3	1,058	166,739	一般消費財・サービス
HESS CORP	158	2,266	357,043	エネルギー
DAVITA INC	31.5	444	70,046	ヘルスケア
DANAHER CORP	402.5	10,257	1,615,897	ヘルスケア
FORTIVE CORP	201	1,461	230,288	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	328	4,449	701,004	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	296	1,761	277,441	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	176.95	2,607	410,737	情報技術
APPLE INC	8,382	178,109	28,057,529	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	144	1,756	276,748	金融
BOEING CO/THE	332	5,885	927,121	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	90.15	1,012	159,438	金融
BECTON DICKINSON AND CO	165.99	3,879	611,166	ヘルスケア
LEIDOS HOLDINGS INC	74	1,063	167,514	資本財・サービス
NISOURCE INC	256	721	113,603	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	67	560	88,235	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	431.71	2,504	394,578	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,403.04	9,532	1,501,711	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	749.5	30,395	4,788,159	金融
ANSYS INC	50	1,615	254,544	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	763.17	2,702	425,706	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	409	4,959	781,210	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,158	4,770	751,569	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	1,640.7	31,793	5,008,427	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	128	1,470	231,682	金融
LKQ CORP	153	616	97,107	一般消費財・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	170.12	742	117,004	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	156	4,868	766,975	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	58	2,458	387,269	金融
DOLLAR GENERAL CORP	126	1,584	249,677	生活必需品
SERVICENOW INC	118	8,597	1,354,323	情報技術
CATERPILLAR INC	286	9,194	1,448,337	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	2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BROWN & BROWN INC	139	1, 252	197, 245	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	149	553	87, 151	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	30	628	98, 993	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	171	1, 020	160, 682	公益事業
MOSAIC CO/THE	182	494	77, 868	素材
DELTA AIR LINES INC	93	453	71, 376	資本財・サービス
CORNING INC	464	1, 728	272, 274	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	2, 313. 5	10, 568	1, 664, 787	情報技術
MORGAN STANLEY	701. 52	6, 699	1, 055, 374	金融
DECKERS OUTDOOR CORP	15	1, 535	241, 907	一般消費財・サービス
MSCI INC	46	2, 210	348, 210	金融
FAIR ISAAC CORP	15	2, 085	328, 589	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	19	1, 014	159, 829	資本財・サービス
MANHATTAN ASSOCIATES INC	36	823	129, 776	情報技術
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	128	776	122, 374	資本財・サービス
BROADCOM INC	252. 12	43, 743	6, 890, 965	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	26	748	117, 983	ヘルスケア
CNH INDUSTRIAL NV	556	578	91, 090	資本財・サービス
DICK'S SPORTING GOODS INC	34	735	115, 840	一般消費財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	73	1, 170	184, 443	ヘルスケア
DTE ENERGY COMPANY	119	1, 334	210, 218	公益事業
CENTENE CORP	306. 07	2, 109	332, 347	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	61	1, 022	161, 052	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	259	882	139, 006	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	124	3, 202	504, 438	金融
GARTNER INC	44. 5	1, 923	302, 982	情報技術
DOMINION ENERGY INC	479. 41	2, 417	380, 854	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	446	2, 142	337, 450	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	70	577	90, 929	資本財・サービス
DEERE & CO	152	5, 745	905, 104	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC	84	2, 295	361, 631	資本財・サービス
POOL CORP	22	750	118, 286	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	147. 84	1, 392	219, 314	金融
BURLINGTON STORES INC	37	843	132, 903	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	233	1, 365	215, 088	金融
TARGA RESOURCES CORP	121	1, 439	226, 827	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	41	508	80, 178	金融
WESTLAKE CORP	23	344	54, 286	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	198	1, 799	283, 432	公益事業
TELEFLEX INC	27	562	88, 592	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	48	754	118, 911	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	42	1, 399	220, 486	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	12	338	53, 357	ヘルスケア
CATALENT INC	104	576	90, 893	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	88	1, 625	256, 042	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	34	1, 043	164, 451	ヘルスケア
CARLISLE COS INC	28	1, 134	178, 771	資本財・サービス
IDEX CORP	44	872	137, 399	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	447	4, 229	666, 275	生活必需品
ROLLINS INC	166. 07	805	126, 880	資本財・サービス
AECOM	78	675	106, 396	資本財・サービス
WATSCO INC	20	955	150, 595	資本財・サービス
GRACO INC	97	769	121, 158	資本財・サービス

銘柄	2024年6月17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	
AMETEK INC	133	2, 221	349, 931	資本財・サービス
TORO CO	60	579	91, 313	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	140	1, 507	237, 523	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	90. 5	423	66, 663	資本財・サービス
HEICO CORP	26	585	92, 224	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	22	883	139, 229	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	149	1, 393	219, 556	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	25	1, 179	185, 802	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	253. 6	21, 699	3, 418, 368	生活必需品
EPAM SYSTEMS INC	34	603	95, 112	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	74	823	129, 733	素材
RELIANCE INC	33	914	144, 044	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	16	5, 234	824, 627	一般消費財・サービス
CUMMINS INC	79	2, 105	331, 630	資本財・サービス
CDW CORP/DE	77	1, 718	270, 725	情報技術
COSTAR GROUP INC	234	1, 729	272, 520	不動産
OLD DOMINION FREIGHT LINE	112	1, 934	304, 771	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	26. 9	4, 255	670, 440	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	42	678	106, 898	金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	144. 16	3, 031	477, 626	一般消費財・サービス
DEXCOM INC	221	2, 562	403, 669	ヘルスケア
NORDSON CORP	31. 9	729	114, 936	資本財・サービス
COPART INC	495	2, 633	414, 917	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	97	1, 803	284, 169	エネルギー
ALIGN TECHNOLOGY INC	41	1, 049	165, 349	ヘルスケア
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	43	1, 191	187, 749	金融
TRANSDIGM GROUP INC	31. 9	4, 130	650, 643	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	90. 2	684	107, 805	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	57	772	121, 623	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	1, 141. 81	2, 236	352, 364	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	114	3, 847	606, 042	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	22	440	69, 389	金融
COTERRA ENERGY INC	430	1, 149	181, 063	エネルギー
T-MOBILE US INC	306. 27	5, 390	849, 093	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	90. 5	434	68, 431	不動産
EMCOR GROUP INC	29	1, 093	172, 318	資本財・サービス
COCA-COLA CO/THE	2, 340. 5	14, 639	2, 306, 212	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	122	903	142, 314	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	81. 5	1, 005	158, 416	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	165	360	56, 741	金融
CSX CORP	1, 119	3, 600	567, 256	資本財・サービス
EXPEDIA GROUP INC	74. 25	925	145, 751	一般消費財・サービス
AMAZON. COM INC	5, 352	98, 294	15, 484, 384	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	344	3, 002	473, 027	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	2, 562. 09	27, 954	4, 403, 745	エネルギー
AES CORP	408	789	124, 302	公益事業
EVEREST GROUP LTD	25	918	144, 754	金融
EOG RESOURCES INC	332	3, 925	618, 394	エネルギー
EQT CORP	241	948	149, 353	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	87	775	122, 098	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	6	979	154, 237	金融
CENCORA INC	103	2, 395	377, 293	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	168	2, 181	343, 648	ヘルスケア

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2024年6月17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	
FORD MOTOR CO	2, 229. 23	2, 610	411, 220	一般消費財・サービス
EXACT SCIENCES CORP	104	435	68, 612	ヘルスケア
ENTEGRIS INC	87	1, 164	183, 511	情報技術
MICROSTRATEGY INC-CL A	10	1, 495	235, 592	情報技術
AERCAP HOLDINGS NV	119	1, 059	166, 896	資本財・サービス
FORTINET INC	371	2, 254	355, 220	情報技術
MARKEL CORP	7. 3	1, 127	177, 563	金融
NEXTERA ENERGY INC	1, 173. 8	8, 575	1, 350, 943	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC	820. 08	3, 945	621, 519	素材
INSULET CORP	41	821	129, 465	ヘルスケア
US BANCORP	891	3, 459	545, 014	金融
UNITED RENTALS INC	39	2, 403	378, 579	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	34	569	89, 756	情報技術
SUPER MICRO COMPUTER INC	31	2, 618	412, 425	情報技術
FASTENAL CO	328	2, 068	325, 778	資本財・サービス
FISERV INC	337. 33	5, 024	791, 461	金融
GENERAL ELECTRIC CO	625. 06	9, 743	1, 534, 883	資本財・サービス
AXON ENTERPRISE INC	41	1, 198	188, 808	資本財・サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP	26	361	57, 025	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	761	3, 559	560, 680	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	134	3, 909	615, 918	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	185. 5	8, 281	1, 304, 637	金融
ALPHABET INC-CL A	3, 367	59, 525	9, 377, 003	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	2, 915. 4	52, 001	8, 191, 873	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	50	882	139, 083	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	323	2, 115	333, 278	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	312. 18	1, 210	190, 662	公益事業
GENUINE PARTS CO	80. 5	1, 100	173, 351	一般消費財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	391	1, 377	216, 934	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	109. 5	2, 381	375, 125	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	509	1, 675	263, 961	エネルギー
REPLIGEN CORP	31	389	61, 345	ヘルスケア
HOME DEPOT INC	566. 5	19, 648	3, 095, 225	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	30. 5	504	79, 536	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	833	1, 030	162, 322	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	23. 1	550	86, 774	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	86	1, 608	253, 312	生活必需品
HUMANA INC	69	2, 476	390, 141	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	147	3, 952	622, 573	情報技術
HENRY SCHEIN INC	74	486	76, 704	ヘルスケア
HP INC	561	1, 992	313, 817	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	743	1, 604	252, 816	情報技術
ARCH CAPITAL GROUP LTD	215	2, 091	329, 409	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	522. 03	1, 690	266, 278	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	78	971	153, 112	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	524	8, 866	1, 396, 756	情報技術
HUBBELL INC	31	1, 161	183, 001	資本財・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	189	848	133, 651	素材
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	73	491	77, 427	資本財・サービス
ZOETIS INC	262	4, 468	703, 908	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	129. 99	4, 284	675, 014	資本財・サービス
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	79	475	74, 943	情報技術
CHENIERE ENERGY INC	132	2, 057	324, 136	エネルギー

銘柄	2024年6月17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	
HYATT HOTELS CORP - CL A	26	383	60,400	一般消費財・サービス
ALLEGION PLC	49.5	575	90,734	資本財・サービス
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	70	1,046	164,910	資本財・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	147.37	2,484	391,431	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	169	599	94,403	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	61	680	107,220	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	1,378	20,055	3,159,329	ヘルスケア
ABBVIE INC	1,012.72	17,073	2,689,580	ヘルスケア
HOLOGIC INC	133	954	150,410	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	193	2,692	424,095	生活必需品
KROGER CO	392	1,974	311,105	生活必需品
KLA CORP	78	6,433	1,013,508	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	124	5,683	895,308	資本財・サービス
CORPAY INC	40	998	157,315	金融
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	123	532	83,821	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	327	7,303	1,150,527	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	461.85	40,571	6,391,183	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	75.8	7,852	1,237,040	情報技術
LOEWS CORP	108	796	125,540	金融
MCDONALD'S CORP	412.5	10,460	1,647,791	一般消費財・サービス
3M CO	315.9	3,187	502,116	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	1,252	63,120	9,943,424	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	183.39	7,966	1,254,956	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	36	2,040	321,465	素材
PHILLIPS 66	245	3,350	527,823	エネルギー
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	91	1,456	229,492	情報技術
MGM RESORTS INTERNATIONAL	152.5	607	95,732	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	144	976	153,777	生活必需品
METLIFE INC	350	2,399	377,953	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	495	3,626	571,340	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	152	4,993	786,578	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	95.98	3,603	567,609	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	13	1,891	297,914	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	572.23	1,779	280,255	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	66	1,678	264,488	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	1,447.21	18,738	2,951,871	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	238.51	1,899	299,302	素材
MASCO CORP	125	864	136,145	資本財・サービス
M & T BANK CORP	95.99	1,364	214,994	金融
MARSH & MCLENNAN COS	281.7	5,884	926,930	金融
HEICO CORP-CLASS A	43.2	765	120,596	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	141.02	3,376	531,935	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	121	2,534	399,292	情報技術
BLOCK INC CLASS A	318.12	1,977	311,455	金融
TRANSUNION	111	796	125,530	資本財・サービス
VISTRA CORP	200	1,751	275,961	公益事業
NETAPP INC	118	1,488	234,531	情報技術
NIKE INC -CL B	693	6,471	1,019,522	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	130	2,858	450,331	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	309	2,822	444,662	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	114.05	1,319	207,816	金融
ALLY FINANCIAL INC	157	608	95,911	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	81	3,435	541,135	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	2024年6月17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	
APTIV PLC	157	1, 103	173, 867	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	659. 11	2, 690	423, 832	素材
MCKESSON CORP	76	4, 483	706, 304	ヘルスケア
XYLEM INC	139	1, 918	302, 217	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	888	9, 075	1, 429, 641	生活必需品
NUCOR CORP	138	2, 134	336, 282	素材
GODADDY INC - CLASS A	78	1, 072	168, 987	情報技術
EVERGY INC	131. 5	693	109, 251	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	380. 24	2, 275	358, 436	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	14. 5	507	79, 905	金融
OKTA INC	92	825	130, 087	情報技術
WIX. COM LTD	32. 1	525	82, 732	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	188	745	117, 514	金融
KKR & CO INC	356	3, 886	612, 288	金融
PAYCHEX INC	186	2, 269	357, 437	資本財・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	34	3, 424	539, 517	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	983	4, 356	686, 304	生活必需品
P G & E CORP	1, 159	2, 115	333, 203	公益事業
PFIZER INC	3, 227. 13	8, 884	1, 399, 542	ヘルスケア
CIGNA CORP	163	5, 432	855, 801	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	151. 01	2, 038	321, 098	情報技術
XCEL ENERGY INC	318	1, 709	269, 358	公益事業
STERIS PLC	57	1, 244	196, 007	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	222	1, 652	260, 259	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	81. 33	251	39, 640	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	136. 99	454	71, 602	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	195. 8	6, 754	1, 064, 069	ヘルスケア
DOW INC	402. 18	2, 212	348, 581	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	67	698	110, 094	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	142	819	129, 160	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	74	3, 724	586, 707	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	1, 072	7, 510	1, 183, 118	資本財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1, 344. 67	22, 427	3, 533, 043	生活必需品
EXELON CORP	572. 22	2, 033	320, 364	公益事業
INGERSOLL-RAND INC	231. 08	2, 113	332, 932	資本財・サービス
NVR INC	1. 8	1, 368	215, 567	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	672. 02	7, 351	1, 158, 038	エネルギー
TWILIO INC - A	99	536	84, 589	情報技術
DOCUSIGN INC	118	599	94, 504	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	30	428	67, 476	資本財・サービス
DAYFORCE INC	85	429	67, 606	資本財・サービス
PURE STORAGE INC - CLASS A	187	1, 265	199, 372	情報技術
PEPSICO INC	786	12, 875	2, 028, 272	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	26. 2	661	104, 143	情報技術
MONGODB INC	42	953	150, 189	情報技術
SNAP INC - A	599	933	147, 107	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	399. 68	2, 045	322, 237	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	206	2, 330	367, 055	金融
AMCOR PLC	826	822	129, 599	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	132	5, 087	801, 471	情報技術
ROKU INC	73	397	62, 684	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	112	1, 448	228, 128	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	360	10, 321	1, 625, 955	情報技術

銘柄	2024年6月17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	
PENTAIR PLC	94.75	732	115,422	資本財・サービス
QUALCOMM INC	638	13,738	2,164,155	情報技術
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	135	1,034	163,029	金融
DATADOG INC - CLASS A	158	1,861	293,300	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	341	1,483	233,725	コミュニケーション・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	62	6,426	1,012,354	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	127	2,395	377,399	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	20	7,718	1,215,848	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	192	2,801	441,376	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	51.3	937	147,628	素材
RESMED INC	85	1,799	283,507	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	63.3	872	137,459	ヘルスケア
MODERNA INC	187	2,618	412,501	ヘルスケア
HUBSPOT INC	27.8	1,625	256,064	情報技術
REVVITY INC	71	771	121,521	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	463.87	2,985	470,227	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	232.38	2,257	355,562	資本財・サービス
AVANTOR INC	389	843	132,853	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	135	527	83,045	金融
DYNATRACE INC	152	697	109,929	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	255	2,439	384,267	コミュニケーション・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	524.85	978	154,197	金融
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	217	584	92,023	ヘルスケア
MATCH GROUP INC	151	476	75,048	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	1,002.18	15,290	2,408,674	エネルギー
ZSCALER INC	52	957	150,904	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	220	1,610	253,720	公益事業
ETSY INC	67	394	62,134	一般消費財・サービス
TESLA INC	1,638.5	29,166	4,594,667	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	173	2,200	346,572	情報技術
GEN DIGITAL INC	328	799	126,022	情報技術
UNITY SOFTWARE INC	156	255	40,302	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	88.02	735	115,848	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	88	5,193	818,186	情報技術
CLOUDFLARE INC - CLASS A	171	1,292	203,621	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	54.05	1,493	235,221	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	667.21	678	106,892	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	162.5	1,820	286,832	一般消費財・サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	272	954	150,397	コミュニケーション・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	253	3,693	581,764	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	175	1,520	239,563	不動産
SOUTHERN CO/THE	624	4,907	773,119	公益事業
SYSCO CORP	285	2,014	317,370	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	131.03	2,697	424,898	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	34	241	38,059	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	64	412	64,957	金融
STEEL DYNAMICS INC	86.5	1,043	164,456	素材
SCHLUMBERGER LTD	813.52	3,498	551,061	エネルギー
AT&T INC	4,087.91	7,211	1,135,960	コミュニケーション・サービス
APA CORP	210	584	92,032	エネルギー
SOUTHWEST AIRLINES CO	86.5	245	38,671	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	245	1,763	277,767	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	124	446	70,379	一般消費財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	138	4,098	645,630	素材
SEMPRA ENERGY	362	2,750	433,225	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	119	597	94,086	情報技術
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	1,088	2,564	403,972	情報技術
UIPATH INC - CLASS A	253	291	45,992	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	114.5	1,189	187,334	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	107	2,616	412,122	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC	521	10,102	1,591,397	情報技術
SALESFORCE. COM INC	554.66	12,864	2,026,589	情報技術
WESTROCK CO	147	730	114,997	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	228.09	2,642	416,332	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	390.34	2,710	426,926	資本財・サービス
TERADYNE INC	88	1,276	201,091	情報技術
UNION PACIFIC CORP	348.8	7,746	1,220,360	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	330	900	141,918	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	210.88	3,586	564,971	エネルギー
RTX CORP	798.79	8,325	1,311,561	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	417	5,656	891,084	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	104.04	2,213	348,684	ヘルスケア
AMEREN CORPORATION	153	1,072	169,003	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	527.66	26,231	4,132,174	ヘルスケア
APPLOVIN CORP CLASS A	103	798	125,780	情報技術
TOAST INC CLASS A	201	456	71,939	金融
VERISIGN INC	52	937	147,702	情報技術
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	418	454	71,642	一般消費財・サービス
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	305	683	107,720	金融
VALERO ENERGY CORP	189.42	2,842	447,798	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	28	1,094	172,384	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	148.88	718	113,231	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	34.3	644	101,500	ヘルスケア
ELEVANCE HEALTH INC	133	7,112	1,120,506	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	1,048.62	10,483	1,651,395	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	2,018.22	11,584	1,824,919	金融
WASTE MANAGEMENT INC	230	4,683	737,826	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	697	2,869	452,040	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	62	1,737	273,716	一般消費財・サービス
WALMART INC	2,533	16,976	2,674,255	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	118	1,264	199,250	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	57	506	79,735	一般消費財・サービス
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	1,273	458	72,192	資本財・サービス
CELSIUS HOLDINGS INC	87	521	82,175	生活必需品
WABTEC CORP	101.11	1,620	255,355	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	648	7,030	1,107,561	一般消費財・サービス
WATERS CORP	34	1,002	157,970	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	30	904	142,424	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	420	653	102,882	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	58.63	1,496	235,776	金融
WILLIAMS-SONOMA INC	35	1,055	166,299	一般消費財・サービス
WESTERN DIGITAL CORP	187	1,460	230,126	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	181	1,427	224,852	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	285	2,070	326,124	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	904.5	24,481	3,856,522	金融
PPL CORP	422	1,184	186,669	公益事業

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	180. 24	3, 873	610, 170	公益事業
PULTEGROUP INC	120. 5	1, 374	216, 569	一般消費財・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	1, 324. 53	958	151, 064	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC	135	1, 718	270, 765	素材
NORTHERN TRUST CORP	117	955	150, 489	金融
FERGUSON PLC	116	2, 337	368, 155	資本財・サービス
NVIDIA CORP	14, 298	188, 562	29, 704, 175	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	228. 13	3, 446	542, 976	金融
DRAFTKINGS INC CLASS A	245	953	150, 172	一般消費財・サービス
ASPEN TECHNOLOGY CORP	17	336	52, 933	情報技術
TYSON FOODS INC-CL A	164	885	139, 431	生活必需品
NETFLIX INC	247. 9	16, 593	2, 614, 041	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	218	12, 470	1, 964, 507	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	125. 5	986	155, 471	公益事業
TEXTRON INC	109	929	146, 380	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	211. 87	573	90, 381	コミュニケーション・サービス
TEXAS PACIFIC LAND CORP	11. 5	862	135, 869	エネルギー
OMNICOM GROUP	112	990	155, 984	コミュニケーション・サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	72. 2	997	157, 184	資本財・サービス
ORACLE CORP	942. 33	13, 016	2, 050, 474	情報技術
MASTERCARD INC - A	476	21, 164	3, 334, 026	金融
ONEOK INC	334	2, 608	410, 923	エネルギー
ROPER TECHNOLOGIES INC	62	3, 406	536, 640	情報技術
U HAUL NON VOTING SERIES N	56	339	53, 459	資本財・サービス
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	104	1, 379	217, 289	金融
CHESAPEAKE ENERGY CORP	64	544	85, 837	エネルギー
HF SINCLAIR CORP	94	490	77, 341	エネルギー
OVINTIV INC	155	710	111, 854	エネルギー
YUM! BRANDS INC	161	2, 202	346, 931	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	94	1, 494	235, 385	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	105	520	81, 925	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	4, 058. 01	15, 923	2, 508, 449	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	28	1, 090	171, 846	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	109	910	143, 393	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	329	7, 396	1, 165, 182	金融
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	248. 35	1, 899	299, 248	ヘルスケア
LINDE PLC	275. 46	12, 036	1, 896, 066	素材
ANALOG DEVICES INC	283. 91	6, 563	1, 033, 982	情報技術
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	198	396	62, 413	生活必需品
MONDAYCOM LTD	23	521	82, 094	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	924. 27	14, 754	2, 324, 216	情報技術
COREBRIDGE FINANCIAL INC	142	402	63, 416	金融
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	114	825	130, 072	コミュニケーション・サービス
CONFLUENT INC CLASS A	117	324	51, 182	情報技術
KENVUE INC	985	1, 779	280, 386	生活必需品
GLOBAL E ONLINE LTD	61	195	30, 749	一般消費財・サービス
VERALTO CORP	142. 16	1, 432	225, 624	資本財・サービス
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	389. 72	2, 861	450, 744	金融
BUNGE GLOBAL LTD	81	832	131, 210	生活必需品
VERTIV HOLDINGS CLASS A	208	1, 902	299, 745	資本財・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	92	960	151, 260	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	140	2, 079	327, 504	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	46. 3	1, 048	165, 222	素材

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2024年6月17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	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	285	1,831	288,502	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	327	3,481	548,400	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	114	3,367	530,473	金融
AMGEN INC	307	9,167	1,444,177	ヘルスケア
SAMSARA INC CLASS A	117	328	51,735	情報技術
EATON CORP PLC	229.36	7,317	1,152,653	資本財・サービス
COOPER INC	114	1,065	167,857	ヘルスケア
CONSTELLATION BRANDS INC-A	95	2,408	379,371	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	475	11,258	1,773,618	情報技術
CME GROUP INC	206	4,060	639,710	金融
ECOLAB INC	148	3,552	559,663	素材
EQUIFAX INC	71	1,715	270,231	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	713	4,638	730,746	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	619	2,107	331,927	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	173	527	83,066	生活必需品
CHORD ENERGY CORP	36	584	92,109	エネルギー
STATE STREET CORP	172.13	1,220	192,276	金融
SOLVENTUM CORP	84.72	462	72,815	ヘルスケア
GE VERNOVA	157.26	2,676	421,564	資本財・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	862.4	6,317	995,129	金融
CRH PUBLIC LIMITED PLC	416	3,184	501,651	素材
LABCORP HOLDINGS	49	979	154,286	ヘルスケア
BAXTER INTERNATIONAL INC	291	982	154,851	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	111	488	76,920	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	69.8	545	85,963	素材
CARDINAL HEALTH INC	139	1,392	219,404	ヘルスケア
FEDEX CORP	134	3,302	520,189	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	218.54	2,921	460,283	金融
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	146.13	1,381	217,629	素材
INTEL CORP	2,434	7,411	1,167,538	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	213	626	98,715	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	170.5	1,695	267,165	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	171	4,021	633,492	資本財・サービス
ILLUMINA INC	91	988	155,766	ヘルスケア
INTUITIVE SURGICAL INC	203	8,643	1,361,584	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	55.5	868	136,817	情報技術
SNAP-ON INC	31	812	128,063	資本財・サービス
CARMAX INC	90	629	99,116	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP	441.28	4,516	711,553	公益事業
TARGET CORP	264	3,726	587,055	生活必需品
DOVER CORP	79	1,400	220,585	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	26	2,357	371,401	資本財・サービス
JABIL INC	71	848	133,633	情報技術
CINTAS CORP	53	3,687	580,837	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	274	776	122,324	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	83	720	113,438	生活必需品
CLOROX COMPANY	71	949	149,538	生活必需品
ENTERGY CORP	122	1,305	205,678	公益事業
MICROSOFT CORP	4,034	178,532	28,124,262	情報技術
INCYTE CORP	110	683	107,626	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	718.69	4,327	681,782	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	758.98	6,150	968,931	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	633	8,948	1,409,592	情報技術

銘柄	2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BLACKROCK INC	86	6,616	1,042,255	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	362	1,116	175,924	公益事業
KELLOGG CO	157	903	142,259	生活必需品
KEYCORP	530	708	111,543	金融
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	769.11	5,064	797,824	生活必需品
CHUBB LTD	231.99	6,019	948,206	金融
ALLSTATE CORP	151	2,371	373,622	金融
EBAY INC	296	1,543	243,076	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	569.5	3,453	543,976	金融
EASTMAN CHEMICAL CO	68	676	106,595	素材
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	134	1,526	240,431	生活必需品
TRIMBLE INC	138	756	119,152	情報技術
LENNAR CORP-A	140	2,171	342,060	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	335	6,831	1,076,137	金融
PACCAR INC	299.55	3,196	503,591	資本財・サービス
BIOGEN INC	84	1,946	306,584	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	48	2,419	381,096	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	647	5,153	811,808	一般消費財・サービス
PTC INC	69	1,197	188,587	情報技術
EVERSOURCE ENERGY	200	1,180	185,916	公益事業
INTUIT INC	160.8	9,578	1,508,957	情報技術
BEST BUY CO INC	111.5	972	153,180	一般消費財・サービス
BALL CORP	180.04	1,188	187,215	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	840.97	6,455	1,016,901	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	146	1,985	312,745	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	76	1,920	302,467	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	148	7,114	1,120,795	ヘルスケア
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	306.25	311	49,063	コミュニケーション・サービス
CARNIVAL CORP	578	886	139,674	一般消費財・サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC	281	418	66,000	素材
COMCAST CORP-CLASS A	2,263.9	8,476	1,335,230	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	96	351	55,440	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	668	215	33,884	不動産
アメリカ・ドル通貨計 株数、金額	207,757.84	2,670,079	420,617,561	
アメリカ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	580銘柄		<72.1%>	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)				
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	406	3,081	353,421	生活必需品
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	176.81	923	105,893	金融
IMPERIAL OIL LTD	100	881	101,053	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	11	4,180	479,404	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	158.87	1,503	172,459	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	239	1,737	199,277	素材
INTACT FINANCIAL CORP	94.5	2,101	241,041	金融
BCE INC	37.3	168	19,327	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	102	1,626	186,577	素材
SUNCOR ENERGY INC	678.3	3,409	390,993	エネルギー
METRO INC/CN	120	887	101,830	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	179	1,905	218,495	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	645	4,108	471,221	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	495	3,232	370,774	金融
TORONTO-DOMINION BANK	932	6,946	796,659	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	149	584	67,005	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2024年6月17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	
MEG ENERGY CORP	142	393	45, 128	エネルギー
ROYAL BANK OF CANADA	743. 5	10, 622	1, 218, 281	金融
TOURMALINE OIL CORP	176	1, 111	127, 430	エネルギー
TC ENERGY CORP	547. 5	2, 915	334, 371	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	305. 29	1, 554	178, 289	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	926	2, 038	233, 752	素材
CAE INC	169	418	48, 010	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	83. 41	1, 915	219, 689	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	71	227	26, 147	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	30	329	37, 754	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	77. 5	563	64, 601	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	206	498	57, 198	資本財・サービス
HYDRO ONE LTD	170	670	76, 858	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	80. 6	1, 260	144, 530	生活必需品
STANTEC INC	61	690	79, 244	資本財・サービス
NORTHLAND POWER INC	132	315	36, 152	公益事業
WSP GLOBAL INC	66	1, 365	156, 568	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	44	517	59, 325	資本財・サービス
PARKLAND CORP	71	274	31, 521	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	77	224	25, 716	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	151	691	79, 334	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC	43	812	93, 159	資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A	68	207	23, 755	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	189	981	112, 565	コミュニケーション・サービス
BRP INC/CA- SUB VOTING	19	160	18, 463	一般消費財・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	327	571	65, 556	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	263. 17	2, 323	266, 425	素材
AIR CANADA	89	152	17, 515	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	634	646	74, 095	素材
BANK OF MONTREAL	386	4, 433	508, 489	金融
POWER CORP OF CANADA	299	1, 149	131, 853	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	637	5, 920	678, 996	情報技術
NUTRIEN LTD	261. 19	1, 836	210, 649	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	70	289	33, 156	公益事業
CAMECO CORP	229	1, 632	187, 236	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	22	460	52, 830	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	116	604	69, 340	資本財・サービス
TELUS CORP	108	234	26, 903	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	242	1, 587	182, 100	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	28	378	43, 400	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1, 132	5, 277	605, 263	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	12	1, 831	210, 097	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	144	834	95, 739	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	32. 37	612	70, 285	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	193	527	60, 451	素材
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	46	594	68, 162	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	307	2, 005	230, 061	金融
ENBRIDGE INC	1, 121	5, 408	620, 338	エネルギー
BROOKFIELD CORP	715. 25	4, 022	461, 348	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	949	3, 274	375, 500	金融
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	492. 2	5, 198	596, 229	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	52	442	50, 800	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	79	407	46, 770	一般消費財・サービス

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千カナダ・ドル	千円	
CANADIAN NATL RAILWAY CO		287.5	4,809	551,611	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A		109	1,491	171,091	情報技術
ONEX CORPORATION		34	320	36,775	金融
IGM FINANCIAL INC		42	154	17,765	金融
TMX GROUP LTD		147	545	62,615	金融
OPEN TEXT CORP		144	568	65,252	情報技術
SAPUTO INC		135	396	45,474	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		366	603	69,219	素材
FORTIS INC		261	1,401	160,716	公益事業
RB GLOBAL INC		97	1,064	122,096	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP		348	511	58,670	素材
CENOVUS ENERGY INC		736	1,844	211,536	エネルギー
DOLLARAMA INC		147	1,820	208,804	一般消費財・サービス
ALTAGAS LTD		157	478	54,865	公益事業
KEYERA CORP		122	446	51,197	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		315	754	86,525	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額	21,606.26	137,911	15,817,104	
	銘柄数<比率>	85銘柄		<2.7%>	
		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		1,157.28	600	62,567	一般消費財・サービス
TELSTRA GROUP LTD		2,104.15	736	76,716	コミュニケーション・サービス
ANZ GROUP HOLDINGS LTD		1,604.21	4,612	480,442	金融
SEVEN GROUP HOLDINGS LTD		108	425	44,371	資本財・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD		1,432.05	528	55,046	金融
BHP GROUP LTD		2,705.5	11,657	1,214,413	素材
SOUTH32 LTD		2,415.23	883	92,083	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD		1,013.02	2,761	287,664	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD		903.5	2,096	218,352	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		1,653.28	5,789	603,122	金融
WESTPAC BANKING CORP		1,850.49	4,957	516,418	金融
SANTOS LTD		1,731.84	1,293	134,763	エネルギー
RIO TINTO LTD		197.57	2,374	247,382	素材
ORIGIN ENERGY LTD		918.46	925	96,441	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD		933.81	340	35,505	資本財・サービス
PILBARA MINERALS LTD		1,530.72	495	51,663	素材
XERO LTD		77.73	1,017	106,023	情報技術
PRO MEDICUS LTD		35	459	47,823	ヘルスケア
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		122.01	395	41,166	金融
COLES GROUP LTD		714.32	1,213	126,423	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD		88.76	853	88,901	情報技術
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		612.49	822	85,687	素材
REECE LTD		114.43	295	30,801	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI		823.15	415	43,302	生活必需品
SEEK LTD		185.28	427	44,507	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		434.76	524	54,618	生活必需品
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		892.75	11,187	1,165,355	金融
AMPOL LTD		127.49	421	43,958	エネルギー
ORICA LTD		260.28	468	48,804	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		802	1,468	152,969	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD		651.72	2,123	221,252	生活必需品
QANTAS AIRWAYS LTD		443.32	270	28,216	資本財・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		228.31	1,102	114,872	素材

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
MACQUARIE GROUP LTD		193. 77	3, 695	385, 009	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD		300. 48	1, 402	146, 113	一般消費財・サービス
CSL LTD		257. 61	7, 447	775, 806	ヘルスケア
WESFARMERS LTD		605. 7	4, 082	425, 265	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD		35. 01	1, 132	117, 983	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD		236. 73	486	50, 651	素材
SUNCORP GROUP LTD		678. 97	1, 112	115, 923	金融
ASX LTD		103. 68	585	60, 967	金融
COMPUTERSHARE LTD		280. 11	741	77, 236	資本財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		1, 249. 07	823	85, 746	金融
SONIC HEALTHCARE LTD		243. 71	617	64, 331	ヘルスケア
BRAMBLES LTD		742. 9	1, 078	112, 367	資本財・サービス
CARSALES. COM LTD		192. 37	674	70, 277	コミュニケーション・サービス
MINERAL RESOURCES LTD		93. 85	585	60, 975	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD		95. 41	460	47, 994	ヘルスケア
REA GROUP LTD		27. 5	528	55, 024	コミュニケーション・サービス
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額	34, 209. 78	89, 404	9, 313, 316	
	銘柄数<比率>	49 銘柄		<1. 6%>	
		百株	千香港・ドル	千円	
(香港)					
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		840	3, 578	72, 140	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		1, 330	5, 193	104, 703	一般消費財・サービス
MTR CORP		945	2, 353	47, 437	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES		880	6, 300	127, 024	不動産
SINO LAND CO		2, 360	1, 939	39, 108	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		1, 626. 69	5, 994	120, 846	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD		650	1, 504	30, 335	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		260	1, 822	36, 743	不動産
CLP HOLDINGS LTD		995	6, 507	131, 187	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		885. 07	1, 898	38, 273	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		6, 784. 75	4, 023	81, 110	公益事業
HANG SENG BANK LTD		463	4, 963	100, 061	金融
WH GROUP LTD		5, 050	2, 610	52, 634	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		730	18, 804	379, 104	金融
SWIRE PROPERTIES LTD		710	935	18, 865	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD		1, 176. 69	3, 459	69, 742	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		385	1, 680	33, 879	公益事業
AIA GROUP LTD		6, 802	37, 751	761, 062	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS		820	1, 697	34, 219	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		1, 020	2, 198	44, 313	不動産
SANDS CHINA LTD		1, 472	2, 620	52, 822	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		835	7, 982	160, 929	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		2, 240	5, 465	110, 186	金融
香港・ドル通貨計	株数、金額	39, 260. 2	131, 286	2, 646, 733	
	銘柄数<比率>	23 銘柄		<0. 5%>	
		百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)					
CAPITALAND INVESTMENT LTD		1, 575	414	48, 244	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD		766	2, 341	272, 733	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD		1, 206. 4	4, 280	498, 527	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD		901. 75	606	70, 683	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD		882	575	67, 080	資本財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		2, 050	2, 898	337, 611	金融

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千シンガポール・ドル	千円	
GENTING SINGAPORE LTD		3,661	318	37,096	一般消費財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		4,998.5	1,274	148,454	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING		945	376	43,805	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		541	272	31,757	公益事業
SINGAPORE EXCHANGE LTD		519	494	57,606	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD		1,163	357	41,584	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額	19,208.65	14,211	1,655,185	
	銘柄数<比率>	12銘柄		<0.3%>	
		百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
(ニュージーランド)					
MERIDIAN ENERGY LTD		783.52	499	48,243	公益事業
MERCURY NZ LTD		421.43	281	27,251	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD		1,098.47	443	42,895	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		806.3	602	58,257	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		353.19	1,086	105,046	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額	3,462.91	2,914	281,695	
	銘柄数<比率>	5銘柄		<0.0%>	
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)					
SHELL PLC		3,570.57	9,679	1,934,704	エネルギー
HALEON PLC		3,824.6	1,240	247,902	生活必需品
WISE PLC CLASS A		335.41	239	47,831	金融
BP PLC		9,381.05	4,315	862,495	エネルギー
UNILEVER PLC		1,399.61	6,228	1,244,843	生活必需品
BARCLAYS PLC		8,385.52	1,693	338,554	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		4,699.69	2,151	430,023	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC		1,535.43	1,074	214,820	金融
NATWEST GROUP PLC		3,692.87	1,134	226,742	金融
BAE SYSTEMS PLC		1,689.65	2,255	450,843	資本財・サービス
AVIVA PLC		1,494.8	711	142,212	金融
GSK		2,315.52	3,715	742,567	ヘルスケア
INFORMA PLC		749.76	631	126,237	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC		725.2	435	87,054	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC		504.37	413	82,562	コミュニケーション・サービス
DCC PLC		53.9	299	59,790	資本財・サービス
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI		99.46	1,376	275,026	一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		41.17	349	69,820	資本財・サービス
HALMA PLC		212.14	561	112,149	情報技術
ENTAIN PLC		357.11	234	46,822	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC		1,380.98	166	33,328	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC		394.03	189	37,849	金融
M&G PLC		1,265.6	253	50,717	金融
ENDEAVOUR MINING PLC		104.49	168	33,623	素材
RELX PLC		1,047.42	3,726	744,859	資本財・サービス
DIAGEO PLC		1,242.2	3,203	640,310	生活必需品
RIO TINTO PLC		629.72	3,286	656,874	素材
STANDARD CHARTERED PLC		1,234.47	894	178,684	金融
TESCO PLC		3,930.05	1,219	243,661	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC		487.99	487	97,495	ヘルスケア
GLENCORE PLC		5,791.45	2,632	526,158	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC		189.53	199	39,813	金融
SMITHS GROUP PLC		194.52	326	65,355	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		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千イギリス・ポンド	千円	
PEARSON PLC		331.65	314	62,906	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC		931.01	240	48,157	生活必需品
NEXT PLC		66.12	595	119,044	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC		1,980.7	293	58,709	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC		101.75	296	59,220	一般消費財・サービス
BUNZL PLC		188.47	550	110,070	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC		12,853.19	886	177,155	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		72.38	298	59,703	素材
KINGFISHER PLC		1,026.57	255	51,007	一般消費財・サービス
WPP PLC		602.59	443	88,571	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC		381.95	395	79,126	公益事業
SEVERN TRENT PLC		150.87	373	74,601	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC		1,409.49	630	125,954	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		393.99	1,730	345,934	生活必需品
SCHRODERS PLC		428.39	158	31,748	金融
SSE PLC		610.58	1,078	215,638	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		545.34	266	53,288	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC		865.77	10,830	2,164,748	ヘルスケア
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		3,339.58	750	149,983	金融
3I GROUP PLC		543.43	1,652	330,190	金融
ASHTEAD GROUP PLC		244.47	1,325	264,930	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE		555.8	587	117,364	情報技術
NATIONAL GRID PLC		2,877.07	2,537	507,185	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC		35,354.16	1,915	382,848	金融
IMPERIAL BRANDS PLC		455.89	911	182,191	生活必需品
CENTRICA PLC		2,946.67	388	77,741	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC		59.33	298	59,647	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		1,120.83	2,681	535,856	生活必需品
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		185.8	461	92,208	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC		10,530.83	7,127	1,424,526	金融
ANGLO AMERICAN PLC		709.47	1,694	338,693	素材
MONDI PLC		247.32	361	72,318	素材
COMPASS GROUP PLC		950.31	2,106	421,093	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC		178.88	254	50,768	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC		3,620.19	505	100,973	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI		122.88	330	66,115	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC		200.44	196	39,268	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		90.05	736	147,226	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC		90.03	427	85,364	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		255.95	2,414	482,612	金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		93.66	183	36,653	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC		146.13	372	74,507	金融
ANTOFAGASTA PLC		219.85	448	89,684	素材
EXPERIAN PLC		512.71	1,900	379,876	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額	151,552.82	107,705	21,527,160	
	銘柄数<比率>	77銘柄		<3.7%>	
		百株	千イスラエル・シュケル	千円	
(イスラエル)					
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		733.33	1,372	58,107	金融
AZRIELI GROUP LTD		25.16	564	23,889	不動産
ICL GROUP LTD		440.23	725	30,744	素材
ELBIT SYSTEMS LTD		15.18	1,024	43,381	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM		753.12	2,486	105,285	金融

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千イスラエル・シュケル	千円	
BANK LEUMI LE-ISRAEL		902.78	2,752	116,573	金融
NICE LTD		37.54	2,333	98,840	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		91.81	1,199	50,780	金融
イスラエル・シュケル通貨計	株数、金額	2,999.15	12,457	527,603	
	銘柄数<比率>	8銘柄		<0.1%>	
		百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)					
SANDOZ GROUP AG		218.52	696	123,232	ヘルスケア
AVOLTA AG		48.54	175	31,004	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG		1,757.33	4,730	836,582	金融
ROCHE HOLDING AG-BR		17.11	468	82,784	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		3.55	260	45,985	素材
ADECCO GROUP AG-REG		90.58	281	49,816	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		375.85	9,306	1,645,681	ヘルスケア
SIKA AG-REG		81.95	2,097	370,851	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.06	656	116,077	生活必需品
ABB LTD-REG		854.47	4,262	753,860	資本財・サービス
SWISS RE AG		161.21	1,755	310,456	金融
NESTLE SA-REG		1,426.76	13,594	2,403,992	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG		11.73	1,354	239,481	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		22.08	519	91,914	資本財・サービス
JULIUS BAER GROUP LTD		109.62	554	98,089	金融
SGS SA-REG		79.78	652	115,405	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG		12.91	297	52,623	資本財・サービス
TEMENOS AG - REG		32.32	193	34,235	情報技術
HELVETIA HOLDING AG-REG		20.28	239	42,282	金融
VAT GROUP AG		13.98	695	122,993	資本財・サービス
BKW AG		11.74	165	29,210	公益事業
ALCON INC		266.79	2,146	379,509	ヘルスケア
SIG GROUP N AG		158.64	254	45,054	素材
SWATCH GROUP AG/THE-BR		15	277	49,139	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG		77.79	3,667	648,475	金融
BALOISE HOLDING AG - REG		24.16	375	66,351	金融
CLARIANT AG-REG		109.62	147	26,170	素材
NOVARTIS AG-REG		1,061.53	10,085	1,783,536	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG		1.81	281	49,708	生活必需品
BACHEM HOLDING AG-REG B		17.66	139	24,749	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG		287.43	4,134	731,176	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG		13.41	665	117,622	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		15.44	146	25,829	金融
GEBERIT AG-REG		18.34	994	175,848	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG		4.78	2,053	363,138	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG		59.8	661	116,959	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG		27.29	755	133,630	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		85.37	754	133,425	情報技術
LONZA GROUP AG-REG		39.56	1,900	336,007	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG		26.86	98	17,384	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD		278.94	2,232	394,819	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		15.3	967	171,051	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		28.15	722	127,686	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG		41.8	348	61,648	不動産

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千スイス・フラン	千円	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.49	526	93,150	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額	8,026.33	77,293	13,668,640	
	銘柄数<比率>	45銘柄		<2.3%>	
		百株	千デンマーク・クローネ	千円	
(デンマーク)					
NOVO NORDISK A/S-B		1,974.87	195,709	4,423,037	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S		417.9	8,458	191,157	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A		1.73	1,923	43,476	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		611.67	11,135	251,661	資本財・サービス
CARLSBERG AS-B		57.38	5,383	121,664	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES		226.18	9,214	208,249	素材
COLOPLAST-B		76.77	6,537	147,752	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S		103.86	11,232	253,853	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS		5.26	1,446	32,690	資本財・サービス
DEMANT A/S		60.39	1,971	44,547	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		2.52	2,872	64,925	資本財・サービス
TRYG A/S		210.99	3,019	68,235	金融
PANDORA A/S		50.12	5,275	119,217	一般消費財・サービス
GENMAB A/S		40.17	7,361	166,362	ヘルスケア
ORSTED A/S		114.14	4,403	99,519	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額	3,953.95	275,944	6,236,352	
	銘柄数<比率>	15銘柄		<1.1%>	
		百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
(ノルウェー)					
DNB BANK		513.7	10,566	156,071	金融
NORSK HYDRO ASA		803.55	5,210	76,954	素材
ORKLA ASA		424.57	3,829	56,563	生活必需品
TELENOR ASA		381.33	4,686	69,220	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA		545.09	15,791	233,236	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		100.08	2,984	44,079	素材
MOWI ASA		281.9	5,340	78,880	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		120.98	2,286	33,771	金融
AKER BP ASA		191.34	4,881	72,093	エネルギー
KONGSBERG GRUPPEN ASA		53.15	4,632	68,414	資本財・サービス
SALMAR ASA		39.73	2,403	35,502	生活必需品
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額	3,455.42	62,612	924,789	
	銘柄数<比率>	11銘柄		<0.2%>	
		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)					
SAGAX CLASS B		132.55	3,531	52,861	不動産
VOLVO CAR CLASS B		451.14	1,452	21,746	一般消費財・サービス
ERICSSON LM-B SHS		1,678.94	10,372	155,276	情報技術
VOLVO AB-B SHS		961.65	25,349	379,475	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES		206.05	4,267	63,881	資本財・サービス
TELE2 AB-B SHS		324.33	3,386	50,688	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS		138.92	2,539	38,015	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		960.73	14,679	219,758	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		882.68	8,848	132,467	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		514.31	11,037	165,225	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		347.89	6,561	98,221	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B		367.26	5,694	85,244	素材
SKANSKA AB-B SHS		205.7	3,857	57,752	資本財・サービス
SANDVIK AB		645.08	13,914	208,298	資本財・サービス

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
INVESTOR AB-B SHS		1,047.86	29,733	445,103	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		1,625.38	32,540	487,125	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS		120.71	3,244	48,572	資本財・サービス
HOLMEN AB-B SHARES		45.77	1,948	29,174	素材
SECURITAS AB-B SHS		297.55	3,094	46,324	資本財・サービス
TELIA CO AB		1,427.62	3,820	57,190	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB		175.52	8,154	122,075	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS		944.32	16,332	244,490	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		606.18	18,330	274,413	資本財・サービス
TRELLEBORG AB-B SHS		130	5,246	78,544	資本財・サービス
SAAB AB-B		193.88	4,672	69,947	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		74.55	2,646	39,618	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		400.92	2,747	41,136	不動産
INDUTRADE AB		164.98	4,490	67,226	資本財・サービス
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB		118.25	3,192	47,795	ヘルスケア
LUNDBERGS AB-B SHS		45.51	2,350	35,188	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		89.43	2,647	39,627	資本財・サービス
LIFCO AB-B SHS		141.19	4,001	59,899	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		917.42	4,335	64,905	資本財・サービス
BEIJER REF AB		218.18	3,590	53,744	資本財・サービス
ESSITY AKTIEBOLAG-B		369.2	10,285	153,980	生活必需品
BOLIDEN AB		165.14	5,604	83,904	素材
EPIROC AB-A		398.68	8,444	126,407	資本財・サービス
EPIROC AB-B		236.18	4,546	68,060	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		211.95	1,873	28,048	資本財・サービス
EQT AB		226.37	7,074	105,898	金融
EVOLUTION AB		111.64	11,789	176,484	一般消費財・サービス
HEXAGON AB-B SHS		1,256.8	14,641	219,186	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		95.2	3,367	50,407	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額	19,673.61	340,240	5,093,396	
	銘柄数<比率>	43銘柄		<0.9%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（アイルランド）					
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		145.09	611	103,108	素材
AIB GROUP PLC		949.63	454	76,645	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC		567.3	551	92,990	金融
KINGSPAN GROUP PLC		86.73	702	118,544	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		86.94	654	110,401	生活必需品
国小計	株数、金額	1,835.69	2,974	501,690	
	銘柄数<比率>	5銘柄		<0.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オランダ）					
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV		456.27	1,306	220,294	コミュニケーション・サービス
EXOR NV		55.34	535	90,385	金融
FERROVIAL		287.47	1,052	177,529	資本財・サービス
QIAGEN N. V.		122.75	487	82,181	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV		445.27	1,073	181,042	ヘルスケア
NN GROUP NV		149.72	618	104,378	金融
HEINEKEN NV		159.68	1,514	255,389	生活必需品
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		522.48	1,467	247,415	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.		94.76	550	92,845	素材
WOLTERS KLUWER		137.47	2,099	354,003	資本財・サービス
ING GROEP NV		1,829.69	2,805	473,082	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE KPN NV		2, 217. 49	775	130, 735	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		221. 51	21, 109	3, 559, 974	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA		255. 61	389	65, 715	金融
IMCD NV		31. 59	431	72, 744	資本財・サービス
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES		42. 39	651	109, 803	情報技術
ASR NEDERLAND NV		87. 62	381	64, 350	金融
ADYEN NV		11. 67	1, 397	235, 691	金融
PROSUS NV		785. 62	2, 664	449, 329	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV		68. 85	134	22, 722	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV		26. 22	1, 771	298, 821	情報技術
RANDSTAD NV		60. 64	275	46, 447	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		71. 71	548	92, 573	生活必需品
OCI NV		55. 2	128	21, 624	素材
EURONEXT NV		44. 71	399	67, 331	金融
STMICROELECTRONICS NV		375. 07	1, 477	249, 243	情報技術
AIRBUS SE		329. 4	4, 737	798, 920	資本財・サービス
ARGENX SE		32. 79	1, 183	199, 567	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		342. 06	329	55, 492	生活必需品
STELLANTIS NV		1, 227. 96	2, 311	389, 730	一般消費財・サービス
FERRARI NV		69. 7	2, 646	446, 307	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額	10, 618. 71	57, 256	9, 655, 676	
	銘柄数<比率>	31 銘柄		<1. 7%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ベルギー）					
LOTUS BAKERIES NV		0. 21	209	35, 378	生活必需品
SYENSQO SA		39. 87	352	59, 390	素材
UCB SA		69. 9	963	162, 496	ヘルスケア
KBC GROUP NV		138. 47	888	149, 823	金融
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		48. 84	326	54, 977	金融
UMICORE		116. 64	158	26, 810	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		499. 5	2, 770	467, 171	生活必需品
AGEAS		88. 92	375	63, 280	金融
D'IETEREN GROUP		12. 22	232	39, 154	一般消費財・サービス
ELIA GROUP SA/NV		16. 62	150	25, 309	公益事業
SOFINA		8. 31	178	30, 186	金融
国小計	株数、金額	1, 039. 5	6, 605	1, 113, 980	
	銘柄数<比率>	11 銘柄		<0. 2%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ルクセンブルグ）					
ARCELORMITTAL		275. 34	600	101, 317	素材
INPOST SA		121	201	33, 995	資本財・サービス
EUROFINS SCIENTIFIC		72. 53	378	63, 750	ヘルスケア
TENARIS SA		261. 53	374	63, 135	エネルギー
国小計	株数、金額	730. 4	1, 554	262, 198	
	銘柄数<比率>	4 銘柄		<0. 0%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フランス）					
TOTALENERGIES SE		1, 188. 94	7, 302	1, 231, 488	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		376. 79	1, 390	234, 469	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		319. 78	5, 093	858, 960	素材
KERING		40. 98	1, 239	209, 053	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		301. 27	6, 664	1, 123, 832	資本財・サービス
BOUYGUES SA		105. 49	324	54, 792	資本財・サービス

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
BNP PARIBAS		572.65	3,344	564,075	金融
THALES SA		52.79	793	133,804	資本財・サービス
DANONE		356.82	2,098	353,823	生活必需品
CARREFOUR SA		314.45	452	76,388	生活必需品
VIVENDI		403.08	382	64,576	コミュニケーション・サービス
L'OREAL		133.24	5,868	989,673	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		252.79	1,827	308,218	資本財・サービス
LEGRAND SA		146.8	1,371	231,372	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA		113.83	1,501	253,199	生活必需品
EURAZEO SE		25.89	186	31,414	金融
REXEL SA		128	314	53,101	資本財・サービス
SOCIETE GENERALE SA		400.08	886	149,444	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		153.3	10,905	1,839,147	一般消費財・サービス
ACCOR SA		107.71	398	67,262	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		86.44	1,575	265,743	情報技術
PUBLICIS GROUPE		126.92	1,240	209,243	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA		171.79	457	77,235	資本財・サービス
EIFFAGE		41.26	350	59,115	資本財・サービス
SODEXO SA		47.56	399	67,372	一般消費財・サービス
IPSEN		21.31	256	43,304	ヘルスケア
AMUNDI SA		34.14	205	34,688	金融
TELEPERFORMANCE		30.77	287	48,413	資本財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		15.7	280	47,326	ヘルスケア
SEB SA		13.02	133	22,571	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA		163.44	3,285	554,006	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA		10.89	189	31,991	資本財・サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		54.98	170	28,742	一般消費財・サービス
AXA SA		1,006.43	2,961	499,498	金融
EDENRED		138.05	559	94,380	金融
RENAULT SA		106.2	511	86,216	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL		18.01	3,803	641,457	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU		12.09	96	16,331	生活必需品
DASSAULT SYSTEMES SE		370.89	1,324	223,354	情報技術
ORANGE		1,032.06	958	161,724	コミュニケーション・サービス
ALSTOM		160.33	248	41,922	資本財・サービス
SANOFI		630.36	5,448	918,784	ヘルスケア
VINCI SA		277.9	2,727	459,933	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		382.13	1,066	179,923	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		586.85	764	129,002	金融
BIOMERIEUX		23.52	213	36,015	ヘルスケア
ENGIE		1,011.95	1,342	226,459	公益事業
SAFRAN SA		189.58	3,728	628,705	資本財・サービス
ARKEMA		32.34	270	45,648	素材
ADP		19.12	215	36,371	資本財・サービス
GETLINK SE		186.46	289	48,849	資本財・サービス
BOLLORE		383.68	220	37,139	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額	12,880.85	87,936	14,829,575	
	銘柄数<比率>	52銘柄		<2.5%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ドイツ）					
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		296.29	1,080	182,227	資本財・サービス
DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)		63.25	446	75,326	一般消費財・サービス
BAYER AG-REG		544.64	1,474	248,586	ヘルスケア

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2024年6月17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	
EVONIK INDUSTRIES AG	125. 81	229	38, 699	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1, 040. 98	1, 500	253, 039	金融
COMMERZBANK AG	584. 18	804	135, 607	金融
VOLKSWAGEN AG	15. 88	178	30, 100	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	114. 75	1, 199	202, 222	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	421. 18	6, 980	1, 177, 214	資本財・サービス
E. ON SE	1, 243. 8	1, 546	260, 724	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	176. 26	1, 531	258, 305	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	88. 02	331	55, 901	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	61. 39	337	56, 940	一般消費財・サービス
BASF SE	494. 36	2, 204	371, 700	素材
ALLIANZ SE-REG	217. 38	5, 508	928, 938	金融
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	94. 08	781	131, 780	生活必需品
RHEINMETALL AG	24. 42	1, 170	197, 343	資本財・サービス
RWE AG	350. 57	1, 162	196, 042	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	332. 93	196	33, 103	資本財・サービス
BRENNTAG SE	71. 27	463	78, 123	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	234. 36	692	116, 828	ヘルスケア
SAP SE	578. 83	10, 116	1, 706, 095	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	75. 3	3, 439	580, 071	金融
ZALANDO SE	124. 35	275	46, 449	一般消費財・サービス
HEIDELBERG MATERIALS AG	75. 96	723	122, 027	素材
COVESTRO AG	104. 49	524	88, 528	素材
RATIONAL AG	2. 68	212	35, 817	資本財・サービス
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	38	301	50, 817	コミュニケーション・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	14. 07	345	58, 298	ヘルスケア
TALANX AG	35. 71	255	43, 118	金融
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	84. 87	360	60, 770	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	107. 12	298	50, 292	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	20. 94	176	29, 786	ヘルスケア
BECHTLE AG	44. 23	196	33, 162	情報技術
NEMETSCHEK SE	32. 19	291	49, 236	情報技術
SCOUT24 AG	41. 19	289	48, 901	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	156. 46	839	141, 531	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	39. 02	274	46, 325	資本財・サービス
SIEMENS ENERGY AG	335. 94	780	131, 661	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	56. 14	822	138, 650	生活必需品
MERCK KGAA	71. 41	1, 228	207, 132	ヘルスケア
ADIDAS AG	90. 01	2, 024	341, 382	一般消費財・サービス
PUMA SE	58. 26	262	44, 271	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	58. 21	428	72, 298	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1, 795. 77	4, 063	685, 323	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	114. 13	440	74, 350	ヘルスケア
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	444. 94	2, 812	474, 219	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	723. 38	2, 640	445, 266	情報技術
HANNOVER RUECK SE	33. 39	756	127, 595	金融
DHL GROUP	549. 38	2, 073	349, 744	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	105. 05	1, 914	322, 867	金融
MTU AERO ENGINES AG	29. 91	671	113, 187	資本財・サービス
SYMRISE AG	73. 31	824	138, 960	素材
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	32. 73	266	44, 929	一般消費財・サービス

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
VONOVIA SE		406.77	1,097	185,076	不動産
LEG IMMOBILIEN SE		39.86	307	51,893	不動産
国小計	株数、金額	13,189.8	72,158	12,168,801	
	銘柄数<比率>	56銘柄		<2.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ポルトガル）					
JERONIMO MARTINS		157.64	309	52,158	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		1,738.88	638	107,650	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		258.05	483	81,486	エネルギー
国小計	株数、金額	2,154.57	1,430	241,295	
	銘柄数<比率>	3銘柄		<0.0%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（スペイン）					
TELEFONICA SA		2,625.15	1,078	181,951	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA		176.55	328	55,438	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		3,235.34	2,918	492,138	金融
IBERDROLA SA		3,295.98	3,996	673,948	公益事業
BANCO DE SABADELL SA		3,293	573	96,738	金融
REPSOL SA		674.72	965	162,769	エネルギー
GRIFOLS SA		156.13	143	24,191	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		8,752.13	3,832	646,248	金融
AMADEUS IT GROUP SA		249.95	1,604	270,613	一般消費財・サービス
CAIXABANK SA		2,078.4	1,013	170,869	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		113.52	445	75,082	資本財・サービス
AENA SME SA		41.28	762	128,508	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA		275.57	892	150,523	コミュニケーション・サービス
ACCIONA SA		13.33	154	25,986	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		604.86	2,779	468,808	一般消費財・サービス
RED ELECTRICA CORPORACION SA		225.57	384	64,896	公益事業
EDP RENOVAVEIS SA		173.7	239	40,306	公益事業
国小計	株数、金額	25,985.18	22,112	3,729,020	
	銘柄数<比率>	17銘柄		<0.6%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（イタリア）					
AMPLIFON		67.24	0	34	ヘルスケア
PRYSMIAN SPA		146.09	827	139,541	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		565.35	1,277	215,374	金融
MEDIOBANCA SPA		282.18	381	64,361	金融
UNICREDIT SPA		837.72	2,725	459,632	金融
TELECOM ITALIA SPA		5,562.74	124	20,994	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO		8,105.87	2,699	455,202	金融
POSTE ITALIANE SPA		245.93	299	50,494	金融
MONCLER SPA		122.62	719	121,259	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		56.29	270	45,660	ヘルスケア
ENI SPA		1,178.44	1,591	268,447	エネルギー
BANCO BPM SPA		719	422	71,296	金融
DIASORIN SPA		11.44	112	18,902	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		175.91	172	29,012	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA		328.04	185	31,300	金融
AMPLIFON SPA		67.24	232	39,279	ヘルスケア
LEONARDO SPA		224.28	475	80,108	資本財・サービス
ENEL SPA		4,507.23	2,856	481,674	公益事業
SNAM SPA		1,117.65	478	80,745	公益事業

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2024年6月17日現在 株数	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	千ユーロ	千円	
TERNA SPA		779.41	583	98,474	公益事業
FINECOBANK SPA		338.84	473	79,913	金融
国小計	株数、金額	25,439.51	16,910	2,851,709	
	銘柄数<比率>	21銘柄		<0.5%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フィンランド）					
UPM-KYMMENE OYJ		295.66	966	162,992	素材
NOKIA OYJ		2,955.58	1,001	168,817	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		280.85	532	89,823	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		323.32	400	67,528	素材
ELISA OYJ		79.14	337	56,881	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		250.46	984	165,951	金融
FORTUM OYJ		248.89	353	59,601	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		151.38	248	41,981	生活必需品
KONE OYJ-B		188.55	890	150,209	資本財・サービス
NESTE OYJ		234.7	417	70,412	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		60.25	226	38,183	ヘルスケア
METSO CORPORATION		356.73	370	62,565	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP		1,747.33	1,974	332,976	金融
国小計	株数、金額	7,172.84	8,704	1,467,925	
	銘柄数<比率>	13銘柄		<0.3%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オーストリア）					
VERBUND AG		38.05	279	47,195	公益事業
OMV AG		79.24	309	52,196	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		184.67	775	130,861	金融
VOESTALPINE AG		60.73	149	25,214	素材
国小計	株数、金額	362.69	1,514	255,467	
	銘柄数<比率>	4銘柄		<0.0%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（その他）					
DSM FIRMENICH AG		102.88	1,020	172,178	素材
AEGON LTD		779.64	442	74,653	金融
国小計	株数、金額	882.52	1,463	246,831	
	銘柄数<比率>	2銘柄		<0.0%>	
ユーロ通貨計	株数、金額	102,292.26	280,622	47,324,172	
	銘柄数<比率>	219銘柄		<8.1%>	
ファンド合計	株数、金額	617,459.18	—	545,633,714	
	銘柄数<比率>	1,172銘柄		<93.6%>	

（注1）邦貨換算金額は、2024年6月17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)外国投資証券

銘柄		2024年6月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
AVALONBAY COMMUNITIES INC		8.137	1,642	258,786
SIMON PROPERTY GROUP INC		18.707	2,784	438,589
BOSTON PROPERTIES INC		8.6	530	83,507
SBA COMMUNICATIONS CORP		6.2	1,214	191,391
EQUITY RESIDENTIAL		20.1	1,340	211,227
EQUINIX INC		5.508	4,220	664,864
AMERICAN TOWER CORP		26.7	5,260	828,718
HOST HOTELS & RESORTS INC		40.243	717	112,969
AMERICAN HOMES 4 RENT- A		18.9	669	105,516
KIMCO REALTY CORP		38.6	723	114,012
GAMING AND LEISURE PROPERTIE		15.6	677	106,678
INVITATION HOMES INC		35	1,242	195,731
VICI PROPERTIES INC		59.7	1,688	266,054
VENTAS INC		23	1,152	181,521
WEYERHAEUSER CO		41.714	1,209	190,564
CROWN CASTLE INTL CORP		24.9	2,467	388,719
IRON MOUNTAIN INC		16.8	1,478	232,945
SUN COMMUNITIES INC		7.2	839	132,294
PROLOGIS INC		52.954	5,946	936,705
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		9.2	1,070	168,579
CAMDEN PROPERTY TRUST		6.2	669	105,521
ESSEX PROPERTY TRUST INC		3.7	1,030	162,326
WELLTOWER INC		32.6	3,391	534,295
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		40.6	797	125,675
MID-AMERICA APARTMENT COMM		6.7	933	147,045
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		10.2	639	100,778
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		28.6	578	91,098
REALTY INCOME CORP		49.395	2,636	415,282
PUBLIC STORAGE		9.1	2,577	406,045
REGENCY CENTERS CORP		10.1	623	98,279
UDR INC		17.9	721	113,581
WP CAREY INC		12.5	701	110,448
DIGITAL REALTY TRUST INC		17.9	2,683	422,742
EXTRA SPACE STORAGE INC		12.1	1,894	298,440
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額	735.358	56,757	8,940,939
	銘柄数<比率>	34銘柄		<1.5%>
		千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)				
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		4.3	187	21,546
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		7.9	131	15,131
カナダ・ドル通貨計	口数、金額	12.2	319	36,677
	銘柄数<比率>	2銘柄		<0.0%>
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)				
DEXUS/AU		55.93	362	37,812
TRANSURBAN GROUP		164.915	2,061	214,739

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2024年6月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
APA GROUP		68.713	573	59,767
SCENTRE GROUP		276.99	864	90,024
GPT GROUP		99.602	405	42,228
MIRVAC GROUP		211.167	398	41,464
STOCKLAND		127.778	567	59,099
GOODMAN GROUP		91.172	3,261	339,721
VICINITY CENTRES		201.203	374	38,984
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額	1,297.47	8,868	923,843
	銘柄数<比率>	9銘柄		<0.2%>
		千口	千香港・ドル	千円
(香港)				
LINK REIT		154.6	5,039	101,605
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		230	2,007	40,479
香港・ドル通貨計	口数、金額	384.6	7,047	142,084
	銘柄数<比率>	2銘柄		<0.0%>
		千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)				
CAPITALAND ASCENDAS REIT		226.1	581	67,678
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		325.97	632	73,653
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	552.07	1,213	141,331
	銘柄数<比率>	2銘柄		<0.0%>
		千口	千イギリス・ポンド	千円
(イギリス)				
LAND SECURITIES GROUP PLC		39.56	246	49,180
SEGRO PLC		71.041	645	129,068
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	110.601	891	178,249
	銘柄数<比率>	2銘柄		<0.0%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ(ベルギー)				
WAREHOUSES DE PAUW SCA		9.789	247	41,765
国小計	口数、金額	9.789	247	41,765
	銘柄数<比率>	1銘柄		<0.0%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ(フランス)				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		6.557	475	80,168
GECINA SA		2.408	220	37,177
KLEPIERRE		11.572	295	49,841
COVIVIO		2.737	122	20,669
国小計	口数、金額	23.274	1,113	187,855
	銘柄数<比率>	4銘柄		<0.0%>
ユーロ通貨計	口数、金額	33.063	1,361	229,621
	銘柄数<比率>	5銘柄		<0.0%>
ファンド合計	口数、金額	3,125.362	—	10,592,747
	銘柄数<比率>	56銘柄		<1.8%>

(注1)邦貨換算金額は、2024年6月17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		2024年6月17日現在	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
外国	S&P500 EMINI FUT（アメリカ）	17,174	—
	S&P/TSX 60 IX FUT（カナダ）	2,075	—
	SPI 200 FUTURES（オーストラリア）	1,127	—
	FTSE 100 IDX FUT（イギリス）	1,435	—
	SWISS MKT IX FUTR（ドイツ）	1,576	—
	EURO STOXX 50（ドイツ）	3,445	—

（注1）外貨建の評価額は、2024年6月17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24期　（決算日　2023年11月30日）

（作成対象期間　2022年12月１日～2023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。

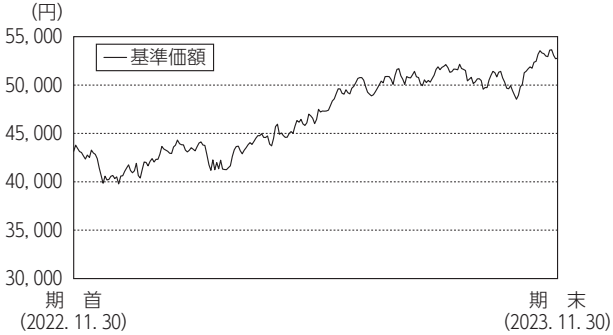
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年　月　日	基準価額		ＭＳＣＩコクサイ指数(税引後配当込み、円ベース)(ベンチマーク)		株　式組入比率	株　式先物比率	投資証券組入比率
		騰落率		騰落率			
	円	%		%	%	%	%
(期首)2022年11月30日	43,159	—	41,586	—	89.7	8.1	2.2
12月末	40,510	△ 6.1	39,012	△ 6.2	91.3	6.4	2.2
2023年1月末	42,041	△ 2.6	40,506	△ 2.6	90.2	7.6	2.3
2月末	43,520	0.8	41,881	0.7	93.0	5.0	2.2
3月末	43,305	0.3	41,662	0.2	92.4	5.6	2.1
4月末	44,495	3.1	42,776	2.9	92.2	5.7	2.1
5月末	46,568	7.9	44,784	7.7	91.8	6.4	2.0
6月末	50,230	16.4	48,320	16.2	92.8	5.1	2.0
7月末	50,995	18.2	49,052	18.0	91.9	6.3	2.0
8月末	51,888	20.2	49,885	20.0	90.3	7.8	1.9
9月末	50,638	17.3	48,668	17.0	92.2	6.0	1.9
10月末	48,935	13.4	47,036	13.1	90.7	7.6	1.9
(期末)2023年11月30日	52,771	22.3	50,700	21.9	89.9	8.2	1.9

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) ＭＳＣＩコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）は、ＭＳＣＩ Inc.（「ＭＳＣＩ」）の承諾を得て、ＭＳＣＩコクサイ指数（税引後配当込み、米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。ＭＳＣＩコクサイ指数（税引後配当込み、米ドルベース）は、ＭＳＣＩが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はＭＳＣＩに帰属します。またＭＳＣＩは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。本ファンドは、ＭＳＣＩによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、ＭＳＣＩは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html]
(注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
(注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注5) 株式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。
※ベンチマークを「ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）」から「ＭＳＣＩコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）」に変更しました。

《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：43,159円　期末：52,771円　騰落率：22.3%

【基準価額の主な変動要因】

海外株式市況が上昇したことや、為替相場が円安になったことにより、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。

◆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、米国の景況感や企業業績の悪化懸念などから、2022年末にかけて下落しました。2023年に入ると、ＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）が今後利上げ幅を縮小させるのではないかとの期待を背景に上昇しました。２月は、米国の利上げ長期化への懸念から軟調な展開となり、３月には、米国の地方銀行の経営破綻やスイスの金融大手の株価急落により信用不安が高まり、続落しました。経営破綻した米国の地方銀行の預金保護やＦＲＢによる金融機関への流動性供給、スイスの金融大手の救済合併の決定などにより信用不安が後退したことから、３月下旬には上昇に転じました。その後レンジでの推移をはさみ、６月以降は、米国の債務上限問題の解決や米国のインフレ警戒感の後退、中国の経済対策への期待から、欧米株ともに上昇しました。８月以降は、米国で堅調な経済指標が追加利上げ観測からの米国金利上昇を招いたことや、欧州で弱い経済指標が欧州経済への先行き懸念を強めたことから、下落しました。11月に入ると、米国の利上げ打ち止め観測などを背景に米国金利の下落傾向が続き、上昇しました。

○為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると円安となりました。

対円為替相場は、当作成期首より、インフレ率の低下期待などから米国金利が低下したことで日米金利差の縮小が意識され、円高米ドル安となりました。その後2023年２月には、堅調な米国の経済指標を受けて米国金利が上昇したことで円安に転じましたが、３月に入り、信用不安の拡大により米国金利が大きく低下したことやリスク回避による円買い需要の高まりなどから、円高となりました。４月以降は、経済指標の上振れなどを背景に米国金利が上昇するに連れて、米ドルなどの通貨は対円で上昇（円安）しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は21.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は22.3%となりました。

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（税引後配当込み、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	2円
（株式）	(1)
（先物・オプション）	(1)
（投資証券）	(0)
有価証券取引税	2
（株式）	(2)
（投資証券）	(0)
その他費用	8
（保管費用）	(8)
（その他）	(0)
合　　計	12

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

■売買および取引の状況

(1)株　　式

（2022年12月１日から2023年11月30日まで）

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		百株	千アメリカ・ドル	百株	千アメリカ・ドル
外国	アメリカ	26,739.9 (572.12)	256,972 (△5,151)	3,369.84	8,533
		百株	千カナダ・ドル	百株	千カナダ・ドル
	カナダ	2,442 (71.1)	13,997 (△810)	426	413
		百株	千オーストラリア・ドル	百株	千オーストラリア・ドル
	オーストラリア	5,460.54 (32.77)	10,750 (—)	1,113.97	1,263
		百株	千香港・ドル	百株	千香港・ドル
	香港	6,507 (—)	24,651 (—)	820	1,118
		百株	千シンガポール・ドル	百株	千シンガポール・ドル
	シンガポール	14,098 (12,844.22)	2,839 (△17)	128	167
		百株	千ニュージーランド・ドル	百株	千ニュージーランド・ドル
	ニュージーランド	569.72 (—)	749 (—)	—	—
		百株	千イギリス・ポンド	百株	千イギリス・ポンド
	イギリス	16,362.76 (△306.04)	11,511 (783)	1,279.71	1,136
		百株	千イスラエル・シュケル	百株	千イスラエル・シュケル
	イスラエル	614.37 (—)	2,513 (—)	1,069.08	1,390
		百株	千スイス・フラン	百株	千スイス・フラン
	スイス	1,315.43 (255.88)	8,132 (△122)	2,620.45	128
		百株	千デンマーク・クローネ	百株	千デンマーク・クローネ
	デンマーク	407.63 (823.58)	24,258 (—)	54.65	922
		百株	千ノルウェー・クローネ	百株	千ノルウェー・クローネ
	ノルウェー	536.85 (—)	9,041 (△14)	—	—
		百株	千スウェーデン・クローネ	百株	千スウェーデン・クローネ
	スウェーデン	3,298.61 (208.94)	50,892 (—)	1,623.52	16,537
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ（アイルランド）	1,269.4 (△339.42)	1,294 (△1,322)	—	—
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ（オランダ）	1,481.07 (442.37)	6,579 (—)	168.06	986
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ（ベルギー）	123.91 (—)	856 (—)	60.35	60
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ（ルクセンブルグ）	101.76 (—)	136 (—)	435.51	42
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ（フランス）	1,410.96 (—)	9,797 (△28)	280.16	362
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ（ドイツ）	1,683.23 (—)	8,104 (△151)	131.89	153
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ（ポルトガル）	435.19 (—)	248 (—)	—	—
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ（スペイン）	2,259.36 (5,532.2)	2,243 (151)	5,856.91	981
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ（イタリア）	2,379.1 (—)	1,342 (△0)	195.31	448
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ（フィンランド）	918.49 (215.14)	1,169 (—)	215.14	78
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ（オーストリア）	55.35 (—)	209 (—)	—	—
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ（その他）	141.44 (—)	1,034 (—)	—	—
		百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ユーロ（ユーロ通貨計）	12,259.26 (5,850.29)	33,017 (△1,352)	7,343.33	3,112

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

(2) 投資証券

(2022年12月 1 日から2023年11月30日まで)

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
外国	**アメリカ**				
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.1	196	—	—
	SIMON PROPERTY GROUP INC	2.2	258	—	—
	BOSTON PROPERTIES INC	1	69	—	—
	VORNADO REALTY TRUST	—	—	6.297	159
	SBA COMMUNICATIONS CORP	0.7	181	—	—
	EQUITY RESIDENTIAL	2.6	165	—	—
	EQUINIX INC	0.7	511	—	—
	AMERICAN TOWER CORP	3.6	732	—	—
	HOST HOTELS & RESORTS INC	5.4	94	—	—
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	2.7	89	—	—
	KIMCO REALTY CORP	5	103	—	—
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	3	57	—	—
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	1.7	85	—	—
	INVITATION HOMES INC	4.4	145	—	—
	VICI PROPERTIES INC	8.8	285	—	—
	VENTAS INC	2.9	135	—	—
	WEYERHAEUSER CO	4.6	147	—	—
	NET LEASE OFFICE PROPERTIES	—	—	0.686	10
		(0.686)	(—)		
	CROWN CASTLE INTL CORP	3.1	388	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	2.3	129	—	—
	SUN COMMUNITIES INC	1	138	—	—
	PROLOGIS INC	6.5	805	—	—
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.5	201	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1	110	—	—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.4	90	—	—
	WELLTOWER INC	5.2	390	—	—
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	4.6	106	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.8	124	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1.4	94	—	—
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	6	122	—	—
	REALTY INCOME CORP	7.7	469	—	—
	PUBLIC STORAGE	1.2	349	—	—
	REGENCY CENTERS CORP	1.8	112	—	—
	UDR INC	2.2	91	—	—
	WP CAREY INC	2.3	175	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	2.3	260	—	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	4.9	651	—	—
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	3	35	27.2	224
		千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
	カナダ				
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.4	19	—	—
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1.1	21	—	—
		千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
	オーストラリア				
	DEXUS/AU	7.753	62	—	—
	LENDLEASE GROUP	6.101	47	—	—

外国株式インデックスマザーファンド

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国		千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
	TRANSURBAN GROUP	19.259	270	—	—
	APA GROUP	8.309	85	—	—
	SCENTRE GROUP	32.277	93	—	—
	GPT GROUP	13.76	60	—	—
	MIRVAC GROUP	28.18	63	—	—
	STOCKLAND	13.654	55	—	—
	GOODMAN GROUP	10.959	224	—	—
	VICINITY CENTRES	23.552	45	—	—
		千口	千香港・ドル	千口	千香港・ドル
	香港				
	LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	20.22	85
		(20.22)	(△90)		
	LINK REIT	40.7	2,023	—	—
		(—)	(90)		
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	—	—	107	536
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34	326	—	—
		千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
	シンガポール				
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	49.5	136	—	—
		(—)	(△3)		
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	56.6	113	—	—
		(—)	(△0)		
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	29.4	48	—	—
		(—)	(△4)		
	KEPPEL REIT	—	—	15.14	11
		(15.14)	(10)		
	CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	—	—	6.852	7
		(6.852)	(7)		
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	11.4	20	—	—
		(—)	(△0)		
		千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
	イギリス				
	LAND SECURITIES GROUP PLC	5.165	34	—	—
	SEGRO PLC	6.908	56	—	—
	BRITISH LAND CO PLC	2.98	13	38.375	124
		千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	ユーロ（ベルギー）				
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	1.197	30	—	—
		千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	ユーロ（フランス）				
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.954	50	—	—
	GECINA SA	0.347	36	—	—
	KLEPIERRE	1.599	38	—	—
		(—)	(△7)		
	COVIVIO	0.399	18	—	—

（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）金額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の種類別取引状況

(2022年12月1日から2023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
		百万円	百万円	百万円	百万円
外国	株式先物取引	115,566	109,696	—	—

(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

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

当期							
買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC (アメリカ)	90.4	2,087,159	23,088	JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	8.8	215,291	24,464
MICROSOFT CORP (アメリカ)	47.5	1,922,769	40,479	FERGUSON PLC (ジャージィー)	8.777	131,432	14,974
AMAZON.COM INC (アメリカ)	67.9	1,069,788	15,755	KONINKLIJKE DSM NV (オランダ)	7.276	127,629	17,541
TESLA INC (アメリカ)	28.8	856,671	29,745	FERROVIAL SA (スペイン)	23.057	104,629	4,537
NVIDIA CORP (アメリカ)	15.9	729,013	45,849	ABIOMED INC (アメリカ)	2	101,117	50,558
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	38.5	607,588	15,781	SWEDISH MATCH AB (スウェーデン)	65.778	95,920	1,458
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	9.5	431,058	45,374	NEWCREST MINING LTD (オーストラリア)	40.32	89,555	2,221
UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)	6.2	430,394	69,418	BLACK KNIGHT INC (アメリカ)	7.65	86,679	11,330
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	19.8	391,454	19,770	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP (アメリカ)	9	70,363	7,818
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	16.4	377,025	22,989	INVESTOR CLASS A (スウェーデン)	23.863	68,354	2,864

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国株式

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)					
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	49	57	1,086	159,813	資本財・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	123	148	4,275	628,851	情報技術
FIRST SOLAR INC	—	49	761	112,009	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	75	86	1,185	174,390	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	54	62	771	113,495	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	26	31	354	52,093	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	211	211	658	96,881	金融
ABBOTT LABORATORIES	723.66	840.66	8,711	1,281,238	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	155.83	189.83	979	144,030	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	65	71	1,691	248,790	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	139	166	752	110,691	一般消費財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AMPHENOL CORP-CL A	247	288	2,597	381,967	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	18	22	1,215	178,750	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	253	287	1,669	245,572	金融
QORVO INC	44.2	48.2	462	67,974	情報技術
AFLAC INC	253	278	2,269	333,748	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	51	59	918	135,128	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	71	79	660	97,130	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	195.2	220.2	13,594	1,999,406	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	86	94	702	103,338	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	48	56	2,454	361,021	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	63	74	895	131,686	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	92	107	2,851	419,345	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	282	322	6,255	919,948	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	86.42	101.42	715	105,261	金融
AUTOZONE INC	8.2	9.2	2,388	351,319	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	92.71	102.71	1,244	182,958	生活必需品
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	478	583	564	83,083	ヘルスケア
CELANESE CORP	44.5	49.5	680	100,055	素材
DR HORTON INC	138.16	149.16	1,898	279,169	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	89	103	322	47,459	ヘルスケア
AUTODESK INC	90	103	2,202	323,944	情報技術
MOODY'S CORP	69	80	2,895	425,785	金融
DEVON ENERGY CORP	259	310	1,391	204,615	エネルギー
ALBEMARLE CORP	48	57	703	103,429	素材
ATMOS ENERGY CORP	58	70	784	115,354	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	102	122	609	89,605	公益事業
CITIGROUP INC	804.73	941.73	4,308	633,638	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	174	200	4,583	674,051	資本財・サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	213	249	1,972	290,088	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	15.3	17.3	672	98,938	一般消費財・サービス
HESS CORP	116	134	1,870	275,036	エネルギー
DAVITA INC	27.5	27.5	273	40,286	ヘルスケア
DANAHER CORP	286.5	339.5	7,554	1,111,048	ヘルスケア
FORTIVE CORP	141	171	1,157	170,283	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	231	271	3,053	449,136	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	233	263	1,924	283,094	生活必需品
BUNGE LTD	63	—	—	—	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	131.95	151.95	1,981	291,475	情報技術
APPLE INC	6,700	7,604	143,996	21,177,631	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	116	124	1,102	162,105	金融
BOEING CO/THE	233	277	6,216	914,291	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	62.15	76.15	766	112,732	金融
BECTON DICKINSON AND CO	117.99	136.99	3,228	474,847	ヘルスケア
LEIDOS HOLDINGS INC	54	63	669	98,417	資本財・サービス
NISOURCE INC	165	200	516	75,917	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	53	55	448	65,980	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	317.71	375.71	1,786	262,740	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,737.04	2,034.04	7,680	1,129,576	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	532.5	627.5	22,507	3,310,221	金融
ANSYS INC	36	42	1,255	184,604	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	551.17	644.17	2,069	304,393	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	290	342	3,808	560,168	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	883	1,016	4,949	727,989	ヘルスケア

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
JPMORGAN CHASE & CO	1,214.7	1,412.7	21,800	3,206,241	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	93	109	1,080	158,959	金融
LKQ CORP	111	129	572	84,216	一般消費財・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	128.12	150.12	874	128,561	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	114	132	3,632	534,271	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	45	50	1,741	256,159	金融
DOLLAR GENERAL CORP	94	106	1,366	200,916	生活必需品
SERVICENOW INC	83	99	6,721	988,517	情報技術
CATERPILLAR INC	221	249	6,211	913,496	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	97	117	853	125,560	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	103	121	427	62,942	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	21	25	492	72,468	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	120	141	800	117,681	公益事業
MOSAIC CO/THE	149	161	586	86,236	素材
DELTA AIR LINES INC	62	78	285	42,031	資本財・サービス
CORNING INC	332	391	1,103	162,277	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,713.5	1,970.5	9,468	1,392,495	情報技術
MORGAN STANLEY	541.52	605.52	4,756	699,517	金融
DECKERS OUTDOOR CORP	—	13	851	125,228	一般消費財・サービス
MSCI INC	34	39	2,053	302,026	金融
FAIR ISAAC CORP	11	12	1,290	189,737	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	13	15	601	88,495	資本財・サービス
MANHATTAN ASSOCIATES INC	—	32	715	105,236	情報技術
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	94	108	604	88,947	資本財・サービス
BROADCOM INC	167.12	199.12	18,733	2,755,180	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	23	533	78,500	ヘルスケア
DICK'S SPORTING GOODS INC	—	31	396	58,334	一般消費財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	50	60	984	144,725	ヘルスケア
ARAMARK	96	120	333	49,027	一般消費財・サービス
DTE ENERGY COMPANY	79	100	1,041	153,158	公益事業
CENTENE CORP	242.07	265.07	1,868	274,758	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	44	51	915	134,635	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	202	234	637	93,744	金融
DARLING INGREDIENTS INC	—	75	312	45,929	生活必需品
ARTHUR J GALLAGHER & CO	87	104	2,548	374,764	金融
GARTNER INC	33.5	38.5	1,655	243,542	情報技術
SPLUNK INC	67	76	1,144	168,330	情報技術
DOMINION ENERGY INC	335.41	404.41	1,889	277,934	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	164	380	2,078	305,755	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	53	60	450	66,269	資本財・サービス
DEERE & CO	120	135	4,913	722,582	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC	60	70	1,299	191,083	資本財・サービス
POOL CORP	17	19	656	96,493	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	116.84	126.84	1,475	217,062	金融
VMWARE INC-CLASS A	87	—	—	—	情報技術
CABLE ONE INC	2	—	—	—	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	27	31	531	78,198	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	143	166	924	135,983	金融
VAIL RESORTS INC	17	19	408	60,139	一般消費財・サービス
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	209	—	—	—	コミュニケーション・サービス
TARGA RESOURCES CORP	90	104	915	134,613	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	30	34	376	55,439	金融
WESTLAKE CORP	16	18	231	34,088	素材

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CONSOLIDATED EDISON INC	147	168	1,510	222,221	公益事業
COGNEX CORP	69	84	315	46,462	情報技術
WEBSTER FINANCIAL CORP	73	85	378	55,679	金融
TELEFLEX INC	19	23	508	74,840	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	35	40	728	107,096	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	31	36	1,256	184,736	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	9	11	334	49,259	ヘルスケア
CATALENT INC	69	87	344	50,630	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	58	70	1,213	178,472	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	24	28	982	144,466	ヘルスケア
CARLISLE COS INC	22	25	687	101,151	資本財・サービス
IDEX CORP	31	37	733	107,906	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	329	381	2,967	436,390	生活必需品
ROLLINS INC	92.07	116.07	466	68,605	資本財・サービス
AECOM	—	64	561	82,641	資本財・サービス
WATSCO INC	—	16	608	89,524	資本財・サービス
GRACO INC	—	80	640	94,242	資本財・サービス
AMETEK INC	96	112	1,712	251,821	資本財・サービス
TORO CO	—	49	404	59,460	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	100	118	1,116	164,275	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	64.5	78.5	417	61,454	資本財・サービス
HEICO CORP	18	21	354	52,124	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	26	30	346	51,003	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	16	18	817	120,288	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	108	126	1,184	174,189	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	17	20	814	119,806	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	182.6	213.6	12,556	1,846,712	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	32.5	—	—	—	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	24	28	733	107,882	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	53	62	627	92,332	素材
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	—	28	756	111,287	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	12	13	2,845	418,538	一般消費財・サービス
UGI CORP	85	—	—	—	公益事業
CUMMINS INC	58	68	1,522	223,967	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	323	—	—	—	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	56	65	1,378	202,748	情報技術
SIGNATURE BANK	26.5	—	—	—	金融
COSTAR GROUP INC	164	198	1,662	244,432	不動産
SVB FINANCIAL GROUP	24	—	—	—	金融
OLD DOMINION FREIGHT LINE	40	48	1,842	271,015	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	18.9	21.9	3,527	518,740	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	30	35	546	80,305	金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	115.16	128.16	2,135	314,128	一般消費財・サービス
DEXCOM INC	162	187	2,172	319,519	ヘルスケア
NORDSON CORP	20.9	24.9	579	85,179	資本財・サービス
COPART INC	174	415	2,084	306,512	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	70	83	1,276	187,728	エネルギー
SEAGEN INC	57	68	1,451	213,536	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	31	35	757	111,431	ヘルスケア
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	33	38	823	121,173	金融
TRANSDIGM GROUP INC	20.9	26.9	2,563	376,953	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	15.8	76.2	480	70,736	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	39	46	522	76,812	ヘルスケア

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	90	—	—	—	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	843. 81	974. 81	1, 688	248, 308	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	98	102	2, 540	373, 648	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	16	18	426	62, 763	金融
COTERRA ENERGY INC	330	366	954	140, 436	エネルギー
T-MOBILE US INC	259. 27	260. 27	3, 892	572, 446	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	67. 5	74. 5	315	46, 335	不動産
COCA-COLA CO/THE	1, 704. 5	1, 987. 5	11, 573	1, 702, 072	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	88	107	638	93, 946	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	69. 5	73. 5	878	129, 196	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	124	140	344	50, 630	金融
CSX CORP	899	991	3, 144	462, 453	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	38	43	920	135, 390	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	63. 25	68. 25	926	136, 259	一般消費財・サービス
AMAZON. COM INC	3, 788	4, 467	65, 361	9, 612, 663	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	257	293	1, 975	290, 566	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1, 742. 05	1, 955. 05	20, 007	2, 942, 573	エネルギー
AES CORP	271	324	557	82, 054	公益事業
EVEREST GROUP LTD	16	21	844	124, 261	金融
EOG RESOURCES INC	242	283	3, 487	512, 934	エネルギー
EQT CORP	141	175	695	102, 305	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	65	73	844	124, 216	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	5	5	721	106, 064	金融
ABIOMED INC	19	—	—	—	ヘルスケア
CENCORA INC	65	83	1, 656	243, 550	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	124	143	1, 824	268, 334	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1, 634. 23	1, 901. 23	2, 013	296, 111	一般消費財・サービス
EXACT SCIENCES CORP	71	87	566	83, 244	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	62. 37	—	—	—	コミュニケーション・サービス
ENTEGRIS INC	62	72	752	110, 666	情報技術
AERCAP HOLDINGS NV	56	82	545	80, 173	資本財・サービス
FORTINET INC	282	323	1, 731	254, 619	情報技術
MARKEL CORP	5. 5	6. 1	863	126, 957	金融
NEXTERA ENERGY INC	812. 8	978. 8	5, 712	840, 104	公益事業
MASIMO CORP	22	—	—	—	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	599. 08	693. 08	2, 576	378, 878	素材
INSULET CORP	29	34	642	94, 467	ヘルスケア
US BANCORP	584	741	2, 800	411, 831	金融
UNITED RENTALS INC	30	33	1, 571	231, 124	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	25	29	493	72, 526	情報技術
SUPER MICRO COMPUTER INC	—	25	719	105, 754	情報技術
FASTENAL CO	238	276	1, 646	242, 086	資本財・サービス
FISERV INC	254. 33	298. 33	3, 859	567, 572	金融
GENERAL ELECTRIC CO	455. 06	527. 06	6, 264	921, 339	資本財・サービス
AXON ENTERPRISE INC	—	34	767	112, 938	資本財・サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP	—	22	341	50, 160	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	573	673	2, 126	312, 770	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	98	113	2, 766	406, 880	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	142. 5	161. 5	5, 495	808, 178	金融
FIRST HORIZON CORP	—	257	325	47, 813	金融
ALPHABET INC-CL A	2, 488	2, 873	38, 782	5, 703, 760	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	2, 333. 4	2, 554. 4	34, 842	5, 124, 215	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	39	44	590	86, 803	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
GENERAL MILLS INC	249	283	1,771	260,504	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	224.18	263.18	973	143,134	公益事業
GENUINE PARTS CO	59.5	68.5	916	134,854	一般消費財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	284	330	937	137,882	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	80.5	92.5	1,745	256,652	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	373	436	1,626	239,176	エネルギー
REPLIGEN CORP	—	26	414	60,986	ヘルスケア
HOME DEPOT INC	425.5	486.5	15,131	2,225,334	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	22.5	26.5	434	63,838	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	595	698	776	114,254	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	17.1	19.1	446	65,661	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	60	71	1,318	193,928	生活必需品
HUMANA INC	52	60	2,894	425,688	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	109	126	2,574	378,640	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	33.2	—	—	—	情報技術
HENRY SCHEIN INC	56	63	419	61,763	ヘルスケア
HP INC	473	473	1,375	202,222	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	538	625	1,032	151,849	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	68.28	—	—	—	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	79	—	—	—	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	29.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	154	180	1,482	218,081	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	304.03	418.03	1,466	215,670	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	56	66	666	97,998	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	372	439	6,866	1,009,841	情報技術
HUBBELL INC	—	26	766	112,672	資本財・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	143	160	572	84,218	素材
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	52	61	415	61,040	資本財・サービス
ZOETIS INC	195	224	3,937	579,116	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	96.99	109.99	2,448	360,131	資本財・サービス
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	—	68	401	59,064	情報技術
CHENIERE ENERGY INC	95	117	2,111	310,486	エネルギー
HYATT HOTELS CORP - CL A	—	23	261	38,497	一般消費財・サービス
ALLEGION PLC	36.5	43.5	454	66,911	資本財・サービス
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	—	68	917	134,900	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	129.73	—	—	—	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	106.37	125.37	1,662	244,563	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	134	156	437	64,331	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	44	50	542	79,844	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	1,089	1,165	17,720	2,606,200	ヘルスケア
PLUG POWER INC	211	—	—	—	資本財・サービス
ABBVIE INC	730.72	852.72	11,810	1,736,921	ヘルスケア
HOLOGIC INC	101	119	840	123,559	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	139	163	1,984	291,912	生活必需品
KROGER CO	286	330	1,440	211,798	生活必需品
KLA CORP	62	66	3,590	528,108	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	99	110	4,895	719,923	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	31	34	806	118,624	金融
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	105	105	336	49,492	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	272	283	5,657	832,083	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	333.85	389.85	23,073	3,393,443	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	56.8	64.8	4,626	680,442	情報技術
LOEWS CORP	86	94	643	94,712	金融

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LINCOLN NATIONAL CORP	66.49	—	—	—	金融
MCDONALD'S CORP	306.5	353.5	9,911	1,457,674	一般消費財・サービス
3M CO	234.9	266.9	2,628	386,524	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	948	1,070	35,545	5,227,661	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	144.39	159.39	6,608	971,977	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	26	30	1,388	204,161	素材
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	23.2	27.2	213	31,422	情報技術
ALCOA CORP	77	—	—	—	素材
PHILLIPS 66	199	222	2,713	399,042	エネルギー
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	—	73	1,427	209,944	情報技術
MGM RESORTS INTERNATIONAL	160.5	160.5	632	93,073	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	104	121	777	114,389	生活必需品
METLIFE INC	284	315	1,989	292,601	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	352	416	2,333	343,226	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	102	127	2,785	409,606	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	68.98	80.98	2,583	379,967	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	9	11	1,201	176,730	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	408.23	490.23	1,634	240,375	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	48	56	1,515	222,831	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	1,046.21	1,227.21	12,410	1,825,252	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	207.51	225.51	1,611	236,936	素材
MASCO CORP	98	109	658	96,776	資本財・サービス
M & T BANK CORP	73.99	79.99	1,021	150,263	金融
MARSH & MCLENNAN COS	207.7	238.7	4,686	689,228	金融
BLACK KNIGHT INC	63.5	—	—	—	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	30.2	36.2	492	72,400	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	115.02	124.02	2,511	369,315	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	82	100	2,634	387,514	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	29	—	—	—	一般消費財・サービス
BLOCK INC CLASS A	215.12	263.12	1,676	246,616	金融
TRANSUNION	80	93	546	80,410	資本財・サービス
VISTRA CORP	176	176	614	90,388	公益事業
NOVOCURE LTD	38.5	—	—	—	ヘルスケア
NETAPP INC	92	103	922	135,637	情報技術
NIKE INC -CL B	525	596	6,578	967,434	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	99	110	2,365	347,949	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	229	263	2,182	320,961	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	81.05	96.05	996	146,558	金融
ALLY FINANCIAL INC	142	142	406	59,811	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	61	70	3,271	481,193	資本財・サービス
APTIV PLC	112	137	1,127	165,762	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	328.11	384.11	1,551	228,110	素材
MCKESSON CORP	61	65	2,968	436,584	ヘルスケア
XYLEM INC	73	116	1,200	176,572	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	641	751	7,033	1,034,360	生活必需品
NUCOR CORP	111	122	1,998	293,862	素材
WESTERN UNION CO	152.46	—	—	—	金融
GODADDY INC - CLASS A	68	70	685	100,807	情報技術
NEWELL BRANDS INC	164.42	—	—	—	一般消費財・サービス
EVERGY INC	93.5	111.5	564	83,041	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	388.24	335.24	2,022	297,449	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	11.5	12.5	358	52,755	金融
OKTA INC	62	75	530	78,061	情報技術

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
COUPA SOFTWARE INC	29	—	—	—	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	56	58	477	70, 296	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	173. 05	—	—	—	ヘルスケア
LINDE PLC	208. 46	—	—	—	素材
WIX. COM LTD	23. 1	28. 1	286	42, 198	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	158	168	503	74, 024	金融
KKR & CO INC	233	292	2, 182	320, 966	金融
PAYCHEX INC	134	157	1, 902	279, 735	資本財・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	27	29	2, 824	415, 388	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	749	863	3, 603	530, 023	生活必需品
P G & E CORP	617	920	1, 579	232, 317	公益事業
PFIZER INC	2, 321. 13	2, 731. 13	8, 215	1, 208, 215	ヘルスケア
CIGNA CORP	131	143	3, 759	552, 842	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	118. 01	124. 01	930	136, 895	情報技術
XCEL ENERGY INC	225	266	1, 596	234, 723	公益事業
STERIS PLC	41	48	947	139, 380	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	155	190	698	102, 663	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	60. 33	65. 33	180	26, 604	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	127. 99	136. 99	405	59, 595	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	140. 8	164. 8	4, 851	713, 468	ヘルスケア
LYFT INC-A	125	—	—	—	資本財・サービス
DOW INC	301. 18	342. 18	1, 756	258, 315	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	45	53	503	74, 057	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	94	115	781	114, 924	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	53	62	2, 653	390, 319	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	609	881	4, 968	730, 767	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	95	113	2, 597	382, 035	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	992. 67	1, 139. 67	17, 223	2, 533, 109	生活必需品
EXELON CORP	405. 22	481. 22	1, 847	271, 697	公益事業
TELADOC HEALTH INC	65	—	—	—	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	168. 08	196. 08	1, 364	200, 708	資本財・サービス
NVR INC	1. 3	1. 6	977	143, 707	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	535. 02	585. 02	6, 667	980, 585	エネルギー
TWILIO INC - A	70	83	548	80, 723	情報技術
DOCUSIGN INC	83	98	427	62, 868	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	21	25	453	66, 655	資本財・サービス
CERIDIAN HCM HOLDING INC	57	71	490	72, 185	資本財・サービス
PEPSICO INC	572	666	11, 132	1, 637, 309	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	18. 2	22. 2	442	65, 057	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	121	126	353	52, 034	情報技術
MONGODB INC	28	34	1, 429	210, 270	情報技術
SNAP INC - A	458	497	645	94, 875	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	298. 68	343. 68	1, 563	229, 979	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	155	176	1, 700	250, 042	金融
AMCOR PLC	614	711	674	99, 233	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	84	108	2, 531	372, 374	情報技術
ROKU INC	48	60	640	94, 198	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	75	94	1, 233	181, 406	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	262	305	10, 166	1, 495, 241	情報技術
PENTAIR PLC	66. 75	79. 75	508	74, 736	資本財・サービス
QUALCOMM INC	463	539	6, 894	1, 013, 951	情報技術
INVESCO LTD	141	167	238	35, 072	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	25. 5	—	—	—	一般消費財・サービス

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	106	118	875	128,716	金融
DATADOG INC - CLASS A	100	122	1,423	209,299	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	238	287	955	140,471	コミュニケーション・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	45	52	4,204	618,380	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	91	107	1,711	251,673	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	17	18	5,627	827,610	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	145	165	2,131	313,523	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	38.3	43.3	700	103,068	素材
RESMED INC	61	71	1,127	165,870	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	49.3	54.3	734	108,025	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	45	52	418	61,563	資本財・サービス
MODERNA INC	139	157	1,240	182,434	ヘルスケア
HUBSPOT INC	18.8	22.8	1,132	166,492	情報技術
REVVITY INC	51	61	545	80,212	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	350.87	403.87	2,108	310,112	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	175.38	200.38	1,689	248,519	資本財・サービス
BILL HOLDINGS INC	39	45	305	44,963	情報技術
AVANTOR INC	248	327	682	100,319	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	80	102	352	51,783	金融
DYNATRACE INC	81	122	651	95,866	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	183	215	1,512	222,510	コミュニケーション・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	386.85	453.85	747	109,933	金融
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	110	132	187	27,605	コミュニケーション・サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	144	184	494	72,793	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	32.3	—	—	—	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	116	135	438	64,487	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	772.18	878.18	12,637	1,858,654	エネルギー
ZSCALER INC	35	42	839	123,439	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	158	185	1,216	178,973	公益事業
ETSY INC	52	60	463	68,122	一般消費財・サービス
TESLA INC	1,091.5	1,379.5	33,679	4,953,187	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	92	126	2,209	324,882	情報技術
GEN DIGITAL INC	236	279	607	89,327	情報技術
UNITY SOFTWARE INC	79	113	343	50,455	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	66.02	74.02	676	99,564	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	63	74	4,088	601,252	情報技術
CHEWY INC - CLASS A	39.5	57.5	101	14,993	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	105	133	1,041	153,176	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	49.05	50.05	1,996	293,624	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	490.21	580.21	529	77,907	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	78.5	122.5	1,163	171,080	一般消費財・サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	146	203	785	115,479	コミュニケーション・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	156	199	2,516	370,168	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	136	150	1,190	175,116	不動産
SOUTHERN CO/THE	440	527	3,701	544,323	公益事業
SYSCO CORP	211	245	1,756	258,386	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	99.03	112.03	1,987	292,354	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	25	29	158	23,261	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	46	53	306	45,115	金融
STEEL DYNAMICS INC	78.5	81.5	941	138,428	素材
SCHLUMBERGER LTD	584.52	689.52	3,576	526,001	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	62	74	239	35,228	資本財・サービス
AFFIRM HOLDINGS INC	77	—	—	—	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AT&T INC	2, 961. 91	3, 458. 91	5, 638	829, 184	コミュニケーション・サービス
APA CORP	144	149	541	79, 567	エネルギー
SOUTHWEST AIRLINES CO	60. 5	69. 5	176	25, 890	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	180	209	1, 496	220, 142	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	87	104	468	68, 874	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	102	119	3, 257	479, 046	素材
SEMPRA ENERGY	130	304	2, 217	326, 154	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	78	105	552	81, 273	情報技術
CLARIVATE PLC	134	175	134	19, 817	資本財・サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	685	877	1, 739	255, 897	情報技術
UIPATH INC - CLASS A	—	175	347	51, 139	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	84. 5	88. 5	694	102, 147	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	49	81	1, 035	152, 267	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC	381	439	6, 725	989, 116	情報技術
SALESFORCE. COM INC	410. 66	469. 66	10, 818	1, 591, 094	情報技術
WESTROCK CO	107	124	497	73, 129	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	166. 09	192. 09	1, 772	260, 668	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	288. 34	332. 34	1, 753	257, 876	資本財・サービス
TERADYNE INC	66	75	695	102, 316	情報技術
UNION PACIFIC CORP	259. 8	294. 8	6, 528	960, 210	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	299	299	756	111, 254	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	239. 88	221. 88	3, 270	481, 059	エネルギー
RTX CORP	614. 79	706. 79	5, 721	841, 455	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	304	351	5, 345	786, 144	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	78. 04	90. 04	1, 925	283, 131	ヘルスケア
AMEREN CORPORATION	107	127	977	143, 801	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	387. 66	449. 66	24, 055	3, 537, 902	ヘルスケア
APPLOVIN CORP CLASS A	49	—	—	—	情報技術
TOAST INC CLASS A	—	144	219	32, 338	金融
VERISIGN INC	41	45	952	140, 106	情報技術
LUCID GROUP INC	168	449	195	28, 791	一般消費財・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	132	309	535	78, 710	一般消費財・サービス
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	—	222	198	29, 123	金融
VALERO ENERGY CORP	169. 42	176. 42	2, 189	321, 939	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	22	24	1, 008	148, 250	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	108. 88	124. 88	554	81, 527	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	28. 3	31. 3	424	62, 489	ヘルスケア
ELEVANCE HEALTH INC	100	115	5, 351	787, 065	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	752. 62	883. 62	8, 173	1, 202, 074	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1, 567. 22	1, 771. 22	7, 754	1, 140, 439	金融
WASTE MANAGEMENT INC	172	197	3, 343	491, 784	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	504	589	2, 146	315, 658	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	46	53	1, 061	156, 042	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	24	27	296	43, 532	一般消費財・サービス
WALMART INC	626	716	11, 175	1, 643, 555	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	87	101	1, 150	169, 217	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	45	50	418	61, 526	一般消費財・サービス
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	559	974	299	44, 119	資本財・サービス
WABTEC CORP	71. 11	87. 11	1, 003	147, 585	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	484	556	4, 898	720, 401	一般消費財・サービス
WATERS CORP	25	29	811	119, 309	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	22	25	591	86, 999	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	304	355	709	104, 315	生活必需品

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	48.63	50.63	1,219	179,281	金融
WESTERN DIGITAL CORP	127	155	733	107,869	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	130	153	1,269	186,696	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	204	241	1,525	224,324	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	681.5	782.5	19,893	2,925,736	金融
PPL CORP	304	357	929	136,667	公益事業
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	135.24	157.24	1,895	278,844	公益事業
PULTEGROUP INC	98.5	108.5	954	140,438	一般消費財・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	954.53	1,118.53	1,205	177,333	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC	98	114	1,590	233,969	素材
NORTHERN TRUST CORP	82	101	790	116,277	金融
FERGUSON PLC	—	99	1,669	245,596	資本財・サービス
NVIDIA CORP	1,035.8	1,194.8	57,517	8,459,124	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	171.13	193.13	2,556	376,007	金融
DRAFTKINGS INC CLASS A	—	216	826	121,572	一般消費財・サービス
ASPEN TECHNOLOGY CORP	—	14	261	38,416	情報技術
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	35	—	—	—	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	121	138	649	95,572	生活必需品
NETFLIX INC	183.9	214.9	10,254	1,508,175	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	162	187	9,217	1,355,633	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	98.5	111.5	522	76,826	公益事業
GLOBE LIFE INC	38.55	42.55	511	75,256	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	74	—	—	—	金融
TEXTRON INC	89	98	733	107,851	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	152.87	178.87	399	58,768	コミュニケーション・サービス
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2.5	3.5	578	85,039	エネルギー
OMNICOM GROUP	83	97	773	113,826	コミュニケーション・サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	52.2	61.2	772	113,588	資本財・サービス
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC CLA	209	—	—	—	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	662.33	788.33	9,161	1,347,335	情報技術
MASTERCARD INC - A	359	409	16,761	2,465,134	金融
ONEOK INC	185	216	1,455	214,078	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	373.52	—	—	—	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	44	52	2,734	402,135	情報技術
U HAUL NON VOTING SERIES N	36	46	246	36,295	資本財・サービス
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	—	78	866	127,505	金融
CHESAPEAKE ENERGY CORP	—	55	438	64,520	エネルギー
HF SINCLAIR CORP	—	73	384	56,611	エネルギー
OVINTIV INC	—	121	531	78,157	エネルギー
YUM! BRANDS INC	117	136	1,707	251,059	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	66	82	1,287	189,349	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	74	92	552	81,317	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	2,999.01	3,468.01	10,511	1,545,931	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	19	23	917	134,999	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	77	91	816	120,102	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	265	306	5,123	753,492	金融
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	—	200.35	1,356	199,510	ヘルスケア
LINDE PLC	—	237.46	9,768	1,436,707	素材
ANALOG DEVICES INC	214.91	241.91	4,419	650,040	情報技術
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	—	154	328	48,241	生活必需品
MONDAYCOM LTD	—	11	192	28,310	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	670.27	779.27	9,651	1,419,410	情報技術
LIBERTY MEDIA LIBERTY SIRIUSXM COR	—	80.28	216	31,807	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 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	—	96	608	89,484	コミュニケーション・サービス
CONFLUENT INC CLASS A	—	85	180	26,527	情報技術
KENVUE INC	—	741	1,487	218,829	生活必需品
GLOBAL E ONLINE LTD	—	47	161	23,757	一般消費財・サービス
VERALTO CORP	—	113.16	839	123,520	資本財・サービス
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	329.72	349.72	2,267	333,442	金融
BUNGE GLOBAL LTD	—	73	789	116,057	生活必需品
LIBERTY GLOBAL LTD CLASS C	—	129.73	219	32,225	コミュニケーション・サービス
SKYWORKS SOLUTIONS INC	66	77	739	108,714	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	93	111	1,175	172,895	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	34.3	39.3	755	111,181	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	216	245	1,717	252,657	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	246	276	2,437	358,461	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	88	99	3,188	468,975	金融
AMGEN INC	226	258	6,878	1,011,588	ヘルスケア
EATON CORP PLC	165.36	193.36	4,366	642,117	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	67	80	1,903	279,962	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	360	406	6,064	891,834	情報技術
CME GROUP INC	149	174	3,738	549,779	金融
ECOLAB INC	106	124	2,339	343,998	素材
EQUIFAX INC	51	59	1,277	187,946	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	519	603	4,536	667,163	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	323	441	1,399	205,794	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	124	145	441	64,977	生活必需品
STATE STREET CORP	152.13	167.13	1,198	176,335	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	601.4	727.4	4,336	637,700	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	208	244	888	130,621	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	86	94	373	54,966	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	49.8	57.8	485	71,464	素材
CARDINAL HEALTH INC	113	123	1,295	190,483	ヘルスケア
FEDEX CORP	102	115	2,920	429,473	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	167.54	184.54	2,032	298,896	金融
FMC CORP	51.5	60.5	318	46,873	素材
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	105.13	123.13	926	136,231	素材
INTEL CORP	1,692	2,017	9,064	1,333,101	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	160	187	572	84,266	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	134.5	150.5	1,158	170,387	金融
WOLFSPEED INC	—	58	210	30,921	情報技術
ILLINOIS TOOL WORKS	129	147	3,540	520,657	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	386	386	181	26,681	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	65	76	771	113,528	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	58	67	222	32,674	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	149	170	5,282	776,959	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	43.5	48.5	708	104,261	情報技術
SNAP-ON INC	22	26	706	103,946	資本財・サービス
CARMAX INC	66	77	486	71,524	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP	318.28	373.28	3,386	497,982	公益事業
TARGET CORP	194	223	2,928	430,685	生活必需品
DOVER CORP	60	68	957	140,780	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	19	22	1,706	250,977	資本財・サービス
JABIL INC	—	68	783	115,248	情報技術
CINTAS CORP	38	44	2,415	355,314	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	199	231	647	95,192	生活必需品

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LAMB WESTON HOLDINGS INC		—	70	682	100,406	生活必需品
CLOROX COMPANY		51	60	854	125,603	生活必需品
ENTERGY CORP		84	102	1,026	150,896	公益事業
MICROSOFT CORP		2,941	3,416	129,415	19,033,087	情報技術
INCYTE CORP		76	92	491	72,239	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP		541.69	619.69	4,145	609,711	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC		549.98	642.98	5,070	745,724	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC		462	530	4,064	597,776	情報技術
BLACKROCK INC		63	72	5,380	791,318	金融
CENTERPOINT ENERGY INC		260	305	850	125,104	公益事業
HASBRO INC		54	64	297	43,702	一般消費財・サービス
KELLOGG CO		104	133	687	101,048	生活必需品
KEYCORP		386	453	563	82,878	金融
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A		572.11	659.11	4,642	682,812	生活必需品
COOPER COS INC/THE		20	24	795	117,040	ヘルスケア
CHUBB LTD		175.99	199.99	4,501	662,017	金融
ARROW ELECTRONICS INC		27	29	346	51,001	情報技術
ALLSTATE CORP		114	127	1,720	253,066	金融
EBAY INC		249	259	1,052	154,802	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC		455.5	512.5	2,970	436,939	金融
EASTMAN CHEMICAL CO		52	58	482	70,961	素材
DISH NETWORK CORP-A		96	—	—	—	コミュニケーション・サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A		96	112	1,406	206,886	生活必需品
TRIMBLE INC		102	120	551	81,041	情報技術
LENNAR CORP-A		106	122	1,547	227,583	一般消費財・サービス
LEAR CORP		25	29	390	57,496	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP		242	283	4,612	678,419	金融
PACCAR INC		144.37	252.55	2,306	339,148	資本財・サービス
BIOGEN INC		61	70	1,624	238,903	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC		35	40	1,866	274,573	ヘルスケア
STARBUCKS CORP		474	554	5,531	813,545	一般消費財・サービス
PTC INC		46	54	839	123,486	情報技術
EVERSOURCE ENERGY		143	169	1,009	148,408	公益事業
INTUIT INC		110.8	134.8	7,781	1,144,360	情報技術
BORGWARNER INC		97	114	389	57,272	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC		88.5	95.5	675	99,411	一般消費財・サービス
BALL CORP		130.04	152.04	833	122,580	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP		590.97	694.97	3,852	566,648	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC		116	128	1,757	258,485	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO		55	64	1,361	200,184	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		106	125	4,387	645,269	ヘルスケア
VF CORP		134	160	274	40,308	一般消費財・サービス
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B		252.25	271.25	390	57,485	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC		22	25	219	32,281	一般消費財・サービス
CARNIVAL CORP		409	487	726	106,790	一般消費財・サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC		218	250	422	62,137	素材
COMCAST CORP-CLASS A		1,847.9	2,009.9	8,367	1,230,566	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		87	87	343	50,489	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		486	576	183	27,023	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	141,212.8	165,154.98	1,905,237	280,203,284	
	銘柄数<比率>	597銘柄	603銘柄		<67.4%>	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)					
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	335	358	2,729	295,308	生活必需品
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	—	161.81	785	84,955	金融
IMPERIAL OIL LTD	95	95	743	80,420	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	8	9	2,894	313,175	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	116.87	135.87	1,286	139,217	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	179	209	1,393	150,802	素材
INTACT FINANCIAL CORP	71.5	81.5	1,702	184,222	金融
BCE INC	49.3	49.3	261	28,338	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	78	88	1,363	147,588	素材
SUNCOR ENERGY INC	582.3	606.3	2,718	294,119	エネルギー
METRO INC/CN	96	107	740	80,099	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	134	155	1,387	150,147	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	482	548	3,272	354,074	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	366	417	2,225	240,779	金融
TORONTO-DOMINION BANK	737	846	7,047	762,575	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	114	125	538	58,230	金融
ROYAL BANK OF CANADA	575.5	637.5	7,574	819,597	金融
TOURMALINE OIL CORP	129	148	966	104,626	エネルギー
TC ENERGY CORP	397.5	468.5	2,361	255,560	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	223.29	253.29	1,140	123,447	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	721	807	1,907	206,437	素材
CAE INC	126	142	375	40,642	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	68.12	72.41	1,369	148,153	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	65	71	260	28,211	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	35	35	354	38,343	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	61.5	69.5	390	42,273	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	—	176	378	40,946	金融
HYDRO ONE LTD	131	152	570	61,745	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	67.6	73.6	886	95,937	生活必需品
STANTEC INC	—	58	562	60,885	資本財・サービス
NORTHLAND POWER INC	94	112	245	26,517	公益事業
WSP GLOBAL INC	50	57	1,062	114,989	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	33	37	409	44,261	資本財・サービス
PARKLAND CORP	58	66	288	31,224	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	60	68	202	21,876	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	104	126	598	64,763	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC	33	35	555	60,109	資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A	48	61	184	19,934	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	144	163	935	101,278	コミュニケーション・サービス
BRP INC/CA- SUB VOTING	16	16	152	16,447	一般消費財・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	246	267	294	31,839	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	185.17	226.17	1,641	177,680	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	267	293	242	26,188	公益事業
AIR CANADA	65	76	132	14,350	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	530	561	444	48,139	素材
BANK OF MONTREAL	273	328	3,611	390,776	金融
POWER CORP OF CANADA	222	266	992	107,450	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	463	552	5,504	595,646	情報技術
NUTRIEN LTD	223.19	231.19	1,744	188,803	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	53	63	227	24,623	公益事業
CAMECO CORP	158	200	1,201	130,025	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	15	18	382	41,345	不動産

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	71	108	403	43,626	資本財・サービス
LIGHTSPEED COMMERCE INC	53	—	—	—	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	26	26	73	7,905	金融
TELUS CORP	108	108	257	27,884	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	194	209	1,053	113,984	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	22	24	337	36,491	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	466	509	4,590	496,701	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	10	10	1,229	133,027	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	113	125	921	99,729	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	29.37	31.37	508	55,049	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	78	170	361	39,146	素材
BLACKBERRY LTD	224	—	—	—	情報技術
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	—	38	417	45,182	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	238	270	1,846	199,783	金融
ENBRIDGE INC	821	931	4,368	472,688	エネルギー
BROOKFIELD CORP	571.25	647.25	3,130	338,708	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	780	846	2,219	240,215	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	113	—	—	—	ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	377.2	428.2	4,151	449,222	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	44	47	418	45,315	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	75	83	403	43,667	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	237.5	259.5	4,036	436,735	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	87	97	1,329	143,852	情報技術
ONEX CORPORATION	29	32	298	32,265	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	190	—	—	—	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	31	36	120	13,050	金融
TMX GROUP LTD	23	125	358	38,820	金融
OPEN TEXT CORP	110	121	669	72,445	情報技術
SAPUTO INC	102	117	304	32,980	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	233	271	307	33,313	素材
FORTIS INC	193	223	1,212	131,175	公益事業
RB GLOBAL INC	44	84	721	78,061	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	246	304	283	30,626	素材
CENOVUS ENERGY INC	555	659	1,582	171,216	エネルギー
DOLLARAMA INC	112	128	1,246	134,907	一般消費財・サービス
ALTAGAS LTD	111	130	351	38,037	公益事業
KEYERA CORP	88	102	336	36,412	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	286	286	620	67,095	エネルギー
カナダ・ドル通貨計 株数、金額	16,476.16	18,563.26	111,713	12,088,466	
カナダ・ドル通貨計 銘柄数<比率>	86銘柄	86銘柄		<2.9%>	
	百株	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	1,006.4	458	44,721	一般消費財・サービス
TELSTRA GROUP LTD	1,563.94	1,823.47	689	67,169	コミュニケーション・サービス
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	—	1,355.6	3,277	319,425	金融
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,050.94	1,247.81	426	41,586	金融
BHP GROUP LTD	1,973.18	2,285.01	10,554	1,028,532	素材
SOUTH32 LTD	1,770.77	2,056.49	629	61,323	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	740.59	856.46	2,655	258,732	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	660.05	763.85	1,892	184,455	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,250.31	1,416.29	3,979	387,829	金融
WESTPAC BANKING CORP	1,362.77	1,582.75	3,347	326,215	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
SANTOS LTD	1, 254. 13	1, 449. 25	1, 005	98, 013	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	1, 168. 89	—	—	—	金融
RIO TINTO LTD	144. 67	167. 44	2, 085	203, 277	素材
ORIGIN ENERGY LTD	688. 87	752. 81	632	61, 623	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD	676	838. 43	297	29, 005	資本財・サービス
PILBARA MINERALS LTD	—	1, 224. 21	435	42, 470	素材
XERO LTD	51. 35	64. 82	661	64, 480	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	79	103. 88	347	33, 912	金融
COLES GROUP LTD	520. 8	603. 47	917	89, 388	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	54	73. 81	487	47, 472	情報技術
IDP EDUCATION LTD	79	111. 69	255	24, 913	一般消費財・サービス
IGO LTD	—	304. 05	259	25, 274	素材
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	445. 84	519. 49	658	64, 140	素材
EVOLUTION MINING LTD	656	—	—	—	素材
REECE LTD	105	105	197	19, 277	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	512. 6	649. 15	317	30, 933	生活必需品
SEEK LTD	128. 45	162. 68	380	37, 064	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	275. 29	309. 76	328	32, 057	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	340. 97	—	—	—	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	665. 19	755. 26	7, 804	760, 509	金融
AMPOL LTD	88	104. 54	357	34, 790	エネルギー
ORICA LTD	177. 51	194. 99	301	29, 395	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	562. 69	672. 99	1, 020	99, 489	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD	473. 31	549. 7	1, 884	183, 632	生活必需品
QANTAS AIRWAYS LTD	354. 69	390. 82	203	19, 804	資本財・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	174. 15	199. 14	946	92, 276	素材
MACQUARIE GROUP LTD	141. 98	165. 61	2, 742	267, 224	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	229. 09	265. 26	1, 068	104, 173	一般消費財・サービス
CSL LTD	187. 75	217. 58	5, 704	555, 947	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	442. 06	511. 74	2, 697	262, 909	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	25. 1	29. 68	792	77, 224	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	178	206. 66	419	40, 902	素材
SUNCORP GROUP LTD	480. 15	572. 84	780	76, 087	金融
ASX LTD	73. 65	87. 54	508	49, 546	金融
COMPUTERSHARE LTD	206. 89	251. 69	585	57, 099	資本財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	964. 1	1, 104. 68	636	62, 007	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	173. 28	195. 99	566	55, 215	ヘルスケア
BRAMBLES LTD	561. 58	626. 38	818	79, 719	資本財・サービス
MINERAL RESOURCES LTD	66. 66	76. 02	465	45, 360	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD	69. 73	82. 91	406	39, 589	ヘルスケア
REA GROUP LTD	20. 23	23. 95	379	36, 978	コミュニケーション・サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	22	—	—	—	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	24, 740. 7	29, 120. 04	68, 272	6, 653, 182	
オーストラリア・ドル通貨計 銘柄数＜比率＞	49 銘柄	48 銘柄		＜1. 6%＞	
	百株	百株	千香港・ドル	千円	
(香港)					
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	580	720	2, 869	54, 055	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	940	1, 140	4, 588	86, 447	一般消費財・サービス
MTR CORP	665	810	2, 276	42, 881	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	605	755	5, 768	108, 672	不動産
SINO LAND CO	1, 420	1, 820	1, 414	26, 642	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1, 116. 69	1, 396. 69	5, 468	103, 017	資本財・サービス

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千香港・ドル	千円	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		215	240	1, 224	23, 060	不動産
CLP HOLDINGS LTD		700	855	5, 164	97, 293	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		595. 07	755. 07	1, 604	30, 229	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		4, 824. 75	5, 824. 75	3, 087	58, 161	公益事業
HANG SENG BANK LTD		329	398	3, 482	65, 610	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT		635	795	931	17, 553	不動産
WH GROUP LTD		3, 610	4, 335	2, 128	40, 100	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		511	626	17, 502	329, 755	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD		870	970	1, 028	19, 371	不動産
XINYI GLASS HOLDINGS LTD		780	870	773	14, 571	資本財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		450	608	924	17, 411	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD		911. 69	1, 026. 69	3, 916	73, 792	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		265	300	1, 143	21, 534	公益事業
AIA GROUP LTD		5, 096	6, 006	41, 561	783, 019	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS		540	640	783	14, 758	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		720	870	2, 170	40, 895	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		741	895	1, 218	22, 965	生活必需品
ESR CAYMAN LTD		862	1, 138	1, 138	21, 439	不動産
SANDS CHINA LTD		1, 044	1, 264	2, 406	45, 341	一般消費財・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU		820	—	—	—	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		575	715	5, 716	107, 697	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		1, 590	1, 925	4, 052	76, 342	金融
香港・ドル通貨計	株数、金額	32, 011. 2	37, 698. 2	124, 343	2, 342, 622	
	銘柄数＜比率＞	28 銘柄	27 銘柄		＜0. 6%＞	
		百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)						
CAPITALAND INVESTMENT LTD		1, 074	1, 353	414	45, 699	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD		508	657	1, 794	198, 123	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD		779	942	2, 991	330, 234	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD		539. 75	773. 75	492	54, 403	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD		627	757	486	53, 727	資本財・サービス
UOL GROUP LTD		200	229	136	15, 014	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		161	246	153	16, 916	不動産
SEATRIUM		—	23, 060. 22	246	27, 235	資本財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		—	51	147	16, 325	資本財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		1, 457	1, 761	2, 234	246, 667	金融
GENTING SINGAPORE LTD		2, 380	3, 144	286	31, 580	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD		112	—	—	—	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		3, 553. 5	4, 293. 5	983	108, 526	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING		627	812	302	33, 341	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		—	465	239	26, 484	公益事業
SINGAPORE EXCHANGE LTD		357	446	426	47, 063	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD		800	999	367	40, 579	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額	13, 175. 25	39, 989. 47	11, 704	1, 291, 923	
	銘柄数＜比率＞	14 銘柄	16 銘柄		＜0. 3%＞	
		百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
(ニュージーランド)						
MERIDIAN ENERGY LTD		525	671. 52	344	31, 245	公益事業
MERCURY NZ LTD		300	341. 43	207	18, 828	公益事業
EBOS GROUP LTD		—	76. 6	283	25, 699	ヘルスケア
SPARK NEW ZEALAND LTD		805. 3	921. 47	467	42, 373	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 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	521.13	650.88	514	46,637	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	242	301.25	716	65,029	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計 株数、金額	2,393.43	2,963.15	2,533	229,813	
ニュージーランド・ドル通貨計 銘柄数<比率>	5銘柄	6銘柄		<0.1%>	
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)					
SHELL PLC	3,052.97	3,164.34	8,080	1,509,693	エネルギー
HALEON PLC	2,041.62	2,644.82	875	163,615	生活必需品
WISE PLC CLASS A	—	302.73	236	44,186	金融
BP PLC	7,881.77	8,188.83	3,864	722,083	エネルギー
UNILEVER PLC	1,041.21	1,190.31	4,467	834,769	生活必需品
BARCLAYS PLC	6,832.63	7,366.15	1,033	193,093	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	3,363.9	3,987.38	1,050	196,233	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	1,122.04	1,303.55	1,113	208,044	金融
NATWEST GROUP PLC	2,183.95	2,753.93	568	106,201	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	70.64	83.88	134	25,177	素材
BAE SYSTEMS PLC	1,288.2	1,443.09	1,493	279,063	資本財・サービス
AVIVA PLC	1,156.48	1,270.14	527	98,627	金融
AVEVA GROUP PLC	49.48	—	—	—	情報技術
GSK	1,659.76	1,938.76	2,716	507,495	ヘルスケア
INFORMA PLC	600.95	663.43	489	91,478	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,787.92	702.66	367	68,662	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	380.02	435.78	312	58,476	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	39.64	46.96	251	47,046	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	238.27	276.77	164	30,696	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	29	35.02	321	60,039	資本財・サービス
HALMA PLC	152.6	180.19	382	71,508	情報技術
ENTAIN PLC	240.59	304.69	243	45,554	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	997	1,232.36	193	36,218	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	301.68	357.03	165	30,932	金融
M&G PLC	1,045.04	1,045.04	219	41,081	金融
ENDEAVOUR MINING PLC	—	91.41	167	31,322	素材
RELX PLC	785.4	896.22	2,729	510,051	資本財・サービス
DIAGEO PLC	932.76	1,063.61	2,914	544,506	生活必需品
RIO TINTO PLC	458.86	533.07	2,878	537,833	素材
STANDARD CHARTERED PLC	1,046.59	1,122.54	718	134,314	金融
TESCO PLC	3,063.36	3,387.02	963	179,977	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	353.11	413.44	422	78,907	ヘルスケア
GLENCORE PLC	4,022.88	4,978.95	2,210	412,992	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	132.5	169.56	120	22,505	金融
SMITHS GROUP PLC	153.83	166.14	271	50,799	資本財・サービス
PEARSON PLC	283.63	306.19	283	53,055	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	718.64	782.74	221	41,461	生活必需品
NEXT PLC	53.11	56.2	445	83,268	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	1,466.73	1,676.29	216	40,433	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	81.27	92.18	286	53,563	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	135.62	159.99	470	87,973	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	10,810.03	11,455.92	811	151,563	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	56.01	66.27	294	55,099	素材
KINGFISHER PLC	787.11	857.79	188	35,275	一般消費財・サービス
WPP PLC	458.47	508.89	357	66,841	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	278.81	322.8	363	67,850	公益事業
SEVERN TRENT PLC	102.32	119.46	324	60,620	公益事業

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
RENTOKIL INITIAL PLC		747.06	1,193.17	518	96,886	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		291.82	339.78	1,831	342,181	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC		217.32	260.55	168	31,516	金融
SCHRODERS PLC		273.52	398.15	159	29,830	金融
SSE PLC		435.75	516.22	944	176,552	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		395	462.6	235	43,924	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC		632.33	733.82	7,361	1,375,456	ヘルスケア
FERGUSON PLC		87.77	—	—	—	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		2,396.89	2,830.52	646	120,843	金融
3I GROUP PLC		390.73	460.84	1,028	192,096	金融
ASHTEAD GROUP PLC		178.54	207.46	982	183,498	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE		401.14	485.36	548	102,473	情報技術
NATIONAL GRID PLC		1,488.17	1,743.49	1,787	334,060	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC		28,500.13	30,160.79	1,310	244,851	金融
IMPERIAL BRANDS PLC		381.61	408.12	748	139,886	生活必需品
CRH PLC		—	339.42	1,670	312,203	素材
CENTRICA PLC		—	2,799.88	412	77,109	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC		42.32	49.18	228	42,691	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		878.5	1,005.93	2,529	472,595	生活必需品
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		138	164.69	393	73,480	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC		8,199.21	9,349.51	5,561	1,039,033	金融
ANGLO AMERICAN PLC		518.56	601.64	1,286	240,389	素材
MONDI PLC		198.53	229.86	321	60,125	素材
COMPASS GROUP PLC		728	820.31	1,654	309,138	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC		128.32	151.88	191	35,726	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC		3,453	3,453	423	79,064	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI		78	101.36	220	41,266	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC		160.61	178.7	259	48,413	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU		75.23	80.05	489	91,474	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC		64.81	76.6	305	57,018	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		134.5	188.86	1,682	314,403	金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		66	78.66	135	25,315	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC		75	97.79	264	49,386	金融
ANTOFAGASTA PLC		153	187.17	265	49,606	素材
ABRDN PLC		843.62	908.62	151	28,384	金融
EXPERIAN PLC		375.75	435.65	1,271	237,515	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額	116,867.14	131,644.15	84,931	15,868,602	
	銘柄数<比率>	79銘柄	81銘柄		<3.8%>	
		百株	百株	千イスラエル・シュケル	千円	
(イスラエル)						
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		514.98	643.14	1,191	47,566	金融
AZRIELI GROUP LTD		18.26	22.07	489	19,529	不動産
TOWER SEMICONDUCTOR LTD		45.41	—	—	—	情報技術
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		890	—	—	—	コミュニケーション・サービス
ICL GROUP LTD		304.61	380.9	740	29,539	素材
ELBIT SYSTEMS LTD		11	13.83	1,049	41,902	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM		546.45	660.5	2,113	84,360	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL		664.26	798.01	2,298	91,731	金融
NICE LTD		27.31	32.9	2,361	94,257	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		64.07	80.29	1,095	43,711	金融
イスラエル・シュケル通貨計	株数、金額	3,086.35	2,631.64	11,339	452,599	
	銘柄数<比率>	10銘柄	8銘柄		<0.1%>	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)					
CS GROUP ANR RIGHTS AG	1,040.49	—	—	—	金融
SANDOZ GROUP AG	—	189.4	492	82,941	ヘルスケア
AVOLTA AG	—	48.54	149	25,257	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	1,404.83	1,526.27	3,647	614,870	金融
ROCHE HOLDING AG-BR	11.8	14.47	360	60,781	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2.8	3.26	200	33,767	素材
ADECCO GROUP AG-REG	63.6	74.58	313	52,824	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	280.61	325.81	7,702	1,298,274	ヘルスケア
SIKA AG-REG	58.34	67.89	1,607	270,982	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.04	0.05	537	90,516	生活必需品
ABB LTD-REG	656.05	743.42	2,534	427,184	資本財・サービス
SWISS RE AG	120.47	139.88	1,437	242,265	金融
NESTLE SA-REG	1,124.33	1,233.71	12,229	2,061,449	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	9	10.52	1,203	202,859	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	16.01	18.93	371	62,588	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,040.49	—	—	—	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	87.08	95.36	413	69,760	金融
SGS SA-REG	2.52	69.25	515	86,938	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	9.34	10.91	203	34,315	資本財・サービス
TEMENOS AG - REG	25	29.73	216	36,542	情報技術
HELVETIA HOLDING AG-REG	—	18.28	215	36,389	金融
VAT GROUP AG	10.5	12.55	488	82,290	資本財・サービス
BKW AG	—	9.42	142	23,960	公益事業
ALCON INC	199.59	231.73	1,515	255,533	ヘルスケア
SIG GROUP N AG	130	141.78	287	48,418	素材
SWATCH GROUP AG/THE-BR	11.59	13.42	308	51,982	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	60.1	69.77	3,038	512,166	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	18	21.34	276	46,689	金融
CLARIANT AG-REG	86.78	96.78	126	21,321	素材
NOVARTIS AG-REG	863.2	947.01	8,034	1,354,283	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1.41	1.59	231	38,941	生活必需品
BACHEM HOLDING AG-REG B	12.5	15.75	103	17,468	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	208.49	242.07	2,650	446,796	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	10.36	12.01	614	103,528	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	13.44	142	24,036	金融
GEBERIT AG-REG	14.33	15.59	758	127,818	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	3.69	4.28	1,388	234,106	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	43.89	51.76	631	106,440	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	21.1	24.15	608	102,500	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	69.29	76.19	571	96,396	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	29.74	34.53	1,180	198,940	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	19	22.69	99	16,770	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD	218.29	246.69	1,576	265,709	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	12.37	13.72	769	129,739	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	21.35	25.19	645	108,783	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	30.25	35.75	312	52,607	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.42	0.44	478	80,693	生活必需品
スイス・フラン通貨計 株数、金額	8,049.04	6,999.9	61,333	10,338,437	
スイス・フラン通貨計 銘柄数<比率>	42銘柄	45銘柄		<2.5%>	
	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
(デンマーク)					
NOVO NORDISK A/S-B	701.05	1,647.16	113,555	2,459,605	ヘルスケア

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
DANSKE BANK A/S		296.78	358.61	6,306	136,591	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A		1.31	1.53	1,638	35,492	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		430.42	525.05	9,584	207,595	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S		54.65	—	—	—	一般消費財・サービス
CARLSBERG AS-B		41.8	51.2	4,236	91,757	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES		88	106.34	3,716	80,501	素材
COLOPLAST-B		51.12	61.77	4,961	107,463	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S		82.8	96.78	10,195	220,840	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS		3.7	4.26	777	16,839	資本財・サービス
DEMANT A/S		42.75	52.39	1,522	32,987	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		2.3	2.52	2,739	59,331	資本財・サービス
TRYG A/S		149.9	177.29	2,587	56,046	金融
PANDORA A/S		40	43.41	3,956	85,695	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S		43	54.84	2,931	63,501	素材
GENMAB A/S		28.29	34.33	7,353	159,276	ヘルスケア
ORSTED A/S		81.4	98.35	3,107	67,316	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額	2,139.27	3,315.83	179,170	3,880,843	
	銘柄数<比率>	17銘柄	16銘柄		<0.9%>	
		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
(ノルウェー)						
DNB BANK		400.25	481.22	9,855	136,102	金融
NORSK HYDRO ASA		578.66	689.82	4,350	60,073	素材
ORKLA ASA		323.17	390.5	3,120	43,099	生活必需品
TELENOR ASA		291.31	363.8	4,207	58,103	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA		420.51	469.08	16,054	221,709	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		71.24	86.08	3,115	43,021	素材
MOWI ASA		178	228.53	4,393	60,674	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		80.5	103.98	1,892	26,134	金融
AKER BP ASA		135.97	164.3	5,004	69,113	エネルギー
KONGSBERG GRUPPEN ASA		37.23	45.73	2,124	29,340	資本財・サービス
SALMAR ASA		24.52	35.73	2,088	28,845	生活必需品
ADEVINTA ASA		120	139.44	1,553	21,451	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額	2,661.36	3,198.21	57,760	797,670	
	銘柄数<比率>	12銘柄	12銘柄		<0.2%>	
		百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)						
SAGAX CLASS B		79.24	102.55	2,454	34,871	不動産
INVESTOR CLASS A		214.58	—	—	—	金融
VOLVO CAR CLASS B		248.08	285.14	980	13,930	一般消費財・サービス
ERICSSON LM-B SHS		1,255.88	1,522.46	8,005	113,752	情報技術
VOLVO AB-B SHS		649.3	784.58	19,002	270,025	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES		164.95	177.19	3,464	49,224	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B		86	—	—	—	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB		657.78	—	—	—	生活必需品
TELE2 AB-B SHS		244.23	263.33	2,156	30,646	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS		92	118.92	2,686	38,173	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		700.28	825.04	10,461	148,658	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		627.59	758.34	7,525	106,941	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		389.66	433.33	8,374	118,995	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		314.25	349.46	6,116	86,921	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B		260.69	315	5,021	71,349	素材
SKANSKA AB-B SHS		146.38	176.89	2,975	42,278	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
SANDVIK AB		457	554.35	11,330	161,012	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS		783.94	899.89	19,392	275,569	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		1,155.75	1,396.53	22,588	320,987	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS		80	104.11	2,554	36,304	資本財・サービス
HOLMEN AB-B SHARES		39.06	48.77	2,148	30,534	素材
SECURITAS AB-B SHS		119.5	255.7	2,373	33,733	資本財・サービス
TELIA CO AB		1,106.67	1,228.66	3,061	43,508	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB		127	150.43	5,863	83,324	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS		671.61	811.53	11,251	159,888	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		431.26	521.11	14,049	199,638	資本財・サービス
SAAB AB-B		—	39.43	2,159	30,682	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		52.43	67.68	2,131	30,284	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		262.68	301.92	1,896	26,951	不動産
INDUTRADE AB		113.71	134.54	3,098	44,029	資本財・サービス
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB		70.32	101.25	2,555	36,314	ヘルスケア
LUNDBERGS AB-B SHS		30	39.51	1,967	27,965	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		57	68.43	1,593	22,646	資本財・サービス
LIFCO AB-B SHS		95	121.2	2,777	39,474	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		652.08	787.93	4,930	70,067	資本財・サービス
BEIJER REF AB		—	200.12	2,343	33,299	資本財・サービス
ESSITY AKTIEBOLAG-B		262.04	316.69	8,341	118,534	生活必需品
EMBRACER GROUP AB		265.94	—	—	—	コミュニケーション・サービス
BOLIDEN AB		113.87	142.2	4,043	57,457	素材
EPIROC AB-A		274.36	342.63	6,647	94,454	資本財・サービス
EPIROC AB-B		167.8	192.02	3,166	44,994	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		170.5	193.95	1,557	22,130	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP		1,467.48	1,674.88	19,579	278,222	金融
EQT AB		123.18	184.89	4,600	65,366	金融
EVOLUTION AB		78.67	95.28	10,497	149,175	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B		104.31	—	—	—	金融
HEXAGON AB-B SHS		837.5	1,079.44	11,280	160,290	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		62	80.28	2,526	35,900	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額	16,363.55	18,247.58	271,535	3,858,515	
	銘柄数<比率>	46 銘柄	43 銘柄		<0.9%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（アイルランド）						
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		99.48	121.88	404	65,255	素材
AIB GROUP PLC		—	679.31	281	45,509	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC		—	495.16	424	68,569	金融
KINGSPAN GROUP PLC		60.76	72.49	516	83,477	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A		62.72	74.71	551	89,025	生活必需品
CRH PLC		306.32	—	—	—	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		67.04	82.75	1,189	192,121	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額	596.32	1,526.3	3,367	543,958	
	銘柄数<比率>	5 銘柄	6 銘柄		<0.1%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オランダ）						
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV		291.69	383.6	927	149,869	コミュニケーション・サービス
EXOR NV		45	50.95	450	72,743	金融
FERROVIAL		—	246.4	777	125,516	資本財・サービス
QIAGEN N. V.		91.05	106.9	402	64,969	ヘルスケア

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE PHILIPS NV		349	435.15	819	132,325	ヘルスケア
NN GROUP NV		112.92	120.86	383	61,976	金融
HEINEKEN NV		104.07	136.49	1,129	182,352	生活必需品
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N		419.83	460.15	1,212	195,755	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.		71	78.41	550	88,875	素材
KONINKLIJKE DSM NV		70.17	—	—	—	素材
WOLTERS KLUWER		105.4	120.73	1,520	245,591	資本財・サービス
ING GROEP NV		1,568.62	1,695.86	2,165	349,713	金融
KONINKLIJKE KPN NV		1,327.81	1,516.71	480	77,653	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV		163.2	188.99	11,891	1,920,555	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA		167	189.75	237	38,384	金融
IMCD NV		22.46	26.78	367	59,428	資本財・サービス
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES		—	40.08	515	83,214	情報技術
ASR NEDERLAND NV		—	83.11	310	50,229	金融
ADYEN NV		8.7	10.18	1,107	178,853	金融
JUST EAT TAKEAWAY		72.2	—	—	—	一般消費財・サービス
PROSUS NV		354.8	785.72	2,363	381,656	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV		37	57.85	141	22,816	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV		18.83	22.01	1,033	166,863	情報技術
RANDSTAD NV		47.2	52.75	289	46,755	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV		42.5	61.43	433	69,996	生活必需品
OCI NV		43.86	49.87	104	16,874	素材
EURONEXT NV		33	38.76	294	47,639	金融
STMICROELECTRONICS NV		274.39	320.41	1,378	222,703	情報技術
AIRBUS SE		237.36	277.9	3,767	608,442	資本財・サービス
ARGENX SE		22.29	26.24	1,055	170,453	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		210.64	246.06	244	39,486	生活必需品
CNH INDUSTRIAL NV		402.65	479.63	464	75,063	資本財・サービス
STELLANTIS NV		883.5	1,035.31	2,041	329,643	一般消費財・サービス
FERRARI NV		50.61	59.09	1,981	320,093	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額	7,648.75	9,404.13	40,842	6,596,499	
	銘柄数<比率>	31銘柄	32銘柄		<1.6%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ベルギー）						
LOTUS BAKERIES NV		—	0.21	167	27,065	生活必需品
UCB SA		49.76	59.4	399	64,565	ヘルスケア
KBC GROUP NV		98.43	117.34	615	99,457	金融
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		42	43.83	316	51,181	金融
SOLVAY SA		29.84	34.89	367	59,421	素材
UMICORE		82.69	98.4	240	38,825	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		348.72	407.2	2,328	376,054	生活必需品
AGEAS		62.9	74.99	295	47,731	金融
D'IETEREN GROUP		10.36	10.36	162	26,269	一般消費財・サービス
PROXIMUS		60.35	—	—	—	コミュニケーション・サービス
ELIA GROUP SA/NV		13.33	14.62	144	23,258	公益事業
SOFINA		6	6.7	135	21,923	金融
国小計	株数、金額	804.38	867.94	5,174	835,757	
	銘柄数<比率>	11銘柄	11銘柄		<0.2%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ルクセンブルグ）						
AROUNDTOWN SA		380	—	—	—	不動産

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ARCELORMITTAL		257	257	586	94,762	素材
EUROFINS SCIENTIFIC		52.96	63.42	334	54,103	ヘルスケア
TENARIS SA		186.08	221.87	340	54,951	エネルギー
国小計	株数、金額	876.04	542.29	1,261	203,818	
	銘柄数<比率>	4銘柄	3銘柄		<0.0%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フランス）						
TOTALENERGIES SE		995.42	1,094.87	6,753	1,090,702	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		267.4	318.04	980	158,414	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		209.95	245.54	4,266	689,082	素材
KERING		30.04	34.9	1,364	220,394	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		217.87	255.2	4,266	689,154	資本財・サービス
BOUYGUES SA		90.62	95.72	336	54,325	資本財・サービス
BNP PARIBAS		446.02	500.23	2,847	459,868	金融
THALES SA		42.91	49.27	683	110,332	資本財・サービス
DANONE		257.08	301.95	1,786	288,462	生活必需品
CARREFOUR SA		244.54	280.25	486	78,554	生活必需品
VIVENDI		295.91	311.66	272	44,064	コミュニケーション・サービス
L'OREAL		96.88	113.09	4,883	788,781	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		199.87	220.86	1,312	211,957	資本財・サービス
LEGRAND SA		107.37	125.08	1,102	178,097	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA		84.11	95.78	1,491	240,936	生活必需品
EURAZEO SE		17.24	19.81	124	20,076	金融
SOCIETE GENERALE SA		319.64	355.28	807	130,485	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		111.46	129.45	8,938	1,443,660	一般消費財・サービス
ACCOR SA		67.17	83.55	264	42,682	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		65.74	77.3	1,457	235,399	情報技術
VALEO SA		84	91.48	123	19,997	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		91.79	107.3	829	133,926	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA		116.05	138.62	311	50,306	資本財・サービス
EIFFAGE		32.85	36.75	340	55,057	資本財・サービス
SODEXO SA		34.91	41.57	412	66,696	一般消費財・サービス
IPSEN		14	17.06	175	28,352	ヘルスケア
AMUNDI SA		22.5	28.88	162	26,167	金融
TELEPERFORMANCE		23.15	27.71	361	58,315	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		36	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		11	13.02	270	43,634	ヘルスケア
SEB SA		9.97	11.82	123	19,968	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA		115.49	138.42	2,453	396,241	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA		10	11.08	204	33,106	資本財・サービス
WORLDLINE SA		96.06	112.65	157	25,380	金融
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		41.63	49.44	163	26,446	一般消費財・サービス
AXA SA		762.06	860.16	2,446	395,101	金融
EDENRED		100.44	116.99	585	94,513	金融
RENAULT SA		77.55	90.48	324	52,352	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL		12.72	14.85	2,817	454,980	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU		9	10.09	109	17,689	生活必需品
DASSAULT SYSTEMES SE		267.58	314.2	1,354	218,844	情報技術
WENDEL		9.3	11.24	88	14,250	金融
ORANGE		800.96	877.88	988	159,623	コミュニケーション・サービス
ALSTOM		125.25	141.07	162	26,190	資本財・サービス
SANOFI		457.21	532.73	4,521	730,231	ヘルスケア

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千ユーロ	千円	
VINCI SA		214.23	249.19	2,793	451,245	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		261.79	318.58	913	147,569	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		491.28	567.33	669	108,122	金融
BIOMERIEUX		16.91	18.52	183	29,564	ヘルスケア
ENGIE		733.28	856.25	1,359	219,498	公益事業
EDF		221.2	—	—	—	公益事業
SAFRAN SA		137.22	160.24	2,566	414,448	資本財・サービス
ARKEMA		23.95	28.29	264	42,730	素材
ADP		11.1	13.43	151	24,510	資本財・サービス
GETLINK SE		173.45	194.11	325	52,496	資本財・サービス
BOLLORE		356.75	391.41	209	33,757	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額	10,169.87	11,300.67	73,349	11,846,755	
	銘柄数<比率>	56銘柄	54銘柄		<2.8%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ドイツ）						
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		179.02	231.24	689	111,407	資本財・サービス
DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)		46	53.38	453	73,178	一般消費財・サービス
BAYER AG-REG		394.42	460.56	1,412	228,138	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		80	94.86	165	26,673	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		813.28	909.46	1,025	165,570	金融
COMMERZBANK AG		420.31	498.95	564	91,101	金融
VOLKSWAGEN AG		12	13.04	155	25,157	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		74.51	96.57	1,032	166,700	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG		307.42	356.31	5,447	879,788	資本財・サービス
E.ON SE		901.36	1,052.52	1,260	203,566	公益事業
UNIPER SE		66.5	—	—	—	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		132.93	149.09	1,432	231,332	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		58	72.18	243	39,286	資本財・サービス
CONTINENTAL AG		43.42	51.68	370	59,763	一般消費財・サービス
BASF SE		368.75	418.85	1,800	290,719	素材
ALLIANZ SE-REG		164.11	189.07	4,367	705,397	金融
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		71.68	79.26	565	91,375	生活必需品
RHEINMETALL AG		18.13	20.42	561	90,761	資本財・サービス
RWE AG		257.91	296.64	1,164	188,095	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		219.5	270.29	216	35,010	資本財・サービス
BRENNTAG SE		60.9	69.69	538	86,961	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		164.83	198	565	91,363	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		38.39	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SAP SE		419.6	489.54	7,075	1,142,814	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		56.25	63.79	2,471	399,230	金融
ZALANDO SE		87.83	105.53	233	37,633	一般消費財・サービス
HEIDELBERG MATERIALS AG		57.08	68.04	504	81,429	素材
KION GROUP AG		27	—	—	—	資本財・サービス
COVESTRO AG		73	90.78	441	71,256	素材
RATIONAL AG		1.9	2.42	142	23,060	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG		12.1	12.1	356	57,553	ヘルスケア
TALANX AG		—	31.19	204	33,096	金融
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		60.35	71.94	325	52,529	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE		64.43	82.46	250	40,520	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		15.92	18.94	159	25,689	ヘルスケア
BECHTLE AG		32.38	36.26	165	26,804	情報技術
NEMETSCHEK SE		22.84	25.57	207	33,467	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 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千ユーロ	千円	
SCOUT24 AG		36	36	227	36, 816	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		110. 97	132. 18	692	111, 908	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG		28	34. 13	197	31, 894	資本財・サービス
HELLOFRESH SE		65. 16	71. 77	103	16, 715	生活必需品
SIEMENS ENERGY AG		172. 9	237. 42	255	41, 279	資本財・サービス
BEIERSDORF AG		39. 8	47. 25	610	98, 558	生活必需品
MERCK KGAA		51. 89	60. 59	971	156, 965	ヘルスケア
ADIDAS AG		72	75. 75	1, 459	235, 781	一般消費財・サービス
PUMA SE		41. 63	49. 69	290	46, 932	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		41. 01	48. 83	306	49, 448	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		1, 301. 22	1, 519. 48	3, 332	538, 309	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		80. 7	96. 5	359	58, 103	ヘルスケア
MERCEDES-BENZ GROUP N AG		325	387. 64	2, 298	371, 201	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		524. 3	612. 22	2, 185	353, 000	情報技術
HANNOVER RUECK SE		23. 78	28. 26	614	99, 272	金融
DHL GROUP		397. 96	463. 85	1, 990	321, 466	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		76. 28	89. 07	1, 550	250, 383	金融
MTU AERO ENGINES AG		21. 04	25. 24	474	76, 577	資本財・サービス
WACKER CHEMIE AG		—	8. 99	101	16, 392	素材
SYMRISE AG		52. 28	62. 24	631	101, 931	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		413. 12	413. 12	97	15, 679	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		22	26. 86	234	37, 850	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		287. 7	345. 42	896	144, 771	不動産
LEG IMMOBILIEN SE		28	35. 01	251	40, 655	不動産
国小計	株数、金額	10, 036. 79	11, 588. 13	56, 704	9, 158, 335	
	銘柄数＜比率＞	59 銘柄	58 銘柄		＜2. 2%＞	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（ポルトガル）						
JERONIMO MARTINS		114. 16	133. 3	300	48, 483	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		1, 094	1, 480. 83	652	105, 329	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		201. 96	231. 18	314	50, 854	エネルギー
国小計	株数、金額	1, 410. 12	1, 845. 31	1, 267	204, 668	
	銘柄数＜比率＞	3 銘柄	3 銘柄		＜0. 0%＞	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（スペイン）						
CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV		—	29. 38	78	12, 688	公益事業
TELEFONICA SA		2, 104. 78	2, 425. 11	942	152, 284	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA		121	143. 67	274	44, 319	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		2, 677	2, 793. 58	2, 429	392, 355	金融
IBERDROLA SA		2, 395. 38	2, 858. 48	3, 231	521, 921	公益事業
REPSOL SA		572. 01	606	849	137, 269	エネルギー
GRIFOLS SA		118. 3	140. 39	177	28, 705	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		6, 823. 35	7, 575. 56	2, 877	464, 696	金融
AMADEUS IT GROUP SA		180. 86	211. 19	1, 347	217, 685	一般消費財・サービス
NATURGY ENERGY GROUP SA		103	103	280	45, 248	公益事業
CAIXABANK SA		1, 749. 27	1, 950. 84	818	132, 239	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		88. 76	103. 06	378	61, 187	資本財・サービス
AENA SME SA		29	35. 15	550	88, 846	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA		214. 6	264. 97	930	150, 211	コミュニケーション・サービス
ACCIONA SA		10. 28	11. 17	143	23, 236	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		437. 94	511. 38	1, 919	310, 054	一般消費財・サービス

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千ユーロ	千円	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		94.14	—	—	—	資本財・サービス
ENAGAS SA		98.84	117.14	196	31,680	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		157	190.67	292	47,208	公益事業
FERROVIAL SA		190.18	—	—	—	資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA		115.94	145.54	237	38,420	公益事業
国小計	株数、金額	18,281.63	20,216.28	17,957	2,900,261	
	銘柄数<比率>	20銘柄	19銘柄		<0.7%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（イタリア）						
PRYSMIAN SPA		100.4	123.78	436	70,510	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		446	488.78	927	149,754	金融
MEDIOBANCA SPA		244.07	262.3	281	45,456	金融
UNICREDIT SPA		832.17	862.65	2,184	352,844	金融
TELECOM ITALIA SPA		3,787.82	4,343.74	114	18,479	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO		6,630.75	7,214.38	1,909	308,368	金融
ATLANTIA SPA		195.31	—	—	—	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		210.74	245.93	241	38,981	金融
MONCLER SPA		82.61	96.54	492	79,551	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		42.17	49.12	217	35,160	ヘルスケア
ENI SPA		1,013.29	1,100.08	1,662	268,429	エネルギー
DIASORIN SPA		10	11.44	98	15,919	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		128	158.1	178	28,854	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA		199	278.66	197	31,963	金融
AMPLIFON SPA		47	56.32	159	25,687	ヘルスケア
ENEL SPA		3,265.35	3,812.94	2,452	396,162	公益事業
SNAM SPA		793.5	947.44	431	69,762	公益事業
TERNA SPA		554.64	659.48	488	78,904	公益事業
FINECOBANK SPA		232	286.93	351	56,699	金融
国小計	株数、金額	18,814.82	20,998.61	12,825	2,071,491	
	銘柄数<比率>	19銘柄	18銘柄		<0.5%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フィンランド）						
UPM-KYMMENE OYJ		214.28	250.22	800	129,321	素材
NOKIA OYJ		2,172.54	2,511.61	815	131,714	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		191.24	222.36	282	45,609	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		214	263.2	315	50,947	素材
ELISA OYJ		57.25	64.14	264	42,721	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		196.22	215.14	845	136,608	金融
FORTUM OYJ		169	210.78	273	44,119	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		104	123.55	216	34,890	生活必需品
KONE OYJ-B		133.75	159.31	649	104,876	資本財・サービス
NESTE OYJ		169.85	198.34	678	109,555	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		40	48.46	176	28,567	ヘルスケア
METSO CORPORATION		—	313.51	285	46,087	資本財・サービス
国小計	株数、金額	3,662.13	4,580.62	5,603	905,022	
	銘柄数<比率>	11銘柄	12銘柄		<0.2%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オーストリア）						
VERBUND AG		27.4	32.05	271	43,844	公益事業
OMV AG		56.5	69.2	272	44,001	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		135.46	161.16	591	95,604	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		期首 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
		百株	百株	千ユーロ	千円	
VOESTALPINE AG		42.5	54.8	142	23,047	素材
国小計	株数、金額	261.86	317.21	1,278	206,497	
	銘柄数＜比率＞	4銘柄	4銘柄		＜0.0%＞	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（その他）						
DSM FIRMENICH AG		—	87.74	764	123,527	素材
AEGON LTD		720.59	774.29	382	61,802	金融
国小計	株数、金額	720.59	862.03	1,147	185,330	
	銘柄数＜比率＞	1銘柄	2銘柄		＜0.0%＞	
ユーロ通貨計	株数、金額	73,283.3	84,049.52	220,781	35,658,394	
	銘柄数＜比率＞	224銘柄	222銘柄		＜8.6%＞	
ファンド合計	株数、金額	452,459.55	543,575.93	—	373,664,357	
	銘柄数＜比率＞	1,209銘柄	1,213銘柄		＜89.9%＞	

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

(2) 外国投資証券

銘柄	期首 口数	当期末 口数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
（アメリカ）				
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5.837	6.937	1,185	174,284
SIMON PROPERTY GROUP INC	13.607	15.807	1,940	285,384
BOSTON PROPERTIES INC	6.2	7.2	410	60,357
VORNADO REALTY TRUST	6.297	—	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	4.5	5.2	1,275	187,520
EQUITY RESIDENTIAL	14.8	17.4	984	144,789
EQUINIX INC	3.808	4.508	3,643	535,902
AMERICAN TOWER CORP	18.9	22.5	4,639	682,265
HOST HOTELS & RESORTS INC	29.043	34.443	600	88,342
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	13	15.7	561	82,639
KIMCO REALTY CORP	25	30	570	83,918
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	15.5	18.5	279	41,165
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11	12.7	582	85,694
INVITATION HOMES INC	25.2	29.6	975	143,483
VICI PROPERTIES INC	39.8	48.6	1,439	211,711
VENTAS INC	16.5	19.4	880	129,561
WEYERHAEUSER CO	30.814	35.414	1,122	165,104
CROWN CASTLE INTL CORP	17.9	21	2,435	358,200
IRON MOUNTAIN INC	11.8	14.1	892	131,222
SUN COMMUNITIES INC	5	6	768	112,949
PROLOGIS INC	38.154	44.654	5,047	742,363
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6.4	7.9	861	126,653
CAMDEN PROPERTY TRUST	4.2	5.2	466	68,637
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2.7	3.1	657	96,759
WELLTOWER INC	18.8	24	2,116	311,317

銘柄		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		21.9	26.5	454	66,800
MID-AMERICA APARTMENT COMM		4.8	5.6	693	102,010
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		7.2	8.6	602	88,649
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		17.9	23.9	432	63,621
REALTY INCOME CORP		24.895	32.595	1,749	257,280
PUBLIC STORAGE		6.5	7.7	1,985	292,056
REGENCY CENTERS CORP		6.3	8.1	497	73,227
UDR INC		12.9	15.1	502	73,929
WP CAREY INC		8	10.3	640	94,206
DIGITAL REALTY TRUST INC		11.8	14.1	1,948	286,583
EXTRA SPACE STORAGE INC		5.6	10.5	1,360	200,024
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		24.2	—	—	—
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額	536.755	612.858	45,207	6,648,620
	銘柄数<比率>	37銘柄	35銘柄		<1.6%>
		千口	千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)					
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		3.4	3.8	174	18,841
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		5.8	6.9	120	13,014
カナダ・ドル通貨計	口数、金額	9.2	10.7	294	31,855
	銘柄数<比率>	2銘柄	2銘柄		<0.0%>
		千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)					
DEXUS/AU		40.978	48.731	341	33,241
LENDLEASE GROUP		25.3	31.401	209	20,410
TRANSURBAN GROUP		119.689	138.948	1,782	173,724
APA GROUP		45.041	53.35	449	43,775
SCENTRE GROUP		203.007	235.284	618	60,301
GPT GROUP		73.031	86.791	354	34,507
MIRVAC GROUP		144.9	173.08	340	33,227
STOCKLAND		91.123	104.777	426	41,556
GOODMAN GROUP		65.537	76.496	1,783	173,839
VICINITY CENTRES		151.865	175.417	318	31,026
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額	960.471	1,124.275	6,625	645,611
	銘柄数<比率>	10銘柄	10銘柄		<0.2%>
		千口	千口	千香港・ドル	千円
(香港)					
LINK REIT		90.8	131.5	5,115	96,373
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		107	—	—	—
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		163	197	1,654	31,176
香港・ドル通貨計	口数、金額	360.8	328.5	6,770	127,549
	銘柄数<比率>	3銘柄	2銘柄		<0.0%>
		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)					
CAPITALAND ASCENDAS REIT		144.5	194	550	60,814
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		220.07	276.67	511	56,496
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		140.8	170.2	275	30,434
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS		101.3	112.7	154	17,042
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	606.67	753.57	1,492	164,788
	銘柄数<比率>	4銘柄	4銘柄		<0.0%>

外国株式インデックスマザーファンド

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
		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
（イギリス）					
LAND SECURITIES GROUP PLC		28. 317	33. 482	210	39, 323
SEGRO PLC		48. 274	55. 182	452	84, 584
BRITISH LAND CO PLC		35. 395	—	—	—
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	111. 986	88. 664	663	123, 908
	銘柄数＜比率＞	3 銘柄	2 銘柄		＜0. 0%＞
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ（ベルギー）					
WAREHOUSES DE PAUW SCA		6. 192	7. 389	188	30, 455
国小計	口数、金額	6. 192	7. 389	188	30, 455
	銘柄数＜比率＞	1 銘柄	1 銘柄		＜0. 0%＞
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ（フランス）					
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		4. 6	5. 554	318	51, 363
GECINA SA		1. 817	2. 164	218	35, 370
KLEPIERRE		8. 527	10. 126	233	37, 778
COVIVIO		2	2. 399	106	17, 187
国小計	口数、金額	16. 944	20. 243	877	141, 700
	銘柄数＜比率＞	4 銘柄	4 銘柄		＜0. 0%＞
ユーロ通貨計	口数、金額	23. 136	27. 632	1, 065	172, 156
	銘柄数＜比率＞	5 銘柄	5 銘柄		＜0. 0%＞
合計	口数、金額	2, 609. 018	2, 946. 199	—	7, 914, 490
	銘柄数＜比率＞	64 銘柄	60 銘柄		＜1. 9%＞

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

(3)先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当期末 買建額	当期末 売建額
		百万円	百万円
外国	S&P500 EMINI FUT（アメリカ）	24,004	—
	S&P/TSX 60 IX FUT（カナダ）	1,783	—
	SPI 200 FUTURES（オーストラリア）	1,202	—
	FTSE 100 IDX FUT（イギリス）	1,738	—
	SWISS MKT IX FUTR（ドイツ）	1,366	—
	EURO STOXX 50（ドイツ）	4,102	—

（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

2023年11月30日現在

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
株式	373,664,357	89.7
投資証券	7,914,490	1.9
コール・ローン等、その他	34,833,809	8.4
投資信託財産総額	416,412,657	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＝147.07円、１カナダ・ドル＝108.21円、１オーストラリア・ドル＝97.45円、１香港・ドル＝18.84円、１シンガポール・ドル＝110.38円、１ニュージーランド・ドル＝90.70円、１イギリス・ポンド＝186.84円、１イスラエル・シュケル＝39.913円、１スイス・フラン＝168.56円、１デンマーク・クローネ＝21.66円、１ノルウェー・クローネ＝13.81円、１スウェーデン・クローネ＝14.21円、１ユーロ＝161.51円です。
（注３）当期末における外貨建純資産（394,774,332千円）の投資信託財産総額（416,412,657千円）に対する比率は、94.8％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年11月30日現在

項目	当期末
(A)資産	**437,391,983,390円**
コール・ローン等	25,889,333,630
株式（評価額）	373,664,357,535
投資証券（評価額）	7,914,490,575
未収入金	21,749,483,507
未収配当金	501,157,490
差入委託証拠金	7,673,160,653
(B)負債	**21,521,967,015**
未払金	21,409,528,115
未払解約金	112,438,900
(C)純資産総額（A－B）	**415,870,016,375**
元本	78,806,686,628
次期繰越損益金	337,063,329,747
(D)受益権総口数	**78,806,686,628口**
１万口当り基準価額（C／D）	**52,771円**

＊期首における元本額は69,133,888,947円、当作成期間中における追加設定元本額は14,051,097,197円、同解約元本額は4,378,299,516円です。
＊当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワ外国株式インデックスＶＡ	253,960,411円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	2,398,033円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	27,113,381円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	4,173,336円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	132,412,472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）	99,283,243円
ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	90,561,111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）	751,588,780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）	4,575,264,354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）	565,403,560円
Ｄ－Ｉ's 外国株式インデックス	20,741,287円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	52,732,027円
ｉＦｒｅｅ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし）	7,602,914,266円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	1,483,695,864円
ｉＦｒｅｅ 年金バランス	320,411,034円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	3,052,677円
ＤＣダイワ外国株式インデックス	47,516,377,923円
ダイワ・ライフ・バランス３０	507,111,516円
ダイワ・ライフ・バランス５０	1,075,299,438円
ダイワ・ライフ・バランス７０	1,029,409,746円
大和ＤＣ海外株式インデックスファンド	2,012,098,874円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	12,430,841円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	12,894,554円
ダイワつみたてインデックス外国株式	2,126,545,615円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	2,059,357円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	2,504,278円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	5,293,680円
ダイワ先進国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	11,365,941円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	54,089,276円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	34,472,185円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	912,121,494円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	48,039,078円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	140,584,660円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,397,074,322円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	429,662,271円
ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）	2,299,488,278円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	3,021,971,653円
ダイワライフスタイル２５	8,689,227円
ダイワライフスタイル５０	39,113,782円
ダイワライフスタイル７５	32,628,804円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	89,653,999円

＊当期末の計算口数当りの純資産額は52,771円です。

■損益の状況

当期　自 2022年12月 1 日　至 2023年11月30日

項　　目	当　　期
(A)配当等収益	**6, 771, 854, 280円**
受取配当金	6, 504, 570, 354
受取利息	44, 080, 104
その他収益金	227, 504, 113
支払利息	△ 4, 300, 291
(B)有価証券売買損益	**62, 831, 381, 001**
売買益	84, 924, 975, 155
売買損	△ 22, 093, 594, 154
(C)先物取引等損益	**2, 566, 038, 828**
取引益	3, 359, 283, 660
取引損	△ 793, 244, 832
(D)その他費用	**△ 59, 415, 452**
(E)当期損益金（A＋B＋C＋D）	**72, 109, 858, 657**
(F)前期繰越損益金	**229, 239, 375, 441**
(G)解約差損益金	**△ 16, 142, 416, 184**
(H)追加信託差損益金	**51, 856, 511, 833**
(I)合計（E＋F＋G＋H）	**337, 063, 329, 747**
次期繰越損益金（I）	**337, 063, 329, 747**

（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。

《お知らせ》
■ベンチマークの変更について
ベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。
変更前：ＭＳＣＩコクサイ指数（円ベース）
変更後：ＭＳＣＩコクサイ指数（配当込み、円ベース）

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８期
（決算日　2024年６月17日）
（作成対象期間　2023年６月16日～2024年６月17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、ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数に連動する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/

<4662>

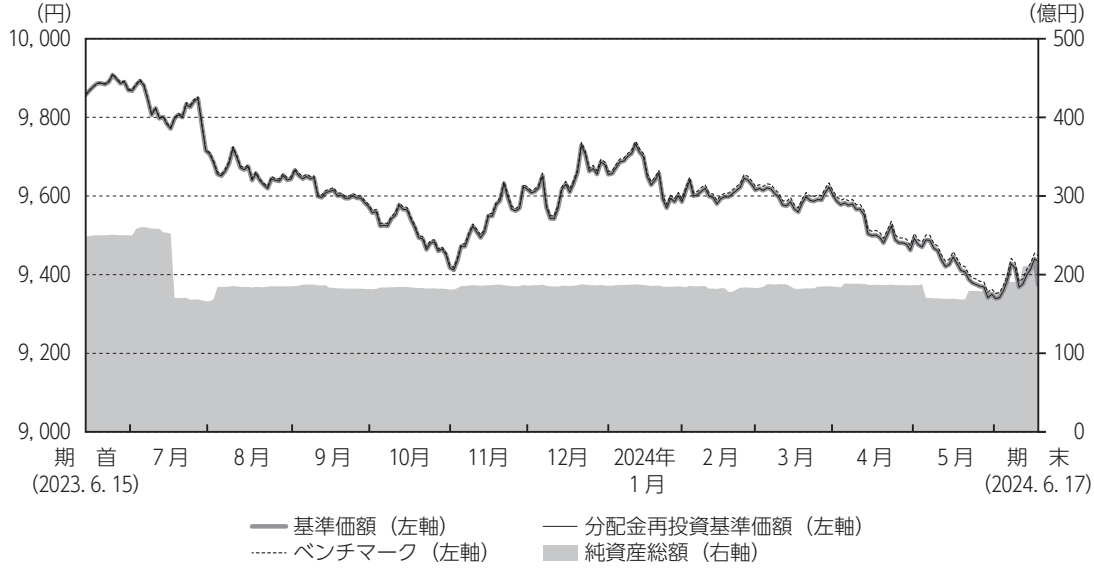
最近5期の運用実績

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
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
7期末(2023年6月15日)	9,857	5	0.1	516.013	0.3	99.4	—	24,860
8期末(2024年6月17日)	9,373	60	△ 4.3	494.601	△ 4.1	99.4	—	21,017

（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（ＤＢＩ）総合指数です。

■基準価額・騰落率

期　首：9,857円
期　末：9,373円（分配金60円）
騰落率：△4.3%（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、債券価格が下落したことなどを受け、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（ＤＢＩ）総合指数		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首) 2023年６月15日	9,857	—	516.013	—	99.4	—
６月末	9,869	0.1	516.779	0.1	99.6	—
７月末	9,715	△ 1.4	508.731	△ 1.4	99.3	—
８月末	9,643	△ 2.2	505.088	△ 2.1	99.4	—
９月末	9,573	△ 2.9	501.436	△ 2.8	99.5	—
10月末	9,418	△ 4.5	493.357	△ 4.4	99.4	—
11月末	9,617	△ 2.4	503.781	△ 2.4	99.5	—
12月末	9,655	△ 2.0	505.836	△ 2.0	99.5	—
2024年１月末	9,585	△ 2.8	502.190	△ 2.7	99.5	—
２月末	9,615	△ 2.5	503.843	△ 2.4	99.5	—
３月末	9,602	△ 2.6	503.272	△ 2.5	99.3	—
４月末	9,492	△ 3.7	497.541	△ 3.6	99.3	—
５月末	9,339	△ 5.3	489.572	△ 5.1	99.6	—
(期末) 2024年６月17日	9,433	△ 4.3	494.601	△ 4.1	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

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■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、0. 3％台後半から0. 4％台後半で推移しましたが、2023年７月の金融政策決定会合において、日銀が長短金利操作の運用を一部変更し、実質的に長期金利の許容上限を0. 5％から1. 0％に引き上げたことなどにより長期金利は上昇基調となり、10月には0. 8％台まで上昇しました。10月の金融政策決定会合では、許容上限の1. 0％を「めど」に修正し、1. 0％を超える長期金利の上昇を容認したことで、一時0. 9％台半ばまで上昇しました。しかし11月以降は、米国金利の低下（債券価格は上昇）を受けて国内長期金利は低下基調で推移し、12月後半には0. 5％台半ばに達しました。2024年１月以降は、米国金利の上昇に加え、春闘での大幅な賃上げ見通しなどを受けて日銀の政策修正観測が高まり、国内長期金利は上昇しました。３月の金融政策決定会合では、マイナス金利政策の解除や長短金利操作の廃止などが決定されましたが、「当面、緩和的な金融環境が継続する」と日銀が明示したこともあり、国内長期金利はやや低下しました。４月以降は、一段と円安が進む中で輸入物価起因のインフレ再燃が懸念され、日銀による追加利上げ観測や国債買い入れ減額観測が高まり、国内長期金利は５月下旬に１％を超えて上昇しました。その後は、６月の金融政策決定会合において、７月会合後に国債買い入れを減額する方針を決定しましたが、米国金利の低下を受けて国内長期金利も低下しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

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

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

ポートフォリオについて （2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

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

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

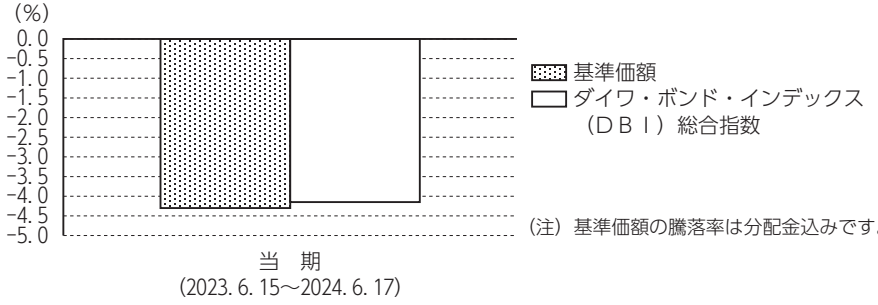
組入ファンド	ベンチマーク
日本債券インデックスマザーファンド	ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△4. 1％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△4. 3％となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



＊ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数です。

分配金について

当作成期の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 2023年６月16日 ～2024年６月17日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**60**
対基準価額比率	（％）	0.64
当期の収益	（円）	47
当期の収益以外	（円）	12
翌期繰越分配対象額	（円）	462

（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。
（注４）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。

■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	✓	47.76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		437.38
（ｄ）分配準備積立金	✓	37.23
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）		522.38
（ｆ）分配金		60.00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）		462.38

（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

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

■日本債券インデックスマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

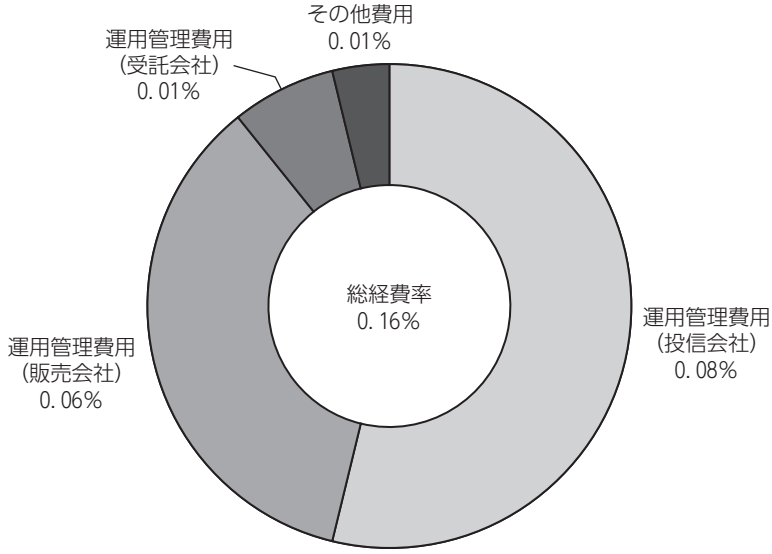
項　　目	当　期 (2023. 6. 16～2024. 6. 17)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	15円	0. 153%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は9, 600円です。**
（投 信 会 社）	(8)	(0. 085)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(5)	(0. 056)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(1)	(0. 011)	受託会社分は、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	15	0. 158	

（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0.16％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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
日本債券インデックスマザーファンド	7,841,062	10,457,401	9,969,118	13,499,089

（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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	45,254	1,779	3.9	30,810	199	0.6
コール・ローン	147,128	—	—	—	—	—

（注）平均保有割合16.8%
※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

種類	当期
	日本債券インデックスマザーファンド
	買付額
	百万円
公社債	3,700

（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	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
日本債券インデックスマザーファンド	18,044,202	15,916,146	20,996,580

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年６月17日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
日本債券インデックスマザーファンド	20,996,580	99.1
コール・ローン等、その他	184,844	0.9
投資信託財産総額	21,181,425	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

2024年６月17日現在

項　　目	当　期　末
（Ａ）資産	**21, 181, 425, 529円**
コール・ローン等	169, 716, 624
日本債券インデックス マザーファンド（評価額）	20, 996, 580, 646
未収入金	15, 128, 259
（Ｂ）負債	**164, 403, 189**
未払収益分配金	134, 538, 907
未払解約金	14, 751, 517
未払信託報酬	14, 599, 692
その他未払費用	513, 073
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）	**21, 017, 022, 340**
元本	22, 423, 151, 229
次期繰越損益金	△ 1, 406, 128, 889
（Ｄ）受益権総口数	**22, 423, 151, 229口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）	**9, 373円**

＊期首における元本額は25, 221, 028, 431円、当作成期間中における追加設定元本額は11, 346, 984, 854円、同解約元本額は14, 144, 862, 056円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は9, 373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, 406, 128, 889円です。

■損益の状況

当期　自 2023年６月16日　至 2024年６月17日

項　　目	当　　期
（Ａ）配当等収益	**2, 938円**
受取利息	8, 267
支払利息	△ 5, 329
（Ｂ）有価証券売買損益	△ **585, 906, 882**
売買益	177, 565, 918
売買損	△ 763, 472, 800
（Ｃ）信託報酬等	△ **30, 197, 625**
（Ｄ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	△ **616, 101, 569**
（Ｅ）前期繰越損益金	△ **151, 083, 001**
（Ｆ）追加信託差損益金	△ **504, 405, 412**
（配当等相当額）	(980, 763, 790)
（売買損益相当額）	(△ 1, 485, 169, 202)
（Ｇ）合計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	△ **1, 271, 589, 982**
（Ｈ）収益分配金	△ **134, 538, 907**
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	△ **1, 406, 128, 889**
追加信託差損益金	△ 504, 405, 412
（配当等相当額）	(980, 763, 790)
（売買損益相当額）	(△ 1, 485, 169, 202)
分配準備積立金	56, 052, 440
繰越損益金	△ 957, 775, 917

（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	107, 096, 283円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	0
（ｃ）収益調整金	980, 763, 790
（ｄ）分配準備積立金	83, 495, 064
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	1, 171, 355, 137
（ｆ）分配金	134, 538, 907
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	1, 036, 816, 230
（ｈ）受益権総口数	22, 423, 151, 229口

収　益　分　配　金　の　お　知　ら　せ	
１万口当り分配金（税込み）	60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（2023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（2024年６月17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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
373 10年国債 0.6% 2033/12/20	1,411,300	143 5年国債 0.1% 2025/3/20	2,501,984
372 10年国債 0.8% 2033/9/20	1,256,413	144 5年国債 0.1% 2025/6/20	1,497,585
156 5年国債 0.2% 2027/12/20	1,217,122	355 10年国債 0.1% 2029/6/20	1,331,604
370 10年国債 0.5% 2033/3/20	1,207,349	141 5年国債 0.1% 2024/9/20	1,242,852
456 2年国債 0.1% 2026/1/1	1,098,608	151 5年国債 0.005% 2027/3/20	1,100,310
149 5年国債 0.005% 2026/9/20	1,085,528	142 5年国債 0.1% 2024/12/20	1,041,394
371 10年国債 0.4% 2033/6/20	973,863	352 10年国債 0.1% 2028/9/20	993,010
161 5年国債 0.3% 2028/6/20	875,922	369 10年国債 0.5% 2032/12/20	903,762
163 5年国債 0.4% 2028/9/20	853,963	153 20年国債 1.3% 2035/6/20	787,101
16 40年国債 1.3% 2063/3/20	849,439	335 10年国債 0.5% 2024/9/20	694,071

（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、2024年６月17日現在における日本債券インデックスマザーファンド（91,769,046千口）の内容です。

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

作成期	2024年６月17日現在						
区分	額面金額	評価額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	105,182,000	100,536,383	83.0	—	53.9	21.1	8.0
地方債証券	6,900,000	6,991,689	5.8	—	4.0	1.2	0.6
特殊債券（除く金融債券）	3,900,000	3,854,898	3.2	—	2.1	0.9	0.2
金融債券	100,000	99,125	0.1	—	—	0.1	—
普通社債券	9,100,000	8,953,662	7.4	—	2.1	4.6	0.7
合計	125,182,000	120,435,758	99.5	—	62.1	27.8	9.5

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

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

2024年6月17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	450 2年国債	0.0050	300,000	299,565	2025/07/01
	452 2年国債	0.0050	40,000	39,925	2025/09/01
	145 5年国債	0.1000	1,770,000	1,768,442	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	760,000	762,188	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	89,106	2025/09/20
	453 2年国債	0.0050	70,000	69,850	2025/10/01
	455 2年国債	0.0050	430,000	428,783	2025/12/01
	146 5年国債	0.1000	1,180,000	1,178,218	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	500,000	500,750	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	95,654	2025/12/20
	456 2年国債	0.1000	1,050,000	1,048,141	2026/01/01
	457 2年国債	0.1000	160,000	159,675	2026/02/01
	458 2年国債	0.2000	100,000	99,932	2026/03/01
	147 5年国債	0.0050	1,430,000	1,424,122	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	710,000	708,260	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	59,888	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	82,884	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	56,887	2026/03/20
	459 2年国債	0.2000	550,000	549,510	2026/04/01
	460 2年国債	0.3000	300,000	300,195	2026/05/01
	148 5年国債	0.0050	1,600,000	1,591,376	2026/06/20
	343 10年国債	0.1000	780,000	777,270	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	53,000	55,039	2026/06/20
	149 5年国債	0.0050	1,170,000	1,162,512	2026/09/20
	344 10年国債	0.1000	780,000	776,669	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	20,000	20,859	2026/09/20
	150 5年国債	0.0050	1,300,000	1,290,289	2026/12/20
	345 10年国債	0.1000	950,000	945,145	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	310,000	323,881	2026/12/20
	151 5年国債	0.0050	850,000	842,690	2027/03/20
	152 5年国債	0.1000	600,000	596,394	2027/03/20
	346 10年国債	0.1000	780,000	775,312	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	104,613	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	136,351	2027/03/20
	153 5年国債	0.0050	430,000	425,777	2027/06/20
	347 10年国債	0.1000	1,100,000	1,092,300	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	52,939	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	55,000	57,905	2027/06/20
	154 5年国債	0.1000	980,000	971,944	2027/09/20
	348 10年国債	0.1000	1,050,000	1,041,369	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	42,390	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	320,000	338,089	2027/09/20
	155 5年国債	0.3000	730,000	728,102	2027/12/20
	156 5年国債	0.2000	1,000,000	993,940	2027/12/20
	349 10年国債	0.1000	1,250,000	1,238,100	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	100,000	106,007	2027/12/20
	157 5年国債	0.2000	200,000	198,484	2028/03/20
	158 5年国債	0.1000	700,000	692,104	2028/03/20
	350 10年国債	0.1000	900,000	889,848	2028/03/20

2024年6月17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	
	100 20年国債	2.2000	155,000	165,377	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	350,000	376,022	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	97,311	2028/04/20
	161 5年国債	0.3000	880,000	875,494	2028/06/20
	351 10年国債	0.1000	600,000	592,200	2028/06/20
	11 フイリピン共和国	0.9900	100,000	98,873	2028/08/15
	162 5年国債	0.3000	200,000	198,704	2028/09/20
	163 5年国債	0.4000	850,000	848,045	2028/09/20
	352 10年国債	0.1000	20,000	19,703	2028/09/20
	164 5年国債	0.2000	270,000	266,606	2028/12/20
	165 5年国債	0.3000	450,000	446,328	2028/12/20
	166 5年国債	0.4000	630,000	627,776	2028/12/20
	353 10年国債	0.1000	750,000	737,257	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	300,000	319,002	2028/12/20
	167 5年国債	0.4000	150,000	149,268	2029/03/20
	168 5年国債	0.6000	400,000	401,760	2029/03/20
	354 10年国債	0.1000	730,000	716,268	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	55,000	58,601	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	260,000	279,442	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	540,000	529,189	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	250,000	270,885	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	250,000	269,662	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	500,000	489,375	2029/09/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	17,898	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	310,000	335,581	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	700,000	684,257	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	70,000	76,022	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	196,452	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	184,000	203,297	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	500,000	487,995	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	200,000	218,952	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	200,000	217,834	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	33,086	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	650,000	633,178	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	103,187	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	99,932	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	317,000	336,837	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	1,000,000	971,890	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	200,000	216,464	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	200,000	215,252	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	41,288	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	780,000	756,280	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	200,000	219,404	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	300,000	327,222	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	850,000	822,145	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	130,000	143,780	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	120,189	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	350,000	380,145	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	31,007	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	1,000,000	964,440	2031/06/20

2024年６月17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	
	128 20年国債	1.9000	250,000	271,940	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	200,000	216,206	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	1,000,000	961,540	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	151,473	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	161,250	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	27,022	2031/11/20
	365 10年国債	0.1000	1,130,000	1,082,799	2031/12/20
	132 20年国債	1.7000	100,000	107,515	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	100,000	108,269	2031/12/20
	366 10年国債	0.2000	600,000	577,512	2032/03/20
	134 20年国債	1.8000	30,000	32,498	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	98,947	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	550,000	587,482	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	61,719	2032/05/20
	367 10年国債	0.2000	900,000	863,262	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	300,000	318,072	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	370,000	395,093	2032/06/20
	368 10年国債	0.2000	1,200,000	1,147,332	2032/09/20
	140 20年国債	1.7000	570,000	613,297	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	29,270	2032/11/22
	369 10年国債	0.5000	990,000	967,497	2032/12/20
	9 30年国債	1.4000	43,000	45,198	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	400,000	430,384	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	240,000	260,150	2032/12/20
	370 10年国債	0.5000	1,350,000	1,315,251	2033/03/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	46,123	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	224,109	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	140,000	148,198	2033/03/20
	371 10年国債	0.4000	800,000	770,200	2033/06/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	43,024	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	340,000	365,704	2033/06/20
	372 10年国債	0.8000	900,000	895,365	2033/09/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	66,636	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	20,000	21,495	2033/09/20
	373 10年国債	0.6000	1,120,000	1,090,566	2033/12/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	82,586	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	600,000	639,018	2033/12/20
	374 10年国債	0.8000	350,000	346,083	2034/03/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	93,279	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	400,000	421,516	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	50,000	57,395	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	532,000	560,009	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	250,000	287,157	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	310,000	322,886	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	130,000	148,149	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	420,000	428,391	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	90,360	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	600,000	610,758	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	500,000	564,720	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	280,000	287,187	2035/06/20

2024年6月17日現在					
区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
	154 20年国債	1.2000	680,000	688,880	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	67,734	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	480,000	474,609	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	170,000	195,583	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	430,000	395,582	2036/03/20
	157 20年国債	0.2000	710,000	634,491	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	105,911	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	430,000	396,984	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	169,138	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	400,000	372,280	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	180,000	204,910	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	510,000	478,614	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	470,000	433,640	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	172,500	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	590,000	542,068	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	460,000	420,587	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	270,000	310,154	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	580,000	520,695	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	470,000	419,728	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	226,870	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	550,000	503,041	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	450,000	397,804	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	246,015	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	570,000	493,659	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	500,000	423,910	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	300,000	330,588	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	520,000	438,438	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	350,000	293,286	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	385,000	428,612	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	170,000	144,059	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	500,000	421,395	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	280,000	298,883	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	800,000	670,520	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	470,000	398,583	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	270,000	295,304	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	530,000	447,357	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	530,000	437,377	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	250,000	265,135	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	710,000	593,148	2041/09/20
	179 20年国債	0.5000	510,000	423,998	2041/12/20
	36 30年国債	2.0000	350,000	370,380	2042/03/20
	180 20年国債	0.8000	540,000	471,787	2042/03/20
	181 20年国債	0.9000	450,000	398,448	2042/06/20
	37 30年国債	1.9000	450,000	467,424	2042/09/20
	182 20年国債	1.1000	490,000	447,477	2042/09/20
	183 20年国債	1.4000	490,000	469,302	2042/12/20
	38 30年国債	1.8000	260,000	265,015	2043/03/20
	184 20年国債	1.1000	450,000	408,123	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	270,000	278,958	2043/06/20
	185 20年国債	1.1000	500,000	451,715	2043/06/20

2024年６月17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	
	40 30年国債	1.8000	240,000	243,480	2043/09/20
	186 20年国債	1.5000	430,000	415,113	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	250,000	249,087	2043/12/20
	187 20年国債	1.3000	400,000	371,928	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	320,000	317,881	2044/03/20
	188 20年国債	1.6000	350,000	341,789	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	260,000	257,691	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	300,000	296,646	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	250,000	238,052	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	250,000	237,412	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	320,000	308,832	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	320,000	296,896	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	220,000	203,515	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	350,000	285,467	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	340,000	245,670	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	350,000	264,257	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	300,000	230,871	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	400,000	321,172	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	300,000	239,874	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	340,000	270,932	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	300,000	238,059	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	100,000	109,437	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	430,000	339,790	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	300,000	230,394	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	280,000	224,915	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	300,000	228,348	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	115,652	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	310,000	222,685	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	300,000	208,353	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	290,000	200,210	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	310,000	212,746	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	156,562	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	270,000	184,199	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	350,000	251,538	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	340,000	243,185	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	410,000	300,243	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	180,000	186,924	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	330,000	240,754	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	390,000	283,218	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	320,000	231,504	2051/09/20
	73 30年国債	0.7000	360,000	259,455	2051/12/20
	5 40年国債	2.0000	185,000	183,525	2052/03/20
	74 30年国債	1.0000	380,000	296,818	2052/03/20
	75 30年国債	1.3000	340,000	286,477	2052/06/20
	76 30年国債	1.4000	310,000	267,251	2052/09/20
	77 30年国債	1.6000	295,000	266,556	2052/12/20
	6 40年国債	1.9000	285,000	275,520	2053/03/20
	78 30年国債	1.4000	240,000	206,184	2053/03/20
	79 30年国債	1.2000	320,000	260,796	2053/06/20
	80 30年国債	1.8000	330,000	311,209	2053/09/20

2024年6月17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	
		81 30年国債	1.6000	375,000	337,155	2053/12/20
		7 40年国債	1.7000	190,000	174,642	2054/03/20
		82 30年国債	1.8000	200,000	188,322	2054/03/20
		8 40年国債	1.4000	230,000	194,642	2055/03/20
		9 40年国債	0.4000	220,000	133,834	2056/03/20
		10 40年国債	0.9000	230,000	164,321	2057/03/20
		11 40年国債	0.8000	320,000	218,019	2058/03/20
		12 40年国債	0.5000	380,000	227,456	2059/03/20
		13 40年国債	0.5000	360,000	211,492	2060/03/20
		14 40年国債	0.7000	430,000	269,115	2061/03/20
		15 40年国債	1.0000	410,000	283,396	2062/03/20
		16 40年国債	1.3000	1,120,000	850,427	2063/03/20
		17 40年国債	2.2000	300,000	294,993	2064/03/20
種別小計	銘柄数	262銘柄				
	金額			105,182,000	100,536,383	
地方債証券		4 東京都5年	0.0200	200,000	199,470	2025/09/19
		22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	102,023	2025/11/21
		27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	100,322	2025/11/27
		751 東京都公債	0.3700	100,000	100,165	2025/12/19
		153 共同発行地方	0.4690	200,000	200,628	2025/12/25
		222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,442	2026/06/19
		28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	99,516	2027/01/29
		168 共同発行地方	0.2100	100,000	99,538	2027/03/25
		170 共同発行地方	0.1800	200,000	198,782	2027/05/25
		420 大阪府公債	0.1700	200,000	198,702	2027/05/28
		29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	99,406	2027/06/23
		29-5 広島県公債	0.2450	100,000	99,282	2028/01/25
		14 横浜市20年	2.3200	100,000	106,896	2028/03/17
		20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	107,411	2028/05/26
		16 東京都20年	2.0100	100,000	106,532	2028/12/20
		26-2 京都府15年	1.0710	100,000	102,442	2029/04/27
		6-1 大阪市5年	0.5800	100,000	100,093	2029/05/22
		21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	108,479	2029/06/20
		195 共同発行地方	0.0290	100,000	97,364	2029/06/25
		196 共同発行地方	0.0600	100,000	97,484	2029/07/25
		8 静岡県20年	2.2430	200,000	217,122	2029/08/17
		19 横浜市20年	2.2000	100,000	108,404	2029/08/31
		796 東京都公債	0.0400	100,000	97,303	2029/09/20
		26-5 札幌市15年	0.9610	100,000	102,080	2029/09/20
		1 北九州市15年	0.9360	100,000	101,958	2029/10/22
		1-1 山梨県公債	0.0500	100,000	97,279	2029/10/30
		11 名古屋市20年	2.1300	200,000	216,864	2029/12/14
		1-5 千葉市公債	0.0800	100,000	97,221	2030/02/25
		2-1 静岡県公債	0.1260	100,000	97,439	2030/03/19
		2-1 京都府公債	0.1350	200,000	194,866	2030/04/12
		9 埼玉県20年	2.1500	100,000	109,071	2030/05/24
		206 共同発行地方	0.1310	100,000	97,309	2030/05/24
		808 東京都公債	0.1100	100,000	96,885	2030/09/20
		2-4 札幌市公債	0.1200	100,000	96,945	2030/09/20

2024年６月17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	
		2-7 埼玉県公債	0.1250	100,000	96,907	2030/10/16
		27-12 愛知県15年	0.7590	100,000	100,836	2030/10/21
		2-2 岡山県公債	0.1200	100,000	96,626	2031/01/29
		3-5 北海道公債	0.1400	100,000	96,277	2031/06/30
		23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	108,364	2031/08/19
		7 大阪府20年	1.8400	200,000	216,100	2031/09/26
		37-2 宮城県公債	0.1350	100,000	95,848	2031/10/28
		10 京都市20年	1.8030	100,000	107,813	2031/11/21
		3-2 徳島県公債	0.1300	100,000	95,696	2031/11/26
		827 東京都公債	0.2940	100,000	96,489	2032/03/19
		12 埼玉県20年	1.7300	100,000	107,334	2032/05/24
		4-3 長崎県公債	0.3640	100,000	96,777	2032/06/18
		13 千葉県20年	1.7010	100,000	107,107	2032/10/15
		5-1 福岡県公債	0.6810	100,000	98,259	2033/05/30
		244 共同発行地方	0.5900	200,000	194,601	2033/07/25
		25-1 広島県20年	1.7500	100,000	107,413	2033/09/13
		19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	105,687	2033/12/09
		262 神奈川県公債	1.0800	100,000	100,079	2034/03/17
		16 千葉県20年	1.5550	100,000	105,364	2034/04/14
		26-4 愛知県20年	1.5420	100,000	105,197	2034/05/15
		6-2 大阪市公債	0.9950	100,000	100,023	2034/05/22
		255 共同発行地方	1.0810	100,000	100,071	2034/06/23
		27 神奈川県20年	1.3980	100,000	103,567	2034/09/20
		31 神奈川県20年	1.0020	100,000	98,106	2035/12/20
		4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	106,388	2041/09/20
		4 埼玉県30年	1.3270	100,000	90,013	2045/12/20
種別小計	銘柄数	60銘柄				
	金額			6,900,000	6,991,689	
特殊債券（除く金融債券）		261 政保道路機構	0.3810	200,000	200,387	2025/11/28
		127 都市再生	0.0750	100,000	99,186	2026/09/18
		80 住宅支援機構	1.5890	100,000	102,585	2026/09/18
		F124地方公共団体	1.4180	100,000	102,441	2027/06/04
		97政保地方公共団	0.1300	100,000	99,229	2027/06/14
		F143地方公共団体	1.3510	100,000	102,353	2027/08/25
		321 政保道路機構	0.1550	200,000	198,398	2027/08/31
		1 地方公共団15年	1.3340	100,000	102,463	2028/01/28
		F192地方公共団体	1.1670	100,000	101,947	2028/10/24
		F226地方公共団体	1.0960	100,000	101,580	2029/02/28
		4 国際協力銀行 CO	0.6390	100,000	100,023	2029/03/19
		86 政保道路機構	2.0000	100,000	107,286	2029/07/31
		47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	101,907	2029/09/20
		97 政保道路機構	2.1000	100,000	108,340	2029/12/28
		129 地方公共団体	0.0950	200,000	192,456	2030/02/28
		403 政保道路機構	0.0010	100,000	96,737	2030/03/29
		F221地方公共団体	1.1980	200,000	204,750	2030/04/26
		69 政保政策投資 C	0.0800	100,000	96,500	2030/12/16
		160 政保道路機構	1.8000	200,000	215,687	2032/03/19
		123 住宅支援機構	1.8010	100,000	107,012	2032/09/17
		174 日本政策投資	0.6490	300,000	290,594	2033/07/14

2024年6月17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	
		31 地方公共団20	1.7440	100,000	105,564	2033/09/28
		478 政保道路機構	1.0900	100,000	100,042	2034/06/30
		223 政保道路機構	1.4270	100,000	104,020	2034/07/31
		235 政保道路機構	1.2240	100,000	101,723	2034/12/28
		F568地方公共団体	0.3260	200,000	179,646	2035/07/30
		284 政保道路機構	0.1490	200,000	176,086	2036/07/31
		298 政保道路機構	0.5470	100,000	91,875	2036/12/26
		247 道路機構	0.3420	200,000	164,070	2040/03/19
種別小計	銘柄数	29銘柄				
	金額			3,900,000	3,854,898	
金融債券		19 利付商工債	0.1000	100,000	99,125	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄				
	金額			100,000	99,125	
普通社債券		11日本たばこ産業	0.5990	100,000	100,312	2025/07/15
		63 中日本高速道	0.5760	100,000	100,312	2025/11/13
		4 フアーストリテイリング	0.7490	100,000	100,452	2025/12/18
		14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	99,677	2025/12/19
		16 NTT フアイナンス	0.1800	100,000	99,637	2025/12/19
		11 ヒユーリツク	0.3200	100,000	99,647	2026/04/13
		36 芙蓉総合リース	0.2700	100,000	99,445	2026/06/05
		36 三井住友 F&L	0.2600	200,000	198,927	2026/06/15
		56 日産フイナンシヤル	0.5200	100,000	99,482	2026/06/19
		1 日生2021基金	0.2800	100,000	99,309	2026/08/03
		20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,141	2026/08/21
		32大和ハウス工業	0.3100	300,000	298,779	2026/09/07
		17 パナソニツク	0.4700	100,000	99,643	2026/09/18
		7 三井住友海上	0.1900	100,000	99,144	2026/11/13
		6 楽天カード	0.6200	100,000	92,803	2026/12/17
		22 イオン FS	0.4400	200,000	197,997	2027/01/04
		509 関西電力	0.4700	100,000	99,611	2027/05/25
		30 阪神高速道路	0.3390	100,000	99,540	2027/05/31
		42 リコーリース	0.3900	100,000	99,171	2027/06/01
		12 アサヒグループ HD	0.3300	100,000	99,180	2027/06/11
		15 デンソー	0.2450	100,000	99,087	2027/06/18
		78 トヨタフアイナンス	0.2650	100,000	99,098	2027/07/23
		11 東京電力パワー	0.7900	100,000	99,528	2028/01/25
		7 日本製鉄	0.5640	100,000	99,481	2028/03/17
		16 クボタ	0.4790	100,000	99,119	2028/04/20
		16 JERA	0.6400	100,000	99,330	2028/04/25
		1 SOMPOHD	0.4790	100,000	99,091	2028/04/27
		111 住友不動産	0.5200	100,000	99,428	2028/04/28
		11サントリーホールデイング	0.3890	100,000	98,806	2028/05/25
		50 大阪瓦斯	0.3900	100,000	98,908	2028/06/02
		82 三井不動産	0.3600	100,000	98,630	2028/06/06
		22 積水ハウス	0.3600	100,000	98,770	2028/06/07
		26 りそなホールデイン	0.4150	100,000	98,818	2028/06/07
		1 レゾナツク HD	0.6950	100,000	98,819	2028/06/15
		31 豊田通商	0.3550	200,000	197,186	2028/06/15

日本債券インデックスマザーファンド

2024年６月17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	
		81 ホンダフアイナンス	0.3890	100,000	98,910	2028/06/20
		34 沖縄電力	0.3650	100,000	98,792	2028/06/23
		62 日本電気	0.3550	200,000	196,318	2028/07/11
		3 オリツクス銀行	0.4100	200,000	197,417	2028/07/12
		68 名古屋鉄道	0.3750	200,000	197,194	2028/07/13
		20 ZHD	0.4600	100,000	97,061	2028/07/28
		101 中日本高速道	0.4390	400,000	397,141	2028/08/17
		4 アステラス製薬	0.5190	300,000	297,391	2028/08/31
		27 りそなホールデイン	0.5190	200,000	198,182	2028/09/08
		15 ソフトバンク	0.4100	100,000	97,276	2028/10/12
		33 首都高速道路	0.5230	100,000	99,386	2028/12/20
		28 三井住友 TB	0.5440	300,000	297,048	2029/01/25
		41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	106,407	2029/01/29
		111 東日本高速道	0.6070	100,000	99,623	2029/04/25
		32 住友電工	0.4640	100,000	98,440	2029/07/13
		13 NTT フアイナンス	1.0900	100,000	101,468	2029/09/20
		85 電源開発	0.8720	100,000	100,178	2029/10/31
		7 凸版印刷	1.1040	100,000	101,413	2029/12/12
		65 東京瓦斯	0.2250	100,000	96,431	2030/09/10
		18 セブンアンドアイ	1.0400	100,000	101,014	2030/11/01
		35 東レ	0.9730	300,000	300,254	2030/11/22
		538 関西電力	0.3900	100,000	96,302	2031/01/24
		88 西日本高速道	0.8580	100,000	100,318	2031/05/23
		33 NTT フアイナンス	1.1120	100,000	100,097	2031/06/20
		18 楽天グループ	1.0500	100,000	71,686	2031/12/02
		143 三菱地所	0.9000	100,000	97,664	2033/05/02
		448 中国電力	0.9200	100,000	97,401	2033/05/25
		31 トヨタ自動車	0.7350	100,000	97,206	2033/06/01
		2 AGC	0.7900	100,000	96,568	2033/06/08
		63 住友商事	0.8400	100,000	96,857	2033/06/15
		67 阪急阪神 HLDG	0.7740	100,000	96,398	2033/07/13
		560 東北電力	0.8700	200,000	193,580	2033/07/25
		87 電源開発	1.1060	100,000	98,143	2034/02/20
		41 ソニーＧ	1.0010	100,000	98,039	2034/03/07
		332 北海道電力	0.9070	100,000	92,358	2036/04/25
		23 森ビル	0.9700	100,000	87,473	2038/05/17
		107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	89,886	2045/01/27
種別小計	銘柄数	72銘柄				
	金額			9,100,000	8,953,662	
合計	銘柄数	424銘柄				
	金額			125,182,000	120,435,758	

（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24期　（決算日　2023年11月30日）

（作成対象期間　2022年12月１日～2023年11月30日）

日本債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

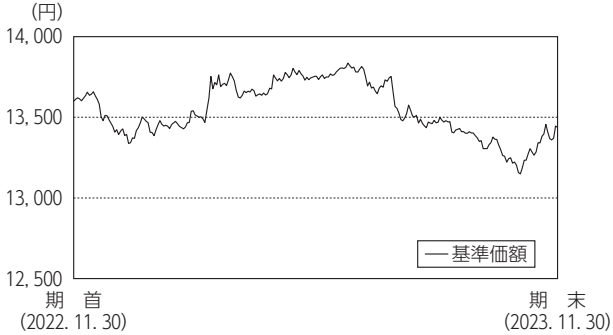
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年　月　日	基準価額		ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数(ベンチマーク)		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首) 2022年11月30日	13,600	—	509.828	—	99.5	—
12月末	13,423	△ 1.3	503.154	△ 1.3	99.7	—
2023年1月末	13,386	△ 1.6	501.780	△ 1.6	99.5	—
2月末	13,537	△ 0.5	507.513	△ 0.5	99.6	—
3月末	13,726	0.9	514.584	0.9	99.8	—
4月末	13,763	1.2	515.907	1.2	99.6	—
5月末	13,749	1.1	515.440	1.1	99.6	—
6月末	13,781	1.3	516.779	1.4	99.7	—
7月末	13,567	△ 0.2	508.731	△ 0.2	99.4	—
8月末	13,469	△ 1.0	505.088	△ 0.9	99.5	—
9月末	13,372	△ 1.7	501.436	△ 1.6	99.6	—
10月末	13,158	△ 3.3	493.357	△ 3.2	99.5	—
(期末) 2023年11月30日	13,437	△ 1.2	503.781	△ 1.2	99.6	—

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。
(注4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：13,600円　期末：13,437円　騰落率：△1.2%

【基準価額の主な変動要因】

わが国の公社債に投資した結果、金利が上昇（債券価格は下落）したことなどがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇しました。

国内長期金利は、当作成期首より、世界的なインフレの進行や海外金利の上昇、日銀が金融政策を一部修正するのではないかとの思惑などにより、日銀が長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）で許容する上限である0.25%程度を上限とした狭いレンジでの推移が続きました。2022年12月には、金融政策決定会合において日銀が長期金利の許容上限を0.25%程度から0.5%程度に引き上げたことを受けて長期金利は急上昇し、2023年1月には0.5%まで上昇しました。3月に入ると、米国の地方銀行の経営破綻をきっかけとした信用不安が警戒されたことで投資家心理が悪化し、長期金利は一時0.2%台まで急低下（債券価格は上昇）したものの、当局の迅速な対応などが評価されて再び0.4%台後半まで上昇しました。その後は、日銀が7月の金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールの運用を一部変更して実質的に長期金利の許容上限を0.5%から1.0%に引き上げたことや、金融政策の修正を想起させる植田日銀総裁の発言、日銀が物価見通しを再び上昇修正するとの見方などにより、さらなる金融政策の修正が警戒され、10月には0.8%台まで上昇しました。10月の金融政策決定会合では、イールドカーブ・コントロールにおいて許容する上限である1.0%を「めど」に修正し、1.0%を超える長期金利の上昇を容認したものの、11月に入り米国金利が低下したことを受け、国内長期金利は低下しました。

◆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、ファンドの資金流出入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△1.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△1.2%となりました。

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差はほとんどなく、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・ボンド・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、ファンドの資金流出入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

■１万口当りの費用の明細

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

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

■売買および取引の状況
公　社　債

（2022年12月１日から2023年11月30日まで）

		買　付　額	売　付　額
		千円	千円
国内	国債証券	26, 610, 118	35, 725, 426 (　　—)
	地方債証券	3, 463, 296	201, 144 (　　—)
	特殊債券	916, 742	100, 523 (　　—)
	社債券	5, 694, 557	299, 826 (　　—)

（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

（2022年12月１日から2023年11月30日まで）

当　期			
買　付		売　付	
銘　柄	金　額	銘　柄	金　額
	千円		千円
369 10年国債 0. 5% 2032/12/20	1, 584, 041	436 2年国債 0. 005% 2024/5/1	2, 302, 925
370 10年国債 0. 5% 2033/3/20	1, 122, 671	352 10年国債 0. 1% 2028/9/20	1, 791, 346
368 10年国債 0. 2% 2032/9/20	967, 906	355 10年国債 0. 1% 2029/6/20	1, 252, 681
147 5年国債 0. 005% 2026/3/20	931, 403	141 5年国債 0. 1% 2024/9/20	1, 242, 852
350 10年国債 0. 1% 2028/3/20	918, 282	138 5年国債 0. 1% 2023/12/20	1, 202, 316
149 5年国債 0. 005% 2026/9/20	909, 927	140 5年国債 0. 1% 2024/6/20	1, 122, 531
371 10年国債 0. 4% 2033/6/20	828, 404	151 5年国債 0. 005% 2027/3/20	1, 100, 310
155 5年国債 0. 3% 2027/12/20	733, 642	433 2年国債 0. 005% 2024/2/1	1, 000, 655
151 5年国債 0. 005% 2027/3/20	658, 204	149 5年国債 0. 005% 2026/9/20	1, 000, 108
351 10年国債 0. 1% 2028/6/20	596, 038	351 10年国債 0. 1% 2028/6/20	999, 381

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

■組入資産明細表

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

作成期	当期末						
区分	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	95,583,000	93,894,775	84.3	—	54.6	20.0	9.8
地方債証券	6,000,000	6,120,781	5.5	—	3.9	1.0	0.6
特殊債券（除く金融債券）	2,700,000	2,695,739	2.4	—	1.6	0.5	0.4
金融債券	100,000	99,549	0.1	—	—	0.1	—
普通社債券	8,200,000	8,088,307	7.3	—	2.0	5.0	0.3
合計	112,583,000	110,899,152	99.6	—	62.0	26.6	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）

当期末					
区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	443 2年国債	0.0050	200,000	200,080	2024/12/01
	142 5年国債	0.1000	980,000	981,283	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	400,000	401,368	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	74,632	2024/12/20
	445 2年国債	0.0050	100,000	100,040	2025/02/01
	143 5年国債	0.1000	2,470,000	2,474,001	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	580,000	583,201	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	82,208	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	52,275	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	133,419	2025/03/20
	448 2年国債	0.0050	240,000	240,050	2025/05/01
	449 2年国債	0.0050	550,000	550,038	2025/06/01
	144 5年国債	0.1000	1,300,000	1,302,210	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	590,000	593,746	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	62,806	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	51,558	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	54,734	2025/06/20
	450 2年国債	0.0050	180,000	180,000	2025/07/01
	452 2年国債	0.0050	40,000	40,000	2025/09/01
	145 5年国債	0.1000	1,770,000	1,773,026	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	760,000	765,411	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	90,285	2025/09/20
	453 2年国債	0.0050	70,000	69,974	2025/10/01
	146 5年国債	0.1000	1,080,000	1,081,652	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	500,000	502,820	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	96,957	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	1,630,000	1,628,679	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	710,000	710,972	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	60,743	2026/03/20

当		期		末	
区　　分	銘　　柄	年 利 率	額 面 金 額	評　価　額	償還年月日
		%	千円	千円	
	86 20年国債	2. 3000	80, 000	84, 152	2026/03/20
	87 20年国債	2. 2000	55, 000	57, 728	2026/03/20
	148 5年国債	0. 0050	1, 200, 000	1, 198, 464	2026/06/20
	343 10年国債	0. 1000	780, 000	780, 889	2026/06/20
	89 20年国債	2. 2000	78, 000	82, 261	2026/06/20
	149 5年国債	0. 0050	860, 000	858, 555	2026/09/20
	344 10年国債	0. 1000	780, 000	780, 756	2026/09/20
	90 20年国債	2. 2000	20, 000	21, 194	2026/09/20
	150 5年国債	0. 0050	1, 050, 000	1, 047, 438	2026/12/20
	345 10年国債	0. 1000	950, 000	950, 427	2026/12/20
	92 20年国債	2. 1000	310, 000	329, 065	2026/12/20
	151 5年国債	0. 0050	800, 000	797, 368	2027/03/20
	152 5年国債	0. 1000	200, 000	199, 966	2027/03/20
	346 10年国債	0. 1000	780, 000	779, 867	2027/03/20
	93 20年国債	2. 0000	100, 000	106, 246	2027/03/20
	94 20年国債	2. 1000	130, 000	138, 547	2027/03/20
	153 5年国債	0. 0050	750, 000	746, 812	2027/06/20
	347 10年国債	0. 1000	1, 100, 000	1, 099, 021	2027/06/20
	95 20年国債	2. 3000	50, 000	53, 853	2027/06/20
	96 20年国債	2. 1000	55, 000	58, 850	2027/06/20
	154 5年国債	0. 1000	730, 000	728, 751	2027/09/20
	348 10年国債	0. 1000	1, 050, 000	1, 048, 204	2027/09/20
	97 20年国債	2. 2000	40, 000	43, 116	2027/09/20
	98 20年国債	2. 1000	320, 000	343, 721	2027/09/20
	155 5年国債	0. 3000	730, 000	733, 817	2027/12/20
	156 5年国債	0. 2000	360, 000	360, 432	2027/12/20
	349 10年国債	0. 1000	1, 250, 000	1, 246, 475	2027/12/20
	99 20年国債	2. 1000	100, 000	107, 788	2027/12/20
	157 5年国債	0. 2000	200, 000	200, 042	2028/03/20
	158 5年国債	0. 1000	500, 000	497, 975	2028/03/20
	350 10年国債	0. 1000	900, 000	896, 355	2028/03/20
	100 20年国債	2. 2000	155, 000	168, 283	2028/03/20
	101 20年国債	2. 4000	350, 000	382, 980	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1. 0500	100, 000	97, 203	2028/04/20
	161 5年国債	0. 3000	280, 000	281, 008	2028/06/20
	351 10年国債	0. 1000	600, 000	596, 754	2028/06/20
	11 フイリピン共和国	0. 9900	100, 000	98, 493	2028/08/15
	162 5年国債	0. 3000	200, 000	200, 474	2028/09/20
	353 10年国債	0. 1000	930, 000	922, 346	2028/12/20
	108 20年国債	1. 9000	300, 000	324, 612	2028/12/20
	354 10年国債	0. 1000	730, 000	723, 138	2029/03/20
	109 20年国債	1. 9000	55, 000	59, 682	2029/03/20
	110 20年国債	2. 1000	260, 000	284, 853	2029/03/20
	355 10年国債	0. 1000	430, 000	425, 420	2029/06/20
	111 20年国債	2. 2000	200, 000	220, 988	2029/06/20
	112 20年国債	2. 1000	150, 000	164, 920	2029/06/20
	356 10年国債	0. 1000	700, 000	691, 614	2029/09/20
	1 30年国債	2. 8000	16, 000	18, 291	2029/09/20
	113 20年国債	2. 1000	310, 000	341, 920	2029/09/20
	357 10年国債	0. 1000	750, 000	739, 762	2029/12/20

当		期		末	
区　　分	銘　　柄	年 利 率	額 面 金 額	評　価　額	償還年月日
		%	千円	千円	
	114 20年国債	2.1000	70,000	77,420	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	200,149	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	184,000	207,220	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	450,000	442,926	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	200,000	223,008	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	200,000	221,774	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	33,698	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	800,000	785,680	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	104,970	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	101,537	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	317,000	342,046	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	1,000,000	979,480	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	200,000	220,012	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	200,000	218,686	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	42,116	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	430,000	419,998	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	200,000	223,088	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	300,000	332,577	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	790,000	769,641	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	130,000	146,230	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	122,134	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	250,000	275,810	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	31,539	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	1,200,000	1,165,920	2031/06/20
	128 20年国債	1.9000	250,000	276,167	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	200,000	219,476	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	1,000,000	968,500	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	153,783	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	163,639	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	27,516	2031/11/20
	365 10年国債	0.1000	800,000	772,832	2031/12/20
	132 20年国債	1.7000	100,000	109,203	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	100,000	109,977	2031/12/20
	366 10年国債	0.2000	950,000	923,238	2032/03/20
	134 20年国債	1.8000	30,000	33,041	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	100,595	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	550,000	597,014	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	62,887	2032/05/20
	367 10年国債	0.2000	900,000	872,487	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	300,000	323,406	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	370,000	401,890	2032/06/20
	368 10年国債	0.2000	700,000	676,585	2032/09/20
	140 20年国債	1.7000	570,000	624,246	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	29,835	2032/11/22
	369 10年国債	0.5000	680,000	673,288	2032/12/20
	9 30年国債	1.4000	43,000	45,973	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	400,000	438,340	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	240,000	265,068	2032/12/20
	370 10年国債	0.5000	1,130,000	1,116,598	2033/03/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	46,899	2033/03/20

当		期		末	
区　　分	銘　　柄	年 利 率	額 面 金 額	評　価　額	償還年月日
		%	千円	千円	
	143 20年国債	1. 6000	210, 000	228, 293	2033/03/20
	144 20年国債	1. 5000	140, 000	150, 963	2033/03/20
	371 10年国債	0. 4000	650, 000	635, 095	2033/06/20
	11 30年国債	1. 7000	40, 000	43, 895	2033/06/20
	145 20年国債	1. 7000	340, 000	373, 109	2033/06/20
	372 10年国債	0. 8000	120, 000	121, 434	2033/09/20
	12 30年国債	2. 1000	60, 000	68, 111	2033/09/20
	146 20年国債	1. 7000	20, 000	21, 945	2033/09/20
	13 30年国債	2. 0000	75, 000	84, 473	2033/12/20
	147 20年国債	1. 6000	480, 000	522, 038	2033/12/20
	14 30年国債	2. 4000	82, 000	95, 666	2034/03/20
	148 20年国債	1. 5000	360, 000	387, 849	2034/03/20
	15 30年国債	2. 5000	50, 000	58, 929	2034/06/20
	149 20年国債	1. 5000	532, 000	572, 969	2034/06/20
	16 30年国債	2. 5000	250, 000	295, 045	2034/09/20
	150 20年国債	1. 4000	480, 000	511, 689	2034/09/20
	17 30年国債	2. 4000	130, 000	152, 201	2034/12/20
	151 20年国債	1. 2000	480, 000	501, 019	2034/12/20
	18 30年国債	2. 3000	80, 000	92, 915	2035/03/20
	152 20年国債	1. 2000	520, 000	542, 110	2035/03/20
	19 30年国債	2. 3000	57, 000	66, 250	2035/06/20
	153 20年国債	1. 3000	570, 000	599, 816	2035/06/20
	154 20年国債	1. 2000	630, 000	655, 055	2035/09/20
	21 30年国債	2. 3000	60, 000	69, 816	2035/12/20
	155 20年国債	1. 0000	480, 000	487, 334	2035/12/20
	22 30年国債	2. 5000	170, 000	201, 793	2036/03/20
	156 20年国債	0. 4000	330, 000	311, 209	2036/03/20
	157 20年国債	0. 2000	560, 000	512, 898	2036/06/20
	24 30年国債	2. 5000	92, 000	109, 399	2036/09/20
	158 20年国債	0. 5000	350, 000	331, 831	2036/09/20
	25 30年国債	2. 3000	150, 000	174, 732	2036/12/20
	159 20年国債	0. 6000	500, 000	478, 290	2036/12/20
	26 30年国債	2. 4000	180, 000	211, 941	2037/03/20
	160 20年国債	0. 7000	460, 000	444, 323	2037/03/20
	161 20年国債	0. 6000	470, 000	446, 495	2037/06/20
	27 30年国債	2. 5000	150, 000	178, 588	2037/09/20
	162 20年国債	0. 6000	530, 000	501, 549	2037/09/20
	163 20年国債	0. 6000	480, 000	452, 438	2037/12/20
	28 30年国債	2. 5000	270, 000	321, 467	2038/03/20
	164 20年国債	0. 5000	430, 000	398, 119	2038/03/20
	165 20年国債	0. 5000	370, 000	341, 084	2038/06/20
	29 30年国債	2. 4000	200, 000	235, 496	2038/09/20
	166 20年国債	0. 7000	600, 000	567, 276	2038/09/20
	167 20年国債	0. 5000	400, 000	365, 700	2038/12/20
	30 30年国債	2. 3000	220, 000	255, 574	2039/03/20
	168 20年国債	0. 4000	420, 000	376, 324	2039/03/20
	169 20年国債	0. 3000	400, 000	350, 980	2039/06/20
	31 30年国債	2. 2000	300, 000	343, 731	2039/09/20
	170 20年国債	0. 3000	420, 000	366, 618	2039/09/20
	171 20年国債	0. 3000	350, 000	303, 919	2039/12/20

当		期		末	
区　　分	銘　　柄	年 利 率	額 面 金 額	評　価　額	償還年月日
		%	千円	千円	
	32 30年国債	2. 3000	285, 000	330, 212	2040/03/20
	172 20年国債	0. 4000	200, 000	175, 790	2040/03/20
	173 20年国債	0. 4000	510, 000	445, 964	2040/06/20
	33 30年国債	2. 0000	280, 000	311, 102	2040/09/20
	174 20年国債	0. 4000	600, 000	521, 928	2040/09/20
	175 20年国債	0. 5000	400, 000	352, 380	2040/12/20
	34 30年国債	2. 2000	270, 000	307, 794	2041/03/20
	176 20年国債	0. 5000	480, 000	421, 008	2041/03/20
	177 20年国債	0. 4000	530, 000	454, 363	2041/06/20
	35 30年国債	2. 0000	250, 000	276, 697	2041/09/20
	178 20年国債	0. 5000	510, 000	443, 322	2041/09/20
	179 20年国債	0. 5000	440, 000	380, 740	2041/12/20
	36 30年国債	2. 0000	350, 000	386, 501	2042/03/20
	180 20年国債	0. 8000	490, 000	446, 194	2042/03/20
	181 20年国債	0. 9000	500, 000	462, 160	2042/06/20
	37 30年国債	1. 9000	450, 000	488, 947	2042/09/20
	182 20年国債	1. 1000	340, 000	324, 574	2042/09/20
	183 20年国債	1. 4000	390, 000	390, 585	2042/12/20
	38 30年国債	1. 8000	260, 000	277, 274	2043/03/20
	184 20年国債	1. 1000	400, 000	379, 460	2043/03/20
	39 30年国債	1. 9000	270, 000	292, 064	2043/06/20
	185 20年国債	1. 1000	440, 000	415, 905	2043/06/20
	40 30年国債	1. 8000	240, 000	255, 081	2043/09/20
	186 20年国債	1. 5000	170, 000	171, 836	2043/09/20
	41 30年国債	1. 7000	210, 000	219, 347	2043/12/20
	42 30年国債	1. 7000	205, 000	213, 874	2044/03/20
	43 30年国債	1. 7000	260, 000	270, 933	2044/06/20
	44 30年国債	1. 7000	300, 000	312, 483	2044/09/20
	45 30年国債	1. 5000	250, 000	251, 002	2044/12/20
	46 30年国債	1. 5000	210, 000	210, 508	2045/03/20
	47 30年国債	1. 6000	370, 000	377, 252	2045/06/20
	48 30年国債	1. 4000	280, 000	274, 722	2045/09/20
	49 30年国債	1. 4000	220, 000	215, 461	2045/12/20
	50 30年国債	0. 8000	310, 000	267, 917	2046/03/20
	51 30年国債	0. 3000	340, 000	260, 705	2046/06/20
	52 30年国債	0. 5000	350, 000	280, 521	2046/09/20
	53 30年国債	0. 6000	250, 000	204, 455	2046/12/20
	54 30年国債	0. 8000	310, 000	264, 761	2047/03/20
	55 30年国債	0. 8000	260, 000	221, 390	2047/06/20
	56 30年国債	0. 8000	340, 000	288, 632	2047/09/20
	57 30年国債	0. 8000	320, 000	270, 832	2047/12/20
	1 40年国債	2. 4000	70, 000	81, 582	2048/03/20
	58 30年国債	0. 8000	430, 000	362, 825	2048/03/20
	59 30年国債	0. 7000	300, 000	246, 117	2048/06/20
	60 30年国債	0. 9000	220, 000	188, 799	2048/09/20
	61 30年国債	0. 7000	300, 000	244, 287	2048/12/20
	2 40年国債	2. 2000	110, 000	123, 442	2049/03/20
	62 30年国債	0. 5000	280, 000	215, 600	2049/03/20
	63 30年国債	0. 4000	300, 000	223, 752	2049/06/20
	64 30年国債	0. 4000	260, 000	193, 141	2049/09/20

当期末					
区分		銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
			%	千円	千円	
		65 30年国債	0.4000	270,000	199,945	2049/12/20
		3 40年国債	2.2000	150,000	168,058	2050/03/20
		66 30年国債	0.4000	270,000	198,976	2050/03/20
		67 30年国債	0.6000	300,000	233,022	2050/06/20
		68 30年国債	0.6000	340,000	263,374	2050/09/20
		69 30年国債	0.7000	310,000	246,167	2050/12/20
		4 40年国債	2.2000	180,000	201,668	2051/03/20
		70 30年国債	0.7000	330,000	261,399	2051/03/20
		71 30年国債	0.7000	310,000	244,940	2051/06/20
		72 30年国債	0.7000	320,000	252,204	2051/09/20
		73 30年国債	0.7000	310,000	243,709	2051/12/20
		5 40年国債	2.0000	185,000	199,026	2052/03/20
		74 30年国債	1.0000	320,000	272,256	2052/03/20
		75 30年国債	1.3000	330,000	302,590	2052/06/20
		76 30年国債	1.4000	310,000	290,891	2052/09/20
		77 30年国債	1.6000	275,000	270,440	2052/12/20
		6 40年国債	1.9000	285,000	299,663	2053/03/20
		78 30年国債	1.4000	240,000	224,599	2053/03/20
		79 30年国債	1.2000	290,000	257,926	2053/06/20
		80 30年国債	1.8000	80,000	82,232	2053/09/20
		7 40年国債	1.7000	121,000	121,363	2054/03/20
		8 40年国債	1.4000	230,000	213,720	2055/03/20
		9 40年国債	0.4000	220,000	149,171	2056/03/20
		10 40年国債	0.9000	230,000	183,089	2057/03/20
		11 40年国債	0.8000	320,000	244,364	2058/03/20
		12 40年国債	0.5000	380,000	257,529	2059/03/20
		13 40年国債	0.5000	360,000	241,106	2060/03/20
		14 40年国債	0.7000	430,000	307,299	2061/03/20
		15 40年国債	1.0000	430,000	338,212	2062/03/20
		16 40年国債	1.3000	500,000	430,565	2063/03/20
種別小計	銘柄数	259銘柄				
	金額			95,583,000	93,894,775	
地方債証券		26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	100,457	2025/02/26
		3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	201,271	2025/04/16
		4 東京都5年	0.0200	200,000	199,640	2025/09/19
		22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	103,036	2025/11/21
		27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	100,679	2025/11/27
		751 東京都公債	0.3700	100,000	100,480	2025/12/19
		153 共同発行地方	0.4690	200,000	201,360	2025/12/25
		222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,722	2026/06/19
		28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	99,918	2027/01/29
		168 共同発行地方	0.2100	100,000	99,976	2027/03/25
		420 大阪府公債	0.1700	200,000	199,501	2027/05/28
		29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	99,869	2027/06/23
		29-5 広島県公債	0.2450	100,000	99,798	2028/01/25
		20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	109,132	2028/05/26
		16 東京都20年	2.0100	100,000	108,126	2028/12/20
		21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	110,189	2029/06/20
		195 共同発行地方	0.0290	100,000	97,835	2029/06/25

当期末					
区分		銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
			%	千円	千円	
		196 共同発行地方	0.0600	100,000	97,948	2029/07/25
		8 静岡県20年	2.2430	200,000	220,437	2029/08/17
		19 横浜市20年	2.2000	100,000	110,025	2029/08/31
		796 東京都公債	0.0400	100,000	97,735	2029/09/20
		26-5 札幌市15年	0.9610	100,000	103,001	2029/09/20
		1 北九州市15年	0.9360	100,000	102,862	2029/10/22
		1-1 山梨県公債	0.0500	100,000	97,694	2029/10/30
		11 名古屋市20年	2.1300	200,000	219,899	2029/12/14
		1-5 千葉市公債	0.0800	100,000	97,531	2030/02/25
		2-1 静岡県公債	0.1260	100,000	97,746	2030/03/19
		2-1 京都府公債	0.1350	200,000	195,446	2030/04/12
		9 埼玉県20年	2.1500	100,000	110,407	2030/05/24
		808 東京都公債	0.1100	100,000	97,100	2030/09/20
		2-4 札幌市公債	0.1200	100,000	97,166	2030/09/20
		2-7 埼玉県公債	0.1250	100,000	97,106	2030/10/16
		27-12 愛知県15年	0.7590	100,000	101,374	2030/10/21
		2-2 岡山県公債	0.1200	100,000	96,716	2031/01/29
		3-5 北海道公債	0.1400	100,000	96,225	2031/06/30
		23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	109,350	2031/08/19
		7 大阪府20年	1.8400	200,000	217,828	2031/09/26
		37-2 宮城県公債	0.1350	100,000	95,959	2031/10/28
		10 京都市20年	1.8030	100,000	108,783	2031/11/21
		3-2 徳島県公債	0.1300	100,000	95,796	2031/11/26
		827 東京都公債	0.2940	100,000	96,800	2032/03/19
		12 埼玉県20年	1.7300	100,000	108,405	2032/05/24
		4-3 長崎県公債	0.3640	100,000	97,085	2032/06/18
		13 千葉県20年	1.7010	100,000	108,350	2032/10/15
		5-1 福岡県公債	0.6810	100,000	99,066	2033/05/30
		244 共同発行地方	0.5900	200,000	196,232	2033/07/25
		19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	107,108	2033/12/09
		16 千葉県20年	1.5550	100,000	106,961	2034/04/14
		31 神奈川県20年	1.0020	100,000	99,956	2035/12/20
		4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	110,607	2041/09/20
		4 埼玉県30年	1.3270	100,000	95,063	2045/12/20
種別小計	銘柄数	51銘柄				
	金額			6,000,000	6,120,781	
特殊債券（除く金融債券）		236 政保道路機構	0.3200	100,000	100,307	2025/01/31
		71 地方公共団体	0.4650	100,000	100,496	2025/04/28
		261 政保道路機構	0.3810	200,000	201,098	2025/11/28
		127 都市再生	0.0750	100,000	99,579	2026/09/18
		80 住宅支援機構	1.5890	100,000	103,814	2026/09/18
		F143地方公共団体	1.3510	100,000	103,919	2027/08/25
		1 地方公共団15年	1.3340	100,000	104,096	2028/01/28
		F192地方公共団体	1.1670	100,000	103,546	2028/10/24
		F226地方公共団体	1.0960	100,000	103,311	2029/02/28
		86 政保道路機構	2.0000	100,000	108,948	2029/07/31
		47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	103,072	2029/09/20
		129 地方公共団体	0.0950	200,000	194,647	2030/02/28
		F221地方公共団体	1.1980	200,000	208,144	2030/04/26

当期末					
区分		銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
			%	千円	千円	
		123 住宅支援機構	1.8010	100,000	108,839	2032/09/17
		174 日本政策投資	0.6490	300,000	294,632	2033/07/14
		31 地方公共団20	1.7440	100,000	108,294	2033/09/28
		223 政保道路機構	1.4270	100,000	106,060	2034/07/31
		284 政保道路機構	0.1490	200,000	179,730	2036/07/31
		298 政保道路機構	0.5470	100,000	93,974	2036/12/26
		247 道路機構	0.3420	200,000	169,224	2040/03/19
種別小計	銘柄数	20銘柄				
	金額			2,700,000	2,695,739	
金融債券		19 利付商工債	0.1000	100,000	99,549	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄				
	金額			100,000	99,549	
普通社債券		5 野村不動産 HD	0.9240	100,000	101,005	2025/05/30
		11日本たばこ産業	0.5990	100,000	100,667	2025/07/15
		63 中日本高速道	0.5760	100,000	100,700	2025/11/13
		4 フアーストリテイリング	0.7490	100,000	100,910	2025/12/18
		14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	99,761	2025/12/19
		16 NTT フアイナンス	0.1800	100,000	99,802	2025/12/19
		11 ヒユーリツク	0.3200	100,000	99,874	2026/04/13
		36 芙蓉総合リース	0.2700	100,000	99,632	2026/06/05
		36 三井住友 F&L	0.2600	200,000	199,344	2026/06/15
		56 日産フイナンシヤル	0.5200	100,000	98,884	2026/06/19
		1 日生2021基金	0.2800	100,000	99,662	2026/08/03
		20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,525	2026/08/21
		32大和ハウス工業	0.3100	300,000	299,927	2026/09/07
		17 パナソニツク	0.4700	100,000	100,049	2026/09/18
		7 三井住友海上	0.1900	100,000	99,610	2026/11/13
		6 楽天カード	0.6200	100,000	89,980	2026/12/17
		22 イオン FS	0.4400	200,000	198,496	2027/01/04
		509 関西電力	0.4700	100,000	99,917	2027/05/25
		42 リコーリース	0.3900	100,000	99,460	2027/06/01
		12 アサヒグループ HD	0.3300	100,000	99,718	2027/06/11
		15 デンソー	0.2450	100,000	99,468	2027/06/18
		78 トヨタフアイナンス	0.2650	100,000	99,568	2027/07/23
		11 東京電力パワー	0.7900	100,000	99,838	2028/01/25
		7 日本製鉄	0.5640	100,000	100,120	2028/03/17
		16 クボタ	0.4790	100,000	99,785	2028/04/20
		16 JERA	0.6400	100,000	99,812	2028/04/25
		1 SOMPOHD	0.4790	100,000	100,021	2028/04/27
		111 住友不動産	0.5200	100,000	99,952	2028/04/28
		11サントリーホールデイング	0.3890	100,000	99,413	2028/05/25
		50 大阪瓦斯	0.3900	100,000	99,314	2028/06/02
		82 三井不動産	0.3600	100,000	99,294	2028/06/06
		22 積水ハウス	0.3600	100,000	99,385	2028/06/07
		26 りそなホールデイン	0.4150	100,000	99,576	2028/06/07
		1 レゾナツク HD	0.6950	100,000	99,335	2028/06/15
		31 豊田通商	0.3550	200,000	197,633	2028/06/15

日本債券インデックスマザーファンド

当期末					
区分		銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
			%	千円	千円	
		81 ホンダフアイナンス	0.3890	100,000	99,434	2028/06/20
		34 沖縄電力	0.3650	100,000	98,982	2028/06/23
		62 日本電気	0.3550	200,000	197,093	2028/07/11
		3 オリツクス銀行	0.4100	200,000	198,928	2028/07/12
		68 名古屋鉄道	0.3750	200,000	198,549	2028/07/13
		20 ZHD	0.4600	100,000	97,475	2028/07/28
		101 中日本高速道	0.4390	400,000	399,133	2028/08/17
		4 アステラス製薬	0.5190	300,000	299,652	2028/08/31
		27 りそなホールデイン	0.5190	200,000	199,767	2028/09/08
		15 ソフトバンク	0.4100	100,000	96,982	2028/10/12
		41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	108,001	2029/01/29
		32 住友電工	0.4640	100,000	99,137	2029/07/13
		13 NTT フアイナンス	1.0900	100,000	102,570	2029/09/20
		85 電源開発	0.8720	100,000	100,570	2029/10/31
		7 凸版印刷	1.1040	100,000	102,483	2029/12/12
		65 東京瓦斯	0.2250	100,000	96,250	2030/09/10
		18 セブンアンドアイ	1.0400	100,000	100,833	2030/11/01
		35 東レ	0.9730	300,000	299,706	2030/11/22
		538 関西電力	0.3900	100,000	95,470	2031/01/24
		18 楽天グループ	1.0500	100,000	66,261	2031/12/02
		143 三菱地所	0.9000	100,000	98,829	2033/05/02
		448 中国電力	0.9200	100,000	96,688	2033/05/25
		31 トヨタ自動車	0.7350	100,000	97,542	2033/06/01
		2 AGC	0.7900	100,000	97,810	2033/06/08
		63 住友商事	0.8400	100,000	96,415	2033/06/15
		67 阪急阪神 HLDG	0.7740	100,000	97,374	2033/07/13
		560 東北電力	0.8700	200,000	192,045	2033/07/25
		332 北海道電力	0.9070	100,000	92,124	2036/04/25
		23 森ビル	0.9700	100,000	90,065	2038/05/17
		107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	92,674	2045/01/27
種別小計	銘柄数	65銘柄				
	金額			8,200,000	8,088,307	
合計	銘柄数	396銘柄				
	金額			112,583,000	110,899,152	

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年11月30日現在

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　　率
	千円	%
公社債	110, 899, 152	99. 5
コール・ローン等、その他	540, 591	0. 5
投資信託財産総額	111, 439, 744	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

2023年11月30日現在

項　　目	当　期　末
（A）資産	**111, 439, 744, 593円**
コール・ローン等	309, 769, 003
公社債（評価額）	110, 899, 152, 830
未収利息	221, 388, 521
前払費用	9, 434, 239
（B）負債	**109, 686, 818**
未払金	96, 080, 000
未払解約金	13, 606, 818
（C）純資産総額（A－B）	**111, 330, 057, 775**
元本	82, 851, 732, 167
次期繰越損益金	28, 478, 325, 608
（D）受益権総口数	**82, 851, 732, 167口**
1万口当り基準価額（C／D）	**13, 437円**

＊期首における元本額は83, 142, 525, 531円、当作成期間中における追加設定元本額は20, 248, 665, 071円、同解約元本額は20, 539, 458, 435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30ＶＡ（一般投資家私募）	45, 308, 502円
ダイワ国内重視バランスファンド50ＶＡ（一般投資家私募）	236, 159, 177円
ダイワ国際分散バランスファンド30ＶＡ（一般投資家私募）	37, 299, 453円
ダイワ国際分散バランスファンド50ＶＡ（一般投資家私募）	523, 999, 150円
ＤＣダイワ日本債券インデックス	10, 596, 563, 344円
ダイワ国内債券インデックス（ラップ専用）	9, 631, 665, 187円
ダイワ・バランスファンド35ＶＡ	8, 365, 243, 656円
ダイワ・バランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家専用）	1, 477, 234, 743円
ダイワ国内バランスファンド25ＶＡ（適格機関投資家専用）	197, 493, 843円
ダイワ国内バランスファンド30ＶＡ（適格機関投資家専用）	212, 842, 015円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	65, 102, 953円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	27, 224, 231, 107円
ダイワ日本債券インデックス（ダイワＳＭＡ専用）	13, 853, 994, 971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, 120, 651, 560円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	819, 920, 641円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6, 233, 967, 736円
ダイワライフスタイル25	445, 077, 928円
ダイワライフスタイル50	599, 475, 391円
ダイワライフスタイル75	165, 500, 810円

＊当期末の計算口数当りの純資産額は13, 437円です。

■損益の状況

当期　自 2022年12月 1 日　至 2023年11月30日

項　　目		当　期
（A）配当等収益		**773, 483, 546円**
受取利息		773, 689, 341
支払利息	△	205, 795
（B）有価証券売買損益	△	**2, 013, 639, 330**
売買益		167, 943, 130
売買損	△	2, 181, 582, 460
（C）当期損益金（A＋B）	△	**1, 240, 155, 784**
（D）前期繰越損益金		**29, 934, 212, 946**
（E）解約差損益金	△	**7, 421, 391, 288**
（F）追加信託差損益金		**7, 205, 659, 734**
（G）合計（C＋D＋E＋F）		**28, 478, 325, 608**
次期繰越損益金（G）		**28, 478, 325, 608**

（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８期

（決算日　2024年６月17日）

（作成対象期間　2023年６月16日～2024年６月17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	純資産総額の10％以下
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をあげ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/

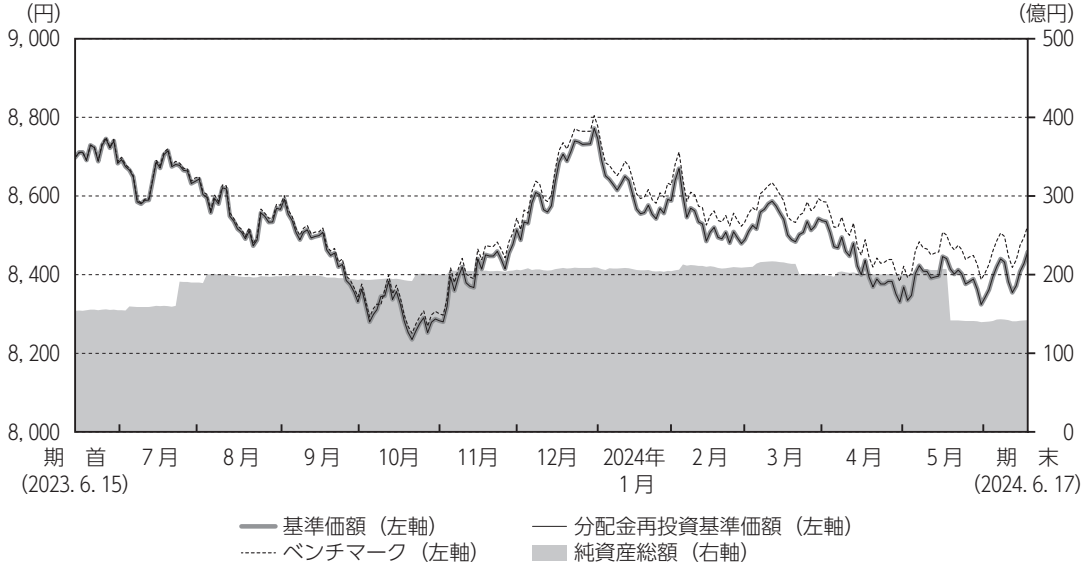
最近5期の運用実績

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
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
7期末(2023年6月15日)	8,698	0	△ 4.6	9,092	△ 4.2	98.0	1.6	15,393
8期末(2024年6月17日)	8,458	0	△ 2.8	8,911	△ 2.0	96.4	1.7	14,214

（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、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。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：8,698円
期　末：8,458円（分配金 0 円）
騰落率：△2.8%（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、主に為替ヘッジコストなどの要因から、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。

年　月　日	基準価額		FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率		
	円	%		%	%	%
（期首）2023年６月15日	8,698	—	9,092	—	98.0	1.6
６月末	8,683	△ 0.2	9,081	△ 0.1	101.1	1.6
７月末	8,637	△ 0.7	9,038	△ 0.6	95.2	1.5
８月末	8,566	△ 1.5	8,965	△ 1.4	99.0	1.5
９月末	8,331	△ 4.2	8,722	△ 4.1	98.4	1.6
10月末	8,283	△ 4.8	8,677	△ 4.6	96.9	1.5
11月末	8,514	△ 2.1	8,931	△ 1.8	95.9	1.5
12月末	8,747	0.6	9,176	0.9	93.8	1.5
2024年１月末	8,588	△ 1.3	9,020	△ 0.8	100.3	1.5
２月末	8,489	△ 2.4	8,921	△ 1.9	99.5	1.6
３月末	8,537	△ 1.9	8,976	△ 1.3	96.6	1.5
４月末	8,369	△ 3.8	8,803	△ 3.2	99.8	1.6
５月末	8,342	△ 4.1	8,786	△ 3.4	97.0	1.7
（期末）2024年６月17日	8,458	△ 2.8	8,911	△ 2.0	96.4	1.7

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■海外債券市況

主要国の国債金利は、国によってまちまちな動きとなりました。

主要国の国債金利は、当作成期首より2023年10月にかけて、経済指標の上振れや金融引き締めの長期化が意識されたことなどを背景に、上昇（債券価格は下落）基調で推移しました。11月から12月にかけては、経済指標が軟調となったことを受けて利上げサイクルの終了が意識されたことにより、金利は低下（債券価格は上昇）しました。2024年１月から当作成期末にかけては、市場予想を上回る経済指標などを受けて過度な利下げ織り込みが後退したことで、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。

ポートフォリオについて （2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■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。

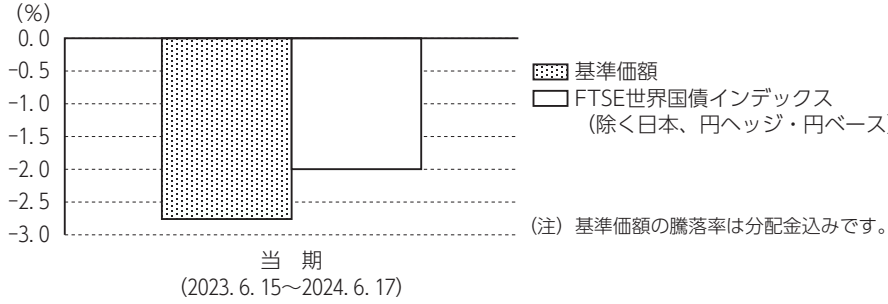
組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）

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△2. 0％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△2. 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 2023年６月16日 ～2024年６月17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）	1,343

（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。
（注４）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。

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

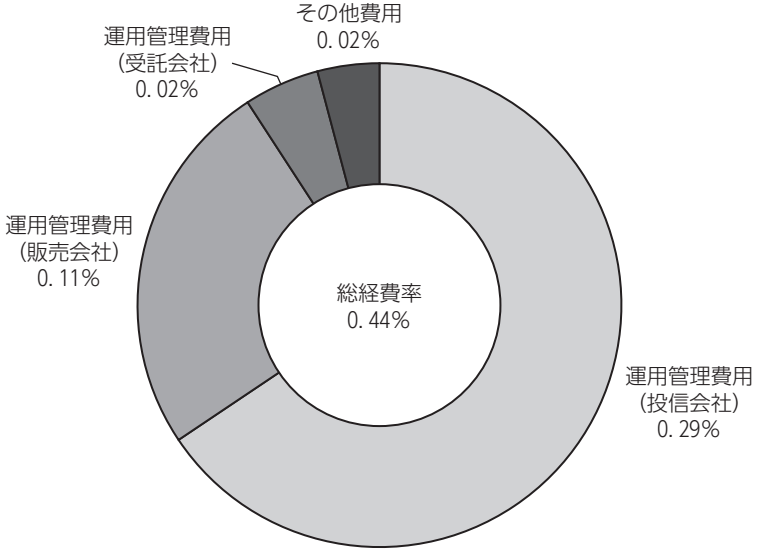
項　　目	当　期 (2023. 6. 16～2024. 6. 17)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	36円	0. 420%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は8, 506円です。**
（投 信 会 社）	(24)	(0. 287)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(9)	(0. 111)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(2)	(0. 022)	受託会社分は、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. 009)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0. 008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ　の　他）	(0)	(0. 001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	37	0. 438	

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

参考情報

■総経費率

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



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

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2023年６月16日から2024年６月17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, 462, 787	9, 727, 051	12, 430, 812	10, 449, 297

（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	17, 824, 777	16, 856, 752	14, 173, 157

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年６月17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	14, 173, 157	99. 4
コール・ローン等、その他	83, 474	0. 6
投資信託財産総額	14, 256, 631	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17日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝157. 53円、１カナダ・ドル＝114. 69円、１オーストラリア・ドル＝104. 17円、１シンガポール・ドル＝116. 47円、１ニュージーランド・ドル＝96. 66円、１イギリス・ポンド＝199. 87円、１イスラエル・シュケル＝42. 35円、１デンマーク・クローネ＝22. 60円、１ノルウェー・クローネ＝14. 77円、１スウェーデン・クローネ＝14. 97円、１メキシコ・ペソ＝8. 51円、１オフショア・人民元＝21. 658円、１マレーシア・リンギット＝33. 352円、１南アフリカ・ランド＝8. 58円、１ポーランド・ズロチ＝38. 519円、１ユーロ＝168. 64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（125, 543, 397千円）の投資信託財産総額（127, 198, 324千円）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

2024年６月17日現在

項目	当期末
（A）資産	**14, 256, 631, 649円**
コール・ローン等	83, 474, 116
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）	14, 173, 157, 533
（B）負債	**42, 357, 172**
未払信託報酬	41, 537, 450
その他未払費用	819, 722
（C）純資産総額（A－B）	**14, 214, 274, 477**
元本	16, 805, 681, 010
次期繰越損益金	△ 2, 591, 406, 533
（D）受益権総口数	**16, 805, 681, 010口**
１万口当り基準価額（C／D）	**8, 458円**

＊期首における元本額は17, 697, 664, 507円、当作成期間中における追加設定元本額は11, 562, 078, 814円、同解約元本額は12, 454, 062, 311円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は8, 458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2, 591, 406, 533円です。

■損益の状況

当期　自 2023年６月16日　至 2024年６月17日

項　　目	当　　期
（Ａ）配当等収益	**4, 555円**
受取利息	18, 988
支払利息	△ 14, 433
（Ｂ）有価証券売買損益	**△ 220, 438, 396**
売買益	177, 734, 753
売買損	△ 398, 173, 149
（Ｃ）信託報酬等	**△ 82, 823, 366**
（Ｄ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	**△ 303, 257, 207**
（Ｅ）前期繰越損益金	**△ 1, 298, 752, 866**
（Ｆ）追加信託差損益金	**△ 989, 396, 460**
（配当等相当額）	(1, 715, 628, 467)
（売買損益相当額）	(△ 2, 705, 024, 927)
（Ｇ）合計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	**△ 2, 591, 406, 533**
次期繰越損益金（Ｇ）	**△ 2, 591, 406, 533**
追加信託差損益金	△ 989, 396, 460
（配当等相当額）	(1, 715, 628, 467)
（売買損益相当額）	(△ 2, 705, 024, 927)
分配準備積立金	542, 673, 238
繰越損益金	△ 2, 144, 683, 311

（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	301, 120, 409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, 715, 628, 467
（ｄ）分配準備積立金	241, 552, 829
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	2, 258, 301, 705
（ｆ）分配金	0
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	2, 258, 301, 705
（ｈ）受益権総口数	16, 805, 681, 010口

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

運用報告書　第８期　（決算日　2024年６月17日）

（作成対象期間　2023年６月16日～2024年６月17日）

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

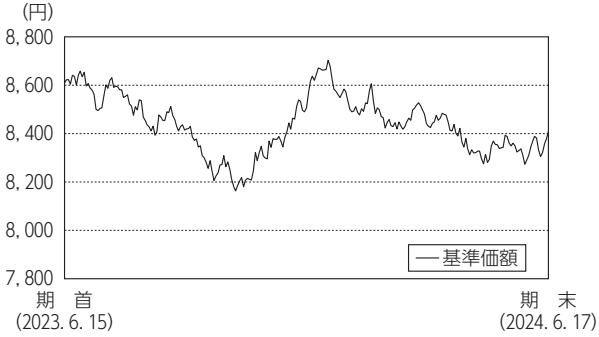
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年　月　日	基準価額		FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首) 2023年6月15日	8,610	—	8,666	—	98.3	1.6
6月末	8,597	△ 0.2	8,656	△ 0.1	101.4	1.6
7月末	8,554	△ 0.7	8,614	△ 0.6	95.5	1.5
8月末	8,487	△ 1.4	8,545	△ 1.4	99.3	1.5
9月末	8,256	△ 4.1	8,313	△ 4.1	98.7	1.6
10月末	8,211	△ 4.6	8,271	△ 4.6	97.2	1.5
11月末	8,444	△ 1.9	8,512	△ 1.8	96.2	1.5
12月末	8,679	0.8	8,746	0.9	94.1	1.5
2024年1月末	8,524	△ 1.0	8,597	△ 0.8	100.6	1.5
2月末	8,428	△ 2.1	8,503	△ 1.9	99.8	1.6
3月末	8,479	△ 1.5	8,555	△ 1.3	96.9	1.6
4月末	8,314	△ 3.4	8,391	△ 3.2	100.1	1.6
5月末	8,291	△ 3.7	8,374	△ 3.4	97.3	1.7
(期末) 2024年6月17日	8,408	△ 2.3	8,493	△ 2.0	96.6	1.7

（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、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。FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
（注3）海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
（注4）指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
（注5）公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。
（注6）債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：8,610円　期末：8,408円　騰落率：△2.3%

【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、主に為替ヘッジコストなどの要因から、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外債券市況

主要国の国債金利は、国によってまちまちな動きとなりました。

主要国の国債金利は、当作成期首より2023年10月にかけて、経済指標の上振れや金融引き締めの長期化が意識されたことなどを背景に、上昇（債券価格は下落）基調で推移しました。11月から12月にかけては、経済指標が軟調となったことを受けて利上げサイクルの終了が意識されたことにより、金利は低下（債券価格は上昇）しました。2024年1月から当作成期末にかけては、市場予想を上回る経済指標などを受けて過度な利下げ織り込みが後退したことで、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。

◆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△2.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△2.3%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。

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

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

■売買および取引の状況

(1)公　社　債

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 146,245	千アメリカ・ドル 199,326 (　—)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 5,394	千カナダ・ドル 7,344 (　—)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 975	千オーストラリア・ドル 5,671 (　—)
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル —	千シンガポール・ドル 148 (　—)
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 422	千ニュージーランド・ドル — (　—)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 11,571	千イギリス・ポンド 12,035 (　—)
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ —	千デンマーク・クローネ 6,721 (　—)
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ —	千ノルウェー・クローネ 146 (　—)
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローネ —	千スウェーデン・クローネ 3,792 (　—)
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 9,084	千メキシコ・ペソ 33,361 (　—)
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 327,878	千オフショア・人民元 110,097 (　—)
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 740	千マレーシア・リンギット 4,836 (　—)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 3,210	千ポーランド・ズロチ 1,945 (　—)
	ユーロ (アイルランド)	国債証券	千ユーロ 418	千ユーロ 1,671 (　—)
	ユーロ (オランダ)	国債証券	千ユーロ 2,204	千ユーロ 3,505 (　—)
	ユーロ (ベルギー)	国債証券	千ユーロ 5,252	千ユーロ 7,740 (　—)
	ユーロ (フランス)	国債証券	千ユーロ 20,446	千ユーロ 29,453 (　—)
	ユーロ (ドイツ)	国債証券	千ユーロ 15,368	千ユーロ 22,729 (　—)
	ユーロ (スペイン)	国債証券	千ユーロ 9,449	千ユーロ 17,386 (　—)
	ユーロ (イタリア)	国債証券	千ユーロ 16,748	千ユーロ 26,604 (　—)
	ユーロ (フィンランド)	国債証券	千ユーロ 195	千ユーロ 425 (　—)
	ユーロ (オーストリア)	国債証券	千ユーロ 758	千ユーロ 2,325 (　—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	国債証券	千ユーロ 70,842	千ユーロ 111,840 (　—)

（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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	債券先物取引	百万円 8,065	百万円 8,030	百万円 —	百万円 —

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
公　社　債

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

当期			
買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）0.625% 2024/10/15	1,244,746	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2.5% 2025/1/31	2,332,705
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）5% 2025/10/31	1,175,254	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2.125% 2025/5/15	2,330,726
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）1.375% 2031/11/15	1,101,888	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2.125% 2024/7/31	1,781,605
United States Treasury Note/Bond（アメリカ）0.25% 2025/7/31	1,052,800	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2.25% 2024/11/15	1,780,072
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）4% 2028/6/30	1,015,484	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2% 2025/8/15	1,393,086
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）0.625% 2026/7/31	1,007,969	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）1.375% 2031/11/15	1,298,217
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）4.375% 2028/11/30	907,179	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）0.625% 2024/10/15	1,264,800
FRENCH GOVERNMENT BOND（フランス） 2032/5/25	830,781	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2.25% 2025/11/15	1,212,653
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）4.875% 2025/11/30	781,389	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）1.625% 2026/2/15	1,191,906
United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2% 2025/2/15	768,180	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2.625% 2029/2/15	1,191,122

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

■組入資産明細表
(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

作成期	当期末							
区分	額面金額	評価額		組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
アメリカ	千アメリカ・ドル 402,047	千アメリカ・ドル 361,530	千円 56,951,873	% 44.9	% —	% 19.9	% 18.1	% 6.9
カナダ	千カナダ・ドル 24,039	千カナダ・ドル 22,522	2,583,058	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 17,218	千オーストラリア・ドル 15,439	1,608,375	1.3	—	0.8	0.2	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 5,442	千シンガポール・ドル 5,133	597,908	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 3,300	千ニュージーランド・ドル 2,949	285,100	0.2	—	0.1	0.1	—
イギリス	千イギリス・ポンド 38,872	千イギリス・ポンド 32,933	6,582,432	5.2	—	3.6	1.3	0.2
イスラエル	千イスラエル・シュケル 10,600	千イスラエル・シュケル 9,377	397,122	0.3	—	0.1	0.2	0.0
デンマーク	千デンマーク・クローネ 16,870	千デンマーク・クローネ 16,219	366,557	0.3	—	0.2	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 14,930	千ノルウェー・クローネ 13,730	202,803	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 17,350	千スウェーデン・クローネ 16,753	250,799	0.2	—	0.1	0.1	—
メキシコ	千メキシコ・ペソ 127,750	千メキシコ・ペソ 112,054	953,684	0.8	—	0.4	0.2	0.1
中国	千オフショア・人民元 544,200	千オフショア・人民元 567,426	12,289,312	9.7	—	4.4	3.5	1.8
マレーシア	千マレーシア・リンギット 19,130	千マレーシア・リンギット 19,646	655,260	0.5	—	0.4	0.1	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 18,085	千ポーランド・ズロチ 16,726	644,286	0.5	—	0.2	0.3	0.1

作成期	当期末							
区分	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千ユーロ	千ユーロ	千円	%	%	%	%	%
ユーロ（アイルランド）	4,260	3,818	643,951	0.5	—	0.4	0.0	0.1
ユーロ（オランダ）	11,730	11,001	1,855,233	1.5	—	1.0	0.4	0.1
ユーロ（ベルギー）	13,250	12,257	2,067,144	1.6	—	1.1	0.3	0.2
ユーロ（フランス）	62,335	57,105	9,630,294	7.6	—	4.1	2.4	1.1
ユーロ（ドイツ）	46,413	44,761	7,548,576	6.0	—	3.4	1.9	0.7
ユーロ（スペイン）	35,120	33,211	5,600,805	4.4	—	2.6	1.3	0.4
ユーロ（イタリア）	53,453	51,808	8,737,045	6.9	—	4.1	2.1	0.7
ユーロ（フィンランド）	4,710	4,105	692,286	0.5	—	0.2	0.2	0.2
ユーロ（オーストリア）	9,720	8,657	1,460,072	1.2	—	0.7	0.4	0.1
ユーロ（小計）	240,991	226,728	38,235,410	30.1	—	17.6	9.0	3.5
合計	—	—	122,603,987	96.6	—	49.2	33.9	13.5

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

(2) 外国（外貨建）公社債（銘柄別）

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	7,950	8,398	1,322,971	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	3,700	3,848	606,192	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	1,400	1,547	243,731	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	630	675	106,457	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	2,000	2,069	326,011	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	300	324	51,118	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	430	395	62,285	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,410	1,425	224,480	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,390	1,443	227,357	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	770	807	127,281	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	600	554	87,350	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	670	563	88,785	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,500	1,182	186,257	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,000	785	123,703	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,000	1,658	261,250	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	1,988	313,319	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,100	978	154,147	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,532	1,385	218,322	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,000	887	139,751	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	1,200	1,023	161,247	2044/05/15

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	940	769	121,233	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,100	805	126,841	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	370	295	46,476	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,820	4,658	733,903	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	800	623	98,165	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,500	4,339	683,570	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,500	3,323	523,566	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	300	217	34,247	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,865	6,482	1,021,109	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,070	772	121,769	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,750	5,383	848,016	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	500	343	54,080	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	12,850	12,103	1,906,671	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,000	772	121,673	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,000	4,720	743,675	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	900	709	111,775	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,550	5,236	824,937	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	950	747	117,828	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	14,000	13,112	2,065,552	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,000	750	118,251	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	700	524	82,624	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	4,000	3,783	596,011	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,000	783	123,494	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,000	801	126,276	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,300	3,128	492,868	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	3,782	595,904	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,800	1,408	221,869	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,300	4,100	645,887	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	1,850	1,548	244,003	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,500	6,052	953,466	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,500	1,172	184,723	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,000	957	150,846	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	1,525	240,318	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,300	2,111	332,561	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,500	4,259	671,030	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,000	4,406	694,171	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,500	1,003	158,038	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,400	4,765	750,768	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,300	893	140,683	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,500	3,887	612,434	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	6,000	5,558	875,652	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	1,572	247,723	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	3,000	2,441	384,650	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,000	1,030	162,277	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	500	316	49,824	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,910	300,970	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,856	450,023	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	8,000	7,591	1,195,816	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	2,800	2,259	355,985	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,200	637	100,410	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	500	313	49,338	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,884	296,808	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,890	297,797	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	5,000	4,075	642,052	2030/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	800	454	71,560	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,000	649	102,331	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	4,500	3,964	624,520	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,737	588,790	2025/12/31

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	3,300	2,904	457,617	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,211	190,768	2051/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	4,900	4,043	636,961	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,000	1,862	293,427	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,000	890	140,332	2028/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,400	1,687	265,860	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,000	930	146,622	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,500	4,911	773,777	2028/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,600	3,895	613,645	2031/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,673	421,186	2028/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,400	1,636	257,765	2051/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,600	1,189	187,317	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,000	889	140,127	2028/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,500	1,331	209,697	2028/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	3,500	3,246	511,475	2026/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,700	3,849	606,483	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	2,400	1,494	235,429	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	5,750	3,907	615,534	2041/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	8,000	7,359	1,159,294	2026/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	2,000	1,752	276,105	2028/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	1,000	879	138,468	2028/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	2,400	2,208	347,826	2026/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	3,000	2,463	388,114	2031/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	3,100	1,868	294,299	2051/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	2,000	1,410	222,268	2041/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,697	582,514	2026/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	4,000	3,553	559,855	2028/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	900	763	120,321	2032/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	2,500	1,651	260,121	2052/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	1,000	747	117,715	2042/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	2,500	2,248	354,147	2029/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	1,500	1,401	220,713	2027/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	1,500	1,423	224,303	2027/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	5,300	4,827	760,510	2032/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	2,300	1,746	275,097	2052/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	1,000	851	134,213	2042/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	4,000	3,734	588,311	2029/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	1,500	1,450	228,461	2027/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	2,500	2,250	354,446	2032/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	2,000	1,558	245,444	2052/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	1,200	1,179	185,771	2029/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,000	2,974	468,629	2027/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	4,000	3,976	626,440	2032/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	2,000	1,883	296,726	2052/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,000	2,966	467,254	2029/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	700	687	108,314	2029/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	3,000	2,891	455,420	2030/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	4,000	3,793	597,542	2033/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	1,000	924	145,573	2043/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	1,800	1,583	249,414	2053/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	1,500	1,453	229,019	2030/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.3750	4,500	4,220	664,877	2033/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	1,800	1,583	249,442	2053/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,307	363,468	2043/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	1,000	988	155,732	2028/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,000	1,947	306,843	2033/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	1,900	1,828	288,082	2053/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	1,500	1,480	233,275	2043/08/15

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	1,700	1,679	264,592	2030/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	5.0000	8,000	8,007	1,261,386	2025/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	4,500	4,598	724,331	2033/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.7500	2,100	2,244	353,579	2053/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.8750	5,000	4,999	787,634	2025/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	4,000	4,034	635,620	2030/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	6,000	6,025	949,215	2028/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	2,000	1,966	309,814	2034/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	1,300	1,279	201,555	2054/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	1,700	1,722	271,376	2034/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	1,700	1,742	274,453	2031/04/30
通貨小計 銘柄数	147銘柄						
通貨小計 金額				402,047	361,530	56,951,873	
				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	460	417	47,864	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	907	1,010	115,948	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	300	353	40,539	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	620	675	77,523	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	140	144	16,613	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	500	458	52,583	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,492	1,464	167,950	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,920	1,839	211,004	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	930	866	99,380	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	571	65,521	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,520	1,178	135,146	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	300	287	32,923	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,700	1,517	174,019	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	862	98,935	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,000	1,783	204,551	2031/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,250	901	103,378	2053/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,500	1,411	161,929	2027/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,000	884	101,458	2031/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	500	456	52,319	2032/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,000	944	108,314	2032/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,500	1,505	172,693	2028/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,500	1,488	170,748	2025/08/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,500	1,497	171,709	2033/12/01
通貨小計 銘柄数	23銘柄						
通貨小計 金額				24,039	22,522	2,583,058	
				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	889	911	94,928	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	320	311	32,454	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	359	369	38,539	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,398	2,412	251,295	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	725	691	72,019	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	800	701	73,034	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	184	162	16,925	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	658	620	64,665	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	775	608	63,405	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,250	1,195	124,554	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,000	926	96,489	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	510	409	42,644	2041/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,800	1,529	159,318	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	850	690	71,898	2032/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	900	512	53,339	2051/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	1,503	156,597	2032/11/21
	AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.0000	1,000	914	95,229	2033/11/21

区分		当期末 銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
		AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.7500	1,000	969	101,035	2034/05/21
通貨小計	銘柄数	18銘柄						
	金額				17,218	15,439	1,608,375	
					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	203	204	23,794	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	600	589	68,694	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	239	226	26,402	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	420	426	49,700	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	500	493	57,431	2029/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	400	395	46,066	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	300	281	32,754	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	200	195	22,739	2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	660	599	69,875	2036/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	350	274	32,020	2050/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	400	361	42,078	2031/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	170	131	15,339	2051/10/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	1,000	953	111,011	2026/11/01
通貨小計	銘柄数	13銘柄						
	金額				5,442	5,133	597,908	
					千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル		
ニュージーランド		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,000	997	96,423	2027/04/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	300	276	26,768	2033/04/14
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	300	242	23,449	2037/04/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	500	468	45,278	2029/04/20
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	500	411	39,804	2031/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	500	416	40,219	2032/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	200	136	13,156	2051/05/15
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金額				3,300	2,949	285,100	
					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,350	1,308	261,473	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	810	520	104,106	2065/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,775	1,679	335,661	2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	650	372	74,351	2047/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	820	617	123,390	2037/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	900	484	96,827	2057/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	650	597	119,485	2027/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	800	727	145,446	2028/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	517	242	48,390	2071/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	200	118	23,754	2049/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	350	185	37,072	2054/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	800	685	136,938	2029/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	300	186	37,300	2041/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	400	321	64,312	2030/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	850	261	52,201	2061/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	500	435	87,037	2028/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	370	151	30,360	2050/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	950	657	131,345	2035/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	1,700	1,317	263,389	2031/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	500	252	50,480	2046/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	1,000	915	182,939	2026/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,200	595	118,986	2051/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.5000	1,000	856	171,122	2029/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.8750	500	381	76,189	2033/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	200	103	20,680	2053/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.0000	500	404	80,752	2032/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	400	149	29,815	2073/10/22

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 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.1250	1,100	1,094	218,691	2027/01/29
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.7500	800	757	151,469	2038/01/29
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.2500	1,900	1,798	359,447	2033/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.7500	700	603	120,671	2053/10/22
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.0000	600	547	109,428	2063/10/22
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.5000	800	811	162,233	2028/06/07
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.7500	700	723	144,539	2043/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	963	1,043	208,507	2028/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,200	1,227	245,276	2032/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	915	924	184,691	2036/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	550	577	115,336	2038/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	850	813	162,635	2055/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	770	742	148,368	2046/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	300	301	60,332	2027/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	911	917	183,465	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	907	950	190,004	2030/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	543	521	104,182	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	330	326	65,304	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	600	621	124,139	2034/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	527	483	96,730	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,000	984	196,807	2040/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	700	615	123,072	2052/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	875	736	147,114	2044/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	338	281	56,164	2068/07/22
通貨小計	銘柄数	51銘柄						
	金額				38,872	32,933	6,582,432	
					千イスラエル・シュケル	千イスラエル・シュケル		
イスラエル		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,200	1,241	52,559	2042/01/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	500	484	20,535	2025/08/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	4,000	3,742	158,510	2027/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	1,200	947	40,133	2047/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,000	909	38,530	2028/09/28
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	1,700	1,384	58,643	2030/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,000	666	28,210	2037/05/31
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金額				10,600	9,377	397,122	
					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
デンマーク		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	4,740	5,883	132,970	2039/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,830	2,787	63,000	2025/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,200	2,998	67,768	2027/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,544	34,913	2029/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	1,316	29,749	2052/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,688	38,154	2031/11/15
通貨小計	銘柄数	6銘柄						
	金額				16,870	16,219	366,557	
					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
ノルウェー		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,430	1,375	20,322	2026/02/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,000	2,862	42,274	2027/02/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,000	1,895	27,995	2028/04/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,000	1,840	27,191	2029/09/06
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	2,500	2,216	32,740	2030/08/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,000	1,722	25,436	2031/09/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1250	2,000	1,817	26,843	2032/05/18
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金額				14,930	13,730	202,803	

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ	千円	
スウェーデン		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,520	2,922	43,752	2039/03/30
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,780	4,622	69,191	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,550	2,412	36,120	2028/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	500	504	7,547	2032/06/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,000	2,796	41,869	2029/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	4,000	3,494	52,318	2031/05/12
通貨小計	銘柄数	6銘柄						
	金額				17,350	16,753	250,799	
					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	24,200	22,331	190,057	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	11,450	9,264	78,853	2047/11/07
		MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	10,000	7,975	67,879	2053/07/31
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	20,800	19,238	163,733	2027/06/03
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	2,750	2,733	23,261	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,500	6,089	51,828	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	5,000	4,383	37,304	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,700	20,045	170,604	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	14,050	11,252	95,765	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,300	8,741	74,395	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	10銘柄						
	金額				127,750	112,054	953,684	
					千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		
中国		China Government Bond	国債証券	3.2200	3,000	3,069	66,489	2025/12/06
		China Government Bond	国債証券	3.2500	6,500	6,865	148,685	2028/11/22
		China Government Bond	国債証券	3.2900	11,000	11,693	253,268	2029/05/23
		China Government Bond	国債証券	3.2500	15,000	15,459	334,817	2026/06/06
		China Government Bond	国債証券	3.1200	3,000	3,096	67,066	2026/12/05
		China Government Bond	国債証券	3.1300	5,300	5,593	121,150	2029/11/21
		China Government Bond	国債証券	2.8500	8,000	8,221	178,063	2027/06/04
		China Government Bond	国債証券	2.6800	10,000	10,282	222,687	2030/05/21
		China Government Bond	国債証券	3.0200	13,000	13,239	286,734	2025/10/22
		China Government Bond	国債証券	3.2800	14,000	14,674	317,820	2027/12/03
		China Government Bond	国債証券	3.2700	18,000	19,280	417,569	2030/11/19
		China Government Bond	国債証券	3.0300	20,000	20,450	442,906	2026/03/11
		China Government Bond	国債証券	3.8100	7,000	8,652	187,394	2050/09/14
		China Government Bond	国債証券	3.0100	8,000	8,315	180,099	2028/05/13
		China Government Bond	国債証券	3.7200	7,000	8,556	185,315	2051/04/12
		China Government Bond	国債証券	3.0200	8,800	9,273	200,851	2031/05/27
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	5,000	5,091	110,276	2026/08/12
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	7,000	7,151	154,882	2026/05/05
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7400	13,000	13,256	287,117	2026/08/04
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5900	6,500	6,876	148,935	2027/08/03
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	6,000	6,440	139,486	2028/05/17
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0800	4,400	5,619	121,717	2048/10/22
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8600	6,000	7,438	161,093	2049/07/22
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	8,800	10,156	219,971	2050/03/16
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	3,500	3,626	78,544	2028/10/14
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	3,300	3,919	84,885	2051/10/18
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	5,300	5,542	120,037	2031/11/18
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	12,000	12,144	263,032	2027/01/20
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	9,800	10,142	219,660	2032/02/17
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	4,000	4,131	89,480	2029/03/24
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	15,000	15,245	330,188	2027/04/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	5,000	5,740	124,337	2052/04/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	9,000	9,318	201,820	2032/05/15

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		当期末 銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,000	3,093	67,003	2029/06/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	12,000	12,199	264,220	2027/07/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	7,000	7,212	156,216	2032/08/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	15,000	15,087	326,754	2025/08/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	2,000	2,047	44,347	2032/09/01
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	13,000	13,327	288,654	2029/09/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	4,000	4,060	87,934	2027/10/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	4,000	4,440	96,169	2052/10/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	8,000	8,316	180,113	2032/11/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	14,000	14,113	305,674	2025/11/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	13,000	13,438	291,053	2029/12/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8800	4,000	4,187	90,698	2033/02/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	8,000	8,281	179,361	2030/03/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	4,000	4,086	88,507	2028/04/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	3,000	3,405	73,750	2053/04/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	9,000	9,265	200,670	2033/05/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	6,000	6,148	133,155	2030/06/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	20,000	20,269	438,998	2028/07/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5200	11,000	11,186	242,278	2033/08/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	15,000	15,106	327,186	2026/08/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2200	18,000	18,119	392,440	2025/09/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	3,000	3,070	66,506	2030/09/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	5,000	5,483	118,764	2053/10/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	15,000	15,310	331,585	2028/10/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	8,000	8,240	178,468	2033/11/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5400	8,000	8,166	176,864	2030/12/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	10,000	10,138	219,588	2029/01/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	5,000	5,019	108,716	2034/02/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	4,000	4,019	87,061	2031/03/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4900	2,000	2,018	43,714	2044/05/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2700	10,000	9,994	216,463	2034/05/25
通貨小計	銘柄数	64銘柄						
	金額				544,200	567,426	12,289,312	
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,760	1,829	61,029	2030/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,000	1,025	34,211	2031/06/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	1,950	1,968	65,644	2027/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,400	1,397	46,614	2033/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,500	1,506	50,231	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	700	771	25,722	2043/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	500	513	17,121	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	1,420	1,530	51,041	2046/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	500	505	16,850	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,000	1,075	35,876	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	1,600	1,749	58,360	2038/06/08
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	1,500	1,513	50,495	2026/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,200	1,212	40,431	2029/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,295	43,193	2034/07/05
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	400	385	12,849	2040/05/22
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	1,400	1,366	45,586	2050/06/15
通貨小計	銘柄数	16銘柄						
	金額				19,130	19,646	655,260	
					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	2,640	2,499	96,292	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,815	1,670	64,330	2027/07/25

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	2,300	2,006	77,276	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.2500	1,800	1,390	53,545	2030/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.2500	900	803	30,937	2026/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,000	756	29,150	2032/04/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	2,000	2,145	82,645	2028/07/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,000	1,020	39,292	2033/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	600	604	23,282	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	1,800	1,638	63,102	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,230	2,191	84,429	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金額				18,085	16,726	644,286	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（アイルランド）		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	680	669	112,836	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	510	426	71,941	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	520	501	84,655	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	500	430	72,681	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	150	132	22,369	2033/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	1,100	1,008	170,057	2031/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	300	278	47,015	2029/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	100	71	12,093	2050/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	—	200	164	27,673	2031/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	200	134	22,626	2041/04/22
国小計	銘柄数	10銘柄						
	金額				4,260	3,818	643,951	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オランダ）		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	580	636	107,369	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	800	901	151,944	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,180	1,330	224,373	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	390	386	65,096	2033/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	910	907	153,046	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,670	1,595	268,989	2026/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	900	836	141,069	2028/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	623	105,098	2029/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	177	29,990	2040/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	750	642	108,318	2030/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	193	32,650	2052/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	584	98,591	2031/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	266	44,991	2029/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	478	80,625	2026/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,300	1,101	185,742	2032/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	400	339	57,335	2054/01/15
国小計	銘柄数	16銘柄						
	金額				11,730	11,001	1,855,233	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ベルギー）		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,000	974	164,395	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	300	264	44,671	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	460	390	65,876	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	95	91	15,403	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	500	356	60,121	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	300	221	37,398	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	730	687	115,867	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	310	237	40,010	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	400	325	54,897	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	500	435	73,451	2033/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	100	91	15,393	2029/06/22

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	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	償還年月日
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	350	245	41,466	2050/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	900	766	129,317	2030/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	600	384	64,876	2040/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	300	273	46,077	2027/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	400	325	54,828	2031/10/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	400	250	42,290	2053/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	500	469	79,168	2039/04/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	600	601	101,476	2033/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3000	400	384	64,908	2054/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,000	1,095	184,670	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	750	879	148,306	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	965	1,077	181,663	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	700	717	121,003	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	390	409	69,098	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	300	299	50,502	2034/06/22
国小計 銘柄数	26銘柄						
国小計 金額				13,250	12,257	2,067,144	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フランス）	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,715	2,811	474,203	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,000	2,224	375,078	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,600	3,107	523,999	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,210	1,382	233,160	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	732	793	133,861	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,265	1,360	229,425	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,143	1,302	219,650	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,000	1,096	184,933	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,410	2,392	403,540	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,340	1,299	219,125	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,600	1,456	245,558	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,400	3,239	546,347	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,650	1,329	224,179	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	800	514	86,764	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,370	1,282	216,220	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,000	815	137,534	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,200	2,079	350,728	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	500	380	64,182	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,000	2,759	465,335	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	1,514	255,457	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,750	2,504	422,350	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,350	897	151,294	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,000	1,780	300,226	2029/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,053	346,259	2029/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,100	570	96,146	2052/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,374	400,511	2026/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	649	109,529	2040/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,489	419,893	2030/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	200	74	12,534	2072/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	1,286	216,871	2031/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	462	77,911	2027/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,000	506	85,392	2053/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	869	146,607	2032/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,000	769	129,726	2038/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,500	1,386	233,803	2028/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,500	1,384	233,540	2032/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,000	866	146,205	2043/05/25

区分		当期末 銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	800	719	121,368	2054/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,000	988	166,692	2026/09/24
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,200	1,236	208,594	2033/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	100	92	15,543	2049/06/25
国小計	銘柄数	41銘柄						
	金額				62,335	57,105	9,630,294	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ドイツ）		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	455	507	85,543	2027/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	800	885	149,320	2028/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	800	871	147,016	2028/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,296	1,555	262,334	2030/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,000	2,377	400,982	2031/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,270	1,537	259,363	2034/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,390	1,618	273,012	2037/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,020	1,239	208,950	2039/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,310	1,691	285,263	2040/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	656	722	121,773	2042/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,098	1,089	183,777	2044/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	775	770	129,918	2046/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,319	559,867	2025/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	883	850	143,363	2026/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,350	1,276	215,194	2026/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,000	941	158,842	2027/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,100	2,917	491,944	2027/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,160	896	151,128	2048/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,050	980	165,395	2028/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,000	917	154,737	2028/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,800	1,637	276,098	2029/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	444	74,978	2029/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	841	141,992	2050/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	615	103,860	2030/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	231	39,067	2035/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	602	101,653	2031/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	150	25,336	2036/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,354	228,395	2028/11/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	211	35,651	2050/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	851	143,645	2031/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,261	212,807	2032/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	1,100	1,051	177,390	2032/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	800	683	115,289	2053/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	1,000	987	166,584	2029/11/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	2,000	1,997	336,892	2033/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	400	342	57,761	2053/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	800	789	133,135	2034/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	400	399	67,295	2054/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	452	76,340	2052/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	952	160,590	2026/04/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	941	158,840	2026/10/09
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,000	991	167,240	2028/04/13
国小計	銘柄数	42銘柄						
	金額				46,413	44,761	7,548,576	
					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	1,607	271,014	2029/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	910	858	144,839	2030/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,400	1,371	231,343	2026/04/30

区分		当期末 銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,100	961	162,193	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,480	1,345	226,982	2066/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,000	961	162,160	2026/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,100	2,016	339,995	2027/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	820	765	129,108	2033/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,170	1,114	187,999	2027/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	650	614	103,556	2028/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,050	873	147,327	2048/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	747	125,995	2029/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	400	344	58,170	2035/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	900	796	134,277	2029/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	869	146,575	2030/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	100	54	9,181	2050/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	1,620	273,303	2030/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	150	105	17,756	2040/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	800	657	110,872	2031/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	200	98	16,562	2071/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,800	303,555	2028/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	900	652	109,972	2037/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	500	326	55,047	2042/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	1,000	835	140,817	2032/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	1,400	1,258	212,162	2029/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	600	574	96,830	2032/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	600	576	97,298	2043/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1500	1,500	1,495	252,125	2033/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,500	1,491	251,571	2026/05/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,000	996	168,130	2034/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	680	807	136,172	2032/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	900	969	163,467	2037/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	800	922	155,587	2040/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	500	566	95,612	2041/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	500	507	85,531	2025/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,000	1,057	178,308	2026/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	490	589	99,399	2044/10/31
国小計	銘柄数	37銘柄						
	金額				35,120	33,211	5,600,805	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（イタリア）		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	2,700	2,938	495,533	2026/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,135	1,249	210,694	2027/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	905	777	131,040	2046/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,500	1,303	219,812	2032/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	900	882	148,763	2025/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	300	233	39,392	2047/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	450	375	63,372	2036/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	500	363	61,319	2067/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,200	1,079	182,080	2033/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,700	1,646	277,734	2027/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	950	835	140,978	2048/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,050	1,973	332,747	2027/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	700	614	103,656	2038/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,500	1,432	241,579	2028/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	900	879	148,356	2028/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,300	1,283	216,511	2025/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	700	666	112,358	2035/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	500	466	78,684	2049/09/01

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	1,400	1,365	230,240	2026/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	500	439	74,090	2040/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	500	444	74,992	2030/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	250	179	30,309	2050/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	500	383	64,719	2036/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	500	429	72,475	2030/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	600	534	90,164	2030/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	954	160,916	2026/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	700	502	84,699	2041/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,000	840	141,821	2031/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	400	242	40,823	2051/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	200	139	23,571	2037/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	700	441	74,385	2045/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	450	273	46,142	2072/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	300	248	41,889	2031/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	300	244	41,264	2032/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	500	437	73,760	2029/02/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	200	131	22,229	2052/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	500	485	81,944	2029/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	700	639	107,904	2032/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	400	365	61,567	2038/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,200	1,212	204,417	2035/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	600	629	106,121	2033/05/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,500	1,527	257,659	2029/12/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4000	1,300	1,302	219,582	2028/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	500	510	86,150	2053/10/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,000	1,006	169,790	2026/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7000	500	504	85,083	2030/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.3500	500	521	87,901	2033/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,200	1,193	201,301	2031/02/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	1,840	2,004	338,103	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	1,488	1,709	288,290	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,300	1,489	251,160	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,650	1,807	304,776	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	1,270	1,275	215,050	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,140	1,245	210,034	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,000	1,017	171,635	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,080	2,191	369,530	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	525	559	94,301	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,370	1,373	231,621	2030/03/01
国小計 銘柄数	58銘柄						
国小計 金額				53,453	51,808	8,737,045	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フィンランド）	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	190	165	27,951	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	800	778	131,211	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	180	172	29,042	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	270	194	32,848	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	200	185	31,340	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	150	126	21,373	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	454	76,625	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	266	44,974	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	350	248	41,987	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	150	95	16,119	2040/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	200	92	15,635	2052/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	200	164	27,777	2031/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	374	63,223	2026/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	300	269	45,420	2032/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	200	192	32,526	2055/04/15

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		当期末 銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	200	201	34,004	2025/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	120	119	20,223	2028/07/04
国小計	銘柄数	17銘柄						
	金額				4,710	4,105	692,286	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オーストリア）		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	490	467	78,771	2026/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	270	199	33,627	2047/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	280	170	28,724	2086/11/02
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,000	937	158,172	2027/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	200	151	25,480	2117/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	558	94,106	2028/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	700	631	106,484	2029/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	450	384	64,891	2030/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	348	58,719	2051/03/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.8500	100	45	7,752	2120/06/30
		Austria Government Bond	国債証券	—	1,000	828	139,692	2031/02/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	200	142	24,072	2036/10/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	150	68	11,468	2071/04/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	200	156	26,366	2049/05/23
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	800	797	134,511	2033/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	380	417	70,489	2027/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	300	333	56,293	2037/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	700	722	121,915	2026/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	170	195	32,902	2062/01/26
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	500	501	84,522	2044/06/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	630	599	101,107	2034/05/23
国小計	銘柄数	21銘柄						
	金額				9,720	8,657	1,460,072	
通貨小計	銘柄数	268銘柄						
	金額				240,991	226,728	38,235,410	
合計	銘柄数	654銘柄						
	金額						122,603,987	

（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	当期末 売建額
		百万円	百万円
外国	US LONG BOND (CBT)（アメリカ）	37	—
	US 10YR NOTE (CBT)（アメリカ）	174	—
	US 5YR NOTE (CBT)（アメリカ）	252	—
	US 2YR NOTE (CBT)（アメリカ）	1,289	—
	US ULTRA BOND CBT（アメリカ）	223	—
	EURO-SCHATZ FUT（ドイツ）	89	—
	EURO-OAT FUTURE（ドイツ）	62	—

（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

2024年６月17日現在

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　　率
	千円	%
公社債	122, 603, 987	96. 4
コール・ローン等、その他	4, 594, 337	3. 6
投資信託財産総額	127, 198, 324	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17日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝157. 53円、１カナダ・ドル＝114. 69円、１オーストラリア・ドル＝104. 17円、１シンガポール・ドル＝116. 47円、１ニュージーランド・ドル＝96. 66円、１イギリス・ポンド＝199. 87円、１イスラエル・シュケル＝42. 35円、１デンマーク・クローネ＝22. 60円、１ノルウェー・クローネ＝14. 77円、１スウェーデン・クローネ＝14. 97円、１メキシコ・ペソ＝8. 51円、１オフショア・人民元＝21. 658円、１マレーシア・リンギット＝33. 352円、１南アフリカ・ランド＝8. 58円、１ポーランド・ズロチ＝38. 519円、１ユーロ＝168. 64円です。
（注３）当期末における外貨建純資産（125, 543, 397千円）の投資信託財産総額（127, 198, 324千円）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

2024年６月17日現在

項　　目		当　期　末
（Ａ）資産		**250, 822, 917, 299円**
コール・ローン等		2, 900, 881, 009
公社債（評価額）		122, 603, 987, 234
未収入金		124, 172, 521, 959
未収利息		870, 695, 083
前払費用		43, 765, 372
差入委託証拠金		231, 066, 642
（Ｂ）負債		**123, 956, 348, 432**
未払金		123, 922, 911, 290
未払解約金		33, 437, 142
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）		**126, 866, 568, 867**
元本		150, 884, 982, 568
次期繰越損益金	△	24, 018, 413, 701
（Ｄ）受益権総口数		**150, 884, 982, 568口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）		**8, 408円**

＊期首における元本額は141, 933, 741, 025円、当作成期間中における追加設定元本額は40, 419, 718, 586円、同解約元本額は31, 468, 477, 043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：

ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用）	2, 345, 854, 351円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）	116, 437, 041, 046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, 599, 899, 537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）	18, 119, 568円
ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用）	3, 691, 729, 083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）	16, 856, 752, 538円
ダイワバランスファンド2023-08（適格機関投資家専用）	2, 338, 208, 341円
ダイワバランスファンド2024-01（適格機関投資家専用）	2, 268, 146, 411円
ダイワバランスファンド2024-05（適格機関投資家専用）	2, 329, 231, 693円

＊当期末の計算口数当りの純資産額は8, 408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24, 018, 413, 701円です。

■損益の状況

当期　自 2023年６月16日　至 2024年６月17日

項　　目		当　期
（Ａ）配当等収益		**3, 620, 920, 646円**
受取利息		3, 611, 127, 110
その他収益金		10, 148, 701
支払利息	△	355, 165
（Ｂ）有価証券売買損益	△	**6, 570, 547, 342**
売買益		25, 316, 476, 289
売買損	△	31, 887, 023, 631
（Ｃ）先物取引等損益	△	**55, 922, 825**
取引益		42, 413, 848
取引損	△	98, 336, 673
（Ｄ）その他費用	△	**12, 806, 465**
（Ｅ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ）	△	**3, 018, 355, 986**
（Ｆ）前期繰越損益金	△	**19, 727, 162, 305**
（Ｇ）解約差損益金		**4, 976, 168, 249**
（Ｈ）追加信託差損益金	△	**6, 249, 063, 659**
（Ｉ）合計（Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ）	△	**24, 018, 413, 701**
次期繰越損益金（Ｉ）	△	**24, 018, 413, 701**

（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（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）

運用報告書（全体版）

第８期

（決算日　2024年６月17日）

（作成対象期間　2023年６月16日～2024年６月17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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果をあげ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/

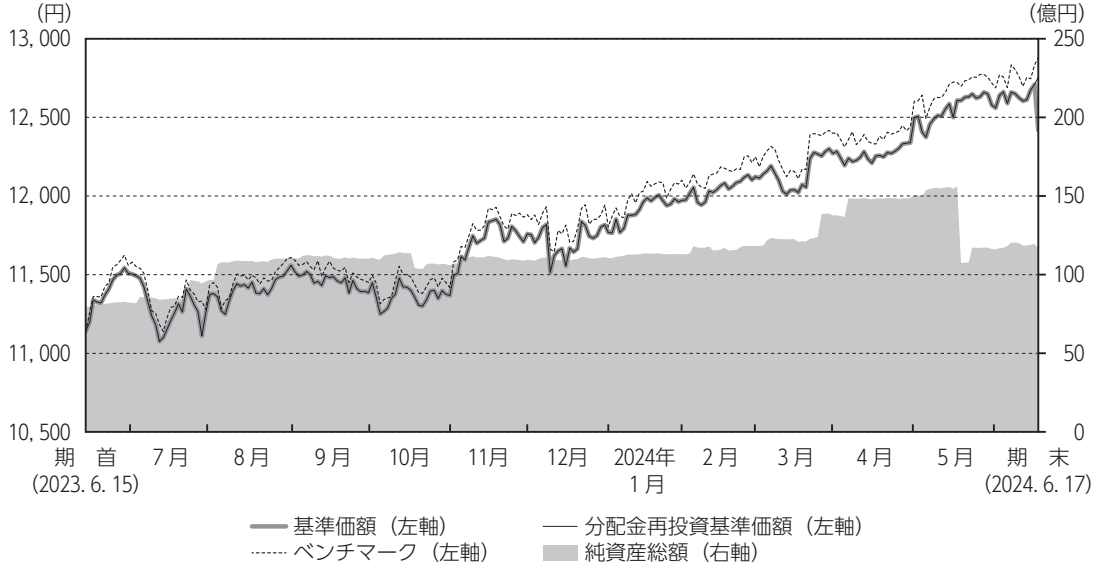
最近5期の運用実績

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
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
7 期末（2023年 6 月15日）	11, 139	310	4. 1	12, 179	4. 4	97. 6	—	7, 912
8 期末（2024年 6 月17日）	12, 417	340	14. 5	14, 082	15. 6	97. 7	—	11, 665

（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、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10, 000として大和アセットマネジメントが計算したものです。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：11,139円
期　末：12,417円（分配金340円）
騰落率：14.5%（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、主に為替相場で円安が進んだことから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年　月　日	基準価額		FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率		
	円	%		%	%	%
（期首）2023年６月15日	11,139	—	12,179	—	97.6	—
６月末	11,509	3.3	12,638	3.8	97.2	—
７月末	11,257	1.1	12,332	1.3	97.2	—
８月末	11,559	3.8	12,693	4.2	97.2	—
９月末	11,384	2.2	12,519	2.8	97.2	—
10月末	11,366	2.0	12,485	2.5	97.0	—
11月末	11,759	5.6	12,992	6.7	96.7	—
12月末	11,769	5.7	12,906	6.0	97.1	—
2024年１月末	11,972	7.5	13,231	8.6	96.7	—
２月末	12,123	8.8	13,395	10.0	96.9	—
３月末	12,270	10.2	13,556	11.3	96.9	—
４月末	12,496	12.2	13,780	13.1	97.1	—
５月末	12,559	12.7	13,873	13.9	97.1	—
（期末）2024年６月17日	12,757	14.5	14,082	15.6	97.7	—

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■海外債券市況

主要国の国債金利は、国によってまちまちな動きとなりました。

主要国の国債金利は、当作成期首より2023年10月にかけて、経済指標の上振れや金融引き締めの長期化が意識されたことなどを背景に、上昇（債券価格は下落）基調で推移しました。11月から12月にかけては、経済指標が軟調となったことを受けて利上げサイクルの終了が意識されたことにより、金利は低下（債券価格は上昇）しました。2024年１月から当作成期末にかけては、市場予想を上回る経済指標などを受けて過度な利下げ織り込みが後退したことで、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。

対円為替相場は、当作成期首より2023年10月にかけて、過度な信用不安の後退や海外主導で金利が上昇したことなどを受けて、円安で推移しました。11月から12月にかけては、日銀による政策修正や金利が海外主導で低下したことなどを受けて、円高で推移しました。2024年に入ってからは、米国金利の上昇や日銀による金融政策の維持などを背景に円安に転じました。その後は、日銀によるマイナス金利政策解除の発表を受けて円高となる局面もありましたが、主要国の堅調な経済指標により金利が上昇したことなどから、当作成期末にかけて円安基調で推移しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「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。

ポートフォリオについて

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■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。

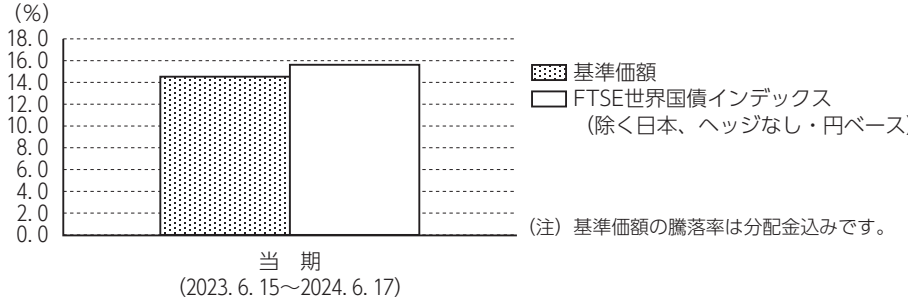
組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックスマザーファンド	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

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15. 6％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は14. 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。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
		2023年６月16日～2024年６月17日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**340**
対基準価額比率	（％）	2.67
当期の収益	（円）	340
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	4,017

（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。
（注４）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。

■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	✓	293.21円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	✓	819.09
（ｃ）収益調整金		3,213.85
（ｄ）分配準備積立金		31.12
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）		4,357.29
（ｆ）分配金		340.00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）		4,017.29

（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

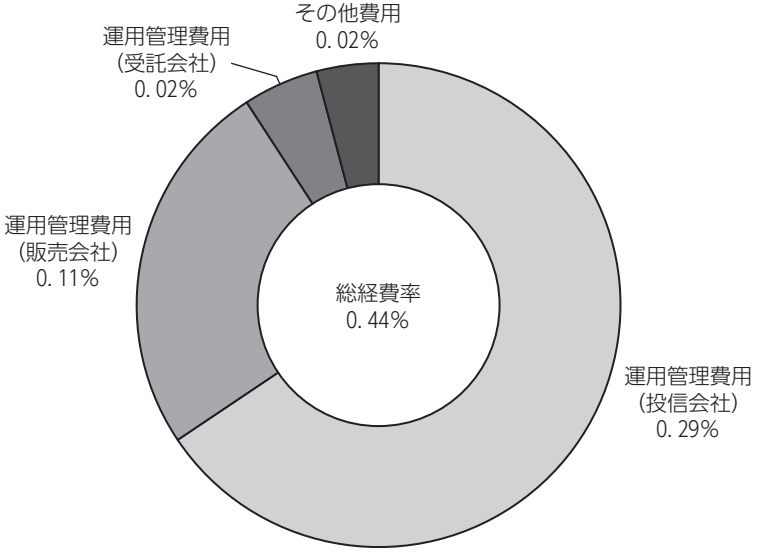
項　　目	当　期 (2023. 6. 16～2024. 6. 17)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	50円	0. 420%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は11, 825円です。**
（投 信 会 社）	(34)	(0. 288)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(13)	(0. 111)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	3	0. 022	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(2)	(0. 014)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0. 008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ　の　他）	(0)	(0. 000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	52	0. 442	

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

参考情報

■総経費率

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



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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2023年６月16日から2024年６月17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	2, 936, 482	10, 192, 018	2, 252, 478	8, 076, 485

（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マザーファンド	2, 432, 461	3, 116, 465	11, 631, 584

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年６月17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	11, 631, 584	96. 8
コール・ローン等、その他	380, 253	3. 2
投資信託財産総額	12, 011, 837	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17日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝157. 53円、１カナダ・ドル＝114. 69円、１オーストラリア・ドル＝104. 17円、１シンガポール・ドル＝116. 47円、１ニュージーランド・ドル＝96. 66円、１イギリス・ポンド＝199. 87円、１イスラエル・シュケル＝42. 35円、１デンマーク・クローネ＝22. 60円、１ノルウェー・クローネ＝14. 77円、１スウェーデン・クローネ＝14. 97円、１メキシコ・ペソ＝8. 51円、１オフショア・人民元＝21. 658円、１マレーシア・リンギット＝33. 352円、１ポーランド・ズロチ＝38. 519円、１ユーロ＝168. 64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（321, 480, 708千円）の投資信託財産総額（323, 422, 994千円）に対する比率は、99. 4％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年６月17日現在

項目	当期末
（A）資産	**12, 011, 837, 162円**
コール・ローン等	380, 253, 007
外国債券インデックスマザーファンド（評価額）	11, 631, 584, 155
（B）負債	**346, 461, 520**
未払収益分配金	319, 416, 450
未払信託報酬	26, 521, 710
その他未払費用	523, 360
（C）純資産総額（A－B）	**11, 665, 375, 642**
元本	9, 394, 601, 499
次期繰越損益金	2, 270, 774, 143
（D）受益権総口数	**9, 394, 601, 499口**
１万口当り基準価額（C／D）	**12, 417円**

＊期首における元本額は7, 103, 019, 200円、当作成期間中における追加設定元本額は8, 719, 913, 600円、同解約元本額は6, 428, 331, 301円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は12, 417円です。

■損益の状況

当期　自 2023年６月16日　至 2024年６月17日

項　　目	当　　期
（Ａ）配当等収益	**4, 804円**
受取利息	13, 116
支払利息	△ 8, 312
（Ｂ）有価証券売買損益	**1, 094, 005, 173**
売買益	1, 600, 136, 368
売買損	△ 506, 131, 195
（Ｃ）信託報酬等	△ **49, 036, 479**
（Ｄ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	**1, 044, 973, 498**
（Ｅ）前期繰越損益金	**29, 243, 075**
（Ｆ）追加信託差損益金	**1, 515, 974, 020**
（配当等相当額）	(3, 019, 290, 099)
（売買損益相当額）	(△ 1, 503, 316, 079)
（Ｇ）合計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	**2, 590, 190, 593**
（Ｈ）収益分配金	△ **319, 416, 450**
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	**2, 270, 774, 143**
追加信託差損益金	1, 515, 974, 020
（配当等相当額）	(3, 019, 290, 099)
（売買損益相当額）	(△ 1, 503, 316, 079)
分配準備積立金	754, 800, 123

（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	275, 467, 765円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	769, 505, 733
（ｃ）収益調整金	3, 019, 290, 099
（ｄ）分配準備積立金	29, 243, 075
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	4, 093, 506, 672
（ｆ）分配金	319, 416, 450
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	3, 774, 090, 222
（ｈ）受益権総口数	9, 394, 601, 499口

収　益　分　配　金　の　お　知　ら　せ	
１万口当り分配金（税込み）	340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（2023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（2024年６月17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

（2023年６月16日から2024年６月17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）3.875% 2033/8/15	1,572,025	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）0.375% 2024/9/15	1,052,371
CHINA GOVERNMENT BOND（中国）2.05% 2029/4/15	1,569,034	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2.375% 2024/8/15	896,117
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）4.5% 2033/11/15	1,514,073	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2.125% 2025/5/15	882,056
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）4% 2034/2/15	1,232,674	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2% 2025/2/15	844,645
CHINA GOVERNMENT BOND（中国）2.37% 2029/1/15	1,216,791	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2.25% 2024/11/15	816,780
CHINA GOVERNMENT BOND（中国）2.39% 2026/11/15	1,193,027	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）1.75% 2024/7/31	796,277
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）4.25% 2054/2/15	1,075,115	FRENCH GOVERNMENT BOND（フランス）1.75% 2024/11/25	769,312
CHINA GOVERNMENT BOND（中国）2.54% 2030/12/25	1,052,426	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）0.375% 2024/7/15	767,167
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）4.875% 2028/10/31	934,143	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）1.125% 2025/2/28	759,971
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）4.25% 2026/1/31	902,714	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）1.75% 2025/3/15	733,988

（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、2024年６月17日現在における外国債券インデックスマザーファンド（86,637,182千口）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

作成期	2024年６月17日現在							
区分	額面金額	評価額		組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
アメリカ	千アメリカ・ドル 1,059,000	千アメリカ・ドル 955,694	千円 150,550,549	% 46.6	% —	% 20.0	% 17.5	% 9.0
カナダ	千カナダ・ドル 58,333	千カナダ・ドル 54,872	6,293,292	1.9	—	1.1	0.4	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 43,063	千オーストラリア・ドル 38,812	4,043,114	1.3	—	0.9	0.3	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 11,336	千シンガポール・ドル 10,783	1,255,911	0.4	—	0.2	0.1	0.1
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 8,390	千ニュージーランド・ドル 7,520	726,908	0.2	—	0.1	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 99,816	千イギリス・ポンド 83,171	16,623,443	5.1	—	3.7	1.2	0.3
イスラエル	千イスラエル・シュケル 25,620	千イスラエル・シュケル 22,855	967,945	0.3	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーク・クローネ 34,865	千デンマーク・クローネ 35,693	806,667	0.2	—	0.2	0.0	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 34,640	千ノルウェー・クローネ 32,650	482,250	0.1	—	0.1	0.0	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 32,585	千スウェーデン・クローネ 31,562	472,489	0.1	—	0.1	0.1	—
メキシコ	千メキシコ・ペソ 294,983	千メキシコ・ペソ 259,737	2,210,603	0.7	—	0.4	0.2	0.1

外国債券インデックスマザーファンド

作成期		2024年6月17日現在							
区分		額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
			外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
中国		千オフショア・人民元 1,372,500	千オフショア・人民元 1,416,173	千円 30,671,477	% 9.5	% —	% 4.1	% 3.9	% 1.5
マレーシア		千マレーシア・リンギット 46,246	千マレーシア・リンギット 47,223	1,575,026	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ポーランド		千ポーランド・ズロチ 44,455	千ポーランド・ズロチ 41,695	1,606,082	0.5	—	0.2	0.2	0.1
ユーロ	アイルランド	千ユーロ 10,815	千ユーロ 9,562	1,612,601	0.5	—	0.3	0.1	0.1
	オランダ	千ユーロ 30,649	千ユーロ 28,569	4,817,890	1.5	—	0.9	0.5	0.1
	ベルギー	千ユーロ 35,393	千ユーロ 32,853	5,540,459	1.7	—	1.1	0.4	0.1
	フランス	千ユーロ 157,857	千ユーロ 142,929	24,103,572	7.5	—	4.3	2.3	0.9
	ドイツ	千ユーロ 122,751	千ユーロ 115,843	19,535,839	6.0	—	3.5	1.9	0.7
	スペイン	千ユーロ 91,408	千ユーロ 86,442	14,577,609	4.5	—	2.6	1.4	0.6
	イタリア	千ユーロ 140,794	千ユーロ 133,923	22,584,941	7.0	—	4.1	1.7	1.1
	フィンランド	千ユーロ 11,677	千ユーロ 10,298	1,736,689	0.5	—	0.3	0.2	0.1
	オーストリア	千ユーロ 25,685	千ユーロ 23,160	3,905,753	1.2	—	0.6	0.5	0.1
	小計	627,029	583,582	98,415,358	30.4	—	17.8	8.9	3.7
合計		—	—	316,701,120	97.9	—	49.3	33.1	15.5

（注1）邦貨換算金額は、2024年6月17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）

2024年6月17日現在							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	873	137,602	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	748	117,985	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	767	120,910	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	789	124,303	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	2,564	404,033	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,216	191,694	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	916	144,324	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	557	87,853	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	534	84,187	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	964	151,948	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,118	176,259	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,087	171,273	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,222	192,639	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,048	165,202	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	1,692	266,542	2040/05/15

2024年6月17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	3.8750	1,091	1,034	162,899	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,454	229,122	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,315	207,287	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,368	215,544	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,401	220,851	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,223	192,762	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,365	215,073	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,112	175,205	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,231	4,123	649,540	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	1,279	201,636	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	2,177	343,022	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	1,828	288,003	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	2,859	450,390	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	1,882	296,559	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	2,933	462,157	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	2,837	447,059	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	1,579	248,785	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,746	2,196	346,083	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	1,876	295,540	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,835	1,463	230,496	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,550	874,441	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,873	1,458	229,829	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,631	887,122	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	659	523	82,509	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,866	4,620	727,907	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,148	2,281	359,372	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,729	7,297	1,149,622	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,823	2,039	321,265	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	5,055	796,398	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,780	1,908	300,685	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	4,992	786,409	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,000	772	121,673	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,640	3,436	541,395	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,345	1,848	291,237	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	6,038	951,279	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	1,574	248,059	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,525	870,482	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,450	1,839	289,716	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,131	808,295	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	1,873	295,089	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,350	6,006	946,168	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,000	2,351	370,482	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,800	3,046	479,848	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	6,162	970,802	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,476	547,661	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	2,931	461,772	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	6,336	998,140	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,220	2,519	396,900	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,442	384,806	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,506	552,397	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,440	384,400	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,437	383,932	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,700	3,527	555,763	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,020	2,528	398,318	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	2,916	459,442	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	1,500	1,451	228,605	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	6,145	968,135	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,415	380,438	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	3,674	578,800	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,407	379,210	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,393	377,115	2026/03/31

2024年6月17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	2.8750	4,650	3,546	558,740	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	3,579	563,909	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,683	422,730	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,858	450,231	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	2,650	417,530	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,361	372,054	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,142	652,521	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,200	1,471	231,790	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,611	411,376	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,341	368,840	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	2,802	441,498	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,850	2,515	396,239	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	3,091	486,982	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	1,865	293,865	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,336	368,009	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,000	4,319	680,482	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	6,500	6,021	948,623	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	3,396	535,083	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	274	43,252	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,440	226,921	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,800	5,534	871,874	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,400	2,146	338,211	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,000	515	81,138	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	3,162	498,243	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,121	491,736	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,865	451,455	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,332	525,027	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,114	490,551	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,226	508,222	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	8,000	6,456	1,017,101	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,416	695,683	2027/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	8,200	4,355	686,136	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	3,132	493,383	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,095	487,601	2027/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,768	593,617	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,513	553,453	2027/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,308	521,146	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	9,800	7,988	1,258,423	2030/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,755	591,670	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,000	3,517	554,058	2027/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,800	3,861	608,261	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,100	3,312	521,890	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,100	4,781	753,158	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,404	693,911	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,392	691,989	2027/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,672	735,988	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	7,000	6,162	970,704	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,900	3,572	562,768	2051/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	10,700	8,829	1,390,916	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,656	733,569	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,454	701,662	2028/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,700	3,305	520,642	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,000	2,792	439,867	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,572	562,747	2028/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,728	587,423	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	8,700	7,367	1,160,589	2031/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,500	4,184	659,107	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,347	842,372	2028/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	4,363	687,375	2051/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,800	2,824	444,877	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,337	840,765	2028/05/31

2024年6月17日現在							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,400	4,079	642,685	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	4,437	698,992	2028/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	5,000	4,638	730,679	2026/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	10,300	8,437	1,329,102	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	6,900	4,296	676,858	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	5,700	3,873	610,182	2041/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	6,000	5,519	869,471	2026/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	5,000	4,381	690,264	2028/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	5,000	4,395	692,344	2028/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	5,000	4,600	724,638	2026/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	5,000	4,408	694,463	2028/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,500	3,222	507,687	2026/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	10,000	8,212	1,293,715	2031/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	6,600	3,977	626,573	2051/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	4,000	2,821	444,537	2041/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	6,000	5,310	836,531	2028/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	7,000	6,464	1,018,341	2026/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,697	582,514	2026/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	5,600	4,975	783,797	2028/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	4,000	3,527	555,633	2028/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,691	581,531	2026/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,400	4,582	721,931	2032/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	4,300	3,850	606,606	2029/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	6,900	4,557	717,935	2052/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	2,500	1,868	294,289	2042/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,000	4,496	708,294	2029/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,000	4,670	735,712	2027/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	3,000	2,757	434,409	2029/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	5,000	4,746	747,676	2027/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	9,300	8,471	1,334,480	2032/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	5,000	3,796	598,039	2052/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	1,500	1,277	201,320	2042/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	3,000	2,819	444,187	2029/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,863	451,072	2027/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	6,000	5,601	882,467	2029/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	2,000	1,899	299,294	2027/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	4,000	3,915	616,786	2025/06/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	4,000	3,820	601,764	2029/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	3,000	2,900	456,923	2027/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	3,000	2,937	462,712	2025/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	4,070	3,872	610,064	2027/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	4,500	4,405	694,069	2025/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	9,500	8,550	1,346,896	2032/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	5,200	4,051	638,155	2052/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.3750	2,000	1,729	272,476	2042/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	3,360	3,112	490,301	2029/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	2,500	2,404	378,808	2027/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	3,500	3,319	522,860	2029/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	2,300	2,259	355,934	2025/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,456	387,023	2029/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,500	3,470	546,734	2027/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,400	3,370	530,883	2025/10/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,000	2,975	468,662	2027/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	9,700	9,643	1,519,117	2032/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	1,500	1,492	235,052	2025/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,700	3,484	548,944	2052/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,000	2,966	467,254	2029/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,456	386,917	2029/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	3,000	2,952	465,066	2027/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	2,500	2,355	371,101	2042/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,500	3,456	544,545	2025/12/15

2024年6月17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	3.8750	1,500	1,478	232,863	2026/01/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	5,000	4,911	773,677	2029/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	1,500	1,475	232,509	2027/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	5,000	4,818	759,034	2030/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,500	3,455	544,385	2026/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	8,000	7,586	1,195,085	2033/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,310	363,933	2043/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	4,500	3,958	623,535	2053/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	3,700	3,594	566,237	2028/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	4,000	3,953	622,854	2030/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,000	2,964	466,928	2028/02/29
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	2,500	2,493	392,852	2026/03/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	1,800	1,744	274,823	2030/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	3,700	3,608	568,493	2028/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.7500	2,000	1,965	309,625	2026/04/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	3,000	2,887	454,811	2030/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	2,000	1,941	305,822	2028/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	4,000	3,921	617,807	2026/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.3750	7,800	7,315	1,152,454	2033/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	5,600	4,926	776,043	2053/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,307	363,468	2043/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,600	3,571	562,576	2025/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	3,700	3,607	568,254	2028/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.7500	1,500	1,462	230,427	2030/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,000	2,968	467,675	2026/06/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	2,500	2,489	392,170	2025/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.7500	3,000	2,924	460,718	2030/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,500	3,460	545,064	2028/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	5,000	4,984	785,184	2026/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.7500	4,000	3,989	628,393	2025/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,500	3,476	547,688	2028/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	11,000	10,713	1,687,637	2033/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	6,000	5,967	940,113	2026/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	5,000	4,812	758,113	2053/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	2,300	2,270	357,688	2043/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,000	2,964	466,928	2030/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	5.0000	3,900	3,899	614,354	2025/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,100	3,083	485,745	2030/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	3,000	3,008	473,946	2028/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	3,000	3,000	472,679	2026/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	5.0000	1,000	1,000	157,605	2025/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	1,500	1,532	241,486	2030/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	4,200	4,253	670,035	2028/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	1,000	1,000	157,656	2026/10/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	5.0000	1,000	1,000	157,673	2025/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.8750	6,000	6,139	967,089	2028/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	10,000	10,217	1,609,625	2033/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	3,800	3,805	599,452	2026/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.7500	2,300	2,383	375,453	2043/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.8750	3,100	3,212	506,006	2030/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.7500	5,300	5,664	892,367	2053/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.8750	3,500	3,499	551,343	2025/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	3,000	3,026	476,715	2030/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	4,000	4,017	632,810	2028/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	2,000	1,992	313,853	2026/12/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	2,000	1,975	311,206	2031/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.7500	4,500	4,382	690,298	2030/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	1,000	991	156,126	2025/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	6,000	5,946	936,815	2026/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	4,800	4,747	747,826	2029/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.7500	1,000	978	154,173	2028/12/31

2024年6月17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	4.0000	1,000	987	155,532	2027/01/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	8,200	8,063	1,270,238	2034/02/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	4,000	3,962	624,196	2027/02/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	4,400	4,330	682,187	2054/02/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	3,000	3,008	473,988	2044/02/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,600	3,608	568,389	2031/02/28
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	5,000	4,986	785,554	2026/02/28
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	5,200	5,201	819,328	2029/02/28
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	5,000	4,970	783,018	2027/03/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	5,000	4,973	783,396	2029/03/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	2,000	1,990	313,506	2031/03/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	5,200	5,177	815,600	2026/03/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	5,000	5,004	788,382	2027/04/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.8750	2,500	2,506	394,852	2026/04/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	2,200	2,229	351,192	2034/05/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	4,000	4,004	630,832	2027/05/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	2,500	2,541	400,283	2029/04/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	1,600	1,639	258,308	2031/04/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	1,300	1,361	214,516	2054/05/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	1,000	1,021	160,949	2044/05/15
通貨小計	銘柄数	279銘柄						
	金額				1,059,000	955,694	150,550,549	
					千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
カナダ		Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	605	548	62,951	2064/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,095	125,663	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,330	152,586	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,192	136,752	2037/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	913	995	114,160	2041/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	961	994	114,041	2045/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,225	140,608	2048/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,134	130,127	2025/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	928	106,491	2026/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,155	132,507	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	650	618	70,981	2028/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,710	2,876	329,864	2051/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,167	133,886	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	3,079	353,156	2030/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,770	317,692	2025/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,000	1,683	193,057	2030/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,100	1,977	226,744	2026/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	300	283	32,465	2026/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,400	3,031	347,738	2031/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,650	1,910	219,162	2053/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,200	2,070	237,496	2027/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,100	1,857	213,062	2031/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,500	1,368	156,959	2032/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	100	95	10,941	2029/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	391	44,927	2027/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,000	986	113,138	2025/10/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,270	2,143	245,873	2032/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,300	1,304	149,668	2028/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	600	591	67,827	2026/04/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,700	1,632	187,230	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	900	818	93,876	2055/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,200	1,195	137,127	2028/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	500	496	56,916	2025/08/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,000	998	114,473	2033/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,000	2,011	230,673	2025/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	300	308	35,437	2029/03/01

外国債券インデックスマザーファンド

2024年6月17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	
				%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,000	2,017	231,350	2026/02/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,700	1,660	190,428	2034/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,000	1,003	115,034	2026/05/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	400	408	46,814	2034/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	800	807	92,667	2029/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	700	703	80,725	2026/08/01
通貨小計	銘柄数	42銘柄						
	金額				58,333	54,872	6,293,292	
					千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
オーストラリア		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,989	2,038	212,388	2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,354	1,318	137,323	2029/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,258	2,326	242,399	2033/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,748	1,758	183,179	2026/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,061	110,562	2037/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,307	1,145	119,319	2035/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	699	72,851	2039/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,672	1,615	168,290	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,178	1,111	115,769	2028/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	983	102,429	2047/03/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,500	1,434	149,465	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,900	1,795	187,086	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,870	2,658	276,924	2030/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,390	1,115	116,226	2041/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	2,413	251,368	2031/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,700	2,192	228,382	2032/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,000	1,664	173,422	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,400	796	82,973	2051/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,516	157,921	2025/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,020	210,506	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,113	116,026	2026/09/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,600	1,336	139,197	2032/11/21
		AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.0000	1,700	1,554	161,889	2033/11/21
		AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.7500	1,200	1,163	121,242	2034/05/21
		AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.5000	1,100	1,040	108,374	2034/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	900	936	97,591	2054/06/21
通貨小計	銘柄数	26銘柄						
	金額				43,063	38,812	4,043,114	
					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	776	90,490	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	809	795	92,622	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	379	44,188	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	577	67,213	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	616	71,789	2029/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	518	60,346	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	644	75,117	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	439	51,164	2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	750	681	79,403	2036/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	538	62,732	2028/05/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	316	36,832	2039/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	540	424	49,403	2050/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	750	720	83,875	2025/11/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	600	541	63,117	2031/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	500	387	45,116	2051/10/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	200	190	22,202	2026/11/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	240	230	26,848	2032/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	620	609	70,983	2072/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	100	98	11,523	2027/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	400	395	46,047	2028/08/01

2024年6月17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	3.0000	600	595	69,363	2029/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	300	305	35,528	2034/05/01
通貨小計	銘柄数	22銘柄						
	金額				11,336	10,783	1,255,911	
					千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル		
ニュージーランド		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	600	598	57,853	2027/04/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,500	1,384	133,841	2033/04/14
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	490	396	38,301	2037/04/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	600	562	54,334	2029/04/20
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	530	436	42,192	2031/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	350	224	21,693	2041/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,100	934	90,337	2028/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	500	461	44,605	2026/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	440	366	35,392	2032/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	380	258	24,997	2051/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	200	194	18,794	2034/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	500	500	48,404	2030/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	700	708	68,466	2054/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	500	493	47,692	2035/05/15
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金額				8,390	7,520	726,908	
					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	921	892	178,382	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,282	824	164,770	2065/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,386	277,038	2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,760	1,007	201,322	2047/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,450	1,091	218,190	2037/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,810	974	194,730	2057/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,410	1,296	259,192	2027/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,500	1,364	272,711	2028/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,740	814	162,862	2071/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,210	719	143,712	2049/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	450	90,032	2054/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	1,500	1,284	256,758	2029/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,900	1,828	365,455	2025/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,190	740	147,958	2041/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	1,300	1,045	209,015	2030/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	1,700	522	104,403	2061/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,406	281,082	2026/01/30
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,600	1,393	278,519	2028/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	451	90,262	2050/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	3,700	2,559	511,554	2035/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	2,500	1,937	387,338	2031/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	2,000	1,010	201,920	2046/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	3,500	3,203	640,286	2026/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,800	892	178,479	2051/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	2,100	1,380	276,016	2039/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.5000	2,700	2,311	462,031	2029/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.8750	2,300	1,753	350,471	2033/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	1,300	672	134,420	2053/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.0000	3,600	2,908	581,417	2032/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	820	305	61,122	2073/10/22
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.1250	2,000	1,989	397,621	2027/01/29
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.7500	1,000	947	189,336	2038/01/29
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.2500	3,600	3,407	681,058	2033/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.5000	400	393	78,714	2025/10/22
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.7500	2,500	2,156	430,969	2053/10/22
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.0000	1,500	1,368	273,572	2063/10/22

外国債券インデックスマザーファンド

2024年6月17日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.5000	2,200	2,232	446,142	2028/06/07
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.6250	1,000	1,045	208,954	2034/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.7500	1,000	1,033	206,485	2043/10/22
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.7500	1,900	1,871	374,113	2027/03/07
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.3750	850	828	165,523	2054/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.0000	500	500	100,100	2031/10/22
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.1250	1,300	1,305	260,922	2029/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,028	205,476	2028/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,040	1,063	212,572	2032/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,362	1,375	274,917	2036/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,357	1,423	284,567	2038/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	1,635	326,801	2055/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,366	1,316	263,209	2046/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,239	247,766	2027/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,116	2,132	426,139	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,600	1,676	334,994	2030/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	1,289	257,674	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,846	1,827	365,307	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,560	1,614	322,763	2034/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,174	1,078	215,486	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	1,552	310,366	2040/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	1,365	272,868	2052/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,866	1,569	313,731	2044/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,386	1,149	229,696	2068/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,524	1,321	264,120	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	61銘柄						
	金額				99,816	83,171	16,623,443	
					千イスラエル・シュケル	千イスラエル・シュケル		
イスラエル		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	1,800	1,871	79,262	2026/10/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	2,200	2,275	96,358	2042/01/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,230	94,461	2025/08/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,684	71,329	2027/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,400	1,895	80,267	2047/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,200	1,091	46,236	2028/09/28
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	2,400	1,954	82,791	2030/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,700	1,132	47,957	2037/05/31
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.5000	200	187	7,926	2026/02/27
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	1.3000	2,300	1,774	75,153	2032/04/30
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	2.8000	820	511	21,660	2052/11/29
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	3.7500	3,000	2,886	122,233	2029/02/28
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	4.0000	1,000	921	39,015	2035/03/30
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	3.7500	2,500	2,438	103,291	2027/09/30
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金額				25,620	22,855	967,945	
					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
デンマーク		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	13,662	16,958	383,259	2039/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	5,922	133,859	2025/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,100	4,779	108,006	2027/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,090	3,716	83,998	2029/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,500	1,919	43,383	2052/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	422	9,538	2031/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,000	1,974	44,621	2033/11/15
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金額				34,865	35,693	806,667	
					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
ノルウェー		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,340	4,175	61,679	2026/02/19

2024年6月17日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,450	4,245	62,707	2027/02/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,316	48,991	2028/04/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	3,543	52,343	2029/09/06
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	4,800	4,256	62,861	2030/08/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,500	3,013	44,513	2031/09/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1250	1,700	1,544	22,816	2032/05/18
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,500	3,563	52,636	2042/10/06
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,500	1,444	21,340	2033/08/15
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6250	3,500	3,544	52,359	2034/04/13
通貨小計	銘柄数	10銘柄						
	金額				34,640	32,650	482,250	
					千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ		
スウェーデン		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,655	4,238	63,457	2039/03/30
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	6,942	103,932	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,050	4,778	71,532	2028/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,300	3,327	49,813	2032/06/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	6,400	5,966	89,321	2029/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	5,000	4,368	65,397	2031/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,000	1,939	29,034	2033/11/11
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金額				32,585	31,562	472,489	
					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	37,290	34,410	292,860	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	21,300	17,235	146,688	2047/11/07
		MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	7,000	6,208	52,840	2027/03/04
		MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	14,000	11,165	95,031	2053/07/31
		MEXICAN BONOS	国債証券	7.5000	30,000	25,512	217,135	2033/05/26
		MEXICAN BONOS	国債証券	7.0000	3,000	2,786	23,713	2026/09/03
		MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	5,000	4,337	36,919	2035/05/24
		MEXICAN BONOS	国債証券	8.5000	10,000	9,351	79,591	2029/03/01
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	27,968	25,867	220,158	2027/06/03
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	8,819	75,063	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,544	27,679	235,574	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	18,894	16,563	140,966	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	44,515	39,309	334,558	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	29,654	23,748	202,122	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,944	6,741	57,378	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金額				294,983	259,737	2,210,603	
					千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		
中国		China Government Bond	国債証券	3.2200	5,200	5,321	115,249	2025/12/06
		China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,280	114,373	2028/11/22
		China Government Bond	国債証券	3.2900	5,000	5,315	115,122	2029/05/23
		China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,153	111,605	2026/06/06
		China Government Bond	国債証券	3.1200	12,000	12,386	268,264	2026/12/05
		China Government Bond	国債証券	3.1300	8,000	8,443	182,868	2029/11/21
		China Government Bond	国債証券	2.8500	13,000	13,360	289,353	2027/06/04
		China Government Bond	国債証券	2.6800	11,500	11,824	256,090	2030/05/21
		China Government Bond	国債証券	3.0200	18,000	18,331	397,017	2025/10/22
		China Government Bond	国債証券	3.2800	9,000	9,433	204,313	2027/12/03
		China Government Bond	国債証券	3.2700	12,500	13,389	289,978	2030/11/19
		China Government Bond	国債証券	3.0300	7,000	7,157	155,017	2026/03/11
		China Government Bond	国債証券	3.8100	7,300	9,023	195,425	2050/09/14
		China Government Bond	国債証券	3.0100	7,000	7,276	157,586	2028/05/13
		China Government Bond	国債証券	3.7200	14,000	17,112	370,631	2051/04/12
		China Government Bond	国債証券	3.0200	15,800	16,650	360,620	2031/05/27

外国債券インデックスマザーファンド

2024年6月17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	
				%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,582	99,248	2026/08/12
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7400	5,000	5,098	110,429	2026/08/04
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5900	5,500	5,818	126,021	2027/08/03
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	5,000	5,367	116,238	2028/05/17
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6100	17,000	17,374	376,304	2025/06/07
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5400	4,500	4,811	104,206	2028/08/16
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0800	4,500	5,747	124,484	2048/10/22
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8600	6,300	7,809	169,148	2049/07/22
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	12,000	13,849	299,961	2050/03/16
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	5,500	5,698	123,427	2028/10/14
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	11,500	13,658	295,811	2051/10/18
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	16,000	16,731	362,378	2031/11/18
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	17,000	17,205	372,630	2027/01/20
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	7,200	7,451	161,382	2032/02/17
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	15,000	15,493	335,551	2029/03/24
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	15,000	15,245	330,188	2027/04/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	5,500	6,315	136,771	2052/04/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	5,000	5,176	112,122	2032/05/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	4,000	4,124	89,338	2029/06/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	19,000	19,577	424,015	2032/08/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	25,000	25,145	544,590	2025/08/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	32,000	32,761	709,557	2032/09/01
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	9,500	9,739	210,940	2029/09/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	17,200	17,458	378,120	2027/10/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	14,000	15,541	336,592	2052/10/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	5,500	5,717	123,827	2032/11/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	18,000	18,146	393,009	2025/11/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	19,000	19,641	425,386	2029/12/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6400	20,000	20,442	442,741	2028/01/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4600	38,000	38,444	832,633	2026/02/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8800	15,000	15,704	340,119	2033/02/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	15,000	15,527	336,302	2030/03/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	25,000	25,541	553,172	2028/04/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	23,000	26,106	565,421	2053/04/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	7,000	7,069	153,112	2026/05/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	40,000	41,179	891,867	2033/05/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	9,000	9,028	195,536	2025/06/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	33,000	33,814	732,353	2030/06/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	35,000	35,471	768,248	2028/07/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5200	40,000	40,678	881,012	2033/08/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	30,000	30,213	654,372	2026/08/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	25,000	25,422	550,595	2028/09/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2200	30,000	30,199	654,067	2025/09/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	20,000	20,471	443,378	2030/09/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	24,000	26,321	570,071	2053/10/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	20,000	20,413	442,113	2028/10/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3900	60,000	60,744	1,315,593	2026/11/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	36,000	37,081	803,109	2033/11/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3300	18,000	18,171	393,559	2025/12/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5400	50,000	51,039	1,105,402	2030/12/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	58,000	58,805	1,273,612	2029/01/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0400	35,000	35,146	761,198	2027/02/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	8,000	8,031	173,946	2034/02/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9900	26,000	26,111	565,512	2026/03/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	9,000	9,044	195,888	2031/03/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	73,000	73,011	1,581,286	2029/04/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	40,000	39,956	865,375	2027/05/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4900	25,000	25,230	546,436	2044/05/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2700	5,000	4,997	108,231	2034/05/25
通貨小計	銘柄数	75銘柄						
	金額				1,372,500	1,416,173	30,671,477	

2024年6月17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	
				%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,370	79,048	2027/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	3,378	3,512	117,134	2030/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,539	51,347	2026/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,333	44,474	2031/06/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	737	24,608	2027/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,424	47,513	2033/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,893	63,157	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	1,300	1,432	47,770	2043/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,750	58,382	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,252	41,776	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	1,002	33,428	2046/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,550	1,566	52,242	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,202	40,103	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,950	2,097	69,959	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,272	42,433	2033/11/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	2,000	2,187	72,950	2038/06/08
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	656	21,881	2026/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,310	2,333	77,830	2029/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,328	44,309	2048/07/06
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	2,000	1,992	66,452	2034/07/05
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,685	56,218	2040/05/22
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	2,650	2,587	86,288	2050/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,800	1,674	55,851	2031/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	1,400	1,374	45,836	2032/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	1,900	2,038	68,003	2042/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5040	500	518	17,300	2029/04/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4570	1,400	1,452	48,445	2053/03/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5190	1,000	997	33,257	2028/04/20
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0540	1,200	1,205	40,194	2039/04/18
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1800	800	804	26,825	2044/05/16
通貨小計	銘柄数	30銘柄						
	金額				46,246	47,223	1,575,026	
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	4,144	159,648	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	2,916	112,356	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840	4,221	162,617	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,316	89,242	2030/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.2500	2,200	1,963	75,624	2026/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	1,362	52,471	2032/04/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	500	479	18,455	2027/05/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	5,000	5,363	206,612	2028/07/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,404	54,113	2025/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	5,000	5,100	196,464	2033/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,826	70,355	2026/04/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,000	1,927	74,250	2029/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	833	32,091	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,650	3,321	127,957	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,591	4,512	173,819	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金額				44,455	41,695	1,606,082	
ユーロ（アイルランド）					千ユーロ	千ユーロ		
		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	961	945	159,465	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	931	778	131,329	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,035	174,682	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	474	79,949	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	747	126,095	2028/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	750	663	111,848	2033/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	750	687	115,948	2031/03/18

外国債券インデックスマザーファンド

2024年6月17日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	950	882	148,882	2029/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	600	430	72,562	2050/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	350	269	45,373	2035/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	500	464	78,410	2027/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	685	115,630	2030/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	—	800	656	110,693	2031/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	400	268	45,253	2041/04/22
		IRISH TREASURY	国債証券	0.3500	100	82	13,859	2032/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	3.0000	200	197	33,235	2043/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	2.6000	300	292	49,381	2034/10/18
国小計	銘柄数	17銘柄						
	金額				10,815	9,562	1,612,601	
					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	1,250	210,851	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,755	1,976	333,328	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,729	1,949	328,763	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,468	1,452	245,030	2033/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,929	1,923	324,424	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,736	292,885	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,938	1,851	312,156	2026/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,077	350,420	2027/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,254	211,604	2028/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,068	180,168	2029/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	640	107,965	2040/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,198	202,194	2030/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,147	362,202	2027/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,250	605	102,031	2052/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,085	183,098	2031/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	616	103,898	2038/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	800	134,975	2029/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	95	16,125	2026/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	600	508	85,727	2032/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,200	1,019	172,006	2054/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	900	887	149,648	2033/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,300	1,292	217,977	2030/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	600	638	107,682	2044/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	500	490	82,721	2034/07/15
国小計	銘柄数	24銘柄						
	金額				30,649	28,569	4,817,890	
					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	1,656	279,307	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	1,566	264,158	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	758	643	108,552	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,463	1,406	237,221	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	886	149,583	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	740	547	92,249	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,100	1,035	174,594	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	580	443	74,857	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	600	488	82,345	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,490	1,379	232,588	2028/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	650	566	95,487	2033/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,369	230,906	2029/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	700	491	82,933	2050/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	220	187	31,610	2030/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	860	551	92,989	2040/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,092	184,310	2027/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,600	1,300	219,312	2031/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	530	222	37,465	2071/06/22

2024年6月17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	0.3500	1,400	1,146	193,268	2032/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	800	501	84,580	2053/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	375	63,335	2039/04/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,500	1,504	253,691	2033/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3000	600	577	97,362	2054/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	700	705	118,921	2043/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8500	300	294	49,678	2034/10/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,000	994	167,661	2055/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	100	99	16,771	2029/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	3,206	3,510	592,054	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,904	2,232	376,501	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	1,790	301,957	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,026	173,035	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	838	141,487	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	643	675	113,923	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	745	125,751	2034/06/22
国小計	銘柄数	34銘柄						
	金額				35,393	32,853	5,540,459	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フランス）		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	3,132	528,347	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	3,695	623,193	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,227	3,856	650,364	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	3,038	512,375	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,764	1,912	322,585	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	2,553	430,557	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,164	3,605	608,026	2041/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,717	1,882	317,531	2060/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,646	3,673	619,485	2026/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,899	1,885	317,976	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,088	2,994	504,970	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,087	4,971	838,346	2030/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,101	3,006	506,981	2025/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,120	4,659	785,787	2031/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,387	4,180	704,948	2026/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	4,169	3,358	566,427	2036/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,387	892	150,428	2066/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,050	3,790	639,191	2026/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	2,095	353,463	2039/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,214	542,035	2027/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,550	1,941	327,331	2048/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,400	4,966	837,603	2028/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	5,150	4,334	730,891	2034/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	4,508	760,231	2028/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,850	1,893	319,398	2050/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,350	4,762	803,105	2029/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	3,593	605,954	2029/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,770	1,435	242,114	2052/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,849	480,613	2026/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	1,428	240,965	2040/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,000	4,149	699,822	2030/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,480	550	92,754	2072/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,104	186,296	2044/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,600	3,697	623,504	2031/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,100	2,864	483,052	2027/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,600	1,316	222,020	2053/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,600	2,845	479,806	2032/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,200	1,692	285,397	2038/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,300	3,974	670,236	2028/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	4,800	4,431	747,328	2032/11/25

2024年6月17日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,000	866	146,205	2043/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,100	1,889	318,591	2054/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,200	3,163	533,415	2026/09/24
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,900	3,875	653,545	2033/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	4,300	4,264	719,082	2029/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,700	2,783	469,338	2033/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	700	645	108,807	2049/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,100	3,055	515,297	2027/09/24
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	700	657	110,960	2055/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,000	989	166,870	2030/02/25
国小計	銘柄数	50銘柄						
	金額				157,857	142,929	24,103,572	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ドイツ）		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,301	219,405	2027/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	2,392	403,538	2028/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,035	174,581	2028/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	2,341	394,918	2030/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,048	3,623	611,096	2031/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,305	2,791	470,734	2034/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,271	3,809	642,462	2037/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	1,609	271,431	2039/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,739	2,245	378,681	2040/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,974	2,172	366,434	2042/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,608	1,595	269,139	2044/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	2,663	449,098	2046/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,083	351,399	2025/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,168	4,012	676,715	2026/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,287	385,756	2026/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,072	349,452	2027/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,300	3,105	523,683	2027/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,470	2,680	452,081	2048/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,774	299,287	2028/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,100	3,761	634,423	2028/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,700	4,274	720,924	2029/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,667	449,869	2029/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,850	1,499	252,923	2050/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,539	259,652	2030/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,621	273,469	2035/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,841	310,557	2027/11/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,567	264,387	2030/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,045	176,379	2030/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	775	130,697	2031/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,051	177,352	2036/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,805	304,526	2028/11/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	581	98,040	2050/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,600	3,066	517,125	2031/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	596	100,617	2031/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,800	3,196	539,112	2032/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,600	1,321	222,836	2038/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	2,700	2,581	435,411	2032/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	2,350	2,008	338,661	2053/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	3,200	3,160	533,069	2029/11/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	2,400	2,397	404,270	2033/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	1,700	1,698	286,450	2033/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,000	856	144,403	2053/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	2,400	2,452	413,579	2033/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	1,500	1,506	254,037	2030/11/15

2024年6月17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	2.2000	1,600	1,578	266,270	2034/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,100	1,097	185,062	2054/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	1,000	1,006	169,763	2041/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,056	178,127	2052/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,000	996	168,017	2025/06/12
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	100	100	16,868	2025/09/18
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	300	300	50,697	2025/12/12
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	800	795	134,147	2026/03/19
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	800	802	135,288	2026/06/18
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,213	373,202	2025/10/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	96	16,228	2025/10/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,094	353,299	2026/04/10
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,800	2,637	444,752	2026/10/09
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,100	2,888	487,093	2027/04/16
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	3,000	2,890	487,519	2027/10/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	430	414	69,903	2027/10/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	100	99	16,724	2028/04/13
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	100	100	16,866	2028/10/19
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	100	98	16,660	2029/04/12
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	100	98	16,665	2029/04/12
国小計	銘柄数	64銘柄						
	金額				122,751	115,843	19,535,839	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（スペイン）		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	3,001	506,147	2029/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	1,936	326,604	2030/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,161	364,598	2025/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	2,677	451,615	2026/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	1,706	287,819	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	1,409	237,717	2066/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,630	2,528	426,483	2026/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	1,824	307,615	2027/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,750	1,633	275,535	2033/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	1,953	329,401	2027/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,400	2,267	382,362	2028/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	2,200	1,830	308,686	2048/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,900	2,730	460,514	2028/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,494	251,991	2029/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,250	1,940	327,206	2035/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,477	417,752	2029/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,560	2,225	375,232	2030/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	762	128,540	2050/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,246	378,921	2027/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,400	2,160	364,404	2030/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,300	912	153,892	2040/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	475	80,233	2026/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	2,200	1,807	304,898	2031/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	650	319	53,828	2071/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,250	379,444	2028/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	700	507	85,534	2037/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,584	267,223	2031/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	600	391	66,056	2042/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	832	140,394	2027/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	2,100	1,753	295,717	2032/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9000	1,600	1,075	181,348	2052/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,065	179,695	2025/05/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	1,100	988	166,699	2029/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	1,700	1,626	274,351	2032/10/31

2024年6月17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	3.4500	1,000	961	162,164	2043/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1500	2,600	2,591	437,017	2033/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,300	2,287	385,742	2026/05/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.9000	800	827	139,481	2039/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5500	1,500	1,536	259,197	2033/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	600	614	103,651	2029/05/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,600	2,592	437,139	2034/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	200	197	33,252	2027/05/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,000	1,017	171,641	2054/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,179	2,587	436,351	2032/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,754	1,889	318,579	2037/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,858	2,142	361,351	2040/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,973	2,237	377,288	2041/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,789	2,829	477,095	2025/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,077	350,375	2026/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	1,928	325,300	2028/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	1,562	263,509	2044/10/31
国小計	銘柄数	51銘柄						
	金額				91,408	86,442	14,577,609	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（イタリア）		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,208	203,719	2026/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	2,633	444,036	2027/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	1,295	218,497	2046/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,440	411,556	2025/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	1,794	302,608	2032/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,891	2,833	477,860	2025/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	1,253	211,408	2047/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,386	2,306	388,967	2026/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	1,940	327,284	2036/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	1,016	171,417	2026/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	703	118,713	2067/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,349	227,600	2033/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,462	246,693	2027/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,650	1,451	244,856	2048/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,700	2,598	438,253	2027/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,141	192,505	2038/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	2,005	338,211	2028/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,550	2,492	420,343	2028/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,530	258,148	2025/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,208	203,849	2035/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,450	1,353	228,186	2049/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,900	2,844	479,690	2029/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	2,100	2,047	345,361	2026/07/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	1,250	1,098	185,225	2040/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	1,689	284,971	2030/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,208	372,391	2027/01/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,550	1,114	187,917	2050/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,151	194,159	2036/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,500	1,474	248,735	2025/07/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	1,719	289,902	2030/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,100	1,871	315,574	2030/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,200	2,041	344,239	2027/09/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,622	273,557	2026/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,500	1,076	181,498	2041/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,900	1,597	269,460	2031/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	1,200	726	122,471	2051/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	700	489	82,500	2037/03/01

2024年6月17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	0.2500	1,900	1,695	285,910	2028/03/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,800	1,465	247,136	2031/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,200	1,386	233,783	2045/04/30
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,035	174,696	2026/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	460	279	47,168	2072/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	714	120,457	2028/07/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,573	265,298	2031/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,100	2,888	487,103	2026/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,000	815	137,549	2032/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	900	787	132,769	2029/02/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	800	527	88,917	2052/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1000	300	282	47,617	2027/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	2,000	1,947	328,385	2025/08/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	800	777	131,111	2029/06/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,600	1,462	246,638	2032/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,300	2,099	354,014	2038/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6500	200	195	32,988	2027/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	500	505	85,174	2035/04/30
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,300	3,302	556,996	2026/01/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	2,800	2,936	495,234	2033/05/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	300	305	51,531	2029/12/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4000	1,500	1,502	253,364	2028/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4500	100	102	17,238	2043/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	800	817	137,840	2053/10/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	500	503	84,895	2026/04/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	900	923	155,747	2031/10/30
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7000	1,200	1,210	204,199	2030/06/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.3500	2,100	2,189	369,188	2033/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	700	711	119,941	2028/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	900	909	153,342	2026/09/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6000	300	300	50,638	2025/09/29
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	2,100	2,161	364,431	2034/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,500	1,537	259,225	2030/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1000	600	617	104,173	2029/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	200	197	33,380	2027/02/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,000	994	167,751	2031/02/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1500	2,000	1,992	336,079	2039/10/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2000	100	99	16,795	2026/01/28
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	400	398	67,168	2029/07/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	200	199	33,659	2034/07/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0500	50	50	8,444	2037/10/30
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,000	989	166,786	2031/07/15
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	3,254	3,545	597,928	2029/11/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	3,273	551,975	2031/05/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,067	348,727	2033/02/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	2,517	424,470	2034/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	2,751	463,968	2037/02/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	2,233	376,588	2039/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	2,449	413,135	2040/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,106	355,284	2026/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	2,538	428,157	2028/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	1,931	325,654	2044/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,318	2,323	391,896	2030/03/01
国小計	銘柄数	90銘柄						
	金額				140,794	133,923	22,584,941	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フィンランド）		Finland Government Bond	国債証券	0.7500	364	317	53,549	2031/04/15

2024年6月17日現在								
区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	271	45,759	2025/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	775	130,853	2026/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	259	43,797	2047/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	743	125,361	2027/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.1250	470	397	66,970	2034/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	454	76,625	2028/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	444	74,957	2029/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	220	37,188	2036/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	254	42,984	2040/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	—	500	420	70,859	2030/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	185	31,271	2052/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	494	83,331	2031/09/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	187	31,611	2026/09/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	450	283	47,773	2043/04/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	800	718	121,122	2032/09/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	270	259	43,697	2027/04/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	382	64,560	2038/04/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	300	300	50,740	2033/09/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8750	1,000	1,002	169,017	2029/04/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	400	385	65,052	2055/04/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	100	100	16,865	2034/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	672	113,405	2025/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	388	65,556	2028/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	378	63,775	2042/07/04
国小計	銘柄数	25銘柄						
	金額				11,677	10,298	1,736,689	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オーストリア）		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	500	487	82,267	2025/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	2,126	2,026	341,771	2026/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	579	97,645	2047/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	145	24,621	2086/11/02
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,200	202,460	2027/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	407	68,798	2117/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	1,116	188,212	2028/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,154	194,713	2029/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	980	837	141,318	2030/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	696	117,438	2051/03/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	242	40,839	2040/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.8500	350	160	27,132	2120/06/30
		Austria Government Bond	国債証券	—	1,200	994	167,631	2031/02/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	428	72,216	2036/10/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	300	136	22,937	2071/04/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,599	269,696	2028/10/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,500	1,297	218,780	2032/02/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	234	39,550	2049/05/23
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	294	49,704	2026/07/15
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	800	797	134,511	2033/02/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1500	300	299	50,514	2053/10/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,000	1,007	169,857	2029/05/23
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	800	828	139,791	2030/10/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	500	497	83,854	2034/02/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2000	500	504	85,045	2039/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	907	153,036	2027/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,373	1,527	257,637	2037/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	903	152,394	2026/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	387	65,418	2062/01/26
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	723	724	122,219	2044/06/20

2024年６月17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	
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	733	123,736	2034/05/23
国小計	銘柄数	31銘柄						
	金　額				25,685	23,160	3,905,753	
通貨小計	銘柄数	386銘柄						
	金　額				627,029	583,582	98,415,358	
合　計	銘柄数	1003銘柄						
	金　額						316,701,120	

（注１）邦貨換算金額は、2024年６月17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24期　（決算日　2023年11月30日）

（作成対象期間　2022年12月１日～2023年11月30日）

外国債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

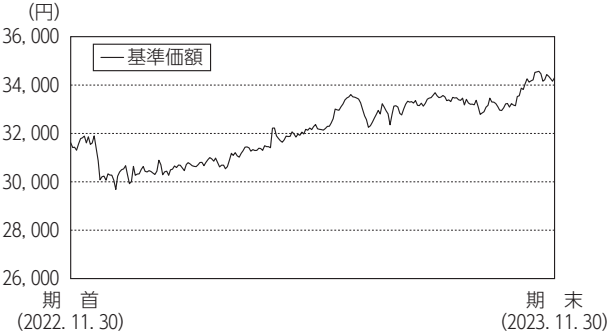
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年　月　日	基準価額		FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)(ベンチマーク)		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2022年11月30日	31,615	—	31,857	—	98.1	—
12月末	30,067	△ 4.9	30,508	△ 4.2	98.1	—
2023年1月末	30,422	△ 3.8	30,754	△ 3.5	97.9	—
2月末	30,793	△ 2.6	31,063	△ 2.5	97.9	—
3月末	31,180	△ 1.4	31,326	△ 1.7	97.7	—
4月末	31,408	△ 0.7	31,717	△ 0.4	97.6	—
5月末	32,222	1.9	32,574	2.3	97.7	—
6月末	33,512	6.0	33,818	6.2	97.5	—
7月末	32,788	3.7	32,998	3.6	97.5	—
8月末	33,682	6.5	33,966	6.6	97.5	—
9月末	33,183	5.0	33,500	5.2	97.5	—
10月末	33,143	4.8	33,410	4.9	97.3	—
(期末)2023年11月30日	34,304	8.5	34,765	9.1	97.0	—

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：31,615円　期末：34,304円　騰落率：8.5%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外債券市況

主要国の国債金利は上昇しました。

主要国の国債金利は、当作成期首より2023年1月にかけて、米国CPI(消費者物価指数)が予想を下振れたことで長期のインフレ期待が低下したことや、世界的な景気減速懸念が高まったことなどから低下(債券価格は上昇)しました。2月は主要国の経済指標が堅調な結果となり、さらなる金融引き締め観測が織り込まれたことで、金利は上昇に転じて推移しました。3月は米国の地方銀行の経営破綻に端を発する信用不安が広がり、将来の利下げ織り込みが加速したことや投資家のリスク回避姿勢が強まったことから金利は低下しましたが、4月から10月にかけては、過度な信用不安の後退や経済指標の上振れなどを背景に、金利は上昇基調で推移しました。その後当作成期末にかけては、経済指標が軟調となったことを受けて利上げサイクルの終了が意識されたことにより、金利は低下しました。

○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2023年1月にかけて、インフレ率の低下期待などから米国金利が低下したことで日米金利差の縮小が意識されたことや、日銀が想定外の政策修正を行ったことで金融緩和政策の転換などが意識され、日本の長期金利が大きく上昇したことなどから、円高が進行しました。2月は、堅調な米国の経済指標を受けて米国金利が大きく上昇したことで、円安に転じて推移しました。3月は欧米の信用不安により円高に推移しましたが、その後当作成期末にかけては、過度な信用不安の後退や主要国の金利が上昇したことなどを受け、円安で推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

今後も、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9.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は8.5%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。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。

■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	4
（保管費用）	(4)
（その他）	(0)
合　　計	4

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

■売買および取引の状況

公　社　債

（2022年12月１日から2023年11月30日まで）

			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 219,648	千アメリカ・ドル 173,686 (—)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 11,254	千カナダ・ドル 10,478 (—)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 5,034	千オーストラリア・ドル 569 (—)
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 1,033	千シンガポール・ドル 1,396 (—)
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランド・ドル 2,295	千ニュージーランド・ドル 669 (—)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 17,677	千イギリス・ポンド 4,067 (—)
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シュケル 3,504	千イスラエル・シュケル 3,458 (—)
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 1,907	千デンマーク・クローネ 4,812 (—)
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 4,825	千ノルウェー・クローネ 5,868 (—)
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローネ 1,835	千スウェーデン・クローネ 9,190 (—)
	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 54,466	千メキシコ・ペソ 50,442 (—)
	中国	国債証券	千オフショア・人民元 598,197	千オフショア・人民元 85,651 (—)
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 5,716	千マレーシア・リンギット 3,027 (—)
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 4,388	千ポーランド・ズロチ 7,038 (—)
	ユーロ（アイルランド）	国債証券	千ユーロ 199	千ユーロ 609 (—)
	ユーロ（オランダ）	国債証券	千ユーロ 3,266	千ユーロ 2,858 (—)
	ユーロ（ベルギー）	国債証券	千ユーロ 3,549	千ユーロ 2,512 (—)
	ユーロ（フランス）	国債証券	千ユーロ 19,169	千ユーロ 12,379 (—)
	ユーロ（ドイツ）	国債証券	千ユーロ 20,353	千ユーロ 16,407 (—)
	ユーロ（スペイン）	国債証券	千ユーロ 12,476	千ユーロ 8,133 (—)
	ユーロ（イタリア）	国債証券	千ユーロ 19,389	千ユーロ 16,094 (—)
	ユーロ（フィンランド）	国債証券	千ユーロ 2,553	千ユーロ 1,147 (—)
	ユーロ（オーストリア）	国債証券	千ユーロ 3,526	千ユーロ 1,689 (—)
	ユーロ（ユーロ通貨計）	国債証券	千ユーロ 84,483	千ユーロ 61,832 (—)

（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

（2022年12月１日から2023年11月30日まで）

当期			
買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）4.125% 2032/11/15	1,342,829	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）0.375% 2024/9/15	1,052,371
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）3.375% 2033/5/15	1,087,492	FRENCH GOVERNMENT BOND（フランス）2.25% 2024/5/25	951,259
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）3.5% 2033/2/15	1,079,241	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2.375% 2024/8/15	896,117
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）3.875% 2033/8/15	970,806	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）1.75% 2024/7/31	796,277
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）4.375% 2026/8/15	893,623	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）0.375% 2024/7/15	767,167
CHINA GOVERNMENT BOND（中国）2.52% 2033/8/25	814,297	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2% 2024/5/31	722,463
CHINA GOVERNMENT BOND（中国）2.67% 2033/5/25	799,368	China Government Bond（中国）2.88% 2023/11/5	708,723
CHINA GOVERNMENT BOND（中国）2.4% 2028/7/15	699,462	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）0.25% 2024/5/15	705,397
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）3.875% 2029/12/31	687,341	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2.5% 2024/5/15	694,072
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND（アメリカ）3.5% 2030/1/31	658,473	United States Treasury Note/Bond（アメリカ）2.75% 2024/2/15	682,725

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

■組入資産明細表
(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

作成期	当期末							
区分	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカ・ドル 1,018,352	千アメリカ・ドル 898,347	千円 132,119,911	% 46.6	% —	% 19.6	% 17.7	% 9.3
カナダ	千カナダ・ドル 50,893	千カナダ・ドル 46,522	5,034,152	1.8	—	1.1	0.4	0.3
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 46,861	千オーストラリア・ドル 41,660	4,059,779	1.4	—	0.9	0.3	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 10,436	千シンガポール・ドル 10,003	1,104,228	0.4	—	0.2	0.1	0.0
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 7,830	千ニュージーランド・ドル 6,743	611,648	0.2	—	0.1	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 90,238	千イギリス・ポンド 73,673	13,765,099	4.9	—	3.6	0.9	0.4
イスラエル	千イスラエル・シュケル 21,800	千イスラエル・シュケル 20,291	809,921	0.3	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 40,365	千デンマーク・クローネ 39,919	864,665	0.3	—	0.2	0.0	0.1
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 36,535	千ノルウェー・クローネ 34,079	470,635	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 40,180	千スウェーデン・クローネ 38,137	541,938	0.2	—	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 299,902	千メキシコ・ペソ 276,497	2,353,161	0.8	—	0.5	0.2	0.1
中国	千オフショア・人民元 894,500	千オフショア・人民元 904,995	18,643,275	6.6	—	3.1	2.2	1.2
マレーシア	千マレーシア・リンギット 41,846	千マレーシア・リンギット 42,382	1,338,933	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 35,455	千ポーランド・ズロチ 32,266	1,199,821	0.4	—	0.1	0.2	0.1

外国債券インデックスマザーファンド

作成期		当期末							
区分		額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
			外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ユーロ		千ユーロ	千ユーロ	千円	%	%	%	%	%
	アイルランド	11,546	10,187	1,645,306	0.6	—	0.4	0.1	0.1
	オランダ	千ユーロ 28,349	千ユーロ 26,097	4,214,970	1.5	—	1.0	0.4	0.1
	ベルギー	千ユーロ 33,793	千ユーロ 30,648	4,950,081	1.7	—	1.2	0.4	0.1
	フランス	千ユーロ 159,178	千ユーロ 144,699	23,370,409	8.2	—	4.7	2.4	1.1
	ドイツ	千ユーロ 119,095	千ユーロ 111,086	17,941,500	6.3	—	3.6	2.0	0.7
	スペイン	千ユーロ 92,350	千ユーロ 86,007	13,891,150	4.9	—	2.8	1.5	0.7
	イタリア	千ユーロ 138,576	千ユーロ 129,521	20,918,985	7.4	—	4.2	2.4	0.9
	フィンランド	千ユーロ 11,177	千ユーロ 9,729	1,571,376	0.6	—	0.3	0.2	0.1
	オーストリア	千ユーロ 23,038	千ユーロ 20,415	3,297,356	1.2	—	0.7	0.3	0.1
	小計	617,102	568,392	91,801,136	32.4	—	18.9	9.8	3.8
合計		—	—	274,718,308	97.0	—	49.2	32.1	15.7

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

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	880	129,448	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	755	111,078	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	769	113,226	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	791	116,439	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	2,559	376,382	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,204	177,148	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	905	133,136	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	547	80,496	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	523	76,984	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	936	137,745	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,090	160,336	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,058	155,738	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,189	174,915	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,020	150,136	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	1,643	241,642	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,001	147,312	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,411	207,587	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,279	188,210	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,329	195,535	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,361	200,174	2041/08/15

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,186	174,435	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,323	194,619	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,078	158,573	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,231	3,993	587,293	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	1,240	182,394	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	2,115	311,142	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	1,774	260,998	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	2,788	410,076	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	1,835	269,947	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	2,859	420,614	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	2,762	406,326	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	1,535	225,792	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	5,758	846,889	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,746	2,135	314,113	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,539	814,757	2025/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	1,818	267,405	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,563	818,153	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,835	1,421	209,076	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,484	806,598	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,873	1,416	208,320	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,578	820,401	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	659	508	74,793	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,866	4,568	671,888	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,148	2,209	324,902	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,729	7,216	1,061,397	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,823	1,975	290,492	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	4,997	734,979	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,780	1,844	271,311	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	4,950	728,119	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,000	749	110,281	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,640	3,412	501,876	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,345	1,795	264,025	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	5,997	882,024	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	1,529	224,993	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,482	806,374	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,450	1,784	262,440	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,090	748,590	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	1,819	267,637	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,407	501,212	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,104	456,618	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	2,715	399,392	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,350	5,973	878,495	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,524	371,304	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,626	386,292	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,000	2,288	336,541	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	2,813	413,712	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,800	2,966	436,317	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	6,129	901,484	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	1,846	271,636	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,449	507,317	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	2,906	427,488	2025/06/30

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	6,302	926,838	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,220	2,454	361,036	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,423	356,449	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,478	511,641	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,425	356,758	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,424	356,512	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,700	3,511	516,417	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,020	2,467	362,916	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	2,899	426,455	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	1,500	1,441	211,961	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	6,093	896,231	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,400	352,968	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	3,582	526,827	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,391	351,659	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,375	349,368	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	3,459	508,776	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	3,542	520,941	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,664	391,910	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,834	416,855	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	2,626	386,219	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,339	344,018	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,086	601,016	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	2,995	440,584	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,580	379,478	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,317	340,801	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	967	142,226	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	2,773	407,876	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,850	2,484	365,393	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	3,013	443,177	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	1,846	271,550	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,892	425,370	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,314	340,393	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,411	354,681	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,700	1,629	239,640	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,000	4,250	625,157	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	6,500	5,954	875,664	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	3,308	486,537	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	271	39,869	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	4,956	728,988	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,500	2,357	346,647	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,416	208,319	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,800	5,407	795,270	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,533	372,572	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,400	2,109	310,265	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	2,790	410,330	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	2,998	440,915	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,067	451,091	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,801	411,971	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	6,050	889,908	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,058	449,804	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,154	464,005	2025/07/31

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	8,000	6,309	927,894	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,335	637,621	2027/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	6,700	3,453	507,869	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	2,970	436,900	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,041	447,251	2027/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,690	542,764	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,447	507,079	2027/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,237	476,144	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	9,800	7,833	1,152,034	2030/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,678	540,994	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,000	3,455	508,156	2027/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,800	3,754	552,141	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,100	3,155	464,120	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,100	4,688	689,594	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,328	636,636	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,317	634,923	2027/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,587	674,610	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	7,000	6,059	891,229	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,900	3,479	511,759	2051/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	10,700	8,674	1,275,725	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,570	672,124	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,389	645,571	2028/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,700	3,162	465,051	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,000	2,742	403,358	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,523	518,133	2028/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,672	540,041	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	8,700	7,251	1,066,483	2031/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,500	4,117	605,620	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,273	775,505	2028/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	4,261	626,711	2051/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,800	2,714	399,192	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,262	773,891	2028/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,400	4,014	590,447	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	4,375	643,482	2028/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	5,000	4,571	672,367	2026/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	10,300	8,280	1,217,794	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	6,900	4,189	616,155	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	5,700	3,708	545,347	2041/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	6,000	5,429	798,572	2026/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	5,000	4,312	634,290	2028/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	5,000	4,328	636,607	2028/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	5,000	4,528	665,962	2026/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	5,000	4,346	639,188	2028/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,500	3,176	467,100	2026/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	4,500	4,314	634,568	2024/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	10,000	8,062	1,185,722	2031/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	6,600	3,876	570,089	2051/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	4,000	2,708	398,324	2041/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	6,000	5,235	770,026	2028/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	7,000	6,378	938,019	2026/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,650	536,846	2026/11/30

外国債券インデックスマザーファンド

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	5,600	4,908	721,845	2028/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	2,200	2,108	310,032	2024/12/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	4,000	3,474	511,009	2028/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,646	536,240	2026/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	1,000	957	140,750	2025/01/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	10,400	8,682	1,276,941	2032/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	3,700	3,548	521,815	2025/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	4,300	3,801	559,080	2029/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	3,900	2,517	370,275	2052/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	2,500	1,799	264,681	2042/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,000	4,441	653,211	2029/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,000	4,625	680,309	2027/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	5,000	4,799	705,891	2025/03/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	3,000	2,730	401,540	2029/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	5,000	4,717	693,751	2027/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	3,000	2,908	427,748	2025/04/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	9,300	8,373	1,231,536	2032/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,909	427,964	2025/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	5,000	3,718	546,828	2052/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	1,500	1,239	182,352	2042/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	3,000	2,797	411,432	2029/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,849	419,052	2027/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	6,000	5,552	816,564	2029/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	2,000	1,888	277,800	2027/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	4,000	3,883	571,166	2025/06/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	4,000	3,795	558,130	2029/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	3,000	2,893	425,533	2027/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	3,000	2,916	428,944	2025/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	4,070	3,853	566,700	2027/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	4,500	4,379	644,065	2025/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	9,500	8,442	1,241,618	2032/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	5,200	3,970	584,012	2052/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.3750	2,000	1,680	247,086	2042/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	3,360	3,080	453,115	2029/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	2,500	2,396	352,434	2027/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	3,500	3,293	484,411	2029/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	2,300	2,251	331,116	2025/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,445	359,681	2029/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,500	3,475	511,182	2027/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,400	3,372	496,062	2025/10/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	1,000	992	145,961	2024/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,000	2,979	438,227	2027/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	9,700	9,580	1,409,074	2032/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	1,500	1,495	219,969	2025/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,700	3,421	503,238	2052/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,000	2,954	434,503	2029/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	3,000	2,979	438,178	2024/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,444	359,523	2029/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	3,000	2,952	434,234	2027/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	2,500	2,295	337,628	2042/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,500	3,457	508,480	2025/12/15

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	1,500	1,478	217,432	2026/01/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	5,000	4,887	718,856	2029/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	1,500	1,476	217,143	2027/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,000	2,972	437,115	2024/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	1,000	989	145,515	2025/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	5,000	4,786	703,877	2030/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,500	3,458	508,588	2026/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	8,000	7,524	1,106,695	2033/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,252	331,208	2043/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	4,500	3,885	571,483	2053/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	3,700	3,588	527,812	2028/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	4,500	4,478	658,724	2025/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	1,000	983	144,671	2030/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,000	2,966	436,330	2028/02/29
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	2,500	2,504	368,303	2026/03/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	3,000	2,957	435,010	2025/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	1,800	1,733	254,941	2030/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	3,700	3,605	530,233	2028/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.7500	2,000	1,965	289,089	2026/04/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	3,000	2,867	421,765	2030/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	2,000	1,938	285,112	2028/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	1,000	980	144,147	2026/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.3750	7,800	7,256	1,067,201	2033/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	4,400	3,802	559,191	2053/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,250	331,021	2043/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	4,000	3,942	579,891	2025/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,600	3,567	524,734	2025/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	3,700	3,605	530,277	2028/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.7500	1,500	1,454	213,847	2030/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,000	2,974	437,512	2026/06/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	2,500	2,492	366,601	2025/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.7500	3,000	2,907	427,585	2030/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,500	3,463	509,304	2028/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	2,000	2,001	294,390	2026/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.7500	4,000	3,997	587,838	2025/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,500	3,481	511,985	2028/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	7,000	6,776	996,669	2033/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	6,000	5,988	880,655	2026/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,500	3,311	486,953	2053/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	1,300	1,254	184,499	2043/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,000	2,949	433,780	2030/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	5.0000	3,900	3,915	575,901	2025/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,100	3,069	451,389	2030/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	3,000	3,017	443,742	2028/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	3,000	3,015	443,446	2026/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	5.0000	1,000	1,004	147,764	2025/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	1,500	1,529	224,981	2030/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	4,200	4,268	627,774	2028/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	1,000	1,005	147,873	2026/10/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	5.0000	1,000	1,005	147,908	2025/10/31

外国債券インデックスマザーファンド

区分		当期末 銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.8750	2,000	2,055	302,296	2028/10/31
通貨小計	銘柄数	275銘柄						
	金額				1,018,352	898,347	132,119,911	
					千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
カナダ		Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	605	528	57,195	2064/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,092	118,167	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,315	142,354	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,168	126,493	2037/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	913	977	105,807	2041/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	961	974	105,405	2045/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,198	129,644	2048/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,121	121,408	2025/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	914	98,925	2026/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,131	122,490	2027/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	650	608	65,839	2028/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,710	2,797	302,708	2051/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,144	123,887	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	2,997	324,306	2030/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	700	673	72,835	2025/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,711	293,403	2025/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,000	1,627	176,083	2030/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,100	1,932	209,138	2026/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	300	277	30,073	2026/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,400	2,945	318,712	2031/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,650	1,856	200,867	2053/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,200	2,029	219,652	2027/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,100	1,803	195,106	2031/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	200	192	20,821	2025/04/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,500	1,331	144,070	2032/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	100	93	10,109	2029/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	386	41,820	2027/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,000	978	105,913	2025/10/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,270	2,089	226,098	2032/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	360	354	38,357	2024/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	200	198	21,509	2028/03/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	300	297	32,174	2025/02/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	600	586	63,490	2026/04/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	600	562	60,916	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	300	297	32,181	2025/05/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	352	38,136	2055/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,200	1,182	127,905	2028/09/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	500	493	53,417	2025/08/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,000	978	105,859	2033/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,000	2,012	217,725	2025/11/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	300	306	33,134	2029/03/01
通貨小計	銘柄数	41銘柄						
	金額				50,893	46,522	5,034,152	
					千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
オーストラリア		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,989	2,034	198,307	2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,354	1,299	126,610	2029/04/21

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,798	1,774	172,951	2025/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,258	2,283	222,574	2033/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,748	1,756	171,184	2026/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,031	100,537	2037/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,307	1,112	108,395	2035/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	676	65,946	2039/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,672	1,594	155,387	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,178	1,092	106,459	2028/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	956	93,200	2047/03/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,500	1,412	137,632	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,900	1,762	171,716	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,870	2,600	253,374	2030/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,390	1,079	105,238	2041/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	2,338	227,871	2031/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,700	2,117	206,340	2032/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,308	224,931	2024/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,000	1,610	156,910	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,400	771	75,222	2051/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,484	144,654	2025/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	1,949	189,978	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,089	106,146	2026/09/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,600	1,294	126,140	2032/11/21
		AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.0000	1,300	1,158	112,856	2033/11/21
		AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.7500	1,200	1,137	110,883	2034/05/21
		AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.5000	1,100	1,015	98,912	2034/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	900	917	89,414	2054/06/21
通貨小計	銘柄数	28銘柄						
	金額				46,861	41,660	4,059,779	
					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	781	86,210	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	809	806	88,984	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	386	42,633	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	587	64,856	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	623	68,815	2029/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	515	56,899	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	661	72,979	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	437	48,329	2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	750	695	76,741	2036/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	543	59,944	2028/05/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	323	35,757	2039/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	540	430	47,505	2050/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	750	709	78,331	2025/11/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	600	546	60,333	2031/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	500	398	43,955	2051/10/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	200	189	20,917	2026/11/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	240	234	25,881	2032/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	620	635	70,112	2072/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	100	99	11,010	2027/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	400	398	44,026	2028/08/01
通貨小計	銘柄数	20銘柄						
	金額				10,436	10,003	1,104,228	

外国債券インデックスマザーファンド

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル	千円	
ニュージーランド		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	600	593	53,814	2027/04/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,500	1,340	121,625	2033/04/14
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	490	379	34,440	2037/04/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	600	548	49,765	2029/04/20
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	530	418	37,978	2031/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	350	213	19,406	2041/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,100	900	81,659	2028/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	500	448	40,705	2026/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	440	352	31,957	2032/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	380	248	22,574	2051/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	640	619	56,158	2025/04/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	200	188	17,103	2034/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	500	490	44,457	2030/05/15
通貨小計	銘柄数	13銘柄						
	金額				7,830	6,743	611,648	
					千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	921	882	164,910	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,282	817	152,771	2065/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,367	255,460	2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,760	981	183,458	2047/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,450	1,060	198,176	2037/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,810	958	179,134	2057/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,410	1,278	238,854	2027/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,500	1,346	251,547	2028/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,040	484	90,530	2071/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,210	703	131,395	2049/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	441	82,503	2054/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	1,500	1,261	235,665	2029/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,900	1,793	335,031	2025/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,190	717	134,093	2041/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	1,300	1,021	190,891	2030/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	1,700	504	94,208	2061/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,374	256,771	2026/01/30
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,600	1,364	254,858	2028/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	436	81,601	2050/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,700	1,139	212,906	2035/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	2,500	1,888	352,847	2031/07/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	2,000	977	182,692	2046/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	3,500	3,141	586,943	2026/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,800	871	162,842	2051/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.2500	1,100	1,045	195,360	2025/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	2,100	1,335	249,563	2039/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.5000	2,700	2,262	422,693	2029/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.8750	2,300	1,710	319,570	2033/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	1,300	659	123,170	2053/07/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.0000	3,600	2,847	531,944	2032/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	820	301	56,258	2073/10/22
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.1250	2,000	1,996	372,932	2027/01/29
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.7500	1,000	930	173,817	2038/01/29
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.2500	1,100	1,030	192,524	2033/01/31
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.5000	400	392	73,350	2025/10/22

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.7500	2,500	2,150	401,706	2053/10/22
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.0000	800	728	136,124	2063/10/22
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.5000	700	711	132,994	2028/06/07
		UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.6250	1,000	1,037	193,794	2034/01/31
		United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,033	193,184	2028/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,240	2,280	426,092	2032/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,477	275,963	2025/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,362	1,362	254,476	2036/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,357	1,406	262,841	2038/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	1,621	302,975	2055/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,366	1,298	242,543	2046/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,240	231,851	2027/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,116	2,103	393,005	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,600	1,677	313,418	2030/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	1,272	237,777	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	1,410	263,570	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,560	1,602	299,485	2034/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,174	1,072	200,464	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	1,528	285,630	2040/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	1,349	252,162	2052/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,866	1,539	287,665	2044/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,386	1,142	213,486	2068/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,524	1,298	242,602	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	58銘柄						
	金額				90,238	73,673	13,765,099	
					千イスラエル・シュケル	千イスラエル・シュケル		
イスラエル		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	1,800	1,921	76,690	2026/10/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,600	1,796	71,703	2042/01/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,219	88,582	2025/08/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,699	67,826	2027/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,400	2,107	84,127	2047/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,200	1,115	44,542	2028/09/28
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	2,400	1,999	79,814	2030/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.5000	1,600	1,527	60,980	2025/04/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,700	1,201	47,964	2037/05/31
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.5000	200	185	7,416	2026/02/27
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.4000	900	872	34,815	2024/10/31
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	1.3000	300	240	9,604	2032/04/30
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	2.8000	600	422	16,867	2052/11/29
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	3.7500	3,000	2,981	118,985	2029/02/28
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金額				21,800	20,291	809,921	
					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
デンマーク		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	13,662	16,570	358,908	2039/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	5,892	127,628	2025/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,100	4,720	102,242	2027/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	8,590	7,659	165,896	2029/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,500	1,770	38,353	2052/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	409	8,868	2031/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	968	20,986	2024/11/15

外国債券インデックスマザーファンド

区分		当期末 銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,000	1,928	41,781	2033/11/15
通貨小計	銘柄数	8銘柄						
	金額				40,365	39,919	864,665	
					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
ノルウェー		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	5,395	5,240	72,369	2025/03/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,340	4,123	56,940	2026/02/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,450	4,186	57,817	2027/02/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,277	45,260	2028/04/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	3,498	48,313	2029/09/06
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	4,800	4,196	57,949	2030/08/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,500	2,969	41,015	2031/09/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1250	1,700	1,529	21,127	2032/05/18
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,500	3,621	50,008	2042/10/06
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,500	1,436	19,832	2033/08/15
通貨小計	銘柄数	10銘柄						
	金額				36,535	34,079	470,635	
					千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ		
スウェーデン		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,655	4,021	57,140	2039/03/30
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,595	7,512	106,753	2025/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	6,830	97,065	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,050	4,677	66,470	2028/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,300	3,229	45,897	2032/06/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	6,400	5,798	82,399	2029/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	5,000	4,202	59,723	2031/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,000	1,864	26,488	2033/11/11
通貨小計	銘柄数	8銘柄						
	金額				40,180	38,137	541,938	
					千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	37,290	34,251	291,498	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	21,300	18,397	156,573	2047/11/07
		MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	7,000	6,235	53,065	2027/03/04
		MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	1,000	941	8,011	2025/03/06
		MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	14,000	12,016	102,266	2053/07/31
		MEXICAN BONOS	国債証券	7.5000	10,000	8,870	75,494	2033/05/26
		MEXICAN BONOS	国債証券	7.0000	3,000	2,812	23,938	2026/09/03
		MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	5,000	4,552	38,746	2035/05/24
		MEXICAN BONOS	国債証券	8.5000	10,000	9,708	82,620	2029/03/01
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	23,919	23,710	201,791	2024/12/05
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	27,968	26,350	224,257	2027/06/03
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	9,331	79,420	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,544	28,643	243,770	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	18,894	17,496	148,904	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	44,515	40,850	347,662	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	29,654	25,220	214,638	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,944	7,108	60,500	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	17銘柄						
	金額				299,902	276,497	2,353,161	
					千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		
中国		China Government Bond	国債証券	3.2200	5,200	5,299	109,161	2025/12/06
		China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,168	106,462	2028/11/22

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,000	5,194	107,014	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,119	105,462	2026/06/06
	China Government Bond	国債証券	3.1200	12,000	12,249	252,339	2026/12/05
	China Government Bond	国債証券	3.1300	8,000	8,252	169,997	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2.8500	13,000	13,136	270,619	2027/06/04
	China Government Bond	国債証券	2.6800	11,500	11,500	236,904	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	3.0200	18,000	18,235	375,653	2025/10/22
	China Government Bond	国債証券	3.2800	9,000	9,291	191,418	2027/12/03
	China Government Bond	国債証券	3.2700	12,500	13,066	269,175	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3.0300	7,000	7,107	146,409	2026/03/11
	China Government Bond	国債証券	3.8100	7,300	8,316	171,322	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	3.0100	7,000	7,142	147,135	2028/05/13
	China Government Bond	国債証券	3.7200	14,000	15,701	323,461	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.0200	15,800	16,214	334,020	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,526	93,253	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7400	5,000	5,035	103,736	2026/08/04
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5900	5,500	5,750	118,458	2027/08/03
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	5,000	5,268	108,528	2028/05/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6100	17,000	17,391	358,268	2025/06/07
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5400	4,500	4,721	97,265	2028/08/16
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0800	4,500	5,319	109,582	2048/10/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8600	6,300	7,216	148,659	2049/07/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7700	11,000	11,235	231,456	2025/03/08
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	12,000	12,730	262,252	2050/03/16
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	5,500	5,580	114,970	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	11,500	12,594	259,443	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	6,000	6,105	125,781	2031/11/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	17,000	16,939	348,963	2027/01/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	7,200	7,215	148,640	2032/02/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2600	10,000	9,965	205,297	2025/02/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	15,000	15,117	311,428	2029/03/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	5,500	5,774	118,951	2052/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	5,000	5,032	103,669	2032/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	4,000	4,019	82,812	2029/06/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,000	3,991	82,228	2032/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	25,000	24,877	512,491	2025/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	32,000	31,674	652,515	2032/09/01
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	9,500	9,478	195,253	2029/09/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	17,200	17,129	352,867	2027/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	14,000	14,123	290,949	2052/10/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	5,500	5,538	114,094	2032/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	18,000	17,931	369,394	2025/11/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	19,000	19,127	394,030	2029/12/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2900	5,000	4,993	102,861	2024/12/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6400	20,000	20,086	413,783	2028/01/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4600	18,000	17,996	370,744	2026/02/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8800	15,000	15,250	314,172	2033/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	23,000	22,975	473,311	2025/03/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	15,000	15,108	311,240	2030/03/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	25,000	25,069	516,441	2028/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	23,000	23,839	491,103	2053/04/15

外国債券インデックスマザーファンド

区分		当期末 銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	7,000	6,973	143,666	2026/05/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	40,000	39,894	821,832	2033/05/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	9,000	8,938	184,141	2025/06/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	33,000	32,888	677,515	2030/06/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	35,000	34,750	715,865	2028/07/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5200	40,000	39,384	811,334	2033/08/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	30,000	29,766	613,191	2026/08/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	25,000	24,885	512,656	2028/09/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2200	30,000	29,883	615,620	2025/09/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	20,000	19,916	410,277	2030/09/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	20,000	19,985	411,711	2028/10/15
通貨小計	銘柄数	64銘柄						
	金額				894,500	904,995	18,643,275	
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,358	74,525	2027/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,220	38,544	2030/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,540	48,681	2026/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,325	41,880	2031/06/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	736	23,263	2027/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,414	44,701	2033/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,885	59,563	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	1,300	1,419	44,843	2043/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,750	55,316	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,239	39,172	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	981	30,992	2046/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,550	1,563	49,388	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,198	37,872	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,950	2,079	65,696	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,208	38,174	2025/03/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,278	40,401	2033/11/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	2,000	2,187	69,096	2038/06/08
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	656	20,741	2026/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,310	2,310	72,978	2029/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,303	41,176	2048/07/06
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,279	40,427	2034/07/05
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,651	52,165	2040/05/22
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	2,650	2,528	79,878	2050/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,800	1,650	52,156	2031/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	1,400	1,363	43,066	2032/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	1,900	2,021	63,874	2042/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5040	500	516	16,301	2029/04/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4570	700	715	22,614	2053/03/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5190	1,000	995	31,437	2028/04/20
通貨小計	銘柄数	29銘柄						
	金額				41,846	42,382	1,338,933	
					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	4,083	151,845	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	2,886	107,341	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840	4,237	157,559	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.7500	2,000	1,880	69,911	2025/04/25

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
		Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,316	86,133	2030/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.2500	2,200	1,911	71,096	2026/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	1,362	50,646	2032/04/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	500	476	17,724	2027/05/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	1,000	1,087	40,442	2028/07/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,361	50,625	2025/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,000	2,078	77,288	2033/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	841	31,303	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,650	3,298	122,667	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,591	4,443	165,234	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金額				35,455	32,266	1,199,821	
					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	1,060	171,252	2025/03/13
		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	961	943	152,435	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	931	744	120,173	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,028	166,148	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	464	74,980	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	742	119,965	2028/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	750	655	105,828	2033/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	750	683	110,348	2031/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	950	875	141,377	2029/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	600	407	65,759	2050/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	350	264	42,646	2035/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	500	459	74,272	2027/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	674	108,985	2030/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	—	800	646	104,443	2031/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	400	260	42,063	2041/04/22
		IRISH TREASURY	国債証券	0.3500	100	80	13,079	2032/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	3.0000	200	195	31,543	2043/10/18
国小計	銘柄数	17銘柄						
	金額				11,546	10,187	1,645,306	
					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	1,266	204,478	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,755	1,965	317,452	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,729	1,924	310,861	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,468	1,443	233,099	2033/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,929	1,882	304,078	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,715	276,996	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,938	1,830	295,637	2026/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,061	332,918	2027/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,244	200,972	2028/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,056	170,630	2029/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	624	100,806	2040/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,181	190,874	2030/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	737	119,106	2027/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,250	572	92,418	2052/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,066	172,182	2031/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	598	96,688	2038/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	790	127,697	2029/01/15

外国債券インデックスマザーファンド

区分		当期末 銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	94	15, 222	2026/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 5000	600	500	80, 785	2032/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 0000	900	739	119, 461	2054/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 5000	900	880	142, 277	2033/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 5000	1, 300	1, 292	208, 738	2030/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 2500	600	628	101, 582	2044/01/15
国小計	銘柄数	23銘柄						
	金額				28, 349	26, 097	4, 214, 970	
					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, 640	264, 883	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1. 0000	1, 774	1, 551	250, 586	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1. 9000	1, 058	883	142, 703	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1. 0000	1, 463	1, 398	225, 795	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1. 6000	1, 244	863	139, 405	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2. 1500	740	531	85, 832	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0. 8000	1, 100	1, 029	166, 253	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2. 2500	580	435	70, 310	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1. 4500	600	480	77, 620	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0. 8000	1, 490	1, 372	221, 681	2028/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1. 2500	650	559	90, 384	2033/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0. 9000	1, 500	1, 362	220, 109	2029/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1. 7000	700	478	77, 256	2050/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0. 1000	1, 220	1, 026	165, 838	2030/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0. 4000	860	534	86, 287	2040/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1, 200	1, 081	174, 725	2027/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1, 600	1, 277	206, 283	2031/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0. 6500	530	208	33, 666	2071/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0. 3500	1, 400	1, 127	182, 021	2032/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1. 4000	800	487	78, 708	2053/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2. 7500	400	370	59, 826	2039/04/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 0000	1, 500	1, 496	241, 649	2033/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 3000	600	564	91, 181	2054/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3. 4500	700	693	111, 995	2043/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5. 5000	1, 706	1, 902	307, 228	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5. 0000	1, 904	2, 232	360, 641	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4. 2500	1, 604	1, 774	286, 571	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4. 5000	1, 001	1, 037	167, 507	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4. 0000	780	842	136, 054	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	3. 7500	643	665	107, 486	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3. 0000	747	740	119, 581	2034/06/22
国小計	銘柄数	31銘柄						
	金額				33, 793	30, 648	4, 950, 081	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フランス）		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6. 0000	3, 025	3, 194	515, 868	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 5000	3, 323	3, 780	610, 558	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5. 7500	3, 227	3, 941	636, 517	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 7500	2, 659	3, 080	497, 523	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 0000	1, 764	1, 923	310, 730	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 0000	2, 374	2, 581	416, 893	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4. 5000	3, 164	3, 647	589, 131	2041/04/25

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,717	1,889	305,143	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,646	3,701	597,757	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	5,899	5,909	954,500	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,088	3,011	486,369	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,087	5,019	810,723	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,899	1,868	301,702	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,362	543,080	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	4,915	793,824	2025/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,120	4,685	756,766	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,387	4,145	669,609	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	4,169	3,355	541,927	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,387	891	143,931	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,050	3,762	607,653	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	2,104	339,897	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,207	518,085	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,550	1,945	314,163	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,400	4,963	801,710	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	3,327	537,453	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	4,509	728,377	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,850	1,891	305,521	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,350	4,758	768,623	2029/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,330	4,154	670,973	2025/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	3,580	578,354	2029/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,770	1,424	230,142	2052/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,817	455,026	2026/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	1,418	229,147	2040/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,000	4,133	667,593	2030/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,480	533	86,107	2072/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	863	139,522	2044/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,600	3,683	594,966	2031/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,100	2,840	458,834	2027/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,600	1,308	211,331	2053/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,600	2,834	457,869	2032/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	2,019	326,102	2025/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,200	1,690	273,022	2038/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,300	3,969	641,058	2028/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	4,800	4,464	721,003	2032/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,000	870	140,541	2043/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,100	992	160,349	2054/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,200	2,181	352,315	2026/09/24
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,200	2,210	357,070	2033/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	600	600	97,025	2029/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	700	730	118,004	2033/11/25
国小計 銘柄数	50銘柄						
国小計 金額				159,178	144,699	23,370,409	
				千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（ドイツ）	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,325	214,095	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	2,432	392,836	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,048	169,359	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	2,384	385,040	2030/01/04

外国債券インデックスマザーファンド

当期末							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,048	3,673	593,298	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,305	2,793	451,107	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,271	3,780	610,560	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	1,591	256,982	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,739	2,219	358,491	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,974	2,131	344,294	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	2,722	439,742	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	2,598	419,626	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,125	343,258	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,067	333,912	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,168	3,973	641,783	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,260	365,100	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,200	3,915	632,438	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,300	3,081	497,640	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,470	2,600	419,931	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,761	284,455	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,100	3,728	602,136	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,700	4,235	684,136	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,637	425,969	2029/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,850	1,430	231,067	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,521	245,757	2030/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,579	255,073	2035/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,823	294,432	2027/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,547	249,907	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,032	166,825	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	764	123,424	2031/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,021	165,036	2036/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,786	288,598	2028/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	555	89,665	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,600	3,019	487,627	2031/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	587	94,857	2031/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,800	3,144	507,825	2032/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,600	1,288	208,148	2038/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	2,700	2,561	413,688	2032/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,700	1,401	226,289	2053/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	200	197	31,915	2029/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	1,600	1,588	256,601	2033/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	1,700	1,689	272,793	2033/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,000	826	133,415	2053/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	900	913	147,574	2033/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	1,500	1,505	243,117	2030/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,000	161,540	2052/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,500	1,483	239,544	2024/12/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,500	1,487	240,314	2025/03/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,000	996	160,947	2025/06/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	100	100	16,205	2025/09/18
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	300	301	48,713	2025/12/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,303	371,995	2025/04/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,184	352,784	2025/10/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	95	15,350	2025/10/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,068	334,112	2026/04/10

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,800	2,605	420,852	2026/10/09
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	92	14,877	2027/04/16
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	3,000	2,881	465,361	2027/10/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	430	413	66,834	2027/10/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	100	99	16,036	2028/04/13
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	100	100	16,183	2028/10/19
国小計	銘柄数	61銘柄						
	金額				119,095	111,086	17,941,500	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（スペイン）		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	3,027	488,988	2029/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	1,997	322,585	2025/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	1,910	308,563	2030/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,155	348,163	2025/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	2,664	430,270	2026/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	1,642	265,316	2046/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	1,335	215,730	2066/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,630	2,507	404,972	2026/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	1,809	292,258	2027/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,750	1,603	258,974	2033/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	1,936	312,736	2027/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,400	2,244	362,583	2028/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	2,200	1,754	283,355	2048/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,900	2,703	436,599	2028/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,476	238,388	2029/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,250	1,888	304,988	2035/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,432	392,859	2029/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,560	2,178	351,917	2030/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,404	388,366	2025/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	718	116,073	2050/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,220	358,668	2027/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,400	2,121	342,698	2030/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,300	873	141,107	2040/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	468	75,611	2026/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	2,200	1,759	284,143	2031/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	650	296	47,835	2071/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,212	357,336	2028/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	1,900	1,321	213,513	2037/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,543	249,306	2031/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	600	372	60,174	2042/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	819	132,368	2027/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	2,100	1,709	276,125	2032/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9000	600	381	61,562	2052/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	95	15,390	2025/05/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	1,100	972	157,032	2029/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	1,700	1,601	258,584	2032/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,000	931	150,453	2043/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1500	1,500	1,473	237,921	2033/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,300	2,285	369,169	2026/05/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.9000	800	805	130,027	2039/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5500	1,500	1,515	244,808	2033/10/31

外国債券インデックスマザーファンド

区分		当期末 銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	600	613	99,032	2029/05/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,179	2,583	417,283	2032/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,754	1,854	299,441	2037/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,858	2,092	337,956	2040/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,973	2,186	353,071	2041/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,789	2,853	460,892	2025/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,105	340,103	2026/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	1,942	313,710	2028/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	1,522	245,939	2044/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,081	336,183	2024/10/31
国小計	銘柄数	51銘柄						
	金額				92,350	86,007	13,891,150	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（イタリア）		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,230	198,802	2026/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	2,665	430,466	2027/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,796	290,160	2024/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	1,233	199,271	2046/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,418	390,569	2025/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	1,744	281,826	2032/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,891	2,819	455,448	2025/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	1,193	192,735	2047/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,386	2,291	370,044	2026/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	1,860	300,497	2036/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	1,006	162,619	2026/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	660	106,657	2067/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,311	211,875	2033/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,455	235,056	2027/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,650	1,386	223,962	2048/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,700	2,582	417,151	2027/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,568	253,363	2024/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,096	177,110	2038/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	1,988	321,205	2028/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,265	204,342	2025/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,550	2,473	399,499	2028/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,527	246,750	2025/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,170	189,003	2035/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	650	579	93,539	2049/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,900	2,817	455,058	2029/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	2,100	2,038	329,209	2026/07/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	1,250	1,052	170,023	2040/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	1,653	267,022	2030/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,300	1,254	202,570	2025/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,181	352,414	2027/01/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,550	1,058	170,929	2050/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,098	177,471	2036/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,500	1,464	236,523	2025/07/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	1,676	270,697	2030/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,100	1,828	295,360	2030/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,200	2,014	325,439	2027/09/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,600	258,559	2026/02/01

区分	銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,500	1,021	164,941	2041/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,900	1,552	250,794	2031/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	1,200	684	110,546	2051/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	700	465	75,145	2037/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,663	268,734	2028/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,800	1,419	229,239	2031/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,200	1,307	211,167	2045/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,019	164,634	2026/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	460	259	41,850	2072/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	701	113,224	2028/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,524	246,185	2031/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,100	2,843	459,194	2026/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,700	1,341	216,622	2032/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	900	769	124,338	2029/02/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	289	46,758	2024/12/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	800	498	80,435	2052/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1000	300	279	45,123	2027/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	500	482	77,870	2025/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	800	769	124,203	2029/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,600	1,425	230,160	2032/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	300	263	42,498	2038/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6500	200	194	31,446	2027/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	500	491	79,347	2035/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,300	3,314	535,280	2026/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	2,800	2,885	466,043	2033/05/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	300	303	48,971	2029/12/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4000	1,500	1,499	242,216	2028/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4500	100	98	15,850	2043/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	500	487	78,770	2053/10/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4000	400	399	64,533	2025/03/28
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	500	505	81,682	2026/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	900	910	147,017	2031/10/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7000	1,200	1,198	193,594	2030/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.3500	2,100	2,147	346,775	2033/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	700	710	114,696	2028/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	400	405	65,525	2026/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6000	300	301	48,641	2025/09/29
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	400	402	65,038	2034/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,500	1,520	245,654	2030/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1000	600	615	99,426	2029/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	3,254	3,539	571,728	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	3,261	526,834	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,045	330,333	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	2,462	397,698	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	2,656	429,097	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	2,162	349,234	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,155	348,174	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	2,371	383,006	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,122	342,827	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	2,547	411,445	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	1,855	299,605	2044/09/01

外国債券インデックスマザーファンド

区分		当期末 銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,318	2,300	371,576	2030/03/01
国小計	銘柄数	89銘柄						
	金額				138,576	129,521	20,918,985	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（フィンランド）		Finland Government Bond	国債証券	0.7500	364	314	50,820	2031/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	268	43,442	2025/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	768	124,195	2026/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	254	41,044	2047/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	738	119,255	2027/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.1250	470	391	63,299	2034/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	451	72,856	2028/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	441	71,285	2029/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	214	34,705	2036/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	247	39,971	2040/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	—	500	414	67,006	2030/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	177	28,717	2052/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	486	78,646	2031/09/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	185	29,913	2026/09/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	450	274	44,255	2043/04/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	800	713	115,252	2032/09/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	270	258	41,726	2027/04/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	377	61,029	2038/04/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	300	300	48,553	2033/09/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8750	1,000	1,007	162,743	2029/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	676	109,250	2025/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	390	63,062	2028/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	373	60,342	2042/07/04
国小計	銘柄数	23銘柄						
	金額				11,177	9,729	1,571,376	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ（オーストリア）		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	1,373	1,329	214,783	2025/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,062	171,656	2026/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	559	90,389	2047/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	135	21,940	2086/11/02
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,187	191,831	2027/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	378	61,078	2117/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	1,106	178,760	2028/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,141	184,374	2029/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	980	824	133,184	2030/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	664	107,342	2051/03/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	234	37,866	2040/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.8500	350	150	24,252	2120/06/30
		Austria Government Bond	国債証券	—	1,200	978	157,972	2031/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	480	460	74,302	2025/04/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	416	67,293	2036/10/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	300	128	20,701	2071/04/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	262	42,433	2028/10/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,500	1,280	206,775	2032/02/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	226	36,660	2049/05/23
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	293	47,473	2026/07/15

区分		銘柄	種類	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	当期末 償還年月日
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	300	298	48,149	2033/02/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1500	300	290	46,995	2053/10/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,000	1,009	162,976	2029/05/23
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	800	829	134,014	2030/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	923	149,125	2027/07/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,373	1,514	244,538	2037/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	912	147,378	2026/03/15
		Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	374	60,493	2062/01/26
		Austria Government Bond	国債証券	3.1500	723	712	114,996	2044/06/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	728	117,613	2034/05/23
国小計	銘柄数	30銘柄						
	金額				23,038	20,415	3,297,356	
通貨小計	銘柄数	375銘柄						
	金額				617,102	568,392	91,801,136	
合計	銘柄数	974銘柄						
	金額						274,718,308	

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

■投資信託財産の構成

2023年11月30日現在

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
公社債	274,718,308	96.9
コール・ローン等、その他	8,689,892	3.1
投資信託財産総額	283,408,201	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＝147.07円、１カナダ・ドル＝108.21円、１オーストラリア・ドル＝97.45円、１シンガポール・ドル＝110.38円、１ニュージーランド・ドル＝90.70円、１イギリス・ポンド＝186.84円、１イスラエル・シュケル＝39.913円、１デンマーク・クローネ＝21.66円、１ノルウェー・クローネ＝13.81円、１スウェーデン・クローネ＝14.21円、１メキシコ・ペソ＝8.51円、１オフショア・人民元＝20.60円、１マレーシア・リンギット＝31.591円、１ポーランド・ズロチ＝37.184円、１ユーロ＝161.51円です。
（注３）当期末における外貨建純資産（281,210,137千円）の投資信託財産総額（283,408,201千円）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

2023年11月30日現在

項　　目	当　期　末
(A)資産	**285, 400, 866, 913円**
コール・ローン等	6, 590, 468, 687
公社債（評価額）	274, 718, 308, 942
未収入金	1, 996, 027, 888
未収利息	2, 015, 893, 116
前払費用	80, 168, 280
(B)負債	**2, 065, 572, 763**
未払金	2, 000, 348, 669
未払解約金	65, 224, 094
(C)純資産総額（A－B）	**283, 335, 294, 150**
元本	82, 595, 678, 754
次期繰越損益金	200, 739, 615, 396
(D)受益権総口数	**82, 595, 678, 754口**
1万口当り基準価額（C／D）	**34, 304円**

＊期首における元本額は76, 340, 507, 617円、当作成期間中における追加設定元本額は11, 600, 344, 011円、同解約元本額は5, 345, 172, 874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	391, 220, 587円
ダイワ国内重視バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	7, 319, 300円
ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	40, 271, 896円
ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）	15, 003, 665円
ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）	206, 248, 674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）	566, 369, 227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）	804, 205, 846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）	3, 747, 848, 437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）	850, 255, 984円
Ｄ－Ｉ's外国債券インデックス	2, 616, 753円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	19, 605, 277円
ｉＦｒｅｅ　外国債券インデックス	2, 159, 651, 283円
ｉＦｒｅｅ　８資産バランス	2, 274, 181, 036円
ｉＦｒｅｅ　年金バランス	497, 028, 931円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	317, 728円
ＤＣダイワ外国債券インデックス	51, 424, 951, 579円
ダイワ・ライフ・バランス３０	1, 152, 680, 509円
ダイワ・ライフ・バランス５０	811, 578, 029円
ダイワ・ライフ・バランス７０	624, 049, 099円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	691, 231, 526円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／６分散コース）	546, 358, 716円
ＤＣダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	218, 171, 346円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	36, 831, 686円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	18, 569, 302円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1, 946, 640, 644円
ダイワつみたてインデックスバランス３０	4, 601, 402円
ダイワつみたてインデックスバランス５０	1, 919, 154円
ダイワつみたてインデックスバランス７０	3, 291, 011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）	1, 093, 939, 740円
ダイワ世界バランスファンド４０ＶＡ	93, 247, 794円
ダイワ世界バランスファンド６０ＶＡ	25, 462, 305円
ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ	2, 826, 420, 113円
ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	174, 572, 917円
ダイワ・インデックスセレクト　外国債券	160, 388, 033円
ダイワ・ノーロード　外国債券ファンド	66, 632, 761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）	3, 178, 053, 407円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5, 811, 265, 010円
ダイワライフスタイル２５	26, 830, 233円
ダイワライフスタイル５０	59, 333, 757円
ダイワライフスタイル７５	16, 514, 057円

＊当期末の計算口数当りの純資産額は34, 304円です。

■損益の状況

当期　自 2022年12月１日　至 2023年11月30日

項　　目	当　　期
(A)配当等収益	**6, 381, 972, 000円**
受取利息	6, 382, 966, 582
その他収益金	2, 981
支払利息	△　997, 563
(B)有価証券売買損益	**15, 539, 154, 653**
売買益	23, 993, 198, 028
売買損	△　8, 454, 043, 375
(C)その他費用	△　**34, 763, 152**
(D)当期損益金（A＋B＋C）	**21, 886, 363, 501**
(E)前期繰越損益金	**165, 011, 810, 967**
(F)解約差損益金	△　**11, 882, 066, 402**
(G)追加信託差損益金	**25, 723, 507, 330**
(H)合計（D＋E＋F＋G）	**200, 739, 615, 396**
次期繰越損益金（H）	**200, 739, 615, 396**

（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８期
（決算日　2024年６月17日）
（作成対象期間　2023年６月16日～2024年６月17日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／不動産投信（リート）／インデックス型		
信託期間	無期限（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。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券に投資し、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に連動する投資成果をあげ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/

<4663>

最近5期の運用実績

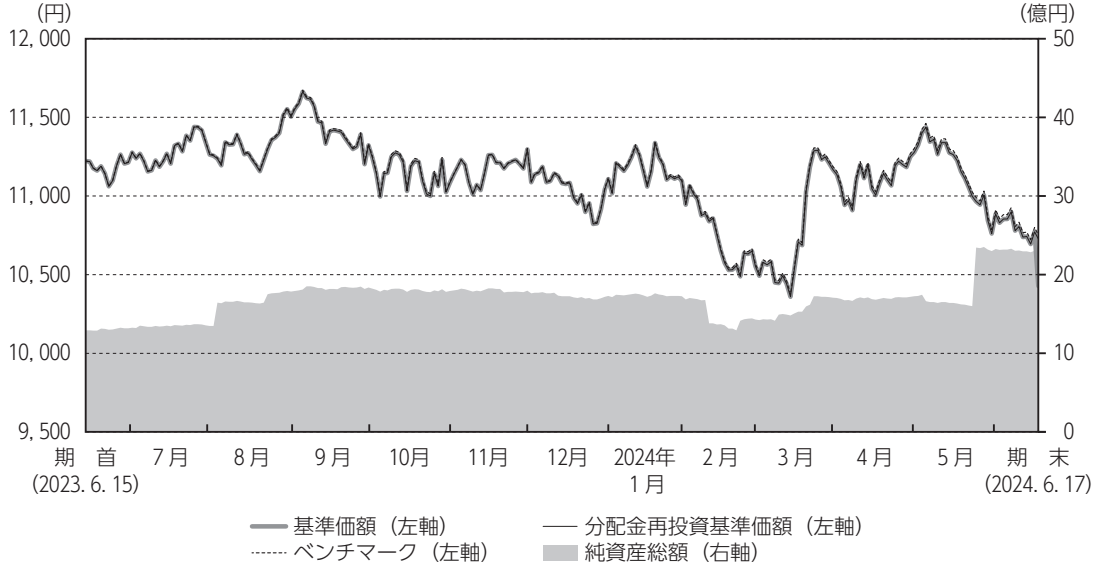
決算期	基準価額			東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）		投資証券組入比率	不動産投信指数先物比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
4期末（2020年6月15日）	9,599	300	△ 12.7	3,448.87	△ 12.3	99.3	2.7	569
5期末（2021年6月15日）	12,784	310	36.4	4,720.99	36.9	99.3	2.5	1,329
6期末（2022年6月15日）	11,244	300	△ 9.7	4,278.73	△ 9.4	99.8	2.4	1,133
7期末（2023年6月15日）	11,222	360	3.0	4,424.14	3.4	100.5	2.3	1,291
8期末（2024年6月17日）	10,428	300	△ 4.4	4,239.82	△ 4.2	99.2	3.0	2,228

（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。

配当込み東証ＲＥＩＴ指数（本書類における「東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）」をいう。）の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）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・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有する。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。当ファンドは、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負わない。

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：11,222円
期　末：10,428円（分配金300円）
騰落率：△4.4%（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）		投資証券組入比率	不動産投信指数先物比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率		
	円	%		%	%	%
（期首）2023年６月15日	11,222	—	4,424.14	—	100.5	2.3
６月末	11,213	△ 0.1	4,421.28	△ 0.1	97.7	2.2
７月末	11,340	1.1	4,472.88	1.1	97.7	2.3
８月末	11,505	2.5	4,539.20	2.6	97.7	2.3
９月末	11,322	0.9	4,468.30	1.0	97.6	2.3
10月末	11,084	△ 1.2	4,372.14	△ 1.2	97.6	2.4
11月末	11,297	0.7	4,455.46	0.7	97.6	2.4
12月末	11,108	△ 1.0	4,382.85	△ 0.9	97.5	2.5
2024年１月末	11,095	△ 1.1	4,378.56	△ 1.0	97.4	2.6
２月末	10,553	△ 6.0	4,166.74	△ 5.8	97.3	2.7
３月末	11,168	△ 0.5	4,410.17	△ 0.3	97.2	2.7
４月末	11,279	0.5	4,455.74	0.7	97.2	2.8
５月末	10,886	△ 3.0	4,302.09	△ 2.8	97.1	2.9
（期末）2024年６月17日	10,728	△ 4.4	4,239.82	△ 4.2	99.2	3.0

（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

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■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、当作成期首から2023年７月中旬にかけて、日銀の金融政策を巡る不透明感などから、横ばい圏で推移しました。７月末に日銀が長短金利操作の修正を発表し一時下落しましたが、９月上旬にかけては、国内長期金利上昇への警戒感後退から国内リート市況は上昇しました。９月中旬から12月下旬にかけては、金融政策の早期修正が警戒され、長期金利の上昇が続いたことや需給悪化などにより下落しました。12月末から2024年１月前半にかけては、日銀が金融政策を据え置いたことや国内リート市況の割安感が意識されたこともあり、上昇しました。１月後半から３月前半にかけては、米国を中心とした商業用不動産への懸念、公募増資発表による需給悪化懸念、日銀の金融政策正常化への警戒感などの複合的な要因から下落しました。３月後半は、金融政策を巡る不透明感の後退から、金融政策決定会合前後に大幅に反発しました。４月から５月上旬にかけて、国内長期金利は上昇しましたが、複数の自己投資口取得が発表されたことなどが押し上げ要因となり、国内リート市況は底堅く推移しました。５月中旬以降は、日銀が国債買い入れを減額したことなどを受けて長期金利が１％を超えて上昇する中、国内リート市況は下落しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「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

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■当ファンド

国内リートへの投資は、「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の受益証券を通じて行いました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

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

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

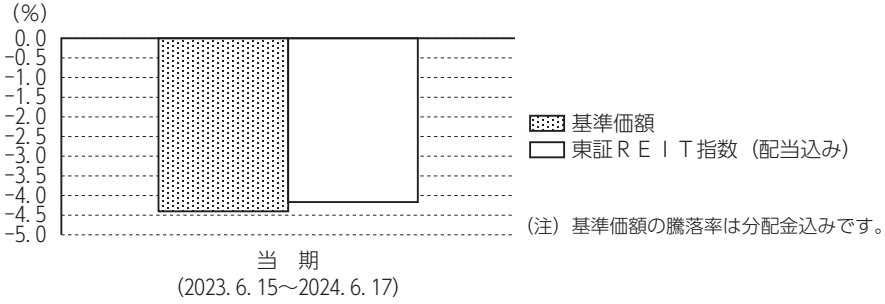
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）

ベンチマークとの差異について

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

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



＊ベンチマークは東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）です。

分配金について

当作成期の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
		2023年６月16日～2024年６月17日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**300**
対基準価額比率	（％）	2.80
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）	2,139

（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。
（注４）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。

■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	✓ 309.95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	2,064.61
（ｄ）分配準備積立金	64.91
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	2,439.49
（ｆ）分配金	300.00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	2,139.49

（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

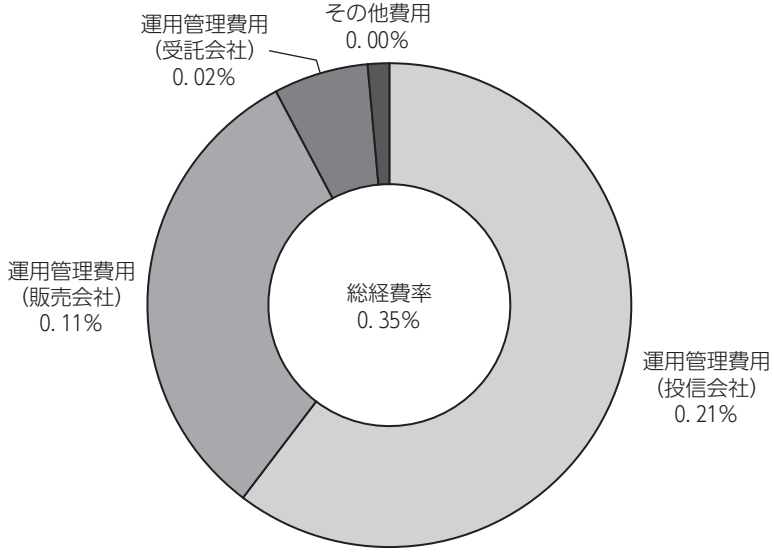
項　　目	当　期 (2023. 6. 16～2024. 6. 17)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	38円	0. 343%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は11, 114円です。**
(投 信 会 社)	(23)	(0. 210)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(12)	(0. 111)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0. 022)	受託会社分は、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. 003	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 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. 005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合　　計	39	0. 351	

(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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	506,992	1,637,390	184,736	594,570

（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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資証券	24,715	959	3.9	135,264	—	—
不動産投信指数先物取引	39,637	—	—	40,051	—	—
コール・ローン	1,559,433	—	—	—	—	—

（注）平均保有割合0.4％
※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

（2023年６月16日から2024年６月17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
投資証券	947	4,054	9,459

（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

（2023年６月16日から2024年６月17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
投資証券	3,103

（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	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	406,375	728,631	2,291,254

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年６月17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	2, 291, 254	99. 8
コール・ローン等、その他	3, 938	0. 2
投資信託財産総額	2, 295, 192	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

2024年６月17日現在

項　　目	当　期　末
（Ａ）資産	**2, 295, 192, 818円**
コール・ローン等	3, 918, 351
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（評価額）	2, 291, 254, 467
未収入金	20, 000
（Ｂ）負債	**67, 118, 162**
未払収益分配金	64, 100, 692
未払信託報酬	2, 969, 664
その他未払費用	47, 806
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）	**2, 228, 074, 656**
元本	2, 136, 689, 750
次期繰越損益金	91, 384, 906
（Ｄ）受益権総口数	**2, 136, 689, 750口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）	**10, 428円**

＊期首における元本額は1, 150, 653, 836円、当作成期間中における追加設定元本額は1, 494, 983, 095円、同解約元本額は508, 947, 181円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は10, 428円です。

■損益の状況

当期　自 2023年６月16日　至 2024年６月17日

項　　目		当　　期
（Ａ）配当等収益		**380円**
受取利息		590
支払利息	△	210
（Ｂ）有価証券売買損益	△	**70, 736, 265**
売買益		15, 724, 280
売買損	△	86, 460, 545
（Ｃ）信託報酬等	△	**5, 890, 197**
（Ｄ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	△	**76, 626, 082**
（Ｅ）前期繰越損益金	△	**68, 780, 621**
（Ｆ）追加信託差損益金		**300, 892, 301**
（配当等相当額）	(	441, 144, 677)
（売買損益相当額）	(△	140, 252, 376)
（Ｇ）合計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）		**155, 485, 598**
（Ｈ）収益分配金	△	**64, 100, 692**
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）		**91, 384, 906**
追加信託差損益金		300, 892, 301
（配当等相当額）	(	441, 144, 677)
（売買損益相当額）	(△	140, 252, 376)
分配準備積立金		15, 998, 053
繰越損益金	△	225, 505, 448

（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	66, 227, 781円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	0
（ｃ）収益調整金	441, 144, 677
（ｄ）分配準備積立金	13, 870, 964
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	521, 243, 422
（ｆ）分配金	64, 100, 692
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	457, 142, 730
（ｈ）受益権総口数	2, 136, 689, 750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（2024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（2024年６月17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

投資証券

（2023年６月16日から2024年６月17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
産業ファンド	12.847	1,686,131	131,247	日本ビルファンド	15.082	9,003,958	597,000
インヴィンシブル投資法人	25.823	1,535,358	59,457	ジャパンリアルエステイト	13.278	7,389,501	556,522
日本ビルファンド	1.847	1,114,708	603,523	日本都市ファンド投資法人	72.602	6,972,908	96,042
ジャパンリアルエステイト	1.701	974,456	572,872	野村不動産マスターＦ	41.811	6,621,883	158,376
アドバンス・レジデンス	2.706	910,895	336,620	日本プロロジスリート	22.522	6,060,626	269,098
星野リゾート・リート	1.508	864,219	573,090	ＧＬＰ投資法人	44.273	5,899,043	133,242
野村不動産マスターＦ	5.124	840,544	164,040	KDX 不動産投資法人	30.168	5,091,493	168,771
日本プロロジスリート	2.898	811,022	279,856	大和ハウスリート投資法人	19.491	5,078,059	260,533
スターアジア不動産投	14.467	795,277	54,971	アドバンス・レジデンス	14.648	4,847,340	330,921
イオンリート投資	5.264	782,492	148,649	オリックス不動産投資	25.76	4,352,550	168,965

（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、2024年６月17日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（103,664,583千口）の内容です。

(1) 国内投資証券

銘柄	2024年６月17日現在	
	口数	評価額
	千口	千円
エスコンジャパンリート	6.503	770,605
サンケイリアルエステート	10.249	852,716
SOSILA 物流リート投	15.963	1,835,745
東海道リート投資法	5.466	665,212
日本アコモデーションファンド投資法人	11.047	7,070,080
森ヒルズリート	37.622	4,887,097
産業ファンド	58.274	7,115,255
アドバンス・レジデンス	31.39	10,044,800
ＡＰＩ投資法人	16.784	6,151,336
ＧＬＰ投資法人	107.466	13,959,833
コンフォリア・レジデンシャル	15.732	4,947,714
日本プロロジスリート	55.734	13,939,073
星野リゾート・リート	6.724	3,422,516
Ｏｎｅリート投資法人	5.581	1,423,155
イオンリート投資	39.245	5,168,566
ヒューリックリート投資法	29.933	4,301,372

銘柄	2024年６月17日現在	
	口数	評価額
	千口	千円
日本リート投資法人	10.392	3,450,144
積水ハウス・リート投資	96.138	7,441,081
トーセイ・リート投資法人	6.737	925,663
ヘルスケア＆メディカル投資	7.888	997,043
サムティ・レジデンシャル	8.717	905,696
野村不動産マスターＦ	103.46	14,515,438
いちごホテルリート投資	5.3	577,700
ラサールロジポート投資	40.897	6,003,679
スターアジア不動産投	49.307	2,923,905
マリモ地方創生リート	4.931	643,988
三井不ロジパーク	13.307	5,735,317
日本ホテル＆レジデンシャル投資法人	4.892	362,986
投資法人みらい	43.906	1,951,621
三菱地所物流 REIT	11.047	4,148,148
CRE ロジスティクスファンド	13.773	1,957,143
ザイマックス・リート	5.189	608,669

銘柄		2024年６月17日現在	
		口数	評価額
		千口	千円
タカラレーベン不動産投		17.043	1,680,439
アドバンス・ロジスティクス投資法人		14.019	1,668,261
日本ビルファンド		37.323	21,610,017
ジャパンリアルエステイト		32.864	16,662,048
日本都市ファンド投資法人		153.354	13,771,189
オリックス不動産投資		63.747	10,046,527
日本プライムリアルティ		21.88	7,154,760
NTT 都市開発リート投資法人		32.437	3,756,204
東急リアル・エステート		21.45	3,318,315
グローバル・ワン不動産投資法人		23.624	2,352,950
ユナイテッド・アーバン投資法人		71.567	10,176,827
森トラストリート投資法人		61.668	4,236,591
インヴィンシブル投資法人		154.905	10,518,049
フロンティア不動産投資		11.871	5,282,595
平和不動産リート		24.793	3,247,883
日本ロジスティクスファンド投資法人		20.421	5,419,733
福岡リート投資法人		16.547	2,614,426
KDX 不動産投資法人		90.657	13,825,192
いちごオフィスリート投資法人		26.217	2,131,442
大和証券オフィス投資法人		13.255	3,706,098
阪急阪神リート投資法人		15.254	2,001,324
スターツプロシード投資法人		5.546	1,111,418
大和ハウスリート投資法人		48.226	11,800,902
ジャパン・ホテル・リート投資法人		107.1	8,450,190
大和証券リビング投資法人		47.114	4,848,030
ジャパンエクセレント投資法人		27.805	3,342,161
合計	口数、金額	2,040.281	314,436,883
	銘柄数＜比率＞	58 銘柄	<96.5%>

（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		2024年６月17日現在	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
国内	東証ＲＥＩＴ	9,492	—

（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40期（決算日　2024年３月15日）

（作成対象期間　2023年９月16日～2024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。

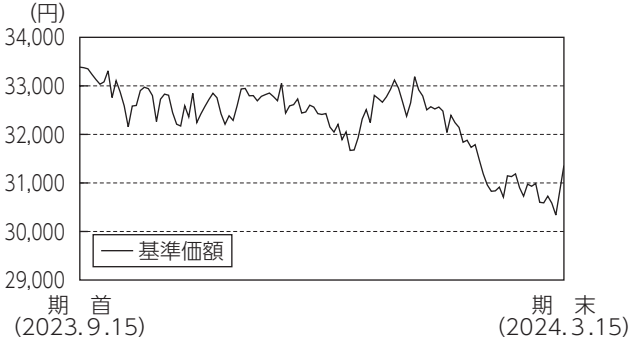
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	「東証ＲＥＩＴ指数」（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年　月　日	基準価額		東証ＲＥＩＴ指数(配当込み)		投資証券組入比率	不動産投信指数先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2023年９月15日	33,386	－	4,505.79	－	97.2	2.3
９月末	33,106	△0.8	4,468.30	△0.8	97.7	2.3
10月末	32,421	△2.9	4,372.14	△3.0	97.6	2.4
11月末	33,052	△1.0	4,455.46	△1.1	97.6	2.4
12月末	32,510	△2.6	4,382.85	△2.7	97.5	2.5
2024年１月末	32,481	△2.7	4,378.56	△2.8	97.4	2.6
２月末	30,903	△7.4	4,166.74	△7.5	97.4	2.7
(期末)2024年３月15日	31,359	△6.1	4,228.19	△6.2	96.8	2.7

（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：33,386円　期末：31,359円　騰落率：△6.1％

【基準価額の主な変動要因】

わが国のリートに投資し、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、日銀の金融政策正常化への警戒感などを背景に国内リート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。

◆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、日米で長期金利の上昇が続き、値動きの大きな推移の中で水準を切り下げました。2023年10月末の金融政策決定会合で日銀は長短金利操作の運用をさらに柔軟化することを決定しました。日米長期金利の上昇に加えて、中東での地政学リスクの高まりも嫌気され、軟調な推移が続きました。12月に入ってからも、植田日銀総裁の国会答弁を受けて金融政策の早期修正が警戒されたことや国内リートへ投資する投資信託からの資金流出などにより、下落しました。しかしその後は、一部で政策修正への思惑があった日銀金融政策決定会合で金融政策が据え置かれたことや国内リート市場の割安感が意識されたこともあり、12月末から2024年１月前半にかけて上昇しました。１月後半以降は、融資の不良債権化を機に米国を中心とした商業用不動産への懸念が広がったこと、相場が軟調な中での公募増資の発表が相次ぎ需給悪化懸念が強まったこと、日銀の金融政策正常化への警戒感、国内リートから好調な日本株への資金シフトなどを背景に、再び下落しました。当作成期末にかけては、日銀の金融政策正常化に対する織り込みが進んだことが一因となり、上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

わが国のリートに投資し、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△6.2％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△6.1％となりました。

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

＊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	0円
（先物・オプション）	(0)
（投資証券）	(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) 投資証券

(2023年９月16日から2024年３月15日まで)

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千円	千口	千円
国内	エスコンジャパンリート	0.14	16,485	1.461	170,995
	サンケイリアルエステート	0.219	19,850	2.301	206,828
	ＳＯＳＩＬＡ物流リート投	0.34	40,422	3.583	424,657
	東海道リート投資法	0.895	111,914	1.091	136,441
	日本アコモデーションファンド投資法人	0.234	142,250	2.478	1,490,549
	森ヒルズリート	0.801	110,751	8.442	1,159,899
	産業ファンド	11.432	1,479,958	10.996	1,481,965
	アドバンス・レジデンス	1.905	629,151	6.983	2,238,103
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	△29.677	△ 6,712,935	0.792	178,893
	ＡＰＩ投資法人	0.359	143,883	3.768	1,488,625
	ＧＬＰ投資法人	2.304	304,116	24.255	3,220,591
	コンフォリア・レジデンシャル	0.334	104,972	3.53	1,095,848
	日本プロロジスリート	1.188	317,896	12.508	3,337,752
	星野リゾート・リート	0.127	73,629	1.326	764,013
	Ｏｎｅリート投資法人	0.119	31,392	1.253	327,886
	イオンリート投資	0.835	117,283	8.806	1,225,677
	ヒューリックリート投資法	0.64	98,431	6.72	1,015,838
	日本リート投資法人	0.22	75,715	2.331	793,342
	積水ハウス・リート投資	2.052	161,532	21.579	1,686,653
	トーセイ・リート投資法人	0.143	19,831	1.512	207,426
	ケネディクス商業リート	△17.573	△ 5,046,963	0.47	135,502
	ヘルスケア＆メディカル投資	0.168	23,247	1.77	242,594
	サムティ・レジデンシャル	0.185	20,261	1.956	211,646
	野村不動産マスターＦ	2.207	357,415	23.221	3,713,133
	いちごホテルリート投資	0.112	12,572	1.189	130,258
	ラサールロジポート投資	0.872	128,695	9.179	1,359,952
	スターアジア不動産投	1.052	60,752	11.067	636,500
	マリモ地方創生リート	0.105	13,030	1.107	137,101
	三井不ロジパーク	0.285	129,516	2.988	1,353,509
	日本ホテル＆レジデンシャル投資法人	0.104	7,324	1.097	76,854
	投資法人みらい	4.449	195,760	9.486	421,611
	三菱地所物流ＲＥＩＴ	0.237	87,748	2.481	917,478
	ＣＲＥロジスティクスファンド	0.294	45,583	3.091	477,395
	ザイマックス・リート	0.111	13,012	1.165	135,898
	タカラレーベン不動産投	2.405	228,503	3.437	341,217
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	0.298	37,193	3.145	391,734
	日本ビルファンド	0.794	479,118	8.374	5,023,413
	ジャパンリアルエステイト	0.701	398,599	7.376	4,151,879
	日本都市ファンド投資法人	3.271	317,074	34.419	3,339,190
	オリックス不動産投資	1.357	230,690	14.305	2,397,602
	日本プライムリアルティ	0.466	164,420	4.91	1,707,611
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	2.732	345,144	7.138	896,028

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千円	千口	千円
	東急リアル・エステート	0.457	79,414	4.814	826,157
	グローバル・ワン不動産投資法人	0.503	56,054	5.301	583,767
	ユナイテッド・アーバン投資法人	1.526	226,568	16.062	2,360,157
	森トラストリート投資法人	1.315	96,019	13.84	1,000,189
	インヴィンシブル投資法人	3.306	204,573	34.769	2,093,111
	フロンティア不動産投資	0.253	111,879	2.664	1,165,417
	平和不動産リート	0.512	70,967	5.367	733,979
	日本ロジスティクスファンド投資法人	0.44	122,393	4.682	1,296,866
	福岡リート投資法人	0.353	59,238	3.714	618,115
	ＫＤＸ不動産投資法人	94.772	12,073,026	18.184	2,969,903
	いちごオフィスリート投資法人	0.558	46,652	5.883	484,859
	大和証券オフィス投資法人	0.142	90,821	1.488	950,508
	阪急阪神リート投資法人	0.325	45,755	3.423	477,948
	スターツプロシード投資法人	0.118	24,029	1.244	250,076
	大和ハウスリート投資法人	1.029	264,713	10.824	2,782,286
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	7.244	551,662	23.904	1,702,683
	大和証券リビング投資法人	4.374	476,009	10.405	1,099,100
	ジャパンエクセレント投資法人	0.596	75,898	6.244	785,647

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

（2023年９月16日から2024年３月15日まで）

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	不動産投信指数先物取引	19,527	19,744	－	－

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内投資証券

銘柄	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
エスコンジャパンリート	8.437	7.116	826,879
サンケイリアルエステート	13.296	11.214	965,525
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投	20.708	17.465	2,029,433
東海道リート投資法	6.176	5.98	729,560
日本アコモデーションファンド投資法人	14.331	12.087	7,143,417
森ヒルズリート	48.805	41.164	5,548,907
産業ファンド	63.326	63.762	8,365,574
アドバンス・レジデンス	39.423	34.345	10,921,710
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	30.469	－	－
ＡＰＩ投資法人	21.774	18.365	6,987,882
ＧＬＰ投資法人	140.196	118.245	14,449,539
コンフォリア・レジデンシャル	20.409	17.213	5,034,802
日本プロロジスリート	72.301	60.981	15,690,411
星野リゾート・リート	7.657	6.458	3,674,602
Ｏｎｅリート投資法人	7.24	6.106	1,536,269
イオンリート投資	50.911	42.94	5,809,782
ヒューリックリート投資法	38.831	32.751	4,758,720
日本リート投資法人	13.481	11.37	3,831,690
積水ハウス・リート投資	124.715	105.188	8,057,400
トーセイ・リート投資法人	8.74	7.371	1,019,409
ケネディクス商業リート	18.043	－	－
ヘルスケア＆メディカル投資	10.233	8.631	1,119,440
サムティ・レジデンシャル	11.309	9.538	982,414
野村不動産マスターＦ	134.214	113.2	15,927,240
いちごホテルリート投資	6.876	5.799	628,031
ラサールロジポート投資	53.054	44.747	6,738,898
スターアジア不動産投	63.964	53.949	2,983,379
マリモ地方創生リート	6.397	5.395	643,623
三井不ロジパーク	17.263	14.56	6,450,080
日本ホテル＆レジデンシャル投資法人	6.346	5.353	437,340
投資法人みらい	53.076	48.039	2,120,921
三菱地所物流ＲＥＩＴ	14.331	12.087	4,387,581
ＣＲＥロジスティクスファンド	17.867	15.07	2,200,220
ザイマックス・リート	6.732	5.678	649,563
タカラレーベン不動産投	19.678	18.646	1,814,255
アドバンス・ロジスティクス投資法人	18.186	15.339	1,834,544
日本ビルファンド	48.417	40.837	23,848,808
ジャパンリアルエステイト	42.632	35.957	19,165,081
日本都市ファンド投資法人	198.939	167.791	15,252,201
オリックス不動産投資	82.696	69.748	11,055,058
日本プライムリアルティ	28.384	23.94	7,648,830
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	39.896	35.49	4,184,271
東急リアル・エステート	27.827	23.47	3,891,326
グローバル・ワン不動産投資法人	30.646	25.848	2,804,508
ユナイテッド・アーバン投資法人	92.841	78.305	11,432,530
森トラストリート投資法人	79.999	67.474	4,736,674
インヴィンシブル投資法人	200.951	169.488	11,135,361
フロンティア不動産投資	15.399	12.988	5,656,274
平和不動産リート	31.009	26.154	3,530,790
日本ロジスティクスファンド投資法人	26.586	22.344	5,916,691
福岡リート投資法人	21.465	18.104	3,070,438
ＫＤＸ不動産投資法人	24.15	100.738	14,838,707
いちごオフィスリート投資法人	34.008	28.683	2,245,878
大和証券オフィス投資法人	8.598	7.252	4,126,388
阪急阪神リート投資法人	19.788	16.69	2,283,192
スターツプロシード投資法人	7.194	6.068	1,185,687
大和ハウスリート投資法人	62.561	52.766	12,990,989
ジャパン・ホテル・リート投資法人	133.842	117.182	9,046,450
大和証券リビング投資法人	57.58	51.549	5,268,307
ジャパンエクセレント投資法人	36.07	30.422	3,760,159
合計 口数、金額	2,560.273	2,225.44	345,373,653
合計 銘柄数<比率>	60銘柄	58銘柄	<96.8%>

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
国内	東証ＲＥＩＴ	9,584	－

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年３月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資証券	345,373,653	96.0
コール・ローン等、その他	14,407,539	4.0
投資信託財産総額	359,781,193	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

2024年３月15日現在

項　　目	当　期　末
(A) 資産	**361,352,643,215円**
コール・ローン等	5,082,932,204
投資証券(評価額)	345,373,653,650
未収入金	3,280,021,798
未収配当金	5,448,568,885
差入委託証拠金	2,167,466,678
(B) 負債	**4,579,175,000**
未払解約金	3,007,725,000
差入委託証拠金代用有価証券	1,571,450,000
(C) 純資産総額(A－B)	**356,773,468,215**
元本	113,768,872,324
次期繰越損益金	243,004,595,891
(D) 受益権総口数	**113,768,872,324口**
１万口当り基準価額(C／D)	**31,359円**

＊期首における元本額は136,170,179,908円、当作成期間中における追加設定元本額は3,881,492,329円、同解約元本額は26,282,799,913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	3,794,361,679円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）	95,435,523,388円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年１回決算型）	531,123,203円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	23,956,298円
ｉＦｒｅｅ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	711,794,341円
ｉＦｒｅｅ　８資産バランス	2,650,018,649円
ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（奇数月決算型）	46,005,317円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	214,693円
ＤＣ・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン	5,350,048,447円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	9,119,664円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	10,165,557円
ダイワ国内ＲＥＩＴインデックス（投資一任専用）	3,930,550円
ダイワ・ノーロード　Ｊ－ＲＥＩＴファンド	97,357,970円
ダイワファンドラップ　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	3,284,212,484円
ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）	487,721,674円
ダイワファンドラップオンライン　Ｊ－ＲＥＩＴインデックス	550,878,281円
スタイル９（６資産分散・保守型）	23,029円
スタイル９（６資産分散・バランス型）	470,057円
スタイル９（６資産分散・積極型）	264,264円
スタイル９（８資産分散・保守型）	24,326円
スタイル９（８資産分散・バランス型）	332,159円
スタイル９（８資産分散・積極型）	206,679円
ダイワ・インデックスセレクト　Ｊ－ＲＥＩＴ	781,119,615円

＊当期末の計算口数当りの純資産額は31,359円です。

■損益の状況

当期　自2023年９月16日　至2024年３月15日

項　　目	当　　期
(A) 配当等収益	**8,746,396,275円**
受取配当金	8,548,794,371
その他収益金	198,019,826
支払利息	△　417,922
(B) 有価証券売買損益	**△　33,852,129,470**
売買益	1,678,741,536
売買損	△　35,530,871,006
(C) 先物取引等損益	**△　648,704,000**
取引益	75,824,000
取引損	△　724,528,000
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**△　25,754,437,195**
(E) 前期繰越損益金	**318,453,435,352**
(F) 解約差損益金	**△　58,361,010,867**
(G) 追加信託差損益金	**8,666,608,601**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**243,004,595,891**
次期繰越損益金(H)	**243,004,595,891**

（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。

配当込み東証ＲＥＩＴ指数（本書類における「東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）」をいう。）の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）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・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有する。ＪＰＸは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。当ファンドは、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負わない。

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）

運用報告書（全体版）

第８期

（決算日　2024年６月17日）

（作成対象期間　2023年６月16日～2024年６月17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	無制限
	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、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に投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をあげ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

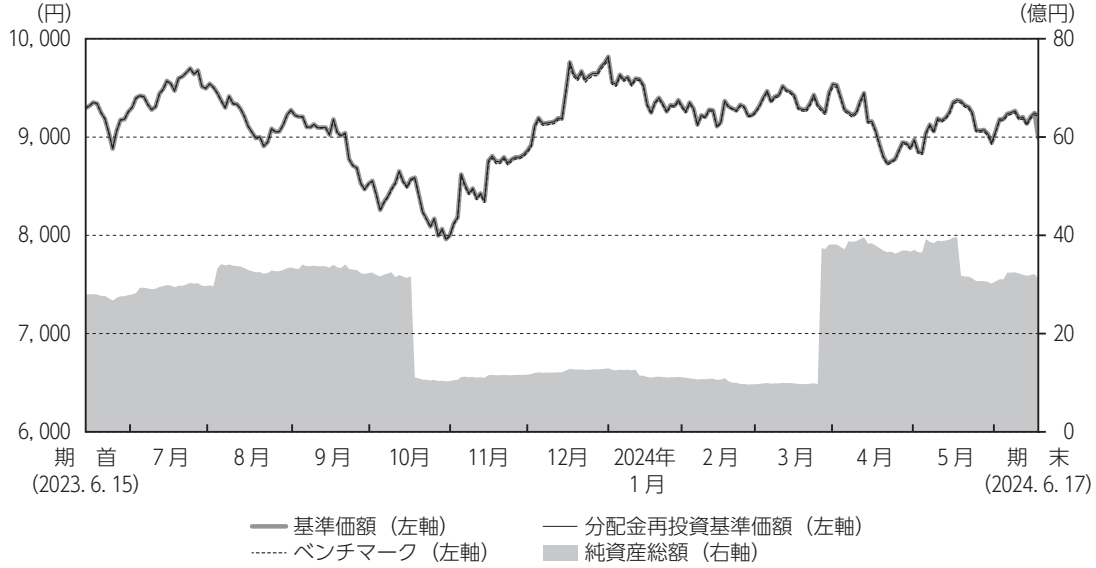
決算期	基準価額			Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数(除く日本)(税引後配当込み、円ヘッジ・円ベース)		投資信託受益証券組入比率	投資証券組入比率	不動産投信指数先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
4期末(2020年6月15日)	8,945	0	△ 15.5	9,469	△ 15.6	2.2	94.5	3.2	134
5期末(2021年6月15日)	11,846	160	34.2	12,656	33.7	0.7	99.0	1.6	3,546
6期末(2022年6月15日)	9,973	220	△ 14.0	10,881	△ 14.0	3.7	101.0	2.4	2,194
7期末(2023年6月15日)	9,295	240	△ 4.4	10,393	△ 4.5	2.3	98.2	3.4	2,791
8期末(2024年6月17日)	8,991	240	△ 0.7	10,300	△ 0.9	1.5	98.1	3.4	3,120

(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）（税引後配当込み、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。
(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）はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Ｓ＆Ｐ®、Ｓ＆Ｐ500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびCDX®は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「Ｓ＆Ｐ」）の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJIに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワＳＭＡ専用）は、SPDJI、Dow Jones、Ｓ＆Ｐ、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

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Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（税引後配当込み、円ヘッジ・円ベース）です。

■基準価額・騰落率

期　首：9,295円
期　末：8,991円（分配金240円）
騰落率：△0.7%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

「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」の受益証券を通じて海外リートに投資した結果、為替ヘッジコスト等の各種コスト要因に伴い、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、税引後配当込み、円ヘッジ・ベース)		投資信託受益証券組入比率	投資証券組入比率	不動産投信指数先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
	円	%		%	%	%	%
(期首)2023年6月15日	9,295	—	10,393	—	2.3	98.2	3.4
6月末	9,257	△ 0.4	10,345	△ 0.5	1.4	99.5	3.4
7月末	9,495	2.2	10,614	2.1	2.4	92.4	3.4
8月末	9,275	△ 0.2	10,366	△ 0.3	4.0	94.5	4.5
9月末	8,524	△ 8.3	9,523	△ 8.4	1.7	96.8	4.6
10月末	7,999	△ 13.9	8,935	△ 14.0	1.6	95.1	3.9
11月末	8,861	△ 4.7	9,886	△ 4.9	1.3	94.1	3.1
12月末	9,817	5.6	10,939	5.3	1.7	91.9	3.3
2024年1月末	9,317	0.2	10,400	0.1	3.0	96.0	5.9
2月末	9,257	△ 0.4	10,335	△ 0.6	1.4	97.5	4.2
3月末	9,538	2.6	10,633	2.3	0.4	95.7	3.8
4月末	8,973	△ 3.5	10,015	△ 3.6	1.3	100.0	3.0
5月末	9,058	△ 2.5	10,110	△ 2.7	0.8	95.9	3.6
(期末)2024年6月17日	9,231	△ 0.7	10,300	△ 0.9	1.5	98.1	3.4

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■海外リート市況

海外リート市況は、当作成期を通して見るとやや上昇しました。

海外リート市況は、当作成期首より、追加利上げ観測や長期金利の上昇などを嫌気し、下落して始まりました。2023年７月に入ると、米国におけるインフレ指標の鈍化や長期金利の低下が好感され上昇に転じましたが、８月以降は、米国国債の増発やＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）の政策金利見通しの引き上げ、米国政府機関の閉鎖懸念などから長期金利が大幅に上昇したことを受けて下落しました。10月に入ると、つなぎ予算の成立によって政府機関の閉鎖が回避され、一時的に反発しましたが、景気の先行き不透明感や企業業績の伸びの鈍化、パレスチナ情勢の悪化、長期金利のさらなる上昇などが嫌気され、続落しました。11月以降は、欧米のインフレ率が予想以上に鈍化し金利が低下したことや、ＦＲＢ議長が将来の利下げについての議論を始めたと述べたことを受けて利下げ観測が高まったことなどが好感され、上昇しました。2024年に入ると、米国を中心とした金利上昇から再度下落に転じました。２月以降については、決算発表が本格化する中でセクターや銘柄によって強弱感はあるものの、おおむね堅調な2024年通年の業績見通しとなり、米国長期金利が上昇する中でも底堅い推移となりました。４月に入ると長期金利の上昇が嫌気され、海外リート市況は再度下落しました。５月以降は米国の長期金利が下落する中で上昇に転じ、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

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および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、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 （2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■当ファンド

「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」の受益証券への投資をほぼ100％行いました。

■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

先進国（日本を除きます。）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、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。

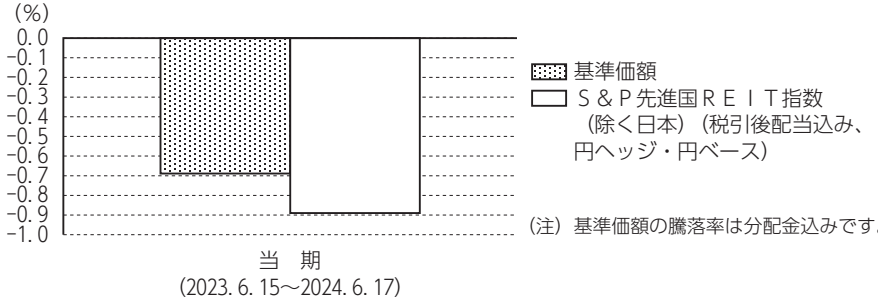
組入ファンド	ベンチマーク
先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（税引後配当込み、円ヘッジ・円ベース）

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△0. 9％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△0. 7％となりました。

マザーファンドについては、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。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



＊ベンチマークはＳ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（税引後配当込み、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 2023年６月16日 ～2024年６月17日
当期分配金（税込み）		**（円）**	**240**
	対基準価額比率	（％）	2.60
	当期の収益	（円）	240
	当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額		（円）	3,651

（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。
（注４）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。

■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	✓ 267.90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	3,536.92
（ｄ）分配準備積立金	86.74
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	3,891.57
（ｆ）分配金	240.00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	3,651.57

（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

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および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、ＥＴＦ（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

1万口当りの費用の明細

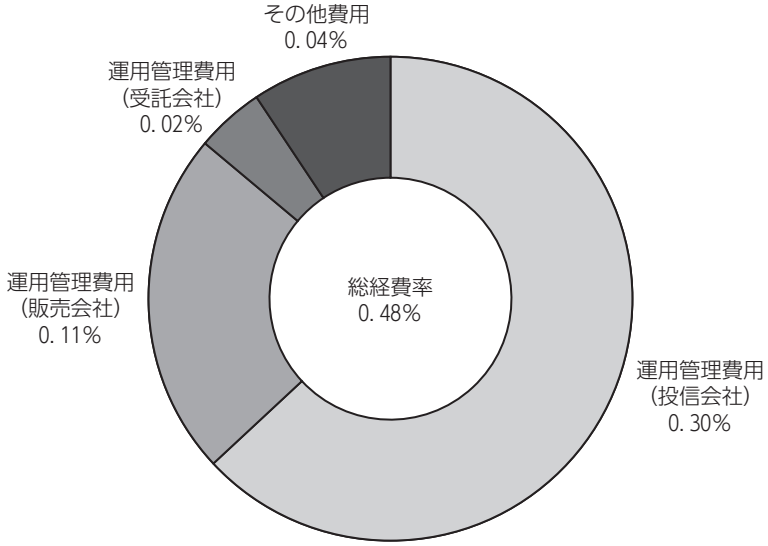
項目	当期 (2023. 6. 16～2024. 6. 17) 金額	比率	項目の概要
信託報酬	40円	0. 437%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は9, 125円です。**
(投信会社)	(28)	(0. 304)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(10)	(0. 111)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(2)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	2	0. 025	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(1)	(0. 007)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0. 004)	
(投資証券)	(1)	(0. 013)	
有価証券取引税	1	0. 010	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託受益証券)	(0)	(0. 000)	
(投資証券)	(1)	(0. 010)	
その他費用	4	0. 045	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. 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)	(2)	(0. 018)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	47	0. 517	

（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。

■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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	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	4, 906, 687	4, 148, 270	4, 492, 880	3, 614, 156

（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	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	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	3, 397, 474	3, 811, 282	3, 204, 144

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年６月17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	3, 204, 144	99. 9
コール・ローン等、その他	4, 412	0. 1
投資信託財産総額	3, 208, 557	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17日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝157. 53円、１カナダ・ドル＝114. 69円、１オーストラリア・ドル＝104. 17円、１香港・ドル＝20. 16円、１シンガポール・ドル＝116. 47円、１ニュージーランド・ドル＝96. 66円、１イギリス・ポンド＝199. 87円、１イスラエル・シュケル＝42. 35円、100韓国・ウォン＝11. 43円、１ユーロ＝168. 64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（25, 257, 114千円）の投資信託財産総額（25, 466, 327千円）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

2024年６月17日現在

項目	当期末
（Ａ）資産	**3, 208, 557, 010円**
コール・ローン等	4, 412, 137
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）	3, 204, 144, 873
（Ｂ）負債	**88, 216, 793**
未払収益分配金	83, 291, 561
未払信託報酬	4, 863, 744
その他未払費用	61, 488
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）	**3, 120, 340, 217**
元本	3, 470, 481, 712
次期繰越損益金	△ 350, 141, 495
（Ｄ）受益権総口数	**3, 470, 481, 712口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）	**8, 991円**

＊期首における元本額は3, 002, 880, 833円、当作成期間中における追加設定元本額は4, 481, 040, 966円、同解約元本額は4, 013, 440, 087円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は8, 991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350, 141, 495円です。

■損益の状況

当期　自 2023年６月16日　至 2024年６月17日

項　　目	当　　期
（Ａ）配当等収益	**316円**
受取利息	669
支払利息	△ 353
（Ｂ）有価証券売買損益	△ **9, 490, 157**
売買益	193, 921, 640
売買損	△ 203, 411, 797
（Ｃ）信託報酬等	△ **10, 431, 590**
（Ｄ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	△ **19, 921, 431**
（Ｅ）前期繰越損益金	△ **41, 606, 139**
（Ｆ）追加信託差損益金	△ **205, 322, 364**
（配当等相当額）	(1, 227, 484, 674)
（売買損益相当額）	(△ 1, 432, 807, 038)
（Ｇ）合計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	△ **266, 849, 934**
（Ｈ）収益分配金	△ **83, 291, 561**
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	△ **350, 141, 495**
追加信託差損益金	△ 205, 322, 364
（配当等相当額）	(1, 227, 484, 674)
（売買損益相当額）	(△ 1, 432, 807, 038)
分配準備積立金	39, 789, 280
繰越損益金	△ 184, 608, 411

（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	92, 977, 217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, 227, 484, 674
（ｄ）分配準備積立金	30, 103, 624
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	1, 350, 565, 515
（ｆ）分配金	83, 291, 561
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	1, 267, 273, 954
（ｈ）受益権総口数	3, 470, 481, 712口

収　益　分　配　金　の　お　知　ら　せ	
１万口当り分配金（税込み）	240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」の決算日（2023年８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（2024年６月17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

（2023年６月16日から2024年６月17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）	330. 11	4, 063, 872	12, 310	VANGUARD REAL ESTATE ETF（アメリカ）	345. 46	4, 234, 672	12, 258

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

(2)投資証券

（2023年６月16日から2024年６月17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）	19. 297	365, 710	18, 951	PROLOGIS INC（アメリカ）	28. 263	472, 743	16, 726
WELLTOWER INC（アメリカ）	20. 552	263, 638	12, 827	EQUINIX INC（アメリカ）	2. 841	321, 039	113, 002
EQUINIX INC（アメリカ）	2. 086	247, 152	118, 481	WELLTOWER INC（アメリカ）	15. 973	217, 390	13, 609
REALTY INCOME CORP（アメリカ）	27. 64	228, 033	8, 250	PUBLIC STORAGE（アメリカ）	4. 825	201, 168	41, 692
DIGITAL REALTY TRUST INC（アメリカ）	10. 173	204, 023	20, 055	GOODMAN GROUP（オーストラリア）	71. 249	192, 288	2, 698
GOODMAN GROUP（オーストラリア）	54. 292	145, 727	2, 684	SIMON PROPERTY GROUP INC（アメリカ）	10. 141	191, 645	18, 898
SIMON PROPERTY GROUP INC（アメリカ）	6. 812	142, 242	20, 881	REALTY INCOME CORP（アメリカ）	22. 729	185, 799	8, 174
PUBLIC STORAGE（アメリカ）	3. 293	137, 865	41, 866	DIGITAL REALTY TRUST INC（アメリカ）	8. 964	175, 095	19, 533
VICI PROPERTIES INC（アメリカ）	24. 475	109, 361	4, 468	VICI PROPERTIES INC（アメリカ）	30. 821	137, 851	4, 472
EXTRA SPACE STORAGE INC（アメリカ）	4. 286	89, 619	20, 909	AVALONBAY COMMUNITIES INC（アメリカ）	4. 33	121, 999	28, 175

（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、2024年６月17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（30, 158, 213千口）の内容です。

(1)外国投資信託受益証券

銘柄		2024年６月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
VANGUARD REAL ESTATE ETF		28. 91	2, 428	382, 552
合計	口数、金額	28. 91	2, 428	382, 552
	銘柄数＜比率＞	1 銘柄		<1. 5%>

（注１）邦貨換算金額は、2024年６月17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)外国投資証券

銘柄	2024年6月17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)			
DIGITAL CORE REIT UNITS	90.4	48	7,689
MANULIFE US REAL ESTATE INV	203.4	13	2,178
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	82.3	11	1,815
PRIME US REIT	75.24	8	1,386
(アメリカ)			
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	13.726	190	30,033
URBAN EDGE PROPERTIES	13.4	240	37,848
XENIA HOTELS & RESORTS INC	11.983	170	26,880
AVALONBAY COMMUNITIES INC	16.157	3,261	513,852
SIMON PROPERTY GROUP INC	37.123	5,525	870,355
BOSTON PROPERTIES INC	16.446	1,013	159,693
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	15.763	127	20,038
VORNADO REALTY TRUST	18.21	463	72,949
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11.191	136	21,454
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8.798	359	56,616
UNITI GROUP INC	27.186	74	11,777
NEXPOINT RESIDENTIAL	2.686	99	15,689
EQUITY RESIDENTIAL	39.315	2,622	413,154
APPLE HOSPITALITY REIT INC	24.238	349	55,134
EPR PROPERTIES	8.58	346	54,510
CITY OFFICE REIT INC	4.603	22	3,560
GLOBAL NET LEASE INC	22.246	160	25,266
EQUINIX INC	10.694	8,194	1,290,861
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10.316	251	39,619
CHATHAM LODGING TRUST	5.858	48	7,640
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6.801	672	105,882
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	14.352	176	27,831
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2.761	64	10,164
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6.929	20	3,198
HOST HOTELS & RESORTS INC	80.352	1,431	225,562
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	36.227	1,283	202,250
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	14.429	71	11,251
RLJ LODGING TRUST	18.046	172	27,205
FARMLAND PARTNERS INC	5.044	57	9,058
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	7.677	84	13,351
KIMCO REALTY CORP	75.877	1,422	224,116
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7.392	66	10,503
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	43.383	715	112,763
WHITESTONE REIT	5.635	75	11,877
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	30.414	1,320	207,982
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14.81	105	16,541
PARK HOTELS & RESORTS INC	23.918	351	55,311
INVITATION HOMES INC	65.522	2,326	366,419
JBG SMITH PROPERTIES	9.92	145	22,971
ALEXANDER & BALDWIN INC	8.527	140	22,177
CLIPPER REALTY INC	1.647	6	952
GLADSTONE LAND CORP	3.874	51	8,165

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	2024年6月17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
AMERICOLD REALTY TRUST	30.357	773	121,896
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7.31	27	4,341
VICI PROPERTIES INC	117.838	3,333	525,147
BRT APARTMENTS CORP	1.402	24	3,823
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3.194	340	53,645
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17.772	490	77,269
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4.309	90	14,220
BROADSTONE NET LEASE INC	21.329	325	51,340
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	12.254	71	11,215
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5.727	123	19,532
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	25.563	458	72,203
PARAMOUNT GROUP INC	19.418	90	14,193
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	15.377	143	22,576
NETSTREIT CORP	8.076	138	21,818
APARTMENT INCOME REIT CO	16.457	640	100,898
CTO REALTY GROWTH INC	2.544	44	6,981
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	24.005	1,076	169,524
STAG INDUSTRIAL INC	20.682	723	113,900
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1.311	19	3,116
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2.551	33	5,300
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	13.899	447	70,567
ORION OFFICE REIT INC	6.028	20	3,257
VENTAS INC	45.833	2,296	361,725
CARETRUST REIT INC	14.865	374	58,940
INVENTRUST PROPERTIES CORP	7.938	196	30,911
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	34.239	762	120,170
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	6.148	13	2,169
SABRA HEALTH CARE REIT INC	26.337	376	59,287
UMH PROPERTIES INC	7.337	113	17,822
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	2.807	61	9,670
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	4.276	20	3,260
PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	4.102	47	7,411
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	1.634	40	6,396
IRON MOUNTAIN INC	33.259	2,927	461,162
TERRENO REALTY CORP	10.65	617	97,289
SUN COMMUNITIES INC	14.175	1,653	260,455
ACADIA REALTY TRUST	12.022	207	32,763
ALEXANDER'S INC	0.272	58	9,137
PROLOGIS INC	105.244	11,817	1,861,665
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17.937	2,086	328,675
BRANDYWINE REALTY TRUST	20.23	92	14,595
SAUL CENTERS INC	1.633	59	9,451
VERIS RESIDENTIAL INC	9.426	142	22,436
CAMDEN PROPERTY TRUST	12.162	1,313	206,991
COUSINS PROPERTIES INC	17.288	399	62,882
SITE CENTERS CORP	20.504	298	47,028
EASTGROUP PROPERTIES INC	5.433	901	141,953
ESSEX PROPERTY TRUST INC	7.313	2,036	320,836
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	15.067	715	112,717

銘柄		2024年6月17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
FEDERAL REALTY INVS TRUST		8.367	846	133,373
GETTY REALTY CORP		5.592	149	23,581
WELLTOWER INC		63.043	6,558	1,033,238
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		80.634	1,584	249,599
HIGHWOODS PROPERTIES INC		12.041	309	48,710
SERVICE PROPERTIES TRUST		19.486	96	15,133
EQUITY COMMONWEALTH		12.155	233	36,802
KILROY REALTY CORP		12.161	386	60,958
LTC PROPERTIES INC		4.717	158	25,011
LXP INDUSTRIAL TRUST		33.332	293	46,206
MID-AMERICA APARTMENT COMM		13.294	1,852	291,764
MACERICH CO/THE		24.601	356	56,115
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		21.235	1,331	209,807
NATL HEALTH INVESTORS INC		4.945	328	51,755
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		20.785	875	137,911
REALTY INCOME CORP		94.728	5,055	796,413
COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST		12.781	311	49,086
PUBLIC STORAGE		18.026	5,105	804,326
REGENCY CENTERS CORP		18.712	1,155	182,079
SAFEHOLD INC		5.263	98	15,545
TANGER FACTORY OUTLET CENTER		12.266	331	52,267
SL GREEN REALTY CORP		7.373	419	66,122
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST		27.338	77	12,144
UDR INC		34.469	1,388	218,716
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME		1.44	55	8,781
WP CAREY INC		24.908	1,397	220,083
ELME		10.325	161	25,405
ASHFORD HOSPITALITY TRUST		4.132	4	650
AGREE REALTY CORP		11.427	700	110,291
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		27.939	904	142,467
CUBESMART		25.613	1,132	178,459
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC		23.401	233	36,716
DIGITAL REALTY TRUST INC		36.783	5,514	868,700
EXTRA SPACE STORAGE INC		24.065	3,767	593,550
CENTERSPACE		1.788	120	19,051
KITE REALTY GROUP TRUST		24.989	548	86,445
ONE LIBERTY PROPERTIES INC		1.965	46	7,305
GLADSTONE COMMERCIAL CORP		4.55	64	10,099
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO		24.642	202	31,870
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		68.229	330	52,128
FRANKLIN STREET PROPERTIES C		11.605	19	3,016
DOUGLAS EMMETT INC		18.992	252	39,791
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額	3,003.067	118,336	18,641,619
	銘柄数<比率>	137銘柄		<73.5%>
		千口	千カナダ・ドル	千円
（カナダ）				
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T		4.6	14	1,661
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS		3.6	25	2,881
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN		5.725	77	8,837

銘柄		2024年6月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千カナダ・ドル	千円
PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T		3.5	17	2,023
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U		2.026	30	3,543
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		7.1	45	5,268
SLATE GROCERY REIT		3.6	40	4,595
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		7.2	123	14,161
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		2.5	37	4,292
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		15.7	76	8,751
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE		0.956	8	940
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		3.8	253	29,082
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		16.1	201	23,155
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		8.9	104	12,003
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		12.5	183	21,088
CHOICE PROPERTIES REIT		19.8	251	28,862
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		2.4	36	4,150
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		6.4	86	9,901
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		8.7	191	21,941
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		9.9	432	49,606
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		15.8	142	16,308
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		17.6	293	33,709
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV		1	19	2,185
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		2.9	199	22,856
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		6.3	78	9,039
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		7.7	121	13,900
カナダ・ドル通貨計	口数、金額	196.307	3,093	354,752
	銘柄数<比率>	26銘柄		<1.4%>
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
（オーストラリア）				
DEXUS/AU		129.126	838	87,297
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI		62.441	70	7,382
HMC CAPITAL LTD		29.287	216	22,545
ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS		71.161	86	9,043
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR		40.594	97	10,191
CROMWELL PROPERTY GROUP		184.36	77	8,066
CENTURIA INDUSTRIAL REIT		64.03	199	20,743
RURAL FUNDS GROUP		50.015	100	10,472
WAYPOINT REIT		80.654	187	19,492
CHARTER HALL LONG WALE REIT		82.086	281	29,329
CENTURIA OFFICE REIT		52.359	62	6,490
CENTURIA CAPITAL GROUP		99.358	171	17,905
HOMECO DAILY NEEDS REIT		220.528	270	28,141
REGION GROUP		143.388	315	32,860
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		32.517	74	7,756
NATIONAL STORAGE REIT		156.226	360	37,593
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT		26.925	79	8,302
GDI PROPERTY GROUP		64.299	38	4,052
SCENTRE GROUP		623.125	1,944	202,522
ARENA REIT		43.831	163	16,985

銘柄		2024年6月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS		23.412	75	7,877
BWP TRUST		64.841	233	24,316
GPT GROUP		229.973	935	97,502
CHARTER HALL RETAIL REIT		62.103	203	21,219
MIRVAC GROUP		473.716	892	93,019
STOCKLAND		285.956	1,269	132,258
ABACUS GROUP UNIT		52.859	59	6,222
GOODMAN GROUP		207.484	7,421	773,118
VICINITY CENTRES		464.533	864	90,006
CHARTER HALL GROUP		56.785	697	72,698
INGENIA COMMUNITIES GROUP		45.017	219	22,837
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額	4,222.989	18,510	1,928,250
	銘柄数<比率>	31銘柄		<7.6%>
		千口	千香港・ドル	千円
(香港)				
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		291	299	6,042
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		128	221	4,464
FORTUNE REIT		184	717	14,466
PROSPERITY REIT		156	210	4,245
LINK REIT		308.8	10,066	202,948
CHAMPION REIT		223	356	7,193
香港・ドル通貨計	口数、金額	1,290.8	11,873	239,360
	銘柄数<比率>	6銘柄		<0.9%>
		千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)				
KEPPEL DC REIT		165.8	296	34,566
AIMS APAC REIT		85	107	12,572
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI		351.2	335	39,063
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		66.4	44	5,142
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL		214.9	119	13,891
EC WORLD REIT		32.9	9	1,072
CAPITALAND ASCENDAS REIT		427.3	1,098	127,902
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		607.5	1,178	137,265
SUNTEC REIT		276.5	293	34,136
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		400.7	528	61,603
KEPPEL REIT		277.1	232	27,110
CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU		306.5	272	31,771
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T		720	201	23,480
CDL HOSPITALITY TRUSTS		80.9	77	8,998
FRASERS CENTREPOINT TRUST		140.4	301	35,157
STARHILL GLOBAL REIT		168.1	80	9,397
CAPITALAND CHINA TRUST		139.9	91	10,672
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		46.5	169	19,713
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		248.4	536	62,491
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS		277.3	338	39,402
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		127.6	78	9,139
PARAGON REIT		153.9	128	14,967
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	5,314.8	6,521	759,520
	銘柄数<比率>	22銘柄		<3.0%>

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		2024年6月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		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		108.963	117	11,374
KIWI PROPERTY GROUP LTD		202.139	162	15,728
GOODMAN PROPERTY TRUST		126.102	265	25,657
PRECINCT PROPERTIES GROUP		190.46	223	21,631
ニュージーランド・ドル通貨計	口数、金額	627.664	769	74,393
	銘柄数<比率>	4銘柄		<0.3%>
		千口	千イギリス・ポンド	千円
（イギリス）				
WAREHOUSE REIT PLC		48.892	38	7,778
HELICAL PLC		13.564	29	5,910
LIFE SCIENCE REIT PLC		44.442	15	3,046
ASSURA PLC		363.873	144	28,887
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		74.712	69	13,962
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE		51.354	26	5,214
CLS HOLDINGS PLC		20.382	17	3,511
PICTON PROPERTY INCOME LTD		64.471	41	8,272
REGIONAL REIT LTD		54.681	11	2,338
NEWRIVER REIT PLC		39.166	28	5,667
SHAFTESBURY CAPITAL PLC		231.528	316	63,351
CUSTODIAN REIT PLC		51.902	37	7,469
PRS REIT PLC/THE		64.664	49	9,887
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		53.298	45	9,065
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		46.825	26	5,306
TARGET HEALTHCARE REIT PLC		73.523	58	11,682
AEW UK REIT PLC		20.041	17	3,432
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS		83.162	62	12,549
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		151.928	109	21,893
URBAN LOGISTICS REIT PLC		58.444	69	13,970
HOME REIT PLC		84.338	16	3,207
LAND SECURITIES GROUP PLC		89.103	554	110,772
SEGRO PLC		158.629	1,441	288,200
HAMMERSON PLC		469.562	131	26,297
UNITE GROUP PLC/THE		47.016	427	85,513
BRITISH LAND CO PLC		111.269	474	94,873
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		48.649	165	33,011
DERWENT LONDON PLC		13.311	309	61,776
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		162.931	148	29,699
WORKSPACE GROUP PLC		16.611	93	18,725
SAFESTORE HOLDINGS PLC		25.894	206	41,299
BIG YELLOW GROUP PLC		23.257	272	54,478
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		241.409	469	93,847
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		55.879	24	4,969
TRITAX BIG BOX REIT PLC		280.932	432	86,358
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	3,439.642	6,385	1,276,227
	銘柄数<比率>	35銘柄		<5.0%>
		千口	千イスラエル・シュケル	千円
（イスラエル）				
MENIVIM- THE NEW REIT LTD		82.303	128	5,423

銘柄		2024年6月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千イスラエル・シュケル	千円
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT		26.7	173	7,339
REIT 1 LTD		23.25	320	13,568
イスラエル・シュケル通貨計	口数、金額	132.253	621	26,331
	銘柄数<比率>	3銘柄		<0.1%>
		千口	千韓国・ウォン	千円
(韓国)				
SK REITS LTD		13.417	65,273	7,460
D&D PLATFORM REIT LTD		6.865	24,096	2,754
NH ALL ONE REIT LTD		3.459	12,763	1,458
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		9.443	57,696	6,594
LOTTE REIT CO LTD		15.417	51,338	5,868
JR REIT XXVII		21.637	89,468	10,226
KORAMCO ENERGY PLUS REIT		5.393	24,915	2,847
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L		21.147	97,381	11,130
韓国・ウォン通貨計	口数、金額	96.778	422,935	48,341
	銘柄数<比率>	8銘柄		<0.2%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（アイルランド）				
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		44.558	40	6,860
国小計	口数、金額	44.558	40	6,860
	銘柄数<比率>	1銘柄		<0.0%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（オランダ）				
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		5.052	109	18,445
WERELDHAVE NV		4.001	53	9,014
NSI NV		1.842	36	6,107
VASTNED RETAIL NV		1.879	43	7,414
国小計	口数、金額	12.774	243	40,981
	銘柄数<比率>	4銘柄		<0.2%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（ベルギー）				
AEDIFICA		5.425	305	51,507
COFINIMMO		4.194	240	40,597
RETAIL ESTATES		1.428	89	15,075
WAREHOUSES DE PAUW SCA		19.778	500	84,384
CARE PROPERTY INVEST		4.054	56	9,543
XIOR STUDENT HOUSING NV		3.886	111	18,808
MONTEA NV		2.092	166	28,047
国小計	口数、金額	40.857	1,470	247,964
	銘柄数<比率>	7銘柄		<1.0%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（フランス）				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		11.58	839	141,581
ICADE		3.652	93	15,766
CARMILA		6.491	103	17,536
ALTAREA		0.505	42	7,204
GECINA SA		5.857	536	90,426
KLEPIERRE		22.255	568	95,853

銘柄		2024年6月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千ユーロ	千円
COVIVIO		5.531	247	41,768
MERCIALYS		10.969	118	20,014
国小計	口数、金額	66.84	2,550	430,152
	銘柄数＜比率＞	8銘柄		<1.7%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（ドイツ）				
HAMBORNER REIT AG		8.268	53	9,035
国小計	口数、金額	8.268	53	9,035
	銘柄数＜比率＞	1銘柄		<0.0%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（スペイン）				
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		5.518	38	6,420
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		33.414	200	33,865
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		38.053	403	68,022
国小計	口数、金額	76.985	642	108,309
	銘柄数＜比率＞	3銘柄		<0.4%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（イタリア）				
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		6.703	12	2,061
国小計	口数、金額	6.703	12	2,061
	銘柄数＜比率＞	1銘柄		<0.0%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（その他）				
SHURGARD SELF STORAGE LTD		3.638	140	23,742
CROMWELL REIT EUR		36.8	52	8,812
国小計	口数、金額	40.438	193	32,555
	銘柄数＜比率＞	2銘柄		<0.1%>
ユーロ通貨計	口数、金額	297.423	5,205	877,920
	銘柄数＜比率＞	27銘柄		<3.5%>
合計	口数、金額	18,621.723	—	24,226,719
	銘柄数＜比率＞	299銘柄		<95.5%>

（注1）邦貨換算金額は、2024年6月17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		2024年6月17日現在	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
外国	DJ US REAL ESTATE（アメリカ）	765	—
外国	STOXX 600 REAL（ドイツ）	81	—

（注1）外貨建の評価額は、2024年6月17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。

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

運用報告書　第２期　（決算日　2023年８月15日）

（作成対象期間　2022年８月16日～2023年８月15日）

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。

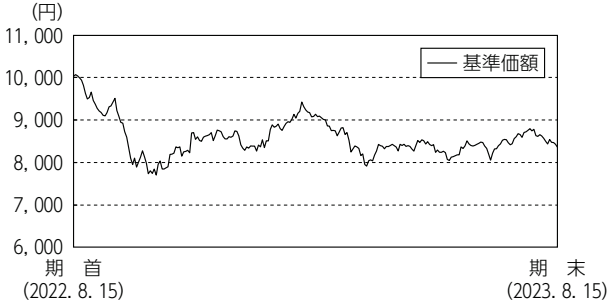
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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	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
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)(税引後配当込み、円ヘッジ・円ベース)(ベンチマーク)		投資信託受益証券組入比率	投資証券組入比率	不動産投信指数先物比率
		騰落率		騰落率			
	円	%		%	%	%	%
(期 首)2022年8月15日	10,040	—	10,039	—	4.1	92.1	3.8
8月末	9,278	△ 7.6	9,274	△ 7.6	4.9	94.9	3.9
9月末	7,889	△ 21.4	7,883	△ 21.5	3.8	96.9	3.8
10月末	8,367	△ 16.7	8,362	△ 16.7	4.6	95.2	3.0
11月末	8,628	△ 14.1	8,620	△ 14.1	0.5	92.0	2.0
12月末	8,410	△ 16.2	8,394	△ 16.4	1.4	88.6	5.6
2023年1月末	9,048	△ 9.9	9,028	△ 10.1	2.0	94.3	3.6
2月末	8,756	△ 12.8	8,747	△ 12.9	4.0	96.6	4.0
3月末	8,269	△ 17.6	8,248	△ 17.8	1.1	93.8	3.6
4月末	8,399	△ 16.3	8,364	△ 16.7	1.9	94.8	4.5
5月末	8,159	△ 18.7	8,129	△ 19.0	1.3	98.4	3.2
6月末	8,395	△ 16.4	8,351	△ 16.8	1.4	99.6	3.4
7月末	8,614	△ 14.2	8,567	△ 14.7	2.4	92.4	3.4
(期 末)2023年8月15日	8,359	△ 16.7	8,310	△ 17.2	3.8	94.4	4.6

（注１）騰落率は期首比。
（注２）Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（税引後配当込み、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。
（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。
※ベンチマークを「Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（配当込み、円ヘッジ・円ベース）」から「Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（税引後配当込み、円ヘッジ・円ベース）」に変更しました。

《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：10,040円　期末：8,359円　騰落率：△16.7%

【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下落等を受け、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。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、ＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）議長がインフレ抑制姿勢を強調したこと、米国の予想以上のインフレ率の上昇や英国の財政悪化懸念などで欧米の金利が上昇したこと、企業業績の見通しの下方修正が相次いだことなどが嫌気され、米国を中心に下落しました。2022年11月から2023年１月にかけては、英国市場の混乱が収束して欧米の金利上昇が一服したことや、米国のインフレ率が予想を下回り、利上げペースが鈍化するとの期待が高まったことなどが好感されて上昇しました。２月に入ると、予想を上回る経済指標の発表が相次いだことで金利が再び上昇し市場に嫌気されたほか、３月には米国の地方銀行の経営破綻による金融不安がリートの資金調達コスト上昇につながるとの懸念が広がったことから、下落に転じました。その後は、ＦＲＢによる緊急融資枠の新設で資金繰り懸念が後退したことや、金利が急低下したことなどが好感されて米国を中心に上昇する局面もありましたが、追加利上げ観測や長期金利の上昇などを嫌気し、再度軟調に推移しました。７月に入ると、米国におけるインフレ指標の鈍化や長期金利の低下が好感され上昇に転じましたが、７月下旬から８月上旬にかけて米国の長期金利が再度上昇すると、米国を中心に下落して当作成期末を迎えました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

先進国（日本を除きます。）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、保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行うことによって、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）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

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。

◆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△17.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△16.7%となりました。

保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。

なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異も、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）（税引後配当込み、円ヘッジ・円ベース）です。

《今後の運用方針》

先進国（日本を除きます。）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、保有する外貨建資産については為替ヘッジを行うことによって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）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	2円
（先物・オプション）	(1)
（投資信託受益証券）	(0)
（投資証券）	(1)
有価証券取引税	1
（投資信託受益証券）	(0)
（投資証券）	(1)
その他費用	4
（保管費用）	(2)
（その他）	(2)
合　　計	7

（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

(2022年８月16日から2023年８月15日まで)

		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口 328.65 (—)	千アメリカ・ドル 27,722 (—)	千口 326.162 (—)	千アメリカ・ドル 27,494 (—)

（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)投資証券

(2022年８月16日から2023年８月15日まで)

		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口 565.791 (△ 63.867)	千アメリカ・ドル 27,583 (△ 1,018)	千口 321.407 (—)	千アメリカ・ドル 14,800 (—)
	カナダ	千口 38.826 (△ 12)	千カナダ・ドル 782 (△ 236)	千口 27.1 (—)	千カナダ・ドル 463 (—)
	オーストラリア	千口 1,304.795 (52.859)	千オーストラリア・ドル 5,373 (△ 1)	千口 901.782 (—)	千オーストラリア・ドル 3,831 (—)
	香港	千口 263.6 (54.2)	千香港・ドル 8,779 (—)	千口 178.3 (—)	千香港・ドル 4,444 (—)
	シンガポール	千口 1,660.2 (8.462)	千シンガポール・ドル 2,400 (△ 72)	千口 955.7 (—)	千シンガポール・ドル 1,543 (—)
	ニュージーランド	千口 165.054 (—)	千ニュージーランド・ドル 265 (—)	千口 81.597 (—)	千ニュージーランド・ドル 110 (—)
	イギリス	千口 948.915 (—)	千イギリス・ポンド 1,943 (—)	千口 521.343 (—)	千イギリス・ポンド 1,102 (—)
	イスラエル	千口 85.85 (—)	千イスラエル・シュケル 222 (—)	千口 3.814 (—)	千イスラエル・シュケル 75 (—)
	韓国	千口 14.919 (6.583)	千韓国・ウォン 74,504 (—)	千口 2.929 (—)	千韓国・ウォン 440 (—)
	ユーロ (オランダ)	千口 1.339 (—)	千ユーロ 25 (—)	千口 0.34 (—)	千ユーロ 7 (—)
	ユーロ (ベルギー)	千口 9.738 (7.298)	千ユーロ 385 (—)	千口 13.097 (—)	千ユーロ 257 (—)
	ユーロ (フランス)	千口 15.299 (—)	千ユーロ 492 (△ 31)	千口 8.834 (—)	千ユーロ 374 (—)
	ユーロ (ドイツ)	千口 0.991 (—)	千ユーロ 7 (△ 7)	千口 0.852 (—)	千ユーロ 7 (—)
	ユーロ (スペイン)	千口 13.696 (—)	千ユーロ 94 (△ 4)	千口 7.839 (—)	千ユーロ 54 (—)
	ユーロ (その他)	千口 5.9 (—)	千ユーロ 11 (△ 0)	千口 — (—)	千ユーロ — (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千口 46.963 (7.298)	千ユーロ 1,017 (△ 44)	千口 30.962 (—)	千ユーロ 700 (—)

（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

(2022年8月16日から2023年8月15日まで)

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
外国	不動産投信指数先物取引	6,615	6,341	—	—

（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

(2022年8月16日から2023年8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
VANGUARD REAL ESTATE ETF（アメリカ）	328.65	3,919,469	11,925	VANGUARD REAL ESTATE ETF（アメリカ）	326.162	3,877,897	11,889

（注1）金額は受渡し代金。
（注2）金額の単位未満は切捨て。

(2)投資証券

(2022年8月16日から2023年8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
PROLOGIS INC（アメリカ）	24.393	395,543	16,215	PROLOGIS INC（アメリカ）	14.548	246,166	16,920
EQUINIX INC（アメリカ）	2.692	260,007	96,585	EQUINIX INC（アメリカ）	1.438	147,428	102,523
REALTY INCOME CORP（アメリカ）	24.39	210,134	8,615	GOODMAN GROUP（オーストラリア）	62.413	108,848	1,744
PUBLIC STORAGE（アメリカ）	4.57	180,584	39,515	PUBLIC STORAGE（アメリカ）	2.306	94,221	40,859
WELLTOWER INC（アメリカ）	16.985	170,969	10,065	SIMON PROPERTY GROUP INC（アメリカ）	5.375	84,499	15,720
LINK REIT（香港）	160.6	145,366	905	REALTY INCOME CORP（アメリカ）	9.376	80,566	8,592
GOODMAN GROUP（オーストラリア）	81.407	141,785	1,741	WELLTOWER INC（アメリカ）	6.997	74,343	10,625
SIMON PROPERTY GROUP INC（アメリカ）	8.628	134,996	15,646	LINK REIT（香港）	80.1	72,310	902
VICI PROPERTIES INC（アメリカ）	30.056	129,608	4,312	VICI PROPERTIES INC（アメリカ）	14.992	66,875	4,460
DIGITAL REALTY TRUST INC（アメリカ）	7.99	112,999	14,142	DIGITAL REALTY TRUST INC（アメリカ）	4.211	64,887	15,409

（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		72.412	74.9	6,200	902,752
合計	□数、金額	72.412	74.9	6,200	902,752
	銘柄数＜比率＞	1銘柄	1銘柄		＜3.8%＞

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

(2)外国投資証券

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
(シンガポール)				
DIGITAL CORE REIT UNITS	38.7	38.7	19	2,845
MANULIFE US REAL ESTATE INV	203.4	203.4	18	2,694
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	95.4	82.3	22	3,295
PRIME US REIT	68.4	68.4	12	1,882
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	14.681	14.715	214	31,280
URBAN EDGE PROPERTIES	12.73	14.052	238	34,679
XENIA HOTELS & RESORTS INC	13.204	13.086	152	22,216
AVALONBAY COMMUNITIES INC	15.627	17.349	3,170	461,603
SIMON PROPERTY GROUP INC	36.698	39.951	4,754	692,323
BOSTON PROPERTIES INC	15.939	17.437	1,162	169,288
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	17.065	18.199	147	21,436
VORNADO REALTY TRUST	17.787	19.693	439	63,940
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	10.146	11.496	168	24,554
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9.405	10.034	323	47,159
NEXPOINT RESIDENTIAL	2.585	2.878	103	15,127
EQUITY RESIDENTIAL	38.246	41.665	2,701	393,286
APPLE HOSPITALITY REIT INC	23.791	26.022	387	56,377
EPR PROPERTIES	8.379	9.197	393	57,299
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.138	—	—	—
CITY OFFICE REIT INC	5.316	4.603	23	3,424
GLOBAL NET LEASE INC	11.978	12.412	137	20,005
EQUINIX INC	10.173	11.427	8,800	1,281,403
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8.982	10.402	265	38,711
CHATHAM LODGING TRUST	5.953	5.858	54	7,983
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6.164	7.221	627	91,301
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	13.882	15.063	216	31,537
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2.634	3.067	103	15,106
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6.929	6.929	18	2,754
HOST HOTELS & RESORTS INC	79.888	86.898	1,406	204,715
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	33.028	38.388	1,385	201,773
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	16.164	15.392	95	13,961
RLJ LODGING TRUST	18.648	19.022	186	27,086
FARMLAND PARTNERS INC	3.465	5.962	66	9,687
PHYSICIANS REALTY TRUST	25.181	29.127	411	59,881
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	7.567	8.574	99	14,518
KIMCO REALTY CORP	69.073	75.738	1,530	222,864
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7.367	7.392	72	10,493
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	42.547	46.528	803	116,927
WHITESTONE REIT	5.635	5.635	57	8,401
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	26.284	32.091	1,520	221,333
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	13.784	14.81	102	14,943
PARK HOTELS & RESORTS INC	26.083	26.345	340	49,520
INVITATION HOMES INC	68.214	71.025	2,447	356,359
JBG SMITH PROPERTIES	12.152	11.589	179	26,204
ALEXANDER & BALDWIN INC	8.385	8.677	157	22,980
CLIPPER REALTY INC	1.647	1.647	10	1,465
GLADSTONE LAND CORP	3.8	3.874	63	9,211
AMERICOLD REALTY TRUST	30.096	33.008	1,068	155,569
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7.31	7.31	30	4,374
VICI PROPERTIES INC	107.632	122.696	3,759	547,369
BRT APARTMENTS CORP	1.402	1.402	26	3,811
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3.126	3.429	280	40,779
SAFEHOLD INC	1.726	—	—	—
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	15.076	16.991	124	18,133
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	15.538	18.185	433	63,069
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4.8	4.936	111	16,191
STORE CAPITAL CORP	28.222	—	—	—
CREATIVE MEDIA AND COMMUNITY TRUST	1.854	—	—	—
BROADSTONE NET LEASE INC	18.923	22.872	374	54,481
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	11.966	13.532	77	11,348
LIFE STORAGE INC	9.429	—	—	—
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6.088	6.248	137	19,949
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	24.689	27.406	442	64,403
PARAMOUNT GROUP INC	18.985	20.87	101	14,798
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	15.266	15.789	135	19,701
NETSTREIT CORP	5.478	7.631	135	19,677
APARTMENT INCOME REIT CO	17.558	18.036	618	90,046
CTO REALTY GROWTH INC	2.184	2.544	44	6,422
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	18.444	24.552	1,287	187,496
STAG INDUSTRIAL INC	20.03	21.916	786	114,460
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1.311	1.311	22	3,271

銘柄	期首	当期末		
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
INDUS REALTY TRUST INC	0. 807	—	—	—
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2. 085	2. 085	30	4, 456
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	12. 73	14. 332	510	74, 267
ORION OFFICE REIT INC	6. 912	6. 028	38	5, 643
VENTAS INC	44. 673	48. 878	2, 091	304, 592
CARETRUST REIT INC	11. 218	12. 202	245	35, 709
INVENTRUST PROPERTIES CORP	7. 532	8. 069	194	28, 349
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	33. 478	36. 721	829	120, 725
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5. 412	6. 148	45	6, 633
SABRA HEALTH CARE REIT INC	25. 813	28. 247	356	51, 861
UMH PROPERTIES INC	6. 036	6. 804	105	15, 424
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3. 127	3. 103	68	9, 921
BLUEROCK HOMES TRUST INC CLASS A	—	0. 392	5	871
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	—	4. 101	46	6, 699
STAR HOLDINGS SHARES OF BENEFICIAL	—	1. 592	21	3, 129
IRON MOUNTAIN INC	32. 475	35. 63	2, 145	312, 353
TERRENO REALTY CORP	8. 442	9. 053	537	78, 230
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	15. 011	17. 263	677	98, 679
SUN COMMUNITIES INC	13. 592	15. 2	1, 882	274, 050
ACADIA REALTY TRUST	10. 605	11. 38	176	25, 649
ALEXANDER'S INC	0. 262	0. 272	51	7, 467
PROLOGIS INC	82. 737	112. 828	13, 932	2, 028, 499
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16. 601	19. 236	2, 304	335, 531
BRANDYWINE REALTY TRUST	19. 784	21. 718	104	15, 209
SAUL CENTERS INC	1. 591	1. 633	62	9, 120
VERIS RESIDENTIAL INC	9. 253	9. 534	173	25, 264
CAMDEN PROPERTY TRUST	11. 906	13. 044	1, 383	201, 467
COUSINS PROPERTIES INC	16. 627	18. 534	426	62, 093
SITE CENTERS CORP	20. 314	21. 76	297	43, 341
DUKE REALTY CORP	42. 969	—	—	—
EASTGROUP PROPERTIES INC	4. 658	5. 426	964	140, 395
ESSEX PROPERTY TRUST INC	7. 302	7. 842	1, 881	273, 973
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	14. 753	16. 157	822	119, 787
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7. 989	8. 963	903	131, 584
GETTY REALTY CORP	4. 815	5. 383	166	24, 288
WELLTOWER INC	50. 739	60. 727	5, 118	745, 191
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	60. 305	66. 831	1, 380	200, 936
HIGHWOODS PROPERTIES INC	11. 753	12. 885	308	44, 931
SERVICE PROPERTIES TRUST	19. 087	19. 775	169	24, 703
EQUITY COMMONWEALTH	12. 593	13. 434	252	36, 753
KILROY REALTY CORP	11. 741	12. 879	467	68, 050
LTC PROPERTIES INC	4. 552	5. 127	170	24, 835
LXP INDUSTRIAL TRUST	32. 038	35. 747	346	50, 434
MID-AMERICA APARTMENT COMM	12. 901	14. 253	2, 032	295, 949
MACERICH CO/THE	23. 99	26. 28	331	48, 288
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19. 335	21. 386	1, 445	210, 430
NATL HEALTH INVESTORS INC	5. 125	5. 186	268	39, 037
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	19. 661	22. 247	871	126, 845

銘柄	期首	当期末		
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
REALTY INCOME CORP	67. 239	82. 253	4, 765	693, 891
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	12. 564	13. 747	355	51, 820
PENN REAL ESTATE INVEST TST	0. 509	—	—	—
PUBLIC STORAGE	17. 068	19. 332	5, 480	797, 894
REGENCY CENTERS CORP	17. 338	18. 801	1, 207	175, 770
RPT REALTY	9. 513	10. 232	104	15, 165
SAFEHOLD INC	—	5. 051	103	15, 024
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	12. 022	12. 572	313	45, 633
SL GREEN REALTY CORP	7. 167	7. 694	261	38, 032
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	29. 173	29. 173	86	12, 657
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3. 682	3. 667	81	11, 879
UDR INC	33. 452	37. 805	1, 475	214, 837
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1. 565	1. 607	77	11, 238
WP CAREY INC	21. 558	26. 134	1, 710	249, 082
ELME	9. 771	10. 485	161	23, 525
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4. 132	4. 132	12	1, 865
AGREE REALTY CORP	8. 402	11. 387	714	104, 003
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	26. 29	28. 633	901	131, 322
CUBESMART	25. 085	27. 451	1, 155	168, 228
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	24. 053	24. 754	225	32, 762
DIGITAL REALTY TRUST INC	31. 817	35. 596	4, 324	629, 603
CEDAR REALTY TRUST INC	1. 501	—	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	15. 008	25. 805	3, 359	489, 075
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4. 032	4. 032	26	3, 839
CENTERSPACE	1. 717	1. 788	111	16, 299
KITE REALTY GROUP TRUST	24. 481	26. 797	619	90, 245
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1. 965	1. 965	39	5, 782
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4. 549	4. 549	62	9, 153
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	23. 567	25. 075	197	28, 696
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	67. 071	73. 099	570	83, 123
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	11. 605	11. 605	22	3, 345
DOUGLAS EMMETT INC	19. 647	20. 296	270	39, 450
アメリカ・ドル 通貨計 口数、金額	2, 896. 249	3, 076. 766	121, 058	17, 626, 120
銘柄数＜比率＞	147銘柄	142銘柄		<73. 3%>
	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
（カナダ）				
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2	2	7	770
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4. 6	4. 6	15	1, 656
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	5. 6	5. 6	14	1, 520
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	3. 6	3. 6	29	3, 208
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	5. 725	6. 525	86	9, 358
PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	—	3. 5	19	2, 063
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	—	2. 026	35	3, 793
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	7. 1	7. 1	50	5, 490
SLATE GROCERY REIT	3. 6	3. 6	46	5, 015

銘柄	期首	当期末		
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	6.7	7.3	133	14,401
SLATE OFFICE REIT	4.9	4.9	7	763
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2.5	2.5	35	3,820
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	14.2	15.7	105	11,377
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	11	—	—	—
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5.5	5.5	13	1,487
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2.4	2.4	28	3,070
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3.8	4.2	311	33,716
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	14.6	16.3	228	24,682
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	8.1	8.9	113	12,311
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	13	13.5	195	21,172
CHOICE PROPERTIES REIT	18.7	20.8	278	30,123
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2.4	2.4	38	4,187
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	6.2	7	103	11,182
PLAZA RETAIL REIT	6.3	—	—	—
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	8.7	9.2	228	24,697
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10.4	10.9	539	58,404
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	16.5	16.4	168	18,270
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	18.5	19.4	376	40,728
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3	2	25	2,771
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2.7	2.9	193	20,949
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6.1	6.9	91	9,933
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7.6	8.1	170	18,459
カナダ・ドル 通貨計 口数、金額	226.025	225.751	3,692	399,387
銘柄数＜比率＞	30銘柄	30銘柄		<1.7%>
	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
（オーストラリア）				
DEXUS/AU	130.887	142.318	1,142	107,961
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	33.012	52.157	70	6,627
HMC CAPITAL LTD	21.693	31.806	158	14,963
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	46.291	46.291	33	3,170
ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	—	52.859	62	5,917
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	39.378	45.483	123	11,644
CROMWELL PROPERTY GROUP	167.757	184.36	94	8,882
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	65.291	69.8	214	20,309
RURAL FUNDS GROUP	45.313	50.015	94	8,953
WAYPOINT REIT	87.433	86.888	218	20,602
CHARTER HALL LONG WALE REIT	74.981	86.095	313	29,605
CENTURIA OFFICE REIT	52.359	52.359	74	7,048
CENTURIA CAPITAL GROUP	75.235	92.458	140	13,320
HOMECO DAILY NEEDS REIT	176.023	200.894	230	21,730
REGION GROUP	136.23	152.021	355	33,605
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	34.802	38.675	102	9,682
NATIONAL STORAGE REIT	132.724	162.36	355	33,590
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	26.502	26.925	74	6,994

銘柄	期首	当期末		
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
GDI PROPERTY GROUP	64.299	64.299	43	4,069
SCENTRE GROUP	631.6	686.788	1,854	175,178
ARENA REIT	41.056	46.46	175	16,546
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	22.847	26.404	77	7,358
BWP TRUST	58.372	62.311	220	20,838
GPT GROUP	233.736	253.468	1,059	100,090
CHARTER HALL RETAIL REIT	63.834	66.904	238	22,563
MIRVAC GROUP	481.108	522.114	1,206	113,938
STOCKLAND	290.569	315.869	1,288	121,747
ABACUS GROUP UNIT	50.221	52.859	62	5,942
GOODMAN GROUP	207.434	226.428	4,528	427,813
VICINITY CENTRES	472.13	512.001	957	90,449
CHARTER HALL GROUP	57.697	62.587	650	61,431
INGENIA COMMUNITIES GROUP	43.391	47.821	201	19,019
オーストラリア・ドル 通貨計 口数、金額	4,064.205	4,520.077	16,424	1,551,599
銘柄数＜比率＞	31銘柄	32銘柄		<6.5%>
	千口	千口	千香港・ドル	千円
（香港）				
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	267	291	448	8,344
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	128	128	367	6,840
FORTUNE REIT	177	188	1,028	19,148
PROSPERITY REIT	156	156	248	4,618
LINK REIT	257.4	337.9	12,958	241,286
CHAMPION REIT	222	246	698	13,008
香港・ドル 通貨計 口数、金額	1,207.4	1,346.9	15,749	293,246
銘柄数＜比率＞	6銘柄	6銘柄		<1.2%>
	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
（シンガポール）				
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	41.3	66.1	39	4,222
CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	—	8.462	0	95
KEPPEL DC REIT	160.9	175.3	368	39,526
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	153.8	153.8	39	4,293
AIMS APAC REIT	57.8	68.3	83	8,946
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	354.7	383.1	459	49,360
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66.4	66.4	47	5,097
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	225.9	244.5	161	17,326
EC WORLD REIT	32.9	32.9	10	1,077
IREIT GLOBAL	64.5	—	—	—
CAPITALAND ASCENDAS REIT	408.5	444.7	1,209	129,873
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	620.5	666.3	1,265	135,927
SUNTEC REIT	265.3	297.9	366	39,342
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	389.4	438.2	718	77,161
KEPPEL REIT	239.9	256.5	223	23,960
CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	235.9	291.8	294	31,643
ESR－LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	621.4	851.4	272	29,252

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		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
CDL HOSPITALITY TRUSTS		103. 4	108. 2	117	12, 663
FRASERS CENTREPOINT TRUST		130. 4	142	306	32, 932
STARHILL GLOBAL REIT		166. 8	188. 2	92	9, 901
CAPITALAND CHINA TRUST		133. 9	152. 8	148	15, 913
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		45. 9	50. 5	186	20, 062
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		237. 7	264. 8	585	62, 833
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS		266. 7	304. 8	475	51, 053
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		124. 3	143. 2	88	9, 455
PARAGON REIT		113	141. 9	134	14, 397
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		284. 1	316. 2	90	9, 675
シンガポール・ドル	口数、金額	5, 545. 3	6, 258. 262	7, 786	835, 996
通貨計	銘柄数＜比率＞	26銘柄	26銘柄		<3. 5%>
		千口	千口	千ニュージーランド・ドル	千円
（ニュージーランド）					
STRIDE PROPERTY GROUP		—	64. 452	91	7, 956
ARGOSY PROPERTY LTD		107. 307	108. 963	130	11, 320
KIWI PROPERTY GROUP LTD		199. 256	202. 139	187	16, 343
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		54. 226	60. 746	141	12, 305
GOODMAN PROPERTY TRUST		132. 996	136. 116	307	26, 744
PRECINCT PROPERTIES GROUP		164. 981	169. 807	217	18, 896
ニュージーランド・ドル	口数、金額	658. 766	742. 223	1, 076	93, 567
通貨計	銘柄数＜比率＞	5銘柄	6銘柄		<0. 4%>
		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
（イギリス）					
WAREHOUSE REIT PLC		—	55. 82	47	8, 718
EDISTON PROPERTY INVESTMENT COMPAN		—	24. 551	16	2, 964
HELICAL PLC		—	13. 564	32	6, 085
ASSURA PLC		336. 071	375. 355	173	31, 987
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		71. 016	74. 712	63	11, 807
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE		51. 354	51. 354	24	4, 531
CLS HOLDINGS PLC		—	20. 382	26	4, 891
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		100. 969	112. 677	58	10, 734
PICTON PROPERTY INCOME LTD		64. 471	64. 471	45	8, 331
REGIONAL REIT LTD		54. 681	54. 681	24	4, 517
NEWRIVER REIT PLC		39. 166	39. 166	32	5, 987
SHAFTESBURY CAPITAL PLC		96. 764	247. 375	306	56, 676
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		73. 284	—	—	—
CUSTODIAN REIT PLC		51. 902	51. 902	43	8, 010
PRS REIT PLC/THE		64. 664	64. 664	50	9, 383
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		45. 413	53. 298	47	8, 757
LXI REIT PLC		263. 618	217. 143	202	37, 463
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		46. 825	46. 825	30	5, 567
AEW UK REIT PLC		20. 041	20. 041	19	3, 622
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS		94. 111	102. 818	70	12, 964
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		140. 841	151. 22	114	21, 162
URBAN LOGISTICS REIT PLC		—	58. 444	69	12, 775
HOME REIT PLC		94. 127	84. 338	32	5, 924
LAND SECURITIES GROUP PLC		85. 402	95. 156	592	109, 411
SEGRO PLC		136. 681	155. 001	1, 133	209, 356
HAMMERSON PLC		417. 915	486. 708	127	23, 470
UNITE GROUP PLC/THE		45. 368	54. 901	514	95, 023
BRITISH LAND CO PLC		106. 618	118. 796	377	69, 700
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		28. 857	30. 876	127	23, 542
DERWENT LONDON PLC		12. 762	14. 222	285	52, 618
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		151. 509	169. 271	158	29, 203
WORKSPACE GROUP PLC		16. 231	17. 748	88	16, 399
SAFESTORE HOLDINGS PLC		23. 965	27. 611	233	43, 023
SHAFTESBURY PLC		32. 755	—	—	—
BIG YELLOW GROUP PLC		19. 661	22. 175	233	43, 191
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		111. 412	124. 496	224	41, 394
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		71. 398	71. 398	30	5, 608
TRITAX BIG BOX REIT PLC		212. 428	236. 692	330	61, 002
イギリス・ポンド	口数、金額	3, 182. 28	3, 609. 852	5, 989	1, 105, 812
通貨計	銘柄数＜比率＞	33銘柄	36銘柄		<4. 6%>
		千口	千口	千イスラエル・シュケル	千円
（イスラエル）					
MENIVIM- THE NEW REIT LTD		—	82. 303	128	4, 999
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT		26. 7	26. 7	206	8, 000
REIT 1 LTD		25. 897	25. 63	401	15, 547
イスラエル・シュケル	口数、金額	52. 597	134. 633	736	28, 546
通貨計	銘柄数＜比率＞	2銘柄	3銘柄		<0. 1%>
		千口	千口	千韓国・ウォン	千円
（韓国）					
SK REITS LTD		7. 476	9. 763	42, 664	4, 650
D&D PLATFORM REIT LTD		6. 865	6. 865	20, 697	2, 256
SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD		3. 286	3. 286	10, 663	1, 162
NH ALL ONE REIT LTD		3. 459	3. 459	10, 636	1, 159
E KOCREF CR		—	2. 796	13, 840	1, 508
SK REITS LTD		—	3. 654	—	—
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		7. 432	9. 443	56, 563	6, 165
LOTTE REIT CO LTD		15. 417	15. 417	52, 803	5, 755
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1		11. 781	11. 781	48, 066	5, 239
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD		3. 918	6. 807	29, 576	3, 223
JR REIT XXVII		16. 902	19. 35	75, 368	8, 215
KORAMCO ENERGY PLUS REIT		5. 393	5. 393	29, 391	3, 203
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L		18. 659	21. 147	82, 684	9, 012
韓国・ウォン	口数、金額	100. 588	119. 161	472, 956	51, 552
通貨計	銘柄数＜比率＞	11銘柄	13銘柄		<0. 2%>
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ（アイルランド）					
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		44. 558	44. 558	41	6, 607
国小計	口数、金額	44. 558	44. 558	41	6, 607
	銘柄数＜比率＞	1銘柄	1銘柄		<0. 0%>

銘柄		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ（オランダ）					
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		4.157	4.64	102	16,281
WERELDHAVE NV		4.183	4.699	75	11,915
NSI NV		1.842	1.842	34	5,498
VASTNED RETAIL NV		1.879	1.879	37	5,877
国小計	口数、金額	12.061	13.06	249	39,573
	銘柄数＜比率＞	4銘柄	4銘柄		＜0.2%＞
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ（ベルギー）					
AEDIFICA		4.098	5.153	312	49,582
COFINIMMO		3.066	3.324	236	37,499
BEFIMMO		2.541	—	—	—
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS		2.459	3.07	41	6,580
RETAIL ESTATES		1.182	1.315	76	12,089
WAREHOUSES DE PAUW SCA		14.678	16.854	432	68,668
CARE PROPERTY INVEST		2.797	4.054	54	8,599
XIOR STUDENT HOUSING NV		2.164	2.745	75	11,985
MONTEA NV		1.061	1.47	106	16,875
国小計	口数、金額	34.046	37.985	1,334	211,880
	銘柄数＜比率＞	9銘柄	8銘柄		＜0.9%＞
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ（フランス）					
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		12.108	11.64	582	92,446
ICADE		3.326	3.481	121	19,256
CARMILA		4.689	6.249	90	14,347
ALTAREA		0.443	0.505	43	6,847
GECINA SA		5.647	5.915	570	90,584
KLEPIERRE		20.263	21.208	507	80,514
COVIVIO		4.92	5.05	213	33,853
MERCIALYS		5.169	8.982	71	11,316
国小計	口数、金額	56.565	63.03	2,199	349,167
	銘柄数＜比率＞	8銘柄	8銘柄		＜1.5%＞
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ（ドイツ）					
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		1.766	0.914	4	724
HAMBORNER REIT AG		7.351	8.342	55	8,755
国小計	口数、金額	9.117	9.256	59	9,480
	銘柄数＜比率＞	2銘柄	2銘柄		＜0.0%＞
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ（スペイン）					
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		7.263	7.263	43	6,884
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		28.026	32.267	178	28,306
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		34.646	36.262	300	47,673
国小計	口数、金額	69.935	75.792	521	82,864
	銘柄数＜比率＞	3銘柄	3銘柄		＜0.3%＞

銘柄		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ（イタリア）					
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		6.703	6.703	15	2,538
国小計	口数、金額	6.703	6.703	15	2,538
	銘柄数＜比率＞	1銘柄	1銘柄		＜0.0%＞
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ（その他）					
CROMWELL REIT EUR		32.1	38	58	9,291
国小計	口数、金額	32.1	38	58	9,291
	銘柄数＜比率＞	1銘柄	1銘柄		＜0.0%＞
ユーロ通貨計	口数、金額	265.085	288.384	4,480	711,404
	銘柄数＜比率＞	29銘柄	28銘柄		＜3.0%＞
合計	口数、金額	18,198.495	20,322.009	—	22,697,235
	銘柄数＜比率＞	320銘柄	322銘柄		＜94.4%＞

（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。

(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
外国	DJ US REAL ESTATE（アメリカ）	899	—
外国	STOXX 600 REAL（ドイツ）	199	—

（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

2023年８月15日現在

項　　目	当　期　末	
	評　価　額	比　　率
	千円	%
投資信託受益証券	902,752	3.7
投資証券	22,697,235	92.2
コール・ローン等、その他	1,019,261	4.1
投資信託財産総額	24,619,249	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、８月15日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝145.60円、１カナダ・ドル＝108.16円、１オーストラリア・ドル＝94.47円、１香港・ドル＝18.62円、１シンガポール・ドル＝107.37円、１ニュージーランド・ドル＝86.94円、１イギリス・ポンド＝184.62円、１イスラエル・シュケル＝38.761円、100韓国・ウォン＝10.90円、１ユーロ＝158.78円です。
（注３）当期末における外貨建純資産（24,125,636千円）の投資信託財産総額（24,619,249千円）に対する比率は、98.0％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年８月15日現在

項　　目	当　期　末
（Ａ）資産	**49,249,190,903円**
コール・ローン等	558,181,594
投資信託受益証券（評価額）	902,752,323
投資証券（評価額）	22,697,235,085
未収入金	24,661,200,874
未収配当金	52,993,800
差入委託証拠金	376,827,227
（Ｂ）負債	**25,201,244,691**
未払金	25,201,148,751
未払解約金	90,000
その他未払費用	5,940
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）	**24,047,946,212**
元本	28,769,189,567
次期繰越損益金	△ 4,721,243,355
（Ｄ）受益権総口数	**28,769,189,567口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）	**8,359円**

＊期首における元本額は24,020,097,532円、当作成期間中における追加設定元本額は8,654,902,728円、同解約元本額は3,905,810,693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）
22,324,641,407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）
1,026,515,513円
ダイワ海外ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジあり）（投資一任専用）
1,128,740円
ダイワ・マクロ・ナビゲーター・ファンド2021-10（為替ヘッジあり／適格機関投資家専用）
1,427,642,151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）
3,989,261,756円
＊当期末の計算口数当りの純資産額は8,359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4,721,243,355円です。

■損益の状況

当期　自2022年８月16日　至2023年８月15日

項　　目	当　期
（Ａ）配当等収益	**898,229,371円**
受取配当金	882,663,497
受取利息	4,656,368
その他収益金	11,075,376
支払利息	△ 165,870
（Ｂ）有価証券売買損益	**△ 4,789,252,971**
売買益	5,812,530,650
売買損	△ 10,601,783,621
（Ｃ）先物取引等損益	**△ 217,777,315**
取引益	53,297,874
取引損	△ 271,075,189
（Ｄ）その他費用	**△ 9,467,575**
（Ｅ）当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ）	**△ 4,118,268,490**
（Ｆ）前期繰越損益金	**96,194,410**
（Ｇ）解約差損益金	**601,493,093**
（Ｈ）追加信託差損益金	**△ 1,300,662,368**
（Ｉ）合計（Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ）	**△ 4,721,243,355**
次期繰越損益金（Ｉ）	**△ 4,721,243,355**

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

Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）はＳ＆Ｐ Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「ＳＰＤＪＩ」）の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Ｓ＆Ｐ®、Ｓ＆Ｐ 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびＣＤＸ®は、Ｓ＆Ｐ Global, Inc. またはその関連会社（「Ｓ＆Ｐ」）の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはＳＰＤＪＩに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドは、ＳＰＤＪＩ、Dow Jones、Ｓ＆Ｐ、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）

運用報告書（全体版）

第８期

（決算日　2024年６月17日）

（作成対象期間　2023年６月16日～2024年６月17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）		
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		無制限
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド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		
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、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）（税引後配当込み、円ベース）		投資信託受益証券組入比率	投資証券組入比率	不動産投信指数先物比率	純資産総額
	（分配落）	税込み分配金	期中騰落率	（参考指数）	期中騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
4期末（2020年6月15日）	8,440	300	△ 15.2	9,339	△ 15.3	2.3	98.0	3.3	424
5期末（2021年6月15日）	11,716	170	40.8	13,122	40.5	0.9	98.7	1.7	1,290
6期末（2022年6月15日）	11,992	115	3.3	13,549	3.3	4.0	95.7	1.8	11
7期末（2023年6月15日）	12,132	400	4.5	14,120	4.2	5.8	94.7	2.8	12
8期末（2024年6月17日）	14,242	190	19.0	16,840	19.3	4.3	94.3	2.7	109

（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）（税引後配当込み、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。
（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）はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「SPDJI」）の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Ｓ＆Ｐ®、Ｓ＆Ｐ500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびCDX®は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「Ｓ＆Ｐ」）の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはSPDJIに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。ダイワ外国ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワＳＭＡ専用）は、SPDJI、Dow Jones、Ｓ＆Ｐ、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

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：12,132円
期　末：14,242円（分配金190円）
騰落率：19.0%（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、海外リート市況の上昇および為替相場が円安に動いたことから、ベンチマークの上昇と同様に、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」をご参照ください。

年　月　日	基準価額		Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（税引後配当込み、円ベース）		投資信託受益証券組入比率	投資証券組入比率	不動産投信指数先物比率
		騰落率	（参考指数）	騰落率			
	円	%		%	%	%	%
（期首）2023年６月15日	12,132	—	14,120	—	5.8	94.7	2.8
６月末	12,465	2.7	14,554	3.1	1.2	96.0	2.8
７月末	12,530	3.3	14,597	3.4	1.8	95.5	2.8
８月末	12,715	4.8	14,849	5.2	2.8	94.5	2.7
９月末	11,993	△ 1.1	14,006	△ 0.8	1.7	95.4	2.9
10月末	11,296	△ 6.9	13,167	△ 6.8	3.7	93.5	2.9
11月末	12,485	2.9	14,612	3.5	3.5	93.5	3.0
12月末	13,486	11.2	15,654	10.9	3.2	93.8	3.0
2024年１月末	13,359	10.1	15,636	10.7	3.4	93.6	2.9
２月末	13,590	12.0	15,896	12.6	3.8	93.5	2.9
３月末	14,122	16.4	16,477	16.7	1.5	95.7	2.9
４月末	13,854	14.2	16,161	14.5	3.5	93.8	2.8
５月末	14,074	16.0	16,434	16.4	3.7	93.5	2.7
（期末）2024年６月17日	14,432	19.0	16,840	19.3	4.3	94.3	2.7

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■海外リート市況

海外リート市況は、当作成期を通して見るとやや上昇しました。

海外リート市況は、当作成期首より、追加利上げ観測や長期金利の上昇などを嫌気し、下落して始まりました。2023年７月に入ると、米国におけるインフレ指標の鈍化や長期金利の低下が好感され上昇に転じましたが、８月以降は、米国国債の増発やＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）の政策金利見通しの引き上げ、米国政府機関の閉鎖懸念などから長期金利が大幅に上昇したことを受けて下落しました。10月に入ると、つなぎ予算の成立によって政府機関の閉鎖が回避され、一時的に反発しましたが、景気の先行き不透明感や企業業績の伸びの鈍化、パレスチナ情勢の悪化、長期金利のさらなる上昇などが嫌気され、続落しました。11月以降は、欧米のインフレ率が予想以上に鈍化し金利が低下したことや、ＦＲＢ議長が将来の利下げについての議論を始めたと述べたことを受けて利下げ観測が高まったことなどが好感され、上昇しました。2024年に入ると、米国を中心とした金利上昇から再度下落に転じました。２月以降については、決算発表が本格化する中でセクターや銘柄によって強弱感はあるものの、おおむね堅調な2024年通年の業績見通しとなり、米国長期金利が上昇する中でも底堅い推移となりました。４月に入ると長期金利の上昇が嫌気され、海外リート市況は再度下落しました。５月以降は米国の長期金利が下落する中で上昇に転じ、当作成期末を迎えました。

■為替相場

為替相場は上昇（円安）しました。

米ドル対円為替相場は、当作成期首より、ＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）が政策金利見通しを引き上げた一方で、日銀は現状の金融緩和政策の維持を決定したことなどから、2023年６月末にかけて上昇しました。しかし７月は、日本の政府要人等による円安けん制発言や日銀の政策運営の柔軟化決定を受け、米ドルは対円で下落（円高）しました。８月以降は、米国金利が上昇した一方で日銀は緩和的な金融政策の維持を発表したことから、米ドルは対円で上昇しました。11月以降は、日銀による政策修正や米国金利の大幅な低下を受け、下落しました。しかし2024年に入ってからは、米国金利の上昇や日銀による金融政策の維持などを背景に円安米ドル高に転じました。３月には、日銀がマイナス金利の解除など大規模な金融緩和の終了を発表したものの、他国・地域に比べて緩和的な環境が続く見通しなどから、円安米ドル高となりました。その後は、過度な円安米ドル高進行に対し政府・日銀が為替介入を行いましたが、円安基調は継続しました。

他の主要な投資先通貨も、おおむね米ドルと同様の推移となり、対円で上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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もあります。

■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。

ポートフォリオについて

（2023. 6. 16 ～ 2024. 6. 17）

■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

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

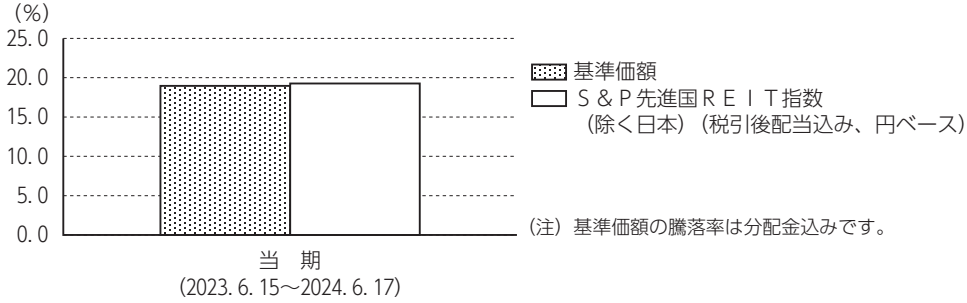
また、運用の効率化を図るため、ＥＴＦ（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物を組み入れました。

＊マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（税引後配当込み、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。



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

分配金について

当作成期の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 2023年６月16日 ～2024年６月17日
当期分配金（税込み）	**（円）**	**190**
対基準価額比率	（%）	1. 32
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）	4, 242

（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。
（注４）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。

■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	✓　224. 32円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	979. 39
（ｃ）収益調整金	3, 053. 46
（ｄ）分配準備積立金	174. 84
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	4, 432. 02
（ｆ）分配金	190. 00
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	4, 242. 02

（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もございます。

■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。

1万口当りの費用の明細

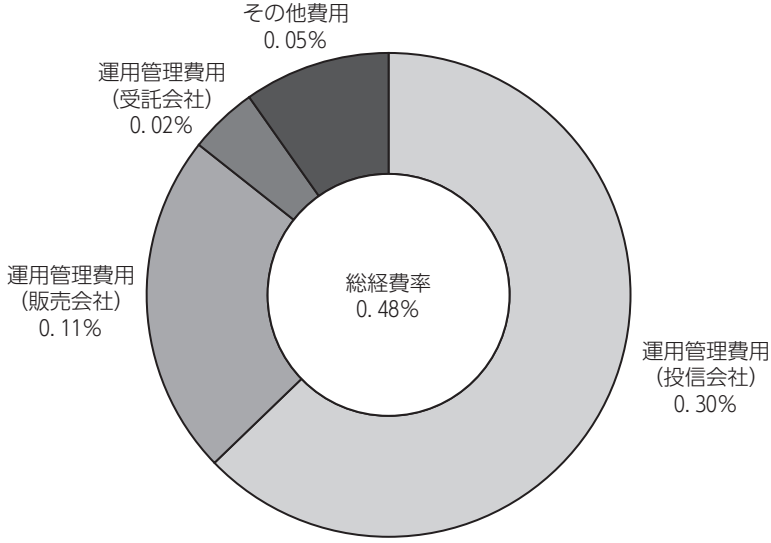
項目	当期 (2023. 6. 16～2024. 6. 17) 金額	比率	項目の概要
信託報酬	57円	0. 437%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は13, 013円です。**
(投信会社)	(40)	(0. 304)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(14)	(0. 111)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0. 011	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. 004)	
(投資証券)	(1)	(0. 004)	
有価証券取引税	1	0. 007	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)	
(投資証券)	(1)	(0. 007)	
その他費用	7	0. 050	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保管費用)	(4)	(0. 029)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(2)	(0. 016)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	66	0. 505	

（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。

■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

（2023年６月16日から2024年６月17日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	34,741	121,290	9,462	34,076

（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	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド	3,929	29,208	111,300

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年６月17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	111,300	99.9
コール・ローン等、その他	153	0.1
投資信託財産総額	111,453	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17日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝157.53円、１カナダ・ドル＝114.69円、１オーストラリア・ドル＝104.17円、１香港・ドル＝20.16円、１シンガポール・ドル＝116.47円、１ニュージーランド・ドル＝96.66円、１イギリス・ポンド＝199.87円、１イスラエル・シュケル＝42.35円、100韓国・ウォン＝11.43円、１ユーロ＝168.64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（1,884,394千円）の投資信託財産総額（1,900,872千円）に対する比率は、99.1％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（41,528,242千円）の投資信託財産総額（41,923,152千円）に対する比率は、99.1％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年６月17日現在

項目	当期末
（Ａ）資産	**111,453,397円**
コール・ローン等	152,204
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）	111,300,193
未収入金	1,000
（Ｂ）負債	**1,613,040**
未払収益分配金	1,465,357
未払信託報酬	145,968
その他未払費用	1,715
（Ｃ）純資産総額（Ａ－Ｂ）	**109,840,357**
元本	77,124,104
次期繰越損益金	32,716,253
（Ｄ）受益権総口数	**77,124,104口**
１万口当り基準価額（Ｃ／Ｄ）	**14,242円**

＊期首における元本額は10,000,000円、当作成期間中における追加設定元本額は91,547,167円、同解約元本額は24,423,063円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は14,242円です。

■損益の状況

当期　自 2023年６月16日　至 2024年６月17日

項　　目	当　　期
（Ａ）有価証券売買損益	**9, 488, 396円**
売買益	11, 556, 858
売買損	△　2, 068, 462
（Ｂ）信託報酬等	△　**204, 805**
（Ｃ）当期損益金（Ａ＋Ｂ）	**9, 283, 591**
（Ｄ）前期繰越損益金	**1, 348, 438**
（Ｅ）追加信託差損益金	**23, 549, 581**
（配当等相当額）	(　17, 080, 842)
（売買損益相当額）	(　6, 468, 739)
（Ｆ）合計（Ｃ＋Ｄ＋Ｅ）	**34, 181, 610**
（Ｇ）収益分配金	△　**1, 465, 357**
次期繰越損益金（Ｆ＋Ｇ）	**32, 716, 253**
追加信託差損益金	23, 549, 581
（配当等相当額）	(　17, 080, 842)
（売買損益相当額）	(　6, 468, 739)
分配準備積立金	9, 166, 672

（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	1, 730, 063円
（ｂ）経費控除後の有価証券売買等損益	7, 553, 528
（ｃ）収益調整金	23, 549, 581
（ｄ）分配準備積立金	1, 348, 438
（ｅ）当期分配対象額（ａ＋ｂ＋ｃ＋ｄ）	34, 181, 610
（ｆ）分配金	1, 465, 357
（ｇ）翌期繰越分配対象額（ｅ－ｆ）	32, 716, 253
（ｈ）受益権総口数	77, 124, 104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（2023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（2024年６月17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

（2023年６月16日から2024年６月17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）	443.6	5,448,329	12,282	VANGUARD REAL ESTATE ETF（アメリカ）	459.9	5,683,584	12,358

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資証券

（2023年６月16日から2024年６月17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）	24.066	443,566	18,431	PROLOGIS INC（アメリカ）	1.5	28,560	19,040
WELLTOWER INC（アメリカ）	27.045	339,747	12,562	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC（イギリス）	105.595	15,244	144
EQUINIX INC（アメリカ）	2.422	287,158	118,562	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS（ベルギー）	4.486	15,227	3,394
REALTY INCOME CORP（アメリカ）	34.032	285,861	8,399	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR（ニュージーランド）	80.882	14,579	180
DIGITAL REALTY TRUST INC（アメリカ）	13.869	270,924	19,534	SIMON PROPERTY GROUP INC（アメリカ）	0.6	12,282	20,471
PUBLIC STORAGE（アメリカ）	4.049	168,535	41,623	UNITE GROUP PLC/THE（イギリス）	6.269	10,558	1,684
SIMON PROPERTY GROUP INC（アメリカ）	8.297	156,716	18,888	STRIDE PROPERTY GROUP（ニュージーランド）	92.477	10,422	112
VICI PROPERTIES INC（アメリカ）	30.05	137,285	4,568	OUE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST（シンガポール）	412.463	9,473	22
GOODMAN GROUP（オーストラリア）	42.826	113,425	2,648	WELLTOWER INC（アメリカ）	0.7	9,012	12,875
AVALONBAY COMMUNITIES INC（アメリカ）	3.947	109,487	27,739	PUBLIC STORAGE（アメリカ）	0.2	8,227	41,137

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2024年６月17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（10,981,310千口）の内容です。

(1) 外国投資信託受益証券

銘柄		2024年６月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千アメリカ・ドル	千円
（アメリカ）				
VANGUARD REAL ESTATE ETF		133.3	11,197	1,763,894
合計	口数、金額	133.3	11,197	1,763,894
	銘柄数＜比率＞	1銘柄		<4.2%>

（注１）邦貨換算金額は、2024年６月17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)外国投資証券

銘柄	2024年6月17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)			
DIGITAL CORE REIT UNITS	126.6	68	10,769
MANULIFE US REAL ESTATE INV	265.962	18	2,848
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	135.3	18	2,983
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90	—	—
PRIME US REIT	101.42	11	1,869
(アメリカ)			
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22.085	306	48,324
URBAN EDGE PROPERTIES	21.56	386	60,896
XENIA HOTELS & RESORTS INC	19.28	274	43,249
AVALONBAY COMMUNITIES INC	26.097	5,268	829,981
SIMON PROPERTY GROUP INC	59.93	8,919	1,405,070
BOSTON PROPERTIES INC	26.562	1,637	257,920
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24	193	30,510
VORNADO REALTY TRUST	29.3	745	117,375
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	17.448	212	33,450
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	14.156	578	91,095
UNITI GROUP INC	43.742	120	18,949
NEXPOINT RESIDENTIAL	4.188	155	24,462
EQUITY RESIDENTIAL	63.457	4,233	666,858
APPLE HOSPITALITY REIT INC	38.998	563	88,710
EPR PROPERTIES	13.806	556	87,712
CITY OFFICE REIT INC	6	29	4,640
GLOBAL NET LEASE INC	35.794	258	40,654
EQUINIX INC	17.206	13,184	2,076,917
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	16.598	404	63,745
CHATHAM LODGING TRUST	8.953	74	11,677
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	10.943	1,081	170,368
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	23.093	284	44,781
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4.348	101	16,007
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7.8	22	3,600
HOST HOTELS & RESORTS INC	129.786	2,312	364,333
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	58.489	2,072	326,536
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	23.216	114	18,103
RLJ LODGING TRUST	28.135	269	42,415
FARMLAND PARTNERS INC	7.936	90	14,251
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	12.353	136	21,483
KIMCO REALTY CORP	122.585	2,298	362,077
GLOBAL MEDICAL REIT INC	11.295	101	16,049
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	69.803	1,151	181,435
WHITESTONE REIT	8.217	109	17,319
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	49.136	2,132	336,010
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22.673	160	25,323
PARK HOTELS & RESORTS INC	38.484	564	88,995

銘柄	2024年６月17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
INVITATION HOMES INC	105.825	3,756	591,806
JBG SMITH PROPERTIES	15.961	234	36,960
ALEXANDER & BALDWIN INC	13.294	219	34,575
CLIPPER REALTY INC	1.89	6	1,092
GLADSTONE LAND CORP	6.132	82	12,924
AMERICOLD REALTY TRUST	48.843	1,245	196,126
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11.179	42	6,639
VICI PROPERTIES INC	190.4	5,386	848,522
BRT APARTMENTS CORP	2.049	35	5,587
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	5.139	547	86,313
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	28.595	789	124,326
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	6.717	140	22,167
BROADSTONE NET LEASE INC	34.319	524	82,607
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	19.716	114	18,045
AMERICAN ASSETS TRUST INC	8.928	193	30,449
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	41.131	737	116,175
PARAMOUNT GROUP INC	30.339	140	22,175
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	23.974	223	35,198
NETSTREIT CORP	12.591	215	34,016
APARTMENT INCOME REIT CO	26.48	1,030	162,350
CTO REALTY GROWTH INC	3.7	64	10,153
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	38.724	1,735	273,471
STAG INDUSTRIAL INC	33.277	1,163	183,264
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2.066	31	4,911
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	3.325	43	6,908
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	22.363	720	113,541
ORION OFFICE REIT INC	9.048	31	4,888
VENTAS INC	74.045	3,709	584,381
CARETRUST REIT INC	23.917	601	94,831
INVENTRUST PROPERTIES CORP	12.376	305	48,193
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	55.091	1,227	193,356
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7.759	17	2,737
SABRA HEALTH CARE REIT INC	42.376	605	95,392
UMH PROPERTIES INC	11.439	176	27,786
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	4.316	94	14,869
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	5.785	27	4,410
PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	6.3	72	11,383
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	2.529	62	9,900
IRON MOUNTAIN INC	53.713	4,727	744,773
TERRENO REALTY CORP	17.127	993	156,457
SUN COMMUNITIES INC	22.907	2,671	420,900
ACADIA REALTY TRUST	18.744	324	51,082
ALEXANDER'S INC	0.393	83	13,202
PROLOGIS INC	170.037	19,093	3,007,791
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28.96	3,368	530,659

銘柄	2024年６月17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
BRANDYWINE REALTY TRUST	31.541	144	22,756
SAUL CENTERS INC	2.261	83	13,085
VERIS RESIDENTIAL INC	14.696	222	34,980
CAMDEN PROPERTY TRUST	19.568	2,114	333,038
COUSINS PROPERTIES INC	27.816	642	101,177
SITE CENTERS CORP	32.991	480	75,669
EASTGROUP PROPERTIES INC	8.742	1,449	228,410
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11.767	3,277	516,243
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	24.242	1,151	181,356
FEDERAL REALTY INVS TRUST	13.463	1,362	214,606
GETTY REALTY CORP	8.998	240	37,945
WELLTOWER INC	101.835	10,594	1,669,016
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	130.24	2,559	403,153
HIGHWOODS PROPERTIES INC	19.374	497	78,375
SERVICE PROPERTIES TRUST	30.381	149	23,594
EQUITY COMMONWEALTH	19.557	375	59,213
KILROY REALTY CORP	19.567	622	98,081
LTC PROPERTIES INC	7.59	255	40,245
LXP INDUSTRIAL TRUST	53.632	471	74,348
MID-AMERICA APARTMENT COMM	21.391	2,980	469,469
MACERICH CO/THE	39.582	573	90,287
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	34.266	2,149	338,557
NATL HEALTH INVESTORS INC	7.956	528	83,269
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	33.442	1,408	221,893
REALTY INCOME CORP	153.016	8,166	1,286,463
COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	20.564	501	78,977
PUBLIC STORAGE	29.103	8,243	1,298,586
REGENCY CENTERS CORP	30.207	1,865	293,933
SAFEHOLD INC	8.205	153	24,235
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	19.735	533	84,094
SL GREEN REALTY CORP	11.862	675	106,380
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	37.967	107	16,866
UDR INC	55.66	2,241	353,179
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2.229	86	13,592
WP CAREY INC	40.176	2,253	354,989
ELME	16.097	251	39,608
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4.7	4	740
AGREE REALTY CORP	18.386	1,126	177,459
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	44.953	1,455	229,226
CUBESMART	41.311	1,827	287,836
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	37.652	375	59,075
DIGITAL REALTY TRUST INC	59.404	8,905	1,402,938
EXTRA SPACE STORAGE INC	38.821	6,078	957,499
CENTERSPACE	2.759	186	29,398
KITE REALTY GROUP TRUST	40.207	882	139,090

銘柄		2024年６月17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
ONE LIBERTY PROPERTIES INC		2.892	68	10,751
GLADSTONE COMMERCIAL CORP		6.928	97	15,377
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO		38.419	315	49,688
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		109.779	532	83,873
FRANKLIN STREET PROPERTIES C		16.005	26	4,160
DOUGLAS EMMETT INC		30.558	406	64,023
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額	4,793.046	190,553	30,017,902
	銘柄数＜比率＞	138銘柄		<71.7%>
		千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)				
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T		8.4	26	3,034
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS		5.6	39	4,483
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN		9.341	125	14,419
PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T		4.4	22	2,543
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U		3.358	51	5,873
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		9.8	63	7,272
SLATE GROCERY REIT		5.5	61	7,020
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		11	188	21,636
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		3.4	50	5,837
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		23.5	114	13,098
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE		1.06	9	1,043
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		6.1	407	46,684
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		26.4	331	37,968
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		14	164	18,882
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		20.5	301	34,585
CHOICE PROPERTIES REIT		31.7	402	46,209
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		3.3	49	5,707
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		10.5	141	16,245
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		14	307	35,308
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		16.2	707	81,175
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		25.366	228	26,183
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		29	484	55,544
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV		1.65	31	3,606
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		4.7	322	37,043
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		10.3	128	14,778
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		12.4	195	22,384
カナダ・ドル通貨計	口数、金額	311.475	4,957	568,570
	銘柄数＜比率＞	26銘柄		<1.4%>
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)				
DEXUS/AU		212.807	1,381	143,871
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI		88.653	100	10,481
HMC CAPITAL LTD		47.711	352	36,728
ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS		106.601	130	13,547
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR		66.132	159	16,602
CROMWELL PROPERTY GROUP		274.625	115	12,015

銘柄		2024年６月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千オーストラリア・ドル	千円
CENTURIA INDUSTRIAL REIT		105.525	328	34,186
RURAL FUNDS GROUP		72.888	146	15,261
WAYPOINT REIT		131.393	304	31,754
CHARTER HALL LONG WALE REIT		130.083	446	46,479
CENTURIA OFFICE REIT		77.754	92	9,638
CENTURIA CAPITAL GROUP		157.455	272	28,375
HOMECO DAILY NEEDS REIT		349.474	428	44,595
REGION GROUP		227.229	499	52,074
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		50.422	115	12,028
NATIONAL STORAGE REIT		247.573	571	59,574
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT		39.338	116	12,129
GDI PROPERTY GROUP		104.909	63	6,611
SCENTRE GROUP		1,026.952	3,204	333,770
ARENA REIT		70.268	261	27,229
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS		38.14	123	12,832
BWP TRUST		105.5	379	39,563
GPT GROUP		379.01	1,542	160,689
CHARTER HALL RETAIL REIT		101.171	331	34,567
MIRVAC GROUP		780.715	1,471	153,301
STOCKLAND		471.274	2,092	217,971
ABACUS GROUP UNIT		79.969	90	9,413
GOODMAN GROUP		341.947	12,231	1,274,149
VICINITY CENTRES		765.581	1,423	148,336
CHARTER HALL GROUP		93.585	1,150	119,812
INGENIA COMMUNITIES GROUP		73.337	357	37,204
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額	6,818.021	30,285	3,154,798
	銘柄数＜比率＞	31銘柄		<7.5%>
		千口	千香港・ドル	千円
(香港)				
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		395	406	8,202
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		181	313	6,312
FORTUNE REIT		294	1,146	23,115
PROSPERITY REIT		246	332	6,695
LINK REIT		508.9	16,590	334,457
CHAMPION REIT		368	588	11,870
香港・ドル通貨計	口数、金額	1,992.9	19,377	390,652
	銘柄数＜比率＞	6銘柄		<0.9%>
		千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)				
KEPPEL DC REIT		262.783	470	54,785
AIMS APAC REIT		134.7	171	19,924
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI		572.09	546	63,632
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		101.6	67	7,869
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL		344.44	191	22,264
EC WORLD REIT		36.5	10	1,190
CAPITALAND ASCENDAS REIT		704.077	1,809	210,749

銘柄		2024年６月17日現在		
		口数	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
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		1,001.122	1,942	226,205
SUNTEC REIT		438.1	464	54,087
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		660.4	871	101,530
KEPPEL REIT		439.1	368	42,959
CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU		485.756	432	50,352
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T		1,172.902	328	38,250
CDL HOSPITALITY TRUSTS		131.7	125	14,648
FRASERS CENTREPOINT TRUST		222.376	478	55,685
STARHILL GLOBAL REIT		273.9	131	15,312
CAPITALAND CHINA TRUST		227.842	149	17,381
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		75.7	275	32,093
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		409.369	884	102,987
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS		451.684	551	64,181
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		200	123	14,325
PARAGON REIT		237.1	197	23,058
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	8,583.241	10,590	1,233,475
	銘柄数＜比率＞	22銘柄		＜2.9%＞
		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		157.936	170	16,487
KIWI PROPERTY GROUP LTD		314.982	253	24,509
GOODMAN PROPERTY TRUST		208.239	438	42,370
PRECINCT PROPERTIES GROUP		313.87	368	35,647
ニュージーランド・ドル通貨計	口数、金額	995.027	1,231	119,014
	銘柄数＜比率＞	4銘柄		＜0.3%＞
		千口	千イギリス・ポンド	千円
（イギリス）				
WAREHOUSE REIT PLC		77.771	61	12,373
HELICAL PLC		20.666	45	9,004
LIFE SCIENCE REIT PLC		61.021	20	4,183
ASSURA PLC		568.072	225	45,098
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		116.204	108	21,716
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE		67.467	34	6,850
CLS HOLDINGS PLC		22.95	19	3,954
PICTON PROPERTY INCOME LTD		104.221	66	13,373
REGIONAL REIT LTD		71.837	15	3,072
NEWRIVER REIT PLC		59.545	43	8,616
SHAFTESBURY CAPITAL PLC		376.124	514	102,915
CUSTODIAN REIT PLC		83.903	60	12,074
PRS REIT PLC/THE		95.537	73	14,607
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		78.863	67	13,413
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		62.933	35	7,131
TARGET HEALTHCARE REIT PLC		118.044	93	18,756
AEW UK REIT PLC		27.617	23	4,730
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS		133.52	100	20,148
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		237.187	171	34,180

銘柄		2024年６月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千イギリス・ポンド	千円
URBAN LOGISTICS REIT PLC		90.888	108	21,726
HOME REIT PLC		117.587	22	4,472
LAND SECURITIES GROUP PLC		144.75	900	179,951
SEGRO PLC		257.696	2,342	468,186
HAMMERSON PLC		733.072	205	41,054
UNITE GROUP PLC/THE		76.379	695	138,919
BRITISH LAND CO PLC		180.759	771	154,123
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		78.316	265	53,141
DERWENT LONDON PLC		21.624	502	100,356
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		254.364	231	46,365
WORKSPACE GROUP PLC		25.932	146	29,232
SAFESTORE HOLDINGS PLC		41.573	331	66,307
BIG YELLOW GROUP PLC		37.781	442	88,501
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		392.175	762	152,456
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		93.799	41	8,342
TRITAX BIG BOX REIT PLC		439.49	675	135,099
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	5,369.667	10,228	2,044,439
	銘柄数＜比率＞	35銘柄		＜4.9%＞
		千口	千イスラエル・シュケル	千円
（イスラエル）				
MENIVIM- THE NEW REIT LTD		125.212	194	8,251
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT		40.78	264	11,210
REIT 1 LTD		35.212	485	20,549
イスラエル・シュケル通貨計	口数、金額	201.204	944	40,011
	銘柄数＜比率＞	3銘柄		＜0.1%＞
		千口	千韓国・ウォン	千円
（韓国）				
SK REITS LTD		22.834	111,087	12,697
D&D PLATFORM REIT LTD		10.703	37,567	4,293
NH ALL ONE REIT LTD		6.454	23,815	2,722
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		13.632	83,291	9,520
LOTTE REIT CO LTD		24.036	80,039	9,148
JR REIT XXVII		32.413	134,027	15,319
KORAMCO ENERGY PLUS REIT		9.157	42,305	4,835
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L		31.62	145,610	16,643
韓国・ウォン通貨計	口数、金額	150.849	657,744	75,180
	銘柄数＜比率＞	8銘柄		＜0.2%＞
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（アイルランド）				
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		73.078	66	11,251
国小計	口数、金額	73.078	66	11,251
	銘柄数＜比率＞	1銘柄		＜0.0%＞
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（オランダ）				
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		7.366	159	26,893
WERELDHAVE NV		6.098	81	13,738
NSI NV		3.09	60	10,244

銘柄		2024年６月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千ユーロ	千円
VASTNED RETAIL NV		3.081	72	12,158
国小計	口数、金額	19.635	373	63,035
	銘柄数＜比率＞	4銘柄		<0.2%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（ベルギー）				
AEDIFICA		8.1	456	76,904
COFINIMMO		6.263	359	60,625
RETAIL ESTATES		2.081	130	21,968
WAREHOUSES DE PAUW SCA		29.532	747	126,000
CARE PROPERTY INVEST		6.301	87	14,833
XIOR STUDENT HOUSING NV		5.665	162	27,418
MONTEA NV		3.05	242	40,890
国小計	口数、金額	60.992	2,185	368,643
	銘柄数＜比率＞	7銘柄		<0.9%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（フランス）				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		17.291	1,253	211,406
ICADE		5.324	136	22,984
CARMILA		9.464	151	25,568
ALTAREA		0.777	65	11,085
GECINA SA		8.745	800	135,013
KLEPIERRE		33.231	848	143,128
COVIVIO		8.259	369	62,369
MERCIALYS		15.994	173	29,184
国小計	口数、金額	99.085	3,799	640,740
	銘柄数＜比率＞	8銘柄		<1.5%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（ドイツ）				
HAMBORNER REIT AG		12.056	78	13,174
国小計	口数、金額	12.056	78	13,174
	銘柄数＜比率＞	1銘柄		<0.0%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（スペイン）				
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		8.412	58	9,788
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		48.722	292	49,381
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		56.822	602	101,574
国小計	口数、金額	113.956	953	160,743
	銘柄数＜比率＞	3銘柄		<0.4%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（イタリア）				
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		6.93	12	2,131
国小計	口数、金額	6.93	12	2,131
	銘柄数＜比率＞	1銘柄		<0.0%>
		千口	千ユーロ	千円
ユーロ（その他）				
SHURGARD SELF STORAGE LTD		5.305	205	34,622

銘柄		2024年６月17日現在		
		口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千ユーロ	千円
CROMWELL REIT EUR		52.92	75	12,672
国小計	口数、金額	58.225	280	47,295
	銘柄数＜比率＞	2銘柄		<0.1%>
ユーロ通貨計	口数、金額	443.957	7,750	1,307,016
	銘柄数＜比率＞	27銘柄		<3.1%>
合計	口数、金額	29,659.387	—	38,951,062
	銘柄数＜比率＞	300銘柄		<93.1%>

（注１）邦貨換算金額は、2024年６月17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		2024年６月17日現在	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
外国	DJ US REAL ESTATE（アメリカ）	844	—
外国	STOXX 600 REAL（ドイツ）	289	—

（注１）外貨建の評価額は、2024年６月17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19期（決算日　2023年11月30日）

（作成対象期間　2022年12月１日～2023年11月30日）

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

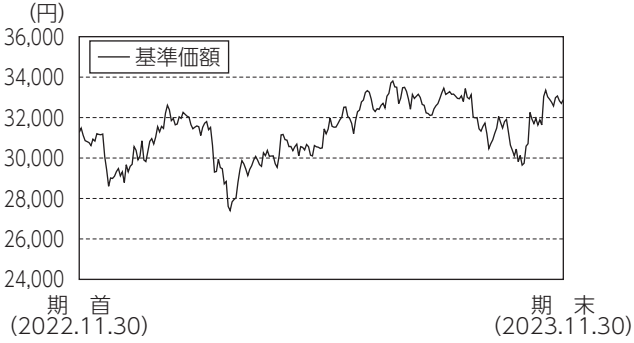
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

大和アセットマネジメント
Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年　月　日	基準価額	騰落率	S&P先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（税引後配当込み、円ベース）(ベンチマーク)	騰落率	投資信託受益証券組入比率	投資証券組入比率	不動産投信指数先物比率
	円	%		%	%	%	%
(期首)2022年11月30日	31,268	－	29,792	－	4.6	93.0	2.5
12月末	29,315	△6.2	28,118	△5.6	5.8	91.2	3.0
2023年１月末	31,293	0.1	29,884	0.3	6.3	90.8	2.9
２月末	31,587	1.0	30,154	1.2	6.7	90.0	3.4
３月末	29,423	△5.9	27,902	△6.3	3.8	93.5	2.8
４月末	30,113	△3.7	28,709	△3.6	4.7	92.5	2.8
５月末	30,534	△2.3	29,150	△2.2	5.3	92.2	2.7
６月末	32,773	4.8	31,165	4.6	1.2	96.0	2.8
７月末	32,955	5.4	31,258	4.9	1.8	95.5	2.8
８月末	33,454	7.0	31,798	6.7	2.8	94.5	2.7
９月末	31,566	1.0	29,992	0.7	1.7	95.4	2.9
10月末	29,743	△4.9	28,195	△5.4	3.7	93.5	2.9
(期末)2023年11月30日	32,886	5.2	31,290	5.0	3.5	93.5	3.0

（注１）騰落率は期首比。
（注２）Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（税引後配当込み、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。
（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。
※ベンチマークを「Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（配当込み、円ベース）」から「Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）（税引後配当込み、円ベース）」に変更しました。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：31,268円　期末：32,886円　騰落率：5.2%

【基準価額の主な変動要因】

海外リートにほぼ100%投資した結果、米国を中心にリート市況は下落したものの、為替相場が円安基調で推移したため、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、米国のインフレ率が予想を下回り、利上げペースが鈍化するとの期待が高まったことなどが好感されて上昇しました。2023年２月に入ると、予想を上回る経済指標の発表が相次いだことで金利が再び上昇し市場に嫌気されたほか、３月には米国地方銀行の経営破綻による金融不安がリートの資金調達コスト上昇につながるとの懸念が広がったことから、下落しました。その後は、ＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）による緊急融資枠の新設で資金繰り懸念が後退したことや、金利が急低下したことなどが好感されて米国を中心に上昇する局面もありましたが、追加利上げ観測や長期金利の上昇などを嫌気し、再度軟調に推移しました。７月に入ると、米国におけるインフレ指標の鈍化や長期金利の低下が好感されて上昇に転じましたが、８月以降は、米国国債の増発やＦＲＢの政策金利見通しの引き上げ、米国政府機関の閉鎖懸念などから長期金利が大幅に上昇したことを受けて下落しました。10月に入ると、つなぎ予算の成立によって米国政府機関の閉鎖が回避されて一時的に反発しましたが、景気の先行き不透明感や企業業績の伸びの鈍化、パレスチナ情勢の悪化、長期金利のさらなる上昇などが嫌気され、続落しました。当作成期末にかけては、欧米のインフレ率が予想以上に鈍化し金利が低下したことなどが好感されて上昇しました。

○為替相場

為替相場は、対円で上昇（円安）しました。

米ドルの対円為替相場は、当作成期首より、インフレ率の減速期待から米国金利が低下したことや、2022年12月に日銀が想定外の政策修正を行ったことで金融緩和政策の転換が意識されたことなどを受けて下落（円高）しました。その後は、欧米の主要中央銀行による追加利上げ観測を背景に、米ドルは対円で上昇基調となる局面もありましたが、米国での利下げ期待が高まったことなどから再度下落しました。2023年５月以降は、米国金利の上昇に連動して米ドルは対円で上昇に転じました。６月に入ると、ＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）が政策金利見通しを引き上げた一方で、日銀は現状の金融緩和政策の維持を決定したことなどから、月末にかけて米ドルは対円での上昇幅を拡大しました。７月は、日本の政府要人等による円安けん制発言や日銀の政策運営の柔軟化決定を受け、米ドルは対円で下落しました。８月以降は、米国金利が上昇した一方で日銀は緩和的な金融政策の維持を発表したことから、米ドルは対円で上昇しました。当作成期末にかけては、米国金利の大幅な低下を背景に日米金利差の縮小が意識され、米ドルは対円で下落しました。他の通貨についても、おおむね米ドルと同様の推移となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は5.0%となりました。一方、当

ファンドの基準価額の騰落率は5.2％となりました。
保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。また、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、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）（税引後配当込み、円ベース）です。

《今後の運用方針》

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

■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）
（投資証券）	（ 2）
有価証券取引税	2
（投資信託受益証券）	（ 0）
（投資証券）	（ 2）
その他費用	15
（保管費用）	（10）
（その他）	（ 5）
合　　計	22

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

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

（2022年12月１日から2023年11月30日まで）

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
	アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
外国	VANGUARD REAL ESTATE ETF	456	37,055	462.6	37,867

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資証券

（2022年12月１日から2023年11月30日まで）

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
	アメリカ	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
外国	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1.408	18	－	－
	URBAN EDGE PROPERTIES	3.358	49	－	－
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	2.388	30	－	－
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	4.341	775	－	－
	SIMON PROPERTY GROUP INC	9.295	1,027	－	－
	BOSTON PROPERTIES INC	4.352	248	－	－
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	2.512	18	1.2	8
	VORNADO REALTY TRUST	4.31	71	－	－
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	3.258	45	－	－
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2.025	77	－	－
	UNITI GROUP INC	41.9	219	－	－
	NEXPOINT RESIDENTIAL	0.546	24	－	－
	EQUITY RESIDENTIAL	10.746	668	－	－
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	5.614	85	－	－
	EPR PROPERTIES	1.981	81	－	－
	GLOBAL NET LEASE INC	3.976 (15.245)	47 (－)	－	－

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
	EQUINIX INC	2.948	2,176	－	－
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3.928	102	－	－
	CHATHAM LODGING TRUST	1.619	17	－	－
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2.364	205	－	－
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	3.57	47	－	－
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	0.648	22	－	－
	HOST HOTELS & RESORTS INC	19.801	322	－	－
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	11.266	380	－	－
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	2.898	17	－	－
	RLJ LODGING TRUST	3.043	30	－	－
	FARMLAND PARTNERS INC	0.835	8	－	－
	PHYSICIANS REALTY TRUST	8.324	118	－	－
	ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1.559	18	－	－
	KIMCO REALTY CORP	17.908	335	－	－
	GLOBAL MEDICAL REIT INC	1.385	13	－	－
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	10.87	204	－	－
	WHITESTONE REIT	1.817	16	－	－
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	8.501	422	－	－
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	3.266	23	－	－
	PARK HOTELS & RESORTS INC	4.786	58	－	－
	INVITATION HOMES INC	15.717	514	－	－
	JBG SMITH PROPERTIES	1.799	26	－	－
	ALEXANDER & BALDWIN INC	2.309	41	－	－
	GLADSTONE LAND CORP	0.952	15	－	－
	AMERICOLD REALTY TRUST	6.438	193	1.4	46
	INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	2.179	8	－	－
	VICI PROPERTIES INC	37.744	1,196	1.4	46
	BRT APARTMENTS CORP	0.449	8	－	－
	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	0.665	52	－	－
	SAFEHOLD INC	0.365 (△ 2.927)	10 (△ 111)	－	－
	NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	3.611 (△ 22.754)	23 (－)	－	－
	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	6.562	158	－	－
	PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	1.268	27	0.3	6
	STORE CAPITAL CORP	0.275 (△ 39.367)	8 (△ 1,252)	－	－
	BROADSTONE NET LEASE INC	7.643	126	－	－
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	2.497	16	－	－
	LIFE STORAGE INC	2.014 (△ 14.428)	248 (－)	－	－
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	1.28	23	－	－
	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	6.417	106	－	－
	PARAMOUNT GROUP INC	4.446	21	－	－
	EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	2.664	17	－	－
	NETSTREIT CORP	4.314	78	－	－

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
	APARTMENT INCOME REIT CO	3.516	123	–	–
	CTO REALTY GROWTH INC	0.631	10	–	–
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	11.097	607	–	–
	STAG INDUSTRIAL INC	5.151	177	–	–
	ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	0.566	8	–	–
	INDUS REALTY TRUST INC	– (△ 0.861)	– (△ 54)	–	–
	POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	1.025	14	–	–
	PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	3.621	119	–	–
	ORION OFFICE REIT INC	1.225	7	–	–
	DIGITAL CORE REIT UNITS	77.2 (–)	43 (△ 0)	–	–
	VENTAS INC	11.808	532	–	–
	CARETRUST REIT INC	3.064	59	–	–
	INVENTRUST PROPERTIES CORP	1.927	44	–	–
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	8.678	185	–	–
	OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	0.631	7	–	–
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	6.26	73	–	–
	UMH PROPERTIES INC	3.131	46	–	–
	CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	0.716	16	–	–
	BLUEROCK HOMES TRUST INC CLASS A	–	–	0.487	6
	NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	5.547 (0.064)	67 (0)	–	–
	STAR HOLDINGS SHARES OF BENEFICIAL	– (2.122)	– (38)	–	–
	PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	6.3	122	–	–
	NET LEASE OFFICE PROPERTIES	– (2.504)	– (–)	–	–
	IRON MOUNTAIN INC	8.468	468	–	–
	TERRENO REALTY CORP	4.885	295	–	–
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	4.766	187	–	–
	SUN COMMUNITIES INC	3.669	489	–	–
	ACADIA REALTY TRUST	3.034	42	–	–
	ALEXANDER'S INC	0.043	8	–	–
	PROLOGIS INC	27.834	3,361	1.4	157
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5.501	663	–	–
	BRANDYWINE REALTY TRUST	4.509	20	–	–
	SAUL CENTERS INC	0.461	16	–	–
	VERIS RESIDENTIAL INC	2.125	34	–	–
	CAMDEN PROPERTY TRUST	3.032	317	–	–
	COUSINS PROPERTIES INC	4.467	94	–	–
	SITE CENTERS CORP	4.492	56	–	–
	EASTGROUP PROPERTIES INC	1.563	266	–	–
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.662	368	–	–
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	3.795	196	–	–
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	2.13	203	–	–
	GETTY REALTY CORP	1.781	60	–	–

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
	WELLTOWER INC	28.879	2,303	－	－
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	16.687	344	－	－
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	2.782	61	－	－
	SERVICE PROPERTIES TRUST	4.454	39	－	－
	EQUITY COMMONWEALTH	2.837	56	－	－
	KILROY REALTY CORP	3.065	95	－	－
	LTC PROPERTIES INC	1.26	42	－	－
	LXP INDUSTRIAL TRUST	10.136	101	－	－
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3.508	520	－	－
	MACERICH CO/THE	5.794	62	－	－
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6.93	463	－	－
	NATL HEALTH INVESTORS INC	0.988	51	－	－
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	5.92	248	－	－
	REALTY INCOME CORP	33.634	2,003	－	－
	COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	2.969	70	－	－
	PUBLIC STORAGE	4.537	1,308	－	－
	REGENCY CENTERS CORP	4.582 (1.605)	275 (－)	－	－
	RPT REALTY	2.169	20	0.6	6
	SAFEHOLD INC	3.036 (△ 7.765)	45 (73)	－	－
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	3.419	69	－	－
	SL GREEN REALTY CORP	1.678	46	－	－
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	7.967	16	2.9	6
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	0.528 (△ 4.628)	9 (－)	－	－
	UDR INC	8.226	334	－	－
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.429	20	－	－
	WP CAREY INC	7.037	511	－	－
	ELME	2.775	45	－	－
	AGREE REALTY CORP	5.159	342	－	－
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	8.497	259	－	－
	CUBESMART	6.389	285	－	－
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	5.083	48	－	－
	DIGITAL REALTY TRUST INC	10.894	1,219	－	－
	EXTRA SPACE STORAGE INC	4.499 (12.913)	654 (－)	－	－
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	1.068 (△ 5.643)	6 (△ 50)	－	－
	CENTERSPACE	0.276	15	－	－
	KITE REALTY GROUP TRUST	5.921	123	－	－
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.392	8	－	－
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1.407	17	－	－
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	5.743	45	－	－
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	16.93	134	－	－
	DOUGLAS EMMETT INC	2.608	30	－	－
	KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	25.1 (－)	6 (△ 2)	－	－

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
	PRIME US REIT	– (–)	– (△ 1)	–	–
	カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	–	–	2.3	7
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	–	–	6.2	15
	NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	1.3	12	–	–
	PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	0.7	9	–	–
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	1.4	10	–	–
	SLATE GROCERY REIT	0.7	10	–	–
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1.3	22	–	–
	SLATE OFFICE REIT	–	–	5.1	7
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	0.6	9	–	–
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2.8	21	–	–
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	–	–	15	352
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE	– (△ 5.04)	– (–)	–	–
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	0.8	9	3.5	36
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	0.5	39	–	–
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	2.9	40	–	–
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1.6	21	–	–
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	2.1	33	–	–
	CHOICE PROPERTIES REIT	3.7	51	–	–
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	0.6	10	–	–
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	0.7	11	–	–
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1.5	38	–	–
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1.3	62	–	–
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2.7	31	–	–
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2.9	59	–	–
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	0.5	31	–	–
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	0.7	10	–	–
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	1.2	27	–	–
	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
	DEXUS/AU	30.054	230	–	–
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	50.253	70	–	–
	HMC CAPITAL LTD	13.953	61	–	–
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	–	–	53.9	37
	HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	– (–)	– (△ 1)	–	–
	ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	27.566 (70.207)	33 (–)	–	–
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	15.409	47	–	–
	CROMWELL PROPERTY GROUP	47.755	30	–	–
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	9.57	29	–	–
	RURAL FUNDS GROUP	13.292	30	–	–
	WAYPOINT REIT	10.546	26	–	–
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	25.212	100	–	–

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
CENTURIA OFFICE REIT	15.504	22	－	－
CENTURIA CAPITAL GROUP	39.173	61	－	－
HOMECO DAILY NEEDS REIT	99.633	123	－	－
REGION GROUP	37.307	86	－	－
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	9.045	27	－	－
NATIONAL STORAGE REIT	67.577	159	－	－
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	7.828	22	－	－
GDI PROPERTY GROUP	15.887	11	－	－
SCENTRE GROUP	145.034	398	－	－
ARENA REIT	7.06	25	－	－
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	7.967	26	－	－
BWP TRUST	9.479	36	－	－
GPT GROUP	53.526	224	－	－
CHARTER HALL RETAIL REIT	10.464	38	－	－
MIRVAC GROUP	110.258	241	－	－
STOCKLAND	66.704	261	－	－
ABACUS GROUP UNIT	4.247	10	－	－
GOODMAN GROUP	50.166	1,020	－	－
VICINITY CENTRES	108.122	207	－	－
CHARTER HALL GROUP	13.774	159	－	－
INGENIA COMMUNITIES GROUP	9.803	38	－	－
香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	－ (70.7)	－ (△318)	70.7	307
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	116	210	42	58
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	39	114	－	－
FORTUNE REIT	35	208	－	－
PROSPERITY REIT	31	69	－	－
LINK REIT	127.9 (－)	6,362 (318)	－	－
CHAMPION REIT	63	204	－	－
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
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	－ (－)	－ (△4)	84.7	46
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	－ (－)	－ (△5)	－	－
CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	－ (－)	－ (△1)	－	－
KEPPEL DC REIT	47.2 (－)	91 (△5)	－	－
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	39.3 (－)	10 (△1)	210.276	48
AIMS APAC REIT	43.7 (－)	56 (△2)	－	－
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	85.3 (－)	101 (△5)	－	－
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	14.1 (－)	10 (△0)	－	－

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	36.7	26	－	－
CAPITALAND ASCENDAS REIT	130.6 (－)	362 (△12)	－	－
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	144.8 (－)	279 (△3)	－	－
SUNTEC REIT	60.1 (－)	78 (△3)	－	－
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	120.9 (－)	198 (△15)	－	－
KEPPEL REIT	41	37	－	－
CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	113.7 (－)	118 (△6)	－	－
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	305.1 (－)	99 (△4)	75.4	23
CDL HOSPITALITY TRUSTS	18 (－)	21 (△0)	23.7	25
FRASERS CENTREPOINT TRUST	35.6	77	－	－
STARHILL GLOBAL REIT	49.2	26	－	－
CAPITALAND CHINA TRUST	32.9 (－)	34 (△9)	－	－
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	7.4 (－)	28 (△2)	－	－
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	77.6 (－)	176 (△0)	－	－
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	65.3 (－)	104 (△3)	－	－
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	37.9	23	－	－
PARAGON REIT	63	58	－	－
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	228.6 (－)	77 (△0)	566.363	143
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
STRIDE PROPERTY GROUP	9.839	13	92.477	116
ARGOSY PROPERTY LTD	25.359	29	－	－
KIWI PROPERTY GROUP LTD	14.244	12	－	－
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	9.399	21	80.882	163
GOODMAN PROPERTY TRUST	17.468	38	－	－
PRECINCT PROPERTIES GROUP	30.348	38	－	－
イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
WAREHOUSE REIT PLC	7.303	7	－	－
EDISTON PROPERTY INVESTMENT COMPAN	－	－	31.488	21
HELICAL PLC	－ (18.206)	－ (50)	－	－
LIFE SCIENCE REIT PLC	61.021	41	－	－
ASSURA PLC	83.766	38	－	－
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	26.649	23	－	－
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	11.267	6	－	－
CLS HOLDINGS PLC	29.022 (28.3)	42 (41)	34.372	43
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	27.026	15	－	－

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	19.611	14	－	－
	REGIONAL REIT LTD	11.997	6	－	－
	NEWRIVER REIT PLC	8.861	7	－	－
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	223.352	273	－	－
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	19.615	12	105.595	84
	CUSTODIAN REIT PLC	15.782	13	－	－
	PRS REIT PLC/THE	19.665	16	－	－
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	16.688	17	－	－
	LXI REIT PLC	56.994	56	－	－
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	11.693	6	－	－
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	108.136	83	－	－
	AEW UK REIT PLC	5.687	5	－	－
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	6.556	5	12.663	8
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	32.859	25	－	－
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	15.69	18	－	－
	LAND SECURITIES GROUP PLC	20.984	127	－	－
	SEGRO PLC	36.613	273	－	－
	HAMMERSON PLC	180.911	46	24.539	6
	UNITE GROUP PLC/THE	16.789	153	6.269	57
	BRITISH LAND CO PLC	26.297	93	－	－
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	9.483	45	－	－
	DERWENT LONDON PLC	3.136	67	－	－
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	37.885	36	－	－
	WORKSPACE GROUP PLC	3.241	15	－	－
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	7.185	62	－	－
	SHAFTESBURY PLC	3.648	14	45.398	190
	BIG YELLOW GROUP PLC	5.146	56	－	－
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	29.347	51	－	－
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	15.661	6	－	－
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	66.316	93	－	－
	イスラエル	千口	千イスラエル・シュケル	千口	千イスラエル・シュケル
	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	19.686	31	－	－
	SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	6.082	44	－	－
	REIT 1 LTD	9.112	143	－	－
	韓国	千口	千韓国ウォン	千口	千韓国ウォン
	SK REITS LTD	7.135 (4.276)	30,782 (△ 96)	－	－
	SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD	－	－	3.93	12,557
	E KOCREF CR	－	－	3.584	17,723
	SHINHAN ALPHA REIT LTD	－ (1.839)	－ (△ 93)	1.839	328
	IGIS VALUE PLUS REIT LTD	－ (2.24)	－ (△ 794)	2.24	282
	SK REITS LTD	－ (－)	－ (17,884)	－	－

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千韓国ウォン	千口	千韓国ウォン
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	3.975 (－)	26,536 (93)	－	－
	LOTTE REIT CO LTD	2.997	12,449	－	－
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	2.765	11,347	15.855	62,202
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	3.7 (－)	15,888 (794)	9.3	38,942
	JR REIT XXVII	7.088	30,206	－	－
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	3.167	17,943	－	－
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	2.852	10,891	－	－
	ユーロ(アイルランド)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	10.019	9	－	－
	ユーロ(オランダ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	0.609	13	－	－
	WERELDHAVE NV	0.938	13	－	－
	NSI NV	0.462	10	－	－
	VASTNED RETAIL NV	0.419	9	－	－
	ユーロ(ベルギー)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	CARE PROPERTY INV RIGHTS NV	－ (3.45)	－ (－)	3.45	2
	AEDIFICA RIGHTS NV	－ (6.035)	－ (－)	6.035	2
	AEDIFICA	1.833	116	－	－
	COFINIMMO	1.144	86	－	－
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	0.954	18	－	－
	RETAIL ESTATES	0.416	26	－	－
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	5.496	150	－	－
	CARE PROPERTY INVEST	2.151	30	－	－
	XIOR STUDENT HOUSING NV	1.643	48	－	－
	MONTEA NV	0.661	48	－	－
	ユーロ(フランス)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1.907	98	0.825	38
	ICADE	0.751 (－)	33 (△8)	－	－
	CARMILA	0.916 (－)	12 (△10)	－	－
	ALTAREA	0.16	19	－	－
	GECINA SA	0.873	84	0.456	45
	KLEPIERRE	2.897 (－)	65 (△24)	－	－
	COVIVIO	1.21	61	－	－
	MERCIALYS	3.96	36	－	－
	ユーロ(ドイツ)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	－	－	1.82	7
	HAMBORNER REIT AG	1.647	11	－	－
	ユーロ(スペイン)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	1.342 (－)	6 (△3)	1.272	7

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	4.727 (－)	27 (△2)	－	－
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	4.758	38	－	－
	ユーロ(その他)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	CROMWELL REIT EUR	11 (－)	17 (△4)	6.2	8

（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）金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

（2022年12月１日から2023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 3,948	百万円 3,631	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。

■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		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
VANGUARD REAL ESTATE ETF		109.2	102.6	8,324	1,224,352
合計	口数、金額	109.2	102.6	8,324	1,224,352
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		<3.5%>

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

(2) 外国投資証券

銘柄	期首	当期末		
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
DIGITAL CORE REIT UNITS	49.4	126.6	75	11,078
MANULIFE US REAL ESTATE INV	265.962	265.962	24	3,559
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	110.2	135.3	36	5,372
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90	90	–	–
PRIME US REIT	92.2	92.2	14	2,061
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	19.596	21.004	267	39,323
URBAN EDGE PROPERTIES	17.277	20.635	340	50,134
XENIA HOTELS & RESORTS INC	16.4	18.788	228	33,544
AVALONBAY COMMUNITIES INC	20.571	24.912	4,255	625,888
SIMON PROPERTY GROUP INC	48.158	57.453	7,052	1,037,274
BOSTON PROPERTIES INC	20.983	25.335	1,444	212,383
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	22.688	24	165	24,319
VORNADO REALTY TRUST	23.721	28.031	666	97,951
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	13.078	16.336	190	28,061
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	12.5	14.525	479	70,579
UNITI GROUP INC	–	41.9	232	34,262
NEXPOINT RESIDENTIAL	3.326	3.872	117	17,345
EQUITY RESIDENTIAL	49.799	60.545	3,425	503,808
APPLE HOSPITALITY REIT INC	31.7	37.314	613	90,273
EPR PROPERTIES	11.184	13.165	584	86,004
CITY OFFICE REIT INC	6	6	28	4,253
GLOBAL NET LEASE INC	14.833	34.054	300	44,123
EQUINIX INC	13.398	16.346	13,212	1,943,182
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11.929	15.857	362	53,288
CHATHAM LODGING TRUST	6.665	8.284	81	12,012
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8.114	10.478	1,034	152,173
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18.5	22.07	282	41,481
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3.5	4.148	111	16,471
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7.8	7.8	16	2,489
HOST HOTELS & RESORTS INC	105.17	124.971	2,179	320,538
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	44.506	55.772	1,996	293,563
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	18.964	21.862	129	19,002
RLJ LODGING TRUST	23.943	26.986	286	42,188
FARMLAND PARTNERS INC	7.101	7.936	99	14,659
PHYSICIANS REALTY TRUST	33.5	41.824	485	71,413
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	9.961	11.52	124	18,297
KIMCO REALTY CORP	90.987	108.895	2,071	304,608
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9.06	10.445	104	15,315
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	56.003	66.873	1,011	148,803
WHITESTONE REIT	6.4	8.217	89	13,172
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	37.584	46.085	2,114	310,961
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17.7	20.966	130	19,240
PARK HOTELS & RESORTS INC	33.077	37.863	554	81,578
INVITATION HOMES INC	85.302	101.019	3,329	489,682
JBG SMITH PROPERTIES	14.641	16.44	228	33,607
ALEXANDER & BALDWIN INC	10.4	12.709	211	31,045
CLIPPER REALTY INC	1.89	1.89	9	1,425
GLADSTONE LAND CORP	4.68	5.632	81	12,018
AMERICOLD REALTY TRUST	39.627	44.665	1,258	185,111
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9	11.179	37	5,557
VICI PROPERTIES INC	141.684	178.028	5,273	775,527
BRT APARTMENTS CORP	1.6	2.049	37	5,448
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4.189	4.854	391	57,545
SAFEHOLD INC	2.562	–	–	–
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	19.143	–	–	–
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	20.776	27.338	642	94,524
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	5.372	6.34	136	20,121
STORE CAPITAL CORP	39.092	–	–	–
BROADSTONE NET LEASE INC	25.2	32.843	521	76,655
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	15.726	18.223	113	16,750
LIFE STORAGE INC	12.414	–	–	–
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7.574	8.854	175	25,782
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	32.919	39.336	532	78,330
PARAMOUNT GROUP INC	24.493	28.939	138	20,301
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	19.5	22.164	199	29,336
NETSTREIT CORP	7.406	11.72	179	26,440
APARTMENT INCOME REIT CO	22.683	26.199	808	118,867
CTO REALTY GROWTH INC	2.58	3.211	54	7,980
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	25.166	36.263	1,765	259,673
STAG INDUSTRIAL INC	26.365	31.516	1,129	166,074
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1.5	2.066	33	4,916
INDUS REALTY TRUST INC	0.861	–	–	–
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2.3	3.325	46	6,836
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	16.969	20.59	724	106,500
ORION OFFICE REIT INC	7.823	9.048	47	7,026
VENTAS INC	58.803	70.611	3,206	471,571
CARETRUST REIT INC	14.404	17.468	399	58,779
INVENTRUST PROPERTIES CORP	9.92	11.847	284	41,781
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	44.085	52.763	1,124	165,440
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7.128	7.759	43	6,447
SABRA HEALTH CARE REIT INC	34.343	40.603	583	85,869
UMH PROPERTIES INC	7.244	10.375	147	21,636
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3.6	4.316	100	14,796
BLUEROCK HOMES TRUST INC CLASS A	0.487	–	–	–
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	–	5.611	45	6,684
STAR HOLDINGS SHARES OF BENEFICIAL	–	2.122	26	3,835
PEAKSTONE REALTY TRUST CLASS E	–	6.3	103	15,204
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	–	2.504	41	6,168
IRON MOUNTAIN INC	42.755	51.223	3,241	476,711
TERRENO REALTY CORP	9.78	14.665	831	122,224
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	19.993	24.759	1,014	149,147
SUN COMMUNITIES INC	18.143	21.812	2,791	410,610
ACADIA REALTY TRUST	13.611	16.645	249	36,621
ALEXANDER'S INC	0.3	0.343	62	9,251
PROLOGIS INC	135.822	162.256	18,341	2,697,472
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21.844	27.345	2,980	438,397
BRANDYWINE REALTY TRUST	24.642	29.151	131	19,335
SAUL CENTERS INC	1.8	2.261	82	12,117
VERIS RESIDENTIAL INC	11.9	14.025	199	29,289
CAMDEN PROPERTY TRUST	15.672	18.704	1,678	246,884

銘柄	期首	当期末		
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
COUSINS PROPERTIES INC	22.155	26.622	544	80,067
SITE CENTERS CORP	27.078	31.57	410	60,312
EASTGROUP PROPERTIES INC	6.409	7.972	1,371	201,742
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9.581	11.243	2,386	350,924
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	19.429	23.224	1,073	157,866
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10.71	12.84	1,211	178,111
GETTY REALTY CORP	6.256	8.037	232	34,230
WELLTOWER INC	68.168	97.047	8,559	1,258,852
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	79.379	96.066	1,646	242,161
HIGHWOODS PROPERTIES INC	15.7	18.482	345	50,883
SERVICE PROPERTIES TRUST	24.6	29.054	206	30,423
EQUITY COMMONWEALTH	16.365	19.202	358	52,724
KILROY REALTY CORP	15.609	18.674	622	91,482
LTC PROPERTIES INC	5.959	7.219	234	34,430
LXP INDUSTRIAL TRUST	41.176	51.312	444	65,427
MID-AMERICA APARTMENT COMM	16.983	20.491	2,538	373,265
MACERICH CO/THE	31.979	37.773	429	63,107
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	25.715	32.645	2,288	336,509
NATL HEALTH INVESTORS INC	6.569	7.557	411	60,549
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	26.056	31.976	1,279	188,202
REALTY INCOME CORP	90.854	124.488	6,681	982,614
COPT DEFENSE PROPERTIES TRUST	16.71	19.679	478	70,386
PUBLIC STORAGE	23.242	27.779	7,164	1,053,639
REGENCY CENTERS CORP	22.656	28.843	1,772	260,752
RPT REALTY	12.53	14.099	161	23,742
SAFEHOLD INC	12.56	7.831	154	22,780
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15.016	18.435	457	67,292
SL GREEN REALTY CORP	9.538	11.216	416	61,296
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	32.9	37.967	85	12,507
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4.1	－	－	－
UDR INC	44.932	53.158	1,769	260,259
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.8	2.229	88	13,073
WP CAREY INC	30.533	37.57	2,336	343,625
ELME	12.6	15.375	202	29,802
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4.7	4.7	10	1,493
AGREE REALTY CORP	11.744	16.903	986	145,103
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	34.441	42.938	1,340	197,150
CUBESMART	33.02	39.409	1,562	229,864
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	31.234	36.317	354	52,076
DIGITAL REALTY TRUST INC	42.282	53.176	7,348	1,080,806
EXTRA SPACE STORAGE INC	19.7	37.112	4,807	706,982
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4.575	－	－	－
CENTERSPACE	2.261	2.537	135	19,961
KITE REALTY GROUP TRUST	32.569	38.49	798	117,403
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2.2	2.592	52	7,666
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5.521	6.928	88	12,990
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	31.03	36.773	304	44,779
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	88.121	105.051	514	75,704
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13.105	13.105	32	4,722
DOUGLAS EMMETT INC	26.186	28.794	354	52,087
アメリカ・ドル通貨計 口数、金額	3,839.687	4,607.537	169,900	24,987,262
銘柄数<比率>	145銘柄	142銘柄		<72.4%>

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
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2.3	－	－	－
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	5.1	5.1	14	1,567
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	6.2	－	－	－
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	4.3	5.6	41	4,496
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	7.841	8.541	112	12,227
PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4.4	4.4	20	2,194
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	2.758	2.758	39	4,252
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8.4	9.8	61	6,617
SLATE GROCERY REIT	4	4.7	49	5,324
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	9.1	10.4	177	19,244
SLATE OFFICE REIT	5.1	－	－	－
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2.8	3.4	49	5,404
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	18.7	21.5	96	10,469
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	15	－	－	－
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL ESTATE	6.1	1.06	7	770
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2.7	－	－	－
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5.1	5.6	386	41,788
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	19.9	22.8	284	30,815
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11	12.6	154	16,702
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	16.7	18.8	260	28,155
CHOICE PROPERTIES REIT	25.3	29	373	40,418
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2.7	3.3	43	4,745
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8.4	9.1	123	13,342
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11.3	12.8	291	31,538
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	13.5	14.8	678	73,381
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	20.866	23.566	209	22,695
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23.7	26.6	463	50,170
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3.3	3.3	29	3,199
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3.6	4.1	270	29,303
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8.2	8.9	112	12,182
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10.1	11.3	203	22,034
カナダ・ドル通貨計 口数、金額	288.465	283.825	4,556	493,043
銘柄数<比率>	31銘柄	26銘柄		< 1.4%>
(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	171.638	201.692	1,411	137,584
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	38.4	88.653	125	12,224
HMC CAPITAL LTD	31.078	45.031	217	21,151
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	53.9	－	－	－
ABACUS STORAGE KING STAPLED UNITS	－	97.773	104	10,194
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	46.82	62.229	163	15,948
CROMWELL PROPERTY GROUP	199.444	247.199	106	10,358
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	88	97.57	294	28,714
RURAL FUNDS GROUP	53.875	67.167	128	12,501
WAYPOINT REIT	113.781	124.327	292	28,471
CHARTER HALL LONG WALE REIT	99.512	124.724	416	40,595
CENTURIA OFFICE REIT	62.25	77.754	97	9,509
CENTURIA CAPITAL GROUP	105.967	145.14	210	20,508
HOMECO DAILY NEEDS REIT	234.898	334.531	376	36,675
REGION GROUP	178.136	215.443	443	43,249
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	41.377	50.422	116	11,399
NATIONAL STORAGE REIT	167.575	235.152	505	49,268
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	31.51	39.338	103	10,120

銘柄	期首	当期末		
	口数	口数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
GDI PROPERTY GROUP	71.46	87.347	49	4,851
SCENTRE GROUP	828.278	973.312	2,559	249,453
ARENA REIT	56.81	63.87	217	21,162
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	27.16	35.127	93	9,139
BWP TRUST	77.951	87.43	298	29,053
GPT GROUP	305.687	359.213	1,465	142,821
CHARTER HALL RETAIL REIT	83.41	93.874	300	29,273
MIRVAC GROUP	629.679	739.937	1,457	142,050
STOCKLAND	380.944	447.648	1,821	177,546
ABACUS GROUP UNIT	65.96	70.207	73	7,149
GOODMAN GROUP	271.299	321.465	7,496	730,540
VICINITY CENTRES	617.483	725.605	1,316	128,339
CHARTER HALL GROUP	73.759	87.533	906	88,371
INGENIA COMMUNITIES GROUP	59.59	69.393	285	27,793
オーストラリア・ドル 通貨計 口数、金額	5,267.631	6,416.106	23,458	2,286,024
銘柄数<比率>	31銘柄	31銘柄		<6.6%>
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	321	395	485	9,153
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	142	181	363	6,854
FORTUNE REIT	233	268	1,286	24,235
PROSPERITY REIT	174	205	280	5,291
LINK REIT	337	464.9	18,084	340,714
CHAMPION REIT	268	331	853	16,088
香港ドル 通貨計 口数、金額	1,475	1,844.9	21,355	402,337
銘柄数<比率>	6銘柄	6銘柄		<1.2%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	84.7	－	－	－
KEPPEL DC REIT	204.483	251.683	470	51,950
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	170.976	－	－	－
AIMS APAC REIT	81.1	124.8	159	17,632
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	460.09	545.39	599	66,220
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	73.8	87.9	61	6,743
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	291.14	327.84	195	21,531
EC WORLD REIT	36.5	36.5	10	1,128
CAPITALAND ASCENDAS REIT	536.277	666.877	1,893	209,052
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	803.522	948.322	1,754	193,650
SUNTEC REIT	357.6	417.7	480	53,021
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	501.8	622.7	1,008	111,348
KEPPEL REIT	317.6	358.6	308	34,040
CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU	312.656	426.356	394	43,531
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	894.402	1,124.102	337	37,223
CDL HOSPITALITY TRUSTS	127.7	122	124	13,735
FRASERS CENTREPOINT TRUST	166.176	201.776	443	48,998
STARHILL GLOBAL REIT	198.4	247.6	120	13,255
CAPITALAND CHINA TRUST	178.942	211.842	173	19,174
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	62.6	70	245	27,120
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	310.269	387.869	884	97,613
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	367.484	432.784	592	65,445
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	147.8	185.7	121	13,425
PARAGON REIT	163	226	189	20,954
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	337.763	－	－	－
シンガポール・ドル 通貨計 口数、金額	7,186.78	8,024.341	10,570	1,166,797
銘柄数<比率>	25銘柄	22銘柄		<3.4%>
(ニュージーランド)	千口	千口	千ニュージーランド・ドル	千円
STRIDE PROPERTY GROUP	82.638	－	－	－
ARGOSY PROPERTY LTD	119.25	144.609	160	14,558
KIWI PROPERTY GROUP LTD	261.44	275.684	228	20,753
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	71.483	－	－	－
GOODMAN PROPERTY TRUST	172.8	190.268	396	35,981
PRECINCT PROPERTIES GROUP	213.35	243.698	277	25,197
ニュージーランド・ドル 通貨計 口数、金額	920.961	854.259	1,063	96,491
銘柄数<比率>	6銘柄	4銘柄		<0.3%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
WAREHOUSE REIT PLC	63.302	70.605	60	11,252
EDISTON PROPERTY INVESTMENT COMPAN	31.488	－	－	－
HELICAL PLC	－	18.206	39	7,296
LIFE SCIENCE REIT PLC	－	61.021	39	7,410
ASSURA PLC	456.627	540.393	247	46,242
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	83.32	109.969	102	19,211
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITE	56.2	67.467	32	6,019
CLS HOLDINGS PLC	－	22.95	22	4,137
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	118.46	145.486	84	15,874
PICTON PROPERTY INCOME LTD	75.64	95.251	61	11,567
REGIONAL REIT LTD	59.84	71.837	22	4,127
NEWRIVER REIT PLC	42.86	51.721	43	8,214
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	132.59	355.942	426	79,672
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	85.98	－	－	－
CUSTODIAN REIT PLC	60.9	76.682	68	12,794
PRS REIT PLC/THE	75.872	95.537	76	14,226
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	53.28	69.968	59	11,177
LXI REIT PLC	255.448	312.442	298	55,691
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	51.24	62.933	40	7,525
TARGET HEALTHCARE REIT PLC	－	108.136	90	16,971
AEW UK REIT PLC	21.93	27.617	27	5,056
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	128.42	122.313	83	15,631
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	194.253	227.112	187	35,007
URBAN LOGISTICS REIT PLC	70.322	86.012	101	18,995
HOME REIT PLC	117.587	117.587	44	8,359
LAND SECURITIES GROUP PLC	115.934	136.918	860	160,806
SEGRO PLC	186.572	223.185	1,831	342,105
HAMMERSON PLC	545.564	701.936	190	35,541
UNITE GROUP PLC/THE	61.739	72.259	709	132,646
BRITISH LAND CO PLC	144.736	171.033	603	112,772
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	36.781	46.264	179	33,521
DERWENT LONDON PLC	17.327	20.463	438	81,895
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	205.675	243.56	243	45,506
WORKSPACE GROUP PLC	20.759	24	129	24,259
SAFESTORE HOLDINGS PLC	32.544	39.729	310	58,084
SHAFTESBURY PLC	41.75	－	－	－
BIG YELLOW GROUP PLC	26.76	31.906	350	65,574

銘柄		期首	当期末		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		149.787	179.134	333	62,253
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		78.138	93.799	42	7,947
TRITAX BIG BOX REIT PLC		280.618	346.934	534	99,889
イギリス・ポンド通貨計	口数、金額	4,180.243	5,248.307	9,019	1,685,268
	銘柄数<比率>	36銘柄	37銘柄		<4.9%>
(イスラエル)		千口	千口	千イスラエル・シュケル	千円
MENIVIM- THE NEW REIT LTD		105.526	125.212	205	8,216
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT		31.07	37.152	321	12,844
REIT 1 LTD		26.1	35.212	580	23,161
イスラエル・シュケル通貨計	口数、金額	162.696	197.576	1,107	44,222
	銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		<0.1%>
(韓国)		千口	千口	千韓国ウォン	千円
SK REITS LTD		11.423	22.834	91,564	10,447
D&D PLATFORM REIT LTD		8	8	24,760	2,825
SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD		3.93	–	–	–
NH ALL ONE REIT LTD		6.454	6.454	22,556	2,573
E KOCREF CR		3.584	–	–	–
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		8.26	12.235	79,527	9,074
LOTTE REIT CO LTD		17.135	20.132	62,509	7,132
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1		13.09	–	–	–
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD		5.6	–	–	–
JR REIT XXVII		22.64	29.728	124,411	14,195
KORAMCO ENERGY PLUS REIT		5.99	9.157	48,074	5,485
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L		24.442	27.294	95,256	10,868
韓国ウォン通貨計	口数、金額	130.548	135.834	548,660	62,602
	銘柄数<比率>	12銘柄	8銘柄		<0.2%>
ユーロ（アイルランド）		千口	千口	千ユーロ	千円
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		54.94	64.959	63	10,176
国小計	口数、金額	54.94	64.959	63	10,176
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		<0.0%>
ユーロ（オランダ）		千口	千口	千ユーロ	千円
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		5.854	6.463	138	22,296
WERELDHAVE NV		5.16	6.098	93	15,167
NSI NV		2.271	2.733	47	7,636
VASTNED RETAIL NV		2.32	2.739	53	8,617
国小計	口数、金額	15.605	18.033	332	53,717
	銘柄数<比率>	4銘柄	4銘柄		<0.2%>
ユーロ（ベルギー）		千口	千口	千ユーロ	千円
AEDIFICA		5.376	7.209	421	67,996
COFINIMMO		4.064	5.208	339	54,884
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS		3.03	3.984	81	13,223
RETAIL ESTATES		1.457	1.873	119	19,269
WAREHOUSES DE PAUW SCA		19.268	24.764	631	102,070
CARE PROPERTY INVEST		3.45	5.601	71	11,597
XIOR STUDENT HOUSING NV		2.67	4.313	134	21,803
MONTEA NV		1.669	2.33	180	29,164
国小計	口数、金額	40.984	55.282	1,981	320,009
	銘柄数<比率>	8銘柄	8銘柄		<0.9%>
ユーロ（フランス）		千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		14.478	15.56	890	143,899
ICADE		4.098	4.849	163	26,439
CARMILA		7.789	8.705	125	20,329
ALTAREA		0.55	0.71	49	8,038
GECINA SA		7.453	7.87	796	128,633
KLEPIERRE		26.957	29.854	689	111,381
COVIVIO		6.222	7.432	329	53,247
MERCIALYS		10.432	14.392	124	20,164
国小計	口数、金額	77.979	89.372	3,170	512,135
	銘柄数<比率>	8銘柄	8銘柄		<1.5%>
ユーロ（ドイツ）		千口	千口	千ユーロ	千円
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		1.82	–	–	–
HAMBORNER REIT AG		9.07	10.717	70	11,372
国小計	口数、金額	10.89	10.717	70	11,372
	銘柄数<比率>	2銘柄	1銘柄		<0.0%>
ユーロ（スペイン）		千口	千口	千ユーロ	千円
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		7.5	7.57	46	7,555
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		40.217	44.944	271	43,880
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		45.751	50.509	467	75,540
国小計	口数、金額	93.468	103.023	786	126,976
	銘柄数<比率>	3銘柄	3銘柄		<0.4%>
ユーロ（イタリア）		千口	千口	千ユーロ	千円
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		6.93	6.93	15	2,445
国小計	口数、金額	6.93	6.93	15	2,445
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		<0.0%>
ユーロ（その他）		千口	千口	千ユーロ	千円
CROMWELL REIT EUR		43.52	48.32	63	10,301
国小計	口数、金額	43.52	48.32	63	10,301
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄		<0.0%>
ユーロ通貨計	口数、金額	344.316	396.636	6,483	1,047,134
	銘柄数<比率>	28銘柄	27銘柄		<3.0%>
合計	口数、金額	23,796.327	28,009.321	–	32,271,184
	銘柄数<比率>	323銘柄	306銘柄		<93.5%>

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

(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
外国	DJ US REAL ESTATE（アメリカ）	762	–
	STOXX 600　REAL（ドイツ）	264	–

（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

2023年11月30日現在

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
投資信託受益証券	1,224,352	3.5
投資証券	32,271,184	93.2
コール・ローン等、その他	1,111,640	3.3
投資信託財産総額	34,607,177	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＝147.07円、１カナダ・ドル＝108.21円、１オーストラリア・ドル＝97.45円、１香港ドル＝18.84円、１シンガポール・ドル＝110.38円、１ニュージーランド・ドル＝90.70円、１イギリス・ポンド＝186.84円、１イスラエル・シュケル＝39.913円、100韓国ウォン＝11.41円、１ユーロ＝161.51円です。
（注３）当期末における外貨建純資産（34,273,357千円）の投資信託財産総額（34,607,177千円）に対する比率は、99.0％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年11月30日現在

項目	当期末
(A) 資産	**34,848,120,283円**
コール・ローン等	785,996,775
投資信託受益証券(評価額)	1,224,352,455
投資証券(評価額)	32,271,184,951
未収入金	259,951,217
未収配当金	54,636,716
差入委託証拠金	251,998,169
(B) 負債	**331,976,118**
未払金	314,889,118
未払解約金	17,087,000
(C) 純資産総額(A－B)	**34,516,144,165**
元本	10,495,625,942
次期繰越損益金	24,020,518,223
(D) 受益権総口数	**10,495,625,942口**
１万口当り基準価額(C／D)	**32,886円**

＊期首における元本額は9,066,118,780円、当作成期間中における追加設定元本額は2,238,016,506円、同解約元本額は808,509,344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：

ダイワバランスファンド2023－01（適格機関投資家専用）	93,059,749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）	1,708,228,155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）	275,301,269円
Ｄ－Ｉ’ｓ グローバルＲＥＩＴインデックス	1,638,253円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2050	17,641,872円
ｉＦｒｅｅ 外国ＲＥＩＴインデックス	718,741,519円
ｉＦｒｅｅ ８資産バランス	2,427,391,242円
グローバル・リート・インデックスファンド（資産形成型）	376,775,346円
グローバル・リート・インデックスファンド（毎月決算型）	249,457,006円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2060	607,839円
ＤＣダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックスファンド	4,041,015,425円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2030	8,380,081円
ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2040	8,649,739円
ダイワ海外ＲＥＩＴインデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	3,207,527円
ダイワバランスファンド2021－02（適格機関投資家専用）	144,489,423円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルＲＥＩＴ	248,223,853円
ダイワ・ノーロード グローバルＲＥＩＴファンド	67,053,492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）	13,068,046円
ダイワバランスファンド2023－08（適格機関投資家専用）	92,696,106円

＊当期末の計算口数当りの純資産額は32,886円です。

■損益の状況

当期　自2022年12月１日　至2023年11月30日

項目	当期
(A) 配当等収益	**1,245,549,394円**
受取配当金	1,234,124,290
受取利息	4,885,061
その他収益金	6,701,639
支払利息	△ 161,596
(B) 有価証券売買損益	**570,228,589**
売買益	3,640,343,386
売買損	△ 3,070,114,797
(C) 先物取引等損益	**△ 63,855,853**
取引益	38,043,157
取引損	△ 101,899,010
(D) その他費用	**△ 14,912,798**
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	**1,737,009,332**
(F) 前期繰越損益金	**19,282,232,779**
(G) 解約差損益金	**△ 1,736,032,182**
(H) 追加信託差損益金	**4,737,308,294**
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	**24,020,518,223**
次期繰越損益金(I)	**24,020,518,223**

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

Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）はS&P Dow Jones Indices LLCまたはその関連会社（「ＳＰＤＪＩ」）の商品であり、これの使用ライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Ｓ＆Ｐ®、S&P 500®、US 500、The 500、iBoxx®、iTraxx®およびＣＤＸ®は、S&P Global, Inc.またはその関連会社（「Ｓ＆Ｐ」）の商標です。Dow Jones®は、Dow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標です。これらの商標の使用ライセンスはＳＰＤＪＩに付与されており、大和アセットマネジメント株式会社により一定の目的でサブライセンスされています。ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンドは、ＳＰＤＪＩ、Dow Jones、Ｓ＆Ｐ、またはそれらの各関連会社によって後援、推奨、販売、または販売促進されているものではなく、これらのいずれの関係者も、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本）のいかなる過誤、遺漏、または中断に対しても一切責任を負いません。

先進国ＲＥＩＴマザーファンド

運用報告書　第11期　（決算日　2024年５月８日）

（作成対象期間　2023年５月９日～2024年５月８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。

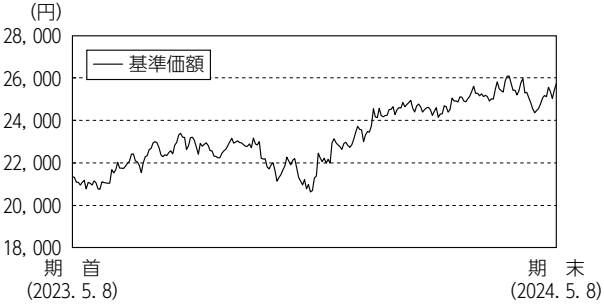
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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,税引後配当込み,円ベース)		投資信託受益証券組入比率	投資証券組入比率	不動産投信指数先物比率
		騰落率	(参考指数)	騰落率			
	円	%		%	%	%	%
(期首) 2023年5月8日	21,350	—	21,634	—	1.8	94.1	2.7
5月末	21,052	△ 1.4	21,416	△ 1.0	2.4	94.9	2.7
6月末	22,621	6.0	22,896	5.8	2.0	95.4	2.5
7月末	22,807	6.8	22,964	6.2	0.5	97.1	2.3
8月末	23,159	8.5	23,361	8.0	0.1	97.6	2.3
9月末	21,899	2.6	22,035	1.9	2.2	95.3	2.4
10月末	20,695	△ 3.1	20,714	△ 4.3	2.7	94.5	2.8
11月末	22,844	7.0	22,988	6.3	2.8	94.4	2.8
12月末	24,655	15.5	24,626	13.8	2.6	94.5	2.8
2024年1月末	24,506	14.8	24,600	13.7	0.6	96.6	2.8
2月末	25,033	17.3	25,007	15.6	0.8	95.8	3.5
3月末	26,089	22.2	25,922	19.8	6.5	90.4	3.1
4月末	25,572	19.8	25,425	17.5	5.6	90.8	3.5
(期末) 2024年5月8日	25,742	20.6	25,572	18.2	5.7	90.8	3.5

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、税引後配当込み、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。Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、税引後配当込み、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) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。
※参考指数を「Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円ベース）」から「Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、税引後配当込み、円ベース）」に変更しました。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について
【基準価額・騰落率】
期首：21,350円　期末：25,742円　騰落率：20.6%

【基準価額の主な変動要因】
日本を除く先進国ＲＥＩＴにほぼ100%投資した結果、海外リート市況の上昇および為替相場が円安に動いたことから、参考指数（Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、税引後配当込み、円ベース））の上昇と同様に、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」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、当作成期を通じて見ると上昇しました。
海外リート市況は、当作成期首より、米国の地方銀行の経営不安や債務上限問題への懸念から下落して始まりました。2023年7月に入ると、米国におけるインフレ指標の鈍化や長期金利の低下が好感され上昇に転じました。8月以降は、米国国債の増発やＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）の政策金利見通しの引き上げなどによる長期金利の大幅な上昇、パレスチナ情勢の悪化などが嫌気され、10月末にかけて下落しました。11月以降は、欧米のインフレ率が予想以上に鈍化し金利が低下したことや、ＦＲＢ議長が将来の利下げについての議論を始めたと述べたことを受けて利下げ観測が高まったことなどが好感され、上昇しました。2024年に入ると、米国を中心とした金利上昇から再度下落に転じ、当作成期末を迎えました。

○為替相場
為替相場は対円で上昇（円安）しました。
米ドル対円為替相場は、当作成期首より、経済指標の上振れなどを背景に米国金利が上昇する中、上昇して始まりました。2023年6月に入ると、ＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）が政策金利見通しを引き上げた一方で、日銀は現状の金融緩和政策の維持を決定したことなどから、米ドルは対円での上昇幅を拡大しました。7月に入ると、日本の政府要人等による円安けん制発言や日銀の政策運営の柔軟化決定を受け、下落（円高）しましたが、同月半ば以降は、米国金利の上昇による日米金利差の拡大が意識され、11月上旬にかけて上昇しました。11月半ばに入ると、日銀による政策修正や米国金利の大幅な低下を受けて下落に転じましたが、2024年に入ってからは、米国金利の上昇や日銀による金融政策の維持などを背景に円安米ドル高に転じました。3月には、日銀がマイナス金利の解除など大規模な金融緩和の終了を発表したものの、他国・地域に比べて緩和的な環境が続く見通しなどから、当作成期末にかけて円安基調が継続しました。
その他の通貨も米ドル円に連れる展開となり、対円で堅調な推移となりました。

◆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
海外リートの組入比率（ＥＴＦ（上場投資信託証券）および不動産投信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。また、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。

◆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ＲＥＩＴ指数（除く日本、税引後配当込み、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。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	8円
（先物・オプション）	(1)
（投資信託受益証券）	(1)
（投資証券）	(5)
有価証券取引税	3
（投資信託受益証券）	(0)
（投資証券）	(3)
その他費用	27
（保管費用）	(23)
（その他）	(4)
合　　計	37

（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

（2023年５月９日から2024年５月８日まで）

銘　　柄		買　付		売　付	
		口　数	金　額	口　数	金　額
		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
外国	**アメリカ**				
	VANGUARD REAL ESTATE ETF	32.49	2,638	29.149	2,381

（注１）金額は受渡し代金。
（注２）金額の単位未満は切捨て。

（2）投資証券

（2023年５月９日から2024年５月８日まで）

銘　　柄		買　付		売　付	
		口　数	金　額	口　数	金　額
		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
外国	**アメリカ**				
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.464	82	0.921	160
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1.142	137	2.264	290
	BOSTON PROPERTIES INC	0.852	48	1.688	102
	VORNADO REALTY TRUST	1.367	28	2.71	65
	EQUITY RESIDENTIAL	1.148	69	2.278	136
	EQUINIX INC	0.268	211	0.531	419
	HOST HOTELS & RESORTS INC	3.594	61	7.126	129

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
	KIMCO REALTY CORP	2.919	56	5.788	109
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	1.288	59	2.554	115
	PARK HOTELS & RESORTS INC	2.349	32	4.657	66
	INVITATION HOMES INC	2.217	75	4.396	143
	VICI PROPERTIES INC	2.963	88	5.875	172
	VENTAS INC	1.551	71	3.075	136
	NET LEASE OFFICE PROPERTIES	—	—	0.166	4
		(0.166)	(0)		
	IRON MOUNTAIN INC	1.204	73	2.388	159
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	1.306	53	0.824	28
		(△4.668)			
	SUN COMMUNITIES INC	0.434	55	0.861	103
	PROLOGIS INC	2.743	319	5.438	645
外国	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.405	45	0.802	91
	CAMDEN PROPERTY TRUST	0.434	42	0.861	82
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.243	53	0.481	110
	WELLTOWER INC	1.451	124	2.876	248
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2.296	42	4.552	81
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.455	61	0.902	116
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.76	52	1.507	100
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1.242	50	2.463	96
	REALTY INCOME CORP	2.452	139	8.417	450
		(3.557)			
	PUBLIC STORAGE	0.429	116	0.851	229
	UDR INC	1.333	48	2.644	95
	WP CAREY INC	0.831	52	1.648	97

銘柄		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
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	1.629	51	3.23	96
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.826	104	1.637	221
	EXTRA SPACE STORAGE INC	0.477	64	0.946	125
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2.3	28	4.562	57
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	3.193	21	6.33	25
	DOUGLAS EMMETT INC	1.971	24	3.907	49
	カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
	CHOICE PROPERTIES REIT	10.6	142	21.669	291
	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
	DEXUS/AU	9.3	67	18.997	142
	SCENTRE GROUP	25.12	65	51.33	150
	MIRVAC GROUP	21.47	44	43.876	93
	GOODMAN GROUP	6.12	134	12.509	318
	香港	千口	千香港・ドル	千口	千香港・ドル
	LINK REIT	2.3	98	6.3	248
	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
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	24.6	69 (△ 2)	50	137
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	42.2	80 (△ 0)	85.9	164
	イギリス	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
	LAND SECURITIES GROUP PLC	5.88	37	12.108	75
	SEGRO PLC	6	47	12.351	99
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	22.25	32	45.837	69

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	**ユーロ(ベルギー)**	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	COFINIMMO	0.31	20	0.692	43
	ユーロ(フランス)	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	GECINA SA	0.87	85	1.942	186

（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）金額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の種類別取引状況

(2023年５月９日から2024年５月８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 267	百万円 270	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。

■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		
		口数	口数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)					
VANGUARD REAL ESTATE ETF		2.679	6.02	494	76,620
合計	口数、金額	2.679	6.02	494	76,620
	銘柄数＜比率＞	1銘柄	1銘柄		<5.7%>

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

(2)外国投資証券

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)					
AVALONBAY COMMUNITIES INC		1.49	1.033	202	31,354
SIMON PROPERTY GROUP INC		3.659	2.537	375	58,160
BOSTON PROPERTIES INC		2.728	1.892	115	17,842
VORNADO REALTY TRUST		4.38	3.037	73	11,392
EQUITY RESIDENTIAL		3.684	2.554	170	26,396
EQUINIX INC		0.858	0.595	423	65,631
HOST HOTELS & RESORTS INC		11.521	7.989	149	23,173
KIMCO REALTY CORP		9.359	6.49	123	19,096
GAMING AND LEISURE PROPERTIE		4.129	2.863	126	19,608
PARK HOTELS & RESORTS INC		7.529	5.221	84	13,049
INVITATION HOMES INC		7.108	4.929	172	26,715
VICI PROPERTIES INC		9.497	6.585	194	30,151
ORION OFFICE REIT INC		0.419	0.419	1	219
VENTAS INC		4.971	3.447	162	25,172
IRON MOUNTAIN INC		3.862	2.678	207	32,200
SPIRIT REALTY CAPITAL INC		4.186	—	—	—
SUN COMMUNITIES INC		1.393	0.966	112	17,437
PROLOGIS INC		8.792	6.097	657	101,804
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		1.295	0.898	107	16,657
CAMDEN PROPERTY TRUST		1.393	0.966	102	15,864
ESSEX PROPERTY TRUST INC		0.777	0.539	138	21,520
WELLTOWER INC		4.647	3.222	314	48,656
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		7.359	5.103	97	15,181
MID-AMERICA APARTMENT COMM		1.457	1.01	137	21,313
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		2.437	1.69	106	16,497
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		3.983	2.762	117	18,171
REALTY INCOME CORP		7.855	5.447	299	46,437
PUBLIC STORAGE		1.376	0.954	260	40,385
UDR INC		4.275	2.964	115	17,897
WP CAREY INC		2.664	1.847	106	16,533
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		5.222	3.621	111	17,354
DIGITAL REALTY TRUST INC		2.647	1.836	265	41,145
EXTRA SPACE STORAGE INC		1.53	1.061	152	23,558
GLADSTONE COMMERCIAL CORP		7.376	5.114	73	11,410
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		10.233	7.096	30	4,705
DOUGLAS EMMETT INC		6.315	4.379	60	9,322
アメリカ・ドル通貨計	□数、金額	162.406	109.841	5,950	922,021
	銘柄数＜比率＞	36銘柄	35銘柄		＜68.8%＞
		千口	千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)					
CHOICE PROPERTIES REIT		39.6	28.531	371	41,938
カナダ・ドル通貨計	□数、金額	39.6	28.531	371	41,938
	銘柄数＜比率＞	1銘柄	1銘柄		＜3.1%＞

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	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)					
DEXUS/AU		34.76	25.063	176	18,053
SCENTRE GROUP		93.92	67.71	218	22,245
MIRVAC GROUP		80.27	57.864	120	12,280
GOODMAN GROUP		22.9	16.511	567	57,917
オーストラリア・ドル通貨計	□数、金額	231.85	167.148	1,082	110,496
	銘柄数＜比率＞	4銘柄	4銘柄		＜8.2%＞
		千口	千口	千香港・ドル	千円
(香港)					
LINK REIT		16.8	12.8	446	8,836
香港・ドル通貨計	□数、金額	16.8	12.8	446	8,836
	銘柄数＜比率＞	1銘柄	1銘柄		＜0.7%＞
		千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)					
CAPITALAND ASCENDAS REIT		91.329	65.929	170	19,450
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		156.988	113.288	217	24,872
シンガポール・ドル通貨計	□数、金額	248.317	179.217	387	44,323
	銘柄数＜比率＞	2銘柄	2銘柄		＜3.3%＞
		千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
(イギリス)					
LAND SECURITIES GROUP PLC		20.4	14.172	97	18,841
SEGRO PLC		20.82	14.469	128	24,815
TRITAX BIG BOX REIT PLC		77.23	53.643	86	16,798
イギリス・ポンド通貨計	□数、金額	118.45	82.284	312	60,454
	銘柄数＜比率＞	3銘柄	3銘柄		＜4.5%＞
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ（ベルギー）					
COFINIMMO		0.88	0.498	32	5,462
国小計	□数、金額	0.88	0.498	32	5,462
	銘柄数＜比率＞	1銘柄	1銘柄		＜0.4%＞
		千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ（フランス）					
GECINA SA		2.5	1.428	142	23,784
国小計	□数、金額	2.5	1.428	142	23,784
	銘柄数＜比率＞	1銘柄	1銘柄		＜1.8%＞
ユーロ通貨計	□数、金額	3.38	1.926	175	29,246
	銘柄数＜比率＞	2銘柄	2銘柄		＜2.2%＞
合計	□数、金額	820.803	581.747	—	1,217,317
	銘柄数＜比率＞	49銘柄	48銘柄		＜90.8%＞

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

(3)先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当期末	
		買建額	売建額
		百万円	百万円
外国	DJ US REAL ESTATE（アメリカ）	30	—
	STOXX 600 REAL（ドイツ）	16	—

（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

2024年５月８日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	76,620	5.7
投資証券	1,217,317	90.6
コール・ローン等、その他	49,495	3.7
投資信託財産総額	1,343,433	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８日における邦貨換算レートは、１アメリカ・ドル＝154.95円、１カナダ・ドル＝112.81円、１オーストラリア・ドル＝102.03円、１香港・ドル＝19.81円、１シンガポール・ドル＝114.35円、１イギリス・ポンド＝193.66円、１ユーロ＝166.56円です。
（注３）当期末における外貨建純資産（1,329,413千円）の投資信託財産総額（1,343,433千円）に対する比率は、99.0％です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年５月８日現在

項目	当期末
(A)資産	**1,355,055,779円**
コール・ローン等	27,256,974
投資信託受益証券（評価額）	76,620,110
投資証券（評価額）	1,217,317,140
未収入金	12,579,500
未収配当金	1,117,541
差入委託証拠金	20,164,514
(B)負債	**14,425,537**
未払金	13,971,537
未払解約金	454,000
(C)純資産総額（A－B）	**1,340,630,242**
元本	520,790,664
次期繰越損益金	819,839,578
(D)受益権総口数	**520,790,664口**
１万口当り基準価額（C／D）	**25,742円**

＊期首における元本額は762,945,559円、当作成期間中における追加設定元本額は405,005,353円、同解約元本額は647,160,248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）	262,008,144円
先進国ＲＥＩＴファンド（適格機関投資家専用）	130,031,865円
海外リート資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用）	9,489,837円
ターゲット・リターン（コスト控除後３％）資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用）	28,665円
ターゲット・リターン（コスト控除後５％）資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用）	77,007円
りそな ダイナミック・アロケーション・ファンド	7,647,871円
堅実バランスファンド －ハジメの一歩－	1,314,130円
ＤＣダイナミック・アロケーション・ファンド	36,580,893円
ダイワ外国３資産アロケーション・ファンド（部分為替ヘッジあり）	73,612,252円

＊当期末の計算口数当りの純資産額は25,742円です。

■損益の状況

当期　自2023年５月９日　至2024年５月８日

項目		当期
(A)配当等収益		**71,881,763円**
受取配当金		70,622,151
受取利息		565,450
その他収益金		700,526
支払利息	△	6,364
(B)有価証券売買損益		**225,960,930**
売買益		363,999,057
売買損	△	138,038,127
(C)先物取引等損益		**651,401**
取引益		5,816,813
取引損	△	5,165,412
(D)その他費用	△	**1,965,161**
(E)当期損益金（A＋B＋C＋D）		**296,528,933**
(F)前期繰越損益金		**865,941,150**
(G)解約差損益金	△	**865,353,252**
(H)追加信託差損益金		**522,722,747**
(I)合計（E＋F＋G＋H）		**819,839,578**
次期繰越損益金（I）		**819,839,578**

（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。