

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

運用報告書 (全体版)

第4期

(決算日 2020年6月15日)

(作成対象期間 2019年6月18日～2020年6月15日)

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

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

ダイワTOPIXインデックス (ダイワSMA専用)

運用報告書(全体版)

第4期

(決算日 2020年6月15日)

(作成対象期間 2019年6月18日～2020年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/株式/インデックス型		
信託期間	無期限		
運用方針	投資成果を東証株価指数(TOPIX)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	東京証券取引所第一部上場株式(上場予定を含みます。)	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、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。		

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			TOPIX		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額
	(分配落) 円	税込み 分配金 円	期中 騰落率 %	(ベンチマーク) 円	期中 騰落率 %			
1 期末 (2017年 6 月15日)	10,274	30	3.0	1,588.09	2.2	99.1	1.2	4
2 期末 (2018年 6 月15日)	11,678	110	14.7	1,789.04	12.7	99.7	1.2	99
3 期末 (2019年 6 月17日)	10,218	30	△ 12.2	1,539.74	△ 13.9	98.8	1.5	1,892
4 期末 (2020年 6 月15日)	10,189	200	1.7	1,530.78	△ 0.6	100.2	1.7	5,083

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

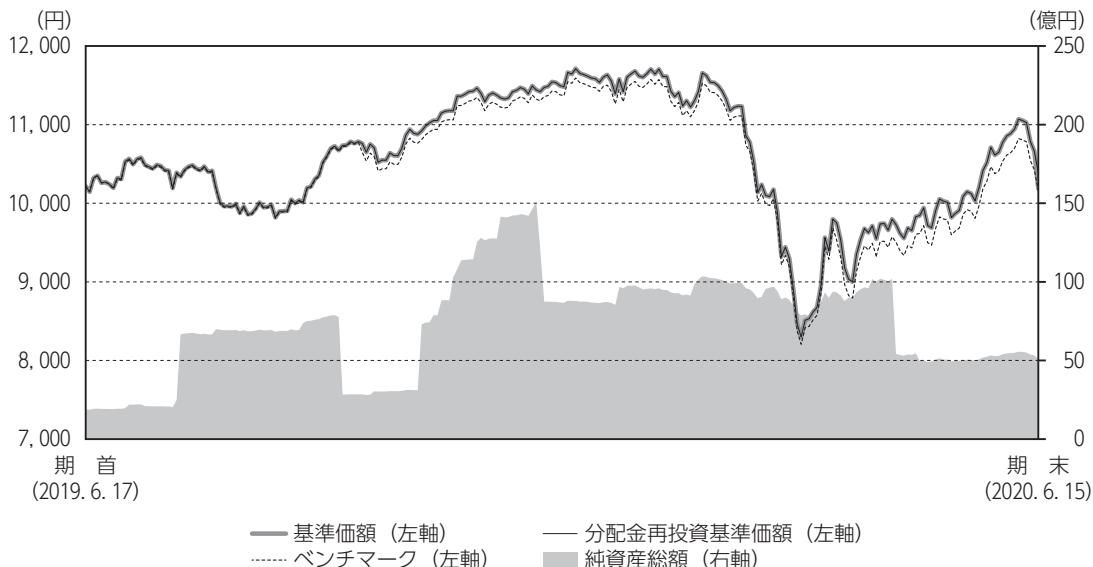
(注 3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注 4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

* ベンチマークはTOP I Xです。

■ 基準価額・騰落率

期首：10,218円

期末：10,189円（分配金200円）

騰落率：1.7%（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。

ダイワTOP I Xインデックス (ダイワSMA専用)

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組入比率	株 式 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2019年 6月17日	円	%		%	%	%
	10,218	—	1,539.74	—	98.8	1.5
6月末	10,308	0.9	1,551.14	0.7	99.3	0.9
7月末	10,399	1.8	1,565.14	1.6	99.0	0.9
8月末	10,046	△ 1.7	1,511.86	△ 1.8	99.0	1.0
9月末	10,649	4.2	1,587.80	3.1	98.5	1.6
10月末	11,178	9.4	1,667.01	8.3	98.9	2.0
11月末	11,393	11.5	1,699.36	10.4	98.3	1.9
12月末	11,554	13.1	1,721.36	11.8	98.5	1.5
2020年 1月末	11,304	10.6	1,684.44	9.4	97.8	2.2
2月末	10,139	△ 0.8	1,510.87	△ 1.9	97.1	3.0
3月末	9,532	△ 6.7	1,403.04	△ 8.9	97.6	2.3
4月末	9,941	△ 2.7	1,464.03	△ 4.9	98.0	1.8
5月末	10,614	3.9	1,563.67	1.6	97.7	2.2
(期末)2020年 6月15日	10,389	1.7	1,530.78	△ 0.6	100.2	1.7

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注2) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

投資環境について

(2019. 6. 18 ~ 2020. 6. 15)

国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、米国がメキシコに対する追加関税を棚上げしたことや米国の利下げ期待、2019年6月末に開催された米中首脳会談で一定の関係改善が見られたことなどが支えとなり、底堅く推移しました。8月には、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され株価は下落したものの、9月以降は、米国が連続利下げを実施したことで過度な景気後退懸念が和らいだことや、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、株価は上昇しました。しかし2020年1月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染拡大が懸念され株価が下落したのに続き、2月後半以降は中国以外における感染拡大が懸念され、3月に入ると米国において感染者の増加が目立ち始めたほか、国内においても感染者の急激な増加が懸念される状況となり、株価は2月後半から3月中旬にかけて大幅に下落しました。3月下旬以降は、主要国の中央銀行による金融緩和策や米国による大型の経済対策に加え、欧米における新型コロナウイルスの新規感染者数がピークアウトしてきたことで経済活動の再開期待が高まったこと、5月下旬に国内の緊急事態宣言が全面解除されたことが好感され、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

「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（TOPIX）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

(2019. 6. 18 ~ 2020. 6. 15)

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

株式を中心に、一部TOP I X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の手法）を用いて構築しています。

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

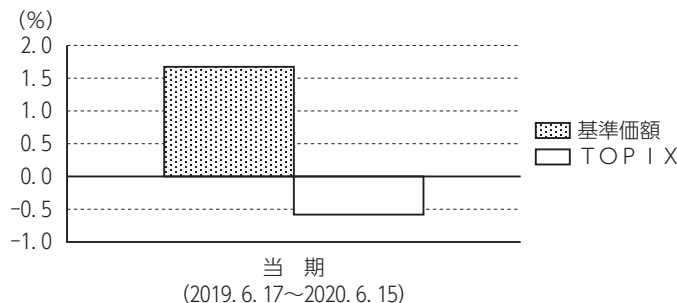
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマーク（TOP I X）の騰落率は $\Delta 0.6\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は 1.7% となりました。

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

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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	
	2019年6月18日 ～2020年6月15日	
当期分配金(税込み)	(円)	200
対基準価額比率	(%)	1.93
当期の収益	(円)	200
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	386

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

収益分配金の計算過程(1万口当り)

項 目	当 期	
(a) 経費控除後の配当等収益	✓	203.92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		382.63
(d) 分配準備積立金		0.14
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)		586.70
(f) 分配金		200.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)		386.70

- (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 (2019. 6. 18~2020. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	36円	0.337%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10,573円です。
(投 信 会 社)	(22)	(0.207)	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)	(0.109)	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	0.002	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.006	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(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	36	0.345	

(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。

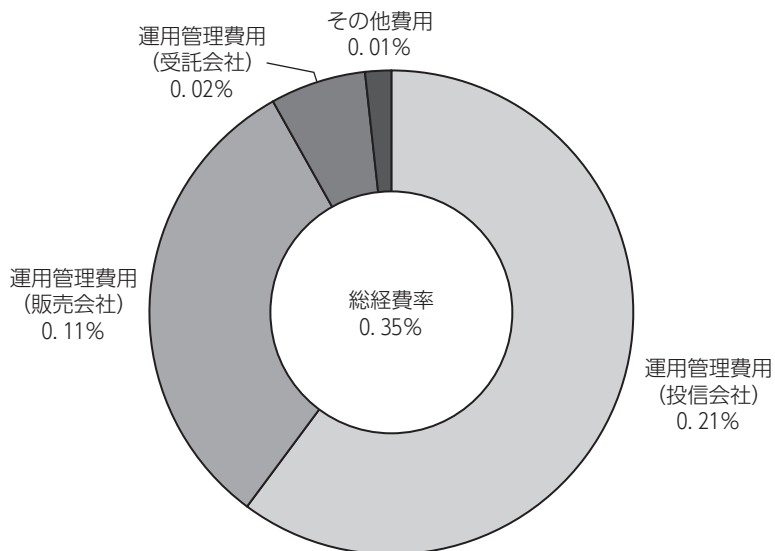
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	20,970,691	21,843,520	17,755,469	18,268,960

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

項 目	当 期	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	50,660,868千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	144,397,254千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.35	

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況 B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況 D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	28,467	0	0.0	22,193	1,845	8.3
株式先物取引	35,092	7,673	21.9	34,355	8,220	23.9
コール・ローン	4,604,562	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合4.9%

※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

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

種 類	当 期		
	トピックス・インデックス・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	50	34	244

(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

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

種 類	当 期	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	
	買 付 額	
	百万円	
株式	9	

(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

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	138千円
うち利害関係人への支払額 (B)	38千円
(B) / (A)	27.5%

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

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

■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	1,918,006	5,133,228	5,183,020

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	5,183,020	99.7
コール・ローン等、その他	14,030	0.3
投資信託財産総額	5,197,051	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	5,197,051,128円
コール・ローン等	13,890,167
トピックス・インデックス・マザーファンド (評価額)	5,183,020,961
未収入金	140,000
(B) 負債	113,544,179
未払収益分配金	99,784,527
未払信託報酬	13,541,303
その他未払費用	218,349
(C) 純資産総額 (A - B)	5,083,506,949
元本	4,989,226,381
次期繰越損益金	94,280,568
(D) 受益権総口数	4,989,226,381口
1万口当り基準価額 (C/D)	10,189円

* 期首における元本額は1,852,409,502円、当作成期間中における追加設定元本額は20,581,650,630円、同解約元本額は17,444,833,751円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,189円です。

■損益の状況

当期 自 2019年6月18日 至 2020年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,529円
受取利息	1,380
支払利息	△ 2,909
(B) 有価証券売買損益	△ 127,750,510
売買益	929,538,340
売買損	△ 1,057,288,850
(C) 信託報酬等	△ 25,141,582
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 152,893,621
(E) 前期繰越損益金	△ 7,141,538
(F) 追加信託差損益金	354,100,254
(配当等相当額)	(190,904,707)
(売買損益相当額)	(163,195,547)
(G) 合計 (D + E + F)	194,065,095
(H) 収益分配金	△ 99,784,527
次期繰越損益金 (G + H)	94,280,568
追加信託差損益金	354,100,254
(配当等相当額)	(190,904,707)
(売買損益相当額)	(163,195,547)
分配準備積立金	2,031,455
繰越損益金	△ 261,851,141

(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	101,743,256円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	190,904,707
(d) 分配準備積立金	72,726
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	292,720,689
(f) 分配金	99,784,527
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	192,936,162
(h) 受益権総口数	4,989,226,381口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	200円

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

《お知らせ》

■商号変更について

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

トピックス・インデックス・マザーファンド

<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（2019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（2020年6月15日）現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■トピックス・インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄 株 式

（2019年6月18日から2020年6月15日まで）

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	141.5	999,409	7,062	トヨタ自動車	89.9455	658,201	7,317
ソニー	77.9	484,677	6,221	ソニー	75.9	510,881	6,730
N T T ドコモ	152.8	443,991	2,905	キーエンス	8.2	407,897	49,743
三菱UFJフィナンシャルG	839.5	428,116	509	ソフトバンクグループ	83.4	402,571	4,827
ソフトバンクグループ	97.9	424,380	4,334	KDDI	128.5	382,956	2,980
日本電信電話	104	402,351	3,868	武田薬品	87.7	347,482	3,962
任天堂	10.1	391,208	38,733	日本電信電話	75.1	308,829	4,112
武田薬品	101.3	375,848	3,710	三菱UFJフィナンシャルG	555.9	290,651	522
キーエンス	7.7	369,345	47,966	本田技研	95.4	276,012	2,893
日立	79	305,563	3,867	ソフトバンク	163.3	243,136	1,488

（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、2020年6月15日現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンド（141,769,254千円）の内容です。

(1) 国内株式

銘 柄	2020年6月15日現在		銘 柄	2020年6月15日現在		銘 柄	2020年6月15日現在		銘 柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			ショーポンドHD	14	67,410	ヤマウラ	4	3,180	ナカノフード建設	5.4	2,030
極洋	3.3	8,764	ミライト・ホールディングス	26.7	39,462	大成建設	68.5	259,615	興村組	11.1	26,529
日本水産	90.2	42,664	タマホーム	5	5,955	大林組	203.6	202,785	東鉄工業	8.8	23,733
マルハニチロ	13.1	27,889	サンヨーホームズ	1.2	752	清水建設	206.1	174,154	イチケン	1.4	2,053
カネコ種苗	2.7	3,877	日本アクア	3.8	2,105	飛鳥建設	5.9	6,153	富士ピー・エス	3	1,689
サカタのタネ	10.6	36,199	ファーストコーポレーション	3	1,593	長谷工コーポレーション	79.2	102,484	浅沼組	2.4	9,996
ホクト	6.7	13,286	ベステラ	1.6	1,540	松井建設	8.2	5,297	戸田建設	83.9	56,045
ホクリヨウ	1.6	992	スペースバリューHD	11.1	3,885	銭高組	0.9	3,474	熊谷組	9.4	23,819
鉱業 (0.2%)			ダイセキ環境ソリューション	1.8	1,647	鹿島建設	160.5	192,921	北野建設	1.3	3,328
住石ホールディングス	18.4	2,152	第一カッター興業	1.1	2,330	不動テトラ	5.4	7,506	植木組	0.9	2,174
日鉄鉱業	2.1	9,135	安藤・間	52.3	32,844	大末建設	2.3	1,842	矢作建設	9.1	6,633
三井松島 HLDGS	3.4	2,839	東急建設	26	14,586	鉄建建設	4.6	9,315	ピーエス三菱	6.4	3,264
国際石油開発帝石	357.8	252,642	コムシスホールディングス	31.8	92,188	西松建設	15.9	32,754	日本ハウス HLDGS	14.2	3,862
石油資源開発	11.9	22,229	ピーアールホールディングス	9.8	5,047	三井住友建設	49.6	23,361	大東建託	22.3	231,362
K&O エナジーグループ	4.3	6,359	高松コンストラクショングP	5.5	12,540	大豊建設	4.8	11,121	新日本建設	8.7	6,986
建設業 (2.6%)			東建コーポレーション	2.7	19,359	前田建設	51.5	42,642	N I P P O	16.8	43,024
ヒノキヤグループ	2.2	3,625	ソネック	0.9	729	佐田建設	4.5	1,854	東亜道路	1.3	4,134

銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
前田道路	18.6	37,032	日本甜菜糖	3.1	5,195	やまみ	0.5	983	三陽商会	3.5	2,915
日本道路	2	14,180	三井製糖	5.4	10,827	ニチレイ	31.4	94,074	ナイガイ	2.5	947
東亜建設	6.5	9,490	塩水港精糖	6.4	1,318	東洋水産	34.1	194,029	オンワードホールディングス	38.3	13,481
日本国土開発	15.2	7,660	日新製糖	2.9	5,452	イトーアアンド	2.3	4,048	ルックホールディングス	2.1	1,533
若築建設	3.5	3,920	森永製菓	15.5	66,185	大冷	0.8	1,591	ゴールドウイン	11.8	73,042
東洋建設	23.6	9,298	中村屋	1.7	6,808	ヨシムラ・フード・HLDGS	3.8	3,952	デサント	12.6	19,794
五洋建設	81.5	45,151	江崎グリコ	19.5	99,060	日清食品HD	27.9	252,216	キング	2.9	1,470
世紀東急	10.1	7,524	名糖産業	3.3	4,299	永谷園ホールディングス	3.4	7,248	ヤマトインターナショナル	3.8	1,383
福田組	2.4	11,220	井村屋グループ	2.8	5,602	一正蒲鉾	2.6	2,657	パルプ・紙 (0.2%)		
住友林業	52.6	65,118	不二家	3.6	7,887	フジッコ	7.1	13,660	特種東海製紙	4.2	17,913
日本基礎技術	7.3	2,971	山崎製パン	49.6	91,958	ロックフィールド	7.3	9,380	王子ホールディングス	268	134,000
バコーポレーション	9.2	3,450	第一屋製パン	1.3	1,236	日本たばこ産業	376.9	793,186	日本製紙	27.7	42,851
大和ハウス	203.1	537,504	モロゾフ	1.1	6,028	ケンコーマヨネーズ	3.7	7,425	三菱製紙	6.2	2,163
ライト工業	11.9	17,005	電田製菓	3.7	18,944	わらべや日洋HD	4.4	7,365	北越コーポレーション	37.7	14,024
積水ハウス	221.3	446,804	寿スピリッツ	6.4	29,120	なとり	3.9	6,704	中越パルプ	2.7	3,771
日特建設	5.4	3,888	カルビー	29.9	87,487	イフジ産業	1	800	巴川製紙	2.1	1,862
北陸電気工事	3.5	3,328	森永乳業	12.2	56,486	ピュクスコーポレーション	1.5	3,457	大王製紙	27.2	39,304
ユアテック	11.3	6,960	六甲バター	4.2	6,337	ユーグレナ	28.7	21,869	阿波製紙	2	964
四電工	1	2,399	ヤクルト	45.3	312,117	北の達人コーポ	23.5	12,854	レンゴウ	61.4	53,172
中電工	7.7	17,086	明治ホールディングス	43.4	359,786	ミヨシ油脂	2.3	2,497	トーモック	3.9	6,462
関電工	29	27,347	雪印メグミルク	16.1	42,214	理研ビタミン	6.3	14,023	ザ・パック	4.9	15,116
きんでん	48.6	85,681	ブリマハム	10.3	27,346	繊維製品 (0.5%)			化学 (7.3%)		
東京エネシス	6.8	5,372	日本ハム	25.1	102,282	片倉工業	9.6	11,068	クラレ	100.5	116,379
トーエネック	2	7,150	林兼産業	2.3	1,274	グンゼ	4.6	17,296	旭化成	425.2	362,780
住友電設	5.8	13,015	丸大食品	7	13,202	東洋紡	25.3	36,356	共和レザー	3.4	2,264
日本電設工業	11.5	27,634	S Foods	5.1	13,224	ユニチカ	19.8	6,732	昭和電工	46	117,438
協和エクシオ	31.6	78,526	伊藤ハム米久HLDGS	40.3	25,308	富士紡ホールディングス	3.2	9,872	住友化学	464	150,800
新日本空調	5.5	13,205	サッポロホールディングス	22.4	43,948	倉敷紡績	6.5	14,664	住友精化	2.9	9,758
九電工	14.5	42,151	アサヒグループホールディングス	137.6	536,089	シキボウ	4	3,844	日産化学	35.9	186,321
三機工業	15	18,990	キリンHD	278.6	624,621	日本毛織	21	20,916	ラサ工業	2.3	3,325
日揮ホールディングス	63.4	71,134	宝ホールディングス	49.2	45,756	ダイトウボウ	12.1	1,439	クレハ	5.5	25,960
中外炉工業	2.2	3,260	オノンホールディングス	18	7,056	トア紡コーポレーション	2.6	1,232	多木化学	1.9	14,041
ヤマト	6.6	4,092	養命酒	1.9	3,484	ダイドーリミテッド	9.7	2,046	テイカ	4.7	6,683
太平電業	5	11,150	コカ・コーラボトラーズHD	46.3	95,702	帝国繊維	7.3	15,979	石原産業	11.6	8,108
高砂熟学	18	31,140	サントリ-食品インター	43.7	184,195	帝人	51.8	88,578	片倉コープアグリ	1.7	2,085
三晃金属	0.8	1,641	グアイログループHD	3.4	16,252	東レ	463.6	231,150	日本曹達	9.6	26,985
朝日工業社	1.4	4,152	伊藤園	20.2	122,412	サカイオーベックス	1.7	3,563	東ソー	98.6	144,449
明星工業	13.4	9,969	キーコーヒー	6.5	14,833	住江織物	1.4	2,861	トクヤマ	18.7	44,468
大気社	10.2	31,875	ユニカフェ	1.6	1,531	日本フエルト	3.3	1,560	セントラル硝子	12.7	23,355
ダイダン	4.9	13,411	ジャパンフーズ	0.9	1,029	イチカウ	0.9	1,154	東亜合成	40.2	41,325
日比谷総合設備	6.8	12,206	日清オリオグループ	8.5	28,007	日東製網	0.8	1,069	大阪ソーダ	6.6	15,991
OSJBHD	33.2	7,835	不二製油グループ	16.2	43,950	アツギ	5.2	3,104	関東電化	15.5	13,314
東洋エンジニア	8.7	3,332	かどや製油	0.7	2,534	ダイニッック	2.3	1,653	デンカ	23.9	61,685
レイズネクスT	11.1	13,275	J-オイルミルズ	3.4	13,566	セーレン	15.9	20,193	信越化学	109.9	1,302,315
食料品 (4.0%)			キッコーマン	47.4	234,630	ソトー	2.3	2,155	日本カーバイド	2.1	2,753
日本製粉	18.9	30,088	味の素	144.6	259,701	東海染工	0.9	1,020	堺化学	4.1	8,060
日清製粉G本社	74.8	122,073	キューピー	36.2	74,210	小松マテーレ	10.7	7,607	第一稀元素化学工	7	5,222
日東富士製粉	0.4	2,472	ハウス食品G本社	24.9	87,523	ワコールホールディングス	16.3	33,659	エア・ウォーター	59.8	90,597
昭和産業	5.8	18,792	カゴメ	25.1	75,199	ホギメディカル	7.4	24,716	大陽日酸	62.2	111,960
鳥越製粉	5.5	4,669	焼津水産化工	3	2,802	クラウディアHLDGS	1.7	708	日本化学工業	2.1	4,529
中部飼料	8.2	12,677	アリアケジャパン	6.1	41,358	T S Iホールディングス	21	9,618	東邦アセチレン	0.9	1,125
フィード・ワン	45	8,550	ピエトロ	0.7	1,138	マツオカコーポレーション	1.9	4,041	日本パーカラライジング	32.3	36,046
東洋精糖	1.2	1,504	エバラ食品工業	1.5	3,237	ワールド	9.2	14,158	高圧ガス	10	7,230

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
チタン工業	0.9	1,552	関西ペイント	72.1	156,096	エフピコ	7.2	57,528	MORESCO	2.3	2,318
四国化成	9.8	10,407	神東塗料	6.8	1,230	天馬	4.4	7,123	出光興産	72.4	171,588
戸田工業	1.5	2,836	中国塗料	18.4	13,616	信越ポリマー	12	10,404	JXTGホールディングス	980.6	385,768
ステラケミファ	3.6	9,140	日本特殊塗料	4.8	4,545	東リ	15.8	4,202	コスモエネルギーHLDGS	19.2	30,508
保土谷化学	2.5	9,450	藤倉化成	8.6	4,265	ニフコ	24.1	55,695	ゴム製品 (0.6%)		
日本触媒	9.9	56,727	太陽ホールディングス	4.7	22,748	バルカー	5.5	10,219	横浜ゴム	38.2	58,102
大日精化	5.8	13,363	D I C	26.9	70,989	ユニ・チャーム	125.9	520,848	TOYO TIRE	37.9	54,992
カネカ	16.6	45,484	サカタインクス	14.1	13,733	ショーエイコーポ	0.7	597	ブリヂストン	187.5	650,250
三菱瓦斯化学	59.7	94,445	東洋インキSCホールディングス	12.7	25,476	医薬品 (6.9%)			住友ゴム	57.3	62,800
三井化学	58.4	133,560	T & K T O K A	4.1	3,058	協和キリン	65.8	179,305	藤倉コンボジット	6.2	2,201
J S R	60	116,700	富士フィルムHLDGS	125.5	598,133	武田薬品	544.1	2,133,960	オカモト	4	15,400
東京応化工業	11.1	53,890	資生堂	130.2	889,656	アステラス製薬	566.7	986,908	フコク	3	2,058
大阪有機化学	6.1	11,785	ライオン	85.3	210,691	大日本住友製薬	48.7	68,959	ニッタ	7.1	15,790
三菱ケミカルHLDGS	426.4	269,953	高砂香料	4.2	9,487	塩野義製薬	82.4	538,484	住友理工	12.9	8,281
K Hネオケム	11.4	22,765	マンダム	14.7	29,429	わかもも製薬	8.5	2,380	三ツ星ベルト	8.6	14,577
ダイセル	83.3	67,806	ミルボン	8.9	44,856	あすか製薬	7.6	8,671	バンドー化学	10.8	6,426
住友ベークライト	10.2	30,906	ファンケル	26.8	80,802	日本新薬	17.3	147,569	ガラス・土石製品 (0.8%)		
積水化学	137	202,897	コーセー	12.4	171,864	ピオフエルミン製薬	1.2	2,748	日東紡績	9.8	48,118
日本ゼオン	57.9	57,726	コタ	3.8	4,552	中外製薬	68.3	1,092,800	A G C	64.7	204,452
アイカ工業	19.4	62,662	シーボン	0.8	1,683	科研製薬	11.2	61,488	日本板硝子	32.1	13,064
宇部興産	31.7	58,423	ノーバ・オルビスHD	28	56,756	エーザイ	78.4	639,822	石塚硝子	1.2	2,382
積水樹脂	11.6	26,181	ノビアホールディングス	5.5	24,585	ロート製薬	33.7	108,514	日本山村硝子	2.3	1,943
タキロンシーアイ	14.4	9,777	アジュパコンスメジャパン	1.4	1,306	小野薬品	150.3	451,200	日本電気硝子	26.4	45,724
旭有機材	3.7	5,217	エステー	4.1	6,826	久光製薬	17.1	92,340	オハラ	2.7	2,697
ニチパン	3.4	4,991	アグロカネシヨウ	2.1	2,746	持田製薬	9.1	35,626	住友大阪セメント	12.3	44,649
リケンテクノス	16	6,672	コシロ	10.9	15,183	参天製薬	121.9	239,777	太平洋セメント	41.8	99,484
大倉工業	2.9	4,503	長谷川香料	8.9	20,283	扶桑薬品	2.3	5,609	日本ヒューム	6.4	4,659
積水化成成品	8.7	4,959	星光PMC	3.5	2,432	日本ケミファ	0.9	2,328	日本コンクリート	14.6	3,825
群栄化学	1.4	3,773	小林製薬	18.4	180,320	ツムラ	20.2	57,994	三谷セキサン	3.2	16,544
タイガースポリマー	3.4	1,598	荒川化学工業	5.9	6,908	日医工	19.2	23,712	アジアパイルHD	8.9	3,996
ミライアル	2.2	2,193	メック	4.6	8,569	キッセイ薬品工業	11.6	29,580	東海カーボン	69.7	72,278
ダイキアクシス	2.4	1,922	日本高純度化学	1.8	4,471	生化学工業	12.5	13,825	日本カーボン	3.5	12,285
ダイキョーニシカワ	12.9	6,772	タカラバイオ	17.4	53,766	栄研化学	11.8	20,555	東洋炭素	3.9	6,372
竹本容器	2.1	1,482	J C U	8.1	25,110	日水製薬	2.8	3,340	ノリタケ	3.5	11,602
森六ホールディングス	2.8	4,398	新田ゼラチン	3.9	2,726	鳥居薬品	4.2	12,936	T O T O	46.7	194,739
日本化薬	39.9	42,653	O A T アグリオ	1.2	1,280	J C R ファーマ	4.7	52,828	日本碍子	77.9	117,551
カリットホールディングス	6.4	3,193	デクセルリアルズ	17.3	14,134	東和薬品	8.4	17,220	日本特殊陶業	49.5	78,061
日本精化	5.4	7,300	アース製薬	5	35,850	富士製薬工業	4.6	5,354	ダントーホールディングス	8.1	704
扶桑化学工業	6.6	24,717	大興化学	6.6	3,940	沢井製薬	13.4	74,504	MA R U W A	2.6	20,540
トリケミカル	1.5	15,735	北栄ラミック	2.2	5,781	ゼリア新薬工業	11.8	23,517	品川フラクトリーズ	1.6	3,636
A D E K A	28.8	39,888	クミアイ化学	27.4	23,646	第一三共	187.4	1,615,762	黒崎播磨	1.3	4,907
日油	24.3	88,938	日本農薬	11.9	5,426	キョーリン製薬HD	14.9	31,155	ヨータイ	5.3	3,598
新日本理化	10.7	1,733	アキレス	4.7	7,552	大幸薬品	8.3	18,218	インソライト	3.4	1,564
ハリマ化成グループ	5.4	5,292	有沢製作所	10.5	8,242	ダイト	4	16,200	東京薬業	8.2	2,337
花王	156.5	1,352,629	日東電工	44.9	262,216	大塚ホールディングス	124.5	586,644	ニッカトール	3	1,950
第一工業製薬	2.5	11,550	レック	7.1	11,459	大正製薬HD	13.8	88,182	フジミンコポーレートッド	5.9	17,847
石原ケミカル	1.7	3,182	三光合成	7.5	2,092	ペプチドリーム	33.5	160,130	クニミネ工業	2.8	2,718
日華化学	2.1	1,969	きもと	12.4	1,909	石油・石炭製品 (0.4%)			エーアンドエーメリアル	1	1,103
ニイタカ	1.1	5,225	藤森工業	5.9	21,535	日本コークス工業	56	3,528	ニチアス	18.1	39,801
三洋化成	3.8	17,860	前澤化成工業	4	3,984	ニチレキ	8	12,576	ニチハ	9.2	19,881
有機合成薬品	5.9	1,988	未来工業	3.5	6,632	ユシロ化学	3.7	4,636	鉄鋼 (0.6%)		
大日本塗料	7.3	6,694	ウェーブロックHLDGS	2.3	1,607	ピーピー・カストロール	2.3	2,730	日本製鉄	290.4	293,013
日本ペイントHOLD	53	417,110	ジェイ エス ビー	4	5,876	富士石油	17.7	3,044	神戸製鋼所	119.9	47,960

銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
中山製鋼所	7.3	2,642	アサヒHD	11.6	31,331	滝澤鉄工所	2	1,988	丸山製作所	1.8	2,030
合同製鐵	3.6	6,703	金属製品 (0.5%)			F U J I	28	50,904	北川鉄工所	2.8	4,555
J F Eホールディングス	175.9	139,840	稲葉製作所	3.6	4,867	牧野フライス	7.8	25,467	ローツェ	2.9	14,253
東京製鐵	31.7	19,495	宮地エンジニアリング	1.9	2,990	オーエスジー	30.4	48,123	タカキタ	2.5	1,462
共英製鋼	7.5	9,660	トーカロ	18.2	19,310	ダイジェット	0.7	889	クボタ	346.4	539,864
大和工業	13.9	29,023	アルファCO	2.2	2,002	旭ダイヤモンド	16.8	8,265	荏原実業	1.7	4,362
東京製鋼	2.6	3,289	SUMCO	76.7	116,353	DMG森精機	41.5	54,282	三菱化工機	2.2	3,674
大阪製鐵	3.3	3,960	川田テクノロジー	1.3	6,305	ソディック	15.6	12,417	月島機械	12.2	14,322
淀川製鋼所	8.2	14,210	RS TECHNOLOGIES	1.9	5,947	ディスコ	8.7	204,537	帝国電機製作所	5.5	6,594
丸一鋼管	21.1	55,830	信和	2.8	2,018	日東工業	3.7	7,126	東京機械	3.1	871
モリ工業	2	4,838	東洋製罐グループHD	41.6	52,582	日進工具	1.9	4,617	新東工業	15.8	11,850
大同特殊鋼	10.5	36,750	ホッカンホールディングス	3.5	5,789	パンチ工業	5.9	2,301	渋谷工業	5.8	16,866
日本高周波	2.4	897	コロナ	3.6	3,603	富士ダイス	2.7	1,728	アイチコーポレーション	11.5	8,153
日本冶金工	5.4	8,937	横河ブリッジHLDGS	12.2	26,510	豊和工業	3.9	3,084	小森コーポレーション	15.5	10,540
山陽特殊製鋼	4.3	4,123	駒井ハルテック	1.2	1,695	OKK	2.7	1,123	鶴見製作所	5.1	9,103
愛知製鐵	3.4	10,016	高田機工	0.5	1,150	石川製作所	1.7	2,867	住友精密	1	2,222
日立金属	70.2	91,611	三和ホールディングス	61.7	57,072	東洋機械金属	4.3	1,741	日本ギア工業	2	572
日本金属	1.6	1,035	文化シャッター	19.6	14,504	津田駒工業	1.2	1,080	酒井重工業	1.2	2,562
大平洋金属	4.4	7,352	三協立山	8.7	8,395	エンシユウ	1.5	1,326	荏原製作所	27	65,691
新日本電工	43.6	7,063	アルインコ	4.9	4,463	島精機製作所	10.4	15,516	石井鉄工所	0.9	2,253
栗本鉄工所	3.2	5,555	東洋シャッター	1.7	1,203	オプトロン	7.3	16,461	西島製作所	6.7	5,286
虹社	1	1,197	L I X I Lグループ	95.5	148,502	NCホールディングス	2	1,064	北越工業	7	7,448
日本鋳鉄管	0.8	1,011	日本フィルコン	4.9	2,513	イワキポンプ	3.1	3,056	ダイキン工業	83.4	1,327,311
三菱製鋼	4.6	3,118	ノーリツ	13.7	16,316	フリユー	6.4	5,964	オルガン	2.4	12,600
日亜鋼業	9.5	2,603	長府製作所	6.7	15,034	ヤマシンフィルタ	14.4	14,241	トーヨーカネツ	3	6,156
日本精線	1.1	3,723	リンナイ	12.6	111,636	日阪製作所	7.6	5,654	栗田工業	35.6	102,777
エンビプロHD	3	1,794	ダイニチ工業	3.5	2,194	やまびこ	12.9	11,597	椿本チエイン	9.1	24,024
シンンクタン	10.4	2,537	日東精工	9	4,050	平田機工	3.1	17,329	大同工業	3.1	2,101
新家工業	1.5	1,749	三洋工業	0.8	1,490	ペガサスミシン製造	6.3	2,060	木村化工機	5.7	2,405
非鉄金属 (0.7%)			岡部	13.6	11,029	マルエ	2.7	2,578	アネスト岩田	10.5	8,809
大紀アルミニウム	10.2	5,752	ジーテクト	7.8	8,385	タツモ	3.1	4,913	ダイフク	33.6	282,576
日本軽金属HD	162.1	28,529	東プレ	11.9	15,005	ナプテスコ	38.1	121,348	サムコ	1.9	3,456
三井金属	17.6	38,808	高周波熱練	12.7	6,629	三井海洋開発	7	10,626	油研製作所	3.7	4,192
東邦亜鉛	3.3	4,917	東京製鋼	4.7	2,599	レオン自動機	6.4	7,936	油研工業	1	1,447
三菱マテリアル	42.3	95,513	サンコール	3.6	1,468	S M C	20.5	1,076,250	タダノ	32.3	27,681
住友鉱山	82.8	240,120	モリテックスチル	5.4	1,598	ユニコワマイクロン	2.3	12,880	フジテック	23.9	41,562
DOWAホールディングス	16.6	54,614	パイオラックス	9.6	15,504	ヒオニオンツール	2.1	5,607	C K D	18.5	32,375
古河機金	11.3	12,023	エイチワン	6.4	3,526	オイレス工業	8.5	11,670	キトー	5.1	6,375
エス・サイエンス	37.6	1,654	日本発条	68.9	49,332	日精工エースビー	2.1	6,667	平和	17	30,753
大板チタニウム	6.8	6,330	中央発條	0.8	2,151	サトーホールディングス	9.4	22,372	理想科学工業	5.9	8,147
東邦チタニウム	11.8	7,552	アドバネクス	0.9	1,080	技研製作所	5.8	28,188	S A N K Y O	14.5	39,425
U A C J	9.9	18,513	立川ブラインド	2.8	3,348	日本エアテック	2.3	2,244	日本金銭機械	7.3	4,270
C Kサンエツ	1.4	4,613	三益半導体	5	10,525	カワタ	1.9	1,409	マースグループHLDGS	3.9	6,271
古河電工	20.4	52,264	機械 (5.1%)			日精樹脂工業	5.4	4,298	フクシマガリレイ	4.1	14,678
住友電工	239.3	304,868	日本ドライケミカル	1.7	2,720	オカダアイオン	2	1,796	オーイズミ	2.8	1,030
フジクラ	80.3	25,294	日本製鋼所	20.1	29,888	ワイエイシホールディングス	2.8	1,248	ダイコク電機	2.9	3,584
昭和電線 HLDGS	7.7	7,723	三浦工業	28.1	122,797	小松製作所	296.3	622,230	竹内製作所	11.2	18,849
東京特殊電線	1	2,157	タクマ	22.3	32,089	住友重機械	37.7	89,914	アマノ	17.4	39,358
タツタ電線	12.9	7,236	ツガミ	13.7	12,001	日立建機	26.5	74,730	J U K I	8.9	5,313
カナレ電気	1	1,826	オークマ	7.6	34,504	日工	9.2	5,786	サンデンホールディングス	9	3,267
平河ヒューテック	2.4	2,380	芝罘機械	7.5	16,755	巴工業	2.8	5,059	蛇の目ミシン	5.9	2,560
リョービ	7.9	10,135	アマダ	78.9	69,589	井関農機	6.7	7,470	マックス	10.2	16,024
アーレスティ	8.6	3,070	アイダエンジニア	16.8	12,196	T O W A	6.7	7,383	グローリー	16.4	40,458

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
新晃工業	6.2	8,748	JVCケンウッド	55.1	9,256	ホシデン	18	16,560	日本シイエムケイ	15.7	6,358
大和冷機工業	9.7	9,263	ミマキエンジニアリング	5.5	2,084	ヒロセ電機	10	116,800	エンプラス	3.4	8,146
セガサミーホールディングス	64.2	85,386	第一精工	2.8	6,364	日本航空電子	15.2	21,888	大真空	2.5	4,577
日本ピストンリング	2.3	2,672	日新電機	15.4	16,000	TOA	7	4,991	ローム	29	205,030
リケン	3	8,181	大崎電気	13.2	6,402	マフセルホールディングス	14.5	14,224	浜松ホトニクス	46.9	217,850
TPR	8.6	11,919	オムロン	58.5	404,820	古野電気	8.6	7,894	三井ハイテック	7.4	11,477
ツバキ・ナカシマ	13.6	12,212	日東工業	9.6	17,155	エニテックホールディングス	1.9	3,450	新光電気工業	22.1	32,354
ホシザキ	19.2	171,840	I D E C	9.7	15,908	スマグコーポレーション	5.1	3,825	京セラ	91.6	524,135
大豊工業	5.2	2,865	正興電機製作所	1.8	1,668	アイコム	3.8	11,229	太陽誘電	29.3	91,855
日本精工	122.6	97,099	不二電機工業	0.7	898	リオン	2.8	6,384	村田製作所	192.1	1,183,336
NTN	154.7	34,652	ジーエス・ユアコーポ	22.3	38,601	本多通信工業	5.8	2,499	双葉電子工業	10.3	9,836
ジェイテクト	62.5	53,062	サクサホールディングス	1.5	2,611	船井電機	6.8	3,270	北陸電気工業	2.7	2,403
不二越	6.2	20,181	メルコホールディングス	2.3	6,210	横河電機	60.6	94,657	ニチコン	22.6	16,520
日本トムソン	19.6	6,820	テクノメディカ	1.5	2,722	新元工業	2.3	5,204	日本ケミコン	5.1	8,527
THK	38.4	101,683	日本電気	79.4	383,899	アズビル	41.5	121,138	KOA	10.1	9,786
ユーション精機	5.1	3,590	富士通	63.1	732,906	東亜ディーケーケー	3.3	2,765	市光工業	10.1	5,130
前澤給装工業	2.4	4,677	沖電気	25.7	26,265	日本光電工業	27.2	92,752	小糸製作所	39.5	172,220
イーグル工業	7.9	5,680	岩崎通信機	2.9	2,436	チノー	2.2	2,838	ミツバ	12.2	5,904
前澤工業	4	1,344	電気興業	3.2	8,038	共和電業	6.8	2,638	SCREENホールディングス	11.5	54,970
日本ビラー工業	6.8	8,853	サンケン電気	7.1	15,662	日本電子材料	2.7	2,370	キャノン電子	6.9	11,350
キッツ	26.8	18,894	ナカヨ	1.2	1,782	堀場製作所	12.8	67,456	キャノン	350.8	768,252
マキタ	85.2	321,630	アイホン	3.7	5,583	アドバンテス	48.9	267,972	リコー	167.7	138,687
日立造船	50.1	19,539	ルネサスエレクトロニクス	312.8	184,864	小野測器	2.5	1,267	象印マホービン	19.4	30,632
三菱重工業	109	293,373	セイコーエプソン	81	103,761	エスベック	5.9	9,752	MUTOHホールディングス	1	1,508
IHI	47.8	73,373	ワコム	45.1	24,083	キーエンス	59.3	2,497,716	東京エレクトロン	41.5	908,020
スター精密	10.3	12,772	アルバック	12.1	36,275	日置電機	3.4	9,720	輸送用機器 (7.3%)		
電気機器 (14.8%)			アクセル	2.7	1,809	シスメックス	46.7	357,535	トヨタ紡織	18.4	25,778
日清紡ホールディングス	43.4	33,635	E I Z O	5.1	20,731	日本マイクロニクス	11.6	11,507	芦森工業	1.3	1,147
イビデン	40.3	113,968	ジャパンディスプレイ	61.7	2,776	メガチップス	6.2	12,840	ユニプレス	12.4	11,879
コニカミノルタ	145.1	57,459	日本信号	16.9	19,113	OBARA GROUP	3.4	11,101	豊田自動織機	52.4	294,488
ブラザー工業	79.7	156,052	京三製作所	15.8	7,931	澤藤電機	0.9	1,366	モリタホールディングス	11.3	19,695
ミネベアミツミ	121.7	233,664	能美防災	8.7	17,304	原田工業	3.2	2,537	三桜工業	8.6	5,719
日立	314.2	1,076,135	ホーチキ	4.9	6,188	コーセル	8.7	7,612	デンソー	143.9	561,641
三菱電機	652.3	906,044	星和電機	3.5	2,058	イリソ電子工業	5.6	19,432	東海理化電機	17.1	26,761
富士電機	39.5	107,321	エレコム	7.4	36,408	オプテックグループ	10.8	13,543	三井E&SHD	21.7	11,045
東洋電機製造	2.3	2,688	パナソニック	747.2	693,551	千代田インテグレ	3	5,271	川崎重工業	50.9	84,494
安川電機	70.7	252,752	シャープ	75.9	86,222	アイ・オー・データ	2.3	2,196	名村造船所	22.2	3,663
シフオニアテクノロジー	8.6	8,677	アンリツ	42.4	98,113	レーザーテック	28.9	270,215	サニヤホールディングス	9.4	1,400
明電舎	12.1	19,868	富士通ゼネラル	17.7	38,072	スタンレー電気	46	117,484	日本車輛	2.4	6,237
オリジン	1.7	2,402	ソニー	409.8	2,998,506	岩崎電気	2.6	4,825	三菱ロジスネクスト	8.9	8,775
山洋電気	3.2	14,000	T D K	31.7	325,559	ウシオ電機	36.9	49,113	近畿車輛	1	1,231
デンヨー	5.8	10,370	帝国通信工業	2.8	3,368	岡谷電機	5.1	1,698	日産自動車	775.5	316,636
東芝テック	8.5	33,065	タムラ製作所	22.1	9,304	ヘリオステックノH	6.3	2,041	いすゞ自動車	191.3	182,691
芝浦メカトロニクス	1.1	2,978	アルプスアルパイン	58.8	81,202	エイモト	2	1,978	トヨタ自動車	729.7	4,888,990
マブチモーター	18	60,210	池上通信機	2	1,672	日本セラミック	6.8	15,170	日野自動車	82.9	59,024
日本電産	157.7	1,014,011	日本電波工業	6.3	2,242	遠藤照明	3.2	1,929	三菱自動車工業	239.1	70,773
ユ-エムシーエレクトロニクス	4.2	1,457	鈴木	3.2	2,342	古河電池	4.6	6,863	エフテック	4.8	2,404
トックス・セミコンダクター	3.8	4,803	日本トリム	0.9	2,666	双信電機	3.3	1,171	レシップホールディングス	2.6	1,489
東光高岳	3.6	3,603	ロ-ランドディー・ジー	3.7	4,477	山一電機	4.8	6,907	GMB	1.5	1,008
ダブル・スコープ	10.6	6,858	FMSスター電機	7	7,714	図研	4.4	11,250	ファルテック	1.4	910
宮越ホールディングス	2.9	1,827	S M K	1.7	4,107	日本電子	13.1	35,108	武蔵精密工業	15	14,610
ダイヘン	7.3	24,893	ヨコオ	4.3	10,646	カシオ	58.4	105,178	日産車体	13.1	12,628
ヤーマン	11	8,943	ティアック	4.9	681	ファナック	62.2	1,172,781	新明和工業	18	18,414

銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
極東開発工業	12.2	15,750	理研計器	5.8	13,682	河合楽器	2.1	5,575	鴻池運輸	9.8	11,279
日信工業	13.3	29,273	タムロン	5.3	9,635	クリナップ	5.9	2,955	西日本鉄道	18.2	52,088
トビロ工業	5.6	6,949	HOYA	130.6	1,273,350	ビジョン	39.6	156,618	ハマキョウレックス	5	15,750
ティラド	2.4	3,321	シード	2.7	1,917	兼松サステック	0.4	562	サカイ引越センター	3.5	20,300
タッチエス	10.9	9,570	ノーリツ鋼機	4.5	6,165	キングジム	5.7	5,358	近鉄グループHLDGS	62	310,620
NOK	34.8	46,632	エー・アンド・デイ	6.1	4,129	リンテック	15	37,215	阪急阪神HLDGS	82.2	306,606
フタバ産業	18.8	8,572	朝日インテック	74.6	225,292	イトーキ	14.4	5,068	南海電鉄	29.1	72,866
KYB	7.5	15,937	シチズン時計	78.7	28,568	任天堂	40.1	1,883,497	京阪ホールディングス	27.5	133,375
大同メタル工業	13.1	7,074	リズム時計	2	1,246	三菱鉛筆	10	14,200	神戸電鉄	1.5	5,505
プレス工業	32	8,640	大研医器	5.1	2,932	タカラスタンダード	13.2	19,430	名古屋鉄道	50.7	155,902
ミクニ	8.4	2,368	メニコン	9.4	47,940	コクヨ	30.6	38,739	山陽電鉄	4.7	10,152
太平洋工業	13.9	13,357	シンシア	0.9	379	ナカバヤシ	6.6	3,821	日本通運	21.5	122,120
ケーヒン	15	38,130	松風	3	4,452	グローブライド	3	6,318	ヤマトホールディングス	109.2	261,424
河西工業	9.2	4,140	セイコーHD	9.4	16,854	オカムラ	22.4	17,158	山九	17.2	69,402
アイシン精機	54.1	174,202	ニプロ	44.4	50,616	美津濃	5.9	11,658	丸連	3.5	819
マツダ	193.9	137,669	その他製品 (2.5%)			電気・ガス業 (1.6%)			丸全昭和運輸	5.1	14,647
今仙電機製作所	6.1	4,495	中本ボックス	1.6	2,294	東京電力HD	526.3	181,047	センコーグループHLDGS	33.4	26,753
本田技研	514.5	1,410,244	スノーピーク	3.4	3,406	中部電力	199	281,087	トナミホールディングス	1.5	9,045
スズキ	130	465,530	パラマウントベッドHD	6.6	27,159	関西電力	247.6	264,932	ニッコンホールディングス	21.9	46,997
SUBARU	203	471,366	トランザクシオン	4.4	4,510	中国電力	94.1	135,504	日石輸送	0.6	1,803
安永	3.3	3,194	粧美堂	2	700	北陸電力	60.1	41,469	福山通運	7.9	28,242
ヤマハ発動機	85.2	133,678	ニホンフラッシュ	6.2	8,109	東北電力	161.9	170,156	セイノーホールディングス	46.3	65,931
ショーワ	15.4	34,526	前田工業	7.3	17,074	四国電力	58.6	47,407	エスライン	1.8	1,818
TBK	7.9	3,341	永大産業	7.5	2,332	九州電力	135.3	122,311	神奈川中央交通	1.6	6,600
エクセディ	9.2	14,986	アートネイチャー	7	4,165	北海道電力	61.9	25,998	日立物流	11.3	32,080
豊田合成	21.4	47,572	パナダイナモHLDGS	67.8	402,799	沖縄電力	12.7	22,758	丸和運輸機関	6.6	18,631
愛三工業	10.6	5,946	アイフィスジャパン	1.8	1,251	電源開発	51.9	103,748	C&Fロジホールディングス	6.4	8,960
昭和産業	1	961	共立印刷	11.3	1,548	エフオン	3.7	2,020	九州旅客鉄道	54.6	158,285
日本ブラスト	5	2,275	S H O E I	6.2	15,041	イーレックス	9.6	12,854	SGホールディングス	65.4	225,957
ヨロズ	6.4	6,924	フランスベッドHLDGS	9.7	8,109	レノバ	11.2	9,979	海運業 (0.1%)		
エフ・シー・シー	10.8	20,325	パイロットコーポレーション	10.4	34,788	東京瓦斯	125.9	310,910	日本郵船	51.4	75,660
シマノ	24.5	495,390	萩原工業	3.6	4,960	大阪瓦斯	126.8	263,490	商船三井	39	71,604
テイ・エス・テック	15	44,415	トッパン・フォームズ	14.5	15,863	東邦瓦斯	32.4	179,172	川崎汽船	19.5	19,110
ジャムコ	3.3	2,458	フジソールインターナショナル	14.8	30,650	北海道瓦斯	3.6	5,720	NSユニテッド海運	3.3	4,827
精密機器 (2.5%)			タカラトミー	29.6	25,604	広島ガス	12.8	4,454	明治海運	6.3	2,016
テルモ	185.1	729,479	廣済堂	4.9	3,826	京西瓦斯	7.4	18,818	飯野海運	29.3	9,756
クリエートメディック	2	1,886	エステールホールディングス	2.2	1,328	静岡ガス	18.4	17,811	共栄タンカー	1.2	954
日機装	20	19,020	アーク	26.4	3,088	メタウォーター	3.2	14,832	乾汽船	3.7	3,441
日本エム・ディ・エム	3.9	6,064	タカノ	2.5	1,780	陸運業 (4.2%)			空運業 (0.4%)		
島津製作所	78.2	209,419	プロネクサス	5.8	6,327	SBSホールディングス	5.7	12,825	日本航空	110.2	230,538
JMS	5.7	4,491	ホクシン	5.7	678	東武鉄道	68.4	252,738	ANAホールディングス	114.6	294,006
クボテック	1.9	630	ウッドワン	2.4	2,750	相鉄ホールディングス	21	60,921	パスコ	1.3	1,904
長野計器	5	4,720	大建工業	4.5	7,380	東急	164.4	259,916	倉庫・運輸関連業 (0.2%)		
ブイ・テクノロジー	3.1	11,160	凸版印刷	92.8	166,019	京浜急行	83.8	141,957	トランコム	1.8	12,420
東京計器	4.1	3,747	大日本印刷	85.8	208,150	小田急電鉄	97.6	256,297	日新	5.4	8,645
愛知時計	0.9	3,915	共同印刷	2.1	5,882	京王電鉄	34.1	209,374	三菱倉庫	19.3	52,129
インターアクション	3.6	6,966	N I S S H A	13.9	13,941	京成電鉄	45.8	155,262	三井倉庫 HOLD	7.1	10,657
オーバル	6.4	1,408	光村印刷	0.6	887	富士急行	9	27,675	住友倉庫	21.5	27,842
東京精密	11.9	39,746	TAKARA & COMPANY	3.3	5,926	新京成電鉄	1.7	3,751	渋沢倉庫	3.4	6,864
マニー	26.3	73,903	アシックス	54.6	66,721	東日本旅客鉄道	114.8	935,964	東陽倉庫	11	3,520
ニコン	99.1	91,469	ツツミ	2.2	3,966	西日本旅客鉄道	58.4	373,234	日本トランスシティ	13.9	7,478
トプコン	33.6	28,828	小松ウオール工業	2.1	3,723	東海旅客鉄道	54.3	961,381	ケイヒン	1	1,281
オリンパス	362.3	642,901	ヤマハ	39.1	206,057	西武ホールディングス	87.6	111,252	中央倉庫	3.6	3,452

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
川西倉庫	1.1	1,118	メディアドゥ	2	9,130	LINE	14.8	79,180	ソフトブレーン	4.1	1,894
安田倉庫	4.8	4,224	じげん	16.5	5,560	カナミックネットワーク	4.1	3,444	電通国際情報S	4.1	19,106
ファイブホールディングス	1.4	1,643	ブイクューブ	4.2	5,103	ノムラシステムコーポレーション	1.8	957	デジタルガレージ	11.7	41,944
東洋埠頭	1.9	2,513	エンカレッジ・テクノロジー	1.3	1,036	チェンジ	1.4	7,896	イーエムシステムズ	9.3	8,546
宇徳	5.4	2,457	サイバーリンクス	1.2	1,971	シンドロ・フード	2.7	866	ウェザーニューズ	2.3	8,510
上組	34.7	72,592	ディー・エル・イー	4.3	2,085	オークネット	4	4,516	C I J	4.9	4,120
サンリツ	1.4	841	フィックスターズ	7.1	8,981	セグエグループ	1.3	1,032	ビジネスエンジニアリング	0.8	2,092
キムラユニティー	1.5	1,491	CARTA HOLDINGS	3.1	3,255	エイトレッド	0.9	1,728	日本エンタープライズ	7.3	1,795
キューソー流通システム	1.6	2,500	オプティム	3.4	11,067	AOI TYO HOLDINGS	6.7	2,988	WOWOW	2.8	6,874
近鉄エクスプレス	13.3	23,195	セレス	2.3	2,727	マクロミル	13.4	9,326	スカラ	4.6	3,003
東海運	3.6	954	ティーガイア	5.7	11,776	ビーグリー	1.3	2,147	インテリジェントウェイブ	3.1	2,396
エーアイティー	4.4	3,313	セック	1	3,080	オー	1.7	4,178	IMAGICA GROUP	5.7	2,177
内外トランスライン	2.1	2,097	日本アジアグループ	7.3	2,124	テモナ	0.9	664	ネットワンシステムズ	24.9	82,792
日本コンセプト	2	2,624	テックマトリックス	4.7	17,249	ニーズウェル	1	632	システムソフト	22.4	2,060
情報・通信業 (9.7%)			プロシップ	1.9	2,243	サインポスト	1.1	1,815	アルゴグラフィックス	5.5	19,580
NEC ネットズエスアイ	18.6	36,679	カンホー・オンライン・インター	15.7	27,051	ソルクシーズ	3	1,965	マーベラス	9.5	6,555
クロスキャット	1.8	1,893	GMO ベイメントゲートウェイ	13.7	152,892	フェイス	2.3	1,495	エイベックス	11.5	9,821
システムナ	23.5	34,169	ザッパラス	2.9	1,113	プロトコーポレーション	6	5,976	日本ユニシス	20.5	64,575
デジタルアーツ	3.3	26,829	システムリサーチ	1.8	3,407	ハイマックス	0.8	1,559	兼松エレクトロニクス	3.6	13,392
日鉄ソリューションズ	10	28,240	インターネットインアティブ	9.7	37,199	野村総合研究所	91.8	256,764	東京放送HD	39.5	66,044
キューブシステム	3.5	2,653	さくらインターネット	6.9	4,160	サイバネットシステム	5.1	3,294	日本テレビHLDS	52.7	61,711
エイジア	1.4	1,755	ウィンクス	1.9	2,283	CEホールディングス	4.1	1,968	朝日放送グループHD	6.2	4,885
コア	2.8	3,085	GMOクラウド	1.2	8,508	日本システム技術	1.2	1,693	テレビ朝日HD	17.8	27,465
ラウンホールディングス	3.2	2,521	SRAホールディングス	3.6	8,330	インテジホールディングス	8.4	7,182	スカパーJSATHD	41.2	17,716
ソリトンシステムズ	3.1	4,485	システムインテグレータ	2.3	1,925	東邦システムサイエンス	1.7	1,565	テレビ東京HD	5.3	12,555
ソフトクリエイイトHD	2.9	6,029	朝日ネット	4.5	6,097	ソースネクスト	31.6	8,690	日本BS放送	2.1	2,177
T I S	65.4	141,067	e B A S E	8	9,448	インフォコム	7.2	21,232	ビジョン	6.1	4,556
ネオス	2.8	1,912	アバント	4.8	4,867	ラクスル	3.5	9,982	スマートパリュウ	1.8	2,030
電算システム	2.5	8,287	アドソル日進	2.4	5,618	F I G	7.7	2,002	USEN-NEXT HLDGS	2.6	3,187
グリー	40.3	17,732	フリービット	3.7	3,000	アルテリア・ネットワークス	7.3	14,417	ワイヤレスゲート	3.2	1,929
コーエーテックモHD	13.2	42,636	コムチュア	7.4	20,105	ヒト・コミュニケーションズHD	1.6	1,520	コネクシオ	3.7	5,180
三菱総合研究所	2.9	11,252	サイバーコム	1.2	2,082	フォーカスシステムズ	4.2	3,515	日本通信	51.5	7,776
ボルテージ	1.9	818	アステリア	4.4	2,032	クレスコ	4	5,584	クロップス	1.3	929
電算	0.7	1,508	アイル	2.4	3,566	フジ・メディア・HD	62.1	64,149	日本電信電話	858.1	122,939
AGS	3.7	2,926	マークラインズ	3.3	6,768	オービック	22.5	413,550	KDDI	478.4	1,502,654
ファンデックス	5.7	5,443	メディカル・データ・ビジ	5	5,125	ジャストシステム	10.7	76,719	ソフトバンク	583.4	785,256
ブレインパッド	1.7	7,794	g u m i	8.6	8,230	TDCソフト	5.9	5,333	光通信	6.7	158,187
K L a b	12.8	8,934	ショーケース	1.6	918	Zホールディングス	885.2	389,488	N T T ドコモ	458.4	1,327,068
ポルトウウィン・ビットクル	8	6,992	モバילファクトリー	1.6	1,667	トレンドマイクロ	28.9	172,244	エムティーアイ	6.3	3,811
イーブックエニアティブ	0.9	2,491	テラスカイ	2.4	6,643	IDホールディングス	2.5	3,417	GMO インターネット	25.7	68,876
ネクソン	179.6	427,268	デジタル・インフォメーション	2.9	4,016	日本オラクル	13.2	156,420	ファイバーゲート	1.7	2,259
アイスタイル	18.4	5,188	PCIホールディングス	2.8	3,290	アルファシステムズ	2.1	8,011	アイドマーケティングコミュ	2.1	995
エムアップホールディングス	1.9	4,246	パイプドHD	0.9	1,333	フューチャー	8	13,600	KADOKAWA	17.6	31,222
エイチーム	4.2	3,439	アイビジー	1.4	1,303	CAC HOLDINGS	4.4	5,583	学研ホールディングス	8.8	12,830
エニグモ	4.6	4,595	ネオジャパン	1.2	2,182	S B テクノロジー	2.4	6,592	ゼンリン	12.9	15,750
テクノスジャパン	5.3	3,068	P R T I M E S	0.6	1,495	トーセ	1.8	1,456	昭文社ホールディングス	3.1	1,252
e n i s h	3.2	1,737	ランドコンピュータ	1	1,064	オービックビジネスC	6.7	38,994	インプレスホールディングス	5.3	747
コプロラ	21.5	20,403	ダブルスタンダード	0.9	3,780	伊藤忠テクノソリューションズ	29.9	110,480	アイネット	3.4	4,777
オルトプラス	4.9	2,048	オープンドア	3.4	3,927	アイティフォー	8.1	5,394	松竹	4.2	59,472
ブロードリーフ	32.9	16,877	マイネット	2.1	2,131	東計電算	1	4,055	東宝	37.7	146,653
クロス・マーケティングG	3.2	972	アカツキ	2.3	8,705	エクスネット	1.1	1,061	東映	2.4	34,416
デジタルハーツHLDGS	3.7	3,004	ベネフィットジャパン	0.5	695	大家商会	35.2	190,432	N T T データ	172.8	204,768
システム情報	3.6	4,654	UBICOMホールディングス	1.6	2,950	サイボウズ	7.7	23,485	ピー・シー・エー	0.9	3,775

銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
ビジネスB太田昭和	1.1	2,827	ミタチ産業	1.7	1,011	ツカモトコーポレーション	1.3	1,457	立花エレテック	4.6	7,645
D T S	14.7	33,075	シッパヘルスケアHD	10.5	45,937	三井物産	557.6	911,676	フォーバル	2.9	2,865
スクウェア・エニックス・HD	27.6	150,144	明治電機工業	1.8	2,559	日本紙パルプ	3.8	14,516	P A L T A C	10.5	51,082
シーイーシー	7.1	12,290	デリカフーズHLDGS	2.2	1,350	カメイ	8.1	8,164	三谷産業	8.7	2,905
カブコム	30.5	117,425	スターティアホールディングス	1.7	1,025	東都水産	0.8	2,668	太平洋興発	2.6	1,565
アイ・エス・ピー	1.4	2,742	コメダホールディングス	14.5	26,607	OUGホールディングス	1.1	2,816	西本 WISMETTAC HD	1.2	2,444
ジャステック	4.2	5,052	富士興産	2.2	954	スターゼン	2.4	10,488	ヤマタヘルスケアHLDGS	0.7	1,236
S C S K	15.1	78,822	協栄産業	0.7	837	山善	25.5	22,644	国際紙パルプ商事	15.9	4,547
日本システムウエア	2.2	4,754	小野建	5.7	6,714	椿本興業	1.2	4,368	ヤマタネ	3.2	3,740
アイネス	6.5	8,456	南陽	1.4	2,027	住友商事	404.2	500,399	丸紅建材リース	0.7	1,078
T K C	5.6	30,408	佐島電機	4.4	3,511	内田洋行	2.7	16,686	日鉄物産	4.6	16,123
富士ソフト	8.5	35,785	Eコマトレーディング	1.5	777	三菱商事	451.6	1,057,421	泉州電業	2	5,440
N S D	21.3	33,973	伯東	3.9	3,701	第一実業	3.3	11,929	トラスコ中山	13.6	34,856
コナミホールディングス	23.5	82,955	コンドールテック	5	5,330	キャノンマーケティングJPN	16	35,088	オートバックスセブン	23.9	32,910
福井コンピュータHLDGS	2.6	6,874	中山福	3.4	1,713	西華産業	3.5	4,165	モリト	4.7	3,078
JBCCホールディングス	4.5	6,619	ナガイレーベン	8.6	22,394	佐藤商事	4.9	4,228	加藤産業	9.6	34,704
ミロク情報サービス	5.9	13,800	三菱食品	6.8	18,822	菱洋エレクトロ	6.6	17,628	北恵	1.3	1,225
ソフトバンクグループ	510.1	2,502,040	松田産業	4.8	6,297	東京産業	5.7	2,986	イノテック	3.9	3,677
卸売業 (4.6%)			第一興商	9.7	32,883	ユアサ商事	6.2	17,998	イエローハット	12.3	17,367
ハウスイ	0.5	448	メディアパルHD	69.2	143,382	神鋼商事	1.6	3,065	JKホールディングス	6	4,710
高千穂交易	2.4	2,260	S P K	2.8	3,780	トルク	3.9	1,314	日伝	6	13,566
伊藤忠食品	1.6	7,800	萩原電気HLDGS	2.3	4,682	北和興業	12.4	23,721	北沢産業	5.2	1,409
エレマテック	6.1	5,258	アズワン	4.3	47,386	正栄食品	4.2	17,976	杉本商事	3.4	6,225
J A L U X	1.8	3,085	スズデン	2.2	2,488	カナデン	5.3	6,725	因幡電機産業	18.4	42,908
あらた	5.2	22,958	尾家産業	1.9	2,874	菱電商事	4.7	6,739	東テク	2.1	4,221
トーマンデバイス	1	3,315	シモジマ	4	4,828	フルサト工業	3.4	4,688	ミスミグループ本社	80.9	216,973
東京エレクトロンデバイス	2.3	6,152	ドウシシャ	6	9,390	岩谷産業	14.1	52,734	アルテック	5.6	1,232
フィールズ	4.6	1,522	小津産業	1.5	2,521	ナイス	2.5	1,950	タキヒヨー	2	3,510
双日	355.4	84,585	高速	3.9	5,577	昭光通商	2.3	1,398	蔵王産業	1.2	1,698
アルフレッサホールディングス	72.4	159,786	たけびし	2.2	3,086	ニチモウ	1	1,797	スズケン	27.4	108,504
横浜冷凍	16.6	14,807	リックス	1.4	2,149	極東貿易	1.9	2,781	ジェコス	4.2	3,675
神栄	1	481	丸文	5.2	2,397	イワキ	8.7	3,836	グローセル	6.3	2,797
ラサ商事	3.3	2,814	ハビネット	5.3	5,771	三菱石油	16.2	16,054	小売業 (5.0%)		
アルコニック	7	8,113	橋本総業HLDGS	1.3	2,632	稲畑産業	14.1	17,300	ローソン	16.4	95,940
神戸物産	22.6	136,730	日本ライフライン	19.4	26,112	G S Iクレオス	1.6	1,750	サンエー	5.2	21,762
あいホールディングス	9.5	14,354	タカショー	3.5	1,617	明和産業	6.3	2,835	カワチ薬品	5.1	13,499
ディーブイエックス	2.2	1,918	マルカ	2.3	4,204	クワザワ	2.4	1,243	エービーシー・マート	10.2	63,444
ダイワボウHD	5.5	40,975	I D O M	17.9	9,218	ワキタ	13.9	13,052	ハードオコーポレーション	2.4	1,668
マクニカ・富士エレHLDGS	15.2	22,678	進和	3.7	6,882	東邦ホールディングス	20.6	41,323	アスクル	6.8	24,752
ラクト・ジャパン	2.5	9,225	エスケイジャパン	1.6	488	サンリオ	17.2	23,787	ゲオホールディングス	11.9	15,565
バイタルK S K HD	11	11,671	ダイトロン	2.7	4,484	ミツウロコグループ	9.7	10,864	アダストリア	9.1	14,805
八洲電機	4.9	4,297	シークス	8.3	8,466	シナネンホールディングス	2.8	7,238	ジーフット	4.4	1,997
メディアスホールディングス	3.6	3,283	田中商事	2.1	1,411	伊藤忠エネクス	12.9	10,900	シー・グレイ・エス・ペイエリア	1	500
リストアホールディングス	6.4	13,504	オーハシテックニカ	3.7	5,723	サンリオ	18	29,124	くら寿司	3.4	16,439
ジュエテックHD	1.7	1,664	白銅	2.3	3,114	サンワテクノス	4.4	3,484	キャンドウ	3.2	6,569
大光	2.8	1,856	伊藤忠	450.3	1,022,181	リョーサン	6.8	15,395	パルグループHLDGS	6.7	8,736
OCHIホールディングス	1.9	2,762	丸紅	671.8	336,303	新光商事	10.1	8,504	エディオン	29.8	29,800
TOKAIホールディングス	35	33,530	高島	1	1,700	トーホー	2.9	5,086	サーラコーポレーション	13.5	7,411
黒谷	1.6	830	長瀬産業	35.4	44,851	三信電機	3.4	5,123	ワッツ	2.8	2,402
Cominix	1	705	蝶理	4.1	7,261	東陽テックニカ	7.6	7,767	ハローズ	2.4	7,248
三洋貿易	6.5	6,396	豊田通商	72.2	194,867	モスフードサービス	8.7	25,308	フジフードシステム	5.6	8,467
ビューティガレージ	1.1	1,631	三共生興	10	4,270	加賀電子	6.4	12,550	あみやき亭	1.4	4,242
ウイン・パートナーズ	4.7	4,215	兼松	24.5	31,531	ソーダニツカ	6.8	3,529	ひらまつ	11.8	2,124

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
大黒天物産	1.5	6,637	サンマルクホールディングス	5.1	8,884	葉王堂ホールディングス	2.9	7,047	吉野家ホールディングス	21.7	48,890
ハニーズホールディングス	5.8	6,090	フェリシモ	1.4	1,534	ヴィア・ホールディングス	8.1	3,653	松屋フーズHLDGS	3.2	11,680
ファーマライズHD	1.5	976	トリドルホールディングス	16.4	20,352	スクロール	9.6	3,849	サガミホールディングス	8.8	10,903
アルペン	5.2	9,302	TOKYO BASE	6	2,076	ヨドシヤホールディングス	6.7	12,328	関西スーパーマーケット	5.5	5,929
ハブ	1.9	1,274	ウエルプラサHLDGS	1.1	778	ファミリーマート	51.9	95,340	王将フードサービス	4.8	28,800
クオールホールディングス	9.7	11,213	JMホールディングス	3.3	8,946	木曽路	8.6	21,293	プレナス	7.1	12,666
ジンスホールディングス	3.5	21,805	サツドラホールディングス	0.9	1,777	SRSホールディングス	8.1	7,257	ミニストップ	4.7	7,191
ビックカメラ	38.2	42,020	アレナホールディングス	3.2	2,771	千趣会	12.2	4,514	アークス	13	27,820
DCMホールディングス	35.2	38,508	串カツ田中HLDGS	1.1	1,739	タカキユー	6.1	866	パローホールディングス	14.4	30,888
ペッパーフードサービス	5.7	3,294	パロックジャパン	4.6	2,852	ケーヨー	13.2	8,355	藤久	0.6	600
Monotaro	46.4	191,632	クスリのアオキHLDGS	5.9	50,445	上新電機	7.6	15,580	ベルク	3.2	21,440
東京一番フーズ	1.5	745	力の源HD	3	2,001	日本瓦斯	10.3	46,504	大庄	3.4	4,321
DDホールディングス	2.7	2,457	スノーグローブHLDGS	28.8	63,072	ロイヤルホールディングス	11.6	21,982	ファーストリテイリング	8.7	528,960
きちりホールディングス	1.7	1,031	L I X I L ビバ	6.6	17,113	東天紅	0.5	484	サンドラッグ	24.4	86,010
アークランドサービスHD	4.9	9,300	メジカシテムネットワーク	6.3	3,074	千趣会	8.1	13,324	サックスホールディング	5.2	2,995
J.フロントリテイリング	76.6	65,952	はるやまHLDGS	2.9	2,128	島忠	12.2	33,891	ヤマザワ	1.4	2,374
ドトール・日レスHD	9.9	17,047	ノジマ	11.5	29,187	チヨダ	6.8	7,412	やまや	1.3	2,945
マツモトキヨシHLDGS	27	103,545	カットパ・クリエイト	9.4	13,761	ライフコーポレーション	5	16,800	ペルーナ	13.5	8,221
ブロンコビリー	3.4	8,602	ライトオン	4.9	2,729	リンガーハット	8.2	19,417	銀行業 (5.1%)		
ZOZO	44.8	99,456	ジーンズメイト	2.7	591	MrMaxHD	8.4	3,897	島根銀行	1.5	775
トレッジャー・ファクトリー	2	1,366	良品計画	86.4	124,675	テンアライド	5.8	2,215	じもとホールディングス	45	4,230
物語コーポレーション	1.8	14,796	三城ホールディングス	6.4	1,907	AOKIホールディングス	13.1	8,239	めがきフィナンシャルG	337.5	81,675
ココカラファイン	6.8	39,100	アドヴァン	10	13,080	オークワ	10.2	15,799	東京きらぼしFG	9	10,143
三越伊勢丹HD	114.2	77,770	アルビス	2.4	5,102	コメリ	10.1	25,886	九州フィナンシャルG	108.2	48,257
Hamee	2.4	4,555	コナカ	7.1	2,030	青山商事	13.1	10,283	ゆうちょ銀行	180.7	157,389
ウエルシアHD	19.4	173,630	ハウス ローゼ	0.7	1,117	しむむら	7.6	55,784	富山第一銀行	15.5	3,968
クリエイトSDH	10.9	37,278	G-7ホールディングス	3.9	9,430	はせがわ	3.1	1,026	コンコディア・フィナンシャル	369.6	127,512
丸善CHIHD	8	3,120	イオン北海道	8.2	6,478	高島屋	46.2	43,705	西日本フィナンシャルHD	44.7	32,094
ミサワ	1.6	769	コジマ	10.8	5,767	松屋	13.2	8,580	関西みらいFG	37.7	15,494
ティーライフ	0.9	921	ヒマラヤ	2.1	1,675	イチ・ツ・オーリテイリング	30.8	24,178	33FG	6	8,424
イー・ピーカンパニー	1.5	699	コーナン商事	9.2	27,830	近鉄百貨店	2.4	7,620	第四北越フィナンシャルG	11.3	24,984
チームニー	2	3,268	エコス	2.4	4,339	丸井グループ	59.7	117,967	新生銀行	47.8	65,294
シュッピン	4.6	3,335	ワタミ	7.8	7,690	アクリアルリテイリング	5.2	21,476	あおぞら銀行	39	75,660
ネクステージ	9.5	7,315	マルシェ	1.5	900	井筒屋	4	760	三菱UFJフィナンシャルG	4,409.7	1,892,202
ジョイフル本田	19	25,479	パンパシフィックHD	142.5	322,905	イオン	248.1	589,485	りそなホールディングス	710.5	265,655
鳥貴族	2.3	3,611	西松屋チェーン	14.4	13,521	イズミ	13.2	42,636	三井住友トラストHD	121.8	366,009
キリン堂ホールディングス	2.6	5,704	セシジョホールディングス	31.3	67,013	平和堂	12.5	23,512	三井住友フィナンシャルG	446.1	1,385,140
ホットランド	4.5	5,377	幸楽苑ホールディングス	4.2	6,342	フジ	7.1	13,142	千葉銀行	215.7	108,497
すかいらーくHD	73	128,042	ハーグスレイ	1.2	1,152	ヤオコー	7.5	55,650	群馬銀行	126.3	41,805
SFPホールディングス	2.8	4,328	サイゼリヤ	10	20,620	ゼビオホールディングス	8	6,888	武蔵野銀行	9.2	14,057
綿半ホールディングス	2.4	4,274	VTホールディングス	27.5	9,130	ケーズホールディングス	62.9	89,569	千葉興業銀行	17.7	4,248
ヨシックス	1.1	2,241	魚力	1.7	2,665	OLYMPICグループ	3.2	2,806	筑波銀行	28.1	4,692
ユニテッド・スーパーマ	18.7	21,018	ポプラ	1.8	761	日産東京販売HD	8.4	2,016	七十七銀行	21.8	33,179
ゴルフダイジェスト・オン	2.9	1,624	フジ・コーポレーション	1.7	3,299	GENKY DRUGSTORES	2.9	9,483	青森銀行	5.1	11,260
B E E N O S	2.5	2,377	ユナイテッドアローズ	6.9	12,364	ブックオフGHD	3.9	3,127	秋田銀行	4.1	6,133
あさひ	4.8	6,892	ハイデイ日高	9.2	16,311	アインホールディングス	8	55,280	山形銀行	7.5	9,645
日本調剤	4	6,352	京都きもの友禅	3.9	889	元氣寿司	1.7	4,017	岩手銀行	4.4	11,343
コスモス薬品	5.8	96,976	コロワイド	21.9	33,726	ヤマダ電機	199.1	107,912	東邦銀行	59.4	13,186
トーエル	3	2,082	ピーシーデポコーポ	8.7	5,742	アークランドサカモト	10.1	16,200	東北銀行	3.1	2,892
オンリー	1.1	661	番番屋	4.6	23,414	トリムホールディングス	28	534,380	みちのく銀行	4.4	5,046
セブン&アイ・HLDGS	252.2	902,623	トップカルチャー	2.4	796	グリメ軒屋	4.5	4,338	ふくおかフィナンシャルG	54.8	92,776
クリエイト・レストランツ・ホル	35.6	26,878	P L A N T	1.3	730	愛眼	5.4	1,166	静岡銀行	159.9	110,970
ツルハホールディングス	14.2	224,076	スギホールディングス	13	90,870	ケーユーホールディングス	3.4	2,747	十六銀行	8.1	16,175

銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在		銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
スルガ銀行	63	24,696	ジャフコ	10	34,250	日本取引所グループ	185.6	433,561	AVANTIA	3.8	2,724
八十二銀行	157.5	63,000	大和証券G本社	516.1	231,006	イー・ギャランティ	7.1	14,413	イオンモール	31.7	45,109
山梨中央銀行	7.5	6,285	野村ホールディングス	1,138.7	527,673	アサックス	3.6	2,332	毎日コムネット	2	1,540
大垣共立銀行	13.1	28,846	岡三証券グループ	54.4	18,006	NECキャピタルソリューション	2.6	5,111	ファースト住建	3.1	2,830
福井銀行	5.7	9,045	丸三証券	19.4	8,419	不動産業 (2.1%)			ランド	378.1	3,781
北國銀行	6.7	18,485	東洋証券	24.3	3,037	いちご	83.3	22,824	カチダス	16.4	43,115
清水銀行	2.7	4,741	東海東京HD	73.5	17,493	日本駐車場開発	69.7	9,339	トーセイ	9.4	10,039
富山銀行	1.3	2,978	光世証券	1.8	934	ADワークスグループ	15.9	2,687	穴吹興産	1.7	2,992
滋賀銀行	13.3	31,521	水戸証券	18.6	3,645	ヒューリック	137.1	139,567	サンフロンティア不動産	9.5	8,075
南都銀行	10.7	22,384	いちよし証券	11.6	5,104	三栄建築設計	3	3,594	インテリックス	2.9	1,394
百五銀行	58.6	18,634	松井証券	37.1	30,459	野村不動産HLDGS	39.2	76,283	ランドビジネス	3	1,125
京都銀行	23.3	90,171	だいちこう証券ビジ	3.2	2,931	三重交通グループHD	13.3	6,157	日本社宅サービス	1.9	2,044
紀陽銀行	23.5	37,882	マネックスG	50	10,850	サムティ	9.5	12,255	グランディハウス	5.8	2,192
ほくほくフィナンシャルG	43.7	38,805	極東証券	8.4	4,410	日本商業開発	4.7	6,805	日本空港ビルデング	20.9	97,812
広島銀行	96.8	48,593	岩井コスモホールディング	5.8	5,811	フルサスコーポレーション	11.2	12,544	サービス業 (5.3%)		
山陰合同銀行	39.2	20,305	藍澤證券	11.8	8,201	日本管理センター	4.7	5,560	日本工営	4.3	12,530
中国銀行	55.8	53,177	マネーパートナーズGP	6.6	1,273	サンセイランディック	2.5	2,062	LIFULL	22.2	8,902
鳥取銀行	2.2	2,780	スパークス・グループ	22.9	4,671	エストラスト	1.4	869	ジェイエイ・リクルートメント	4.3	4,884
伊予銀行	93	58,218	小林洋行	2.8	700	フージャースHD	13.6	7,044	日本M&Aセンター	47.9	222,016
百十四銀行	7.1	13,653	保険業 (2.1%)			オープンハウス	19.1	64,271	メンバーズ	1.9	2,783
四国銀行	10	8,080	かんぼ生命保険	22.3	30,439	東急不動産HD	175.5	91,435	中広	0.6	327
阿波銀行	10.5	26,901	SOMPOホールディングス	121.7	438,241	飯田GHD	53	87,079	アイティメディア	2	2,846
大分銀行	3.7	8,436	アニコムホールディングス	5.4	25,245	イーグランド	1.9	1,278	タケエイ	6.2	5,611
宮崎銀行	4.4	10,124	MS & AD	167.9	523,344	ビーロット	3.4	2,257	E・Jホールディングス	1.2	1,716
佐賀銀行	3.8	4,396	SONY F H	53.6	138,931	ファーストブラザーズ	1.5	1,024	ピーネックスグループ	8	6,720
沖繩銀行	5.9	18,260	第一生命HLDGS	365.1	489,964	ハウスドラ	3.5	3,472	コシダホールディングス	15.3	6,747
琉球銀行	15	13,950	東京海上HD	228.2	1,078,473	シーアールイー	2	2,456	アルトナー	1.8	1,576
セブン銀行	215	62,780	T&Dホールディングス	193.5	183,631	プロパティエージェン	1.3	1,275	パソナグループ	7	7,840
みずほフィナンシャルG	8,762.9	1,171,599	アドバンスクリエイト	1.6	3,344	ケイアイスター不動産	2.4	3,926	CDS	1.6	1,987
高知銀行	2.5	1,702	その他金融業 (1.1%)			グレイ都市デザイン	2.2	992	リンクアンドモチベーション	14.6	5,988
山口フィナンシャルG	80.8	52,358	全国保証	18.4	72,496	ジェイ・エス・ビー	1.6	3,835	GCA	7.8	4,929
長野銀行	2.1	2,312	ジェイリース	2.5	860	テンポイノベーション	1.7	1,089	エス・エム・エス	19.9	48,914
名古屋銀行	5.3	12,704	イントラスト	2.5	1,762	グローバルリンクマネジメント	1.4	848	サニーサイドアップG	1.9	1,466
北洋銀行	97.5	20,670	日本モーゲージサービス	1.4	2,605	パーク24	35.2	69,836	パーソルホールディングス	63.4	86,224
愛知銀行	2.3	6,619	Casa	2.3	2,490	パラカ	1.6	2,624	リニカル	3.2	2,755
中京銀行	2.7	5,775	アルヒ	10.5	15,036	三井不動産	318	650,151	クックパッド	22.6	6,621
大光銀行	2.2	3,170	プレミアグループ	3.6	6,289	三菱地所	451.8	744,566	エスクリ	2	786
愛媛銀行	9.3	10,574	クレディセゾン	45.5	58,922	平和不動産	11.9	35,307	アイ・ケイ・ケイ	3.1	1,767
トマト銀行	2.5	2,567	芙蓉総合リース	6.8	38,828	東京建物	67.9	85,757	学情	2.4	2,839
京葉銀行	27.5	13,612	みずほリース	10	23,140	ダイビル	17	16,456	スタジオアリス	3.2	5,168
栃木銀行	30.2	4,983	東京センチュリー	13.1	71,788	京阪神ビルディング	10.6	14,331	ジミックホールディングス	3.6	5,220
北日本銀行	2	3,844	日本証券金融	29.5	14,514	住友不動産	144.9	412,892	NJS	1.4	2,490
東和銀行	11.4	7,911	アイフル	101.6	23,977	テオオーシー	12.9	8,668	総合警備保障	25.1	127,508
福島銀行	7.3	1,306	リコーリース	5	14,635	東京楽天地	1.2	5,382	カカコム	46.7	121,606
大東銀行	3.2	1,936	イオンフィナンシャルサービス	40.1	49,242	スターツコーポレーション	7.9	16,708	アイロムグループ	2.4	7,500
トモニホールディングス	51.1	17,374	アコム	132.2	55,391	フジ住宅	8.4	4,292	セントケア・ホールディング	3.9	1,563
フィデアホール	63.1	6,688	ジャックス	7.2	12,686	空港施設	7.2	2,916	サイネックス	1.1	728
池田泉州HD	75.5	12,457	オリコ	173.6	21,352	明和地所	5.1	2,045	ルネサンス	3.5	3,650
証券・商品先物取引業 (0.8%)			日立キャピタル	15.6	35,100	ゴールドクレスト	5	7,310	ディップ	9	19,449
FPG	20.2	12,625	アプラスフィナンシャル	34.1	2,284	エスリード	2.7	3,631	オプトホールディング	3.4	4,780
マチュリアインベストメント	2.8	1,582	オリックス	403.7	554,280	日神グループHLDGS	10.3	3,800	新日本科学	7.1	4,714
SBIホールディングス	72.6	155,799	三菱UFJリース	161	80,339	日本エスコ	12.2	9,516	ツクイ	15	7,680
日本アジア投資	6.3	1,442	九州リースサービス	2.9	1,403	タカラレーベン	30.2	10,026	キャリアデザインセンター	1.7	1,615

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ベネフィット・ワン	17.3	34,946
エムスリー	138.7	600,571
ツカダ・グローバルHOLD	3.7	1,202
アラス	0.7	324
ブラスト	36.8	23,220
ウェルネット	6.6	4,633
ワールドホールディングス	2.3	3,847
ディー・エヌ・エー	31.1	44,286
博報堂DY HLDGS	87.8	106,150
ぐるなび	11.1	7,659
タカミヤ	6.7	3,162
ジャパンバスタークス	4.5	3,703
ファンコミュニケーションズ	18	7,920
ライク	2.3	3,523
ビジネス・ブレークスルー	3.2	1,139
エスプール	12.4	8,890
WDBホールディングス	3	7,893
ティア	3.6	1,789
CDG	0.7	1,075
バリューコマース	3.6	9,846
インフォマート	69.9	59,624
JPホールディングス	20.2	5,494
エコナックホールディングス	13.5	1,309
EPSホールディングス	9	9,288
レップス	1.7	1,540
プレステージ・インター	23.9	19,000
アミューズ	3.5	7,612
ドリームインキュベータ	1.9	2,458
フイック	3.9	4,332
TAC	4.4	822
ケネディクス	59.4	31,185
電通グループ	65.2	174,344
テイクアンドギヴニーズ	2.4	1,572
ぴあ	1.8	6,120
イオンファンタジー	2.4	4,010
シーティーエス	7.3	6,168
ネクシイズグループ	2.4	2,371
みらかホールディングス	17.4	44,265
アルパス技研	5.7	10,271
サニックス	11.4	3,294
ダイオーズ	1.2	1,275
日本空調サービス	6.8	4,780
オリエンタルランド	66.5	999,495
ダスキン	16.1	43,373
明光ネットワークジャパン	7.6	6,361
リアルコホールディングス	3.5	5,390
秀英予備校	1.4	585
田谷	1.2	642
ラウンドワン	17.7	14,124
リゾートトラスト	29.3	40,434
ビー・エム・エル	8.3	24,675
ワタベウエディング	1	375
りらいあコミュニケーション	11.6	11,495

銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
リソー教育	29.2	8,993
早稲田アカデミー	2	1,848
ユー・エス・エス	70.7	128,744
東京個別指導学院	2.3	1,304
サイバーエージェント	36.5	182,135
楽天	293.3	270,715
クリーク・アンド・リバー社	3.4	3,471
テー・オー・ダブリュー	10.4	3,900
山田コンサルティングGP	3	3,855
セントラルスポーツ	2.3	5,478
キャストホールディングス	6.4	9,260
エン・ジャパン	11.3	30,928
リソルホールディングス	0.7	2,366
テクノパ・ホールディング	12.7	76,073
アトラ	1.7	409
インターワークス	1.6	588
アイ・アールジャパンHD	2.6	25,142
Keeper技研	2.4	3,818
ファーストロジック	1.4	791
三機サービス	1.3	1,236
Gunosy	3.9	3,564
デザインワン・ジャパン	1.3	323
イー・ガーディアン	3.2	7,776
リブセンス	4.5	1,233
ジャパンマテリアル	19.4	30,555
ベクトル	8.2	6,937
ウチヤマホールディングス	3.2	1,065
チャームケアソリューション	5.5	4,334
ライクキッズ	1.2	1,203
キャリアリンク	2.4	1,279
IBJ	4.5	3,294
アサンテ	2.7	3,877
N・フィールド	4.3	2,274
バリューHR	2.6	3,601
M&Aキャピタルパートナー	4.5	17,190
ライドオンエクスプレスHD	2.4	4,792
ERIホールディングス	1.8	1,161
アピスト	0.9	2,297
シグマクシス	4.4	7,356
ウィルグループ	4.3	2,717
エスクローAJ	9	1,782
リクルートホールディングス	448.9	1,588,208
エラン	3.8	6,771
土木管理総合試験	2.9	1,044
ネットマーケティング	2.2	1,333
日本郵政	509	394,984
ベルシステム24HLDGS	10.9	14,606
鎌倉新書	4.9	5,468
SMMN	1	985
一蔵	0.7	266
LITALICO	2.2	5,200
グローバルキッズCOMP	0.9	495
エアトリ	2.8	3,119

銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
アトラエ	1.7	5,380
ストライク	2.4	11,160
ソラスト	17.5	19,740
セラク	2.2	2,013
インソース	3.2	8,681
ベイクメントコンサルティング	3.9	35,217
ORCHESTRA HLDGS	1.6	2,056
アイモバイル	1.8	1,195
キャリアインデックス	2.8	876
MS-Japan	2.2	1,674
船場	1.1	1,067
グレーステクノロジー	2.9	13,862
ジャパリエベーターSHD	6.8	21,046
フルテック	0.9	1,122
グリーンズ	1.8	876
ツナググループHLDGS	0.9	374
ソウルDNAアウト	1	2,283
MS&CONSULTING	1	534
日総工業	4.5	2,875
キュービーネットHLDGS	2.9	6,020
RPAホールディングス	3.8	2,812
スプリックス	2.2	1,694
カーブホールディングス	15.9	9,555
アドバンテッジリスクマネ	3.3	2,653
リログループ	34.5	73,312
東祥	3.9	4,999
エイチ・アイ・エス	10	17,680
ラックランド	1.5	3,217
共立メンテナンス	10.6	37,312
イチネンホールディングス	7.2	8,539
建設技術研究所	4.4	7,238
スペース	3.9	3,833
長大	2.4	2,467
燦ホールディングス	2.7	3,186
スバル興業	0.4	2,940
東京テアトル	3.1	3,797
タナベ経営	1.1	1,398
ナガワ	2	14,520
よみうりランド	1.4	5,061
東京都競馬	4.2	14,805
常磐興産	2.6	3,780
カナモト	10.1	22,674
東京ドーム	26.4	20,697
西尾レントオール	5.6	12,084
アゴラ・ホスピタリティーG	47.5	1,282
トランス・コスモス	6.1	13,420
乃村工藝社	26.9	24,452
藤田観光	2.9	5,086
KNT-CTホールディングス	3.9	3,985
日本管財	7.2	13,456
トーカイ	6.2	15,847
白洋舎	0.8	2,324
セコム	66.5	620,179

銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
セントラル警備保障	3.1	12,958
丹青社	11.9	9,103
メイテック	7.9	40,685
応用地質	6.9	9,218
船井総研ホールディング	13	30,498
進学会ホールディングス	2.5	1,247
オオバ	4.8	2,899
いであ	1.3	2,268
学究社	1.8	1,980
ベネッセホールディングス	20.7	57,421
イオンディライト	7.8	24,492
ナック	4	3,428
ニチイ学館	9.2	14,720
ダイセキ	10.7	27,755
ステップ	2.3	3,272
合計	千株	千円
	株数、金額	77,285.3 140,637,428
	銘柄数<比率>	2,117銘柄 <98.2%>

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

(2)先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2020年6月15日現在	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
TOPIX	2,342	—

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入状況

区分	2020年6月15日現在	
	貸付	借入
株式	株 6,937,100 (66,200)	株 (—)

(注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
(注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、大和証券へ66,200株を貸付しています。

トピックス・インデックス・マザーファンド 運用報告書 第31期（決算日 2019年9月19日）

（作成対象期間 2018年9月20日～2019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、東証株価指数をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	東京証券取引所第1部上場株式（上場予定を含みます。）
株式組入制限	無制限

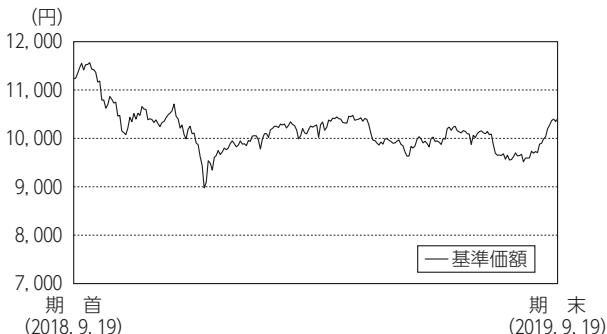
大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		TOPIX (ベンチマーク)		株式組入率	株式先物比率
	円	騰落率 %	騰落率 %	騰落率 %		
(期首)2018年9月19日	11,233	—	1,785.66	—	99.4	0.5
9月末	11,523	△2.6	1,817.25	1.8	98.7	1.3
10月末	10,435	△7.1	1,646.12	△7.8	98.5	1.6
11月末	10,573	△5.9	1,667.45	△6.6	98.7	1.3
12月末	9,490	△15.5	1,494.09	△16.3	99.3	0.9
2019年1月末	9,958	△11.4	1,567.49	△12.2	99.2	0.8
2月末	10,216	△9.1	1,607.66	△10.0	99.5	0.7
3月末	10,225	△9.0	1,591.64	△10.9	97.9	2.1
4月末	10,395	△7.5	1,617.93	△9.4	98.7	1.3
5月末	9,719	△13.5	1,512.28	△15.3	98.4	1.6
6月末	9,985	△11.1	1,551.14	△13.1	99.3	0.9
7月末	10,076	△10.3	1,565.14	△12.3	99.0	0.9
8月末	9,736	△13.3	1,511.86	△15.3	99.0	1.0
(期末)2019年9月19日	10,406	△7.4	1,615.66	△9.5	99.7	0.2

(注1) 騰落率は期首比。

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

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注4) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：11,233円 期末：10,406円 騰落率：△7.4%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク（TOPIX）が下落したことを受けて、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

○国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、米中通商協議に関していったん悪材料は出尽くしたとの見方が広がったことや為替市場で円安が進行したなどが評価され、上昇しました。2018年10月には、米国の長期金利が上昇したことに対する懸念や、国内外の決算発表において一部の分野で事業環境の悪化が見られたことが嫌気され、株価は下落しました。11月は、株価急落からの自律反発や米中首脳会談において米中通商協議に何らかの進展が見られるとの期待により株価が上昇したものの、12月に入ると、中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、下落しました。しかし2019年1月には、F R B議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことが好感されたほか、2月に開催された米中閣僚級協議などにより通商協議の進展期待が再び高まり、株価は反発しました。上昇一服後は一進一退で推移したものの、5月に入り米国が中国製品への関税率の引き上げや対象範囲の拡大方針を発表したこと、また中国の通信機器大手メーカーに対する取引制限措置を実施したことなどにより不透明感が高まり、株価は下落しました。下落一巡後は、世界景気の動向などに不透明感がある中で、6月末に開催された米中首脳会談で一定の成果が見られたことや米国の利下げ期待が支えとなり、株価は横ばい圏で推移しました。しかし8月に入ると、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され、株価は下落しました。9月以降は、米中通商協議の進展期待から、当作成期末にかけて上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は△9.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△7.4%となりました。

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

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

《今後の運用方針》

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

■ 1 万口当りの費用の明細

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

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2018年9月20日から2019年9月19日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 12,873.8 (△ 2,507.842)	千円 21,915,216 (3,997)	千株 7,289.458	千円 12,747,872

(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

(2018年9月20日から2019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
国内 株式先物取引	百万円 25,515	百万円 25,723	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(3) 新株予約権証券

(2018年9月20日から2019年9月19日まで)

	買 付		売 付	
	証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	証 券 (102,600)	千円 — (—)	証 券 96,100 (6,500)	千円 336 (—)

(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

(2018年9月20日から2019年9月19日まで)

買 付	当 期			売 付	当 期		
	銘 柄	株 数	金 額		銘 柄	株 数	金 額
		千株	千円			千株	千円
			円				円
武田薬品	355.2	1,567,077	4,411	トヨタ自動車	91	617,061	6,780
ソフトバンク	675.8	926,910	1,371	ソフトバンクグループ	60.8	403,569	6,637
トヨタ自動車	76.5	525,228	6,865	日本電信電話	37.6	187,248	4,980
ソニー	52.6	301,826	5,738	三井住友フィナンシャルG	45.3	185,878	4,103
三菱UFJフィナンシャルG	531.4	297,828	560	NTTドコモ	72.6	182,839	2,518
ソフトバンクグループ	39.4	252,160	6,400	三菱UFJフィナンシャルG	304	177,941	585
日本郵政	197.8	251,219	1,270	本田技研	55.9	168,744	3,018
キーエンス	3.7	231,266	62,504	任天堂	4.3	168,160	39,107
日本電信電話	45.8	225,511	4,923	リクルートホールディングス	50.9	156,507	3,074
三井住友フィナンシャルG	47.6	184,770	3,881	KDDI	55.9	156,503	2,799

(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			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円	
水産・農林業 (0.1%)																				
極洋	3.8	2.8	8,173					前田建設	47.1	49.1	46,988						三機工業	14	15.3	20,241
日本水産	75.4	84.9	53,571					佐田建設	—	4.5	1,813						日揮	56.5	60.4	87,519
マルハニチロ	12.7	12.3	34,280					ナカノフドー建設	—	5.4	2,446						中外炉工業	3.3	2	2,958
カネコ種苗	6.9	2.6	3,257					奥村組	10.8	11.5	34,086						ヤマト	—	6.3	4,384
サカタのタネ	10	10.1	38,481					東鉄工業	8	8.4	27,258						太平電業	4.6	4.7	11,242
ホクト	7.1	7.1	13,972					イチケン	—	1.3	2,141						高砂熱学	17.5	17	31,025
ホクリヨウ	—	1.1	743					富士ピー・エス	—	2.9	1,447						三晃金属	—	0.8	1,983
鉱業 (0.3%)								浅沼組	29	2.4	9,060						朝日工業社	—	1.5	4,404
住石ホールディングス	—	18.5	2,479					戸田建設	75.2	81.3	52,032						明星工業	13.2	12.7	9,639
日鉄鉱業	2.1	1.9	8,056					熊谷組	10.5	10	31,400						大気社	8.2	9.5	32,252
三井松島 HLDGS	5.1	3.6	4,431					青木あすなる建設	—	3.6	4,345						ダイダ	4.7	4.7	10,067
国際石油開発帝石	316.5	340.3	362,589					北野建設	21	1.5	3,502						日比谷総合設備	8	6.3	12,600
石油資源開発	9.8	12.2	36,722					植木組	—	0.9	2,244						東芝プラントシステム	13.5	15.2	27,527
K&O エナジーグループ	3.5	4.1	5,489					三井ホーム	11	—	—						OS J B HD	38.1	31	7,626
建設業 (2.9%)								矢作建設	10.7	9.5	6,897						東洋エンジニア	11.6	8.3	5,121
ヒノキヤグループ	—	2.1	4,040					ピーエス三菱	13.1	7.4	5,298						千代田化工建	43.4	—	—
ショーボンドHD	6.1	12.1	48,037					日本ハウス HLDGS	17.5	13.4	6,324						レイズネクスト	13.4	12.5	15,600
ミライト・ホールディングス	20.2	23.8	40,222					大東建託	23.4	24.9	359,929						食料品 (4.0%)			
タマホーム	7.5	4.1	5,940					新日本建設	9.2	8.3	6,606						日本製粉	19.2	19.8	34,511
サンヨーホームズ	—	1.2	778					N I P P O	14.3	18.5	36,926						日清製粉G本社	71.8	70.8	144,998
日本アクア	—	3.4	2,012					東亜道路	2	1.3	4,478						日東富士製粉	—	0.4	2,576
ファーストコーポレーション	—	2.6	1,547					前田道路	18.4	20.8	50,232						昭和産業	5.4	5.7	17,869
ベステラ	—	1.6	1,980					日本道路	1.9	1.9	12,464						鳥越製粉	—	5.6	4,838
T A T E R U	10.3	—	—					東亜建設	5.8	6.1	8,100						中部飼料	8	7.6	9,416
スペースバリューHD	—	10.4	5,158					日本国土開発	—	11.5	6,152						フィード・ワン	48.2	42.1	6,820
ダイセキ環境ソリューション	—	1.6	1,128					若築建設	6.1	3.5	5,302						東洋精糖	9.9	0.9	960
第一カッター興業	—	1	1,668					東洋建設	22.9	25.7	11,719						日本甜菜糖	—	3.6	6,609
安藤・間	54	54.4	42,432					五洋建設	76.7	83.3	49,063						三井製糖	5	4.9	11,230
東急建設	26.5	24.8	19,964					世紀東急	13.6	10.2	7,435						塩水港精糖	43.9	6.6	1,379
コムシスホールディングス	24.9	30.1	89,818					福田組	2.4	2.3	9,844						日新製糖	4.6	2.9	5,829
ミサワホーム	6.7	6.7	7,597					住友林業	40.5	49.6	71,126						森永製菓	13.7	15.8	79,316
ピーアルホールディングス	—	9.3	3,552					日本基礎技術	22	7.2	2,397						中村屋	—	1.6	7,136
高松コンストラクショング	4.2	5.3	13,382					日成ビルド工業	12.1	—	—						山崎グリコ	16.4	18.6	88,071
東建コーポレーション	2.4	2.6	17,680					巴コーポレーション	14.9	8.7	3,462						名糖産業	—	3	3,960
ソネック	—	0.8	710					大和ハウス	193	193.8	694,191						井村屋グループ	—	2.7	5,748
ヤマウラ	9.3	3.3	2,930					ライト工業	14.3	13.5	19,291						不二家	3.8	3.5	7,245
大成建設	65.4	69.7	290,300					積水ハウス	211.6	214.2	447,249						山崎製パン	48.9	47.1	91,750
大林組	194	209.8	231,619					日特建設	10.9	6	3,918						一屋製パン	—	1.1	1,042
清水建設	199	214.1	213,457					北陸電気工事	—	3.4	2,988						モロゾフ	1.9	1.1	5,450
飛島建設	74.4	6	7,008					ユアテック	9.4	11.2	7,627						電田製菓	3.9	3.9	18,837
長谷工コーポレーション	75.6	87.4	109,861					四電工	—	1	2,830						寿スピリッツ	6	6.6	46,596
松井建設	11.8	7.7	5,559					中電工	7.5	9	21,762						カルビー	26.8	28.6	97,383
銭高組	—	0.9	3,636					関電工	24.4	31.8	31,482						森永乳業	11.7	12.6	51,975
鹿島建設	286	164	235,832					きんでん	41.2	46.5	76,632						六甲バター	5	4.2	7,539
不動産トラ	63.7	4.8	5,788					東京エネシス	8.2	7.2	6,573						ヤクルト	34.3	46.4	295,568
大末建設	—	2.5	2,340					トーエネック	1.9	2	6,890						明治ホールディングス	38.7	44.4	352,536
鉄建建設	4.4	4.3	11,734					住友電設	5.3	4.8	10,228						雪印メグミルク	14.4	15.1	38,837
西松建設	14.9	15.1	30,411					日本電設工業	9.8	11.9	27,548						プリマハム	42	8.8	19,412
三井住友建設	47.8	50.5	28,532					協和エクシオ	25	27.4	72,829						日本ハム	24.6	26	114,660
大豊建設	27	4.7	13,630					新日本空調	—	5.6	10,421						林兼産業	—	2	1,162
								九電工	12.9	13.8	49,749						丸大食品	35	6.7	15,329

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
S Foods	4.8	5.6	18,032	18,032	富士紡ホールディングス	3.9	3.2	9,385	9,385	住友化学	445	481.2	242,524	242,524
伊藤ハム米久 HLDGS	36.8	40.3	27,605	27,605	倉敷紡績	63	5.8	12,980	12,980	住友精化	2.6	3	10,020	10,020
サッポロホールディングス	20.8	21.4	56,474	56,474	シキボウ	6.8	3.2	2,956	2,956	日産化学	35.6	37.1	169,176	169,176
アサヒグループホールディングス	123.1	131.3	699,829	699,829	日本毛織	18.9	20	19,300	19,300	ラサ工業	3.7	2.2	2,673	2,673
キリンHD	266.2	265.9	606,517	606,517	ダイトウボウ	—	10.4	842	842	クレハ	5.4	5.7	36,822	36,822
宝ホールディングス	45.4	47	52,640	52,640	トーア紡コーポレーション	—	2.5	1,295	1,295	多木化学	—	1.8	9,036	9,036
オエノホールディングス	24.6	16.6	6,640	6,640	ダイドリーミテツド	—	7.2	1,958	1,958	テイカ	5.5	5	9,865	9,865
養命酒	—	1.9	3,691	3,691	帝国繊維	7.2	6.9	12,530	12,530	石原産業	12.3	11.8	10,985	10,985
コカ・コーラボトラーズ JHD	45	44	106,172	106,172	帝人	48.5	49.8	102,687	102,687	片倉コープアグリ	—	1.8	1,969	1,969
サントリー食品インター	39.2	41.9	198,396	198,396	東レ	442.2	474.6	397,572	397,572	日本書達	42	9.7	25,268	25,268
ダイドールグループHD	3.2	3.5	15,750	15,750	サカイオーベックス	3.4	1.5	2,542	2,542	東ソー	87.2	94.5	138,348	138,348
伊藤園	19.8	19	98,230	98,230	住江織物	2.8	1.8	5,328	5,328	トクヤマ	18.1	17.6	42,979	42,979
キーコーヒー	7	6.2	13,677	13,677	日本フエルト	—	3.5	1,648	1,648	セントラル硝子	12.7	13.4	31,114	31,114
ユニカフェ	—	1.6	1,582	1,582	イチカフ	—	0.9	1,276	1,276	東亜合成	34.2	38.4	45,504	45,504
ジャパンフーズ	—	0.9	1,089	1,089	日東製網	—	0.7	1,028	1,028	大阪ソーダ	6.9	6.8	18,713	18,713
日清オイリオグループ	7	8	28,000	28,000	アツギ	8.9	5.1	4,263	4,263	関東電化	16.1	14.6	11,373	11,373
不二製油グループ	16	15.3	46,512	46,512	ダイニック	8.3	2.5	1,847	1,847	デンカ	22.2	24	71,904	71,904
かどや製油	—	0.7	2,558	2,558	セーレン	14.4	15.1	19,041	19,041	信越化学	100.9	107.8	1,274,196	1,274,196
J-オイルミルズ	3.1	3.2	13,328	13,328	ソトー	12.8	2.4	2,380	2,380	日本カーバイド	3.6	2.1	2,620	2,620
キッコーマン	42.8	41.4	213,624	213,624	東海染工	6.3	0.8	923	923	堺化学	4.7	4.1	10,655	10,655
味の素	133.8	138.5	282,540	282,540	小松マターレ	11.5	10	8,190	8,190	第一稀元素化学工	—	6.6	5,425	5,425
キューピー	32.5	34.9	90,181	90,181	ワコールホールディングス	16.1	17.3	47,713	47,713	エア・ウォーター	49	50.1	96,642	96,642
ハウス食品G本社	22.4	23.4	97,461	97,461	ホギメディカル	8	7.6	23,560	23,560	大陽日酸	47.8	50.4	107,805	107,805
カゴメ	23.7	23.8	65,569	65,569	レナウン	—	17.9	1,986	1,986	日本化学工業	2.8	2.1	5,115	5,115
焼津水産化工	—	3.1	3,289	3,289	クラウドディア HLDGS	—	1.5	748	748	東邦アセチレン	—	0.9	1,186	1,186
アリアケジャパン	5.5	5.7	47,652	47,652	T S Iホールディングス	21.2	22.6	13,108	13,108	日本パーカライズン	30.2	33.4	40,881	40,881
ビエトロ	—	0.8	1,303	1,303	マツコカコーポレーション	—	1.9	3,934	3,934	高圧ガス	11	9.7	8,177	8,177
Eバラ食品工業	—	1.5	3,165	3,165	ワールド	—	8	20,176	20,176	チタン工業	—	0.8	2,086	2,086
やまみ	—	0.3	600	600	三陽商会	4.4	3.2	4,729	4,729	四国化成	9.8	10.3	11,875	11,875
ニチレイ	28.2	32.6	81,630	81,630	ナイガイ	—	2.2	829	829	戸田工業	2.4	1.3	2,897	2,897
東洋水産	32.2	32.3	144,542	144,542	オンワードホールディングス	36.5	36.8	20,313	20,313	ステラ ケミファ	3.6	3.6	10,173	10,173
イートアンド	—	2.2	3,834	3,834	ルックホールディングス	—	2.1	2,257	2,257	保土谷化学	2.5	2.1	6,478	6,478
大冷	—	0.7	1,448	1,448	ゴールドウイン	3.7	5.5	97,900	97,900	日本触媒	9.6	10.3	66,435	66,435
ヨシムラ・フード・HLDGS	—	1.7	1,490	1,490	デサント	14.4	14.9	22,454	22,454	大日精化	4.8	5.1	16,728	16,728
日清食品HD	22.9	26.6	206,416	206,416	キング	—	3.3	1,877	1,877	カナカ	80	15.8	54,115	54,115
永谷園ホールディングス	9	3.4	7,408	7,408	ヤマトインターナショナル	—	3.7	1,487	1,487	三菱瓦斯化学	49.9	62.1	90,976	90,976
一正蒲鉾	—	2.4	2,635	2,635	パルプ・紙 (0.2%)					三井化学	54.7	55.5	140,137	140,137
フジッコ	6.7	6.8	13,620	13,620	特種東海製紙	3.3	3.9	15,405	15,405	J S R	61.5	61.4	105,485	105,485
ロックフィールド	7.5	6.8	9,948	9,948	王子ホールディングス	258	275.2	142,278	142,278	東京応化工業	9.5	10.5	41,632	41,632
日本たばこ産業	338.2	361.9	831,646	831,646	日本製紙	25	29.4	53,566	53,566	大阪有機化学	7	5.6	6,014	6,014
ケンコーマヨネーズ	4.7	3.5	8,267	8,267	三菱製紙	14.1	10	4,910	4,910	三菱ケミカル HLDGS	407.7	408.7	330,679	330,679
わらべや日洋 HD	4.3	4.1	7,609	7,609	北越コーポレーション	31.7	40.5	22,356	22,356	K Hネオケム	9.2	10.8	25,326	25,326
なとり	—	3.5	5,687	5,687	中越パルプ	4.9	2.6	4,074	4,074	ダイセル	80.7	90.2	81,811	81,811
イフジ産業	—	1	733	733	巴川製紙	—	2	1,978	1,978	住友ベークライト	50	10.6	44,149	44,149
ビックスコーポレーション	—	1.5	3,882	3,882	大王製紙	23.1	29.9	40,514	40,514	積水化学	123.8	131.5	228,941	228,941
北の達人コーポ	19.8	24.6	17,367	17,367	阿波製紙	—	1.6	656	656	日本ゼオン	51	55.1	75,321	75,321
ユーグレナ	23.6	26.8	24,146	24,146	レンゴー	59.7	63	50,274	50,274	アイカ工業	17.1	18.4	60,444	60,444
ミヨシ油脂	—	2.4	2,704	2,704	トーモク	4.3	3.7	5,905	5,905	宇部興産	30.3	30.8	68,222	68,222
理研ビタミン	2.6	3	10,800	10,800	ザ・パック	4.4	4.6	15,663	15,663	積水樹脂	9.6	10.1	22,068	22,068
繊維製品 (0.7%)					化学 (7.2%)					タキロンシーアイ	15.1	13.1	8,685	8,685
片倉工業	8.1	8.9	11,525	11,525	クラレ	93.3	96.3	130,775	130,775	旭有機材	5	4.2	5,607	5,607
グンゼ	4.8	4.1	18,573	18,573	旭化成	382.6	435.1	479,697	479,697	日立化成	29	28.3	97,635	97,635
東洋紡	22.1	26	37,414	37,414	共和レザー	9.8	3.8	2,967	2,967	ニチパン	3.5	3.2	5,187	5,187
ユニチカ	19.4	18.1	5,900	5,900	昭和電工	38.5	43.5	130,152	130,152	リケンテクノス	16.1	16.7	7,999	7,999

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千株	千円	
大倉工業	3.4	2.9	4,747		長谷川香料	7.4	8.3	17,015		扶桑薬品	4	2.2	4,477	
積水化成	9.1	9.1	7,161		星光PMC	—	3.6	2,811		日本ケミファ	2.2	0.8	2,240	
群栄化学	2.5	1.6	3,891		小林製薬	16.5	17.5	147,000		ツムラ	20.8	19.4	58,103	
タイガースポリマー	—	3.1	1,773		荒川化学工業	6.2	5.6	8,573		日医工	14.3	16.5	20,460	
ミリアル	—	1.8	2,451		メック	5.2	4.3	6,243		キッセイ薬品工業	9.8	11	28,677	
ダイキアクシス	—	2.2	1,779		日本高純度化学	5.3	1.7	4,188		生化学工業	12.2	12.1	13,721	
ダイキョーニシカワ	11.9	12.9	10,307		タカラバイオ	15.8	16.4	38,687		栄研化学	9.9	11	18,777	
竹本容器	2.4	2.2	1,999		JCU	7.6	8.1	17,131		日水製薬	—	2.6	3,169	
森六ホールディングス	—	3.3	8,276		新田ゼラチン	12.7	4	2,708		鳥居薬品	3.4	3.9	11,376	
日本化薬	38.1	37.9	49,270		OATアグリオ	—	1	1,429		JCRファーマ	4.4	4.4	35,816	
カーリットホールディングス	8	6.5	3,796		デクセリアルズ	15.9	16.2	12,717		東和薬品	3	9	22,878	
日本精化	7.7	4.9	5,938		アース製薬	4.3	4.7	25,380		富士製薬工業	4.5	4.3	5,757	
扶桑化学工業	6.2	6.2	14,669		北興化学	12.8	6.4	3,168		沢井製薬	11.6	12.8	73,344	
トリケミカル	—	1.4	8,890		大成ラミック	—	2.1	6,132		ゼリア新薬工業	13	12.4	24,006	
ADEKA	25.2	30.1	41,507		クミアイ化学	25	25.9	24,449		第一三共	167.7	178.7	1,273,416	
日油	23.9	23	83,490		日本農薬	14.8	11.2	5,297		キョーリン製薬HD	15.2	13.8	25,405	
新日本理化	—	10.9	2,092		アキレス	5.4	4.3	7,378		大幸薬品	4.4	2.8	6,683	
ハリマ化成グループ	7.1	5	6,280		有沢製作所	11.6	9.9	10,147		ダイト	4.1	3.7	10,855	
花王	143.2	149.5	1,186,581		日東電工	43.9	43.1	231,188		大塚ホールディングス	111.4	119	564,893	
第一工業製薬	14	2.3	6,522		レック	3.7	6.7	6,686		大正製薬HD	13.2	13.2	104,412	
石原ケミカル	—	1.6	2,742		三光合成	—	7.2	2,556		ペプチドリーム	27.2	31.6	172,536	
日華化学	—	2.1	1,713		きもと	—	10.7	1,958		石油・石炭製品 (0.6%)				
ニイタカ	—	1	1,500		藤森工業	4.9	5.6	17,752		日本コークス工業	58.3	52.6	4,628	
三洋化成	3.7	4.1	20,705		前澤化成工業	—	4.3	5,147		昭和シエル石油	55.9	—	—	
有機合成薬品	—	4.8	1,123		未来工業	—	3.4	6,602		ニチレキ	8.6	8	8,984	
大日本塗料	8.8	6.9	7,638		ウェーブロックHLDGS	—	1.8	1,333		ユシロ化学	4.8	3.2	4,384	
日本ペイントHOLD	47.4	50.5	267,650		ジェイ エス ビー	3.8	3.7	6,774		ビービー・カストロール	2.9	2.2	3,025	
関西ペイント	64	68.8	163,812		エフピコ	4.9	6.9	45,954		富士石油	18.2	15.3	3,825	
神東塗料	—	5	825		天馬	5.2	4.2	8,530		MOR E S C O	5.2	2.3	3,121	
中国塗料	18.8	20.1	18,512		信越ポリマー	12.1	11.2	8,556		出光興産	49.3	72.1	233,604	
日本特殊塗料	4.9	4.6	5,165		東リ	24.6	15.6	4,024		JXTGホールディングス	932.5	1,033	515,570	
藤倉化成	15	8.2	4,469		ニフコ	20.8	25	66,225		コスモエネルギーHLDGS	17.3	18.1	40,272	
太陽ホールディングス	4.5	5.1	17,748		バルカー	5.2	5.1	11,704		ゴム製品 (0.8%)				
DIC	25.5	25.8	77,787		ユニ・チャーム	124.2	120.4	402,978		横浜ゴム	32.3	36.1	78,409	
サカタインクス	13.1	13.4	14,860		ショーエイコーポ	—	0.5	380		TOYO TIRE	29.8	35.9	50,762	
東洋インキSCホールディン	11.2	12.9	31,863		医薬品 (5.6%)					ブリヂストン	179.3	191.9	826,129	
T&K TOKA	6.4	4.7	4,591		協和キリン	72.7	62.8	132,696		住友ゴム	50.9	56.1	72,200	
富士フィルムHLDGS	121.1	129.7	622,430		武田薬品	215.2	545.3	2,048,692		藤倉コンポジット	12.1	5.5	2,376	
資生堂	116.6	124.1	1,082,400		アステラス製薬	574.7	549.4	836,186		オカモト	21	4.2	17,283	
ライオン	81.7	81.2	172,793		大日本住友製薬	44	46.3	85,701		フコク	—	2.7	1,895	
高砂香料	3.8	4.3	11,962		塩野義製薬	82.2	79.8	466,830		ニッタ	5.7	7	21,385	
マンダム	11.1	14.1	39,282		田辺三菱製薬	70.6	65.4	82,077		住友理工	9.8	12.1	10,769	
ミルボン	7.4	8.3	43,907		わかもと製薬	—	7.5	1,845		三ツ星ベルト	16	8.2	15,424	
ファンケル	14.5	27.8	77,367		あすか製薬	7.9	7.7	8,639		バンドー化学	11.3	11.9	10,567	
コーセー	10	10.6	200,764		日本新薬	15.5	16.3	147,026		ガラス・土石製品 (0.8%)				
コタ	—	3.3	3,979		ピオフェルミン製薬	—	1.1	2,427		日東紡績	9	9.3	29,295	
シーズ・ホールディングス	7.4	—	—		中外製薬	61.3	65.1	522,102		AGC	58.2	61.7	202,993	
シーボン	—	0.8	1,931		科研製薬	10.4	10.7	54,356		日本板硝子	30	30	19,740	
ポーラ・オルビスHD	25.2	26.7	66,216		イーザイ	70.2	74.8	404,817		石塚硝子	—	1.1	2,137	
ノエビアホールディングス	3.7	6	34,800		ロート製薬	32.4	32.1	93,025		日本山村硝子	59	2.6	3,302	
アジパコスマージャパン	—	1.4	1,324		小野薬品	138.2	147.5	303,038		日本電気硝子	25.2	25.1	60,566	
エステー	4.7	4.5	7,618		久光製薬	17.3	18.5	87,967		オハラ	—	2.5	3,615	
アグロカネショウ	—	2	3,070		持田製薬	3.8	9.4	39,527		住友大阪セメント	110	12.6	59,661	
コニシ	10.8	11	16,500		参天製薬	110.4	116.3	221,318		太平洋セメント	36.7	39.5	115,142	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			千株	千株	千円			千株	千株	千円	
日本ヒューム	10.3	6.2	4,433		エンビプロHD	—	2.3	1,518		日東精工	—	8.5	4,904	
日本コンクリート	25	13.4	3,792		シンニタン	17.3	9.6	4,492		三洋工業	—	0.8	1,519	
三谷セキサン	—	2.9	9,207		新家工業	—	1.4	2,051		岡部	13.4	12.5	10,650	
アジアパイルHD	10.8	8.9	4,672		非鉄金属 (0.7%)					ジーテクト	7	6.8	11,532	
東海カーボン	54.7	65.4	73,248		大紀アルミニウム	12.7	10.1	7,564		中国工業	—	1	534	
日本カーボン	3.1	3.2	12,176		日本軽金属HD	166.6	168.1	33,620		東プレ	10.5	11.5	19,550	
東洋炭素	4	3.7	8,776		三井金属	15.5	16.7	43,119		高周波熱錬	12.3	11.9	10,769	
ノリタケ	3.5	3.7	14,911		東邦亜鉛	3.5	3.4	6,864		東京製綱	5.4	3.8	3,636	
TOTO	45.3	48.1	199,855		三菱マテリアル	37.2	40.8	119,829		サンコール	—	3.5	1,620	
日本碍子	68.7	76.3	119,791		住友鉱山	73.9	84.6	289,670		モリテックスチル	—	4.8	1,694	
日本特殊陶業	49.4	52.7	110,090		DOWAホールディングス	14.2	14.4	53,064		パイオラックス	8.9	9.9	18,909	
ダントーホールディングス	—	4.9	558		古河機金	9.9	10.2	14,912		エイチワン	6.6	6.1	4,013	
MARUWA	2.2	2.2	14,564		エス・サイエンス	—	27.6	1,490		日本発条	56.4	61.6	51,497	
品川リフラクトリーズ	2.3	1.6	4,278		大阪チタニウム	7.1	7.2	12,758		中央発條	—	0.7	1,929	
黒崎播磨	1.4	1.2	6,720		東邦チタニウム	12.1	11.1	9,168		アドパネクス	—	0.8	1,304	
ヨータイ	—	5.5	3,366		UACJ	8.7	9.4	16,675		立川ブラインド	4.8	2.7	3,753	
イソライト	—	3.2	1,452		CKサンエツ	—	1.2	3,381		三益半導体	5.3	5.4	10,216	
東京窯業	—	8	2,392		古河電工	19.1	17.8	44,891		機械 (5.0%)				
ニッカトー	4.6	2.8	1,934		住友電工	213.7	230.7	322,403		日本ドライケミカル	—	1.7	1,946	
フジミンコボレーテッド	5.7	5.6	14,554		フジクラ	67.3	74.8	29,471		日本製綱所	19.4	18.8	39,235	
クニミネ工業	—	2.8	2,562		昭和電線 HLDGS	11.2	7.2	6,328		三浦工業	25.3	26.7	81,969	
エーアンドエーマテリアル	—	1.2	1,224		東京特殊電線	—	0.8	1,591		タクマ	19.8	22.5	28,237	
ニチアス	33	17.1	33,020		タツタ電線	13.8	12.2	5,758		ツガミ	17	13.9	12,649	
ニチハ	9	8.7	26,361		カナレ電気	—	1.1	2,094		オークマ	6.5	7.9	46,215	
鉄鋼 (0.8%)					平河ヒューテック	—	2.6	2,893		東芝機械	34	7	16,121	
日本製鉄	256.5	286.9	437,379		リョービ	7.5	7.6	13,436		アマダホールディングス	85.2	92.7	108,829	
神戸製鋼所	104	113.2	66,222		アールステイ	9.6	7.6	4,400		アイダエンジニア	14.1	16.7	14,245	
中山製鋼所	9	8.5	3,935		アサヒHD	10.5	11.6	27,387		滝澤鉄工所	4.3	1.9	2,498	
合同製鐵	3.9	3	6,711		金属製品 (0.6%)				FUJII	17.4	24.7	38,680		
JFEホールディングス	155.5	166.8	219,925		稲葉製作所	—	3.5	5,106		牧野フライス	29	7.2	33,660	
日新製鋼	16.2	—	—		宮地エンジニアリングG	2.8	1.9	3,007		オーエスジー	27.8	28.5	64,296	
東京製鐵	31.6	33.1	28,234		トーカロ	17.1	16	14,656		ダイジェット	—	0.7	1,047	
共英製鋼	6.8	7	14,140		アルファCO	3.4	2.2	2,600		旭ダイヤモンド	19.1	16.2	10,465	
大和工業	12.2	13.1	37,138		SUMCO	64.1	74	106,190		DMG森精機	35.6	39.1	61,543	
東京製鋼	5	2.5	3,350		川田テクノロジーズ	1.4	1.4	9,576		ソディック	13.2	14.5	11,310	
大阪製鐵	3.9	4.1	5,580		RS TECHNOLOGIES	—	1.7	6,086		ディスコ	7.9	8.4	182,280	
淀川製鋼所	7.1	8.3	16,649		信和	—	3.3	3,313		日東工器	4	3.4	7,544	
丸一鋼管	20.5	21.9	62,196		東洋製罐グループHD	36.6	39.3	66,770		日進工具	—	1.8	3,564	
モリ工業	—	1.9	3,638		ホッカンホールディングス	20	3.1	4,733		パンチ工業	7.4	4.3	2,150	
大同特殊鋼	9.8	10.1	42,672		コロナ	—	3.4	3,583		富士ダイス	—	2.7	1,598	
日本高周波	8	2.2	954		横河ブリッジ HLDGS	11.3	11.5	18,768		豊和工業	4.9	3.4	2,645	
日本冶金工	54.3	51.2	11,315		駒井ハルテック	4.3	1.2	1,964		OKK	5.6	2.5	1,742	
山陽特殊製鋼	6.9	7.8	11,684		高田機工	—	0.6	1,504		石川製作所	2.4	1.5	2,134	
愛知製鋼	2.7	3.5	11,060		三和ホールディングス	55.7	63.8	81,089		東洋機械金属	9.7	4.4	2,521	
日立金属	61.4	66.5	81,396		文化シャッター	18.6	18.2	16,762		津田駒工業	—	1.2	1,593	
日本金属	2.8	1.5	1,239		三協立山	8.4	8.6	10,681		エンシュウ	—	1.6	1,833	
大太平洋金属	4	4.2	9,445		アルインコ	8.7	4.9	4,610		島精機製作所	7.4	8.5	21,573	
新日本電工	39.6	40	6,760		東洋シャッター	—	1.5	1,047		オプトラン	5.9	6.9	22,114	
日本鉄工所	4.3	3.1	4,724		LI X I Lグループ	84.8	91.2	172,732		NCホールディングス	—	2	946	
虹技	—	0.9	1,183		日本ファイルコン	13.5	4.7	2,368		イワキポンプ	—	2.6	2,589	
日本鑄鉄管	—	0.6	634		ノーリツ	12.2	12.8	16,793		フリュー	—	5	4,790	
三菱製鋼	5.2	4.6	5,405		長府製作所	5.9	6.3	15,756		ヤマシシフィルタ	10.4	10.8	8,434	
日亜鋼業	—	9	2,754		リンナイ	10.2	11	80,630		日阪製作所	10.1	7.6	6,802	
日本精線	1.7	0.9	2,313		ダイニチ工業	—	3.3	2,112		やまびこ	11.4	12	13,872	

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
平田機工	2.3	2.9	20,126	20,126	大同工業	—	3	2,499	2,499	イビデン	34.6	38.3	80,544	80,544
ペガサスミシン製造	—	5.8	2,900	2,900	木村化工機	—	5.2	2,100	2,100	コニカミノルタ	135.3	136.7	108,539	108,539
マルマエ	—	2.5	2,152	2,152	アネスト岩田	11.1	9.7	9,457	9,457	ブラザー工業	70.1	81.5	165,282	165,282
タツモ	—	2.9	3,187	3,187	ダイフク	30	34.4	194,360	194,360	ミネベアミツミ	108.3	115.9	213,024	213,024
ナプテスコ	31.5	36.4	123,578	123,578	サムコ	—	1.7	1,530	1,530	日立	1,399	281.1	1,142,671	1,142,671
三井海洋開発	6.3	6.6	17,344	17,344	加藤製作所	3.4	3.2	6,118	6,118	三菱電機	582.7	624.6	913,477	913,477
レオン自動車	6.2	6.1	9,888	9,888	油研工業	3.1	1	1,588	1,588	富士電機	177	40.5	136,687	136,687
S M C	18.4	18.3	832,284	832,284	タグノ	27.7	30.2	32,012	32,012	東洋電機製造	4.3	2.5	3,992	3,992
ヤマハモーターロボHLDGS	—	4.7	1,941	1,941	フジテック	17.4	22.7	31,144	31,144	安川電機	68.2	72.4	281,998	281,998
ホンカワミクロン	2.3	2.2	8,492	8,492	C K D	16.7	17.4	21,924	21,924	シンフォニアテクノロジー	41	8.7	10,657	10,657
ユニオンツール	2.9	2.3	7,532	7,532	キトー	5.2	4.7	7,322	7,322	明電舎	49	12.4	23,237	23,237
オイレス工業	7.8	8.7	14,415	14,415	平和	18	17.4	38,523	38,523	オリジン	3.6	1.7	2,378	2,378
日精エーエスピー	1.9	2.1	6,972	6,972	理想科学工業	6.2	5.5	9,229	9,229	山洋電気	2.9	3	14,040	14,040
サトーホールディングス	8.1	7.5	21,930	21,930	S A N K Y O	14	15.6	59,124	59,124	デンヨー	5.9	5.7	10,453	10,453
技研製作所	4.9	5.4	18,063	18,063	日本金銭機械	6.5	6.9	6,879	6,879	東芝テック	41	7.8	24,999	24,999
日本エアーテック	—	1.9	1,128	1,128	マースグループHLDGS	3.8	4	7,848	7,848	芝浦メカトロニクス	—	1.1	3,293	3,293
カワタ	—	1.7	1,635	1,635	福島工業	3.8	3.9	12,694	12,694	マブチモーター	15.5	17.3	70,670	70,670
日精樹脂工業	6.8	5.2	5,220	5,220	オーイズミ	—	2.6	1,183	1,183	日本電産	70.4	75.2	1,152,816	1,152,816
オカダアイオン	—	2.1	2,591	2,591	ダイコク電機	3.8	2.9	4,524	4,524	ユーエムシーエレクトロニクス	—	3.4	2,461	2,461
ワイエイシールディングス	—	2.5	1,732	1,732	竹内製作所	9.8	10.5	17,440	17,440	トレックス・セミコンダクター	—	2.8	3,603	3,603
小松製作所	282.1	282.8	701,909	701,909	アmano	18.1	17.9	58,801	58,801	東光高岳	4.2	3.2	3,712	3,712
住友重機械	32.8	35.7	117,810	117,810	J U K I	9.2	8.7	7,882	7,882	ダブル・スコープ	9.6	8.6	5,357	5,357
日立建機	27.2	25	66,025	66,025	サンデンホールディングス	8.3	7.7	4,658	4,658	宮越ホールディングス	—	2.3	2,594	2,594
日工	—	1.7	5,831	5,831	蛇の目ミシン	—	5.8	2,360	2,360	ダイヘン	33	6.8	21,590	21,590
巴工業	4.3	2.7	6,604	6,604	マックス	9	9.5	17,480	17,480	ヤーマン	9.2	9.1	6,233	6,233
井関農機	6.1	6.3	9,418	9,418	グローリー	16.8	17.4	54,375	54,375	J V Cケンウッド	49.1	47.8	14,770	14,770
T O W A	5.9	5.4	4,438	4,438	新晃工業	6.9	5.8	10,614	10,614	ミマキンエンジニアリング	—	5.6	2,990	2,990
丸山製作所	3.8	1.3	1,566	1,566	大和冷機工業	9	9	10,413	10,413	三井物産	3.6	2.3	5,759	5,759
北川鉄工所	3.9	2.8	5,572	5,572	セガサミーホールディングス	57.5	61.9	95,635	95,635	日新電機	13.4	14.6	18,556	18,556
ローツェ	3.4	2.7	6,671	6,671	日本ピストンリング	4.5	2.3	3,070	3,070	大崎電気	14.4	12.4	8,134	8,134
タカキタ	—	2.2	1,236	1,236	リケン	2.8	2.9	11,455	11,455	オムロン	61.5	66.4	387,112	387,112
クボタ	312.7	334.7	568,990	568,990	T P R	6.4	8.4	14,868	14,868	日東工業	10.6	10	21,200	21,200
荏原実業	—	1.6	3,257	3,257	ツバキ・ナカシマ	9.2	12.8	21,350	21,350	I D E C	8.1	8.4	17,110	17,110
三菱化工機	4.3	2.2	3,931	3,931	ホシザキ	17.2	18.3	152,256	152,256	正興電機製作所	—	1.4	1,107	1,107
月島機械	11.7	12.4	17,670	17,670	大豊工業	5.9	5.1	3,621	3,621	不二電機工業	—	0.7	858	858
帝国電機製作所	6.5	4.4	5,354	5,354	日本精工	118.3	128.4	121,851	121,851	ジーエス・ユアサコーポ	104	22.5	43,065	43,065
東京機械	—	2.4	888	888	N T N	128	134.6	42,533	42,533	サクサホールディングス	—	1.6	2,968	2,968
新東工業	13.3	14.8	14,430	14,430	ジェイテクト	60.2	59.9	77,390	77,390	メルコホールディングス	3.1	2.6	7,173	7,173
渋谷工業	5.6	5.4	15,222	15,222	不二越	5.5	5.8	27,492	27,492	テクノメディアカ	—	1.4	3,148	3,148
アイチコーポレーション	9.9	10.8	7,830	7,830	日本トムソン	21	18.6	8,872	8,872	日本電気	74.6	80.9	381,039	381,039
小森コーポレーション	13.7	15.8	18,264	18,264	T H K	36.5	36.3	104,181	104,181	富士通	601	60.2	531,024	531,024
鶴見製作所	5.5	4.9	10,339	10,339	ユーシン精機	6.5	4.8	4,881	4,881	沖電気	22.3	27.1	40,514	40,514
住友精密	24	1	3,070	3,070	前澤給装工業	—	2.4	4,800	4,800	岩崎通信機	—	2.9	2,366	2,366
日本ギア工業	—	1.7	834	834	イーグル工業	6.7	7.7	7,807	7,807	電気興業	4.1	3.3	10,395	10,395
酒井重工業	1.6	1.2	3,444	3,444	前澤工業	—	4.2	1,507	1,507	サンケン電気	36	7.3	15,921	15,921
荏原製作所	26	27.7	78,584	78,584	日本ピラー工業	7.3	6.3	8,019	8,019	ナカヨ	—	1.2	1,951	1,951
石井鉄工所	—	0.9	1,849	1,849	キッツ	25.3	25.4	18,694	18,694	アイホン	5.7	3.5	5,659	5,659
西島製作所	7.4	6.4	6,444	6,444	マキタ	76	76	248,900	248,900	ルネサスエレクトロニクス	61.9	297.4	197,176	197,176
北越工業	8.4	6.4	8,096	8,096	日立造船	42	49.6	17,508	17,508	セイコーエプソン	85.6	77.6	120,900	120,900
ダイキン工業	80	85.3	1,234,717	1,234,717	三菱重工業	96.8	104.7	459,318	459,318	ワコム	47.6	45.3	16,489	16,489
オルガノ	2.8	2.2	10,153	10,153	I H I	44.8	48	115,296	115,296	アルバック	13.5	12.5	56,187	56,187
トーヨーカネツ	3	2.4	4,646	4,646	スター精密	10.2	9.8	15,170	15,170	アクセル	—	2.6	1,630	1,630
栗田工業	31	33.8	98,527	98,527	電気機器 (13.9%)					E I Z O	5.5	5.7	21,546	21,546
椿本チエイン	33	8.2	28,331	28,331	日清紡ホールディングス	36.9	41.7	36,612	36,612	ジャパンディスプレイ	124.6	61.7	4,010	4,010

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千円		株数	千株	株数	千円		株数	千株	株数	千円
日本信号	16.2	15.9	19,588		コーセル	8.8	7.6	8,002		サノヤホールディングス	—	8.3	1,560	
京三製作所	16.7	13.4	5,252		イリソ電子工業	4.9	5.7	30,210		日本車輛	27	2.3	5,754	
能美防災	8.6	8.2	17,744		オプテックスグループ	10.9	10.3	16,799		三菱ロジスネクスト	7.9	10.3	10,629	
ホーチキ	5.4	4	6,132		千代田インテグレ	3.2	2.9	6,214		近畿車輛	—	1	1,308	
星和電機	—	3.3	1,692		アイ・オー・データ	—	2.3	2,051		日産自動車	688.4	736.8	525,854	
エレコム	5.8	5.9	25,281		レーザーテック	12.6	12.8	84,224		いすゞ自動車	169.6	197.5	246,183	
パナソニック	665.8	714.1	637,405		スタンレー電気	44.3	44.1	125,199		トヨタ自動車	710.4	695.9	5,124,607	
シャープ	58	62.1	77,252		岩崎電気	4.7	2.4	3,024		日野自動車	82.4	78	73,242	
アンリツ	43.3	40.2	86,912		ウシオ電機	32.3	36.3	55,212		三菱自動車工業	215.7	231.5	114,824	
富士通ゼネラル	18.2	19.1	34,208		岡谷電機	—	4.5	1,768		エフテック	6	4.4	3,119	
ソニー	391.7	419.2	2,672,400		ヘリオステクノH	8.3	5.8	3,277		レシップホールディングス	—	2.5	1,982	
TDK	30.7	32.7	312,285		エノモト	—	1.7	1,621		GMB	—	1.2	944	
帝国通信工業	6.9	2.7	3,088		日本セラミック	6.1	6.3	17,545		ファルテック	—	1.1	810	
タムラ製作所	24.7	24.1	14,050		遠藤照明	—	3.2	2,147		武蔵精密工業	6.6	15.2	21,690	
アルプスアルパイン	50.3	65.1	134,301		古河電池	7.5	4.5	2,758		日産車体	22.2	12.2	11,529	
池上通信機	48	2	2,196		双信電機	—	3	1,317		新明和工業	25.6	26.1	34,530	
パイオニア	118.6	—	—		山一電機	5.2	4.5	5,584		極東開発工業	11.5	12.4	16,516	
日本電波工業	12.8	5.7	2,559		図研	4.8	4.1	7,662		日信工業	11.6	11.4	17,122	
鈴木	—	3.3	2,154		日本電子	23	12.3	31,082		トピー工業	4.9	5.2	10,301	
日本トリム	1.7	1.2	5,622		カシオ	46.9	55.4	88,806		ティラド	2.6	2.3	4,245	
ローランドディー・ジー	3.6	3.4	6,895		ファナック	55.5	59.3	1,212,388		曙ブレーキ	34.9	—	—	
フオスター電機	7.7	7.1	13,312		日本シイエムケイ	11.7	15.9	9,428		タチエス	10.4	10.3	13,328	
クラリオン	35	—	—		エンプラス	2.9	2.8	9,786		NOK	28.7	33.6	56,078	
SMK	20	1.7	4,807		大真空	4.1	2.3	2,357		フタバ産業	18.7	17.4	13,224	
ヨコオ	5.2	4.5	13,171		ローム	26.2	29.9	256,841		K Y B	6	6.5	20,962	
ティアック	—	4.5	864		浜松ホトニクス	41.7	44.8	177,184		大同メタル工業	9.4	10.2	6,660	
ホシデン	15.1	18.3	19,947		三井ハイテック	8.5	6.9	11,605		プレス工業	33.1	30.9	14,708	
ヒロセ電機	9.4	8.9	118,192		新光電気工業	22.1	21	20,328		ミクニ	—	7.9	2,528	
日本航空電子	15	14.3	23,266		京セラ	95.7	95.2	645,932		太平洋工業	12.9	13.1	20,514	
T O A	8.5	6.7	8,770		太陽誘電	28.8	27.8	69,249		ケーヒン	13.3	14.3	22,908	
マクセルホールディングス	11.5	13.5	20,965		村田製作所	61.3	196.6	992,043		河西工業	8.1	7.7	6,460	
古野電気	8.3	8	7,784		ユージン	15.5	—	—		アイシン精機	48.2	51.4	182,727	
ユニテックホールディングス	23	1.8	3,430		双葉電子工業	9.2	9.9	13,612		マツダ	179.4	196	192,334	
アルパイン	13.9	—	—		北陸電気工業	5.4	2.3	2,357		今仙電機製作所	8.3	5.7	5,118	
スミダコーポレーション	6	4.8	5,040		ニチコン	18.9	19.7	19,542		本田技研	524.5	526.8	1,520,081	
アイコム	3.8	3.4	7,517		日本ケミコン	5	4.4	7,066		スズキ	116.2	114.3	492,061	
リオン	3.7	2.9	6,672		K O A	8.5	9.4	12,737		SUBARU	181	193.9	593,915	
本多通信工業	7.3	5.3	2,782		市光工業	10.4	9.4	7,830		安永	3.5	3	3,984	
船井電機	10	6.3	3,717		小糸製作所	35.2	37.4	203,082		ヤマハ発動機	82	81.4	157,590	
横河電機	58.2	62.5	125,562		ミツバ	11.4	11.5	7,440		ショーワ	15.9	14.7	22,755	
新電元工業	2.2	2.2	7,975		SCREENホールディングス	11.2	10.9	71,286		T B K	20.8	7.4	3,093	
アズビル	17.3	39.4	114,732		キャノン電子	4.6	6.5	11,914		エクセディ	6.7	8.5	18,096	
東亜ディーケーケー	—	3.1	2,669		キャノン	312.6	336.4	985,147		豊田合成	20.8	20.2	44,561	
日本光電工業	24.4	27.5	86,350		リコー	175.8	188.2	195,163		愛三工業	11.1	9.8	8,055	
チノー	—	2.2	3,042		象印マホービン	11.5	18.3	25,912		盟和産業	—	1	1,104	
共和電業	20.1	6.5	2,743		MUTOHホールディングス	—	0.9	1,480		日本プラスト	—	4.9	3,449	
日本電子材料	—	2.5	1,290		東京エレクトロン	39.1	41.6	864,448		ヨロズ	6.9	5.9	7,929	
堀場製作所	11.7	12.4	77,748		トヨタ紡織	16.6	21.8	33,223		エフ・シー・シー	9.8	11.2	24,124	
アドバンテスト	33.1	42.6	200,646		芦森工業	—	1.3	1,847		シマノ	23.6	23.4	381,420	
小野測器	—	2.6	1,375		ユニプレス	10.9	12.1	21,308		テイ・エス・テック	13.5	14.5	47,922	
エスベック	6.1	5.5	10,538		豊田自動織機	46.6	50.6	320,804		ジャムコ	3.2	3.1	4,836	
キーエンス	28.7	30.7	2,053,523		モリタホールディングス	9.7	10.9	19,532		精密機器 (2.2%)	—	—	—	
日置電機	3.5	3.3	11,797		三桜工業	11.7	8	4,800		テルモ	89.9	176.7	585,760	
シスメックス	45.6	48.7	357,068		デンソー	129.6	137.5	667,425		クリエートメディック	—	2.1	1,990	
日本マイクロニクス	11.2	10.9	9,537		東海理化電機	14.8	16.3	30,839		日機装	19.3	18.7	21,561	
メガチップス	5.2	4.9	8,491		三井E&SHD	21.1	21.7	20,463		島津製作所	70.2	80.4	227,532	
OBARA GROUP	3.3	3.2	11,904		川崎重工業	44.2	48.7	112,691		JMS	—	5.7	3,665	
澤藤電機	—	0.8	1,368		名村造船所	19.2	18.9	5,726		クボテック	—	1.3	565	
原田工業	—	2.5	2,087							長野計器	7.5	4.9	3,567	

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
パイ・テクノロジー	1.4	2.9	15,863		アシックス	57.6	51.6	88,029		ハマキョウレックス	4.6	4.8	17,664	
東京計器	5.2	4	3,632		ツツミ	—	2	4,200		サカイ引越センター	3.4	3.3	20,988	
愛知時計	—	0.8	3,264		小松ウオール工業	—	1.9	3,733		近鉄グループHLDGS	54.2	59.2	342,768	
インターアクション	—	3.4	7,112		ヤマハ	38.6	37.2	178,932		阪急阪神HLDGS	73.2	78.9	336,114	
オーバル	—	6.1	1,409		河合楽器	2.6	1.9	5,399		南海電鉄	26.2	26.5	77,300	
東京精密	10.2	11.3	36,329		クリナップ	9.7	5.8	3,248		京阪ホールディングス	24.6	26.3	127,818	
マニー	7.4	24.9	65,188		ビジョン	35.5	37.7	166,257		神戸電鉄	—	1.5	6,067	
ニコン	101.1	108.8	151,123		兼松サステック	—	0.4	724		名古屋鉄道	44.1	48.6	162,324	
トプコン	30.8	33.6	48,484		キングジム	9.5	5.2	4,518		山陽電鉄	5.1	4.6	10,695	
オリンパス	86.7	372.2	522,941		リンテック	13.2	14.8	31,642		日本通運	21.5	22.8	132,012	
理研計器	6.1	5.5	11,654		イトーキ	15.4	11.7	5,276		ヤマトホールディングス	97.7	103.8	197,116	
タムロン	5.9	5	11,340		任天堂	36.1	35.7	1,515,822		山九	14.2	16.4	91,184	
HOYA	117.7	125.7	1,112,445		三菱鉛筆	9.3	10.3	18,055		丸運	—	3.2	832	
シード	—	2.7	2,513		タカラスタンダード	12	12.9	23,632		丸全昭和運輸	22	4.8	15,432	
ノーリツ鋼機	6.7	4.9	8,854		ココロ	27.9	29.9	44,102		セコウグループHLDGS	34.3	32.6	27,873	
イー・アンド・ディ	8.2	5.7	4,012		ナカバヤシ	12.6	6.1	3,214		トナミホールディングス	1.7	1.4	7,322	
朝日インテック	—	53	145,909		グローブライド	3.5	3	8,766		ニッコンホールディングス	19.7	22.4	57,433	
シチズン時計	66.7	68.5	37,195		オカムラ	20.9	21.8	24,198		日石輸送	—	0.7	2,008	
リズム時計	5	2.1	2,272		美津濃	6.1	6.2	17,428		福山通運	8.6	7.6	30,134	
大研医器	—	5	2,675		電気・ガス業 (1.7%)					セイノーホールディングス	41.8	44.3	62,595	
メニコン	8.6	8.6	33,583		東京電力HD	467.3	498.4	274,618		エスライン	—	1.8	1,551	
シンシア	—	0.7	446		中部電力	179.5	191	316,487		神奈川中央交通	—	1.5	5,917	
松風	—	3	4,590		関西電力	239.2	254.8	353,917		日立物流	12.3	13	42,445	
セイコーHD	9.4	9.7	23,086		中国電力	78.9	86.3	123,926		丸和運輸機関	3.4	3.1	16,554	
ニプロ	40.4	43.3	54,731		北陸電力	56.7	61.4	45,743		C&Fロジホールディングス	—	6	7,566	
その他製品 (2.3%)					東北電力	136.4	146.4	164,553		九州旅客鉄道	46.1	49.6	167,896	
中本パックス	—	1.7	2,451		四国電力	52.6	56.3	61,367		SGホールディングス	52.9	55.9	153,780	
スノーピーク	—	2.8	3,654		九州電力	129	128.8	142,195		海運業 (0.2%)				
パラマウントベッドHD	6	7.2	29,268		北海道電力	58.4	58.5	34,047		日本郵船	45.2	49.5	92,367	
トランザクション	—	4	3,996		沖縄電力	12.4	11.6	20,358		商船311	34.2	35.1	102,070	
S H O - B I	14	1.8	694		電源開発	46	49.7	130,661		川崎汽船	24.9	18.3	24,174	
ニホンフラッシュ	3.6	2.7	6,655		エフオン	—	3	2,163		NSユニテッド海運	2.9	3.3	7,603	
前田工織	8.1	6.9	9,949		イーレックス	10.8	10.9	12,131		明治海運	—	6.3	1,965	
永大産業	—	8.3	2,888		レノバ	—	10.3	9,239		飯野海運	30.1	28.1	9,806	
アートネイチャー	10.7	6.6	4,402		東京瓦斯	123.2	120.1	339,582		共栄タンカー	—	0.5	693	
パンダイナムコHLDGS	60.5	64.6	412,148		大阪瓦斯	112	121.1	252,251		乾汽船	—	5.3	5,851	
アイフィスジャパン	—	1.5	1,105		東邦瓦斯	29.1	31	133,765		空運業 (0.5%)				
共立印刷	—	10.4	1,674		北海道瓦斯	34	3.3	5,148		日本航空	101.3	108.2	368,637	
S H O E I	3.2	3	14,460		広島ガス	—	12.8	4,377		ANAホールディングス	107.4	108	402,948	
フランスベッドHLDGS	—	8.8	9,398		西部瓦斯	7.2	7	17,080		パスコ	—	1.1	991	
パイロットコーポレーション	10.1	10.9	43,382		静岡ガス	20.2	17.7	16,496		倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
萩原工業	5.4	3.5	5,334		メタウォーター	3.4	3	11,250		トランコム	1.8	1.7	10,506	
トップパン・フォームズ	12.4	13.4	13,574		陸運業 (4.8%)					日新	5.2	5.1	8,078	
フジールインターナショナル	13	14	39,858		SBSホールディングス	—	5.4	8,656		三菱倉庫	18.9	20.5	56,313	
タカラトミー	25.6	26.2	31,544		東武鉄道	61.5	65.9	233,945		三井倉庫 HOLD	38	7.3	12,468	
廣済堂	—	5.8	4,158		相鉄ホールディングス	18.3	21.5	63,683		住友倉庫	37	21.7	31,573	
エステールホールディングス	—	1.6	1,008		東急	158.9	169.7	354,333		渋谷倉庫	5.7	3.2	6,313	
アーク	—	23.8	2,237		京浜急行	79.8	85.6	184,382		東陽倉庫	33.2	10.7	3,573	
タカノ	—	2.5	1,985		小田急電鉄	87.5	100.1	261,261		日本トランスシティ	18.4	13	6,487	
プロネクサス	—	5.4	6,301		京王電鉄	32.9	34.9	242,206		ケイヒン	—	1.1	1,375	
ホクシン	—	3.7	555		京成電鉄	41.2	46.8	204,516		中央倉庫	—	3.6	3,956	
ウッドワン	—	2.1	2,209		富士急行	8.6	8.5	40,800		川西倉庫	—	1.2	1,310	
大建工業	5.4	4.7	9,696		新京成電鉄	—	1.6	3,408		安田倉庫	—	4.8	4,550	
凸版印刷	157	92.8	177,155		東日本旅客鉄道	104.2	109.9	1,159,445		フェイス	—	1.1	795	
大日本印刷	75.3	88	244,112		西日本旅客鉄道	52.4	55.6	524,808		東洋埠頭	8	1.8	2,462	
共同印刷	3.3	1.9	5,302		東海旅客鉄道	52.5	55.9	1,257,750		宇徳	—	5	2,495	
N I S S H A	12.4	12.9	13,416		西武ホールディングス	74.4	77.4	148,143		上組	32.9	36.4	91,946	
光村印刷	—	0.5	899		鴻池運輸	8.6	9.9	16,760		サンリツ	—	1.4	910	
宝印刷	7.2	3	5,130		西日本鉄道	16	17.4	43,065		キムラユニティ	—	1.6	1,664	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
キューン流通システム	2.6	1.5	2,851	1,500	プロシップ	—	1.8	2,133	1,800	野村総合研究所	37	116.9	247.1	126.0
近鉄エクスプレス	10.3	11.2	17,281	11,200	ガンホー・オンライン・エンター	138	14.8	35,283	14,800	サイバネットシステム	—	4.4	2,807	4.4
東海運	—	3.4	972	3,400	GMOベイメントゲートウェイ	5	10.1	74,841	10,100	C Eホールディングス	—	1.8	1,773	1.8
エアィティイー	—	3.8	3,739	3,800	ザッパラス	—	3	1,065	3,000	日本システム技術	—	1	1,240	1
内外トランスライン	6.3	2.1	2,799	2,100	システムリサーチ	—	0.8	3,168	800	インテジホールディングス	9.6	7.7	7,361	7.7
日本コンセプト	—	1.9	2,458	1,900	インターネットインシアティブ	10.6	10	25,380	10,600	東邦システムサイエンス	—	1.8	1,953	1.8
情報・通信業 (8.6%)	—	—	—	—	さくらインターネット	13.9	7.3	4,511	7,300	ソースネクスト	—	23.8	10,852	23.8
NEC ネットエスアイ	6.1	6.8	20,434	6,800	ヴィンクス	—	1.7	2,045	1,700	インフォコム	—	6.7	16,817	6.7
クロスキャット	—	1.6	1,644	1,600	GMOクラウド	—	1.1	2,931	1,100	F I G	—	6.4	2,003	6.4
システナ	19.9	21.9	34,492	21,900	SRA ホールディングス	3.7	3.3	8,316	3,300	アルテリア・ネットワークス	—	6.8	9,445	6.8
デジタルアーツ	3.2	3.3	22,902	3,300	MINORIソリューションズ	—	1.2	2,287	1,200	ヒト・コムエージェンツHD	—	1.4	2,436	1.4
日鉄ソリューションズ	9.5	9.2	34,086	9,200	システムインテグレータ	5.8	1.7	1,128	1,700	フォーカスシステムズ	—	4.2	3,637	4.2
キューブシステム	9.2	3.3	2,692	3,300	朝日ネット	23	4.9	3,332	4,900	クレスコ	2.1	1.9	6,678	1.9
エイジア	—	1.2	1,462	1,200	e B A S E	—	3.7	3,681	3,700	フジ・メディア・HD	59.3	63.6	92,983	63.6
コア	4.8	2.6	3,476	2,600	アバント	—	2.2	4,459	2,200	オービック	18.5	21.3	261,990	21.3
ソリトンシステムズ	—	2.7	2,654	2,700	アドソル日進	—	2.2	4,851	2,200	ジャストシステム	10	8.7	34,104	8.7
ソフトクリエイトHD	5.7	2.7	4,708	2,700	フリービット	—	3.7	3,226	3,700	T D Cソフト	—	5.4	4,222	5.4
T I S	19.5	20.4	126,684	20,400	コムチュア	3.9	3.4	13,957	3,400	ヤフー	423.2	399.9	125,568	399.9
ネオス	—	2.5	1,930	2,500	サイバーコム	—	1.1	1,962	1,100	トレンドマイクロ	30.9	27.3	143,598	27.3
電算システム	6.3	2.3	6,796	2,300	アステリア	—	4.1	2,607	4,100	IDホールディングス	—	2.4	2,985	2.4
グリー	33.4	42.5	21,335	42,500	アイル	—	1	2,496	1,000	日本オラクル	9.7	12.4	120,156	12.4
コーエーテックモHD	9.6	12.5	28,862	12,500	マークラインズ	—	3.1	5,871	3,100	アルファシステムズ	—	1.9	5,390	1.9
三菱総合研究所	2.8	2.6	9,659	2,600	メディカル・データ・ビジ	—	4.7	5,856	4,700	フューチャー	9.7	7.4	13,845	7.4
ボルテージ	—	1.2	597	1,200	g u m i	9.5	7.9	5,293	7,900	CAC HOLDINGS	8.8	4	5,252	4
電算	—	0.7	1,428	700	ショーケース	—	1.3	947	1,300	ソフトバンク・テクノ	—	2.6	5,460	2.6
AGS	—	3.5	2,415	3,500	モバイルファクトリー	—	1.4	2,238	1,400	トーセ	—	1.7	1,416	1.7
ファインデックス	—	5.2	4,940	5,200	テラスカイ	—	1	1,807	1,000	オービックビジネスC	3.2	6.3	28,444	6.3
ブレインパッド	—	1.2	8,016	1,200	デジタル・インフォメーション	—	2.7	4,152	2,700	伊藤忠テクノソリューションズ	26.8	27.9	82,053	27.9
K L a b	10.9	11.8	12,944	11,800	PCIホールディングス	—	1.3	2,730	1,300	アイティフォー	10.3	7.5	6,465	7.5
ポルトウイン・ビットクル	5	8.2	8,405	8,200	パイプHD	—	1	1,330	1,000	東計電算	—	0.9	2,736	0.9
イブツクインシアティブ	—	1	1,826	1,000	アイビシー	—	1.1	1,179	1,100	エックスネット	—	1.1	1,090	1.1
ネクソン	146.2	173.9	251,285	173,900	ネオジャパン	—	1.2	1,160	1,200	大塚商会	31.6	33.2	139,606	33.2
アイスタイル	16.3	15.8	10,649	15,800	P R T I M E S	—	0.5	1,364	500	サイボウズ	15.4	7.2	7,545	7.2
エムアップ	—	2.1	4,733	2,100	ランドコンピュータ	—	0.9	984	900	ソフトブレーン	—	3.6	2,559	3.6
エイチーム	5.2	4.3	4,588	4,300	ダブルスタンダード	—	0.5	2,462	500	電通国際情報S	4.1	3.8	13,224	3.8
エニグモ	—	4.4	4,426	4,400	オーブンドア	—	3	6,705	3,000	デジタルガレージ	10.7	12	40,380	12
テクノスジャパン	10	5.2	2,698	5,200	マイネット	—	2	982	2,000	イーエムシステムズ	6.5	5	9,935	5
e n i s h	—	2.7	2,340	2,700	アカツキ	1.8	2.2	16,786	2,200	ウェザーニューズ	3.3	2.1	7,140	2.1
コロブラ	16.5	20.1	17,708	20,100	ベネフィットジャパン	—	0.4	639	400	C I J	13.2	4.6	3,831	4.6
オルトプラス	—	4.1	1,070	4,100	UBICOMホールディングス	—	1.1	1,640	1,100	東洋ビジネスエンジ	—	0.6	1,634	0.6
ブロードリーフ	31.2	30.4	18,088	30,400	LINE	18.2	14.1	56,541	14,100	日本エンタープライズ	—	6.1	1,079	6.1
クロス・マーケティングG	—	2.6	925	2,600	カナミックネットワーク	—	3.7	2,109	3,700	WOWOW	3.2	2.9	7,772	2.9
デジタルハーツHLDGS	5.1	2.8	2,704	2,800	ノムラシステムコーポレーション	—	1.4	670	1,400	スカラ	—	4.3	4,368	4.3
システム情報	—	3.1	3,158	3,100	チェンジ	—	1.2	2,341	1,200	インテリジェントウェイブ	—	2.3	1,876	2.3
メディアドゥHLDGS	3	2.2	7,788	2,200	シンクロ・フード	—	2.6	1,352	2,600	IMAGICA GROUP	—	5.1	2,616	5.1
じげん	—	8.7	5,106	8,700	オークネット	—	3.4	4,668	3,400	ネットワンシステムズ	24.4	21.7	62,018	21.7
ブイキューブ	—	3.3	1,425	3,300	セグエグループ	—	0.2	275	300	システムソフト	—	14.5	1,580	14.5
エンカレッジ・テクノロジ	—	0.8	600	800	イトレッド	—	0.7	1,145	800	アルゴグラフィックス	3.3	5.2	13,717	5.2
サイバーリンクス	—	0.9	990	900	AOI TYO HOLDINGS	7.9	6.2	3,949	6,200	マーベラス	10	9.4	7,501	9.4
ディー・エル・イー	—	4.3	769	4,300	マクロミル	8.2	10.9	10,017	10,900	エイバックス	11	10.5	13,807	10.5
フィックスターズ	—	6.5	9,386	6,500	ビーグリー	—	1.3	1,201	1,300	日本ユニシス	17	19.1	66,181	19.1
CARTA HOLDINGS	—	3	3,090	3,000	オロ	—	1.6	4,324	1,600	兼松エレクトロニクス	3.9	3.3	10,230	3.3
オブティム	—	2.7	7,630	2,700	テモナ	—	0.8	448	800	東京放送HD	31.3	40.7	73,219	40.7
セレス	—	2	2,594	2,000	ニーズウェル	—	0.4	298	200	日本テレビHLD	52	56.3	80,790	56.3
ティーガイア	6.1	4.4	9,803	4,400	サインポスト	—	0.9	2,079	900	朝日放送グループHD	—	6	4,440	6
セック	—	1	3,105	1,000	ソルクシーズ	—	2.6	2,540	2,600	テレビ朝日HD	15.3	16.9	30,132	16.9
日本アジアグループ	—	6.5	2,145	6,500	フェイス	—	2.4	1,881	2,400	スカパーJSATHD	44.2	40.5	18,022	40.5
豆蔵ホールディングス	7.9	4.2	6,917	4,200	プロトコーポレーション	—	5.5	6,501	5,500	テレビ東京HD	5.4	5	11,305	5
テクマトリックス	—	4.3	9,601	4,300	ハイマックス	—	0.7	1,295	700	日本BS放送	5.9	2	2,150	2

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ビジョン	—	1.9	9,215	千円	ラサ商事	—	3.3	2,801	千円	マルカ	3.9	2.2	4,492	千円
スマートバリュー	—	1.8	1,285		ラクーンホールディングス	—	3	1,884		I DOM	21	20.8	9,484	
USEN-NEXT HLDGS	—	2.3	1,867		アルコニック	7.4	6.5	7,988		日本エム・ディ・エム	—	3.6	6,159	
ワイヤレスゲート	6.6	2.7	1,773		神戸物産	4.5	10.6	53,000		進和	4.4	3.6	7,941	
コネクシオ	4.7	4.4	6,261		あいホールディングス	9.6	8.8	15,840		エスケイジャパン	—	1.5	615	
日本通信	65.2	53.8	11,029		ディーブイエックス	5.7	2.4	2,080		ダイترون	4.1	2.6	3,424	
クロップス	—	1.1	669		ダイワボウHD	5.1	5.6	24,332		シークス	7.4	7.8	11,723	
日本電信電話	411	419.2	2,209,603		マクニカ・富士エレHLDGS	11	17.1	24,931		田中商事	—	2.1	1,360	
KDDI	505.4	502.4	1,440,380		ラクト・ジャパン	—	2.3	8,636		オーハシテクニカ	—	3.5	4,928	
ソフトバンク	—	649.9	994,347		パイタルK S K HD	10.7	11.5	12,489		白銅	—	2	2,768	
光通信	7	7.2	175,896		八洲電機	—	4.9	4,444		伊藤忠	422.7	430.1	990,090	
NTTドコモ	411.6	388	1,082,132		メディアスホールディングス	—	3.5	2,537		丸紅	472.9	606.5	456,815	
エムティーアイ	12.4	6	4,404		レスターホールディングス	4.1	6.8	11,954		高島	4.2	1	1,606	
GMOインターネット	22.1	24.2	44,019		ジューテックHD	—	1.4	1,372		長瀬産業	32.3	34.5	54,303	
ファイバーゲート	—	1.2	1,749		大光	—	2.6	1,762		蝶理	4.3	3.9	6,735	
アйдマーケティングコミュ	—	1.3	728		OCHIホールディングス	—	1.8	2,295		豊田通商	62.8	68.7	250,411	
KADOKAWA	17.4	17.9	27,780		TOKAIホールディングス	31.6	32.5	33,540		三共生興	—	10.5	5,523	
学研ホールディングス	—	2.1	11,550		黒谷	—	1.4	609		兼松	24.5	24.6	30,430	
ゼンリン	11	12.3	23,222		Cominix	—	1.1	900		ツカモトコーポレーション	6.1	1.1	1,168	
昭文社	—	2.7	1,058		三洋貿易	3.9	3.1	7,114		三井物産	474	506.7	931,567	
インプレスホールディングス	—	4.9	705		ビューティガレージ	—	1	1,930		日本紙パルプ	2.7	3.5	13,877	
アイネット	—	3.5	4,837		ウイン・パートナーズ	5.4	4	4,708		日立ハイテクノロジーズ	19.8	18.7	117,249	
松竹	3.8	4.1	55,555		ミタチ産業	—	1.8	1,225		カメイ	7.2	8	9,048	
東宝	37.8	40.3	189,611		シップヘルスケアHD	11.6	12.8	60,160		東都水産	—	0.9	2,367	
東映	2.2	2.6	39,806		明治電機工業	—	1.9	2,597		OUGホールディングス	—	1	2,780	
NTTデータ	181.1	163.2	232,396		デリカフーズHLDGS	—	2.2	1,610		スターゼン	2.6	2.3	10,051	
ビー・シー・エー	—	0.8	3,076		スターティアホールディングス	—	1.2	643		山善	22.1	24	23,448	
ビジネスB太田昭和	—	1.1	2,788		コマダホールディングス	11.8	14.3	29,129		椿本興業	—	1.4	5,159	
DTS	6.3	13.7	31,551		富士興産	—	2.4	1,730		住友商事	361.5	363.8	638,650	
スクウェア・エニックス・HD	27	28.5	130,957		協栄産業	—	0.7	945		内田洋行	3.3	2.6	9,971	
シーイーシー	8	6.6	13,695		小野建	6	5.5	7,573		三菱商事	404.1	431.6	1,201,142	
カプコン	25.4	26.3	73,192		南陽	—	1.3	2,086		第一実業	3.2	2.8	8,414	
アイ・エス・ビー	—	1.2	1,773		佐鳥電機	7.5	4.5	3,532		キャノンマーケティングJPN	16.6	17.6	40,145	
ジャストテック	8.1	3.6	4,125		エコートレーディング	—	1.5	793		西華産業	4.2	3.5	4,770	
SCSK	13.7	16.2	84,888		伯東	4.3	4.2	5,027		佐藤商事	—	5.5	4,768	
日本システムウエア	—	2	4,968		コンドーテック	10.4	4.7	4,418		菱洋エレクトロ	6	6.2	11,643	
アイネス	11.1	7.8	8,876		中山福	—	3.5	1,890		東京産業	—	6.1	3,117	
TKC	5.3	5.2	24,336		ナガイレーベン	8.4	8.9	20,434		ユアサ商事	5.4	6.3	19,939	
富士ソフト	9.3	7.9	36,656		三菱食品	5.8	6.7	18,371		神鋼商事	2	1.4	3,388	
NSD	9.9	10.1	31,916		松田産業	5.5	4.5	6,682		小林産業	—	3.7	1,054	
コナミホールディングス	23.1	25	125,500		第一興商	8.4	9.1	45,500		阪和興業	10.5	10.7	33,116	
福井コンピュータHLDGS	—	2	4,806		メディパルHD	56.2	66.3	163,694		正栄食品	3.4	4	13,260	
JBCCホールディングス	9.6	4.8	7,497		SPK	—	1.3	3,273		カナデン	7.1	5.6	7,627	
ミロク情報サービス	5.7	6.1	18,239		萩原電気HLDGS	2.9	2.3	6,189		菱電商事	5.3	4.9	8,080	
ソフトバンクグループ	259.9	486.3	2,244,760		アズワン	4.7	4.4	39,468		フルサト工業	—	3.4	4,991	
卸売業 (4.9%)					スズデン	—	2.1	2,950		岩谷産業	12.5	13.6	48,892	
ハウスイ	—	0.5	416		尾家産業	—	2	2,736		すてきなグループ	8.1	2.5	1,852	
高千穂交易	—	2.4	2,692		シモジマ	—	3.8	4,320		昭光通商	—	2.1	1,327	
伊藤忠食品	—	1.5	6,615		ドウシシャ	6.5	5.8	10,324		ニチモウ	—	1	1,823	
エレマテック	2.9	5.7	5,962		小津産業	5.5	1.4	2,602		極東貿易	19	1.9	3,473	
JALUX	2.5	1.7	4,117		高速	—	3.7	4,902		イフキ	13.3	8.1	4,001	
あらた	3.1	4.5	17,662		たけびし	—	2.1	2,866		三菱石油	14.6	16.5	18,414	
トーメンデバイス	—	0.9	2,200		リックス	—	1.4	2,161		稲畑産業	13.7	14.8	19,920	
東京エレクトロンデバイス	3.6	2.2	4,620		丸文	7	5.4	3,072		GS Iクレオス	—	1.6	1,665	
フィールズ	5.7	5.4	2,829		ハビネット	5.3	5.1	6,665		明和産業	—	5.7	3,562	
双日	340.9	340	119,000		橋本総業HLDGS	—	1.2	1,920		クワザワ	—	2.2	1,179	
アルフレッサホールディングス	63.4	68.3	172,252		日本ライフライン	16.8	18.2	33,979		ワキタ	12.9	13.1	14,658	
横浜冷凍	16.4	17.3	18,095		タカショー	—	3	1,374		東邦ホールディングス	15.7	18.2	46,956	
神栄	—	0.8	604		エクセル	3.5	2.3	2,879		サンゲツ	16.7	18.1	37,503	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ミツウロコグループ	8.7	8.2	8,347	8,347	バルグループ HLDGS	3.4	3.1	10,354	10,354	葉王堂	2.8	—	—	—
シナネンホールディングス	2.4	2.5	4,337	4,337	エディオン	22.6	26.1	26,961	26,961	グリエイト・レストランツ・ホール	16.5	16.6	29,564	29,564
伊藤忠エネクス	10.4	13.5	11,502	11,502	サーラコーポレーション	13.7	12.5	7,737	7,737	ツルハホールディングス	12.6	13.4	156,780	156,780
サンリオ	16	19	40,660	40,660	ワッツ	7.2	2.8	1,747	1,747	サンマルクホールディングス	4.1	4.9	12,068	12,068
サンワテクノス	5.4	3.7	3,059	3,059	ハローズ	3.6	2.3	5,285	5,285	フェリシモ	—	1.4	1,432	1,432
リョーサン	6.2	6.8	18,734	18,734	フジオフードシステム	—	2.6	7,397	7,397	トリドールホールディングス	7.6	7.6	19,782	19,782
新光商事	7.3	5.8	10,904	10,904	あみやき亭	2.2	1.3	4,524	4,524	TOKYO BASE	7.2	5.6	4,877	4,877
トーヨー	4.5	2.8	5,104	5,104	ひらまつ	16.2	12.4	4,439	4,439	ウイルプラス HLDGS	—	0.9	687	687
三信電気	5.9	4.2	6,531	6,531	大黒天物産	1.9	1.5	5,130	5,130	ジャパンミート	—	3.1	7,068	7,068
東陽テクニカ	11.5	7.1	7,753	7,753	ハニーズホールディングス	10	5.4	7,862	7,862	サツドラホールディングス	—	0.9	1,594	1,594
モスフード サービス	7.2	8.1	20,379	20,379	ファーマライズ HD	—	1.4	800	800	デファクトスタンダード	—	0.5	157	157
加賀電子	5.2	6.1	12,480	12,480	アルペン	4.4	4.7	8,022	8,022	アレンザホールディングス	6.2	3.3	2,623	2,623
ソーダニツカ	—	6.4	3,628	3,628	ハブ	—	2	2,542	2,542	串カツ田中 HLDGS	—	0.9	1,923	1,923
立花エレクトック	—	4.5	7,623	7,623	クオールホールディングス	6.9	9.1	13,686	13,686	パロックジャパン	—	5	5,030	5,030
フローバル	—	2.7	2,548	2,548	ジンスホールディングス	4.1	3.3	21,417	21,417	クスリのアオキ HLDGS	4.7	6.1	50,203	50,203
PALTA C	8.3	11.1	60,606	60,606	ビックカメラ	31.7	36.5	40,770	40,770	カの源 HD	—	2.3	1,920	1,920
三谷産業	—	7.2	2,095	2,095	DCMホールディングス	27.6	33.2	35,391	35,391	スノーグローバル HLDGS	6.7	6.8	48,076	48,076
太平洋興発	—	2.4	1,864	1,864	ペッパーフードサービス	4.8	4.9	7,697	7,697	L I X I L ビバ	7.7	5.2	8,751	8,751
西本 WISMETTAC HD	—	1.1	3,910	3,910	MonotaRO	18.7	43.7	128,652	128,652	メディカシステムネットワーク	—	6.6	3,544	3,544
ヤマタヘルスケア HLDGS	8.1	0.5	627	627	東京一番フーズ	—	1.6	1,001	1,001	総合メディカル	5.5	—	—	—
国際紙バルブ商事	—	14.4	4,521	4,521	DDホールディングス	—	2.7	4,050	4,050	はるやま HLDGS	—	2.9	2,392	2,392
ヤマタネ	5.9	3.1	4,309	4,309	きちりホールディングス	—	1.6	1,214	1,214	ノジマ	10.6	10.9	19,445	19,445
丸紅建材リース	—	0.6	1,032	1,032	アークランドサービス HD	4.8	4.5	8,869	8,869	カップ・クリエイト	—	8.7	12,858	12,858
日鉄物産	4.3	4.4	19,118	19,118	J. フロントリテイリング	67.4	78.7	100,578	100,578	ライトオン	7.8	4.7	3,214	3,214
泉州電業	—	1.9	5,242	5,242	ドトール・日レス HD	9.4	10.8	23,263	23,263	ジーンズメイト	—	1.9	596	596
トラスコ中山	12.5	12.8	32,512	32,512	マツモトキヨシ HLDGS	24	25.4	102,235	102,235	良品計画	7.7	87.2	181,986	181,986
オートバックスセブン	20.7	24.5	44,859	44,859	ブロンコビリー	3.8	3.2	7,516	7,516	三城ホールディングス	—	7.7	2,363	2,363
モリト	—	4.5	3,586	3,586	ZOZO	57.1	66.5	166,250	166,250	アドヴァン	7.4	9.4	11,214	11,214
加藤産業	9	9.6	32,688	32,688	トレジャー・ファクトリー	—	1.8	2,448	2,448	アルピス	2.5	2.3	5,618	5,618
北恵	—	1.2	1,160	1,160	物語コーポレーション	1.9	1.5	15,405	15,405	コナカ	—	7.3	3,190	3,190
イノテック	6.5	3.7	3,270	3,270	ココカラファイン	6.1	6.9	41,262	41,262	ハウス ローゼ	—	0.8	1,304	1,304
イエロハット	5.4	11.6	19,058	19,058	三越伊勢丹 HD	107.5	115.2	99,072	99,072	G-7ホールディングス	—	1.8	5,670	5,670
JKホールディングス	—	5.6	2,872	2,872	Hamee	—	1.9	1,888	1,888	イオン北海道	—	6	4,512	4,512
日伝	4.5	5.1	10,628	10,628	ウエルシア HD	15.7	16.3	88,998	88,998	ゴジマ	13.1	10.6	5,066	5,066
北沢産業	17.1	4.6	1,209	1,209	クリエイト S DH	8.7	9.1	22,904	22,904	ヒマラヤ	—	2.2	1,793	1,793
杉本商事	—	3.3	6,893	6,893	丸善 CHI HD	—	7.2	2,757	2,757	コーナン商事	8.8	8.1	19,715	19,715
因幡電機産業	7.1	8.7	42,717	42,717	ミサワ	—	1.1	556	556	エコス	—	2.3	3,797	3,797
バイテックホールディングス	3.4	—	—	—	ディーライフ	—	0.8	676	676	ワタミ	8.2	8.1	11,834	11,834
東テック	—	2	4,136	4,136	エー・ピーカンパニー	—	1.1	588	588	マルシェ	—	1.5	1,170	1,170
ミスミグループ本社	67.1	77.1	198,609	198,609	チムニー	—	1.9	4,755	4,755	パンパシフィック HD	37.6	147.4	258,392	258,392
アルテック	—	4.5	922	922	シュッピン	—	4.2	4,468	4,468	西松屋チェーン	12.9	13.6	13,069	13,069
タキヒヨー	—	1.9	3,421	3,421	ネクステージ	—	8.8	9,952	9,952	ゼンショーホールディングス	30.5	29.9	74,779	74,779
蔵王産業	—	1	1,418	1,418	ジョイフル本田	16.5	18	25,650	25,650	幸楽苑ホールディングス	5.9	3.9	9,523	9,523
スズケン	26	28	166,880	166,880	鳥貴族	2.9	2	4,584	4,584	ハークスレイ	—	1.3	1,358	1,358
ジェコス	6	4.2	3,708	3,708	キリン堂ホールディングス	—	2.4	5,042	5,042	サイゼリヤ	9.4	10.2	27,703	27,703
グローセル	—	5.6	2,408	2,408	ホットランド	5.8	3.7	4,266	4,266	V Tホールディングス	21.2	27.8	12,760	12,760
小売業 (4.8%)					すかいらく HD	53	69	132,135	132,135	魚力	—	1.7	2,720	2,720
ローソン	14.3	15.6	89,232	89,232	SFPホールディングス	—	2.6	5,642	5,642	ポプラ	10.4	1.6	795	795
サンエー	4.4	4.6	22,287	22,287	綿半ホールディングス	3.1	2.3	4,728	4,728	フジ・コーポレーション	—	1.6	3,472	3,472
カワチ薬品	4.8	4.8	10,348	10,348	ヨシックス	—	1	3,125	3,125	ユナイテッドアローズ	7.4	7.1	21,513	21,513
エービーシー・マート	10.4	9.6	65,760	65,760	ユナイテッド・スーパーマケ	20.2	17.8	17,675	17,675	ハイデイ日高	8	8.9	19,232	19,232
ハードオフコーポレーション	8.3	2.4	1,725	1,725	ゴルフダイジェスト・オン	—	2.5	1,730	1,730	京都きもの友禅	—	4	1,368	1,368
アスクル	5.1	6.4	17,990	17,990	B E E N O S	—	2.2	2,721	2,721	コロワイド	19.8	20.5	44,259	44,259
ゲオホールディングス	10.9	9.4	12,502	12,502	あさひ	6.4	5.1	6,349	6,349	ピーシーデポコーポ	11.2	8.2	4,034	4,034
アダストリア	9.3	8.5	20,298	20,298	日本調剤	2.3	2.2	8,547	8,547	壺番屋	4.3	4.3	21,629	21,629
ジーフット	—	3.8	2,386	2,386	コスモス薬品	3	2.7	58,320	58,320	トップカルチャー	—	2.2	781	781
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	—	0.8	544	544	トーエール	—	3	2,130	2,130	P L A N T	—	1.6	1,177	1,177
くら寿司	3.6	3.2	14,512	14,512	オンリー	—	1	813	813	スギホールディングス	12.5	13.5	78,300	78,300
キャンドウ	—	2.9	4,843	4,843	セブン&アイ HLDGS	241.3	257.8	1,077,088	1,077,088	葉王堂ホールディングス	—	2.7	7,155	7,155

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
ヴィア・ホールディングス	13.4	7.6	5,221		ブレナス	6.3	6.9	12,523		南都銀行	6	9.6	23,913	
スクロール	16.6	9.5	3,230		ミニストップ	4.3	4.6	6,536		百五銀行	50.7	55.6	19,626	
ヨドシホールディングス	6	6.8	17,938		アークス	10.6	11.5	26,220		京都銀行	21.6	22.1	95,914	
ファミリーマート	18.7	68.8	185,828		パローホールディングス	13.2	13.3	24,937		紀陽銀行	20.6	21.8	35,010	
木曽路	7.4	7.6	21,120		藤久	—	0.5	371		ほくほくフィナンシャルG	34.9	41.1	43,155	
SRSホールディングス	—	7.3	7,774		ペルル	2.8	3	15,900		広島銀行	77.8	91	49,686	
千趣会	14.4	11.2	3,472		大庄	—	3.3	5,316		山陰合同銀行	32.9	36.6	24,339	
タカキュー	35.6	4.8	840		ファーストリテイリング	7.7	8.2	534,804		中国銀行	35.2	53.1	53,365	
ケーヨー	12.9	11.4	5,825		サンドラッグ	21.4	23.2	79,576		鳥取銀行	—	2.1	3,049	
上新電機	7	7.3	15,841		サクスポールホールディング	7.1	5.2	4,752		伊予銀行	75.8	81.6	46,430	
日本瓦斯	11.1	9.7	28,818		ヤマザワ	—	1.3	2,135		百十四銀行	57	6.6	14,546	
ロイヤルホールディングス	10.4	10.8	29,052		やまや	—	1	2,325		四国銀行	9.3	8.8	8,905	
東天紅	—	0.5	614		ペルーナ	14.5	15.1	10,887		阿波銀行	43	9.4	22,221	
いなげや	6.7	6.9	11,240		銀行業 (5.9%)					大分銀行	3.3	3.8	11,476	
島忠	13	13	34,437		島根銀行	—	1.4	953		宮崎銀行	4.1	4.1	10,233	
チヨダ	6.9	6.5	11,141		じもとホールディングス	67.9	42.1	4,252		佐賀銀行	4.2	3.8	5,905	
ライフコーポレーション	4	4.7	10,556		めぶきフィナンシャルG	294	319.6	85,652		十八銀行	42	—	—	
リンガーハット	7.9	7.6	19,106		東京きらぼしFG	7.8	8.4	12,020		沖縄銀行	5.4	5.6	19,152	
Mr Max HD	10.7	8.4	3,838		九州フィナンシャルG	90.1	101.2	45,135		琉球銀行	13.4	14.2	16,287	
テニアライド	—	5.6	2,536		ゆうちょ銀行	161.8	174.3	187,023		セブン銀行	214	205.9	61,358	
AOKIホールディングス	11.1	12.3	13,616		富山第一銀行	21.3	14.8	4,736		みずほフィナンシャルG	7,834.1	8,369.9	1,410,328	
オークワ	10	8.8	10,859		コンコルディア・フィナンシャル	344.9	386.4	162,288		高知銀行	11.9	2.3	1,842	
コメリ	8.2	9.5	21,413		西日本フィナンシャルHD	35.1	38.9	28,513		山口フィナンシャルG	68.7	76.8	58,752	
青山商事	10.2	10.8	21,546		関西みらいFG	26.5	28.8	21,225		長野銀行	—	2	3,348	
しまむら	6.8	7.2	61,632		33FG	5	5.3	9,460		名古屋銀行	4.3	5	15,800	
はせがわ	—	3.1	1,261		第四北越フィナンシャルG	—	10.7	28,847		北洋銀行	82.7	93.2	21,529	
高島屋	43.9	48.3	61,872		新生銀行	46.3	45.3	70,985		愛知銀行	2	2.2	8,074	
松屋	12.8	12.4	10,403		あおぞら銀行	34.1	34.5	94,392		中京銀行	3.2	2.5	5,650	
Eイチ・ツアー・オリテイリング	25.9	31.6	39,278		三菱UFJフィナンシャルG	4,012.9	4,240.3	2,396,193		大光銀行	5	2.1	3,578	
近鉄百貨店	—	2.3	7,360		リそなホールディングス	634.4	676	322,452		愛媛銀行	9.2	8.6	9,718	
パルコ	—	5.9	7,658		三井住友トラストHD	113	121.1	486,337		トマト銀行	9.4	2.4	2,613	
丸井グループ	53.7	52.1	121,028		三井住友フィナンシャルG	431.8	434.1	1,643,502		京葉銀行	40	26.1	16,860	
アクシアルリテイリング	5	5.1	21,369		第四銀行	6.5	—	—		栃木銀行	32.2	32.3	6,266	
井筒屋	—	3.3	749		北越銀行	5.9	—	—		北日本銀行	4.3	1.9	3,496	
イオン	223.1	236.7	471,861		千葉銀行	202.6	211.9	119,723		東和銀行	12.1	10.9	9,014	
イズミ	10.5	12.5	54,687		群馬銀行	107.2	123.3	44,264		福島銀行	18	5.4	1,215	
平和堂	11.7	12.5	25,975		武蔵野銀行	8.1	9.2	17,434		大東銀行	10.8	3	1,770	
フジ	7.2	7.4	14,296		千葉興業銀行	23.7	17.1	5,232		トモニホールディングス	46.4	47.5	16,530	
ヤオコー	6.7	7	34,650		筑波銀行	39.2	25.9	4,817		フィデアホール	71.5	60.4	7,127	
ゼビオホールディングス	7	7.4	8,998		七七七銀行	16.8	19.3	32,173		池田泉州HD	57.2	65.9	12,982	
ケーズホールディングス	51.2	64	75,392		青森銀行	4.6	4.8	13,003		証券・商品先物取引業 (0.8%)				
OLYMPIC グループ	—	3.6	2,235		秋田銀行	4	4	8,492		FPG	20.9	19.4	22,271	
日産東京販売HD	—	9	2,592		山形銀行	6.5	6.9	10,419		マキアインベストメント	—	2.6	1,934	
GENKY DRUGSTORES	2.5	3	6,843		岩手銀行	4	4.3	10,965		SBIホールディングス	66.1	73.4	183,426	
総合メディカルHD	—	5.4	9,666		東邦銀行	49.8	55.3	14,488		日本アジア投資	—	5.2	1,575	
ブックオフGHD	—	3.2	3,980		東北銀行	10.4	3.2	3,392		ジャフコ	8.3	10.1	41,511	
アインホールディングス	7.8	8.3	51,543		みちのく銀行	—	4	6,608		大和証券G本社	489	494.3	251,351	
元氣寿司	2.4	1.7	4,936		ふくおかフィナンシャルG	236	54.3	115,278		野村ホールディングス	983.7	1,084	514,574	
ヤマダ電機	193.6	187.6	97,927		静岡銀行	140.3	152.5	127,337		岡三証券グループ	46	52.6	20,251	
アークランドサカモト	10	10.4	13,457		十六銀行	6.8	8.3	19,413		丸三証券	20.5	18.4	9,715	
ニトリホールディングス	23	26.6	423,871		スルガ銀行	59.6	60.5	26,741		東洋証券	38	22.4	4,099	
グルメ軒屋	—	4.4	5,288		八十二銀行	94.3	148.8	65,472		東海東京HD	62.5	71	22,720	
愛眼	—	5	1,260		山梨中央銀行	37	7.5	8,085		光世証券	—	1.5	912	
ケーヨーホールディングス	—	3.1	2,693		大垣共立銀行	8.1	13	31,369		水戸証券	25.6	18	3,834	
吉野家ホールディングス	20.2	21.5	48,353		福井銀行	5.4	5.3	7,944		いちよし証券	13.7	12.3	8,646	
松屋フーズHLDGS	3	3	11,745		北國銀行	6.4	6.4	16,480		松井証券	29.2	30.2	28,478	
サガミホールディングス	10.6	8.3	11,570		清水銀行	4.1	2.6	4,950		だいちこう証券ビジ	—	2.5	1,377	
関西スーパーマーケット	5.8	4.6	5,216		富山銀行	—	1.2	2,914		マネックスG	63.4	56.9	18,777	
王将フードサービス	4.5	4.5	32,265		滋賀銀行	46	12.4	30,913		カブドットコム証券	39.4	—	—	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
極東証券	8.2	8.3	7,586	7,586	フージャースHD	17.4	13.4	8,549	8,549	中広	—	0.5	302	302
岩井コスモホールディング	8	6.2	7,142	7,142	オープンハウス	10	8.9	47,615	47,615	アイティメディア	—	1.1	752	752
藍澤證券	14	11	8,239	8,239	東急不動産HD	138	165.8	113,075	113,075	タケエイ	9.1	6.2	6,119	6,119
マネーパートナーズGP	—	7.3	1,978	1,978	飯田GHD	47.3	51.3	93,622	93,622	E・Jホールディングス	—	0.7	884	884
スパークス・グループ	—	24.4	6,124	6,124	イーランド	—	0.9	634	634	トラスト・テック	3.2	6.6	8,441	8,441
小林洋行	—	1.9	467	467	ビーロット	—	1.4	2,448	2,448	コソダカホールディングス	16.2	14.4	23,097	23,097
保険業 (2.3%)					ファーストブラザーズ	—	1.4	1,540	1,540	アルトナー	—	1.4	1,047	1,047
かんぽ生命保険	21.5	21.9	36,463	36,463	ハウスドゥ	—	3.4	5,239	5,239	パソナグループ	6.2	7.3	11,446	11,446
SOMPOホールディングス	113	108.6	503,795	503,795	シアールイー	—	1.5	1,522	1,522	CDS	7	1.5	1,984	1,984
アニコムホールディングス	4.4	5.1	20,680	20,680	プロパティエージェン	—	0.8	943	943	リングアンドモチベーション	12.2	13.2	8,025	8,025
MS&AD	149.6	161	579,600	579,600	ケイアスター不動産	—	1.7	3,507	3,507	GCA	9.6	7.1	5,339	5,339
SONY F H	47.7	50.6	120,832	120,832	アグレ都市デザイン	—	1	443	443	エス・エム・エス	22.9	22	60,060	60,060
第一生命HLDGS	325.6	348.6	567,520	567,520	ジェイ・エス・ビー	—	0.7	3,167	3,167	サニーサイドアップ	—	1.3	1,211	1,211
東京海上HD	216.9	220.3	1,299,549	1,299,549	テンポイノベーション	—	0.7	1,162	1,162	パソルホールディングス	52.5	59.7	136,235	136,235
T&Dホールディングス	176.7	190.6	219,666	219,666	グローバルリンクマネジメント	—	0.9	531	531	リニカル	4.8	3.4	3,423	3,423
アドバンスクリエイト	4.6	1.4	2,755	2,755	パーク24	34	33.1	78,711	78,711	クックパッド	21.9	19.1	6,073	6,073
その他金融業 (1.2%)					パラカ	2.9	1.6	3,592	3,592	エスクリ	—	1.6	1,318	1,318
全国保証	16.4	17.4	73,515	73,515	三井不動産	288.2	326.8	895,595	895,595	アイ・ケイ・ケイ	—	2.9	2,038	2,038
ジェイリース	—	1.7	538	538	三菱地所	429.3	431.6	900,317	900,317	学情	—	2.1	2,946	2,946
イントラスト	—	1.7	1,098	1,098	平和不動産	10.6	11.3	27,911	27,911	スタジオアリス	3.9	3	6,030	6,030
日本モーゲージサービス	—	1.1	1,241	1,241	東京建物	61.3	67.4	100,763	100,763	シミックホールディングス	4.3	3.3	5,989	5,989
C a s a	—	2.8	3,446	3,446	ダイビル	14.7	18.2	20,711	20,711	N J S	—	1.3	2,237	2,237
アルヒ	7.3	5.6	12,146	12,146	京阪神ビルディング	12.3	10.8	13,888	13,888	総合警備保障	22.6	23.7	132,720	132,720
プレミアグループ	—	3.5	6,664	6,664	住友不動産	139	138.5	573,390	573,390	アイコムグループ	43.3	44.7	119,393	119,393
クレディセゾン	42.6	43.2	59,702	59,702	テオ	9	—	—	—	—	2.3	3,742	3,742	
芙蓉総合リース	6.6	7	47,250	47,250	テオオーシー	20.6	14.1	12,055	12,055	セントケア・ホールディング	—	4.4	2,406	2,406
興銀リース	10.8	11.6	33,698	33,698	東京楽天地	—	0.9	5,193	5,193	サイネックス	—	0.9	576	576
東京センチュリー	12.1	12.4	64,232	64,232	レオパレス21	69.3	—	—	—	—	3.3	5,454	5,454	
日本証券金融	24.5	27.2	14,171	14,171	スターツコーポレーション	7.8	8.3	21,646	21,646	ディップ	8.5	9.6	24,585	24,585
アイフル	101.7	94.3	22,820	22,820	フジ住宅	11.7	7.9	5,545	5,545	オプトホールディング	4.4	3.3	5,194	5,194
リコーリース	4.2	4.8	17,544	17,544	空港施設	12.2	7.2	3,909	3,909	新日本科学	—	8.1	5,759	5,759
イオンフィナンシャルサービス	39.8	39.4	66,704	66,704	明和地所	—	3.4	1,856	1,856	ツクイ	15.6	14.1	6,429	6,429
アコム	118.6	124.1	51,625	51,625	ゴールドクレスト	4.7	4.8	10,828	10,828	キャリアデザインセンター	—	1.5	2,091	2,091
ジャックス	6.9	6.8	15,680	15,680	日本エスリード	4.1	2.3	3,824	3,824	ベネフィット・ワン	—	16.4	31,422	31,422
オリコ	114.4	167.3	23,422	23,422	日神不動産	11.8	8.9	3,987	3,987	エムスリー	59.8	125.7	317,643	317,643
日立キャピタル	15.7	14.5	33,640	33,640	日本エスコン	13.3	11.1	8,780	8,780	ツカガ・グローバルHOLD	—	3.8	2,261	2,261
アプラスフィナンシャル	56.3	29.8	2,115	2,115	タカラレーベン	29.8	28.2	11,731	11,731	プラス	—	0.6	396	396
オリックス	384.8	410.8	711,916	711,916	サンヨーハウジング名古屋	10.1	3.5	3,094	3,094	アウトソーシング	25.3	34.2	35,123	35,123
三菱UFJ F リース	144.9	138.9	90,423	90,423	イオンモール	36.3	30.9	54,507	54,507	ウエルネット	9.7	5.7	4,075	4,075
九州リースサービス	—	3	1,815	1,815	毎日コムネット	—	1.3	984	984	ワールドホールディングス	2	1.9	3,108	3,108
日本取引所グループ	165.5	166.4	302,016	302,016	ファースト住建	—	2.6	3,463	3,463	ディー・エヌ・エー	30.5	32.2	63,208	63,208
イー・ギャランティ	9.8	5.8	7,685	7,685	ランド	—	255.5	2,044	2,044	博報堂D Y HLDGS	78	82.9	135,873	135,873
アサックス	—	2.6	1,583	1,583	カチタス	8.3	6.9	30,946	30,946	ぐるなび	11	8.5	6,162	6,162
NECキャピタルソリューション	4	2.5	5,495	5,495	トーセイ	10.2	8.5	11,041	11,041	タカミヤ	—	6.3	4,126	4,126
不動産業 (2.5%)					穴吹興産	—	0.7	1,974	1,974	ジャパンベストレスキューS	—	4	4,500	4,500
いちご	85.1	78.5	33,676	33,676	エヌ・ティ・ティ都市開発	35.6	—	—	—	—	19	16.5	8,860	8,860
日本駐車場開発	84.6	67.8	11,729	11,729	サンフロンティア不動産	8.7	8.5	10,642	10,642	ライク	—	2.4	3,859	3,859
ヒューリック	119.7	131.6	145,812	145,812	エフ・ジェー・ネクスト	7	—	—	—	—	—	2.5	917	917
三栄建築設計	3.6	2.4	3,554	3,554	インテリックス	—	1.8	1,310	1,310	ビジネス・ブレイクスルー	—	2.3	6,637	6,637
野村不動産HLDGS	38	41	99,015	99,015	ランドビジネス	—	2.6	2,002	2,002	WDBホールディングス	3.1	2.7	7,284	7,284
三重交通グループHD	15.7	12.5	7,175	7,175	日本社宅サービス	—	1.6	1,760	1,760	ティア	7.8	3.5	2,205	2,205
サムティ	6.5	8.7	16,356	16,356	グランディアハウス	19	5.4	2,435	2,435	C DG	—	0.5	739	739
エー・ディー・ワークス	—	191.5	6,702	6,702	日本空港ビルデング	17	19.7	91,211	91,211	パリュールコマース	4.6	3.4	5,739	5,739
日本商業開発	5.1	3.9	5,970	5,970	サービス業 (5.1%)					インフォーマット	32.2	32.7	54,674	54,674
プレサンスコーポレーション	9.2	9.8	16,816	16,816	日本工営	4.2	4	12,480	12,480	JPホールディングス	25.8	17.1	4,873	4,873
ユニソホールディングス	8	9.4	39,668	39,668	L I F U L L	21.8	20.9	14,295	14,295	エコックホールディングス	—	10.8	1,360	1,360
日本管理センター	6.7	4.1	5,801	5,801	ジェイエイサーリクルートメント	5.3	4	8,260	8,260	EPSホールディングス	9.2	9	11,646	11,646
サンセイインディック	—	1.8	1,506	1,506	日本M&Aセンター	39.8	45.1	140,261	140,261	レックス	—	1.5	2,451	2,451
エストラスト	—	0.9	752	752	メンバーズ	—	2	3,426	3,426	プレステージ・インター	13.3	11.2	19,342	19,342

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株	株数
アミューズ	4.2	3.6	9,997	9,997	N・フィールド	4.8	4	2,352	2,352	よみうりランド	1.9	1.3	6,123	6,123	
ドリームインキュベータ	3.1	1.8	2,458	2,458	パリュールH R	—	1.2	3,858	3,858	東京都競馬	4	3.9	13,123	13,123	
クイック	5	3.7	5,076	5,076	M&Aキャピタルパートナー	1.7	2.1	13,398	13,398	常磐興産	6.4	2.4	4,180	4,180	
TAC	17.1	3.1	610	610	ライオンエクスプレスHD	—	2.5	3,605	3,605	カナモト	8	9.8	26,411	26,411	
ケネディクス	55.9	56.8	31,580	31,580	ERIホールディングス	—	1.7	1,371	1,371	東京ドーム	22.9	22.4	23,049	23,049	
電通	68.3	61.5	245,077	245,077	アビスト	—	0.9	2,489	2,489	西尾レントオール	5.8	6.1	17,683	17,683	
テイクアンドギヴニーズ	—	2.3	2,750	2,750	スピスマクス	—	2.9	4,062	4,062	アゴラ・ホスピタリティーG	—	34.8	1,183	1,183	
びあ	2	1.7	7,658	7,658	ウィルグループ	—	3.9	3,369	3,369	トランス・コスモス	6.7	6.6	17,311	17,311	
イオンファンタジー	2.2	1.9	5,396	5,396	エスクローA J	12.7	8.3	1,992	1,992	乃村工藝社	13.6	27.9	38,306	38,306	
シーティーエス	—	6.7	4,736	4,736	日本ビューホテル	8.2	—	—	—	藤田観光	3	2.6	7,563	7,563	
ネクシィーズグループ	3.6	2.1	4,143	4,143	リクルートホールディングス	432.5	427.5	1,462,905	1,462,905	KNT-CTホールディングス	4.5	3.2	4,716	4,716	
みらかホールディングス	16.5	16.7	42,518	42,518	エラン	—	3.5	6,209	6,209	日本管財	6.5	6.4	12,281	12,281	
アルプス技研	6	5.3	8,225	8,225	土木管理総合試験	—	2.6	1,138	1,138	トーカイ	5.8	5.8	13,931	13,931	
サンックス	—	10.6	3,731	3,731	ネットマーケティング	—	2.1	1,554	1,554	白洋舎	—	0.7	1,974	1,974	
ダイオース	—	1.4	2,076	2,076	日本郵政	315.7	489.1	507,685	507,685	セコム	59.7	63.3	617,871	617,871	
日本空調サービス	—	6.8	4,739	4,739	ベルシステム24HLDGS	10.6	10	15,780	15,780	セントラル警備保障	3.2	2.9	15,950	15,950	
オリエンタルランド	66.3	70.5	1,115,662	1,115,662	鎌倉新書	—	4.4	6,283	6,283	丹青社	12.8	11.3	14,531	14,531	
ダスキン	14.9	15.3	43,406	43,406	ソネット・メディア・ネットワーク	—	0.7	457	457	メイテック	6.7	7.4	39,368	39,368	
明光ネットワークジャパン	9.7	7.1	6,432	6,432	一蔵	—	0.7	420	420	応用地質	7.3	6.4	7,385	7,385	
ファルコホールディングス	8.2	3.3	5,666	5,666	LITALICO	—	1.4	2,693	2,693	船井総研ホールディング	12.2	12.3	29,987	29,987	
秀英予備校	—	1.4	623	623	グローバルキッズCOMP	—	0.9	784	784	進学会ホールディングス	—	2.7	1,371	1,371	
田谷	—	1.2	738	738	エポラブルアジア	—	2.7	5,413	5,413	オオバ	16.3	4.7	2,923	2,923	
ラウンドワン	18.4	18.5	30,081	30,081	アトラエ	—	1.5	4,338	4,338	いであ	—	1.1	1,327	1,327	
リゾートトラスト	23.4	25.3	44,477	44,477	ストライク	—	2.3	6,396	6,396	学究社	7	2	2,502	2,502	
ビー・エム・エル	7.9	7.7	23,600	23,600	ソラスト	12.1	14.6	17,695	17,695	ベネッセホールディングス	19.8	21.9	61,845	61,845	
ワタベウエディング	—	1	593	593	セラク	—	1.9	1,482	1,482	イオンディライト	7.8	7.4	26,381	26,381	
りらいあコミュニケーション	9.9	10.8	14,493	14,493	インソース	—	2.9	7,081	7,081	ナック	—	3.8	3,720	3,720	
リソー教育	11.7	30.3	13,998	13,998	ベイレントコンサルティング	—	4.2	19,026	19,026	ニチイ学館	11.9	8.5	14,985	14,985	
早稲田アカデミー	—	1.7	1,385	1,385	ORCHESTRA HLDGS	—	1.2	1,236	1,236	ダイセキ	9.6	10	27,680	27,680	
ユー・エス・エス	67.8	72.9	153,381	153,381	アイモバイル	—	1.9	1,138	1,138	ステップ	—	2.2	3,132	3,132	
東京個別指導学院	—	2.1	1,967	1,967	キャリアインデックス	—	2.1	932	932						
サイバーエージェント	35	34.3	144,231	144,231	MS-Japan	—	2.4	3,482	3,482						
楽天	262.4	278.3	282,752	282,752	船場	—	0.9	818	818						
クレーク・アンド・リバー社	—	3.5	4,147	4,147	グレイステクノロジー	—	2.2	6,406	6,406						
テール・オー・ダブリュー	13.1	5.2	3,920	3,920	ジャパンエレベーターSHD	—	4.7	13,009	13,009						
山田コンサルティングGP	—	2.9	5,060	5,060	フルテック	—	0.8	1,000	1,000						
セントラルスポーツ	2.5	2.2	7,106	7,106	グリーンズ	—	2.3	3,125	3,125						
フルキャストホールディングス	6.6	6	12,990	12,990	ツナググループHLDGS	—	0.7	418	418						
エン・ジャパン	—	8.7	36,235	36,235	ソウルアウト	—	0.9	1,249	1,249						
リソルホールディングス	—	0.7	2,831	2,831	MS&CONSULTING	—	0.9	821	821						
テクノプロ・ホールディング	10.8	12	77,880	77,880	日総工産	—	4	4,456	4,456						
アトラ	—	1.2	446	446	キュービーネットHLDGS	—	3.6	7,840	7,840						
インターワークス	—	1.1	614	614	RPAホールディングス	—	2.5	4,225	4,225						
アイ・アールジャパンHD	—	2.4	8,784	8,784	スプリックス	—	2	2,892	2,892						
KeepPer 技研	—	2.2	3,174	3,174	アドバンテッジリスクマネ	—	2.3	1,800	1,800						
ファーストロジック	—	1.4	866	866	リログループ	31.1	32.6	83,879	83,879						
三機サービス	—	1.3	1,205	1,205	東祥	4.2	3.7	8,639	8,639						
Gunosy	—	4.2	5,905	5,905	エイチ・アイ・エス	10	9.3	25,751	25,751						
デザインワン・ジャパン	—	1.2	376	376	ラックランド	—	1.2	2,793	2,793						
イー・ガーディアン	3.8	3.1	5,226	5,226	共立メンテナンス	10.3	9.1	40,768	40,768						
リブセンス	—	3.3	848	848	イチネンホールディングス	—	8.6	6.2	7,018	7,018					
ジャパンマテリアル	17.1	16.3	20,945	20,945	建設技術研究所	7.6	4.1	6,789	6,789						
ベクトル	7.6	7.5	6,967	6,967	スペース	—	3.9	4,894	4,894						
ウチヤマホールディングス	—	3	1,443	1,443	長大	—	2.2	2,228	2,228						
チャームケアコーポレーション	—	1.9	3,781	3,781	燦ホールディングス	—	1.3	2,844	2,844						
ライクキッズネクスト	—	1.4	1,276	1,276	スバル興業	1.2	0.4	2,760	2,760						
キャリアリンク	—	2.2	1,302	1,302	東京テアトル	7	2.4	3,352	3,352						
I B J	—	4	4,416	4,416	タナベ経営	—	1.2	1,534	1,534						
アサンテ	4.7	2.4	4,848	4,848	ナガワ	—	1.7	9,622	9,622						

銘柄	株数	金額	当期末	
			株数	金額
合計	70,601.2	73,677.7	144,383.908	144,383.908
銘柄数<比率>	1,498銘柄	2,131銘柄	<99.7%>	<99.7%>

(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) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内	百万円	百万円
TOPIX	287	—

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

項 目	当 期 末	
	貸 付	借 入
株式	株 8,318,400 (240,600)	株 — (—)

- (注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
(注2) 当ファンドに係る当作成期中の利害関係人のうち、大和証券へ240,600株を貸付けています。

■投資信託財産の構成

2019年9月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 144,383,908	% 85.3
コール・ローン等、その他	24,819,662	14.7
投資信託財産総額	169,203,571	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

2019年9月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	169,662,900,164円
コール・ローン等	19,763,867,043
株式 (評価額)	144,383,908,290
未収入金	4,981,771,637
未収配当金	61,109,873
未収利息	1,004,073
その他未収収益	11,859,248
差入委託証拠金	459,380,000
(B) 負債	24,798,875,465
未払解約金	5,440,424,660
差入委託証拠代用有価証券	460,980,000
受入担保金	18,897,468,081
その他未払費用	2,724
(C) 純資産総額 (A - B)	144,864,024,699
元本	139,218,477,453
次期繰越損益金	5,645,547,246
(D) 受益権総口数	139,218,477,453口
1万口当り基準価額 (C / D)	10,406円

* 期首における元本額は133,322,724,900円、当作成期間中における追加設定元本額は24,456,356,141円、同解約元本額は18,560,603,588円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、トピックス・インデックスファンド3,959,780,929円、ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A7,634,005,000円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A2 8,941,003円、ダイワ国内重視バランスファンド30 V A (一般投資家私募) 60,746,661円、ダイワ国内重視バランスファンド50 V A (一般投資家私募) 916,911,182円、ダイワ国際分散バランスファンド30 V A (一般投資家私募) 49,098,482円、ダイワ国際分散バランスファンド50 V A (一般投資家私募) 1,278,942,805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) 33,474,382円、D-1's T O P I Xインデックス40,297,426円、為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド19,815,592円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 3,680,722円、iFree T O P I Xインデックス

1,240,728,743円、iFree 8資産バランス1,946,320,135円、iFree 年金バランス56,248,083円、D Cダイワ日本株式インデックス65,758,738,387円、ダイワ・ライフ・バランス30 2,935,287,098円、ダイワ・ライフ・バランス50 3,322,359,411円、ダイワ・ライフ・バランス70 3,053,282,137円、年金ダイワ日本株式インデックス4,860,270,912円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2020 14,875,081円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 54,571,393円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 21,059,608円、ダイワつみたてインデックス日本株式194,448,237円、ダイワつみたてインデックスバランス30 198,705円、ダイワつみたてインデックスバランス50 300,351円、ダイワつみたてインデックスバランス70 479,367円、ダイワ世界バランスファンド40 V A167,628,084円、ダイワ世界バランスファンド60 V A171,981,504円、ダイワ・バランスファンド35 V A9,347,930,150円、ダイワ・ワールド・バランスファンド75 V A3,092,274円、ダイワ・バランスファンド25 V A (適格機関投資家専用) 827,002,497円、ダイワ国内バランスファンド25 V A (適格機関投資家専用) 127,742,510円、ダイワ国内バランスファンド30 V A (適格機関投資家専用) 222,487,484円、ダイワ・ノーロード T O P I Xファンド160,214,687円、ダイワファンドラップ T O P I Xインデックス9,622,016,197円、ダイワ T O P I Xインデックス (ダイワ S M A専用) 2,723,875,577円、ダイワファンドラップオンライン T O P I Xインデックス2,564,805,669円、ダイワ・インデックスセレクト T O P I X1,429,476,274円、ダイワライフスタイル25 195,425,595円、ダイワライフスタイル50 683,313,759円、ダイワライフスタイル75 559,222,873円、D C・ダイワ・トピックス・インデックス (確定拠出年金専用ファンド) 12,947,400,487円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,406円です。

■損益の状況

当期 自 2018年9月20日 至 2019年9月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,377,304,256円
受取配当金	3,168,480,765
受取利息	19,728,015
その他収益金	202,408,919
支払利息	△ 13,313,443
(B) 有価証券売買損益	△ 13,681,248,964
売買益	5,990,482,970
売買損	△ 19,671,731,934
(C) 先物取引等損益	△ 212,010,360
取引益	260,684,580
取引損	△ 472,694,940
(D) その他費用	△ 1,058,828
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 10,517,013,896
(F) 前期繰越損益金	16,444,933,577
(G) 解約差損益金	△ 554,817,754
(H) 追加信託差損益金	272,445,319
(I) 合計 (E + F + G + H)	5,645,547,246
次期繰越損益金 (I)	5,645,547,246

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

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

ダイワ日経225インデックス (ダイワSMA専用)

運用報告書(全体版)

第4期

(決算日 2020年6月15日)

(作成対象期間 2019年6月18日～2020年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
1 期末 (2017年 6 月15日)	円 10,201	円 70	% 2.7	円 19,831.82	% 2.0	% 98.7	% 1.8	百万円 1
2 期末 (2018年 6 月15日)	11,850	90	17.0	22,851.75	15.2	99.0	1.7	27
3 期末 (2019年 6 月17日)	10,971	180	△ 5.9	21,124.00	△ 7.6	99.3	2.3	33
4 期末 (2020年 6 月15日)	11,262	120	3.7	21,530.95	1.9	99.2	1.9	376

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

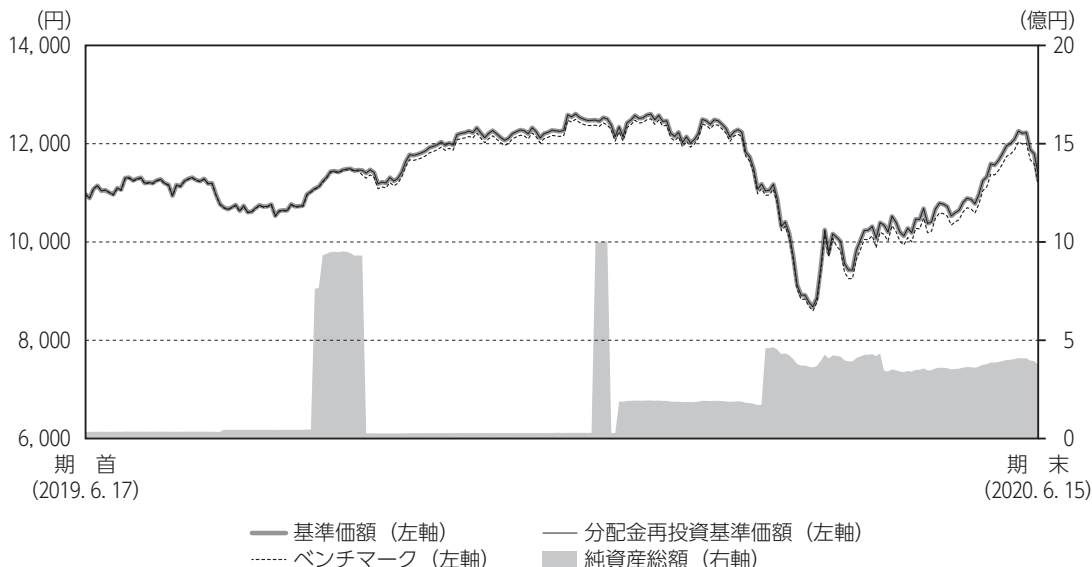
(注3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

* ベンチマークは日経平均株価です。

■ 基準価額・騰落率

期首：10,971円

期末：11,262円（分配金120円）

騰落率：3.7%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 組入比率	株 式 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2019年 6月17日	円	%	円	%	%	%
	10,971	—	21,124.00	—	99.3	2.3
6月末	11,065	0.9	21,275.92	0.7	98.8	1.2
7月末	11,189	2.0	21,521.53	1.9	98.6	1.4
8月末	10,769	△ 1.8	20,704.37	△ 2.0	98.5	1.5
9月末	11,401	3.9	21,755.84	3.0	98.3	1.7
10月末	12,013	9.5	22,927.04	8.5	97.4	2.6
11月末	12,203	11.2	23,293.91	10.3	97.6	2.4
12月末	12,383	12.9	23,656.62	12.0	98.4	1.5
2020年 1月末	12,143	10.7	23,205.18	9.9	97.5	2.5
2月末	11,074	0.9	21,142.96	0.1	97.9	2.1
3月末	10,011	△ 8.8	18,917.01	△ 10.4	96.8	3.2
4月末	10,680	△ 2.7	20,193.69	△ 4.4	96.5	3.5
5月末	11,567	5.4	21,877.89	3.6	97.7	2.3
(期末)2020年 6月15日	11,382	3.7	21,530.95	1.9	99.2	1.9

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2019. 6. 18 ~ 2020. 6. 15）

国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、米国がメキシコに対する追加関税を棚上げしたことや米国の利下げ期待、2019年6月末に開催された米中首脳会談で一定の関係改善が見られたことなどが支えとなり、底堅く推移しました。8月には、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され株価は下落したものの、9月以降は、米国が連続利下げを実施したことで過度な景気後退懸念が和らいだことや、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、株価は上昇しました。しかし2020年1月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染拡大が懸念され株価が下落したのに続き、2月後半以降は中国以外における感染拡大が懸念され、3月に入ると米国において感染者の増加が目立ち始めたほか、国内においても感染者の急激な増加が懸念される状況となり、株価は2月後半から3月中旬にかけて大幅に下落しました。3月下旬以降は、主要国の中央銀行による金融緩和策や米国による大型の経済対策に加え、欧米における新型コロナウイルスの新規感染者数がピークアウトしてきたことで経済活動の再開期待が高まったこと、5月下旬に国内の緊急事態宣言が全面解除されたことが好感され、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

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（日経平均株価）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

(2019. 6. 18 ~ 2020. 6. 15)

当ファンド

「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れて運用を行いました。なお、当作成期末の実質株式組入比率（日経平均先物を含む。以下同じ。）は101.0%となっておりますが、翌営業日計上のマザー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、日経平均株価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、日経平均株価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、日経平均株価採用銘柄の入れ替え時には、その都度、組入銘柄の入れ替えを行い、連動性の維持に努めました。

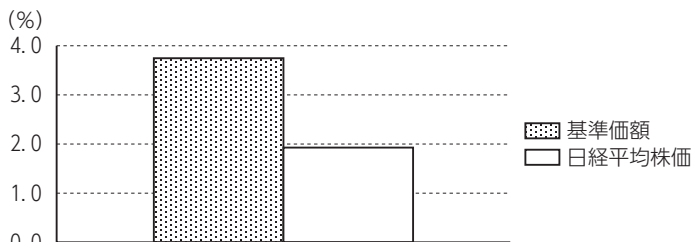
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は1.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は3.7%となりました。

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

また、ファンドから運用管理費用が控除されたことがマイナス要因となりました。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



当期
(2019. 6. 17 ~ 2020. 6. 15)

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	
	2019年6月18日 ～2020年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	120
対基準価額比率	（％）	1.05
当期の収益	（円）	100
当期の収益以外	（円）	20
翌期繰越分配対象額	（円）	1,261

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

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

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

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 102.65円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	✓ 1,279.31
(d) 分配準備積立金	0.00
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,381.97
(f) 分配金	120.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,261.97

（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 (2019. 6. 18~2020. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	38円	0.337%	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11,353円です。
(投 信 会 社)	(23)	(0.207)	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)	(0.109)	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	0.004	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)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.004)	
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	0.008	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)	(0.008)	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	40	0.349	

(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。

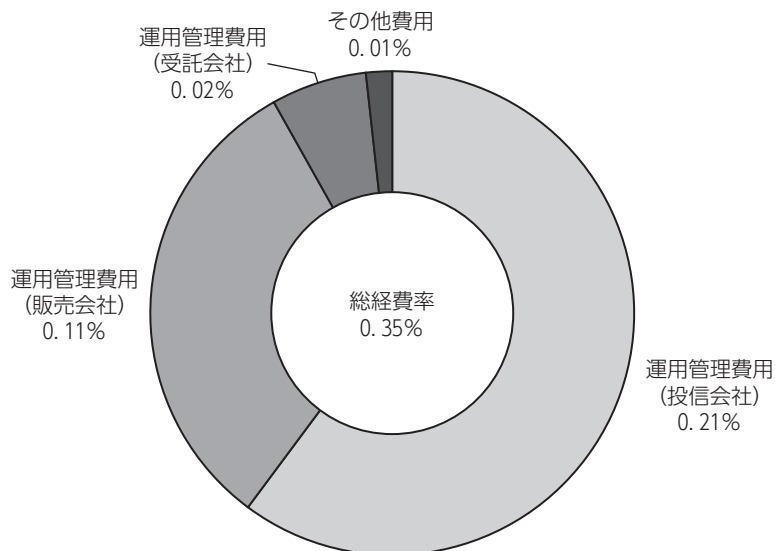
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数 千口	金 額 千円	□ 数 千口	金 額 千円
ストックインデックス225・マザーファンド	818,163	2,305,538	693,145	1,985,322

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

項 目	当 期
	ストックインデックス225・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	76,783,296千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	161,600,036千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.47

(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

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
株式	百万円 28,576	百万円 —	% —	百万円 48,207	百万円 2,538	% 5.3
株式先物取引	81,788	2,532	3.1	83,025	458	0.6
コール・ローン	1,597,645	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.1%

※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

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

種 類	当 期		
	ストックインデックス225・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
株式	百万円 20	百万円 38	百万円 117

(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

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	5千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0千円
(B) / (A)	3.2%

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

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

■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 1	百万円 —	百万円 —	百万円 1	当初設定時における取得

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

ダイワ日経225インデックス（ダイワSMA専用）

■組入資産明細表 親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	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	13,075	138,093	379,951

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ストックインデックス225・マザーファンド	379,951	99.8
コール・ローン等、その他	605	0.2
投資信託財産総額	380,556	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	380,556,690円
コール・ローン等	588,651
ストックインデックス225・マザーファンド（評価額）	379,951,039
未収入金	17,000
(B) 負債	4,544,907
未払収益分配金	4,006,532
未払信託報酬	529,906
その他未払費用	8,469
(C) 純資産総額（A－B）	376,011,783
元本	333,877,680
次期繰越損益金	42,134,103
(D) 受益権総口数	333,877,680口
1万口当り基準価額（C/D）	11,262円

*期首における元本額は30,938,291円、当作成期間中における追加設定元本額は1,970,995,928円、同解約元本額は1,668,056,539円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は11,262円です。

■損益の状況

当期 自 2019年6月18日 至 2020年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 19円
支払利息	△ 19
(B) 有価証券売買損益	△ 4,867,600
売買益	43,310,895
売買損	△ 48,178,495
(C) 信託報酬等	△ 769,361
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 5,636,980
(E) 前期繰越損益金	△ 282
(F) 追加信託差損益金	51,777,897
（配当等相当額）	（ 8,983,255）
（売買損益相当額）	（ 42,794,642）
(G) 合計（D＋E＋F）	46,140,635
(H) 収益分配金	△ 4,006,532
次期繰越損益金（G＋H）	42,134,103
追加信託差損益金	51,110,142
（配当等相当額）	（ 8,315,500）
（売買損益相当額）	（ 42,794,642）
分配準備積立金	88,664
繰越損益金	△ 9,064,703

(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	3,427,433円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	42,713,484
(d) 分配準備積立金	8
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	46,140,925
(f) 分配金	4,006,532
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	42,134,393
(h) 受益権総口数	333,877,680口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	120円

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

【注記】

「日経平均株価」に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延または中断に関して責任を負いません。また、「ダイワ日経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。

《お知らせ》

■商号変更について

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

ストックインデックス 2 2 5 ・ マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（ダイワ日経 2 2 5 インデックス（ダイワ SMA 専用））が投資対象としている「ストックインデックス 2 2 5 ・ マザーファンド」の決算日（2019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（2020年 6 月 15 日）現在におけるストックインデックス 2 2 5 ・ マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

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

（2019年 6 月 18 日から 2020年 6 月 15 日まで）

買 付				売 付			
銘柄	株 数	金 額	平均単価	銘柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ファーストリテイリング	46	2,425,206	52,721	ファーストリテイリング	76	5,067,511	66,677
エムスリー	768	2,011,957	2,619	ソフトバンクグループ	456	2,084,727	4,571
バンダイナムコホールディングス	334	1,955,407	5,854	東京エレクトロン	76	1,691,274	22,253
ソフトバンクグループ	270	1,223,750	4,532	ファナック	76	1,579,691	20,785
東京エレクトロン	46	908,527	19,750	KDDI	456	1,393,878	3,056
KDDI	276	820,557	2,973	ダイキン工業	76	1,155,909	15,209
ファナック	46	756,541	16,446	テルモ	304	1,114,672	3,666
ダイキン工業	46	625,452	13,596	京セラ	152	1,051,548	6,918
テルモ	184	611,941	3,325	信越化学	76	919,317	12,096
京セラ	92	584,106	6,348	リクルートホールディングス	228	839,940	3,683

（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、2020年 6 月 15 日現在におけるストックインデックス 2 2 5 ・ マザーファンド（57,999,406千口）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2020年 6 月 15 日現在		銘柄	2020年 6 月 15 日現在		銘柄	2020年 6 月 15 日現在	
	株 数	評 価 額		株 数	評 価 額		株 数	評 価 額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			積水ハウス	262	528,978	日本たばこ産業	262	551,379
日本水産	262	123,926	日揮ホールディングス	262	293,964	繊維製品 (0.2%)		
マルハニチロ	26.2	55,779	食料品 (3.9%)			東洋紡	26.2	37,649
鉱業 (0.0%)			日清製粉G本社	262	427,584	ユニチカ	26.2	8,908
国際石油開発帝石	104.8	73,999	明治ホールディングス	52.4	434,396	帝人	52.4	89,604
建設業 (2.0%)			日本ハム	131	533,825	東レ	262	130,633
コムシスホールディングス	262	759,538	サッポロホールディングス	52.4	102,808	パルプ・紙 (0.1%)		
大成建設	52.4	198,596	アサヒグループホールディング	262	1,020,752	王子ホールディングス	262	131,000
大林組	262	260,952	キリンHD	262	587,404	日本製紙	26.2	40,531
清水建設	262	221,390	宝ホールディングス	262	243,660	化学 (8.3%)		
長谷工コーポレーション	52.4	67,805	キッコーマン	262	1,296,900	クラレ	262	303,396
鹿島建設	131	157,462	味の素	262	470,552	旭化成	262	223,538
大和ハウス	262	693,383	ニチレイ	131	392,476	昭和電工	26.2	66,888

銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
住友化学	262	85,150
日産化学	262	1,359,780
東ソー	131	191,915
トクヤマ	52.4	124,607
デンカ	52.4	135,244
信越化学	262	3,104,700
三井化学	52.4	119,838
三菱ケミカル HLDGS	131	82,936
宇部興産	26.2	48,286
日本化薬	262	280,078
花王	262	2,264,466
D I C	26.2	69,141
富士フイルム HLDGS	262	1,248,692
資生堂	262	1,790,246
日東電工	262	1,530,080
医薬品 (10.2%)		
協和キリン	262	713,950
武田薬品	262	1,027,564
アステラス製薬	1,310	2,281,365
大日本住友製薬	262	370,992
塩野義製薬	262	1,712,170
中外製薬	262	4,192,000
エーザイ	262	2,138,182
第一三共	262	2,258,964
大塚ホールディングス	262	1,234,544
石油・石炭製品 (0.2%)		
出光興産	104.8	248,376
JXTG ホールディングス	262	103,070
ゴム製品 (0.7%)		
横浜ゴム	131	199,251
ブリヂストン	262	908,616
ガラス・土石製品 (1.1%)		
A G C	52.4	165,584
日本板硝子	26.2	10,663
日本電気硝子	78.6	136,135
住友大阪セメント	26.2	95,106
太平洋セメント	26.2	62,356
東海カーボン	262	271,694
T O T O	131	546,270
日本硝子	262	395,358

銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
鉄鋼 (0.1%)		
日本製鉄	26.2	26,435
神戸製鋼所	26.2	10,480
J F E ホールディングス	26.2	20,829
大平洋金属	26.2	43,780
非鉄金属 (0.8%)		
日本軽金属HD	262	46,112
三井金属	26.2	57,771
東邦亜鉛	26.2	39,038
三菱マテリアル	26.2	59,159
住友鉱山	131	379,900
DOWA ホールディングス	52.4	172,396
古河電工	26.2	67,124
住友電工	262	333,788
フジクラ	262	82,530
金属製品 (0.2%)		
S U M C O	26.2	39,745
東洋製罐グループHD	262	331,168
機械 (4.7%)		
日本製鋼所	52.4	77,918
オークマ	52.4	237,896
アマダ	262	231,084
小松製作所	262	550,200
住友重機械	52.4	124,974
日立建機	262	738,840
クボタ	262	408,327
荏原製作所	52.4	127,489
ダイキン工業	262	4,169,730
日本精工	262	207,504
N T N	262	58,688
ジェイテクト	262	222,438
日立造船	52.4	20,436
三菱重工業	26.2	70,517
I H I	26.2	40,217
電気機器 (19.3%)		
日清紡ホールディングス	262	203,050
コニカミノルタ	262	103,752
ミネベアミツミ	262	503,040
日立	52.4	179,470
三菱電機	262	363,918

銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
富士電機	52.4	142,370
安川電機	262	936,650
オムロン	262	1,813,040
ジーエス・ユアサ コーポ	52.4	90,704
日本電気	26.2	126,677
富士通	26.2	304,313
沖電気	26.2	26,776
セイコーエプソン	524	671,244
パナソニック	262	243,188
ソニー	262	1,917,054
T D K	262	2,690,740
アルプスアルパイン	262	361,822
横河電機	262	409,244
アドバンテスト	524	2,871,520
カシオ	262	471,862
ファナック	262	4,940,010
京セラ	524	2,998,328
太陽誘電	262	821,370
SCREEN ホールディングス	52.4	250,472
キヤノン	393	860,670
リコー	262	216,674
東京エレクトロン	262	5,732,560
輸送用機器 (4.3%)		
デンソー	262	1,022,586
三井E&SHD	26.2	13,335
川崎重工業	26.2	43,492
日産自動車	262	106,974
いすゞ自動車	131	125,105
トヨタ自動車	262	1,755,400
日野自動車	262	186,544
三菱自動車工業	26.2	7,755
マツダ	52.4	37,204
本田技研	524	1,436,284
スズキ	262	938,222
SUBARU	262	608,364
ヤマハ発動機	262	411,078
精密機器 (4.0%)		
テルモ	1,048	4,130,168
ニコン	262	241,826
オリンパス	1,048	1,859,676

ストックインデックス 2 2 5 ・ マザーファンド

銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
シチズン時計	262	95,106
その他製品 (2.2%)		
バンダイナムコ HLDGS	262	1,556,542
凸版印刷	131	234,359
大日本印刷	131	317,806
ヤマハ	262	1,380,740
電気・ガス業 (0.2%)		
東京電力HD	26.2	9,012
中部電力	26.2	37,007
関西電力	26.2	28,034
東京瓦斯	52.4	129,401
大阪瓦斯	52.4	108,887
陸運業 (2.0%)		
東武鉄道	52.4	193,618
東急	131	207,111
小田急電鉄	131	344,006
京王電鉄	52.4	321,736
京成電鉄	131	444,090
東日本旅客鉄道	26.2	213,608
西日本旅客鉄道	26.2	167,444
東海旅客鉄道	26.2	463,871
日本通運	26.2	148,816
ヤマトホールディングス	262	627,228
海運業 (0.1%)		
日本郵船	26.2	38,566
商船三井	26.2	48,103
川崎汽船	26.2	25,676
空運業 (0.0%)		
ANA ホールディングス	26.2	67,216
倉庫・運輸関連業 (0.2%)		
三菱倉庫	131	353,831
情報・通信業 (11.0%)		
Z ホールディングス	104.8	46,112
トレンドマイクロ	262	1,561,520
スカパーJSATHD	26.2	11,266
日本電信電話	104.8	259,275
KDDI	1,572	4,937,652
NTTドコモ	26.2	75,849
東宝	26.2	101,918
NTTデータ	1,310	1,552,350
コナミホールディングス	262	924,860

銘柄	2020年6月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ソフトバンクグループ	1,572	7,710,660
卸売業 (1.8%)		
双日	26.2	6,235
伊藤忠	262	594,740
丸紅	262	131,157
豊田通商	262	707,138
三井物産	262	428,370
住友商事	262	324,356
三菱商事	262	613,473
小売業 (13.0%)		
J. フロントリテイリング	131	112,791
三越伊勢丹HD	262	178,422
セブン&アイ・HLDGS	262	937,698
ファミリーマート	1,048	1,925,176
高島屋	131	123,926
丸井グループ	262	517,712
イオン	262	622,512
ファーストリテイリング	262	15,929,600
銀行業 (0.6%)		
コンコルディア・フィナンシャル	262	90,390
新生銀行	26.2	35,789
あおぞら銀行	26.2	50,828
三菱UFJフィナンシャルG	262	112,424
りそなホールディングス	26.2	9,796
三井住友トラストHD	26.2	78,731
三井住友フィナンシャルG	26.2	81,351
千葉銀行	262	131,786
ふくおかフィナンシャルG	52.4	88,713
静岡銀行	262	181,828
みずほフィナンシャルG	262	35,029
証券・商品先物取引業 (0.3%)		
大和証券G本社	262	117,271
野村ホールディングス	262	121,410
松井証券	262	215,102
保険業 (0.8%)		
SOMPOホールディングス	65.5	235,865
MS & A D	78.6	244,996
SONY FH	52.4	135,820
第一生命HLDGS	26.2	35,160
東京海上HD	131	619,106
T&D ホールディングス	52.4	49,727

銘柄	2020年6月15日現在		
	株数	評価額	
	千株	千円	
その他金融業 (0.2%)			
クレディセゾン	262	339,290	
不動産業 (1.3%)			
東急不動産HD	262	136,502	
三井不動産	262	535,659	
三菱地所	262	431,776	
東京建物	131	165,453	
住友不動産	262	746,569	
サービス業 (6.0%)			
エムスリー	628.8	2,722,704	
ディー・エヌ・エー	78.6	111,926	
電通グループ	262	700,588	
サイバーエージェント	52.4	261,476	
楽天	262	241,826	
リクルートホールディングス	786	2,780,868	
日本郵政	262	203,312	
セコム	262	2,443,412	
	千株	千円	
合計	株数、金額	47,042.1	156,597,158
	銘柄数<比率>	225銘柄	<98.1%>

(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	2020年6月15日現在	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
日経平均	2,989	—

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入状況

区分	2020年6月15日現在	
	貸付	借入
株式	株 4,485,300 (300,000)	株 — (—)

(注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

(注2) 当ファンドに係る当作成期中の利害関係人のうち、大和証券へ300,000株を貸付しています。

ストックインデックス225・マザーファンド

運用報告書 第18期 (決算日 2019年9月19日)

(作成対象期間 2018年9月20日～2019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、日経平均株価をモデルとして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄
株式組入制限	無制限

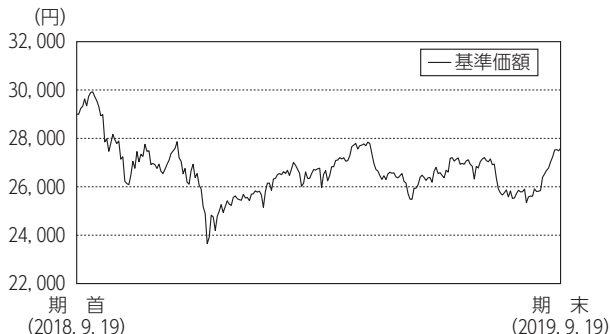
大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		日経平均株価		株式組入率	株式先比率
	円	%	円	%		
(期首)2018年9月19日	28,999	—	23,672.52	—	97.9	1.1
9月末	29,741	△ 2.6	24,120.04	△ 1.9	98.1	1.8
10月末	27,051	△ 6.7	21,920.46	△ 7.4	98.0	2.0
11月末	27,588	△ 4.9	22,351.06	△ 5.6	98.0	2.0
12月末	24,753	△ 14.6	20,014.77	△ 15.5	98.3	1.7
2019年1月末	25,692	△ 11.4	20,773.49	△ 12.2	98.8	1.2
2月末	26,469	△ 8.7	21,385.16	△ 9.7	99.0	1.0
3月末	26,459	△ 8.8	21,205.81	△ 10.4	97.3	2.7
4月末	27,785	△ 4.2	22,258.73	△ 6.0	97.7	2.3
5月末	25,725	△ 11.3	20,601.19	△ 13.0	97.9	2.1
6月末	26,609	△ 8.2	21,275.92	△ 10.1	98.8	1.2
7月末	26,915	△ 7.2	21,521.53	△ 9.1	98.6	1.4
8月末	25,913	△ 10.6	20,704.37	△ 12.5	98.5	1.5
(期末)2019年9月19日	27,592	△ 4.9	22,044.45	△ 6.9	98.3	0.9

(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) 株式先比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：28,999円 期末：27,592円 騰落率：△4.9%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク（日経平均株価）への連動をめざした運用を行った結果、ベンチマークの動きを反映して、基準価額は下落しました。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

○国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、米中通商協議に関していったん悪材料は出尽くしたとの見方が広がったことや為替市場で円安が進行したことなどが評価され、上昇しました。2018年10月には、米国の長期金利が上昇したことに対する懸念や、国内外の決算発表において一部の分野で事業環境の悪化が見られたことが嫌気され、株価は下落しました。11月は、株価急落からの自律反発や米中首脳会談において米中通商協議に何らかの進展が見られるとの期待により株価が上昇したものの、12月に入ると、中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、下落しました。しかし2019年1月には、F R B議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことが好感されたほか、2月に開催された米中閣僚級協議などにより通商協議の進展期待が再び高まり、株価は反発しました。上昇一服後は一進一退で推移したものの、5月に入り米国が中国製品への関税率の引き上げや対象範囲の拡大方針を発表したこと、また中国の通信機器大手メーカーに対する取引制限措置を実施したことなどにより不透明感が高まり、株価は下落しました。下落一巡後は、世界景気の動向などに不透明感がある中で、6月末に開催された米中首脳会談で一定の成果が見られたことや米国の利下げ期待が支えとなり、株価は横ばい圏で推移しました。しかし8月に入ると、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され、株価は下落しました。9月以降は、米中通商協議の進展期待から、当作成期末にかけて上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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、ベンチマークに採用されている全銘柄を組み入れて運用を行いました。

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は△6.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△4.9%となりました。

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

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。
 (注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1)株 式

(2018年9月20日から2019年9月19日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 14,571.9 (1,614.9)	千円 51,184,664 (—)	千株 7,599.9	千円 24,584,715

(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

(2018年9月20日から2019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
国内	百万円 47,048	百万円 47,178	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

(2018年9月20日から2019年9月19日まで)

買 柄	当			期			
	株 数	金 額	平均単価	買 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	82	4,791,896	58,437	ファーストリテイリング	40	2,415,413	60,385
ソフトバンクグループ	276	2,275,901	8,246	ソフトバンクグループ	150	1,312,921	8,752
バンダイナムコHLDGS	300	1,775,467	5,918	ファナック	40	841,041	21,026
オムロン	320	1,649,585	5,154	東京エレクトロン	40	702,662	17,566
ファナック	82	1,526,440	18,615	KDDI	240	659,180	2,746
KDDI	492	1,342,557	2,728	ダイキン工業	40	556,466	13,911
東京エレクトロン	82	1,232,470	15,030	京セラ	80	542,422	6,780
ダイキン工業	82	1,062,156	12,953	テルモ	132	532,552	4,034
ファミリーマート	154	1,056,046	6,857	ファミリーマート	130	453,014	3,484
テルモ	212	1,035,184	4,882	信越化学	40	419,225	10,480

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

ストックインデックス225・マザーファンド

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
			評価額	千円				評価額	千円				評価額	千円
水産・農林業 (0.2%)					日本化薬	252	294	382,200		金属製品 (0.3%)				
日本水産	252	294	185,514		花王	252	294	2,333,478		SUMCO	25.2	29.4	42,189	
マルハニチロ	25.2	29.4	81,937		ＤＩＣ	—	29.4	88,641		東洋製罐グループHD	252	294	499,506	
鉱業 (0.1%)					富士フィルム HLDGS	252	294	1,410,906		機械 (4.7%)				
国際石油開発帝石	100.8	117.6	125,302		資生堂	252	294	2,564,268		日本製鋼所	50.4	58.8	122,715	
建設業 (2.3%)					日東電工	252	294	1,577,016		オークマ	50.4	58.8	343,980	
コムシスホールディングス	252	294	877,296		医薬品 (7.7%)					アマダホールディングス	252	294	345,156	
大成建設	50.4	58.8	244,902		協和キリン	252	294	621,222		小松製作所	252	294	729,708	
大林組	252	294	324,576		武田薬品	252	294	1,104,558		住友重機械	50.4	58.8	194,040	
清水建設	252	294	293,118		アステラス製薬	1,260	1,470	2,237,340		日立建機	252	294	776,454	
長谷工コーポレーション	50.4	58.8	73,911		大日本住友製薬	252	294	544,194		クボタ	252	294	499,800	
鹿島建設	252	147	211,386		塩野義製薬	252	294	1,719,900		荏原製作所	50.4	58.8	166,815	
大和ハウス	252	294	1,053,108		中外製薬	252	294	2,357,880		ダイキン工業	252	294	4,255,650	
積水ハウス	252	294	613,872		エーザイ	252	294	1,591,128		日本精工	252	294	279,006	
日揮	252	294	426,006		第一三共	252	294	2,095,044		NTN	252	294	92,904	
千代田化工建	252	—	—		大塚ホールディングス	252	294	1,395,618		ジェイテクト	252	294	379,848	
食料品 (4.3%)					石油・石炭製品 (0.3%)					日立造船	50.4	58.8	20,756	
日清製粉G本社	252	294	602,112		昭和シエル石油	252	—	—		三菱重工工業	25.2	29.4	128,977	
明治ホールディングス	50.4	58.8	466,872		出光興産	—	117.6	381,024		IHI	25.2	29.4	70,618	
日本ハム	126	147	648,270		JXTGホールディングス	252	294	146,735		電気機器 (19.3%)				
サッポロホールディングス	50.4	58.8	155,173		ゴム製品 (0.9%)					日清紡ホールディングス	252	294	258,132	
アサヒグループホールディングス	252	294	1,567,020		横浜ゴム	126	147	319,284		コニカミノルタ	252	294	233,436	
キリンHD	252	294	670,614		ブリヂストン	252	294	1,265,670		ミネベアミツミ	252	294	540,372	
宝ホールディングス	252	294	329,280		ガラス・土石製品 (1.2%)					日立	252	58.8	239,022	
キッコーマン	252	294	1,517,040		AGC	50.4	58.8	193,452		三菱電機	252	294	429,975	
味の素	252	294	599,760		日本板硝子	25.2	29.4	19,345		富士電機	252	58.8	198,450	
ニチレイ	126	147	368,088		日本電気硝子	75.6	88.2	212,826		安川電機	252	294	1,145,130	
日本たばこ産業	252	294	675,612		住友大阪セメント	252	29.4	139,209		オムロン	—	294	1,714,020	
繊維製品 (0.2%)					太平洋セメント	25.2	29.4	85,701		ジーエス・ユアサコーポ	252	58.8	112,543	
東洋紡	25.2	29.4	42,306		東海カーボン	252	294	329,280		日本電気	25.2	29.4	138,474	
ユニチカ	25.2	29.4	9,584		TOTO	126	147	610,785		富士通	252	29.4	259,337	
帝人	50.4	58.8	121,245		日本硝子	252	294	461,580		沖電気	25.2	29.4	43,953	
東レ	252	294	246,283		鉄鋼 (0.1%)					セイコーエプソン	504	588	916,104	
パルプ・紙 (0.1%)					日本製鉄	25.2	29.4	44,820		パナソニック	252	294	262,424	
王子ホールディングス	252	294	151,998		神戸製鋼所	25.2	29.4	17,199		ソニー	252	294	1,874,250	
日本製紙	25.2	29.4	53,566		JFEホールディングス	25.2	29.4	38,763		TDK	252	294	2,807,700	
化学 (8.4%)					日新製鋼	25.2	—	—		アルプスアルパイン	252	294	606,522	
クラレ	252	294	399,252		大平洋金属	25.2	29.4	66,120		パイオニア	252	—	—	
旭化成	252	294	324,135		非鉄金属 (0.9%)					横河電機	252	294	590,646	
昭和電工	25.2	29.4	87,964		日本軽金属HD	252	294	58,800		アドバンテス	504	588	2,769,480	
住友化学	252	294	148,176		三井金属	25.2	29.4	75,910		カシオ	252	294	471,282	
日産化学	252	294	1,340,640		東邦亜鉛	25.2	29.4	59,358		ファナック	252	294	6,010,830	
東ソー	126	147	215,208		三菱マテリアル	25.2	29.4	86,347		京セラ	504	588	3,989,580	
トクヤマ	50.4	58.8	143,589		住友鉱山	126	147	503,328		太陽誘電	252	294	732,354	
デンカ	50.4	58.8	176,164		DOWAホールディングス	50.4	58.8	216,678		SCREENホールディングス	50.4	58.8	384,552	
信越化学	252	294	3,475,080		古河機金	25.2	—	—		キャンノン	378	441	1,291,468	
三井化学	50.4	58.8	148,470		古河電工	25.2	29.4	74,146		リコー	252	294	304,878	
三菱ケミカル HLDGS	126	147	118,937		住友電工	252	294	410,865		東京エレクトロン	252	294	6,109,320	
宇部興産	25.2	29.4	65,121		フジクラ	252	294	115,836						

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
	千株	千株		千円		千株	千株		千円		千株	千株		千円
輸送用機器 (5.0%)					卸売業 (2.2%)					サービス業 (4.6%)				
デンソー	252	294	1,427,076		スカパー JSATHD	25.2	29.4	13,083		三井不動産	252	294	805,707	
三井 E&SHD	25.2	29.4	27,724		日本電信電話	50.4	58.8	309,934		三菱地所	252	294	613,284	
川崎重工業	25.2	29.4	68,031		KDDI	1,512	1,764	5,057,388		東京建物	126	147	219,765	
日産自動車	252	294	209,827		NTTドコモ	25.2	29.4	81,996		住友不動産	252	294	1,217,160	
いすゞ自動車	126	147	183,235		東宝	25.2	29.4	138,327		サービス業 (4.6%)				
トヨタ自動車	252	294	2,165,016		NTTデータ	1,260	1,470	2,093,280		ディー・エヌ・エー	75.6	88.2	173,136	
日野自動車	252	294	276,066		コナミホールディングス	252	294	1,475,880		電通	252	294	1,171,590	
三菱自動車工業	25.2	29.4	14,582		ソフトバンクグループ	756	1,764	8,142,624		サイバーエージェント	—	58.8	247,254	
マツダ	50.4	58.8	57,700		卸売業 (2.2%)					楽天	252	294	298,704	
本田技研	504	588	1,696,674		双日	25.2	29.4	10,290		リクルートホールディングス	756	882	3,018,204	
スズキ	252	294	1,265,670		伊藤忠	252	294	676,788		日本郵政	252	294	305,172	
SUBARU	252	294	900,522		丸紅	252	294	221,440		東京ドーム	126	147	151,263	
ヤマハ発動機	252	294	569,184		豊田通商	252	294	1,071,630		セコム	252	294	2,869,734	
精密機器 (3.4%)					小売業 (14.3%)					千株 千株 千円				
テルモ	504	1,176	3,898,440		三井物産	252	294	540,519		合計	株数、金額	43,583.4	52,170.3	178,209,911
ニコン	252	294	408,366		住友商事	252	294	516,117		銘柄数<比率> 225銘柄 225銘柄 <98.3%>				
オリンパス	252	1,176	1,652,280		三菱商事	252	294	818,202		(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。				
シチズン時計	252	294	159,642		小売業 (14.3%)					(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。				
その他製品 (2.2%)					J. フロントリテイリング	126	147	187,866		(注3) 評価額の単位未満は切捨て。				
パンダイナムコHLDGS	—	294	1,875,720		三越伊勢丹HD	252	294	252,840		(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)				
凸版印刷	252	147	280,623		セブン&アイ・HLDGS	252	294	1,228,332		銘柄別				
大日本印刷	126	147	407,778		ファミリーマート	252	1,176	3,176,376		当期末				
ヤマハ	252	294	1,414,140		高島屋	126	147	188,307		買建額 売建額				
電気・ガス業 (0.2%)					丸井グループ	252	294	682,962		国内				
東京電力HD	25.2	29.4	16,199		イオン	252	294	586,089		日経平均				
中部電力	25.2	29.4	48,715		ファーストリテイリング	252	294	19,174,680		(注) 単位未満は切捨て。				
関西電力	25.2	29.4	40,836		銀行業 (0.7%)					銘柄別				
東京瓦斯	50.4	58.8	166,257		コンソルディア・フィナンシャル	252	294	123,480		当期末				
大阪瓦斯	50.4	58.8	122,480		コソルディア・フィナンシャル	25.2	29.4	46,069		買建額 売建額				
陸運業 (2.2%)					新生銀行	25.2	29.4	80,438		国内				
東武鉄道	50.4	58.8	208,740		あおぞら銀行	25.2	29.4	166,139		日経平均				
東急	126	147	306,936		三菱UFJフィナンシャルG	252	294	14,023		(注) 単位未満は切捨て。				
小田急電鉄	126	147	383,670		リそなホールディングス	25.2	29.4	118,070		銘柄別				
京王電鉄	50.4	58.8	408,072		三井住友トラストHD	25.2	29.4	111,308		当期末				
京成電鉄	126	147	642,390		三井住友フィナンシャルG	25.2	29.4	166,110		買建額 売建額				
東日本旅客鉄道	25.2	29.4	310,170		千葉銀行	252	294	124,832		国内				
西日本旅客鉄道	25.2	29.4	277,506		ふくおかフィナンシャルG	252	294	245,490		日経平均				
東海旅客鉄道	25.2	29.4	661,500		静岡銀行	252	294	49,539		(注) 単位未満は切捨て。				
日本通運	25.2	29.4	170,226		みずほフィナンシャルG	252	294	149,499		銘柄別				
ヤマトホールディングス	252	294	558,306		証券・商品先物取引業 (0.3%)					当期末				
海運業 (0.1%)					大和証券G本社	252	294	149,499		買建額 売建額				
日本郵船	25.2	29.4	54,860		野村ホールディングス	252	294	139,561		国内				
商船三井	25.2	29.4	85,495		松井証券	252	294	277,242		日経平均				
川崎汽船	25.2	29.4	38,837		保険業 (1.0%)					銘柄別				
空運業 (0.1%)					SOMPOホールディングス	63	73.5	340,966		当期末				
ANAホールディングス	25.2	29.4	109,691		MS&AD	75.6	88.2	317,520		買建額 売建額				
倉庫・運輸関連業 (0.2%)					SONYFH	50.4	58.8	140,414		国内				
三菱倉庫	126	147	403,809		第一生命HLDGS	25.2	29.4	47,863		日経平均				
情報・通信業 (10.6%)					東京海上HD	126	147	867,153		(注) 単位未満は切捨て。				
ヤフー	100.8	117.6	36,926		T&Dホールディングス	50.4	58.8	67,767		銘柄別				
トレンドマイクロ	252	294	1,546,440		その他金融業 (0.2%)					当期末				
不動産業 (1.7%)					クレディセゾン	252	294	406,308		買建額 売建額				
東急不動産HD					252	294	200,508		国内					

ストックインデックス225・マザーファンド

■投資信託財産の構成

2019年9月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	178,209,911 千円	97.6 %
コール・ローン等、その他	4,381,957	2.4
投資信託財産総額	182,591,868	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

2019年9月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	183,455,405,305円
コール・ローン等	561,593,534
株式 (評価額)	178,209,911,040
未収入金	3,642,098,631
未収配当金	140,315,000
差入委託証拠金	901,487,100
(B) 負債	2,110,121,593
未払解約金	1,243,815,000
差入委託証拠金代用有価証券	866,300,000
その他未払費用	6,593
(C) 純資産総額 (A - B)	181,345,283,712
元本	65,724,660,910
次期繰越損益金	115,620,622,802
(D) 受益権総口数	65,724,660,910口
1万口当り基準価額 (C / D)	27,592円

* 期首における元本額は56,651,695,845円、当作成期間中における追加設定元本額は20,929,762,181円、同解約元本額は11,856,797,116円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ストックインデックス ファンド225 32,674,102,769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225V A631,369,403円、大和 ストックインデックス225ファンド11,492,278,360円、D-1's 日経225インデックス205,107,795円、iFree日経225インデックス2,186,833,172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) 5,584,885,712円、ダイワ・ノーロード 日経225ファンド313,091,286円、ダイワファンドラップ 日経225インデックス3,486,838,688円、ダイワ日経225インデックス (ダイワSMA専用) 344,938,346円、ダイワ・インデックスセレクト日経225 8,805,215,379円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は27,592円です。

■損益の状況

当期 自 2018年9月20日 至 2019年9月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,558,286,890円
受取配当金	3,559,293,684
受取利息	49
その他収益金	500,163
支払利息	△ 1,507,006
(B) 有価証券売買損益	9,159,607,116
売買益	10,703,444,465
売買損	△ 19,863,051,581
(C) 先物取引等損益	155,416,765
取引益	673,487,272
取引損	△ 828,904,037
(D) その他費用	922,219
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	5,757,659,210
(F) 前期繰越損益金	107,633,546,777
(G) 解約差損益金	20,811,750,784
(H) 追加信託差損益金	34,556,486,019
(I) 合計 (E + F + G + H)	115,620,622,802
次期繰越損益金 (I)	115,620,622,802

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

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

ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジあり) (ダイワSMA専用)

運用報告書(全体版) 第4期

(決算日 2020年6月15日)

(作成対象期間 2019年6月18日~2020年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、外国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
1 期末(2017年 6月15日)	10,413	60	4.7	10,395	4.0	94.0	3.8	0.0	2.5	3
2 期末(2018年 6月15日)	11,436	100	10.8	11,319	8.9	96.6	3.4	—	2.3	1,333
3 期末(2019年 6月17日)	11,475	190	2.0	11,338	0.2	93.1	6.1	—	2.8	3,003
4 期末(2020年 6月15日)	11,475	160	1.4	11,331	△ 0.1	96.4	2.0	—	2.7	7,959

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

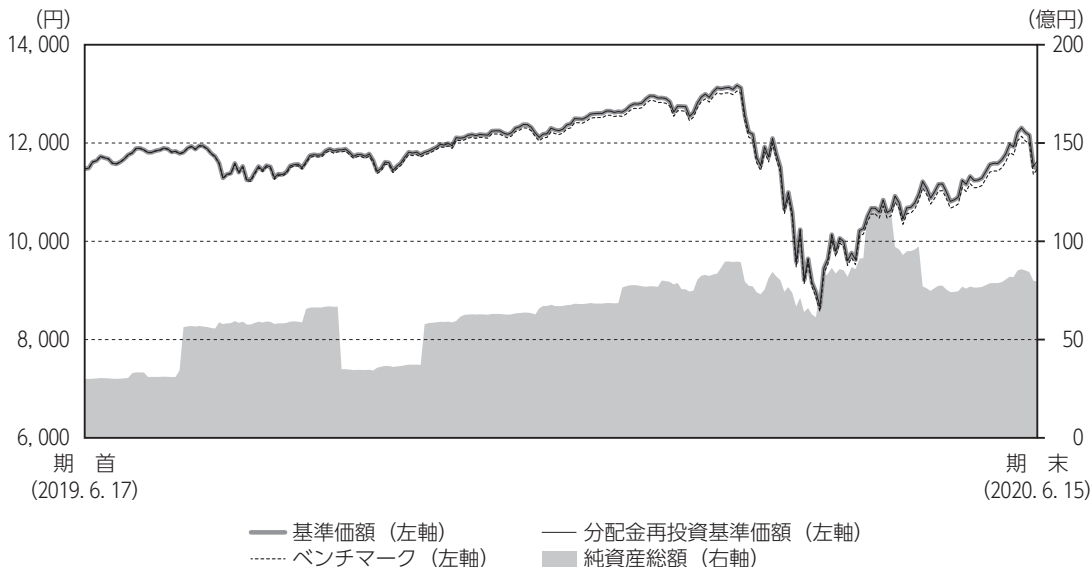
(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

* ベンチマークはMSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース）です。

■ 基準価額・騰落率

期首：11,475円

期末：11,475円（分配金160円）

騰落率：1.4%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドの受益証券を通じてベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ヘッジ・ベース））の動きに連動させることをめざして運用を行った結果、各国の大胆な景気刺激策や新型コロナウイルスの治療薬開発への期待などを好感して外国株式市況が底入れしたことを受け、基準価額はやや上昇しました。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（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 組入比率
	円	騰 落 率 %	(ベンチマーク)	騰 落 率 %				
(期首)2019年 6月17日	11,475	—	11,338	—	93.1	6.1	—	2.8
6月末	11,616	1.2	11,472	1.2	90.9	6.0	—	2.7
7月末	11,885	3.6	11,736	3.5	86.9	10.8	—	2.6
8月末	11,536	0.5	11,366	0.3	91.6	3.5	—	2.8
9月末	11,730	2.2	11,549	1.9	97.6	1.2	—	3.0
10月末	11,991	4.5	11,796	4.0	90.7	8.0	—	2.8
11月末	12,375	7.8	12,157	7.2	93.3	5.0	—	2.8
12月末	12,651	10.2	12,416	9.5	93.3	4.7	—	2.7
2020年 1月末	12,741	11.0	12,495	10.2	90.5	6.7	—	2.7
2月末	11,706	2.0	11,459	1.1	92.0	5.9	—	2.9
3月末	10,064	△ 12.3	9,844	△ 13.2	90.3	7.5	—	2.6
4月末	11,216	△ 2.3	10,953	△ 3.4	94.6	2.1	—	2.7
5月末	11,588	1.0	11,295	△ 0.4	95.6	2.3	—	2.7
(期末)2020年 6月15日	11,635	1.4	11,331	△ 0.1	96.4	2.0	—	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

（2019. 6. 18 ~ 2020. 6. 15）

■海外株式市況

海外株式市況は横ばいとなりました。

米国・欧州を中心とした海外株式市況は、当作成期首より、世界的な金融緩和期待や英国の合意なきEU（欧州連合）離脱懸念の後退などを受け、上昇基調となりました。2019年11月以降は、米中通商協議の進展期待が高まり、底堅い展開となりました。2020年1月以降は、米中通商協議の第1段階合意による米国の対中追加関税回避などを背景に、上昇しました。2月以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大や原油価格の急落などを受けて、大きく下落しました。3月下旬以降は、各国の大胆な景気刺激策やウイルス治療薬開発への期待などを好感し、上昇して当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

(2019. 6. 18 ~ 2020. 6. 15)

■当ファンド

「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の受益証券組入比率は、当作成期を通じておおむね100%程度を維持しました。なお、当作成期末のマザーファンド組入比率は101.4%となっておりますが、翌営業日計上のマザー解約金額を考慮したマザーファンド実質組入比率は100%程度となっております。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

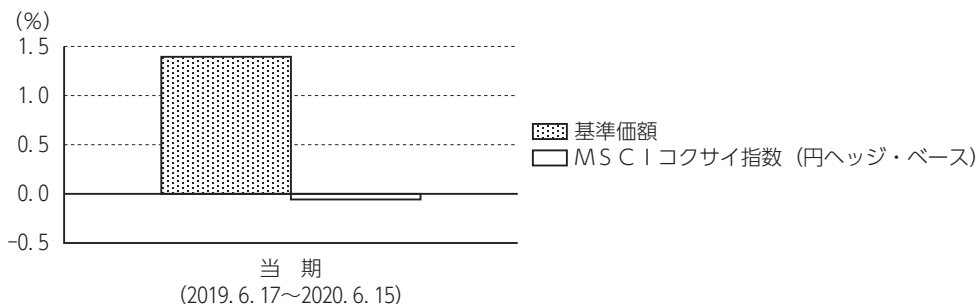
ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式（投資信託証券、株式先物を含む。）のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は $\Delta 0.1\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は 1.4% となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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	
	2019年6月18日 ～2020年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	160
対基準価額比率	（％）	1.38
当期の収益	（円）	160
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	1,474

■ 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	✓ 167.70円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	358.10
(c) 収益調整金	1,098.07
(d) 分配準備積立金	10.79
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	1,634.67
(f) 分配金	160.00
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	1,474.67

- (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) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■ 当ファンド

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

■ 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2019. 6. 18~2020. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	52円	0. 441%	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11,714円です。
（投 信 会 社）	(36)	(0. 310)	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. 109)	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. 012	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. 008)	
（先物・オプション）	(0)	(0. 004)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
有 価 証 券 取 引 税	2	0. 014	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. 014)	
（投資信託証券）	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	4	0. 036	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. 028)	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. 003)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	59	0. 502	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

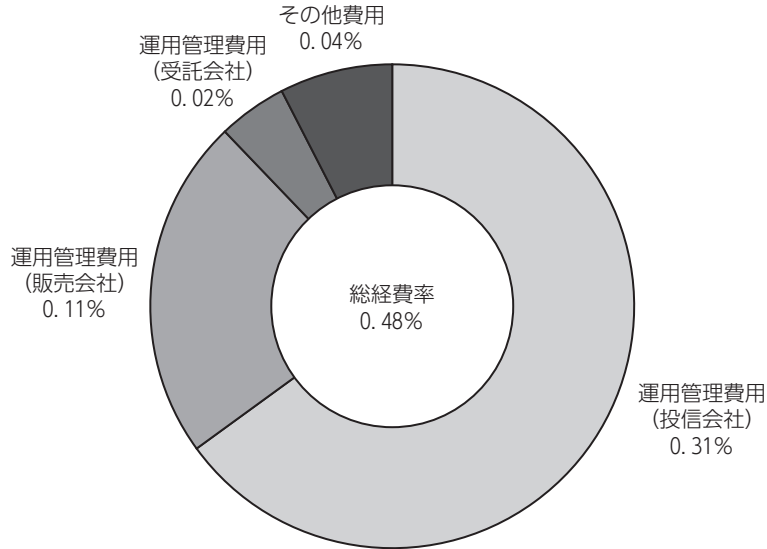
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

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



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2019年6月18日から2020年6月15日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数 千口	金 額 千円	□ 数 千口	金 額 千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	7,551,466	14,366,900	5,041,449	9,742,278

（注）単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2019年6月18日から2020年6月15日まで）

項 目	当 期
	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	17,647,758千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	45,458,673千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.38

（注1）(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

（注2）単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

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

（注1）金額は元本ベース。

（注2）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	□ 数 千口	金 額 千円	評 価 額 千円	□ 数 千口	金 額 千円	評 価 額 千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	1,573,697	4,083,714	8,069,419			

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額 千円	比 率 %
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	8,069,419	99.8
コール・ローン等、その他	19,079	0.2
投資信託財産総額	8,088,499	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。

（注2）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.24円、1カナダ・ドル=78.66円、1オーストラリア・ドル=73.06円、1香港・ドル=13.84円、1シンガポール・ドル=76.86円、1ニュージーランド・ドル=68.74円、1イギリス・ポンド=134.14円、1イスラエル・シェケル=30.85円、1スイス・フラン=112.71円、1デンマーク・クローネ=16.19円、1ノルウェー・クローネ=11.07円、1スウェーデン・クローネ=11.48円、1ユーロ=120.68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（53,821,223千円）の投資信託財産総額（54,769,739千円）に対する比率は、98.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	8,088,499,551円
コール・ローン等	19,079,626
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）	8,069,419,925
(B) 負債	128,988,655
未払収益分配金	110,985,385
未払信託報酬	17,783,761
その他未払費用	219,509
(C) 純資産総額（A - B）	7,959,510,896
元本	6,936,586,592
次期繰越損益金	1,022,924,304
(D) 受益権総口数	6,936,586,592口
1万口当り基準価額（C / D）	11,475円

* 期首における元本額は2,617,621,424円、当作成期間中における追加設定元本額は12,869,207,903円、同解約元本額は8,550,242,735円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,475円です。

■損益の状況

当期 自 2019年6月18日 至 2020年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,128円
受取利息	1,096
支払利息	△ 3,224
(B) 有価証券売買損益	394,061,635
売買益	724,059,140
売買損	△ 329,997,505
(C) 信託報酬等	△ 29,326,019
(D) 当期損益金 (A + B + C)	364,733,488
(E) 前期繰越損益金	7,486,519
(F) 追加信託差損益金	761,689,682
(配当等相当額)	(496,995,163)
(売買損益相当額)	(264,694,519)
(G) 合計 (D + E + F)	1,133,909,689
(H) 収益分配金	△ 110,985,385
次期繰越損益金 (G + H)	1,022,924,304
追加信託差損益金	761,689,682
(配当等相当額)	(496,995,163)
(売買損益相当額)	(264,694,519)
分配準備積立金	261,234,622

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	116,328,598円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	248,404,890
(c) 収益調整金	761,689,682
(d) 分配準備積立金	7,486,519
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,133,909,689
(f) 分配金	110,985,385
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,022,924,304
(h) 受益権総口数	6,936,586,592口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	160円

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

《お知らせ》

■商号変更について

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

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（ダイワ外国株式インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用））が投資対象としている「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の決算日（2020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（2020年6月15日）現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの主要な売買銘柄

（2019年6月18日から2020年6月15日まで）

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
MICROSOFT CORP (アメリカ)	27.692	460,731	16,637	CELGENE CORP (アメリカ)	7.75	91,895	11,857
APPLE INC (アメリカ)	14.598	399,889	27,393	APPLE INC (アメリカ)	2.869	84,523	29,460
AMAZON.COM INC (アメリカ)	1.644	347,293	211,249	MICROSOFT CORP (アメリカ)	2.994	49,831	16,643
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	9.084	181,226	19,950	FIDELITY NATIONAL INFO SERV (アメリカ)	2.67	38,657	14,478
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	1.308	176,792	135,162	BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)	13.541	36,802	2,717
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	9.574	142,872	14,922	LINDE PLC (アイルランド)	1.5	33,756	22,504
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.998	129,950	130,210	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.138	26,082	189,000
NESTLE SA-REG (スイス)	11.135	127,854	11,482	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	2.173	25,225	11,608
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	5.844	125,153	21,415	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.183	24,330	132,953
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	10.668	122,989	11,528	NOVO NORDISK A/S-B (デンマーク)	3.295	21,016	6,378

(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、2020年6月15日現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（27,661,024千円）の内容です。

(1)外国株式

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	17.72	215	23,113	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	15.58	345	37,066	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22.71	217	23,299	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	15.94	122	13,157	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	11.76	123	13,201	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	62	147	15,804	金融
ABBOTT LABORATORIES	233.99	2,082	223,378	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	39.5	55	5,930	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	22.96	373	40,053	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	47.29	235	25,290	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	41.67	395	42,457	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	82.1	1,125	120,690	情報技術
QORVO INC	11.79	128	13,768	情報技術
AFLAC INC	102.3	374	40,196	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	12.48	94	10,163	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	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	18.35	90	9,666	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	63.41	2,577	276,450	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	28.72	84	9,055	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	16.07	476	51,073	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	44.09	53	5,768	金融
GARMIN LTD	21.67	198	21,303	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	28.19	662	71,054	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	94.35	1,363	146,216	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	17.71	100	10,829	金融
AUTOZONE INC	2.91	320	34,343	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	33.98	298	31,983	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	123.65	139	14,917	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	15.08	114	12,225	公益事業
CELANESE CORP	12.97	114	12,312	素材
DR HORTON INC	43.97	237	25,462	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	106	11,397	ヘルスケア
AUTODESK INC	29.66	661	70,917	情報技術
MOODY'S CORP	21.43	572	61,356	金融
ALBEMARLE CORP	16.68	128	13,830	素材
ATMOS ENERGY CORP	16.54	166	17,813	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	36.14	175	18,816	公益事業
CITIGROUP INC	275.73	1,440	154,499	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	58.36	857	92,006	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	67.27	550	59,010	公益事業
ALLEGHANY CORP	3.03	152	16,385	金融
DOMINO'S PIZZA INC	5.26	198	21,330	一般消費財・サービス
HESS CORP	28.96	143	15,407	エネルギー
DAVITA INC	10	78	8,391	ヘルスケア
DANAHER CORP	81.3	1,368	146,803	ヘルスケア
FORTIVE CORP	43.35	275	29,589	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	77.19	719	77,199	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	79.45	313	33,595	生活必需品
BUNGE LTD	18.38	72	7,764	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	48.76	383	41,094	情報技術
APPLE INC	578.64	19,604	2,102,367	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33.59	177	19,088	金融
BOEING CO/THE	71.42	1,353	145,147	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20.63	125	13,502	金融
BECTON DICKINSON AND CO	36.29	837	89,852	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	20	35	3,817	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	14	138	14,849	情報技術
CDK GLOBAL INC	11	45	4,891	情報技術
NISOURCE INC	40.26	93	10,042	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17.08	132	14,237	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	115.44	443	47,587	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	543.42	3,071	329,436	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	180.48	3,270	350,726	金融
ANSYS INC	9.89	267	28,664	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	186.11	734	78,775	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	94.37	525	56,400	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	297.06	1,668	178,939	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	404.57	4,040	433,296	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	34.32	415	44,508	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	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LKQ CORP	33	85	9,160	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5.47	100	10,761	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	36.65	239	25,645	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	36.14	323	34,671	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16.11	236	25,334	金融
DOLLAR GENERAL CORP	33.72	620	66,536	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	23.83	917	98,421	情報技術
CATERPILLAR INC	73.36	903	96,883	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	43.2	175	18,841	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	22.01	96	10,378	公益事業
CMS ENERGY CORP	33.84	197	21,157	公益事業
MOSAIC CO/THE	52.09	69	7,418	素材
DELTA AIR LINES INC	16.5	50	5,384	資本財・サービス
CORNING INC	117.57	316	33,953	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	557.39	2,512	269,403	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	25.29	147	15,830	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	161.03	745	79,920	金融
MSCI INC	11.95	383	41,130	金融
FAIR ISAAC CORP	3.98	164	17,649	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	4.5	98	10,568	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	38.45	217	23,358	情報技術
BROADCOM INC	52.62	1,579	169,430	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14.16	177	19,040	ヘルスケア
ARAMARK	31.73	80	8,608	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	16.12	35	3,836	素材
DTE ENERGY COMPANY	27.39	287	30,862	公益事業
CENTENE CORP	77.79	481	51,671	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	13.58	135	14,548	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	55.32	142	15,317	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	22.32	212	22,815	金融
GARTNER INC	11.74	139	14,948	情報技術
SPLUNK INC	20.29	362	38,922	情報技術
DOMINION ENERGY INC	109.95	914	98,042	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	55.55	379	40,687	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	14	65	7,048	資本財・サービス
DEERE & CO	39.2	607	65,146	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	38.66	690	74,037	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	13.43	182	19,565	情報技術
CABLE ONE INC	0.6	103	11,103	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	10.81	220	23,594	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	14.27	164	17,621	金融
VAIL RESORTS INC	8.18	150	16,158	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	14.61	53	5,721	金融
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	8.94	78	8,434	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	54	5,842	金融
CONSOLIDATED EDISON INC	46.02	346	37,201	公益事業
COGNEX CORP	24.39	134	14,427	情報技術
TELEFLEX INC	7.85	276	29,653	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	14.53	165	17,779	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8.52	171	18,340	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	3	134	14,440	ヘルスケア
CATALENT INC	20	139	14,921	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	19.55	423	45,427	ヘルスケア

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MOLINA HEALTHCARE INC	8	135	14,575	ヘルスケア
IDEX CORP	11.56	176	18,916	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	101.83	741	79,488	生活必需品
ROLLINS INC	28.36	117	12,594	資本財・サービス
AMETEK INC	25.97	227	24,413	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	28.83	210	22,594	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	29.02	113	12,127	資本財・サービス
HEICO CORP	5.35	58	6,281	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	10.6	79	8,507	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	6.46	185	19,881	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	34.22	227	24,444	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	5.09	174	18,706	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	58.63	1,751	187,807	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	11.28	116	12,538	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	7.49	176	18,875	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	17.5	128	13,773	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3.95	391	42,013	一般消費財・サービス
UGI CORP	20.85	64	6,938	公益事業
CUMMINS INC	20.71	346	37,107	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	99.82	715	76,731	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	17.92	204	21,927	情報技術
SIGNATURE BANK	7.69	82	8,896	金融
COSTAR GROUP INC	4.92	328	35,249	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	6.9	143	15,430	金融
AMERCO	0.7	22	2,363	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	12.39	195	20,977	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	6.03	540	57,968	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	144	15,461	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	38.01	294	31,570	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	2.5	39	4,186	情報技術
DEXCOM INC	11.88	439	47,167	ヘルスケア
NORDSON CORP	7.5	139	14,934	資本財・サービス
COPART INC	24.95	212	22,753	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	15.91	74	8,012	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	15.45	233	25,045	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	9.63	242	25,962	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	6.98	312	33,488	資本財・サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	12.03	138	14,812	ヘルスケア
NIELSEN HOLDINGS PLC	43.47	65	7,048	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	278.51	431	46,294	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	37.4	376	40,328	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	5.44	268	28,748	金融
CABOT OIL & GAS CORP	46.08	92	9,917	エネルギー
T-MOBILE US INC	53.79	550	59,016	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	17.86	101	10,877	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	539.06	2,458	263,608	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	25.75	98	10,534	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.46	143	15,353	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	38.51	83	8,998	金融
CSX CORP	94.51	657	70,510	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15.19	254	27,322	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	15.63	128	13,831	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	8	50	5,416	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AMAZON.COM INC	55.94	14,236	1,526,758	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	81.09	551	59,116	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	568.34	2,680	287,495	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	16.13	66	7,137	情報技術
AES CORP	83.41	105	11,333	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	5.71	122	13,162	金融
EOG RESOURCES INC	76.55	402	43,155	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	19.14	192	20,595	情報技術
ABIOMED INC	5.55	134	14,384	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	19.89	188	20,235	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	43.33	373	40,012	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	567.4	366	39,307	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	42.42	93	10,039	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	17.21	146	15,755	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	53	5,786	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	45.54	89	9,620	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	18.24	62	6,699	資本財・サービス
FORTINET INC	15.95	207	22,294	情報技術
MARKEL CORP	1.77	168	18,031	金融
NEXTERA ENERGY INC	64.48	1,592	170,734	公益事業
MASIMO CORP	2.54	55	5,921	ヘルスケア
FREEMPORT-MCMORAN INC	233.66	245	26,285	素材
INSULET CORP	7.69	138	14,890	ヘルスケア
US BANCORP	180.05	675	72,426	金融
UNITED RENTALS INC	10.55	151	16,234	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	11.11	155	16,718	情報技術
FASTENAL CO	79.24	317	34,041	資本財・サービス
FISERV INC	79.25	795	85,276	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	1,169.58	847	90,933	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	165.43	462	49,603	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	32.11	479	51,376	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	40.6	819	87,853	金融
ALPHABET INC-CL A	39.89	5,636	604,419	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	40.37	5,705	611,805	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	17.63	92	9,967	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	78.49	472	50,629	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	76.12	307	33,003	公益事業
GENUINE PARTS CO	17.7	151	16,246	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	52.47	366	39,281	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	81	168	18,072	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	27.79	536	57,562	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	102.3	130	14,020	エネルギー
HOME DEPOT INC	144.03	3,492	374,482	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	8.4	89	9,641	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	166.84	164	17,686	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5	91	9,774	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	17.25	222	23,883	生活必需品
HUMANA INC	17.33	656	70,383	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	41.26	438	46,977	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9.17	240	25,753	情報技術
HENRY SCHEIN INC	18.7	105	11,356	ヘルスケア
HP INC	207.61	337	36,245	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	200.5	203	21,824	情報技術

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	13.95	49	5,289	コミュニケーション・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	17.83	55	6,000	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	27.62	100	10,748	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20.28	72	7,783	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	50.11	153	16,449	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	100.97	321	34,433	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	116.1	1,415	151,784	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	141	15,155	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	87	9,394	資本財・サービス
ZOETIS INC	64.78	868	93,138	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	32.74	295	31,736	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	24.84	114	12,280	エネルギー
ALLEGION PLC	11.1	113	12,190	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	51.08	111	11,925	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	34.31	309	33,191	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	49.12	117	12,584	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC	8.64	137	14,718	ヘルスケア
JM SMUCKER CO/THE	13.93	145	15,640	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	348.16	4,949	530,740	ヘルスケア
ABBVIE INC	232.72	2,151	230,751	ヘルスケア
HOLOGIC INC	30.42	152	16,360	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	44.29	602	64,566	生活必需品
KROGER CO	116.59	376	40,335	生活必需品
KLA CORP	19.19	354	38,008	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	33.57	1,281	137,474	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	12.54	324	34,828	情報技術
LOWE'S COS INC	102.13	1,287	138,055	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	113.55	1,629	174,790	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	19.74	561	60,230	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	5.87	64	6,872	不動産
LOEWS CORP	35.91	118	12,715	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	26.43	107	11,530	金融
MCDONALD'S CORP	99.87	1,889	202,602	一般消費財・サービス
3M CO	76.02	1,177	126,255	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	317.69	7,261	778,750	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	32.65	1,034	110,962	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7.67	151	16,207	素材
CONCHO RESOURCES INC	25.52	148	15,873	エネルギー
PHILLIPS 66	62.29	481	51,609	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	56.59	108	11,633	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	18.19	302	32,486	生活必需品
MYLAN NV	92.06	146	15,736	ヘルスケア
METLIFE INC	107.4	402	43,133	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	86.17	290	31,169	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	5.93	132	14,167	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	24.19	74	8,041	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22.32	313	33,653	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.84	217	23,281	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	84.46	134	14,437	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	14.6	303	32,596	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	335.38	2,558	274,421	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	102.74	524	56,201	素材
MASCO CORP	35.43	162	17,397	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	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
M & T BANK CORP	19.84	216	23,182	金融
MARSH & MCLENNAN COS	63.47	662	71,019	金融
BLACK KNIGHT INC	16.44	118	12,711	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	16.56	151	16,217	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	40.06	369	39,635	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	24.35	422	45,319	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	6	110	11,888	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	49.26	427	45,811	情報技術
TRANSUNION	30.46	267	28,716	資本財・サービス
VISTRA ENERGY CORP	42.85	86	9,282	公益事業
BEIGENE LTD-ADR	3.5	57	6,152	ヘルスケア
NETAPP INC	39.51	167	17,990	情報技術
NIKE INC -CL B	164.61	1,587	170,225	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	33.43	595	63,878	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	34.92	347	37,309	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17.49	125	13,429	金融
ALLY FINANCIAL INC	50.94	104	11,165	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	21.96	697	74,813	資本財・サービス
APTIV PLC	39.89	301	32,365	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	104.13	577	61,920	素材
MCKESSON CORP	21.61	320	34,356	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	32.57	186	19,961	情報技術
XYLEM INC	19.72	126	13,568	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	205.16	1,444	154,933	生活必需品
NUCOR CORP	36.92	152	16,312	素材
WESTERN UNION CO	68.11	153	16,448	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	19.3	147	15,783	情報技術
NEWELL BRANDS INC	40.58	62	6,658	一般消費財・サービス
EVERGY INC	32.43	194	20,894	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	102.38	189	20,311	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	47	5,127	金融
OKTA INC	17.07	305	32,811	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	5	112	12,011	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	13.5	173	18,600	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	48.77	107	11,542	ヘルスケア
LINDE PLC	65.58	1,324	142,020	素材
WIX.COM LTD	7.85	169	18,188	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	61.84	127	13,661	金融
KKR & CO INC	80.96	235	25,308	金融
PAYCHEX INC	46	339	36,386	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	10.51	431	46,250	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	247.49	968	103,854	生活必需品
PFIZER INC	731.26	2,468	264,668	ヘルスケア
CIGNA CORP	50.09	951	102,072	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	19.17	89	9,641	情報技術
ALTICE USA INC- A	10.38	24	2,678	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	65.28	415	44,558	公益事業
STERIS PLC	8.97	136	14,604	ヘルスケア
FOX CORP - CLASS B	15.3	42	4,585	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	52.67	149	15,979	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	44.82	841	90,261	ヘルスケア
DOW INC	108.97	449	48,181	素材
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	14.43	316	33,970	情報技術

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
PARKER HANNIFIN CORP	18.39	331	35,530	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	101.09	325	34,951	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	22.03	216	23,206	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	330.11	3,816	409,306	生活必需品
EXELON CORP	136.69	518	55,570	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	26.52	289	31,084	ヘルスケア
TELADOC HEALTH INC	7.76	133	14,336	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	53.97	168	18,069	資本財・サービス
NVR INC	0.45	142	15,323	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	141.85	620	66,522	エネルギー
TWILIO INC - A	15.26	292	31,402	情報技術
DOCUSIGN INC	17.21	259	27,794	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	7.91	239	25,685	情報技術
MATCH GROUP INC	9.28	80	8,683	コミュニケーション・サービス
PEPSICO INC	183.09	2,361	253,285	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4.09	40	4,303	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	23.92	50	5,394	情報技術
MONGODB INC	8.42	163	17,487	情報技術
SNAP INC - A	142.76	288	30,894	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	107.36	295	31,707	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	53.88	340	36,494	金融
AMCOR PLC	174.57	171	18,365	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	11.6	108	11,583	情報技術
ROKU INC	14.88	160	17,245	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20.92	266	28,557	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	83.03	1,673	179,498	情報技術
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	29.92	92	9,901	情報技術
PENTAIR PLC	15.75	59	6,333	資本財・サービス
QUALCOMM INC	146.03	1,244	133,488	情報技術
INVESCO LTD	37	38	4,102	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	8.19	111	11,921	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31.93	133	14,340	金融
DATADOG INC - CLASS A	8.41	65	7,039	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	43	89	9,633	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	5.86	62	6,658	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	13.27	780	83,732	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	26.67	217	23,375	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	5.38	873	93,692	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	48.88	452	48,477	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	16.1	159	17,079	素材
RESMED INC	19.83	318	34,171	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	18.12	200	21,491	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	14.99	76	8,245	資本財・サービス
MODERNA INC	30.38	188	20,199	ヘルスケア
RALPH LAUREN CORP	4	29	3,207	一般消費財・サービス
PERKINELMER INC	11.63	112	12,115	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	97.33	209	22,482	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	48.66	272	29,243	資本財・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	23	113	12,140	金融
AVANTOR INC	56	95	10,197	ヘルスケア
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	3	106	11,405	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	153.5	182	19,588	金融
CHEVRON CORP	252.16	2,329	249,837	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	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
EDISON INTERNATIONAL	49.85	286	30,776	公益事業
TESLA INC	19.15	1,791	192,073	一般消費財・サービス
NORTONLIFELOCK INC	79.44	157	16,910	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	22	288	30,927	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	20.31	364	39,117	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	19.74	1,031	110,623	コミュニケーション・サービス
CBRE GROUP INC - A	38.49	183	19,635	不動産
TWITTER INC	84.84	283	30,388	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	139.16	781	83,825	公益事業
SYSCO CORP	61.6	334	35,844	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	35.23	399	42,816	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	19.25	108	11,620	金融
STEEL DYNAMICS INC	23	60	6,516	素材
SCHLUMBERGER LTD	178.99	340	36,470	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	75	8,051	資本財・サービス
AT&T INC	942.68	2,875	308,333	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	17.58	63	6,762	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	85.27	161	17,365	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	11.1	607	65,186	素材
SEMPRA ENERGY	39.15	485	52,081	公益事業
TIFFANY & CO	10.86	129	13,873	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	39.82	201	21,611	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	123.16	1,526	163,735	情報技術
SALESFORCE.COM INC	109.44	1,916	205,515	情報技術
WESTROCK CO	45.88	129	13,879	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	99.06	341	36,596	資本財・サービス
TERADYNE INC	20.96	150	16,127	情報技術
UNION PACIFIC CORP	91.28	1,516	162,671	資本財・サービス
MARATHON PETROLEUM CORP	97.95	358	38,466	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	201.42	1,316	141,201	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	95.34	967	103,755	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	24.35	338	36,249	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	18	86	9,238	金融
AMEREN CORPORATION	28.61	205	22,013	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	124.99	3,564	382,212	ヘルスケア
VERISIGN INC	13.65	278	29,886	情報技術
VALERO ENERGY CORP	58.84	375	40,251	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	6.35	143	15,432	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	95	10,280	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9.92	94	10,167	ヘルスケア
ANTHEM INC	34.67	921	98,802	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	239.98	2,771	297,218	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	510.22	1,427	153,040	金融
WASTE MANAGEMENT INC	60.2	625	67,069	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	171.23	312	33,475	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	15.91	188	20,209	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	8.7	106	11,391	一般消費財・サービス
WALMART INC	188.95	2,224	238,576	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	29.52	369	39,631	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	11.45	105	11,334	一般消費財・サービス
WABTEC CORP	18.98	115	12,393	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	161.8	848	91,025	一般消費財・サービス
WATERS CORP	10.35	192	20,595	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	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5.55	143	15,375	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	105.4	436	46,794	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	18.68	348	37,414	金融
WESTERN DIGITAL CORP	35.31	151	16,263	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	41.89	378	40,569	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	68.77	341	36,660	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	225.53	4,336	464,996	情報技術
PPL CORP	101.94	270	29,024	公益事業
PULTEGROUP INC	35.56	120	12,923	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	32.34	328	35,246	素材
NORTHERN TRUST CORP	30.62	256	27,454	金融
NVIDIA CORP	81.07	2,896	310,634	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	10.21	280	30,033	コミュニケーション・サービス
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	57.38	635	68,155	金融
HD SUPPLY HOLDINGS INC	24.82	85	9,126	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	43.27	269	28,862	生活必需品
NETFLIX INC	58.14	2,430	260,663	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	52.87	1,796	192,636	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	30	101	10,835	公益事業
GLOBE LIFE INC	12.15	92	9,889	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	25.52	272	29,201	金融
TEXTRON INC	43.1	147	15,784	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	79.99	93	10,053	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	24.52	75	8,114	公益事業
OMNICOM GROUP	25.46	140	15,025	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	302.97	1,571	168,495	情報技術
MASTERCARD INC - A	118.21	3,520	377,503	情報技術
ONEOK INC	45.66	155	16,692	エネルギー
CENTURYLINK INC	165.34	166	17,872	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	12.69	494	53,048	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	41.58	379	40,702	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	17.51	234	25,162	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	33.74	128	13,767	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	1,034.93	2,564	275,023	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4.18	139	14,951	資本財・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	29.08	307	32,969	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	94.04	956	102,542	金融
ANALOG DEVICES INC	48.3	571	61,332	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	143.08	765	82,089	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	34.8	136	14,659	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	123.38	407	43,716	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22.83	289	31,071	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17.84	109	11,704	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	11.31	128	13,766	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	75	411	44,075	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	78.46	481	51,620	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	30.57	556	59,649	金融
AMGEN INC	78.71	1,715	183,926	ヘルスケア
EATON CORP PLC	56.81	488	52,399	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	21.81	371	39,826	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	119.64	676	72,554	情報技術
CME GROUP INC	45.88	801	85,965	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33.89	43	4,641	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	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ECOLAB INC	33.15	676	72,543	素材
EQUIFAX INC	17.75	298	31,975	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	168.08	1,230	131,942	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	45.94	129	13,853	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	33.15	154	16,591	生活必需品
STATE STREET CORP	51.38	324	34,779	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	150.07	548	58,837	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	62.75	526	56,506	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	33	155	16,657	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	24.45	159	17,103	素材
CARDINAL HEALTH INC	33.19	175	18,825	ヘルスケア
FEDEX CORP	34.51	458	49,117	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	63.88	451	48,385	金融
FMC CORP	19.5	189	20,355	素材
CERNER CORP	41.33	276	29,678	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11.63	147	15,820	素材
CITRIX SYSTEMS INC	18.13	255	27,363	情報技術
INTEL CORP	563	3,340	358,211	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	52.31	90	9,693	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	48.66	194	20,888	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	40.4	666	71,460	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	153	90	9,737	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	19.71	673	72,206	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	14.5	44	4,755	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	15.22	849	91,143	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	17.9	189	20,363	情報技術
SNAP-ON INC	5	67	7,239	資本財・サービス
CARMAX INC	19.9	179	19,202	一般消費財・サービス
COMERICA INC	28.87	112	12,117	金融
INGREDION INC	5.3	43	4,671	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	97.58	846	90,768	公益事業
TARGET CORP	64.74	756	81,160	一般消費財・サービス
DOVER CORP	17.13	165	17,747	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	5.88	178	19,153	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17.5	140	15,105	資本財・サービス
CINTAS CORP	13.36	355	38,139	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	55.67	180	19,348	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	15	97	10,451	生活必需品
CLOROX COMPANY	16.28	333	35,811	生活必需品
ENERGY CORP	29.14	280	30,130	公益事業
MICROSOFT CORP	956.07	17,949	1,924,878	情報技術
INCYTE CORP	26.89	247	26,550	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	171.33	1,099	117,865	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	176.04	1,640	175,966	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	146.66	714	76,578	情報技術
BLACKROCK INC	19.17	1,010	108,348	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	56.36	101	10,879	公益事業
HASBRO INC	14.49	107	11,545	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	36.9	234	25,163	生活必需品
KEYCORP	117.82	155	16,703	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	11.76	173	18,572	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	193.6	982	105,323	生活必需品
COOPER COS INC/THE	5.72	164	17,690	ヘルスケア

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CHUBB LTD	62.98	791	84,890	金融
ARROW ELECTRONICS INC	10	66	7,099	情報技術
ALLSTATE CORP	39.99	382	41,041	金融
EBAY INC	109.11	520	55,766	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	146.45	2,273	243,840	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	26.83	186	20,034	素材
XILINX INC	35.41	321	34,442	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	29.84	97	10,464	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA	19	66	7,107	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	27.45	525	56,337	生活必需品
TRIMBLE INC	46	189	20,289	情報技術
LENNAR CORP-A	33.94	201	21,565	一般消費財・サービス
LEAR CORP	6	66	7,096	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	39.17	186	20,028	金融
PROGRESSIVE CORP	73.91	566	60,713	金融
PACCAR INC	48.25	353	37,860	資本財・サービス
BIOGEN INC	24	670	71,877	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	12	363	38,970	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	156.55	1,195	128,229	一般消費財・サービス
PTC INC	12	90	9,672	情報技術
PERRIGO CO PLC	19.29	99	10,651	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	42.9	361	38,787	公益事業
INTUIT INC	34.01	954	102,370	情報技術
BORGWARNER INC	30.81	103	11,085	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	35	272	29,186	一般消費財・サービス
BALL CORP	35.8	244	26,233	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	184.24	651	69,844	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	36.77	448	48,095	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	16.06	180	19,304	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	34.56	928	99,534	ヘルスケア
VF CORP	50.92	311	33,446	一般消費財・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B	72.02	164	17,686	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	9.42	92	9,873	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10.03	115	12,400	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	49.92	99	10,696	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	601.31	2,372	254,455	コミュニケーション・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	21	46	5,001	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	36	158	16,971	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	56	27	2,906	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	231	93	9,983	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	39,108.36 585銘柄	344,239 <67.5%>	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)				
IMPERIAL OIL LTD	23	53	4,186	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2.5	367	28,927	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	37.21	281	22,168	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	63	326	25,699	素材
INTACT FINANCIAL CORP	17	222	17,522	金融
BCE INC	9	51	4,055	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	22	386	30,401	素材
SUNCOR ENERGY INC	218.12	542	42,670	エネルギー
METRO INC/CN	30	172	13,547	生活必需品

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
NATIONAL BANK OF CANADA	51	311	24,467	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	166	971	76,399	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	57	535	42,154	金融
TORONTO-DOMINION BANK	242	1,510	118,801	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	39	92	7,301	金融
ROYAL BANK OF CANADA	190	1,735	136,526	金融
TC ENERGY CORP	127	747	58,820	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	90.71	303	23,874	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	240	785	61,807	素材
CAE INC	23	55	4,387	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	30.33	277	21,865	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	18	55	4,399	生活必需品
CCL INDUSTRIES INC - CL B	33	148	11,699	素材
HYDRO ONE LTD	48	121	9,518	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	24.89	165	13,007	生活必需品
WSP GLOBAL INC	12	101	7,998	資本財・サービス
PARKLAND CORP	28	96	7,613	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	23	67	5,337	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	43	229	18,034	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	31	2,440	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	56	333	26,244	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	29	233	18,376	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	70	131	10,329	公益事業
B2GOLD CORP	164	114	8,991	素材
AIR CANADA	17	32	2,594	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	220.34	185	14,610	素材
BANK OF MONTREAL	82	610	48,021	金融
POWER CORP OF CANADA	63	150	11,824	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	14	1,412	111,140	情報技術
NUTRIEN LTD	80.27	395	31,109	素材
CANOPY GROWTH CORP	20	44	3,530	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	34	29	2,345	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	43	214	16,857	素材
CAMECO CORP	28	38	3,043	エネルギー
TELUS CORP	6	13	1,099	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	44	62	4,883	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	13	156	12,309	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	152	369	29,101	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3	126	9,942	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	31	186	14,638	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	9.01	88	6,939	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	24	85	6,709	素材
BLACKBERRY LTD	64	45	3,594	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	88	441	34,714	金融
ENBRIDGE INC	267	1,124	88,482	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	180	835	65,753	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	266	499	39,294	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	43	99	7,853	ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	18	616	48,478	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	11	50	3,944	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	28	61	4,816	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	94	1,123	88,373	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	28	250	19,709	情報技術

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
ONEX CORPORATION	16	95	7,550	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	68	156	12,329	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	3	9	781	金融
OPEN TEXT CORP	45	256	20,147	情報技術
CI FINANCIAL CORP	20	33	2,644	金融
SAPUTO INC	29	93	7,393	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63	55	4,355	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	119	497	39,098	生活必需品
YAMANA GOLD INC	119	79	6,215	素材
FORTIS INC	62	318	25,062	公益事業
LUNDIN MINING CORP	66	43	3,405	素材
CENOVUS ENERGY INC	141	87	6,887	エネルギー
DOLLARAMA INC	50	239	18,839	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	8	29	2,289	公益事業
ALTAGAS LTD	47	70	5,575	公益事業
KEYERA CORP	22	45	3,583	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	48	58	4,587	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,133.38 79銘柄	23,087 <3.3%>	1,816,044
(オーストラリア)	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
MEDIBANK PRIVATE LTD	228.24	66	4,885	金融
BHP GROUP LTD	399.36	1,437	105,008	素材
SOUTH32 LTD	563.87	118	8,651	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	156.53	334	24,438	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	205.54	304	22,239	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	421.03	782	57,183	金融
WESTPAC BANKING CORP	495.02	885	64,701	金融
SANTOS LTD	182.7	98	7,207	エネルギー
AUSNET SERVICES	285	49	3,633	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	351.9	665	48,642	金融
RIO TINTO LTD	41.69	407	29,791	素材
ORIGIN ENERGY LTD	209.68	120	8,793	エネルギー
AURIZON HOLDINGS LTD	290.47	134	9,846	資本財・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	9.53	18	1,351	エネルギー
COLES GROUP LTD	166.96	265	19,407	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	61.32	130	9,506	情報技術
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	81.83	112	8,190	素材
EVOLUTION MINING LTD	170.17	93	6,837	素材
AFTERPAY LTD	30	155	11,366	情報技術
OIL SEARCH LTD	173.45	57	4,169	エネルギー
SEEK LTD	26	50	3,702	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	101.73	110	8,071	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	84.2	253	18,510	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	241.63	1,626	118,843	金融
AMPOL LTD	20	55	4,066	エネルギー
ORICA LTD	58.45	99	7,238	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	153.48	127	9,306	金融
CIMIC GROUP LTD	10	24	1,825	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	169.8	622	45,491	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	26	23	1,736	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	173.52	58	4,246	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	30	29	2,180	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等	
		株数	評価額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
QANTAS AIRWAYS LTD	293.95	131	9,642	資本財・サービス	
TELSTRA CORP LTD	351.14	110	8,106	コミュニケーション・サービス	
AMP LTD	249.35	42	3,124	金融	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	67.33	174	12,735	素材	
MACQUARIE GROUP LTD	50.31	581	42,490	金融	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	61.63	158	11,612	一般消費財・サービス	
CSL LTD	58.61	1,666	121,747	ヘルスケア	
WESFARMERS LTD	157.53	669	48,879	一般消費財・サービス	
COCHLEAR LTD	8.05	154	11,260	ヘルスケア	
BLUESCOPE STEEL LTD	70.92	84	6,165	素材	
SUNCORP GROUP LTD	145.04	134	9,854	金融	
ASX LTD	22.6	192	14,056	金融	
COMPUTERSHARE LTD	60.54	76	5,617	情報技術	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	152	11,165	金融	
SONIC HEALTHCARE LTD	52.23	146	10,711	ヘルスケア	
AGL ENERGY LTD	84.66	147	10,799	公益事業	
BRAMBLES LTD	183.37	200	14,669	資本財・サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20.64	135	9,889	ヘルスケア	
TPG TELECOM LTD	50	41	2,995	コミュニケーション・サービス	
REA GROUP LTD	6.08	62	4,558	コミュニケーション・サービス	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15.51	86	6,313	金融	
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	7,899.56 53銘柄	14,474 <1.9%>		
	百株	千香港・ドル	千円		
(香港)					
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	235	1,041	14,408	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	340	1,851	25,621	一般消費財・サービス	
MTR CORP	165	674	9,328	資本財・サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	190	1,905	26,374	不動産	
SINO LAND CO	340	328	4,550	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	375.52	1,954	27,051	資本財・サービス	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	80	356	4,938	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	260	2,029	28,085	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	205.65	607	8,410	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	1,638.36	2,054	28,434	公益事業	
HANG SENG BANK LTD	80	1,036	14,338	金融	
WHEELOCK & CO LTD	50	301	4,169	不動産	
NEW WORLD DEVELOPMENT	580	535	7,417	不動産	
WH GROUP LTD	1,695	1,142	15,811	生活必需品	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	169	5,005	69,279	金融	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	370	644	8,920	不動産	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	30	226	3,138	情報技術	
NWS HOLDINGS LTD	150	107	1,482	資本財・サービス	
KERRY PROPERTIES LTD	75	154	2,133	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	86	158	2,194	金融	
SJM HOLDINGS LTD	100	92	1,280	一般消費財・サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	80	155	2,156	不動産	
CK ASSET HOLDINGS LTD	285.52	1,341	18,572	不動産	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	226	3,132	公益事業	
PCCW LTD	600	268	3,711	コミュニケーション・サービス	
AIA GROUP LTD	1,678	11,980	165,815	金融	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140	482	6,675	不動産	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	192	452	6,257	生活必需品	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
SANDS CHINA LTD	百株 290	千香港・ドル 943	千円 13,064	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	190	1,405	19,445	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	390	939	13,008	金融
WYNN MACAU LTD	168	245	3,403	一般消費財・サービス
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,283.05 32銘柄	40,651 <1.0%>	
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	179	398	30,652	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	271	594	45,678	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	177.5	73	5,675	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	173	104	8,031	資本財・サービス
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	44	3,409	不動産
CAPITALAND LTD	334	100	7,701	不動産
YANGZIJANG SHIPBUILDING	270	26	2,033	資本財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9	19	1,511	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	447	413	31,745	金融
GENTING SINGAPORE LTD	450	34	2,663	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	32	48	3,750	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,284	327	25,165	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	48	3,738	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	168	138	10,652	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	62	4,808	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,145.5 15銘柄	2,435 <0.3%>	
(ニュージーランド)	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	150	71	4,908	公益事業
MERCURY NZ LTD	217.05	100	6,937	公益事業
A2 MILK CO LTD	70	131	9,046	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	168.6	73	5,018	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	269.72	174	12,014	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	92	261	17,960	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	44.19	56	3,903	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,011.56 7銘柄	869 <0.1%>	
(イギリス)	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BP PLC	2,701.83	872	117,080	エネルギー
UNILEVER PLC	151.43	651	87,426	生活必需品
BARCLAYS PLC	2,413.6	282	37,899	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	177.45	58	7,795	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	356.76	407	54,651	金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	508.36	60	8,094	金融
EVRAZ PLC	74.41	21	2,872	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	17.58	36	4,928	素材
BAE SYSTEMS PLC	377.96	190	25,593	資本財・サービス
AVIVA PLC	668	184	24,775	金融
AVEVA GROUP PLC	11.4	44	5,921	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC	661.9	1,058	141,988	ヘルスケア
INFORMA PLC	162	74	10,009	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	643.35	76	10,230	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	144.99	76	10,307	コミュニケーション・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
DCC PLC	9.38	62	8,432	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	79.63	155	20,914	一般消費財・サービス
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7.88	84	11,362	一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7.4	70	9,499	資本財・サービス
HALMA PLC	39.78	86	11,659	情報技術
GVC HOLDINGS PLC	88.05	65	8,806	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	64.11	40	5,402	一般消費財・サービス
M&G PLC	259.64	39	5,276	金融
RELX PLC	269.86	494	66,389	資本財・サービス
DIAGEO PLC	312.54	868	116,549	生活必需品
RIO TINTO PLC	155.23	713	95,700	素材
STANDARD CHARTERED PLC	434.31	185	24,870	金融
TESCO PLC	1,344.91	304	40,807	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	112.97	180	24,268	ヘルスケア
GLENCORE PLC	1,292.26	222	29,874	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	51	6,932	金融
SMITHS GROUP PLC	40.8	51	6,884	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	316.75	86	11,637	金融
PEARSON PLC	82.71	47	6,357	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	176.31	34	4,611	生活必需品
NEXT PLC	24.14	121	16,281	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	48	6,551	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	17.85	42	5,660	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	31.59	59	7,983	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	3,591.29	452	60,746	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	17.49	87	11,749	素材
KINGFISHER PLC	172.29	33	4,550	一般消費財・サービス
WPP PLC	130.21	80	10,804	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	74	9,974	公益事業
SEVERN TRENT PLC	43	103	13,877	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	314.32	150	20,255	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	91.11	629	84,426	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	48.83	45	6,069	金融
SCHRODERS PLC	12.27	35	4,797	金融
SSE PLC	124.6	154	20,700	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	65	8,723	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	174.08	1,427	191,502	ヘルスケア
FERGUSON PLC	27.24	165	22,172	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	682.32	153	20,648	金融
3I GROUP PLC	132.93	108	14,496	金融
ASHTREAD GROUP PLC	59.21	139	18,752	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	185.31	120	16,162	情報技術
NATIONAL GRID PLC	431.13	395	52,985	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,652.13	276	37,057	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	125.86	51	6,847	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	137.85	204	27,468	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	19.63	82	11,009	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	305.87	917	123,088	生活必需品
BHP GROUP PLC	261.42	435	58,470	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	49.64	95	12,837	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	2,715.11	1,032	138,525	金融
ANGLO AMERICAN PLC	146.45	267	35,855	素材
MONDI PLC	59.21	84	11,385	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	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
WM MORRISON SUPERMARKETS	391.67	72	9,661	生活必需品
COMPASS GROUP PLC	204.81	235	31,594	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	49.69	115	15,490	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	1,317.54	151	20,377	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	25.74	52	7,098	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	51.36	81	10,981	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	21.82	84	11,274	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	27.14	143	19,214	資本財・サービス
ITV PLC	275.87	21	2,912	コミュニケーション・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	43.05	342	45,978	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	543.24	733	98,403	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	466.67	609	81,741	エネルギー
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	20.39	46	6,304	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	35	4,765	金融
ANTOFAGASTA PLC	34.6	30	4,028	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	330.46	82	11,130	金融
EXPERIAN PLC	121.19	330	44,282	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	37,451.34 85銘柄	19,259 <4.7%>	2,583,474
(イスラエル)	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	120	140	4,331	金融
AZRIELI GROUP LTD	5.3	93	2,879	不動産
ICL GROUP LTD	110.96	135	4,193	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	3	149	4,622	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	151.6	330	10,195	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	190.43	370	11,444	金融
NICE LTD	8	514	15,886	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	38.83	297	9,174	金融
イスラエル・シェケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	628.12 8銘柄	2,033 <0.1%>	62,727
(スイス)	百株	千スイス・フラン	千円	
UBS GROUP AG-REG	512.59	525	59,247	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1.3	90	10,176	素材
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	78	8,809	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	93.91	3,058	344,687	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	3.89	28	3,156	金融
SIKA AG-REG	16.9	285	32,172	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	162	18,326	生活必需品
ABB LTD-REG	245.81	485	54,731	資本財・サービス
SWISS RE AG	36.66	268	30,245	金融
NESTLE SA-REG	392.17	4,031	454,391	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2.34	188	21,236	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5.31	114	12,915	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	301.22	284	32,090	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	41.13	169	19,122	金融
SGS SA-REG	0.65	143	16,227	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	4.67	100	11,274	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	6.65	92	10,377	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG	7.93	108	12,240	情報技術
ALCON INC	55.88	306	34,564	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	5	94	10,690	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	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千スイス・フラン	千円	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	17.92	585	66,046	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	6.11	86	9,737	金融
CLARIANT AG-REG	15.68	27	3,144	素材
NOVARTIS AG-REG	280.5	2,251	253,743	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.56	101	11,411	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	67.1	407	45,982	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	2.76	134	15,155	コミュニケーション・サービス
GEBERIT AG-REG	4.56	206	23,266	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	1.13	383	43,226	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1.11	82	9,268	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	9.34	185	20,880	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	10.43	57	6,484	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	10.2	474	53,515	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	16	1,877	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	65.87	265	29,882	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3.81	134	15,137	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	9.74	137	15,462	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	84	9,558	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.17	131	14,772	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,272.52 39銘柄	16,371 <3.4% >	1,845,237
(デンマーク)	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	240.58	10,395	168,302	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	72.36	635	10,292	金融
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	1.11	778	12,597	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	5	124	2,021	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	25.57	1,694	27,430	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S	11.59	407	6,601	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B	12.32	1,068	17,293	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	29.81	1,114	18,045	素材
COLOPLAST-B	15.19	1,586	25,686	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	27.98	2,151	34,826	資本財・サービス
DEMANT A/S	13.14	240	3,893	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.66	497	8,056	資本財・サービス
TRYG A/S	17	328	5,325	金融
PANDORA A/S	24.52	832	13,473	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	12.62	836	13,542	素材
GENMAB A/S	10.73	2,123	34,378	ヘルスケア
ORSTED A/S	31.17	2,335	37,807	公益事業
AMBU A/S-B	20.91	449	7,281	ヘルスケア
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	572.26 18銘柄	27,600 <0.8% >	446,857
(ノルウェー)	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORSK HYDRO ASA	130.5	351	3,888	素材
DNB ASA	128.38	1,729	19,143	金融
ORKLA ASA	137.84	1,182	13,089	生活必需品
TELENOR ASA	87.46	1,311	14,522	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	178.54	2,571	28,470	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	27.56	962	10,656	素材
MOWI ASA	46.77	877	9,710	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	365	4,042	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
SCIBSTED ASA-B SHS	百株 17	千ノルウェー・クローネ 400	千円 4,437	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	774.05 9銘柄	9,752 <0.2% >	107,961
(スウェーデン)	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB	7	298	3,429	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	414.43	3,464	39,774	情報技術
VOLVO AB-B SHS	188.73	2,581	29,639	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES	40	677	7,776	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	26	398	4,571	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	21.88	1,370	15,729	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	70.26	854	9,812	コミュニケーション・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	217.79	1,704	19,571	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	241.45	2,151	24,702	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	145.93	1,798	20,642	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	103.52	1,489	17,095	一般消費財・サービス
SKANSKA AB-B SHS	37.09	678	7,792	資本財・サービス
SANDVIK AB	190.87	2,971	34,116	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	62.9	3,038	34,877	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	98.36	3,655	41,960	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	25	298	3,426	資本財・サービス
TELIA CO AB	364.21	1,153	13,237	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	48.4	919	10,554	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	63.7	2,061	23,671	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	144.49	2,709	31,101	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	390	4,479	金融
LUNDIN ENERGY AB	19	421	4,837	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	97.87	2,794	32,077	生活必需品
BOLIDEN AB	31.71	664	7,622	素材
EPIROC AB-A	69.82	772	8,868	資本財・サービス
EPIROC AB-B	100.64	1,099	12,622	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS	24	174	2,004	一般消費財・サービス
NORDEA BANK ABP	435.48	2,946	33,830	金融
EQT AB	38.45	581	6,678	金融
EVOLUTION GAMING GROUP	20.64	1,117	12,833	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B	36.41	823	9,450	金融
HEXAGON AB-B SHS	38.68	1,975	22,681	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13	265	3,050	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,447.19 33銘柄	48,303 <1.0% >	554,520
(ユーロ (アイルランド))	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	46.75	127	15,368	素材
KINGSPAN GROUP PLC	16	83	10,098	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A	22.95	250	30,244	生活必需品
CRH PLC	105.17	311	37,568	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	9.03	108	13,153	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	199.9 5銘柄	881 <0.2% >	106,432
(ユーロ (オランダ))	百株	千ユーロ	千円	
QIAGEN N.V.	25.21	96	11,606	ヘルスケア

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等	
		評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千ユーロ	千円		
KONINKLIJKE PHILIPS NV	111.93	449	54,301	ヘルスケア	
NN GROUP NV	31	93	11,268	金融	
HEINEKEN NV	37.11	302	36,481	生活必需品	
AEGON NV	380.61	97	11,818	金融	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	159.71	374	45,139	生活必需品	
AKZO NOBEL N. V.	25.04	185	22,434	素材	
KONINKLIJKE DSM NV	26.25	312	37,665	素材	
WOLTERS KLUWER	40.53	269	32,575	資本財・サービス	
ING GROEP NV	432.86	275	33,285	金融	
KONINKLIJKE KPN NV	623.75	140	16,929	コミュニケーション・サービス	
ASML HOLDING NV	53.76	1,645	198,525	情報技術	
ABN AMRO BANK NV-CVA	90.53	69	8,351	金融	
ADYEN NV	1.99	232	28,109	情報技術	
UNILEVER NV	186.5	882	106,524	生活必需品	
JUST EAT TAKEAWAY	14	115	13,887	一般消費財・サービス	
PROSUS NV	66.72	513	61,998	一般消費財・サービス	
VOPAK	6.3	30	3,636	エネルギー	
RANDSTAD NV	20.2	77	9,390	資本財・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	12.85	93	11,343	生活必需品	
ALTICE EUROPE NV	112.95	40	4,907	コミュニケーション・サービス	
STMICROELECTRONICS NV	104.88	240	28,984	情報技術	
AIRBUS SE	72.16	483	58,301	資本財・サービス	
EXOR NV	10.88	52	6,377	金融	
CNH INDUSTRIAL NV	116.91	71	8,575	資本財・サービス	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	169.37	138	16,746	一般消費財・サービス	
FERRARI NV	20.83	309	37,367	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,954.83 27銘柄	7,594 <1.7%>	916,531	
ユーロ (ベルギー)	百株	千ユーロ	千円		
GALAPAGOS NV	5.57	95	11,575	ヘルスケア	
UCB SA	19.21	168	20,335	ヘルスケア	
KBC GROUP NV	30.11	147	17,830	金融	
COLRUYT SA	3.5	18	2,264	生活必需品	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11.39	83	10,058	金融	
SOLVAY SA	8.73	61	7,419	素材	
UMICORE	36.19	151	18,225	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	98.76	446	53,870	生活必需品	
AGEAS	16.54	54	6,545	金融	
PROXIMUS	22.69	44	5,317	コミュニケーション・サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	4.62	17	2,086	コミュニケーション・サービス	
SOFINA	2.39	54	6,590	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	259.7 12銘柄	1,343 <0.3%>	162,119	
ユーロ (ルクセンブルグ)	百株	千ユーロ	千円		
AROUNDTOWN SA	160.64	88	10,654	不動産	
ARCELORMITTAL	80.31	76	9,233	素材	
EUROFINS SCIENTIFIC	1.31	74	9,020	ヘルスケア	
SES	44.02	29	3,611	コミュニケーション・サービス	
TENARIS SA	47	29	3,547	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	333.28 5銘柄	298 <0.1%>	36,067	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (フランス)				
JCDECAUX SA	8.45	15	1,882	コミュニケーション・サービス
TOTAL SA	308.73	1,083	130,755	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	27.08	243	29,392	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	61.19	752	90,865	素材
KERING	9.77	476	57,460	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	67.45	614	74,170	資本財・サービス
BOUYGUES SA	43.92	120	14,596	資本財・サービス
BNP PARIBAS	148.99	521	62,876	金融
PEUGEOT SA	64.97	87	10,557	一般消費財・サービス
NATIXIS	76.74	17	2,104	金融
THALES SA	14.04	99	11,958	資本財・サービス
DANONE	75.51	462	55,805	生活必需品
CARREFOUR SA	80.22	112	13,592	生活必需品
SUEZ	29.5	30	3,691	公益事業
VIVENDI	104.3	230	27,842	コミュニケーション・サービス
L'OREAL	32.05	844	101,877	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	84.24	251	30,406	資本財・サービス
LEGRAND SA	41.19	257	31,067	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	2	6	838	生活必需品
PERNOD RICARD SA	31.25	448	54,174	生活必需品
EURAZEO SE	5.6	25	3,114	金融
SOCIETE GENERALE SA	110.65	163	19,717	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	35.73	1,354	163,485	一般消費財・サービス
ACCOR SA	18.5	47	5,755	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	24.45	235	28,373	情報技術
VALEO SA	37.03	81	9,831	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	29.18	86	10,423	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA	32.27	60	7,336	資本財・サービス
EIFFAGE	16.5	133	16,101	資本財・サービス
SODEXO SA	12.48	79	9,638	一般消費財・サービス
IPSEN	2.76	19	2,356	ヘルスケア
INGENICO GROUP	11.85	151	18,268	情報技術
ORPEA	5.24	52	6,278	ヘルスケア
AMUNDI SA	4.37	28	3,480	金融
TELEPERFORMANCE	8.7	181	21,880	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	9.77	65	7,892	コミュニケーション・サービス
FAURECIA	5.6	18	2,221	一般消費財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3.99	83	10,082	ヘルスケア
SEB SA	1.97	26	3,190	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA	38.09	433	52,356	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA	0.22	18	2,251	資本財・サービス
WORLDLINE SA	23.89	161	19,547	情報技術
AXA SA	274.53	502	60,582	金融
EDENRED	30.07	117	14,232	情報技術
RENAULT SA	25.54	56	6,780	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	4.51	333	40,188	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	2.53	29	3,517	生活必需品
ATOS SE	9.46	65	7,936	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA	19.8	291	35,160	情報技術
WENDEL	2.01	16	1,998	金融
ORANGE	257.92	268	32,401	コミュニケーション・サービス
ALSTOM	29.61	122	14,740	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		2020年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
CNP ASSURANCES		13.49	14	1,787	金融
SANOFI		142.91	1,272	153,527	ヘルスケア
VINCI SA		69.25	574	69,347	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		73.51	150	18,141	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		146.09	118	14,326	金融
BIOMERIEUX		4.57	51	6,254	ヘルスケア
ENGIE		210.99	231	27,893	公益事業
EDF		67.6	55	6,660	公益事業
SAFRAN SA		43.81	393	47,498	資本財・サービス
ILIAD SA		2.19	35	4,247	コミュニケーション・サービス
ARKEMA		8.38	67	8,098	素材
ADP		3.5	34	4,179	資本財・サービス
SCOR SE		32.89	80	9,676	金融
GETLINK SE		49.73	64	7,777	資本財・サービス
BOLLORE		73	20	2,452	コミュニケーション・サービス
国小計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,348.32 67銘柄	15,155 1,828,907	<3.3%>
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ドイツ)					
BAYER AG-REG		125.53	818	98,816	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		18	40	4,937	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		336.67	278	33,632	金融
COMMERZBANK AG		96.89	40	4,864	金融
VOLKSWAGEN AG		4.2	61	7,420	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		26.34	352	42,582	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG		99.27	978	118,073	資本財・サービス
E.ON SE		349.32	340	41,051	公益事業
UNIPER SE		41.12	112	13,626	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		45.71	256	30,973	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		13	34	4,221	資本財・サービス
CONTINENTAL AG		20.54	177	21,391	一般消費財・サービス
BASF SE		112.83	576	69,606	素材
ALLIANZ SE-REG		53.92	960	115,877	金融
THYSSENKRUPP AG		40.3	28	3,379	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		26.83	219	26,485	生活必需品
RWE AG		75.26	223	26,974	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		17	17	2,147	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT		5.6	24	2,905	資本財・サービス
BRENNTAG AG		31.09	139	16,868	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		48.35	204	24,634	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		9.59	33	4,064	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG		1.66	12	1,523	資本財・サービス
SAP SE		132.63	1,529	184,546	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		17.04	382	46,207	金融
ZALANDO SE		20.25	125	15,102	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG		21.28	97	11,710	素材
KION GROUP AG		6	31	3,753	資本財・サービス
WIRECARD AG		18.99	174	21,113	情報技術
COVESTRO AG		19.45	63	7,680	素材
SARTORIUS AG-VORZUG		6.5	187	22,591	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		21.02	105	12,713	一般消費財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
DELIVERY HERO SE	19.79	166	20,133	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	5.6	48	5,838	ヘルスケア
METRO AG	15	12	1,536	生活必需品
NEMETSCHKE SE	11.39	68	8,240	情報技術
SIEMENS HEALTHINEERS AG	15	63	7,715	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	5.49	51	6,227	資本財・サービス
TEAMVIEWER AG	25.42	108	13,046	情報技術
BEIERSDORF AG	12.75	125	15,115	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE-PREF	7	25	3,019	素材
MERCK KGAA	16.92	171	20,684	ヘルスケア
ADIDAS AG	23.24	534	64,533	一般消費財・サービス
PUMA SE	12.95	84	10,252	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	13.11	96	11,699	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	418.6	610	73,703	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	33.1	245	29,655	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	121.9	439	52,988	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	164.97	322	38,881	情報技術
HANNOVER RUECK SE	6.44	99	12,022	金融
DEUTSCHE POST AG-REG	131.16	396	47,817	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	24.04	359	43,357	金融
LANXESS AG	15.29	69	8,377	素材
MTU AERO ENGINES AG	6.66	103	12,530	資本財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	47.96	190	22,948	不動産
SYMRISE AG	21.2	203	24,514	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	62.4	16	1,954	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	9	39	4,787	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	71.86	381	46,083	不動産
LEG IMMOBILIEN AG	5.06	59	7,144	不動産
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,185.48 60銘柄	13,724 <3.0%>	1,656,294
ユーロ (ポルトガル)	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	29	43	5,281	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	275.76	113	13,667	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	71.83	77	9,361	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	376.59 3銘柄	234 <0.1%>	28,310
ユーロ (スペイン)	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA	538.2	244	29,500	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA	58.5	125	15,129	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	951.66	297	35,935	金融
IBERDROLA SA	771.43	752	90,768	公益事業
BANKINTER SA	67	28	3,425	金融
REPSOL SA	176.85	153	18,542	エネルギー
GRIFOLS SA	51.14	142	17,231	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	2,073.7	458	55,381	金融
AMADEUS IT GROUP SA	50.48	244	29,484	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA	39.78	65	7,923	公益事業
MAPFRE SA	80.05	13	1,653	金融
CAIXABANK SA	468.59	87	10,509	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	35.83	81	9,785	資本財・サービス
AENA SME SA	8.66	107	12,959	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	2020年6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千ユーロ	千円	
CELLNEX TELECOM SA		36.01	175	21,185	コミュニケーション・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		142.55	347	41,992	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		17.93	26	3,211	資本財・サービス
ENAGAS SA		36.75	76	9,189	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		81.9	133	16,080	公益事業
FERROVIAL SA		60.55	148	17,975	資本財・サービス
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	5,747.56	3,711	447,864	
		20 銘柄		<0.8%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (イタリア)					
PRYSMIAN SPA		41.45	79	9,606	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		159.85	214	25,897	金融
MEDIOBANCA SPA		99.71	67	8,192	金融
UNICREDIT SPA		294.71	234	28,246	金融
TELECOM ITALIA SPA		1,085.03	38	4,627	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP		483.81	18	2,173	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO		1,755.33	284	34,359	金融
ATLANTIA SPA		60.27	86	10,455	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		77.27	63	7,691	金融
MONCLER SPA		39.35	133	16,155	一般消費財・サービス
RECORDATI SPA		23.59	95	11,546	ヘルスケア
ENI SPA		360.61	309	37,369	エネルギー
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		44.83	33	4,035	生活必需品
PIRELLI & C SPA		56.51	22	2,659	一般消費財・サービス
DIASORIN SPA		2.77	46	5,582	ヘルスケア
NEXI SPA		35.53	50	6,071	情報技術
LEONARDO SPA		66.76	41	4,991	資本財・サービス
ENEL SPA		999.1	733	88,559	公益事業
SNAM SPA		243	105	12,683	公益事業
TERNA SPA		199	120	14,510	公益事業
FINECOBANK SPA		59.72	69	8,345	金融
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	6,188.2	2,848	343,760	
		21 銘柄		<0.6%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (フィンランド)					
UPM-KYMMENE OYJ		65.25	167	20,260	素材
NOKIA OYJ		652.61	243	29,352	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		41.16	29	3,585	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		88.53	93	11,324	素材
METSO OYJ		11.08	33	3,983	資本財・サービス
ELISA OYJ		28.18	149	18,030	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		68.09	208	25,119	金融
FORTUM OYJ		44	73	8,867	公益事業
KONE OYJ-B		52.16	310	37,440	資本財・サービス
NESTE OYJ		57.78	201	24,342	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		17.63	76	9,193	ヘルスケア
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,126.47	1,586	191,501	
		11 銘柄		<0.4%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オーストリア)					
VERBUND AG		12.16	47	5,723	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	2020年6月15日現在			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	12.09	37	4,581	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	58.79	132	15,963	金融
VOESTALPINE AG	18	34	4,183	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	11	18	2,291	金融
ANDRITZ AG	5.5	17	2,171	資本財・サービス
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	117.54 6 銘柄	289 <0.1%>	
ユ ー ロ 通 貨 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	23,837.87 237 銘柄	47,669 <10.5%>	
フ ァ ン ド 合 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	137,564.76 1,200 銘柄	— <95.1%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2020年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘 柄	2020年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千□	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)			
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.679	274	29,484
SIMON PROPERTY GROUP INC	4.233	321	34,490
BOSTON PROPERTIES INC	2.356	227	24,391
VORNADO REALTY TRUST	2.128	85	9,167
SBA COMMUNICATIONS CORP	1.501	446	47,866
EQUITY RESIDENTIAL	5.245	333	35,756
EQUINIX INC	1.168	790	84,753
AMERICAN TOWER CORP	5.827	1,503	161,270
HOST HOTELS & RESORTS INC	12.228	154	16,575
INVITATION HOMES INC	9.002	249	26,711
VICI PROPERTIES INC	5.464	121	13,061
VENTAS INC	6.514	256	27,530
WEYERHAEUSER CO	10.935	237	25,517
AGNC INVESTMENT CORP	7.559	102	11,032
CROWN CASTLE INTL CORP	5.507	905	97,072
IRON MOUNTAIN INC	3.474	96	10,364
VEREIT INC	13.632	88	9,516
SUN COMMUNITIES INC	1.214	168	18,022
PROLOGIS INC	9.436	891	95,585
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.648	262	28,148
CAMDEN PROPERTY TRUST	1.177	112	12,030
DUKE REALTY CORP	4.971	175	18,844
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.771	192	20,644
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.974	88	9,449
WELLTOWER INC	5.989	330	35,478
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6.434	176	18,960
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.714	204	21,888
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1.95	123	13,276

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		2020年6月15日現在		
		□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千アメリカ・ドル	千円
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		15.632	108	11,684
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		1.552	55	5,931
REALTY INCOME CORP		4.587	277	29,726
PUBLIC STORAGE		2.105	413	44,351
REGENCY CENTERS CORP		1.939	92	9,958
UDR INC		4.752	185	19,920
WP CAREY INC		2.702	186	20,025
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		2.164	65	7,029
DIGITAL REALTY TRUST INC		3.262	443	47,575
EXTRA SPACE STORAGE INC		1.797	173	18,637
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		8.597	166	17,867
アメリカ・ドル通貨計		183.819	11,092	1,189,597
□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >		39銘柄		<2.2%>
(カナダ)		千口	千カナダ・ドル	千円
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		2	29	2,311
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		4.2	91	7,159
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		1.6	78	6,178
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		1.4	23	1,834
カナダ・ドル通貨計		9.2	222	17,483
□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >		4銘柄		<0.0%>
(オーストラリア)		千口	千オーストラリア・ドル	千円
LENDLEASE GROUP		4.303	52	3,857
TRANSURBAN GROUP		39.765	564	41,225
SYDNEY AIRPORT		9.129	58	4,308
APA GROUP		14.243	159	11,675
SCENTRE GROUP		64.017	146	10,710
DEXUS		13.949	134	9,824
GPT GROUP		30.647	130	9,560
MIRVAC GROUP		61.117	144	10,537
STOCKLAND		18.729	67	4,939
GOODMAN GROUP		20.198	298	21,780
VICINITY CENTRES		50.371	79	5,814
オーストラリア・ドル通貨計		326.468	1,837	134,235
□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >		11銘柄		<0.2%>
(香港)		千口	千香港・ドル	千円
LINK REIT		32	2,147	29,717
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		52	403	5,584
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		34	390	5,402
香港・ドル通貨計		118	2,941	40,703
□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >		3銘柄		<0.1%>
(シンガポール)		千口	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		28	49	3,787
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		30.5	94	7,267
CAPITALAND MALL TRUST		31.5	64	4,963
SUNTEC REIT		26	38	2,937
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		46	86	6,682
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		37.6	76	5,895
シンガポール・ドル通貨計		199.6	410	31,533
□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >		6銘柄		<0.1%>

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		2020年6月15日現在		
		□ 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(イギリス)		千□	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC		10.295	63	8.556
SEGRO PLC		13.286	115	15.533
BRITISH LAND CO PLC		14.58	60	8.075
イギリス・ポンド通貨計		□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 > 38.161 3 銘柄	239	32.165 <0.1%>
(ユーロ (フランス))		千□	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		1.751	100	12.116
ICADE		0.406	26	3.209
GECINA SA		0.578	67	8.133
KLEPIERRE		2.394	44	5.317
COVIVIO		0.353	23	2.786
ユ ー ロ 通 貨 計		□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 > 5.482 5 銘柄	261	31.562 <0.1%>
合 計		□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 > 880.73 71 銘柄	—	1,477.281 <2.7%>

(注1) 邦貨換算金額は、2020年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘 柄 別		2020年6月15日現在	
		買 建 額	売 建 額
外	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	百万円 715	百万円 —
	S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	28	—
	SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	53	—
	FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	57	—
国	SWISS MKT IX FUTR (スイス)	55	—
	EURO STOXX 50 (ドイツ)	155	—

(注1) 外貨建の評価額は、2020年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

運用報告書 第12期（決算日 2020年1月10日）

（作成対象期間 2019年1月11日～2020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。

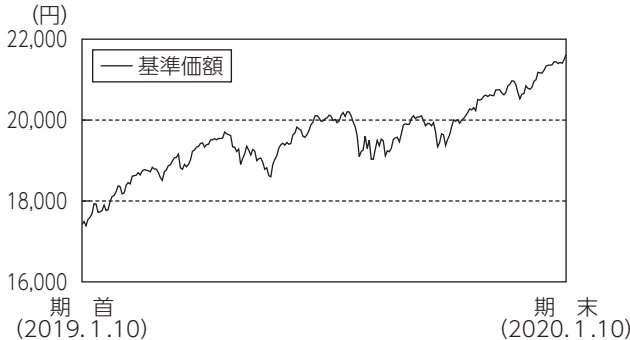
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）
株式組入制限	無制限

大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース、指数化)		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託証券組入比率
	円	%	ベンチマーク	%					
(期首)2019年1月10日	17,415	—	13,628	—	90.1		6.6	6.6	2.4
1月末	17,996	3.3	14,080	3.3	90.5		6.9	2.5	2.5
2月末	18,750	7.7	14,636	7.4	91.6		7.5	2.6	2.6
3月末	18,902	8.5	14,717	8.0	94.4		2.2	2.8	2.8
4月末	19,641	12.8	15,257	11.9	96.0		2.1	2.7	2.7
5月末	18,822	8.1	14,557	6.8	92.2		3.0	2.8	2.8
6月末	19,642	12.8	15,168	11.3	91.0		6.0	2.7	2.7
7月末	20,105	15.4	15,517	13.9	86.9		10.8	2.6	2.6
8月末	19,521	12.1	15,028	10.3	91.6		3.5	2.8	2.8
9月末	19,858	14.0	15,270	12.0	97.6		1.2	3.0	3.0
10月末	20,307	16.6	15,596	14.4	90.8		8.0	2.8	2.8
11月末	20,965	20.4	16,074	17.9	93.3		5.0	2.8	2.8
12月末	21,441	23.1	16,416	20.5	93.3		4.7	2.7	2.7
(期末)2020年1月10日	21,621	24.2	16,543	21.4	91.8		6.0	2.7	2.7

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース、指数化)は、MSCI Inc.の承諾を得て、MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)をもとに、当ファンド設定日を10,000として大和投資信託が計算したものです。MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

(注5) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：17,415円 期末：21,621円 騰落率：24.2%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク(MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース))の動きに連動させることをめざして運用を行った結果、米中通商協議が進展したことや、米中の貿易交渉の第一段階合意による米国の対中追加関税回避などを好感し海外株式市況が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より、米中通商協議の進展期待や米国企業を中心とした良好な2019年1-3月決算の発表などを好感し、上昇しました。2019年5月以降は、米中関係の緊張が続いたことや世界的な景気減速懸念などを嫌気し、下落しました。6月以降は、世界的な金融緩和期待や英国の合意なきEU(欧州連合)離脱懸念の後退などを受け、上昇基調となりました。11月以降は、再度米中通商協議の進展期待が高まり、底堅い展開となりました。当作成期末にかけては、米中の貿易交渉の第一段階合意による米国の対中追加関税回避などを背景に上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は21.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は24.2%となりました。

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

《今後の運用方針》

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

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション) (投資信託証券)	2円 (1) (1) (0)
有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	2 (2) (0)
その他費用 (保管費用) (その他)	6 (6) (0)
合計	10

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2019年1月11日から2020年1月10日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	アメリカ	百株 7,252.36 (△ 23.05)	千アメリカ・ドル 57,486 (△ 453)	百株 1,830.94	千アメリカ・ドル 12,392
	カナダ	百株 941 (△ 81)	千カナダ・ドル 4,504 (△ 180)	百株 257	千カナダ・ドル 1,038
	オーストラリア	百株 1,352.07 (△ 4.34)	千オーストラリア・ドル 3,020 (△ 8)	百株 288.67	千オーストラリア・ドル 648
	香港	百株 2,250 (117.81)	千香港ドル 11,579 ()	百株 1,337	千香港ドル 4,833
	シンガポール	百株 3,626 ()	千シンガポール・ドル 663 ()	百株 3,054	千シンガポール・ドル 256
	ニュージーランド	百株 272.05 ()	千ニュージーランド・ドル 185 ()	百株 -	千ニュージーランド・ドル -
	イギリス	百株 7,428.13 (221.11)	千イギリス・ポンド 4,304 (△ 60)	百株 2,253.35	千イギリス・ポンド 696
	イスラエル	百株 269.03 ()	千イスラエル・シケル 561 ()	百株 50	千イスラエル・シケル 12
	スイス	百株 336.42 (42.49)	千スイス・フラン 2,611 (△ 54)	百株 19.72	千スイス・フラン 368
	デンマーク	百株 99.22 (1.92)	千デンマーク・クローネ 4,620 ()	百株 43.62	千デンマーク・クローネ 1,918
国	ノルウェー	百株 105.86 (17)	千ノルウェー・クローネ 1,558 ()	百株 17	千ノルウェー・クローネ 145
	スウェーデン	百株 752.19 (68.12)	千スウェーデン・クローネ 10,250 ()	百株 323.77	千スウェーデン・クローネ 4,112
	ユーロ (アイルランド)	百株 15.12 ()	千ユーロ 42 ()	百株 -	千ユーロ -

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	ユーロ (オランダ)	百株 588.42 (△ 3.14)	千ユーロ 1,696 (△ 21)	百株 305.71	千ユーロ 385
	ユーロ (ベルギー)	百株 45.65 ()	千ユーロ 407 ()	百株 -	千ユーロ -
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 202.58 ()	千ユーロ 187 ()	百株 98.82	千ユーロ 86
	ユーロ (フランス)	百株 704.07 (8.77)	千ユーロ 2,961 (△ 1)	百株 175.6	千ユーロ 515
	ユーロ (ドイツ)	百株 457.66 (4.59)	千ユーロ 2,468 (△ 35)	百株 110.96	千ユーロ 546
	ユーロ (ポルトガル)	百株 35.74 ()	千ユーロ 50 ()	百株 -	千ユーロ -
	ユーロ (スペイン)	百株 1,054.01 (1,736.69)	千ユーロ 882 (44)	百株 1,680.19	千ユーロ 154
	ユーロ (イタリア)	百株 633.49 ()	千ユーロ 638 ()	百株 65.59	千ユーロ 70
	ユーロ (フィンランド)	百株 266.36 (26.93)	千ユーロ 319 ()	百株 69.62	千ユーロ 74
	ユーロ (オーストリア)	百株 9.76 ()	千ユーロ 44 (△ 3)	百株 10.6	千ユーロ 48
ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 4,012.86 (1,773.84)	千ユーロ 9,698 (△ 18)	百株 2,517.09	千ユーロ 1,881	

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

(2) 投資信託証券

(2019年1月11日から2020年1月10日まで)

	買 付		売 付	
	口数	金額	口数	金額
外	千口 49,874 (0.975)	千アメリカ・ドル 2,407 (-)	千口 4,124 (-)	千アメリカ・ドル 221 (-)
	千口 1.6 (2)	千カナダ・ドル 87 (39)	千口 - (-)	千カナダ・ドル - (-)
	千口 144,611 (-)	千オーストラリア・ドル 759 (-)	千口 18,268 (-)	千オーストラリア・ドル 81 (-)
	千口 60.1 4.88)	千シンガポール・ドル 149 (△ 0)	千口 4.88 (-)	千シンガポール・ドル 1 (-)
	千口 21,133 (-)	千イギリス・ポンド 143 (-)	千口 10,958 (-)	千イギリス・ポンド 30 (-)
	千口 1.243 (-)	千ユーロ 183 (-)	千口 0.497 (-)	千ユーロ 71 (-)
国	(フランス)			

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2019年1月11日から2020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 22,301	百万円 22,064	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄 株 式

(2019年1月11日から2020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
MICROSOFT CORP (アメリカ)	14.645	214,012	14,613	CELGENE CORP (アメリカ)	7.75	91,895	11,857
AMAZON.COM INC (アメリカ)	1.002	192,470	192,086	APPLE INC (アメリカ)	1.673	39,306	23,494
APPLE INC (アメリカ)	7.208	165,206	22,919	FIDELITY NATIONAL INFO SERV (アメリカ)	2.67	38,657	14,478
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	5.084	102,082	20,079	LINDE PLC (アイルランド)	1.5	33,756	22,504
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.625	82,636	132,218	WALT DISNEY CO/THE (アメリカ)	2.498	31,306	12,532
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.636	80,934	127,256	MICROSOFT CORP (アメリカ)	1.994	30,181	15,136
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	5.362	77,040	14,367	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.138	26,082	189,000
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	6.21	76,693	12,349	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.183	24,330	132,953
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO (アメリカ)	12.683	75,071	5,919	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	1.574	19,693	12,511
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	9.118	70,087	7,686	PFIZER INC (アメリカ)	4.299	18,255	4,246

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	11	11	140	15,439	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	8	11.98	287	31,512	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	16.59	22.71	230	25,283	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	-	15.94	121	13,294	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5.5	5.5	80	8,773	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	62	62	219	24,068	金融
ABBOTT LABORATORIES	168.44	201.07	1,738	190,438	ヘルスケア
ARCONIC INC	39.5	39.5	117	12,884	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	15.96	15.96	250	27,479	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	34	32.29	230	25,303	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	31.88	31.88	346	37,987	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	33.53	70.48	1,007	110,369	情報技術
QORVO INC	11.79	11.79	132	14,463	情報技術
AFLAC INC	70.68	81.23	426	46,726	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	12.48	12.48	142	15,642	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	10	18.35	132	14,472	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	46.22	56.65	1,928	211,322	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	17.5	28.72	130	14,340	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	10.08	12.99	306	33,575	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	44.09	44.09	73	8,000	金融
GARMIN LTD	7.5	13.18	128	14,065	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19.42	24.48	571	62,631	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	70.31	79.24	1,418	155,474	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	17.1	-	-	-	その他
WR BERKLEY CORP	6	17.71	121	13,305	金融
AUTOZONE INC	2.4	2.91	333	36,520	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	19.11	23.99	218	23,935	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	96.83	96.83	87	9,569	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	9	15.08	135	14,852	公益事業
CELANESE CORP	12.97	12.97	152	16,749	素材
DR HORTON INC	33.06	43.97	234	25,664	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OX	12.49	12.49	42	4,654	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	24.5	140	15,449	ヘルスケア
AUTODESK INC	19.13	25.81	495	54,280	情報技術
MOODY'S CORP	14.9	17.82	443	48,588	金融
DEVON ENERGY CORP	48.68	48.68	125	13,788	エネルギー
ALBEMARLE CORP	8	16.68	121	13,294	素材
ATMOS ENERGY CORP	10.5	16.54	183	20,134	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	22	22	119	13,144	公益事業
CITIGROUP INC	233.28	263.51	2,110	231,213	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	40.52	47.42	811	88,957	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	44.53	56.57	531	58,190	公益事業
ALLEGHANY CORP	1.38	2.03	162	17,840	金融
DOMINO'S PIZZA INC	3	5.26	151	16,650	一般消費財・サービス
HESS CORP	28.96	28.96	200	21,923	エネルギー
DAVITA INC	10	10	75	8,281	ヘルスケア
DANAHER CORP	61.31	70.15	1,106	121,190	ヘルスケア
FORTIVE CORP	30.44	30.44	237	26,008	資本財・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	53.14	59.49	561	61,552	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	12	40.93	81	8,875	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	17.01	17.01	30	3,313	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	60.74	60.74	268	29,383	生活必需品
BUNGE LTD	9.5	18.38	102	11,273	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	32.46	38.44	375	41,179	情報技術
APPLE INC	452.42	507.77	15,722	1,722,668	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33.59	33.59	280	30,706	金融
BOEING CO/THE	50.77	60.58	2,037	223,254	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	14.5	20.63	216	23,720	ヘルスケア
BENTON DICKINSON AND CO	24.93	30.11	823	90,245	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	15	15	34	3,817	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	14	14	141	15,505	情報技術
CDK GLOBAL INC	11	11	62	6,826	情報技術
NISSOURCE INC	40.26	40.26	111	12,241	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10.5	17.08	135	14,864	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	95.84	96.83	498	54,618	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	390.73	464.47	2,733	299,499	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	122.72	144.92	3,313	363,070	金融
ANSYS INC	7.2	9.89	258	28,329	情報技術
H&R BLOCK INC	16	-	-	-	一般消費財・サービス
TRUIST FINANCIAL CORP	69.55	137.39	771	84,572	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	-	77.86	450	49,352	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	151.31	262.66	1,719	188,362	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	316.28	362.64	4,984	546,110	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	22.75	27.59	353	38,779	金融
LKQ CORP	33	33	114	12,528	一般消費財・サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	5.47	5.47	104	11,482	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	26.52	36.65	246	27,058	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	26.5	36.14	265	29,049	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16.14	16.11	272	29,808	金融
DOLLAR GENERAL CORP	26.72	26.72	407	44,671	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	16.81	20.83	623	68,312	情報技術
CATERPILLAR INC	55.96	65.65	967	105,964	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	-	24.93	100	11,016	金融
AQUA AMERICA INC	-	22.01	102	11,269	公益事業
CMS ENERGY CORP	25	33.84	212	23,259	公益事業
MOSAIC CO/THE	30	52.09	109	12,042	素材
DELTA AIR LINES INC	16.5	16.5	97	10,659	資本財・サービス
CORNING INC	70.47	83.99	253	27,810	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	445.58	483.58	2,288	250,729	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	-	12.65	80	8,769	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	125.59	139.89	728	79,976	金融
WABCO HOLDINGS INC	3.2	9.4	127	13,974	資本財・サービス
MSCI INC	7.3	9.75	261	28,612	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC	4.5	4.5	111	12,193	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	4	9.18	100	11,022	資本財・サービス
COTY INC-CL A	47.57	47.57	51	5,603	生活必需品

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	17.34	25.07	158	17,344	情報技術		
BROADCOM INC	41.33	45.31	1,387	152,046	情報技術		
UNITED THERAPEUTICS CORP	3	—	—	—	ヘルスケア		
ACUITY BRANDS INC	3.5	3.5	43	4,733	資本財・サービス		
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	7	14.16	167	18,317	ヘルスケア		
ARAMARK	17	31.73	141	15,551	一般消費財・サービス		
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	14	16.12	49	5,392	素材		
DTE ENERGY COMPANY	19.33	19.33	248	27,250	公益事業		
CENTENE CORP	19.54	51.13	328	35,944	ヘルスケア		
CBOE GLOBAL MARKETS INC	9	13.58	157	17,261	金融		
CITIZENS FINANCIAL GROUP	40.5	55.32	221	24,257	金融		
ARTHUR J GALLAGHER & CO	17.97	22.32	213	23,423	金融		
GARTNER INC	8	11.74	189	20,730	情報技術		
SPLUNK INC	17.12	17.1	264	28,951	情報技術		
DOMINION ENERGY INC	76.39	89.41	732	80,254	公益事業		
MONSTER BEVERAGE CORP	44.36	44.36	285	31,228	生活必需品		
SMITH (A.O.) CORP	14	14	65	7,217	資本財・サービス		
DEERE & CO	26.86	33.62	597	65,423	資本財・サービス		
GLOBAL PAYMENTS INC	16.1	33.87	648	71,020	情報技術		
VMWARE INC-CLASS A	8.33	8.33	126	13,855	情報技術		
CHEMOURS CO/THE	14	—	—	—	素材		
BURLINGTON STORES INC	7	7	163	17,870	一般消費財・サービス		
NASDAQ INC	8.5	14.27	153	16,784	金融		
VAIL RESORTS INC	3.9	3.9	98	10,813	一般消費財・サービス		
EAST WEST BANCORP INC	14.61	14.61	70	7,682	金融		
TARGA RESOURCES CORP	20.29	16.33	65	7,221	エネルギー		
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	4.5	8.94	141	15,466	金融		
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	8.74	96	10,574	金融		
WESTLAKE CHEMICAL CORP	4.05	4.05	27	3,006	素材		
CONSOLIDATED EDISON INC	29.94	36.48	316	34,726	公益事業		
COGNEX CORP	14	24.39	136	14,984	情報技術		
TELEFLEX INC	4.85	4.85	184	20,162	ヘルスケア		
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	8.06	8.06	95	10,511	資本財・サービス		
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	8.52	129	14,139	ヘルスケア		
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	3	116	12,777	ヘルスケア		
WELL CARE HEALTH PLANS INC	5	5	167	18,362	ヘルスケア		
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12.25	15.7	228	25,067	ヘルスケア		
IDEX CORP	7	7	121	13,337	資本財・サービス		
COLGATE-PALMOLIVE CO	76.33	91.32	637	69,901	生活必需品		
ROLLINS INC	10.5	10.5	35	3,882	資本財・サービス		
AMETEK INC	19.82	25.97	263	28,842	資本財・サービス		
CHURCH & DWIGHT CO INC	21.55	28.83	201	22,033	生活必需品		
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10	10	37	4,056	資本財・サービス		
HEICO CORP	—	5.35	65	7,157	資本財・サービス		
XPO LOGISTICS INC	10.6	10.6	83	9,142	資本財・サービス		
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	3.98	106	11,721	金融		
LYONDELLBASELL INDU-CL A	28.2	34.22	309	33,959	素材		
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	4.17	129	14,227	情報技術		
COSTCO WHOLESALE CORP	40.83	48.83	1,462	160,198	生活必需品		
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	11.28	125	13,730	情報技術		
GRUBHUB INC	10	10	55	6,106	一般消費財・サービス		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
EPAM SYSTEMS INC	—	5.49	122	13,431	情報技術		
AFFILIATED MANAGERS GROUP	8.78	—	—	—	金融		
RPM INTERNATIONAL INC	—	17.5	128	14,122	素材		
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2.4	3.1	267	29,302	一般消費財・サービス		
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	28	28	61	6,718	金融		
UGI CORP	20.85	20.85	91	10,042	公益事業		
CUMMINS INC	13	16.04	278	30,496	資本財・サービス		
ACTIVISION BLIZZARD INC	65.65	87.14	517	56,657	コミュニケーション・サービス		
SABRE CORP	16	43.26	98	10,778	情報技術		
CDW CORP/DE	13	17.92	254	27,875	情報技術		
SIGNATURE BANK	7.69	7.69	106	11,623	金融		
COSTAR GROUP INC	3.82	4.92	309	33,945	資本財・サービス		
SVB FINANCIAL GROUP	6.88	6.9	176	19,362	金融		
AMERCO	0.7	0.7	26	2,914	資本財・サービス		
OLD DOMINION FREIGHT LINE	4.4	8.26	160	17,559	資本財・サービス		
MERCADOLIBRE INC	3.83	4.8	310	33,998	一般消費財・サービス		
HANESBRANDS INC	29	29	40	4,464	一般消費財・サービス		
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	8.37	124	13,629	情報技術		
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	23.13	28.81	314	34,436	一般消費財・サービス		
COMMSCO HOLDING CO INC	22.45	—	—	—	情報技術		
IPG PHOTONICS CORP	2.5	2.5	34	3,825	情報技術		
DEXCOM INC	9	11.72	280	30,726	ヘルスケア		
COPART INC	17.78	24.95	237	26,050	資本財・サービス		
DIAMONDBACK ENERGY INC	15.91	15.91	149	16,412	エネルギー		
SEATTLE GENETICS INC	10	15.45	172	18,931	ヘルスケア		
ALIGN TECHNOLOGY INC	8.62	9.63	285	31,289	ヘルスケア		
TRANSDIGM GROUP INC	5	5	297	32,619	資本財・サービス		
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	12.03	136	14,995	ヘルスケア		
NIELSEN HOLDINGS PLC	25	43.47	87	9,568	資本財・サービス		
KINDER MORGAN INC	171.69	225.94	486	53,349	エネルギー		
HCA HEALTHCARE INC	26.89	31.38	462	50,687	ヘルスケア		
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	3.82	141	15,557	金融		
CABOT OIL & GAS CORP	46.08	46.08	79	8,714	エネルギー		
T-MOBILE US INC	34.49	42.03	335	36,754	コミュニケーション・サービス		
ZILLOW GROUP INC - C	7	17.86	81	8,958	コミュニケーション・サービス		
COCA-COLA CO/THE	383.83	454.42	2,514	275,542	生活必需品		
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	16	25.75	130	14,346	生活必需品		
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.46	19.46	149	16,377	資本財・サービス		
EATON VANCE CORP	12.5	12.5	59	6,492	金融		
FRANKLIN RESOURCES INC	22	38.51	97	10,633	金融		
CSX CORP	80.73	81.51	601	65,857	資本財・サービス		
FLUOR CORP	12.9	—	—	—	資本財・サービス		
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10.5	10.5	183	20,123	ヘルスケア		
EXPEDIA GROUP INC	11.5	15.63	171	18,797	一般消費財・サービス		
AUTOLIV INC	8	8	64	7,097	一般消費財・サービス		
AMAZON.COM INC	38.83	47.47	9,024	988,790	一般消費財・サービス		
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	16	—	—	—	エネルギー		
FLOWSERVE CORP	9	19.86	100	11,021	資本財・サービス		
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	19.45	22.03	515	56,464	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		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
EXXON MOBIL CORP	399.14	479.45	3,344	366,472	エネルギー		
FLIR SYSTEMS INC	16.13	16.13	88	9,642	情報技術		
AES CORP	84.42	83.41	168	18,516	公益事業		
L3 TECHNOLOGIES INC	6.5	-	-	-	その他		
EVEREST RE GROUP LTD	3.5	5.71	157	17,282	金融		
EOG RESOURCES INC	57.49	64.76	571	62,620	エネルギー		
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	12.5	19.14	178	19,543	情報技術		
ABIOMED INC	3.55	5.55	101	11,164	ヘルスケア		
AMERISOURCEBERGEN CORP	13.6	19.89	172	18,886	ヘルスケア		
AGILENT TECHNOLOGIES INC	34.58	34.58	301	33,065	ヘルスケア		
FORD MOTOR CO	321.29	433.81	401	44,015	一般消費財・サービス		
MACY'S INC	22	-	-	-	一般消費財・サービス		
DISCOVERY INC - A	11	11	35	3,886	コミュニケーション・サービス		
EXACT SCIENCES CORP	-	17.21	178	19,526	ヘルスケア		
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	24.16	50	5,506	コミュニケーション・サービス		
DISCOVERY INC-C	21.49	45.54	137	15,089	コミュニケーション・サービス		
AERCAP HOLDINGS NV	18.24	18.24	111	12,185	資本財・サービス		
FORTINET INC	10.5	15.95	182	20,006	情報技術		
MARKEL CORP	1.1	1.58	184	20,183	金融		
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	8	-	-	-	エネルギー		
NEXTERA ENERGY INC	43.99	51.64	1,255	137,545	公益事業		
FREEMPORT-MCMORAN INC	114.5	150.25	194	21,335	素材		
INSULET CORP	-	7.69	138	15,223	ヘルスケア		
US BANCORP	142.81	165.2	942	103,284	金融		
UNITED RENTALS INC	11.15	10.55	172	18,868	資本財・サービス		
F5 NETWORKS INC	5.5	5.5	74	8,195	情報技術		
FASTENAL CO	29.07	58.14	210	23,073	資本財・サービス		
FISERV INC	35	64.56	760	83,329	情報技術		
GENERAL ELECTRIC CO	856.82	988.88	1,177	129,046	資本財・サービス		
NEKTAR THERAPEUTICS	14.01	-	-	-	ヘルスケア		
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	21.49	21.49	124	13,671	一般消費財・サービス		
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	22.5	-	-	-	一般消費財・サービス		
GENERAL MOTORS CO	122.63	136.43	478	52,439	一般消費財・サービス		
TRIPADVISOR INC	7	7	21	2,338	コミュニケーション・サービス		
GENERAL DYNAMICS CORP	23.16	26.11	474	51,956	資本財・サービス		
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33.29	36.27	879	96,411	金融		
ALPHABET INC-CL A	28.21	32.74	4,648	509,324	コミュニケーション・サービス		
ALPHABET INC-CL C	29.7	35.95	5,104	559,276	コミュニケーション・サービス		
OWENS CORNING	8	17.63	114	12,525	資本財・サービス		
GENERAL MILLS INC	55.56	65.95	345	37,850	生活必需品		
FIRSTENERGY CORP	44.88	56.61	270	29,692	公益事業		
GENUINE PARTS CO	12	17.7	178	19,550	一般消費財・サービス		
IHS MARKIT LTD	33.55	42.11	329	36,076	資本財・サービス		
FIFTH THIRD BANCORP	58.5	81	245	26,847	金融		
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	9.82	24.09	511	56,034	資本財・サービス		
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	9.5	9.5	26	2,909	資本財・サービス		
HALLIBURTON CO	78.26	102.3	247	27,114	エネルギー		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
HOME DEPOT INC	106.05	124.15	2,795	306,328	一般消費財・サービス		
ASSURANT INC	2.86	8.4	113	12,392	金融		
HUNTINGTON BANCSHARES INC	107.45	95.84	139	15,289	金融		
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	3.5	3.5	96	10,584	資本財・サービス		
HERSHEY CO/THE	13.58	17.25	252	27,702	生活必需品		
HARLEY-DAVIDSON INC	14	14	50	5,562	一般消費財・サービス		
HUMANA INC	12.88	14.85	541	59,309	ヘルスケア		
NXP SEMICONDUCTORS NV	34.19	33.54	433	47,473	情報技術		
RINGCENTRAL INC-CLASS A	-	9.17	169	18,524	情報技術		
HELMERICH & PAYNE	13.36	-	-	-	エネルギー		
HENRY SCHEIN INC	18.69	18.7	123	13,564	ヘルスケア		
HP INC	141.5	161.33	342	37,545	情報技術		
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	132.5	132.5	207	22,749	情報技術		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	11	11	52	5,784	コミュニケーション・サービス		
HOLLYFRONTIER CORP	17.83	17.83	85	9,408	エネルギー		
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	13.5	27.62	126	13,827	コミュニケーション・サービス		
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	8.5	20.28	97	10,661	コミュニケーション・サービス		
ARCH CAPITAL GROUP LTD	36	50.11	218	23,938	金融		
KRAFT HEINZ CO/THE	59.73	77.25	236	25,883	生活必需品		
INTL BUSINESS MACHINES CORP	84.62	96.54	1,320	144,642	情報技術		
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	40.47	178	19,559	素材		
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	15	99	10,950	資本財・サービス		
ZOETIS INC	46.63	51.45	694	76,138	ヘルスケア		
INGERSOLL-RAND PLC	25.48	25.48	332	36,439	資本財・サービス		
CHENIERE ENERGY INC	17.5	24.84	157	17,214	エネルギー		
ALLEGION PLC	11.1	11.1	136	14,943	資本財・サービス		
LEGGETT & PLATT INC	15.72	15.72	78	8,555	一般消費財・サービス		
LIBERTY GLOBAL PLC- C	51.08	51.08	102	11,176	コミュニケーション・サービス		
WASTE CONNECTIONS INC	26.65	26.65	249	27,375	資本財・サービス		
JUNIPER NETWORKS INC	28.5	49.12	119	13,116	情報技術		
SAREPTA THERAPEUTICS INC	-	8.64	113	12,462	ヘルスケア		
JM SMUCKER CO/THE	9	13.93	144	15,814	生活必需品		
JOHNSON & JOHNSON	252.09	296.77	4,314	472,765	ヘルスケア		
ABBVIE INC	140.59	166.54	1,502	164,613	ヘルスケア		
HOLOGIC INC	30.42	30.42	162	17,757	ヘルスケア		
KIMBERLY-CLARK CORP	31.41	39.32	548	60,083	生活必需品		
KROGER CO	71.6	94.8	269	29,541	生活必需品		
KLA CORP	15.2	19.19	336	36,899	情報技術		
LOCKHEED MARTIN CORP	25.15	29.5	1,224	134,118	資本財・サービス		
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	7.3	9.36	279	30,614	情報技術		
L BRANDS INC	19.5	-	-	-	一般消費財・サービス		
LOWE'S COS INC	76.06	85.96	1,049	114,954	一般消費財・サービス		
ELI LILLY & CO	92.84	98.52	1,339	146,723	ヘルスケア		
LAM RESEARCH CORP	14.77	17.24	513	56,278	情報技術		
JONES LANG LASALLE INC	3	5.87	100	11,065	不動産		
LOEWNS CORP	25.5	35.91	189	20,739	金融		
LINCOLN NATIONAL CORP	18	26.43	157	17,248	金融		
MCDONALD'S CORP	72.43	86.07	1,793	196,488	一般消費財・サービス		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千ドル	千円			
3M CO	55.13	63.95	1,158	126,966	資本財・サービス		
FACEBOOK INC-CLASS A	226.96	270.31	5,900	646,558	コミュニケーション・サービス		
MANPOWERGROUP INC	6.5	6.5	64	7,013	資本財・サービス		
S&P GLOBAL INC	23.87	26.18	758	83,067	金融		
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5.4	7.67	212	23,330	素材		
CONCHO RESOURCES INC	18	25.52	230	25,263	エネルギー		
FIRST DATA CORP- CLASS A	58.32	-	-	-	その他		
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	19	19	65	7,217	コミュニケーション・サービス		
PHILLIPS 66	38.47	50.6	534	58,558	エネルギー		
TECHNIPFMC PLC	45.61	45.61	95	10,419	エネルギー		
MGM RESORTS INTERNATIONAL	56.59	56.59	189	20,734	一般消費財・サービス		
MATTEL INC	36	-	-	-	一般消費財・サービス		
DXC TECHNOLOGY CO	24.29	24.29	87	9,639	情報技術		
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10.29	13.75	223	24,442	生活必需品		
MYLAN NV	48.88	48.88	102	11,209	ヘルスケア		
METLIFE INC	75.19	86.35	452	49,549	金融		
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	61.24	86.17	224	24,642	情報技術		
ARISTA NETWORKS INC	4.23	5.93	122	13,436	情報技術		
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	13.49	24.19	115	12,682	金融		
MOTOROLA SOLUTIONS INC	14.35	17.71	298	32,734	情報技術		
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.1	2.84	230	25,232	ヘルスケア		
BAKER HUGHES CO	37.84	84.46	211	23,172	エネルギー		
ROCKWELL AUTOMATION INC	11	14.6	302	33,141	資本財・サービス		
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	19.64	-	-	-	金融		
MERCK & CO. INC.	248.03	285.53	2,552	279,629	ヘルスケア		
DUPONT DE NEMOURS INC	215.58	83.2	507	55,563	素材		
MASCO CORP	35.43	35.43	168	18,408	資本財・サービス		
M & T BANK CORP	13.23	13.23	221	24,246	金融		
MARSH & MCLENNAN COS	45.04	55.85	625	68,556	金融		
BLACK KNIGHT INC	-	16.44	106	11,661	情報技術		
HEICO CORP-CLASS A	-	7.07	67	7,364	資本財・サービス		
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	27.83	31.8	465	51,027	一般消費財・サービス		
WORKDAY INC-CLASS A	12	18.78	337	36,932	情報技術		
WAYFAIR INC- CLASS A	6	6	58	6,360	一般消費財・サービス		
SQUARE INC - A	27.91	36.26	246	26,988	情報技術		
TRANSUNION	20.29	20.29	185	20,286	資本財・サービス		
VISTRA ENERGY CORP	25	42.85	97	10,732	公益事業		
CAPRI HOLDINGS LTD	11	11	40	4,425	一般消費財・サービス		
WORLDPAY INC-CLASS A	28.76	-	-	-	その他		
BEIGENE LTD-ADR	3.5	3.5	58	6,421	ヘルスケア		
NETAPP INC	23	23	145	15,992	情報技術		
NIKE INC -CL B	124.89	142.18	1,442	158,092	一般消費財・サービス		
NORFOLK SOUTHERN CORP	25.53	28.43	563	61,771	資本財・サービス		
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20.5	26.26	289	31,742	情報技術		
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10.5	17.49	162	17,793	金融		
ALLY FINANCIAL INC	33	50.94	153	16,872	金融		
NORTHROP GRUMMAN CORP	14.4	17.72	659	72,296	資本財・サービス		
APTIV PLC	26.8	26.8	245	26,936	一般消費財・サービス		
NEWMONT GOLDCORP CORP	41.5	91.73	382	41,871	素材		
MCKESSON CORP	17.69	21.61	305	33,457	ヘルスケア		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千ドル	千円			
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23.87	32.57	202	22,136	情報技術		
XYLEM INC	19.72	19.72	158	17,313	資本財・サービス		
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	146.09	171.14	1,510	165,540	生活必需品		
NUCOR CORP	27	36.92	197	21,642	素材		
WESTERN UNION CO	36	36	95	10,516	情報技術		
GODADDY INC - CLASS A	13	19.3	135	14,874	情報技術		
NEWELL BRANDS INC	40.58	40.58	77	8,519	一般消費財・サービス		
EVERGY INC	24	32.43	207	22,769	公益事業		
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	67.97	102.38	464	50,895	エネルギー		
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	-	2.69	44	4,905	金融		
OKTA INC	-	10.1	129	14,222	情報技術		
LIBERTY BROADBAND-C	8	13.5	174	19,136	コミュニケーション・サービス		
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	-	48.77	136	14,983	ヘルスケア		
LINDE PLC	47.33	57.96	1,210	132,633	素材		
WIX.COM LTD	5	5	70	7,674	情報技術		
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	34.52	61.84	159	17,481	金融		
KKR & CO INC -A	-	49.96	149	16,389	金融		
PAYCHEX INC	26.75	33	282	31,003	情報技術		
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7	8.27	361	39,632	一般消費財・サービス		
ALTRIA GROUP INC	174.46	207.29	1,048	114,858	生活必需品		
P G & E CORP	44.79	-	-	-	公益事業		
PFIZER INC	555.06	623.73	2,425	265,782	ヘルスケア		
ALKERMES PLC	10.5	-	-	-	ヘルスケア		
CIGNA CORP	37.26	40.5	853	93,566	ヘルスケア		
DELL TECHNOLOGIES -C	11.12	19.17	95	10,422	情報技術		
ALTICE USA INC- A	-	10.38	29	3,272	コミュニケーション・サービス		
XCEL ENERGY INC	53.81	53.81	336	36,873	公益事業		
STERIS PLC	-	8.97	136	14,917	ヘルスケア		
FOX CORP - CLASS B	-	15.3	55	6,118	コミュニケーション・サービス		
FOX CORP - CLASS A	-	52.67	195	21,456	コミュニケーション・サービス		
STRYKER CORP	31.26	37.38	791	86,677	ヘルスケア		
DOW INC	-	88.15	460	50,408	素材		
PARKER HANNIFIN CORP	12.39	12.39	256	28,119	資本財・サービス		
UBER TECHNOLOGIES INC	-	16.48	55	6,134	資本財・サービス		
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16.5	22.03	335	36,745	エネルギー		
POLARIS INC	4	9.89	93	10,293	一般消費財・サービス		
PROCTER & GAMBLE CO/THE	235.8	278.25	3,446	377,592	生活必需品		
EXELON CORP	90.42	98.59	454	49,853	公益事業		
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	22.07	26.52	293	32,178	ヘルスケア		
NVR INC	0.3	0.45	168	18,449	一般消費財・サービス		
CONOCOPHILLIPS	106.05	122.28	807	88,522	エネルギー		
TWILIO INC - A	-	13.31	150	16,482	情報技術		
DOCUSIGN INC	-	10.27	77	8,529	情報技術		
PAYCOM SOFTWARE INC	-	4.91	140	15,348	情報技術		
MATCH GROUP INC	-	9.28	79	8,719	コミュニケーション・サービス		
PEPSICO INC	133.93	156.2	2,105	230,690	生活必需品		
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	-	4.09	55	6,039	情報技術		
DROPBOX INC-CLASS A	-	23.92	43	4,814	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	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
MONGODB INC	—	百株 3.9	58	6,408	千円	千円	情報技術
SNAP INC - A	—	68.89	119	13,103	千円	千円	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	—	75.09	215	23,637	千円	千円	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42.88	42.88	406	44,493	千円	千円	金融
AMCOR PLC	—	174.57	181	19,892	千円	千円	素材
ROKU INC	—	9.39	125	13,765	千円	千円	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20.92	20.92	255	27,994	千円	千円	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	62.13	72.8	1,500	164,439	千円	千円	情報技術
PENTAIR PLC	15.75	15.75	71	7,886	千円	千円	資本財・サービス
QUALCOMM INC	137.16	134.03	1,205	132,038	千円	千円	情報技術
INVESCO LTD	37	37	66	7,301	千円	千円	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	8.19	8.19	125	13,718	千円	千円	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23	31.93	179	19,654	千円	千円	金融
RAYTHEON COMPANY	25.67	31.16	712	78,065	千円	千円	資本財・サービス
RED HAT INC	15.3	—	—	—	千円	千円	その他
REGENERON PHARMACEUTICALS	7.45	9.25	354	38,865	千円	千円	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	20.5	26.67	242	26,580	千円	千円	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	4.5	4.86	1,012	110,990	千円	千円	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	36.18	41.29	504	55,253	千円	千円	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	8.44	8.44	88	9,712	千円	千円	素材
RESMED INC	13.83	13.83	217	23,878	千円	千円	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	12	18.12	192	21,083	千円	千円	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	8	14.99	95	10,439	千円	千円	資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP	4	4	47	5,168	千円	千円	一般消費財・サービス
PERKINELMER INC	—	11.63	116	12,725	千円	千円	ヘルスケア
REGIONS FINANCIAL CORP	92.5	92.5	153	16,773	千円	千円	金融
CHEVRON CORP	180.78	213.52	2,509	274,919	千円	千円	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	31.03	38.64	294	32,236	千円	千円	公益事業
TESLA INC	11.94	16.51	794	87,074	千円	千円	一般消費財・サービス
NORTONLIFELOCK INC	54	79.44	212	23,231	千円	千円	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	15.81	15.81	261	28,628	千円	千円	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	11	15.82	235	25,770	千円	千円	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	16.05	18.17	921	100,993	千円	千円	コミュニケーション・サービス
CBRE GROUP INC - A	28	38.49	233	25,540	千円	千円	不動産
TWITTER INC	57	84.84	281	30,881	千円	千円	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	89.27	113.05	715	78,359	千円	千円	公益事業
SYSCO CORP	43.92	48.6	411	45,066	千円	千円	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	24.82	28.6	393	43,126	千円	千円	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	10	19.25	126	13,876	千円	千円	金融
STEEL DYNAMICS INC	23	23	77	8,452	千円	千円	素材
SCHLUMBERGER LTD	135.88	149.99	597	65,507	千円	千円	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	20.26	106	11,649	千円	千円	資本財・サービス
AT&T INC	685.37	818.15	3,174	347,821	千円	千円	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	17.58	17.58	95	10,459	千円	千円	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	36.27	36.27	90	9,879	千円	千円	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7.61	8.34	471	51,688	千円	千円	素材
SEMPRA ENERGY	27.68	31.6	470	51,527	千円	千円	公益事業
TIFFANY & CO	10.86	10.86	145	15,920	千円	千円	一般消費財・サービス

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
SEAGATE TECHNOLOGY	23.49	23.49	142	15,561	千円	千円	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	90.23	105.74	1,388	152,159	千円	千円	情報技術
SALESFORCE.COM INC	69.51	96.2	1,727	189,308	千円	千円	情報技術
WESTROCK CO	23.21	23.21	98	10,826	千円	千円	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	83.88	99.06	409	44,859	千円	千円	資本財・サービス
TERADYNE INC	—	20.96	143	15,676	千円	千円	情報技術
UNION PACIFIC CORP	69.85	80.49	1,441	157,953	千円	千円	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	102.44	102.44	137	15,096	千円	千円	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	60.83	70.61	419	45,948	千円	千円	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	78.79	90.33	1,387	152,074	千円	千円	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	64.48	80.87	945	103,610	千円	千円	資本財・サービス
UNUM GROUP	19	19	54	6,010	千円	千円	金融
SPRINT CORP	41.14	114.74	57	6,286	千円	千円	コミュニケーション・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	10	—	—	—	千円	千円	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	14.32	17.81	284	31,125	千円	千円	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	18	18	112	12,277	千円	千円	金融
AMEREN CORPORATION	28.61	28.61	219	24,009	千円	千円	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	90.73	107.26	3,155	345,781	千円	千円	ヘルスケア
VERISIGN INC	10.85	10.85	226	24,832	千円	千円	情報技術
VALERO ENERGY CORP	38.82	45.4	432	47,347	千円	千円	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	4.8	6.35	167	18,333	千円	千円	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	30.08	138	15,137	千円	千円	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9.92	9.92	143	15,687	千円	千円	ヘルスケア
ANTHEM INC	23.46	29.08	891	97,631	千円	千円	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	140.83	201.84	2,923	320,300	千円	千円	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	432.75	476.67	2,513	275,402	千円	千円	金融
WASTE MANAGEMENT INC	42.25	46.9	544	59,677	千円	千円	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	107.9	125.23	296	32,478	千円	千円	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10.5	15.91	144	15,830	千円	千円	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	5	8.7	130	14,333	千円	千円	一般消費財・サービス
WALMART INC	141.09	158.96	1,865	204,408	千円	千円	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	9	9	65	7,178	千円	千円	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19.56	23.65	351	38,507	千円	千円	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	11.45	11.45	162	17,833	千円	千円	一般消費財・サービス
XEROX HOLDINGS CORP	19.88	19.88	72	7,972	千円	千円	情報技術
WABTEC CORP	6.44	18.98	148	16,316	千円	千円	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	112.06	131.81	825	90,467	千円	千円	一般消費財・サービス
WATERS CORP	6.5	6.5	148	16,295	千円	千円	ヘルスケア
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	3.5	9.92	87	9,559	千円	千円	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	31.29	38.47	741	81,205	千円	千円	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	5.55	136	14,989	千円	千円	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	80.64	89.76	490	53,777	千円	千円	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	15.36	15.11	309	33,939	千円	千円	金融
WESTERN DIGITAL CORP	25.45	35.31	242	26,548	千円	千円	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	28.69	34.67	318	34,945	千円	千円	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	42.5	50.77	296	32,498	千円	千円	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	168.27	193.27	3,734	409,237	千円	千円	情報技術
PPL CORP	59	73.94	262	28,768	千円	千円	公益事業
PULTEGROUP INC	19	35.56	141	15,511	千円	千円	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	20.12	24.34	313	34,312	千円	千円	素材

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ドル	千円			
NORTHERN TRUST CORP	20.62	20.62	222	24,429	金融		
NVIDIA CORP	55.71	63.91	1,553	170,177	情報技術		
IAC/INTERACTIVECORP	8.59	8.59	223	24,488	コミュニケーション・サービス		
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	41.75	49.94	803	87,994	金融		
QURATE RETAIL INC-SERIES A	42.88	-	-	-	一般消費財・サービス		
HD SUPPLY HOLDINGS INC	12	24.82	99	10,913	資本財・サービス		
TYSON FOODS INC-CL A	24.5	32.11	286	31,386	生活必需品		
NETFLIX INC	39.86	50.12	1,682	184,332	コミュニケーション・サービス		
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	38.51	43.93	1,447	158,654	ヘルスケア		
NRG ENERGY INC	30	30	111	12,208	公益事業		
GLOBE LIFE INC	12.15	12.15	127	13,931	金融		
FIRST REPUBLIC BANK/CA	13	18.56	214	23,539	金融		
TEXTRON INC	22.1	22.1	99	10,933	資本財・サービス		
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	103.5	-	-	-	コミュニケーション・サービス		
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	45.91	-	-	-	その他		
NEWS CORP - CLASS A	29	79.99	115	12,647	コミュニケーション・サービス		
OGE ENERGY CORP	12	24.52	107	11,735	公益事業		
OMNICOM GROUP	18.5	25.46	203	22,247	コミュニケーション・サービス		
ORACLE CORP	275.01	261.18	1,420	155,621	情報技術		
MASTERCARD INC - A	84.98	101.41	3,134	343,456	情報技術		
ONEOK INC	37.36	45.66	345	37,827	エネルギー		
CENTURYLINK INC	97.47	97.47	127	14,011	コミュニケーション・サービス		
ROPER TECHNOLOGIES INC	9	12.69	469	51,461	資本財・サービス		
YUM! BRANDS INC	32.71	32.71	336	36,901	一般消費財・サービス		
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	11.91	11.91	152	16,706	コミュニケーション・サービス		
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	4	4	44	4,853	情報技術		
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	17.75	17.75	97	10,688	生活必需品		
NOBLE ENERGY INC	37.5	62.74	140	15,426	エネルギー		
BANK OF AMERICA CORP	880.46	1,012.68	3,547	388,690	金融		
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	-	4.18	153	16,767	資本財・サービス		
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	14.97	21.27	190	20,877	ヘルスケア		
NORDSTROM INC	8	8	33	3,699	一般消費財・サービス		
AMERICAN EXPRESS CO	65.84	72.62	928	101,698	金融		
ANALOG DEVICES INC	33.36	39.3	474	51,957	情報技術		
ADVANCED MICRO DEVICES	95.45	114.47	560	61,420	情報技術		
TD AMERITRADE HOLDING CORP	23.94	34.8	175	19,187	金融		
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	84.69	94.6	494	54,189	金融		
ANADARKO PETROLEUM CORP	51.05	-	-	-	その他		
SKYWORKS SOLUTIONS INC	15.69	22.83	273	29,930	情報技術		
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17.84	17.84	238	26,177	一般消費財・サービス		
AVERY DENNISON CORP	6.5	11.31	145	15,952	素材		
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	53.53	62.07	379	41,560	情報技術		
EMERSON ELECTRIC CO	56.56	63.46	493	54,096	資本財・サービス		
AOPLC	22.96	26.41	552	60,508	金融		
AMGEN INC	60.83	66.7	1,593	174,617	ヘルスケア		
TAPESTRY INC	25.5	25.5	69	7,650	一般消費財・サービス		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ドル	千円			
EATON CORP PLC	41.02	48.03	457	50,095	資本財・サービス		
CELGENE CORP	70.24	-	-	-	その他		
CONSTELLATION BRANDS INC-A	15.06	17.84	345	37,841	生活必需品		
APPLIED MATERIALS INC	91.64	102.64	636	69,693	情報技術		
CIT GROUP INC	9	-	-	-	金融		
CIMAREX ENERGY CO	8	-	-	-	エネルギー		
CME GROUP INC	35.41	41.37	862	94,497	金融		
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33.89	33.89	81	8,960	エネルギー		
ECOLAB INC	23.64	29.12	553	60,635	素材		
EQUIFAX INC	12.56	12.56	185	20,364	資本財・サービス		
GAP INC/THE	28.2	28.2	49	5,385	一般消費財・サービス		
GILEAD SCIENCES INC	117.75	144.04	948	103,911	ヘルスケア		
HORMEL FOODS CORP	22	33.15	147	16,159	生活必需品		
STATE STREET CORP	39.48	39.48	327	35,869	金融		
SUNTRUST BANKS INC	46.15	-	-	-	その他		
SCHWAB (CHARLES) CORP	115.1	128.07	616	67,510	金融		
BAXTER INTERNATIONAL INC	45.41	51.75	447	49,070	ヘルスケア		
CAMPBELL SOUP CO	13	13	61	6,783	生活必需品		
CROWN HOLDINGS INC	8	11.45	81	8,912	素材		
CARDINAL HEALTH INC	24.5	33.19	166	18,292	ヘルスケア		
FEDEX CORP	22.83	28.93	457	50,099	資本財・サービス		
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	45.69	51.81	531	58,193	金融		
FMC CORP	11.42	11.42	113	12,452	素材		
FLEX LTD	45	45	56	6,232	情報技術		
CERNER CORP	23.68	41.33	304	33,402	ヘルスケア		
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7.54	11.63	143	15,755	素材		
CITRIX SYSTEMS INC	13.5	13.5	153	16,870	情報技術		
INTEL CORP	427.71	497.06	2,947	322,964	情報技術		
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	28	52.31	121	13,274	コミュニケーション・サービス		
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	28.5	48.66	294	32,320	金融		
ILLINOIS TOOL WORKS	28.56	35.91	645	70,678	資本財・サービス		
SIRIUS XM HOLDINGS INC	153	153	107	11,818	コミュニケーション・サービス		
ILLUMINA INC	13.07	16.54	553	60,639	ヘルスケア		
SEALED AIR CORP	14.5	14.5	55	6,084	素材		
INTUITIVE SURGICAL INC	10.28	12.38	725	79,461	ヘルスケア		
CHECK POINT SOFTWARE TECH	12.36	17.9	199	21,909	情報技術		
SNAP-ON INC	5	5	83	9,130	資本財・サービス		
CARMAX INC	19.9	19.9	174	19,100	一般消費財・サービス		
COMERICA INC	14.76	11.87	82	9,082	金融		
INGREDION INC	5.3	5.3	48	5,271	生活必需品		
DUKE ENERGY CORP	69.64	82.01	743	81,429	公益事業		
TARGET CORP	49.32	55.74	688	75,426	一般消費財・サービス		
DOVER CORP	12	17.13	200	21,982	資本財・サービス		
WW GRAINGER INC	4	5.88	201	22,109	資本財・サービス		
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11.16	17.5	159	17,427	資本財・サービス		
CINTAS CORP	7.63	9.95	277	30,455	資本財・サービス		
CONAGRA BRANDS INC	55.67	55.67	179	19,647	生活必需品		
LAMB WESTON HOLDINGS INC	15	15	136	14,921	生活必需品		
CLOROX COMPANY	12.78	12.78	195	21,396	生活必需品		
ENERGY CORP	16	21.14	254	27,855	公益事業		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千ドル			
MICROSOFT CORP	683.32	809.83	13,126	1,438,274	情報技術		
INCYTE CORP	14.47	19.93	155	17,022	ヘルスケア		
CVS HEALTH CORP	121.21	147.72	1,076	117,928	ヘルスケア		
MEDTRONIC PLC	128.89	148.77	1,761	192,984	ヘルスケア		
MICRON TECHNOLOGY INC	113.72	129.91	744	81,576	情報技術		
BLACKROCK INC	10.57	13.6	697	76,459	金融		
CENTERPOINT ENERGY INC	56.36	56.36	149	16,333	公益事業		
HASBRO INC	10	14.49	150	16,495	一般消費財・サービス		
KELLOGG CO	26.2	26.2	181	19,848	生活必需品		
KEYCORP	87.73	117.82	231	25,418	金融		
KANSAS CITY SOUTHERN	7.5	11.76	188	20,605	資本財・サービス		
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	133.02	165.75	898	98,415	生活必需品		
KOHL'S CORP	16.5	16.5	76	8,343	一般消費財・サービス		
COOPER COS INC/THE	5.97	5.72	190	20,886	ヘルスケア		
APACHE CORP	36.73	36.73	119	13,119	エネルギー		
CHUBB LTD	42.88	50.52	777	85,218	金融		
ARROW ELECTRONICS INC	10	10	84	9,286	情報技術		
ALLSTATE CORP	34.1	39.99	455	49,855	金融		
EBAY INC	90.53	90.53	318	34,896	一般消費財・サービス		
PAYPAL HOLDINGS INC	102.54	129.27	1,455	159,445	情報技術		
EASTMAN CHEMICAL CO	12.83	12.83	96	10,595	素材		
XILINX INC	22	25.83	262	28,729	情報技術		
DISH NETWORK CORP-A	15	29.84	106	11,633	コミュニケーション・サービス		
ZIONS BANCORP NA	19	19	98	10,742	金融		
ESTEEL LAUDER COMPANIES-CL A	20.44	23.4	495	54,345	生活必需品		
TRIMBLE INC	22	22	93	10,208	情報技術		
LENNAR CORP-A	33.94	33.94	195	21,453	一般消費財・サービス		
LEAR CORP	6	6	83	9,108	一般消費財・サービス		
E*TRADE FINANCIAL CORP	23	39.17	181	19,939	金融		
PROGRESSIVE CORP	50.67	64.74	478	52,449	金融		
PACCAR INC	35.25	35.25	276	30,300	資本財・サービス		
PVH CORP	5.5	6.18	63	6,994	一般消費財・サービス		
BIOGEN INC	18.99	21.3	626	68,684	ヘルスケア		
IDEXX LABORATORIES INC	7.42	9.37	260	28,535	ヘルスケア		
STARBUCKS CORP	124.84	130.62	1,182	129,566	一般消費財・サービス		
PTC INC	12	12	92	10,167	情報技術		
PERRIGO CO PLC	9	19.29	96	10,523	ヘルスケア		
EVERSOURCE ENERGY	34.23	34.23	285	31,279	公益事業		
INTUIT INC	24.25	28.46	782	85,723	情報技術		
BORGWARNER INC	15.5	30.81	129	14,154	一般消費財・サービス		
BEST BUY CO INC	23	23	205	22,522	一般消費財・サービス		
BALL CORP	28.92	35.8	238	26,171	素材		
BOSTON SCIENTIFIC CORP	131.42	162.47	742	81,372	ヘルスケア		
ELECTRONIC ARTS INC	30.24	36.77	402	44,059	コミュニケーション・サービス		
VULCAN MATERIALS CO	10.5	16.06	228	25,040	素材		
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	23.03	28.56	657	72,055	ヘルスケア		
VF CORP	32.04	38.82	371	40,740	一般消費財・サービス		
VIACOMCBS INC - CLASS B	28.41	57.34	234	25,639	コミュニケーション・サービス		
VIACOM INC-CLASS B	30.71	-	-	-	その他		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千ドル			
MOHAWK INDUSTRIES INC	4.8	9.42	119	13,082	一般消費財・サービス		
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10.03	10.03	146	16,077	ヘルスケア		
CARNIVAL CORP	38.14	49.92	245	26,911	一般消費財・サービス		
COMCAST CORP-CLASS A	436.24	510.46	2,323	254,542	コミュニケーション・サービス		
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	21	21	66	7,248	資本財・サービス		
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	22	22	122	13,458	資本財・サービス		
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	56	56	31	3,485	生活必需品		
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	110	231	131	14,427	不動産		
アメリカ・ドル 通貨計	28,351.43	33,749.8	313,580	34,359,059			
銘柄数<比率>	594銘柄	608銘柄	<63.7%>				
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円			
IMPERIAL OIL LTD	23	23	80	6,778	エネルギー		
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1.5	2.5	340	28,589	情報技術		
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	24.38	24.38	38	3,255	エネルギー		
RESTAURANT BRANDS INTERN	21.21	21.21	174	14,611	一般消費財・サービス		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	42	42	152	12,779	素材		
INTACT FINANCIAL CORP	10	17	245	20,548	金融		
BCE INC	9	9	54	4,550	コミュニケーション・サービス		
FRANCO-NEVADA CORP	16	22	289	24,298	素材		
SUNCOR ENERGY INC	152.12	172.12	765	64,238	エネルギー		
METRO INC/CN	16	30	162	13,637	生活必需品		
NATIONAL BANK OF CANADA	33	33	237	19,919	金融		
BANK OF NOVA SCOTIA	119	130	939	78,807	金融		
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	38	44	473	39,718	金融		
TORONTO-DOMINION BANK	166	189	1,383	116,016	金融		
GREAT-WEST LIFE CO INC	17	39	131	11,055	金融		
ROYAL BANK OF CANADA	135	166	1,733	145,391	金融		
TOURMALINE OIL CORP	13	-	-	-	エネルギー		
VERMILION ENERGY INC	14	-	-	-	エネルギー		
TC ENERGY CORP	76	88	607	50,977	エネルギー		
PEMBINA PIPELINE CORP	55.71	55.71	279	23,413	エネルギー		
BOMBARDIER INC-B	192	192	35	3,011	資本財・サービス		
BARRICK GOLD CORP	136	174	399	33,535	素材		
CAE INC	23	23	86	7,289	資本財・サービス		
THOMSON REUTERS CORP	18.33	18.33	180	15,141	資本財・サービス		
EMPIRE CO LTD 'A'	18	18	55	4,622	生活必需品		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6	6	34	2,913	素材		
CCL INDUSTRIES INC - CL B	10	10	56	4,776	素材		
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	11	-	-	-	エネルギー		
HYDRO ONE LTD	15	48	120	10,132	公益事業		
LOBLAW COMPANIES LTD	14.89	24.89	168	14,172	生活必需品		
WSP GLOBAL INC	12	12	110	9,280	資本財・サービス		
PARKLAND FUEL CORP	-	28	134	11,255	エネルギー		
QUEBECOR INC -CL B	-	23	75	6,317	コミュニケーション・サービス		
EMERA INC	12	25	140	11,817	公益事業		
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	10	39	3,291	公益事業		
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	30	39	253	21,251	コミュニケーション・サービス		
AGNICO EAGLE MINES LTD	18	29	223	18,742	素材		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千カナダ・ドル	千円			
STARS GROUP INC/THE	35	35	118	9,957	一般消費財・サービス		
ALQUIN POWER & UTILITIES	-	70	130	10,949	公益事業		
AIR CANADA	-	17	84	7,071	資本財・サービス		
KINROSS GOLD CORP	105.34	105.34	61	5,141	素材		
BANK OF MONTREAL	58	66	669	56,156	金融		
POWER CORP OF CANADA	31	31	105	8,821	金融		
METHANEX CORP	6	6	29	2,507	素材		
SHOPIFY INC - CLASS A	8	10	561	47,098	情報技術		
NUTRIEN LTD	51.27	60.27	374	31,446	素材		
AURORA CANNABIS INC	70	70	16	1,420	ヘルスケア		
CANOPY GROWTH CORP	20	20	54	4,564	ヘルスケア		
CRONOS GROUP INC	-	34	31	2,626	ヘルスケア		
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	-	22	123	10,391	素材		
CAMECO CORP	28	28	31	2,644	エネルギー		
TELUS CORP	3	3	15	1,263	コミュニケーション・サービス		
POWER FINANCIAL CORP	20	20	70	5,904	金融		
TECK RESOURCES LTD-CLS B	44	44	89	7,517	素材		
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5	4	57	4,793	一般消費財・サービス		
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	80	-	-	-	素材		
CANADIAN NATURAL RESOURCES	117	117	490	41,174	エネルギー		
FAIRFAX FINANCIAL HDGS LTD	3	3	183	15,386	金融		
MAGNA INTERNATIONAL INC	31	31	218	18,342	一般消費財・サービス		
WESTON (GEORGE) LTD	9.01	9.01	93	7,848	生活必需品		
BLACKBERRY LTD	64	64	55	4,648	情報技術		
SUN LIFE FINANCIAL INC	52	65	408	34,235	金融		
ENBRIDGE INC	173	213	1,109	93,090	エネルギー		
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	78	90	685	57,457	金融		
MANULIFE FINANCIAL CORP	202	202	555	46,555	金融		
BAUSCH HEALTH COS INC	20	43	157	13,192	ヘルスケア		
GOLDCORP INC	63	-	-	-	素材		
ENCANA CORP	69	152	88	7,432	エネルギー		
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12	18	606	50,890	資本財・サービス		
IA FINANCIAL CORP INC	11	11	80	6,734	金融		
GILDAN ACTIVEWEAR INC	14	28	107	9,034	一般消費財・サービス		
CANADIAN NATL RAILWAY CO	64	71	854	71,629	資本財・サービス		
CGI INC - CLASS A	28	28	315	26,470	情報技術		
HUSKY ENERGY INC	30.12	30.12	31	2,617	エネルギー		
ONEX CORPORATION	7	16	138	11,625	金融		
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	39	68	180	15,164	コミュニケーション・サービス		
FINNING INTERNATIONAL INC	25	-	-	-	資本財・サービス		
SNC-LAVALIN GROUP INC	19	-	-	-	資本財・サービス		
IGM FINANCIAL INC	3	3	11	962	金融		
OPEN TEXT CORP	27	27	162	13,611	情報技術		
CI FINANCIAL CORP	20	20	45	3,836	金融		
SAPUTO INC	13	29	115	9,651	生活必需品		
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63	63	76	6,377	素材		
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	45	90	395	33,144	生活必需品		
FORTIS INC	42	42	228	19,169	公益事業		
LUNDIN MINING CORP	66	66	49	4,162	素材		
CENOVUS ENERGY INC	80	141	184	15,432	エネルギー		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千カナダ・ドル	千円			
DOLLARAMA INC	27	27	122	10,307	一般消費財・サービス		
ATCO LTD -CLASS I	8	8	39	3,335	公益事業		
ALTAGAS LTD	8	47	92	7,789	公益事業		
FIRST CAPITAL REALTY INC	20	-	-	-	不動産		
KEYERA CORP	22	22	75	6,356	エネルギー		
INTER PIPELINE LTD	48	48	107	8,977	エネルギー		
ARC RESOURCES LTD	28	-	-	-	エネルギー		
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 総株数<比率>	3,722.88 88銘柄	4,325.88 85銘柄	-20,902 <3.3%>	1,753,064		
(オーストラリア)	株数	株数	千オーストラリア・ドル	千円			
MEDIBANK PRIVATE LTD	228.24	228.24	74	5,575	金融		
BHP GROUP LTD	278.32	318.05	1,273	95,702	素材		
SOUTH32 LTD	563.87	563.87	157	11,825	素材		
ALUMINA LTD	121	362.17	83	6,288	素材		
WOODSIDE PETROLEUM LTD	77.28	95.76	340	25,625	エネルギー		
FORTESCUE METALS GROUP LTD	105	205.54	222	16,717	素材		
BENIGO AND ADELAIDE BANK	36	36	35	2,687	金融		
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	268.99	297.31	738	55,492	金融		
WESTPAC BANKING CORP	330.42	368.11	900	67,710	金融		
SANTOS LTD	182.7	182.7	162	12,181	エネルギー		
AUSNET SERVICES	285	285	49	3,749	公益事業		
AUST AND NZ BANKING GROUP	278.74	307.72	765	57,573	金融		
RIO TINTO LTD	33.49	41.69	426	32,024	素材		
ORIGIN ENERGY LTD	120.5	209.68	182	13,696	エネルギー		
AMCOR LIMITED	109.96	-	-	-	素材		
AURIZON HOLDINGS LTD	153.1	290.47	158	11,921	資本財・サービス		
COLES GROUP LTD	95.67	166.96	254	19,101	生活必需品		
OIL SEARCH LTD	154.18	154.18	119	9,016	エネルギー		
SEEK LTD	26	26	60	4,516	資本財・サービス		
TREASURY WINE ESTATES LTD	55.92	101.73	169	12,762	生活必需品		
NEWCREST MINING LTD	58.04	84.2	262	19,741	素材		
INCITEC PIVOT LTD	204	204	65	4,937	素材		
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	166.92	188.45	1,535	115,436	金融		
CALTEX AUSTRALIA LTD	20	20	71	5,337	エネルギー		
ORICA LTD	20	58.45	131	9,872	素材		
QBE INSURANCE GROUP LTD	98.22	153.48	200	15,078	金融		
CIMIC GROUP LTD	10	10	33	2,488	資本財・サービス		
WOOLWORTHS GROUP LTD	117.6	140.56	523	39,326	生活必需品		
COCA-COLA AMATIL LTD	26	26	30	2,257	生活必需品		
TABCORP HOLDINGS LTD	173.52	173.52	79	5,986	一般消費財・サービス		
CROWN RESORTS LTD	30	30	36	2,767	一般消費財・サービス		
TELSTRA CORP LTD	351.14	351.14	133	10,030	コミュニケーション・サービス		
AMP LTD	249.35	249.35	46	3,476	金融		
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	32	67.33	197	14,854	素材		
MACQUARIE GROUP LTD	33.47	31.29	435	32,724	金融		
ARISTOCRAT LEISURE LTD	61.63	61.63	215	16,223	一般消費財・サービス		
BANK OF QUEENSLAND LTD	30	-	-	-	金融		
CSL LTD	40.37	54.73	1,593	119,760	ヘルスケア		
WESFARMERS LTD	95.67	157.53	681	51,261	一般消費財・サービス		
COCHLEAR LTD	4.44	8.05	184	13,894	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		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ドル	千円			
BLUESCOPE STEEL LTD	70.92	70.92	109	8,225	109	8,225	素材
SUNCORP GROUP LTD	149.38	145.04	191	14,380	191	14,380	金融
BORAL LTD	86	86	41	3,083	41	3,083	素材
ASX LTD	13	22.6	183	13,769	183	13,769	金融
COMPUTERSHARE LTD	37	20.61	35	2,701	35	2,701	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	270.97	205	15,480	205	15,480	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	25	52.23	157	11,801	157	11,801	ヘルスケア
CHALLENGER LTD	63	63	52	3,921	52	3,921	金融
WORLEY LTD	71.26	71.87	114	8,622	114	8,622	エネルギー
AGL ENERGY LTD	47.39	84.66	172	12,944	172	12,944	公益事業
BRAMBLES LTD	183.37	183.37	219	16,471	219	16,471	資本財・サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	8	8	35	2,653	35	2,653	一般消費財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9	20.64	155	11,682	155	11,682	ヘルスケア
REA GROUP LTD	6.08	6.08	65	4,943	65	4,943	コミュニケーション・サービス
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	-	15.51	96	7,283	96	7,283	金融
DOMINOS PIZZA ENTERPRISES L	6.21	-	-	-	-	-	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	6,373.33 55銘柄	7,432.39 53銘柄	14,468 < 2.0%>	1,087,595 < 2.0%>		
(香港)	株数	株数	千香港ドル	千円			
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	145	235	1,357	19,149	1,357	19,149	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	220	220	1,324	18,687	1,324	18,687	一般消費財・サービス
MTR CORP	165	165	759	10,721	759	10,721	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	160	190	2,245	31,688	2,245	31,688	不動産
SINO LAND CO	340	340	386	5,459	386	5,459	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	270.52	285.52	2,098	29,610	2,098	29,610	資本財・サービス
WHARF HOLDINGS LTD	80	-	-	-	-	-	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	35	80	578	8,166	578	8,166	不動産
CLP HOLDINGS LTD	190	190	1,565	22,090	1,565	22,090	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	105.14	205.65	780	11,012	780	11,012	不動産
HANG LUNG GROUP LTD	80	-	-	-	-	-	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,073.05	1,180.35	1,805	25,481	1,805	25,481	公益事業
HANG SENG BANK LTD	64	90	1,467	20,699	1,467	20,699	金融
WHEELLOCK & CO LTD	60	160	858	12,112	858	12,112	不動産
NEW WORLD DEVELOPMENT	580	580	622	8,789	622	8,789	不動産
WH GROUP LTD	915	915	803	11,335	803	11,335	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	119	139	3,819	53,896	3,819	53,896	金融
MINTH GROUP LTD	60	-	-	-	-	-	一般消費財・サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	120	370	683	9,637	683	9,637	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20	20	223	3,154	223	3,154	情報技術
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	80	80	188	2,663	188	2,663	一般消費財・サービス
NWS HOLDINGS LTD	150	150	170	2,400	170	2,400	資本財・サービス
KERRY PROPERTIES LTD	75	75	183	2,582	183	2,582	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	86	86	150	2,125	150	2,125	金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	60	-	-	-	-	-	不動産
SJM HOLDINGS LTD	100	100	98	1,387	98	1,387	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	80	80	207	2,929	207	2,929	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	230.52	305.52	1,686	23,796	1,686	23,796	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	55	306	4,322	306	4,322	公益事業
PCCW LTD	600	600	283	3,995	283	3,995	コミュニケーション・サービス

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千香港ドル	千円			
AIA GROUP LTD	1,236	1,478	12,651	178,515	1,478	178,515	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140	140	644	9,086	140	9,086	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	-	120	328	4,630	120	4,630	生活必需品
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	-	192	504	7,124	192	7,124	生活必需品
SANDS CHINA LTD	230	238	1,023	14,440	238	14,440	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	40	-	-	-	-	-	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	120	190	1,207	17,037	190	17,037	資本財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	140	-	-	-	-	-	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	390	390	1,074	15,160	390	15,160	金融
WYNN MACAU LTD	168	168	334	4,717	168	4,717	一般消費財・サービス
香港ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	8,782.23 38銘柄	9,813.04 34銘柄	42,424 < 1.1%>	598,608 < 1.1%>		
(シンガポール)	株数	株数	千シンガポール・ドル	千円			
UNITED OVERSEAS BANK LTD	133	129	345	28,027	129	28,027	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	171	211	545	44,251	211	44,251	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	71	71	63	5,141	71	5,141	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	173	173	118	9,596	173	9,596	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	52	166	138	11,227	166	11,227	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	52	58	4,714	52	4,714	不動産
CAPITALAND LTD	190	334	128	10,401	334	10,401	不動産
YANGZHIJIANG SHIPBUILDING	270	270	31	2,561	270	2,561	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	120	120	26	2,121	120	2,121	コミュニケーション・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9	9	27	2,208	9	2,208	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	348	348	383	31,129	348	31,129	金融
GENTING SINGAPORE LTD	450	450	41	3,375	450	3,375	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	32	32	52	4,258	32	4,258	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	924	924	310	25,178	924	25,178	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	141	57	4,642	141	4,642	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	40	40	9	755	40	755	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	90	-	-	-	-	-	生活必需品
SATS LTD	77	77	39	3,184	77	3,184	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	69	168	147	11,989	168	11,989	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	100	369	84	6,823	369	6,823	資本財・サービス
WILLMAR INTERNATIONAL LTD	158	158	67	5,484	158	5,484	生活必需品
シンガポール・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,670 21銘柄	4,242 20銘柄	2,676 < 0.4%>	217,077 < 0.4%>		
(ニュージーランド)	株数	株数	千ニュージーランド・ドル	千円			
MERIDIAN ENERGY LTD	150	150	73	5,320	150	5,320	公益事業
MERCURY NZ LTD	-	217.05	111	8,091	-	8,091	公益事業
A2 MILK CO LTD	70	70	103	7,499	70	7,499	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	168.6	168.6	76	5,553	168.6	5,553	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81	81	72	5,283	81	5,283	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	145.26	145.26	75	5,436	145.26	5,436	素材
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	37	92	197	14,318	92	14,318	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	44.19	44.19	72	5,230	44.19	5,230	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	696.05 7銘柄	968.1 8銘柄	783 < 0.1%>	56,733 < 0.1%>		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
(イギリス)	百株	百株	千円	千円			
MERLIN ENTERTAINMENT	50	—	—	—			その他
TUI AG-DI	48.02	48.02	44	6,418			一般消費財・サービス
BP PLC	1,812.02	2,309.65	1,136	162,752			エネルギー
UNILEVER PLC	111.99	120.91	517	74,127			生活必需品
BARCLAYS PLC	1,505.91	1,801.73	329	47,182			金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	140.34	177.45	121	17,417			資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	105	324.28	63	9,027			一般消費財・サービス
PRUDENTIAL PLC	259.64	303.22	447	64,137			金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	508.36	508.36	121	17,377			金融
EVRAZ PLC	—	74.41	29	4,162			素材
JOHNSON MATTHEY PLC	17.58	17.58	51	7,416			素材
BAE SYSTEMS PLC	293.37	377.96	224	32,097			資本財・サービス
AVIVA PLC	327.89	443.49	185	26,529			金融
AVEVA GROUP PLC	—	11.4	54	7,790			情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC	455.6	546.29	977	140,054			ヘルスケア
INFORMA PLC	110	162	136	19,525			コミュニケーション・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	31.33	42.04	46	6,609			情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC	400	643.35	153	21,946			資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	133.52	144.99	81	11,694			コミュニケーション・サービス
DCC PLC	9.38	9.38	61	8,761			資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	—	44.17	56	8,074			一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	7.4	66	9,463			資本財・サービス
HALMA PLC	—	39.78	83	11,946			情報技術
GVC HOLDINGS PLC	41.61	88.05	81	11,716			一般消費財・サービス
CONVATEC GROUP PLC	65.81	—	—	—			ヘルスケア
ROYAL MAIL PLC	100.76	—	—	—			資本財・サービス
NMC HEALTH PLC	9.75	9.75	13	1,871			ヘルスケア
JD SPORTS FASHION PLC	—	64.11	53	7,596			一般消費財・サービス
M&G PLC	—	259.64	63	9,042			金融
RELX PLC	178.81	202.6	390	55,968			資本財・サービス
DIAGEO PLC	228.95	266.94	866	124,070			生活必需品
RIO TINTO PLC	105.82	125.42	558	79,946			素材
STANDARD CHARTERED PLC	297.45	297.45	210	30,150			金融
TESCO PLC	887.48	1,093.1	276	39,652			生活必需品
FRESNILLO PLC	24	—	—	—			素材
SMITH & NEPHEW PLC	83.29	112.97	208	29,881			ヘルスケア
GLENCORE PLC	1,067.03	1,235.14	294	42,178			素材
JOHN WOOD GROUP PLC	54.66	—	—	—			エネルギー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	32	60	8,675			金融
SMITHS GROUP PLC	40.8	40.8	71	10,213			資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	6	—	—	—			資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	109.63	109.63	35	5,039			金融
PEARSON PLC	82.71	82.71	51	7,403			コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	176.31	176.31	39	5,663			生活必需品
NEXT PLC	11.59	11.59	78	11,286			一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	322.36	63	9,052			一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	17.85	17.85	84	12,068			一般消費財・サービス
BUNZL PLC	31.59	31.59	64	9,238			資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	2,477.53	3,034.98	461	66,047			コミュニケーション・サービス

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
(イギリス)	百株	百株	千円	千円			
CRODA INTERNATIONAL PLC	8.03	17.49	88	12,611			素材
KINGFISHER PLC	172.29	172.29	37	5,366			一般消費財・サービス
WPP PLC	130.21	130.21	138	19,766			コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	82.44	77	11,137			公益事業
SEVERN TRENT PLC	13	13	32	4,620			公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	—	177.58	80	11,571			資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	66.64	80.82	491	70,406			生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	48.83	48.83	56	8,094			金融
SCHRODERS PLC	12.27	12.27	40	5,765			金融
SSE PLC	82.82	124.6	175	25,168			公益事業
WEIR GROUP PLC/THE	39.42	39.42	57	8,253			資本財・サービス
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	123.68	93	13,425			一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	121.53	144.04	1,106	158,443			ヘルスケア
FERGUSON PLC	19.89	27.24	194	27,876			資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	496.81	682.32	210	30,184			金融
3I GROUP PLC	84.39	132.93	145	20,826			金融
ASHTOUD GROUP PLC	39	59.21	146	20,969			資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	97.25	97.25	72	10,339			情報技術
NATIONAL GRID PLC	303.25	357.13	334	47,896			公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,763.72	7,349.13	454	65,095			金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	125.86	125.86	71	10,169			金融
IMPERIAL BRANDS PLC	82.23	102.29	201	28,791			生活必需品
CENTRICA PLC	680.02	680.02	59	8,521			公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	7	19.63	94	13,566			一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	223.21	255.03	882	126,332			生活必需品
BHP GROUP PLC	213.17	261.42	463	66,310			素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	29.6	49.64	132	18,909			生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	1,828.42	2,333.46	1,372	196,528			金融
ANGLO AMERICAN PLC	107.45	107.45	230	32,991			素材
MONDI PLC	34	59.21	101	14,516			素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	145	391.67	75	10,800			生活必需品
CARNIVAL PLC	13.83	13.83	48	7,015			一般消費財・サービス
EASYJET PLC	16.44	16.44	23	3,386			資本財・サービス
COMPASS GROUP PLC	142.39	164.81	314	45,080			一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	25.69	25.69	70	10,043			一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	856.24	856.24	165	23,666			コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	12	25.74	67	9,683			生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	33	51.36	113	16,321			一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	13.72	21.82	110	15,827			一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	15.92	15.92	92	13,177			資本財・サービス
ITV PLC	275.87	275.87	40	5,813			コミュニケーション・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	27.35	34.41	267	38,269			金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	437.7	477.42	1,079	154,553			エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	340.53	428.67	972	139,324			エネルギー
MEGGITT PLC	99.25	99.25	67	9,665			資本財・サービス
G4S PLC	113.2	113.2	22	3,256			資本財・サービス
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	15.7	36	5,200			金融
INVESTEC PLC	46	—	—	—			金融
ANTOFAGASTA PLC	34.6	34.6	32	4,631			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		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	178.99	330.46	104	14,978	金融
EXPERIAN PLC	75.55	93.19	240	34,418	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	27,729.14 92銘柄	33,125.03 93銘柄	20,605 < 5.5%>	2,950,852
(イスラエル)	株数	株数	千イスラエル・シケル	千円	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	—	120	188	5,951	金融
AZRIELI GROUP LTD	5.3	5.3	135	4,298	不動産
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	50	—	—	—	コミュニケーション・サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD	110.96	110.96	178	5,650	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	3	3	164	5,215	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	79	151.6	439	13,896	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	114	190.43	472	14,955	金融
NICE LTD	8	8	453	14,349	情報技術
イスラエル・シケル通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	370.26 7銘柄	589.29 7銘柄	2,033 < 0.1%>	64,317
(スイス)	株数	株数	千スイス・フラン	千円	
DUFREY AG-REG	1.89	8.3	80	9,067	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	374.02	425.77	540	60,834	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.5	1.3	81	9,144	素材
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	17.54	108	12,160	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	65.41	76.24	2,422	272,655	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	3.89	3.89	31	3,563	金融
SIKA AG-REG	11.4	11.4	198	22,370	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	0.01	87	9,814	生活必需品
ABB LTD-REG	176.76	206.23	485	54,592	資本財・サービス
SWISS RE AG	25	36.66	398	44,829	金融
NESTLE SA-REG	285.66	335.45	3,457	389,177	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1.63	2.34	213	24,055	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3	5.31	129	14,594	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	215.08	301.22	409	46,073	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	21.98	21.98	111	12,517	金融
SGS SA-REG	0.46	0.65	170	19,145	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1.53	1.53	36	4,053	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	3.69	6.65	120	13,509	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG	5.08	7.93	123	13,847	情報技術
ALCON INC	—	42.49	237	26,713	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	2.67	5	135	15,273	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	13.47	14.92	596	67,102	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	3.2	6.11	107	12,103	金融
CLARIANT AG-REG	15.68	15.68	33	3,790	素材
NOVARTIS AG-REG	202.9	234.62	2,166	243,890	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.2	0.2	42	4,794	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	44.47	54.28	414	46,674	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	2.76	2.76	143	16,153	コミュニケーション・サービス
GEBERIT AG-REG	3.34	4.56	248	28,022	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	0.89	0.89	267	30,130	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1.11	1.11	111	12,499	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	5.63	5.63	125	14,130	ヘルスケア
LONZA GROUP AG-REG	6.92	8.55	300	33,863	ヘルスケア

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	4.5	23	2,593	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	38.01	47.7	253	28,561	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3.81	3.81	186	20,956	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	4.95	4.95	81	9,164	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	9.46	107	12,127	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.1	0.17	132	14,857	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,578.6 38銘柄	1,937.79 39銘柄	14,921 < 3.1%>	1,679,410
(デンマーク)	株数	株数	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	185.25	210.28	8,156	132,792	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	72.36	72.36	798	12,993	金融
ISS A/S	13.2	13.2	224	3,655	資本財・サービス
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.3	0.3	263	4,290	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	5	5	128	2,087	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	18.57	18.57	1,191	19,396	資本財・サービス
CARLSBERG AS-B	12.32	12.32	1,232	20,056	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	18.02	29.81	942	15,345	素材
COLOPLAST-B	10.52	15.19	1,237	20,154	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	16.5	27.98	2,109	34,345	資本財・サービス
DEMANT A/S	13.14	13.14	274	4,464	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.66	0.66	613	9,981	資本財・サービス
TRYG A/S	17	17	335	5,466	金融
PANDORA A/S	7.5	7.5	261	4,253	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	7.5	12.62	658	10,724	素材
GENMAB A/S	7.33	7.33	1,110	18,078	ヘルスケア
ORSTED A/S	23.33	22.76	1,469	23,929	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	428.5 17銘柄	486.02 17銘柄	21,008 < 0.6%>	342,017
(ノルウェー)	株数	株数	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORSK HYDRO ASA	130.5	130.5	416	5,142	素材
DNB ASA	85.45	85.45	1,422	17,570	金融
ORKLA ASA	70	137.84	1,200	14,823	生活必需品
TELENOR ASA	62.5	87.46	1,384	17,098	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	111.21	111.21	2,017	24,921	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	14.5	27.56	979	12,093	素材
MOWI ASA	46.77	46.77	1,069	13,204	生活必需品
GENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	20	368	4,549	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	17	17	439	5,433	コミュニケーション・サービス
AKER BP ASA	13.06	13.06	380	4,693	エネルギー
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	570.99 10銘柄	676.85 10銘柄	9,678 < 0.2%>	119,531
(スウェーデン)	株数	株数	千スウェーデン・クローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB	7	7	307	3,546	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	323.35	403.81	3,393	39,196	情報技術
VOLVO AB-B SHS	145.68	181.58	2,847	32,884	資本財・サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	7.77	7.77	344	3,982	コミュニケーション・サービス
SKF AB-B SHARES	40	40	747	8,630	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円			
ELECTROLUX AB-SER B	26	26	609	7,045	一般消費財・サービス		
SWEDISH MATCH AB	12	21.88	1,155	13,343	生活必需品		
TELE2 AB-B SHS	32.58	70.26	1,001	11,572	コミュニケーション・サービス		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	196.97	196.97	1,791	20,693	金融		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	165.26	165.26	1,674	19,345	金融		
SWEDBANK AB - A SHARES	90.75	90.75	1,237	14,296	金融		
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	90.39	90.39	1,717	19,840	一般消費財・サービス		
SKANSKA AB-B SHS	37.09	37.09	806	9,317	資本財・サービス		
SANDVIK AB	101.22	132.81	2,449	28,293	資本財・サービス		
INVESTOR AB-B SHS	45.5	62.9	3,283	37,923	金融		
ATLAS COPCO AB-A SHS	76.68	76.68	2,924	33,778	資本財・サービス		
SECURITAS AB-B SHS	25	25	407	4,702	資本財・サービス		
TELIA CO AB	241.07	364.21	1,487	17,175	コミュニケーション・サービス		
ALFA LAVAL AB	20	48.4	1,155	13,349	資本財・サービス		
ATLAS COPCO AB-B SHS	54.99	38.11	1,270	14,675	資本財・サービス		
ASSA ABLOY AB-B	108.82	108.82	2,413	27,877	資本財・サービス		
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	9.48	395	4,565	金融		
LUNDIN PETROLEUM AB	19	19	611	7,068	エネルギー		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	50.5	67.47	2,057	23,767	生活必需品		
BOLIDEN AB	31.71	31.71	781	9,024	素材		
EPIROC AB-A	69.82	69.82	807	9,330	資本財・サービス		
EPIROC AB-B	25	25	280	3,235	資本財・サービス		
HUSQVARNA AB-B SHS	24	24	188	2,180	一般消費財・サービス		
NORDEA BANK ABP	339.57	435.48	3,342	38,608	金融		
KINNEVIK AB - B	15	36.41	842	9,726	金融		
HEXAGON AB-B SHS	24	38.68	2,049	23,669	情報技術		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13	13	296	3,427	金融		
スウェーデン・クロネ 通貨計	株数、金額 2,469.2 32銘柄	株数、金額 2,965.74 32銘柄	44,681	516,076			
ユーロ (アイルランド)	株数、金額 7銘柄	株数、金額 7銘柄	809	98,459			
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19.95	19.95	67	8,186	素材		
AIB GROUP PLC	90	90	28	3,471	金融		
BANK OF IRELAND GROUP PLC	102.34	102.34	50	6,196	金融		
KINGSPAN GROUP PLC	16	16	88	10,806	資本財・サービス		
KERRY GROUP PLC-A	17.12	17.12	191	23,354	生活必需品		
CRH PLC	65	80.12	283	34,533	素材		
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	8.89	8.89	97	11,910	一般消費財・サービス		
国小計	株数、金額 7銘柄	株数、金額 7銘柄	809	98,459			
ユーロ (オランダ)	株数、金額 7銘柄	株数、金額 7銘柄	809	98,459			
QIAGEN N.V.	25.21	25.21	77	9,430	ヘルスケア		
KONINKLIJKE PHILIPS NV	81.13	93.09	416	50,625	ヘルスケア		
NN GROUP NV	31	31	105	12,833	金融		
UNILEVER NV-CVA	141.32	-	-	-	その他		
HEINEKEN NV	29.1	29.1	286	34,866	生活必需品		
AEGON NV	143.61	143.61	57	7,046	金融		
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	106.52	131.07	290	35,392	生活必需品		
AKZO NOBEL N.V.	28.18	25.04	224	27,347	素材		
KONINKLIJKE DSM NV	19.38	19.38	220	26,861	素材		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円			
WOLTERS KLUWER	23.76	30.97	205	25,031	資本財・サービス		
ING GROEP NV	364.4	432.86	476	57,973	金融		
KONINKLIJKE KPN NV	360	295.49	78	9,611	コミュニケーション・サービス		
ASML HOLDING NV	34.89	46.53	1,267	154,239	情報技術		
ABN AMRO BANK NV-CVA	34.53	34.53	57	7,052	金融		
ADYEN NV	-	1.5	112	13,631	情報技術		
UNILEVER NV	-	166.82	836	101,826	生活必需品		
PROSUS NV	-	54.94	382	46,578	一般消費財・サービス		
VOPAK	6.3	6.3	31	3,785	エネルギー		
RANDSTAD NV	7.5	20.2	112	13,740	資本財・サービス		
HEINEKEN HOLDING NV	11	11	98	11,926	生活必需品		
ALTICE EUROPE NV	-	112.95	67	8,208	コミュニケーション・サービス		
STMICROELECTRONICS NV	74.98	74.98	188	22,993	情報技術		
AIRBUS SE	51.12	63.45	856	104,174	資本財・サービス		
EXOR NV	10.88	10.88	75	9,177	金融		
CNH INDUSTRIAL NV	116.91	116.91	115	14,098	資本財・サービス		
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	107.87	107.87	138	16,844	一般消費財・サービス		
FERRARI NV	11.3	14.78	225	27,473	一般消費財・サービス		
国小計	株数、金額 23銘柄	株数、金額 26銘柄	7,007	852,775			
ユーロ (ベルギー)	株数、金額 10銘柄	株数、金額 11銘柄	1,552	188,978			
GALAPAGOS NV	-	5.57	106	12,919	ヘルスケア		
UCB SA	11.1	19.21	146	17,822	ヘルスケア		
KBC GROUP NV	22.11	30.11	204	24,879	金融		
COLRUYT SA	3.5	3.5	15	1,927	生活必需品		
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9	15.39	146	17,829	金融		
SOLVAY SA	8.73	8.73	90	10,958	素材		
UMICORE	16	16	68	8,389	素材		
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	65.89	83.47	611	74,433	生活必需品		
AGEAS	16.54	16.54	86	10,562	金融		
PROXIMUS	22.69	22.69	57	6,999	コミュニケーション・サービス		
TELENET GROUP HOLDING NV	4.62	4.62	18	2,256	コミュニケーション・サービス		
国小計	株数、金額 10銘柄	株数、金額 11銘柄	1,552	188,978			
ユーロ (ルクセンブルグ)	株数、金額 5銘柄	株数、金額 5銘柄	417	50,812			
AROUNDTOWN SA	80.42	160.64	127	15,521	不動産		
RTL GROUP	3.5	-	-	-	コミュニケーション・サービス		
ARCELORMITTAL	53.27	80.31	122	14,854	素材		
EUROFINS SCIENTIFIC	1.31	1.31	63	7,773	ヘルスケア		
SES	44.02	44.02	54	6,671	コミュニケーション・サービス		
TENARIS SA	47	47	49	5,991	エネルギー		
国小計	株数、金額 5銘柄	株数、金額 5銘柄	417	50,812			
ユーロ (フランス)	株数、金額 5銘柄	株数、金額 5銘柄	417	50,812			
JCDECAUX SA	8.45	8.45	22	2,786	コミュニケーション・サービス		
TOTAL SA	219.22	255.19	1,274	155,146	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	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円			
MICHELIN (CGDE)	18.61	18.61	206	25,081	一般消費財・サービス		
AIR LIQUIDE SA	39.38	52.1	653	79,567	素材		
KERING	7.08	8.24	491	59,752	一般消費財・サービス		
SCHNEIDER ELECTRIC SE	52.24	58.92	540	65,820	資本財・サービス		
BOUYGUES SA	18.92	18.92	71	8,742	資本財・サービス		
BNP PARIBAS	95.82	122.69	642	78,233	金融		
PEUGEOT SA	64.97	64.97	135	16,516	一般消費財・サービス		
NATIXIS	76.74	76.74	30	3,744	金融		
THALES SA	9.18	14.04	135	16,487	資本財・サービス		
DANONE	58.53	64.94	472	57,451	生活必需品		
CARREFOUR SA	51.56	80.22	121	14,823	生活必需品		
SUEZ	29.5	29.5	40	4,869	公益事業		
VIVENDI	88.01	104.3	270	32,961	コミュニケーション・サービス		
L'OREAL	23.46	27.41	720	87,657	生活必需品		
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	58.49	58.49	208	25,402	資本財・サービス		
LEGRAND SA	22.5	30.42	221	26,956	資本財・サービス		
CASINO GUICHARD PERRACHON	2	2	7	937	生活必需品		
PERNOD RICARD SA	21.54	26.32	420	51,150	生活必需品		
SOCIETE BIC SA	1.5	-	-	-	資本財・サービス		
EURAZEO SE	5.34	5.6	33	4,102	金融		
REXEL SA	38.7	-	-	-	資本財・サービス		
SOCIETE GENERALE SA	61.29	80.65	256	31,194	金融		
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	25.46	29.88	1,268	154,352	一般消費財・サービス		
ACCOR SA	18.5	18.5	75	9,135	一般消費財・サービス		
CAPEGMINI SE	16.45	16.45	179	21,829	情報技術		
VALEO SA	19.65	37.03	119	14,563	一般消費財・サービス		
PUBLICIS GROUPE	18.06	29.18	122	14,920	コミュニケーション・サービス		
BUREAU VERITAS SA	32.27	32.27	76	9,279	資本財・サービス		
IEFFAGE	7.5	7.5	77	9,437	資本財・サービス		
SODEXO SA	6.69	12.48	125	15,262	一般消費財・サービス		
IPSEN	2.76	2.76	21	2,639	ヘルスケア		
INGENICO GROUP	4.99	4.99	49	5,986	情報技術		
AMUNDI SA	4.37	4.37	30	3,717	金融		
TELEPERFORMANCE	5	8.7	195	23,778	資本財・サービス		
UBISOFT ENTERTAINMENT	9.77	9.77	63	7,689	コミュニケーション・サービス		
FAURECIA	5.6	5.6	26	3,271	一般消費財・サービス		
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	-	3.99	60	7,399	ヘルスケア		
SEB SA	1.97	1.97	27	3,325	一般消費財・サービス		
ESSILORLUXOTTICA	27.31	31.11	439	53,436	一般消費財・サービス		
DASSAULT AVIATION SA	0.22	0.22	24	3,006	資本財・サービス		
WORLDLINE SA	-	13.3	87	10,601	情報技術		
AXA SA	185.78	231.71	585	71,196	金融		
EDENRED	19.13	30.07	142	17,330	資本財・サービス		
RENAULT SA	16.5	25.54	107	13,076	一般消費財・サービス		
HERMES INTERNATIONAL	2.68	3.41	234	28,507	一般消費財・サービス		
REMY COINTREAU	2.53	2.53	28	3,408	生活必需品		
ATOS SE	9.46	9.46	73	8,921	情報技術		
DASSAULT SYSTEMES SA	11.49	15.15	230	28,105	情報技術		
WENDEL	2.01	2.01	24	2,922	金融		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円			
ORANGE	174.04	257.92	339	41,272	コミュニケーション・サービス		
ALSTOM	13.1	29.61	127	15,555	資本財・サービス		
CNP ASSURANCES	13.49	13.49	23	2,889	金融		
SANOFI	102.52	120.77	1,111	135,207	ヘルスケア		
VINCI SA	44.64	55.31	547	66,579	資本財・サービス		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	69.73	73.51	174	21,254	公益事業		
CREDIT AGRICOLE SA	99.04	146.09	190	23,137	金融		
BIOMERIEUX	4.57	4.57	39	4,813	ヘルスケア		
ENGIE	144.44	210.99	312	38,025	公益事業		
IMERYS SA	3.4	-	-	-	素材		
EDF	67.6	67.6	67	8,157	公益事業		
SAFRAN SA	31.33	35.87	500	60,870	資本財・サービス		
ILIAD SA	2.19	2.19	25	3,127	コミュニケーション・サービス		
ARKEMA	8.38	8.38	76	9,271	素材		
ADP	3.5	3.5	61	7,423	資本財・サービス		
EUTELSAT COMMUNICATIONS	14	14	19	2,407	コミュニケーション・サービス		
SCOR SE	12.97	32.89	125	15,233	金融		
GETLINK SE	39.4	39.4	60	7,398	資本財・サービス		
BOLLORE	73	73	28	3,455	コミュニケーション・サービス		
国小計	株数、金額 68銘柄	金額 2,987.76 67銘柄	15,305	1,862,569			
			< 3.5% >				
ユーロ (ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
BAYER AG-REG	85.32	100.78	753	91,635	ヘルスケア		
EVONIK INDUSTRIES AG	18	18	48	5,854	素材		
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	229.67	229.67	177	21,565	金融		
COMMERZBANK AG	96.89	96.89	56	6,898	金融		
VOLKSWAGEN AG	4.2	4.2	75	9,153	一般消費財・サービス		
VOLKSWAGEN AG-PREF	17.74	21.21	385	46,902	一般消費財・サービス		
SIEMENS AG-REG	70.78	82.21	973	118,448	資本財・サービス		
E.ON SE	222.7	276.97	261	31,881	公益事業		
INIPER SE	13.8	13.8	40	4,881	公益事業		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	29.21	29.21	217	26,431	一般消費財・サービス		
GEA GROUP AG	13	13	37	4,614	資本財・サービス		
OSRAM LIGHT AG	6.45	-	-	-	資本財・サービス		
CONTINENTAL AG	11.8	11.8	141	17,248	一般消費財・サービス		
BASF SE	79.21	112.83	748	91,045	素材		
ALLIANZ SE-REG	38.42	45.48	1,003	122,145	金融		
THYSSENKRUPP AG	40.3	40.3	48	5,958	素材		
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	18.57	18.57	172	21,025	生活必需品		
RWE AG	53.09	75.26	206	25,185	公益事業		
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	17	17	27	3,343	資本財・サービス		
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	5.6	5.6	40	4,956	資本財・サービス		
BRENNTAG AG	14.36	14.36	71	8,644	資本財・サービス		
FRESENIUS SE & CO KGAA	37.09	48.35	243	29,606	ヘルスケア		
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9.59	9.59	29	3,587	コミュニケーション・サービス		
HOCHTIEF AG	1.66	1.66	18	2,298	資本財・サービス		
SAP SE	89.04	104.71	1,289	156,932	情報技術		
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12.14	17.04	457	55,717	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		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円			
ZALANDO SE	7	20.25	94	11,495	一般消費・サービス		
HEIDELBERGCEMENT AG	12.3	21.28	139	16,935	素材		
KION GROUP AG	6	6	36	4,459	資本財・サービス		
WIRECARD AG	10	13.67	151	18,390	情報技術		
COVESTRO AG	19.45	19.45	80	9,744	素材		
INNOGY SE	15	-	-	-	公益事業		
SARTORIUS AG-VORZUG	3.05	3.05	60	7,348	ヘルスケア		
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	12.65	21.02	144	17,629	一般消費・サービス		
DELIVERY HERO SE	10.56	10.56	69	8,442	一般消費・サービス		
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	-	5.6	66	8,123	ヘルスケア		
METRO AG	15	15	20	2,471	生活必需品		
1&1 DRILLISCH AG	5	-	-	-	コミュニケーション・サービス		
SIEMENS HEALTHINEERS AG	15	15	64	7,891	ヘルスケア		
KNORR-BREMSE AG	-	5.49	50	6,149	資本財・サービス		
BEIERSDORF AG	8.15	12.75	136	16,624	生活必需品		
FUCHS PETROLUB SE - PREF	7	7	31	3,862	素材		
MERCK KGAA	11.49	16.92	190	23,173	ヘルスケア		
ADIDAS AG	15.92	19.8	613	74,693	一般消費・サービス		
PUMA SE	0.51	12.95	94	11,472	一般消費・サービス		
HENKEL AG & CO KGAA	13.11	13.11	112	13,640	生活必需品		
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	289.91	363.69	540	65,722	コミュニケーション・サービス		
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAWMLER AG-REGISTERED SHARES	22.71	22.71	150	18,350	ヘルスケア		
INFINEON TECHNOLOGIES AG	80.1	98.52	489	59,560	一般消費・サービス		
HANNOVER RUECK SE	130.44	130.44	282	34,333	情報技術		
DEUTSCHE POST AG-REG	6.44	6.44	112	13,675	金融		
DEUTSCHE BOERSE AG	89.74	106.76	369	44,983	資本財・サービス		
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	18.97	18.04	259	31,634	金融		
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	15.6	-	-	-	コミュニケーション・サービス		
LANXESS AG	6	15.29	88	10,769	素材		
MTU AERO ENGINES AG	4	6.66	180	21,906	資本財・サービス		
AXEL SPRINGER SE	4.7	-	-	-	コミュニケーション・サービス		
DEUTSCHE WOHNEN SE	32.85	47.96	171	20,899	不動産		
SYMRISE AG	14.36	14.36	131	16,059	素材		
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	62.4	62.4	16	2,060	コミュニケーション・サービス		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	2.5	9	51	6,242	一般消費・サービス		
HUGO BOSS AG -ORD	8.11	-	-	-	一般消費・サービス		
VONOVIA SE	44.35	57.63	282	34,433	不動産		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,256 2,607.29	12,812 1,559,147	1,559,147 < 2.9%>			
ユーロ (ポルトガル)	株数	株数	千ユーロ	千円			
JERONIMO MARTINS	29	29	43	5,297	生活必需品		
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	275.76	275.76	105	12,795	公益事業		
GALP ENERGIA SGPS SA	36.09	71.83	110	13,461	エネルギー		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	340.85 3銘柄	376.59 3銘柄	259 < 0.1%>	31,553		
ユーロ (スペイン)	株数	株数	千ユーロ	千円			
TELEFONICA SA	405.69	542.59	335	40,811	コミュニケーション・サービス		

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円			
ENDESA SA	21.5	21.5	49	6,072	公益事業		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	604.32	711.85	361	44,005	金融		
IBERDROLA SA	560.28	685.24	605	73,630	公益事業		
BANCO DE SABADELL SA	496.34	503.83	52	6,388	金融		
BANKINTER SA	67	67	43	5,327	金融		
REPSOL SA	142	176.85	250	30,495	エネルギー		
GRIFOLS SA	30.04	30.04	98	12,045	ヘルスケア		
BANCO SANTANDER SA	1,404.79	1,775.93	669	81,442	ヘルスケア		
AMADEUS IT GROUP SA	43.11	50.48	375	45,641	情報技術		
NATURGY ENERGY GROUP SA	39.78	39.78	88	10,780	公益事業		
MAPFRE SA	80.05	80.05	19	2,350	金融		
CAIXABANK SA	304.87	468.59	133	16,262	金融		
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	49	-	-	-	資本財・サービス		
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	21.95	35.83	122	14,964	資本財・サービス		
AENA SME SA	5.69	8.66	147	17,915	資本財・サービス		
CELLNEX TELECOM SA	-	20.96	85	10,345	コミュニケーション・サービス		
IBERDROLA SA-RTS	560.28	-	-	-	公益事業		
IBERDROLA SA - RTS	-	685.24	11	1,364	公益事業		
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	96.55	117.54	374	45,585	一般消費・サービス		
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	17.93	17.93	26	3,265	資本財・サービス		
ENAGAS SA	36.75	36.75	84	10,285	公益事業		
RED ELECTRICA CORPORACION SA	40.56	40.56	70	8,536	公益事業		
FERROVIAL SA	38.76	60.55	167	20,343	資本財・サービス		
BANKIA SA	159.05	159.05	29	3,549	金融		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,226.29 23銘柄	6,336.8 23銘柄	4,202 < 0.9%>	511,409		
ユーロ (イタリア)	株数	株数	千ユーロ	千円			
PRYSMIAN SPA	14.4	41.45	88	10,814	資本財・サービス		
ASSICURAZIONI GENERALI	117.33	117.33	216	26,371	金融		
MEDIOBANCA SPA	44.6	99.71	99	12,082	金融		
UNICREDIT SPA	211.47	294.71	398	48,479	金融		
TELECOM ITALIA SPA	1,085.03	1,085.03	57	6,949	コミュニケーション・サービス		
TELECOM ITALIA-RSP	483.81	483.81	24	3,039	コミュニケーション・サービス		
INTESA SANPAOLO	1,354.57	1,354.57	321	39,132	金融		
ATLANTIA SPA	60.27	60.27	129	15,768	資本財・サービス		
POSTE ITALIANE SPA	29	77.27	79	9,642	金融		
MONCLER SPA	15.22	15.22	62	7,619	一般消費・サービス		
RECORDATI SPA	6.92	6.92	26	3,266	ヘルスケア		
ENI SPA	211.46	286.21	404	49,248	エネルギー		
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	44.83	44.83	36	4,487	生活必需品		
PIRELLI & C SPA	56.51	56.51	29	3,635	一般消費・サービス		
LEONARDO SPA	25	66.76	75	9,172	資本財・サービス		
ENEL SPA	711.57	889.57	649	79,077	公益事業		
SNAM SPA	243	243	114	13,910	公益事業		
TERNA SPA	199	199	119	14,495	公益事業		
FINCOBANK SPA	-	59.72	69	8,401	金融		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,913.99 18銘柄	5,481.89 19銘柄	3,004 < 0.7%>	365,593		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ (フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ	44.93	65.25	194	23,677	素材
NOKIA OYJ	544.37	652.61	236	28,792	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	41.16	41.16	40	4,895	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	41.93	88.53	108	13,240	素材
METSO OYJ	11.08	11.08	37	4,570	資本財・サービス
ELISA OYJ	13	13	64	7,859	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS	38.32	49.34	193	23,554	金融
FORTUM OYJ	44	44	95	11,624	公益事業
KONE OYJ-B	38.6	38.6	227	27,638	資本財・サービス
NOKIAN RENKAAT OYJ	17.7	17.7	45	5,550	一般消費財・サービス
NESTE OYJ	11	48.49	148	18,127	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	17.63	17.63	73	8,892	ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	863.72 12銘柄	1,087.39 12銘柄	1,466 < 0.3%>	178,423
ユーロ (オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
VERBUND AG	13	12.16	53	6,475	公益事業
OMV AG	12.09	12.09	60	7,373	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	27.5	27.5	94	11,448	金融
VOESTALPINE AG	18	18	45	5,482	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	11	11	24	3,017	金融
ANDRITZ AG	5.5	5.5	20	2,550	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	87.09 6銘柄	86.25 6銘柄	298 < 0.1%>	36,347
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	18,688.35 237銘柄	21,957.96 236銘柄	47,136 <10.6%>	5,736,070
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	103,430.96 1,236銘柄	122,269.89 1,242銘柄	— <91.8%>	49,480,414

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首		期末		業種等
	口数	口数	評価額	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	1,372	1,679	346	37,961	
SIMON PROPERTY GROUP INC	2,794	3,433	495	54,252	
BOSTON PROPERTIES INC	1,556	1,556	209	22,941	
VORNADO REALTY TRUST	2,128	2,128	140	15,414	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,055	1,28	308	33,828	
EQUITY RESIDENTIAL	3,603	4,248	341	37,427	
EQUINIX INC	0,706	0,944	556	60,921	
AMERICAN TOWER CORP	4,045	4,869	1,102	120,820	
HOST HOTELS & RESORTS INC	6,228	6,228	108	11,894	
KIMCO REALTY CORP	3.3	3.3	63	6,989	
INVITATION HOMES INC	2.2	6,081	181	19,875	
VICI PROPERTIES INC	—	5,464	138	15,176	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	2,403	—	—	—	
VENTAS INC	3,702	3,702	209	22,946	
WEYERHAEUSER CO	7,435	7,435	219	24,064	
AGNC INVESTMENT CORP	4,334	7,559	135	14,858	
CROWN CASTLE INTL CORP	4,153	4,614	647	70,904	
IRON MOUNTAIN INC	1,718	3,474	107	11,765	
VEREIT INC	7.75	13,632	125	13,741	
SUN COMMUNITIES INC	—	1,214	179	19,674	
PROLOGIS INC	5,687	7,007	623	68,299	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.2	1.2	188	20,678	
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.65	1,177	124	13,601	
DUKE REALTY CORP	3.1	4,971	171	18,753	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.6	0,771	230	25,297	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.974	0,974	121	13,317	
WELLTOWER INC	3,797	4,572	377	41,308	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	4.55	6,434	223	24,448	
LIBERTY PROPERTY TRUST	1	2,058	123	13,520	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.1	1.1	143	15,704	
MACERICH CO/THE	0.7	—	—	—	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	1.95	135	14,834	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	9.6	15,632	148	16,271	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,552	1,552	82	9,024	
REALTY INCOME CORP	2,55	3,348	245	26,871	
PUBLIC STORAGE	1.54	1.75	374	41,051	
REGENCY CENTERS CORP	1.15	1,939	119	13,076	
SL GREEN REALTY CORP	0.65	0.65	58	6,434	
UDR INC	1.9	2,965	135	14,833	
WP CAREY INC	1.6	1.6	129	14,170	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	2,164	90	9,913	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1.8	2,269	269	29,515	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,285	1,072	113	12,436	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	4,197	88	9,693	
アメリカ・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	107,467 39銘柄	154,192 42銘柄	9,934 <2.0%>	1,088,519
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	2	40	3,366	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	—	1.6	83	7,033	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2	2	41	3,510	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1.4	1.4	37	3,129	
カナダ・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	3.4 2銘柄	7 4銘柄	203 <0.0%>	17,039

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		当期		期末	
	口数	口数	外貨建金額	邦貨換算金額	評価額	評価額
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円		
LENDEASE GROUP	4.303	4.303	78	5,880		
TRANSURBAN GROUP	26.027	31.468	482	36,285		
SYDNEY AIRPORT	9.129	9.129	80	6,018		
APA GROUP	7.5	14.243	162	12,237		
SCENTRE GROUP	43.529	64.017	252	18,959		
DEXUS	6.5	13.949	168	12,634		
GPT GROUP	14.648	30.647	178	13,453		
MIRVAC GROUP	31.638	61.117	198	14,931		
STOCKLAND	14.3	18.729	89	6,757		
GOODMAN GROUP	14.731	20.198	283	21,316		
VICINITY CENTRES	19.523	50.371	126	9,503		
オーストラリア・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	191,828 11銘柄	318,171 11銘柄	2,101 <0.3%>	157,980 <0.3%>	
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円		
LINK REIT	24	24	1,953	27,565		
HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	52	52	408	5,767		
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34	34	388	5,488		
香港ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	110 3銘柄	110 3銘柄	2,751 <0.1%>	38,820 <0.1%>	
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円		
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	28	28	57	4,677		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30.5	30.5	93	7,569		
CAPITALAND MALL TRUST	9	31.5	78	6,386		
SUNTEC REIT	26	26	48	3,900		
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	-	37.6	90	7,379		
シンガポール・ドル 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	93.5 4銘柄	153.6 5銘柄	368 <0.1%>	29,913 <0.1%>	
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円		
LAND SECURITIES GROUP PLC	4.808	10.295	99	14,209		
SEGRO PLC	5.92	13.286	115	16,591		
HAMMERSON PLC	10.958	-	-	-		
BRITISH LAND CO PLC	6.3	14.58	86	12,373		
イギリス・ポンド 通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	27,986 4銘柄	38,161 3銘柄	301 <0.1%>	43,174 <0.1%>	
ユーロ (フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1.249	1.751	234	28,499		
ICADE	0.406	0.406	39	4,826		
GECINA SA	0.334	0.578	94	11,486		
KLEPIERRE	2.394	2.394	79	9,674		
COVIVIO	0.353	0.353	36	4,381		
ユーロ通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	4,736 5銘柄	5,482 5銘柄	483 <0.1%>	58,868 <0.1%>	
合計	口数、金額 銘柄数<比率>	538,917 68銘柄	786,606 73銘柄	-	1,434,316 <2.7%>	

(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。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期		期末	
	買建額	売建額	買建額	売建額
外				
S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	百万円 2,225		百万円 -	
S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	206		-	
SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	76		-	
FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	194		-	
国				
SWISS MKT IX FUTR (スイス)	142		-	
EURO STOXX 50 (ドイツ)	414		-	

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年1月10日現在

項目	当期		期末	
	評価額	比率	評価額	比率
株式	千円 49,480,414	% 90.7		
投資信託証券	1,434,316	2.6		
コール・ローン等、その他	3,612,735	6.7		
投資信託財産総額	54,527,467	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=109.57円、1カナダ・ドル=83.87円、1オーストラリア・ドル=75.17円、1香港ドル=14.11円、1シンガポール・ドル=81.10円、1ニュージーランド・ドル=72.39円、1イギリス・ポンド=143.21円、1イスラエル・シェケル=31.63円、1スイス・フラン=112.55円、1デンマーク・クローネ=16.28円、1ノルウェー・クローネ=12.35円、1スウェーデン・クローネ=11.55円、1ユーロ=121.69円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (51,771,191千円) の投資信託財産総額 (54,527,467千円) に対する比率は、94.9%です。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年1月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	104,741,744,575円
コール・ローン等	2,992,542,078
株式(評価額)	49,480,414,413
投資信託証券(評価額)	1,434,316,814
未収入金	50,267,600,333
未収配当金	52,619,098
差入委託証拠金	514,251,839
(B) 負債	50,835,408,630
未払金	50,829,638,630
未払解約金	5,770,000
(C) 純資産総額(A - B)	53,906,335,945
元本	24,932,860,048
次期繰越損益金	28,973,475,897
(D) 受益権総口数	24,932,860,048口
1万口当り基準価額(C/D)	21,621円

* 期首における元本額は21,206,702,536円、当作成期間中における追加設定元本額は8,648,429,006円、同解約元本額は4,922,271,494円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 19,746,138,057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) 1,112,575,052円、i F r e e 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 484,020,450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) 3,590,126,489円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は21,621円です。

■損益の状況

当期 自2019年1月11日 至2020年1月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	949,832,503円
受取配当金	944,503,888
受取利息	1,250,974
その他収益金	5,063,900
支払利息	△ 986,259
(B) 有価証券売買損益	8,003,237,110
売買益	13,467,345,239
売買損	△ 5,464,108,129
(C) 先物取引等損益	621,805,523
取引益	715,195,819
取引損	△ 93,390,296
(D) その他費用	△ 13,620,368
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	9,561,254,768
(F) 前期繰越損益金	15,724,208,270
(G) 解約差損益金	△ 4,818,111,135
(H) 追加信託差損益金	8,506,123,994
(I) 合計(E + F + G + H)	28,973,475,897
次期繰越損益金(I)	28,973,475,897

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

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

ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用)

運用報告書(全体版) 第4期

(決算日 2020年6月15日)

(作成対象期間 2019年6月18日～2020年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6 月15日)	10,094	100	1.9	10,127	1.3	97.0	1.4	2.6	1
2 期末 (2018年 6 月15日)	11,273	220	13.9	11,344	12.0	97.9	1.5	2.4	1
3 期末 (2019年 6 月17日)	11,306	30	0.6	11,184	△ 1.4	96.1	1.3	2.9	16
4 期末 (2020年 6 月15日)	11,489	0	1.6	11,193	0.1	96.5	0.6	2.7	223

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

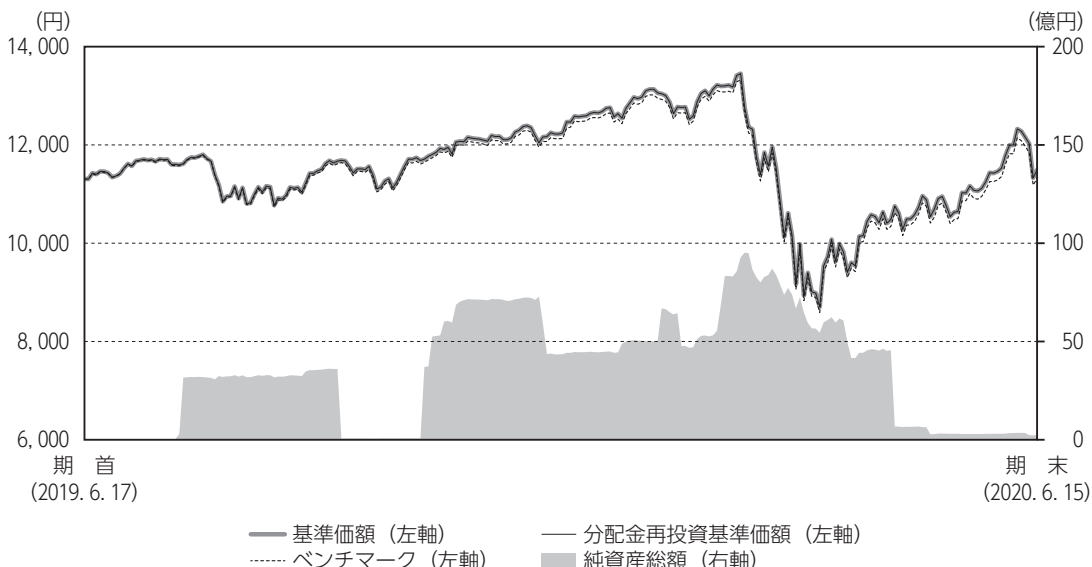
(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

* ベンチマークはMSCIコクサイ指数（円ベース）です。

■ 基準価額・騰落率

期首：11,306円

期末：11,489円（分配金0円）

騰落率：1.6%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

ベンチマーク（MSCIコクサイ指数（円ベース））の動きをほぼ反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ外国株式インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用)

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数 (円ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首)2019年 6月17日	円 11,306	% —	11,184	% —	% 96.1	% 1.3	% 2.9
6月末	11,416	1.0	11,283	0.9	95.8	1.6	2.8
7月末	11,722	3.7	11,577	3.5	95.7	1.5	2.7
8月末	11,137	△ 1.5	10,982	△ 1.8	95.0	2.0	2.9
9月末	11,497	1.7	11,317	1.2	95.8	1.2	3.0
10月末	11,951	5.7	11,741	5.0	91.0	6.1	2.8
11月末	12,390	9.6	12,165	8.8	90.6	6.6	2.7
12月末	12,761	12.9	12,515	11.9	92.4	5.0	2.7
2020年 1月末	12,770	12.9	12,521	12.0	91.2	6.0	2.7
2月末	11,758	4.0	11,517	3.0	89.5	7.8	2.8
3月末	9,986	△ 11.7	9,776	△ 12.6	89.5	8.2	2.6
4月末	10,961	△ 3.1	10,703	△ 4.3	95.3	2.4	2.7
5月末	11,427	1.1	11,135	△ 0.4	93.7	3.9	2.6
(期末)2020年 6月15日	11,489	1.6	11,193	0.1	96.5	0.6	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

（2019. 6. 18 ~ 2020. 6. 15）

■海外株式市況

海外株式市況は横ばいとなりました。

米国・欧州を中心とした海外株式市況は、当作成期首より、世界的な金融緩和期待や英国の合意なきEU（欧州連合）離脱懸念の後退などを受け、上昇基調となりました。2019年11月以降は、米中通商協議の進展期待が高まり、底堅い展開となりました。2020年1月以降は、米中通商協議の第1段階合意による米国の対中追加関税回避などを背景に、上昇しました。2月以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大や原油価格の急落などを受けて、大きく下落しました。3月下旬以降は、各国の大胆な景気刺激策やウイルス治療薬開発への期待などを好感し、上昇して当作成期末を迎えました。

■為替相場

為替相場は円高となりました。

対円為替相場は、当作成期首より、米中貿易摩擦への懸念や世界的な景気減速懸念などから、円高が進行しました。2019年9月以降は、米中貿易摩擦への懸念が後退したことなどから、円安傾向となりました。2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大への懸念が高まり、特に2月下旬から3月中旬にかけて大きく円高が進行しました。その後は、大幅な下落の反発などから、円安となりました。当作成期末にかけては、世界的な経済活動の再開期待から、おおむね円安となりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「外国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（MSCIコクサイ指数（円ベース））の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

ポートフォリオについて

（2019. 6. 18 ~ 2020. 6. 15）

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

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

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

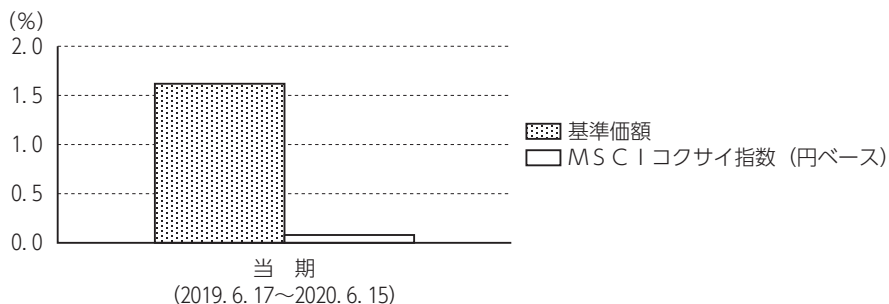
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は0.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は1.6%となりました。

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

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2019年6月18日 ～2020年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	2,842

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



今後の運用方針

当ファンド

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

外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2019. 6. 18~2020. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	51円	0. 441%	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, 581円です。
(投 信 会 社)	(36)	(0. 310)	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. 109)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	1	0. 006	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0. 003)	
(先物・オプション)	(0)	(0. 003)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 000)	
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
(株 式)	(1)	(0. 007)	
(投資信託証券)	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	4	0. 031	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. 024)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0. 001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	56	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。

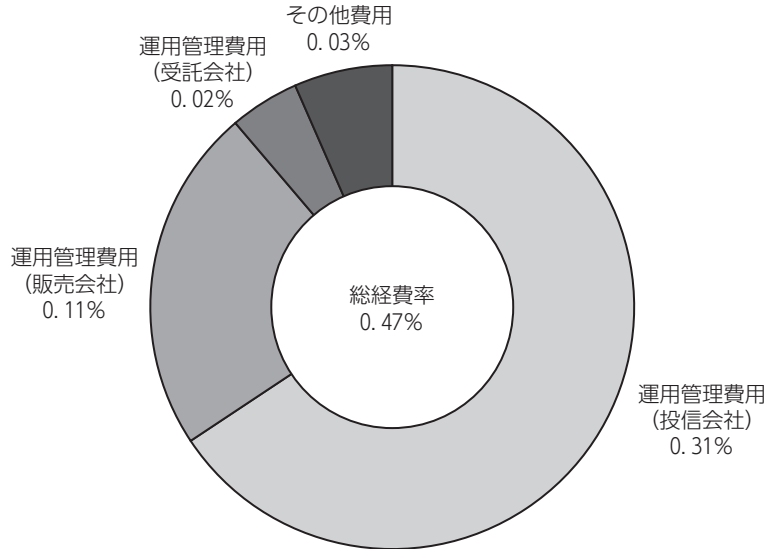
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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。

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）

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2019年6月18日から2020年6月15日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数 千口	金 額 千円	□ 数 千口	金 額 千円
外国株式 インデックス マザーファンド	6,843,191	18,553,362	6,762,354	16,702,537

（注）単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2019年6月18日から2020年6月15日まで）

項 目	当 期
	外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	28,193,116千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	116,508,208千円
(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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

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

（注1）金額は元本ベース。

（注2）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	□ 数 千口	金 額 千円	□ 数 千口	評 価 額 千円
外国株式インデックス マザーファンド	6,619	18,553,362	87,456	223,460

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額 千円	比 率 %
外国株式インデックス マザーファンド	223,460	96.0
コール・ローン等、その他	9,312	4.0
投資信託財産総額	232,772	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。

（注2）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.24円、1カナダ・ドル=78.66円、1オーストラリア・ドル=73.06円、1香港・ドル=13.84円、1シンガポール・ドル=76.86円、1ニュージーランド・ドル=68.74円、1イギリス・ポンド=134.14円、1イスラエル・シェケル=30.85円、1スイス・フラン=112.71円、1デンマーク・クローネ=16.19円、1ノルウェー・クローネ=11.07円、1スウェーデン・クローネ=11.48円、1ユーロ=120.68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（130,087,899千円）の投資信託財産総額（130,252,441千円）に対する比率は、99.9%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	232,772,717円
コール・ローン等	9,302,446
外国株式インデックス マザーファンド（評価額）	223,460,271
未収入金	10,000
(B) 負債	9,293,111
未払信託報酬	9,179,847
その他未払費用	113,264
(C) 純資産総額（A－B）	223,479,606
元本	194,514,017
次期繰越損益金	28,965,589
(D) 受益権総口数	194,514,017口
1万口当り基準価額（C/D）	11,489円

* 期首における元本額は14,626,454円、当作成期間中における追加設定元本額は15,442,007,002円、同解約元本額は15,262,119,439円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,489円です。

■損益の状況

当期 自 2019年6月18日 至 2020年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 445円
受取利息	1,521
支払利息	△ 1,966
(B) 有価証券売買損益	△ 957,291
売買益	1,217,574,600
売買損	△ 1,218,531,891
(C) 信託報酬等	△ 15,815,091
(D) 当期繰越損益金 (A + B + C)	△ 16,772,827
(E) 前期繰越損益金	79
(F) 追加信託差損益金	45,738,337
(配当等相当額)	(55,295,423)
(売買損益相当額)	(△ 9,557,086)
(G) 合計 (D + E + F)	28,965,589
次期繰越損益金 (G)	28,965,589
追加信託差損益金	45,738,337
(配当等相当額)	(55,295,423)
(売買損益相当額)	(△ 9,557,086)
分配準備積立金	79
繰越損益金	△ 16,772,827

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	55,295,423
(d) 分配準備積立金	79
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	55,295,502
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	55,295,502
(h) 受益権総口数	194,514,017口

《お知らせ》

■商号変更について

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

外国株式インデックスマザーファンド

<補足情報>

当ファンド（ダイワ外国株式インデックス（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（2019年12月2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（2020年6月15日）現在における外国株式インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■外国株式インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄

（2019年6月18日から2020年6月15日まで）

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
MICROSOFT CORP (アメリカ)	38.6	665,218	17,233	CELGENE CORP (アメリカ)	20.8	245,538	11,804
AMAZON.COM INC (アメリカ)	2.55	557,470	218,615	APPLE INC (アメリカ)	6.5	161,816	24,894
APPLE INC (アメリカ)	16.7	454,836	27,235	MICROSOFT CORP (アメリカ)	8.2	125,968	15,361
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	13.95	291,959	20,929	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.52	105,764	203,393
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	1.69	233,880	138,391	BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)	24.7	70,517	2,854
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	1.65	225,862	136,886	ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.42	55,711	132,646
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	9.95	214,824	21,590	FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	2.5	50,740	20,296
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	13.9	207,979	14,962	NESTLE SA-REG (スイス)	4	46,543	11,635
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO (アメリカ)	29.2	177,607	6,082	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.33	43,799	132,724
NESTLE SA-REG (スイス)	15	173,180	11,545	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	3.4	43,502	12,794

（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、2020年6月15日現在における外国株式インデックスマザーファンド（50,896,184千円）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	35.5	431	46,304	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	32.3	716	76,845	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	61	583	62,583	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	44	338	36,318	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	17.8	186	19,982	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	173	411	44,099	金融
ABBOTT LABORATORIES	561.66	4,999	536,188	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	132.33	185	19,867	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	49.5	805	86,351	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	111	553	59,363	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	94	893	95,775	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	196.62	2,695	289,040	情報技術
QORVO INC	36.5	397	42,626	情報技術
AFLAC INC	216.5	793	85,068	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	41.5	315	33,796	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	50.5	248	26,601	コミュニケーション・サービス

銘柄	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ADOBE INC	153.5	6,240	669,219	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	70.5	207	22,227	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	39.9	1,182	126,808	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	144	175	18,839	金融
GARMIN LTD	46.5	426	45,712	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	71.1	1,671	179,212	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	227.5	3,287	352,562	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	45.75	260	27,975	金融
AUTOZONE INC	7.4	814	87,333	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	74.21	651	69,849	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	366.5	412	44,216	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	35	264	28,375	公益事業
CELANESE CORP	37.5	331	35,598	素材
DR HORTON INC	108.16	584	62,635	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	70	303	32,564	ヘルスケア
AUTODESK INC	69.8	1,556	166,893	情報技術
MOODY'S CORP	53.5	1,428	153,175	金融
ALBEMARLE CORP	35.5	274	29,435	素材
ATMOS ENERGY CORP	40	401	43,080	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	75.5	366	39,309	公益事業
CITIGROUP INC	669.73	3,499	375,269	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	138.7	2,039	218,665	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	156	1,276	136,846	公益事業
ALLEGHANY CORP	4.8	242	25,957	金融
DOMINO'S PIZZA INC	12	453	48,663	一般消費財・サービス
HESS CORP	85	421	45,221	エネルギー
DAVITA INC	27.5	215	23,076	ヘルスケア
DANAHER CORP	199.5	3,359	360,238	ヘルスケア
FORTIVE CORP	98.5	626	67,234	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	175.5	1,636	175,521	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	178	701	75,266	生活必需品
BUNGE LTD	44.5	175	18,797	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	106.75	838	89,968	情報技術
APPLE INC	1,392	47,160	5,057,541	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	97	514	55,121	金融
BOEING CO/THE	170.6	3,233	346,711	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	47.65	290	31,186	金融
BECTON DICKINSON AND CO	87.19	2,013	215,878	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	67	119	12,789	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	43.5	430	46,140	情報技術
CDK GLOBAL INC	40	165	17,788	情報技術
NISOURCE INC	118	274	29,433	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	42	326	35,010	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	252.21	969	103,968	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,317.04	7,445	798,426	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	441.5	8,000	857,965	金融
ANSYS INC	27.8	751	80,574	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	431.17	1,701	182,504	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	217	1,209	129,689	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	718.5	4,035	432,800	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	980.7	9,794	1,050,335	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	73.5	888	95,318	金融
LKQ CORP	91.5	236	25,399	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	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	14.8	271	29,117	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	100.62	656	70,407	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	90.5	809	86,822	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	38.6	566	60,701	金融
DOLLAR GENERAL CORP	81	1,490	159,830	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	60.8	2,341	251,112	情報技術
CATERPILLAR INC	176.5	2,173	233,096	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	74.5	302	32,492	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	73	320	34,422	公益事業
CMS ENERGY CORP	93	542	58,144	公益事業
MOSAIC CO/THE	109.5	145	15,594	素材
DELTA AIR LINES INC	51.5	156	16,806	資本財・サービス
CORNING INC	246	662	71,044	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,352.5	6,095	653,704	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	42	245	26,290	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	381	1,763	189,092	金融
MSCI INC	27	866	92,930	金融
FAIR ISAAC CORP	9.5	392	42,128	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	11	240	25,832	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	71	402	43,133	情報技術
BROADCOM INC	127.72	3,834	411,243	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	35.8	448	48,139	ヘルスケア
ARAMARK	72	182	19,534	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	72.5	160	17,252	素材
DTE ENERGY COMPANY	62.5	656	70,423	公益事業
CENTENE CORP	183.87	1,138	122,134	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	35	349	37,496	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	134.5	347	37,242	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	61.5	586	62,866	金融
GARTNER INC	29.2	346	37,179	情報技術
SPLUNK INC	50.3	899	96,490	情報技術
DOMINION ENERGY INC	268.41	2,231	239,341	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	128.5	877	94,119	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	42.5	199	21,398	資本財・サービス
DEERE & CO	94.5	1,464	157,049	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	96.34	1,720	184,499	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	26.8	364	39,043	情報技術
CABLE ONE INC	1.5	258	27,759	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	20.5	417	44,744	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	37	426	45,690	金融
VAIL RESORTS INC	13.6	250	26,864	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	46	167	18,015	金融
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	19.5	171	18,398	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	24.3	151	16,242	金融
CONSOLIDATED EDISON INC	105.5	795	85,283	公益事業
COGNEX CORP	55	303	32,534	情報技術
TELEFLEX INC	15	528	56,662	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	28	319	34,261	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	24	481	51,663	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	7.1	318	34,175	ヘルスケア
CATALENT INC	48.5	337	36,184	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	42.8	927	99,453	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	20	339	36,438	ヘルスケア

銘柄	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
IDEX CORP	24	366	39,273	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	261	1,899	203,736	生活必需品
ROLLINS INC	49.25	203	21,870	資本財・サービス
AMETEK INC	74.25	650	69,799	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	78	570	61,129	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	43.5	169	18,179	資本財・サービス
HEICO CORP	14	153	16,438	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	28	209	22,472	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	12.4	355	38,161	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	86	572	61,432	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	12.2	418	44,837	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	140.5	4,196	450,057	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	26	269	28,900	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	18	423	45,362	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	41	300	32,268	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	8.5	843	90,409	一般消費財・サービス
UGI CORP	70.5	218	23,459	公益事業
CUMMINS INC	48.5	810	86,900	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	247	1,770	189,867	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	46.5	530	56,897	情報技術
SIGNATURE BANK	16.5	178	19,088	金融
COSTAR GROUP INC	11.7	781	83,825	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	16.1	335	36,004	金融
AMERCO	2.9	91	9,792	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	30	473	50,793	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	14.4	1,290	138,431	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	25	430	46,180	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	90.16	698	74,884	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	11.7	182	19,591	情報技術
DEXCOM INC	29	1,073	115,140	ヘルスケア
NORDSON CORP	17.3	321	34,448	資本財・サービス
COPART INC	68.5	582	62,469	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	51.5	241	25,935	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	37.5	566	60,788	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	24.2	608	65,243	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	16.5	738	79,163	資本財・サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	28	321	34,477	ヘルスケア
NIELSEN HOLDINGS PLC	111	167	17,998	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	646.81	1,002	107,514	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	86	864	92,733	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	12.2	601	64,473	金融
CABOT OIL & GAS CORP	124	248	26,688	エネルギー
T-MOBILE US INC	134.71	1,378	147,800	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	45.5	258	27,710	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	1,298.5	5,921	634,985	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	65	247	26,592	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	52.5	386	41,420	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	95	207	22,199	金融
CSX CORP	248.5	1,728	185,398	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	31.3	524	56,300	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	43.75	361	38,716	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	27.5	173	18,620	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	134.6	34,255	3,673,610	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	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	197.4	1,341	143,908	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,350.05	6,368	682,924	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	42	173	18,583	情報技術
AES CORP	219	277	29,756	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	13.5	290	31,119	金融
EOG RESOURCES INC	185.5	975	104,577	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	52	521	55,954	情報技術
ABIOMED INC	14.4	348	37,321	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	49.5	469	50,360	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	97.9	843	90,405	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1,231.23	795	85,295	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	46.9	103	11,100	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	46	392	42,113	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48.87	109	11,705	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	8.5	108	11,606	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	103.89	204	21,948	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	40	137	14,691	資本財・サービス
FORTINET INC	46	599	64,297	情報技術
MARKEL CORP	4.4	417	44,823	金融
NEXTERA ENERGY INC	156	3,851	413,066	公益事業
MASIMO CORP	17	369	39,631	ヘルスケア
FREEMPORT-MCMORAN INC	472.08	495	53,106	素材
INSULET CORP	19.5	352	37,758	ヘルスケア
US BANCORP	435	1,631	174,981	金融
UNITED RENTALS INC	23.5	337	36,161	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	19	266	28,591	情報技術
FASTENAL CO	186	745	79,906	資本財・サービス
FISERV INC	185.83	1,864	199,961	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	2,805.5	2,033	218,124	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	406	1,135	121,736	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	77.5	1,156	124,001	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	105.4	2,126	228,073	金融
ALPHABET INC-CL A	95.6	13,507	1,448,545	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	97.87	13,830	1,483,214	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	33.5	176	18,939	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	191.5	1,151	123,526	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	171.68	694	74,435	公益事業
GENUINE PARTS CO	45.5	389	41,762	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	121.34	847	90,840	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	230	478	51,315	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	69.6	1,344	144,165	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	276	352	37,826	エネルギー
HOME DEPOT INC	348	8,437	904,811	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	19	203	21,808	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	318	314	33,710	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	12.9	235	25,217	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	47.4	611	65,628	生活必需品
HUMANA INC	42.5	1,609	172,609	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	90	955	102,471	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	22.6	591	63,469	情報技術
HENRY SCHEIN INC	45	254	27,328	ヘルスケア
HP INC	453	737	79,087	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	419	425	45,607	情報技術

銘柄	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	59.78	211	22,668	コミュニケーション・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	47	147	15,816	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	65	235	25,296	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	29.5	105	11,322	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	132	404	43,330	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	217.53	691	74,182	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	284	3,462	371,291	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	115	401	43,065	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	43.5	254	27,243	資本財・サービス
ZOETIS INC	152.5	2,044	219,259	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	75.79	685	73,466	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	71.5	329	35,347	エネルギー
ALLEGION PLC	29	296	31,849	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	129.73	282	30,286	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	85.07	767	82,297	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	105	250	26,900	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC	24	381	40,884	ヘルスケア
JM SMUCKER CO/THE	36.7	384	41,206	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	840	11,940	1,280,509	ヘルスケア
ABBVIE INC	560.72	5,184	555,976	ヘルスケア
HOLOGIC INC	83.5	418	44,907	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	110	1,495	160,360	生活必需品
KROGER CO	255	822	88,218	生活必需品
KLA CORP	50.3	928	99,624	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	80.8	3,085	330,890	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	26.8	694	74,434	情報技術
LOWE'S COS INC	244.5	3,081	330,505	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	274.05	3,933	421,851	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	45.9	1,305	140,049	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	16.5	180	19,317	不動産
LOEWS CORP	83	274	29,390	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	62.49	254	27,261	金融
MCDONALD'S CORP	237.5	4,492	481,806	一般消費財・サービス
3M CO	183.5	2,841	304,761	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	766	17,509	1,877,689	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	78	2,471	265,086	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	19.6	386	41,418	素材
CONCHO RESOURCES INC	62	359	38,563	エネルギー
PHILLIPS 66	141.5	1,093	117,237	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	152.5	292	31,350	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	38.5	641	68,760	生活必需品
MYLAN NV	160.5	255	27,435	ヘルスケア
METLIFE INC	248	928	99,600	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	217	731	78,493	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	18.7	416	44,676	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	48	148	15,957	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	54.58	767	82,295	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	7.8	596	63,941	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	213.73	340	36,535	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	37.6	782	83,946	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	808.21	6,166	661,310	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	234.68	1,197	128,377	素材
MASCO CORP	87	398	42,721	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	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
M & T BANK CORP	40.39	440	47,195	金融
MARSH & MCLENNAN COS	158.5	1,653	177,352	金融
BLACK KNIGHT INC	47	338	36,340	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	22	200	21,544	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	87.72	809	86,789	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	53.8	933	100,129	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	21	387	41,608	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	111	962	103,228	情報技術
TRANSUNION	61.5	540	57,978	資本財・サービス
VISTRA ENERGY CORP	142.5	287	30,869	公益事業
BEIGENE LTD-ADR	12.5	204	21,973	ヘルスケア
NETAPP INC	69	292	31,418	情報技術
NIKE INC -CL B	396.5	3,823	410,026	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	82	1,461	156,685	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	77.5	772	82,803	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	41.5	297	31,865	金融
ALLY FINANCIAL INC	116.5	238	25,536	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	51.2	1,626	174,428	資本財・サービス
APTIV PLC	81	612	65,721	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	258.61	1,433	153,781	素材
MCKESSON CORP	51	756	81,081	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	87	497	53,320	情報技術
XYLEM INC	58.7	376	40,388	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	496	3,492	374,571	生活必需品
NUCOR CORP	94	387	41,531	素材
WESTERN UNION CO	129.46	291	31,265	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	57	434	46,615	情報技術
NEWELL BRANDS INC	125.42	191	20,578	一般消費財・サービス
EVERGY INC	74	444	47,678	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	281.24	520	55,796	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	8.2	145	15,629	金融
OKTA INC	36.6	656	70,351	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	20.5	459	49,246	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	33.5	430	46,156	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	124.05	273	29,359	ヘルスケア
LINDE PLC	169.96	3,432	368,066	素材
WIX.COM LTD	17	367	39,389	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	133	273	29,381	金融
KKR & CO INC	163	475	50,954	金融
PAYCHEX INC	102.5	756	81,077	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	24.1	988	106,054	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	596	2,332	250,099	生活必需品
PFIZER INC	1,765.13	5,957	638,862	ヘルスケア
CIGNA CORP	119.1	2,263	242,698	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	78.51	368	39,487	情報技術
ALTICE USA INC- A	109	262	28,124	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	165.5	1,053	112,967	公益事業
STERIS PLC	26.5	402	43,145	ヘルスケア
FOX CORP - CLASS B	54.33	151	16,284	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	108.49	306	32,913	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	108.2	2,031	217,899	ヘルスケア
DOW INC	234.68	967	103,763	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	28	175	18,776	金融

銘柄	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	34.3	752	80,746	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	41.7	751	80,565	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	307	989	106,142	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	53.5	525	56,357	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	787.17	9,101	976,019	生活必需品
EXELON CORP	307.72	1,166	125,102	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	70.5	770	82,635	ヘルスケア
TELADOC HEALTH INC	23	396	42,490	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	113.58	354	38,026	資本財・サービス
NVR INC	1.1	349	37,457	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	347	1,517	162,729	エネルギー
TWILIO INC - A	38.5	738	79,226	情報技術
DOCUSIGN INC	53.5	805	86,404	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	16.1	487	52,280	情報技術
MATCH GROUP INC	18	157	16,842	コミュニケーション・サービス
PEPSICO INC	443	5,714	612,844	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	13	127	13,679	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	80	168	18,042	情報技術
MONGODB INC	15	290	31,153	情報技術
SNAP INC - A	283	571	61,244	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	239.68	660	70,786	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	128	808	86,697	金融
AMCOR PLC	501	491	52,706	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	32.5	302	32,455	情報技術
ROKU INC	30.5	329	35,347	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	57.5	731	78,490	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	202.3	4,078	437,342	情報技術
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	102	314	33,756	情報技術
PENTAIR PLC	55.05	206	22,138	資本財・サービス
QUALCOMM INC	364.5	3,106	333,194	情報技術
INVESCO LTD	120	124	13,306	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	22	298	32,022	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	86.5	362	38,848	金融
DATADOG INC - CLASS A	35	273	29,295	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	119	248	26,658	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	25	264	28,405	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	31.9	1,876	201,285	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	71	580	62,229	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	13.1	2,127	228,135	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	114.5	1,058	113,556	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	31	306	32,885	素材
RESMED INC	47	755	80,992	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	43.5	481	51,594	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	36	184	19,801	資本財・サービス
MODERNA INC	70	434	46,542	ヘルスケア
RALPH LAUREN CORP	14.5	108	11,626	一般消費財・サービス
PERKINELMER INC	35.5	344	36,981	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	266.37	573	61,530	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	132.68	743	79,737	資本財・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	58	285	30,614	金融
AVANTOR INC	135	229	24,582	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	47	138	14,808	金融
DYNATRACE INC	43	154	16,550	情報技術

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	12.7	450	48,282	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	302.35	359	38,584	金融
CHEVRON CORP	598.18	5,526	592,670	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	114.5	659	70,690	公益事業
TESLA INC	47	4,395	471,407	一般消費財・サービス
NORTONLIFELOCK INC	178.5	354	37,997	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	50.22	658	70,599	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	47	844	90,523	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	46.85	2,448	262,549	コミュニケーション・サービス
CBRE GROUP INC - A	108.5	516	55,350	不動産
TWITTER INC	252.5	843	90,440	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	338.5	1,901	203,901	公益事業
SYSCO CORP	154	835	89,610	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	81.53	923	99,087	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	43	242	25,957	金融
STEEL DYNAMICS INC	66	174	18,699	素材
SCHLUMBERGER LTD	443.02	841	90,267	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	50.5	187	20,070	資本財・サービス
AT&T INC	2,287.91	6,978	748,334	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	47	168	18,079	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	129	244	26,270	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	26.3	1,440	154,451	素材
SEMPRA ENERGY	94.2	1,168	125,315	公益事業
TIFFANY & CO	34.7	413	44,327	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	76.5	387	41,519	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	297.5	3,688	395,512	情報技術
SALESFORCE.COM INC	268.21	4,696	503,666	情報技術
WESTROCK CO	85.3	240	25,805	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	244.84	843	90,454	資本財・サービス
TERADYNE INC	55	394	42,319	情報技術
UNION PACIFIC CORP	219.8	3,652	391,708	資本財・サービス
MARATHON PETROLEUM CORP	205.88	753	80,851	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	483.29	3,159	338,799	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	225.5	2,288	245,405	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	62.44	866	92,954	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	43.5	208	22,326	金融
AMEREN CORPORATION	80.5	577	61,940	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	302.26	8,618	924,295	ヘルスケア
VERISIGN INC	33.7	688	73,786	情報技術
VALERO ENERGY CORP	131.42	838	89,902	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	17.6	398	42,774	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	86.88	276	29,693	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	25	238	25,624	ヘルスケア
ANTHEM INC	81	2,152	230,833	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	575.62	6,647	712,913	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,238.22	3,463	371,404	金融
WASTE MANAGEMENT INC	134	1,392	149,291	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	389	709	76,048	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	37	438	46,999	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	19.5	238	25,533	一般消費財・サービス
WALMART INC	452	5,321	570,714	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	65.5	819	87,936	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	30.5	281	30,191	一般消費財・サービス

銘柄	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
WABTEC CORP	58.61	356	38,271	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	386.5	2,027	217,437	一般消費財・サービス
WATERS CORP	20.5	380	40,793	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	17.6	454	48,757	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	239	989	106,109	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	41.73	779	83,581	金融
WESTERN DIGITAL CORP	97.5	418	44,908	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	99.8	901	96,654	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	161	800	85,827	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	544	10,458	1,121,617	情報技術
PPL CORP	248	658	70,611	公益事業
PULTEGROUP INC	89	301	32,345	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	76.5	777	83,375	素材
NORTHERN TRUST CORP	64	535	57,384	金融
NVIDIA CORP	195	6,967	747,178	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	25.3	693	74,422	コミュニケーション・サービス
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	138.43	1,533	164,425	金融
HD SUPPLY HOLDINGS INC	53	181	19,489	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	94	584	62,701	生活必需品
NETFLIX INC	139.7	5,840	626,328	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	126.9	4,311	462,371	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	79.5	267	28,714	公益事業
GLOBE LIFE INC	32.25	244	26,249	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	54	576	61,789	金融
TEXTRON INC	71.5	244	26,185	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	117.37	137	14,751	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	67.5	208	22,338	公益事業
OMNICOM GROUP	67.5	371	39,834	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	712.83	3,696	396,438	情報技術
MASTERCARD INC - A	285.5	8,501	911,744	情報技術
ONEOK INC	130	443	47,525	エネルギー
CENTURYLINK INC	288.52	290	31,188	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	34.2	1,333	142,967	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	95.5	871	93,483	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	35.5	475	51,014	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	60.5	230	24,686	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	2,501.01	6,197	664,620	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	11.3	376	40,418	資本財・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	58.5	618	66,323	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	219	2,226	238,801	金融
ANALOG DEVICES INC	116.49	1,379	147,922	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	376	2,011	215,723	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	88.5	347	37,279	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	275.72	910	97,693	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	55	698	74,854	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	55	336	36,085	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	27.5	312	33,472	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	174	953	102,255	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	197	1,208	129,609	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	73.7	1,340	143,805	金融
AMGEN INC	188	4,096	439,310	ヘルスケア
EATON CORP PLC	130.86	1,125	120,701	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	53.3	907	97,330	生活必需品

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
APPLIED MATERIALS INC	291	1,645	176,474	情報技術
CME GROUP INC	115	2,009	215,475	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	116.94	149	16,014	エネルギー
ECOLAB INC	81	1,652	177,255	素材
EQUIFAX INC	39	655	70,255	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	402.5	2,946	315,961	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	115	323	34,679	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	96	448	48,046	生活必需品
STATE STREET CORP	111.93	706	75,765	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	364	1,330	142,713	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	161	1,351	144,979	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	60	282	30,286	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	42	273	29,380	素材
CARDINAL HEALTH INC	94.5	499	53,599	ヘルスケア
FEDEX CORP	78.5	1,041	111,728	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	144.54	1,020	109,479	金融
FMC CORP	42	408	43,842	素材
CERNER CORP	100.5	672	72,166	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	26.74	339	36,375	素材
CITRIX SYSTEMS INC	36	506	54,334	情報技術
INTEL CORP	1,364	8,092	867,851	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	124	214	22,978	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	116.5	466	50,011	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	101	1,665	178,650	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	346	205	22,021	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	47.2	1,612	172,913	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	50	152	16,396	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	37.3	2,082	223,366	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	38.5	408	43,797	情報技術
SNAP-ON INC	16.3	220	23,599	資本財・サービス
CARMAX INC	51	458	49,212	一般消費財・サービス
COMERICA INC	45	176	18,888	金融
INGREDION INC	21.5	176	18,950	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	235.28	2,040	218,857	公益事業
TARGET CORP	162.8	1,903	204,091	一般消費財・サービス
DOVER CORP	45.5	439	47,140	資本財・サービス
VW GRAINGER INC	14.9	452	48,535	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	42.5	342	36,684	資本財・サービス
CINTAS CORP	28.2	750	80,503	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	158	512	54,915	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	47.5	308	33,095	生活必需品
CLOROX COMPANY	39.5	810	86,888	生活必需品
ENERGY CORP	63.5	612	65,659	公益事業
MICROSOFT CORP	2,300	43,180	4,630,644	情報技術
INCYTE CORP	57.5	529	56,773	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	415.69	2,666	285,971	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	426.88	3,978	426,702	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	349	1,699	182,230	情報技術
BLACKROCK INC	49	2,582	276,946	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	158	284	30,499	公益事業
HASBRO INC	40.5	300	32,270	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	84	534	57,282	生活必需品
KEYCORP	306	404	43,382	金融

銘柄	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
KANSAS CITY SOUTHERN	30	441	47,379	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	460.11	2,334	250,312	生活必需品
COOPER COS INC/THE	15.3	441	47,319	ヘルスケア
CHUBB LTD	145.19	1,824	195,701	金融
ARROW ELECTRONICS INC	27	178	19,168	情報技術
ALLSTATE CORP	102.5	980	105,194	金融
EBAY INC	256.5	1,222	131,098	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	354.5	5,503	590,245	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	42.5	295	31,735	素材
XILINX INC	80	725	77,813	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	75	245	26,300	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA	52	181	19,450	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	70.5	1,349	144,691	生活必需品
TRIMBLE INC	82.5	339	36,388	情報技術
LENNAR CORP-A	86	509	54,644	一般消費財・サービス
LEAR CORP	18	198	21,289	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	70	333	35,792	金融
PROGRESSIVE CORP	184	1,409	151,148	金融
PACCAR INC	110.37	807	86,604	資本財・サービス
BIOGEN INC	55	1,535	164,719	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	26.7	808	86,709	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	374.5	2,860	306,752	一般消費財・サービス
PTC INC	34	255	27,404	情報技術
PERRIGO CO PLC	42	216	23,191	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	106.3	896	96,110	公益事業
INTUIT INC	83.1	2,332	250,132	情報技術
BORGWARNER INC	65	218	23,386	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	73	567	60,874	一般消費財・サービス
BALL CORP	105.84	723	77,556	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	438.97	1,551	166,410	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	92.5	1,128	120,990	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	41.5	465	49,885	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	83	2,229	239,043	ヘルスケア
VF CORP	109	667	71,596	一般消費財・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B	173.75	397	42,669	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	19	185	19,915	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	28.5	328	35,236	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	153	305	32,782	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	1,447.9	5,713	612,706	コミュニケーション・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	72	159	17,148	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	71	312	33,471	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	90	43	4,671	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	353	142	15,255	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	93,836.17 589銘柄	830,441 <68.5%>	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)				
IMPERIAL OIL LTD	83	192	15,107	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	6	882	69,426	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	92.87	703	55,329	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	144	746	58,742	素材
INTACT FINANCIAL CORP	46.5	609	47,930	金融
BCE INC	45.3	259	20,414	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	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
FRANCO-NEVADA CORP	60	1,054	82,913	素材
SUNCOR ENERGY INC	485.3	1,206	94,937	エネルギー
METRO INC/CN	82	470	37,030	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	110	670	52,772	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	393	2,299	180,874	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	141.5	1,330	104,647	金融
TORONTO-DOMINION BANK	584	3,644	286,695	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	83	197	15,538	金融
ROYAL BANK OF CANADA	458.5	4,188	329,459	金融
TC ENERGY CORP	304.5	1,792	141,029	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	178.29	596	46,925	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	577	1,889	148,596	素材
CAE INC	79	191	15,069	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	55.12	505	39,737	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	53	164	12,953	生活必需品
CCL INDUSTRIES INC - CL B	46.5	209	16,485	素材
HYDRO ONE LTD	105	264	20,821	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	54.6	362	28,534	生活必需品
WSP GLOBAL INC	34	288	22,663	資本財・サービス
PARKLAND CORP	44	152	11,964	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	53	156	12,298	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	77	410	32,294	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	40	124	9,760	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	112	667	52,489	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	78	628	49,427	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	167	313	24,643	公益事業
B2GOLD CORP	347	241	19,024	素材
AIR CANADA	41	79	6,256	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	379	319	25,131	素材
BANK OF MONTREAL	207	1,541	121,224	金融
POWER CORP OF CANADA	181	431	33,970	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	33	3,330	261,973	情報技術
NUTRIEN LTD	182.19	897	70,609	素材
CANOPY GROWTH CORP	74	166	13,061	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	55	48	3,794	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	88	438	34,499	素材
CAMECO CORP	128	176	13,914	エネルギー
TELUS CORP	108	251	19,794	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	151	213	16,759	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	18	216	17,044	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	376	915	71,988	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	9	379	29,826	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	92	552	43,442	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	25.37	248	19,538	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	70	248	19,569	素材
BLACKBERRY LTD	160	114	8,986	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	186.5	935	73,570	金融
ENBRIDGE INC	654	2,755	216,732	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	434.25	2,016	158,630	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	615	1,154	90,849	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	95	220	17,351	ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	43	1,472	115,809	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	33	150	11,834	金融

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	63	137	10,837	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	230.5	2,754	216,703	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	79	706	55,610	情報技術
ONEX CORPORATION	26	155	12,268	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	151	348	27,378	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	24	79	6,252	金融
TMX GROUP LTD	19	244	19,269	金融
OPEN TEXT CORP	87	495	38,952	情報技術
CI FINANCIAL CORP	70	117	9,255	金融
SAPUTO INC	80	259	20,394	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	193	169	13,344	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	275	1,148	90,354	生活必需品
YAMANA GOLD INC	323	214	16,870	素材
FORTIS INC	150	770	60,635	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	38	206	16,215	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	194	127	10,010	素材
CENOVUS ENERGY INC	314	194	15,338	エネルギー
DOLLARAMA INC	97	464	36,547	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	22	80	6,295	公益事業
ALTAGAS LTD	79	119	9,370	公益事業
KEYERA CORP	74	153	12,054	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	128	155	12,233	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,374.79 81銘柄	55,795 4,388,897	<3.4%>
	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
(オーストラリア)				
MEDIBANK PRIVATE LTD	888	260	19,009	金融
BHP GROUP LTD	937.5	3,374	246,509	素材
SOUTH32 LTD	1,516	318	23,259	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	305.5	652	47,697	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	540	799	58,429	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,024.5	1,904	139,146	金融
WESTPAC BANKING CORP	1,149.48	2,056	150,242	金融
SANTOS LTD	531	286	20,949	エネルギー
AUSNET SERVICES	500	87	6,374	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	890.5	1,684	123,093	金融
RIO TINTO LTD	117.5	1,149	83,965	素材
ORIGIN ENERGY LTD	535	307	22,435	エネルギー
AURIZON HOLDINGS LTD	600	278	20,339	資本財・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	34	65	4,821	エネルギー
COLES GROUP LTD	430.45	684	50,034	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	45	95	6,976	情報技術
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	250	342	25,023	素材
EVOLUTION MINING LTD	530	291	21,296	素材
AFTERPAY LTD	70	363	26,522	情報技術
OIL SEARCH LTD	642	211	15,431	エネルギー
SEEK LTD	96	187	13,669	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	235	255	18,645	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	260	782	57,157	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	554.5	3,732	272,725	金融
AMPOL LTD	71.5	198	14,537	エネルギー
ORICA LTD	131	222	16,222	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	464.5	385	28,167	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等	
		評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
CIMIC GROUP LTD	28	69	5,110	資本財・サービス	
WOOLWORTHS GROUP LTD	397	1,455	106,360	生活必需品	
COCA-COLA AMATIL LTD	157	143	10,483	生活必需品	
TABCORP HOLDINGS LTD	667	223	16,324	一般消費財・サービス	
CROWN RESORTS LTD	116	115	8,432	一般消費財・サービス	
QANTAS AIRWAYS LTD	240	107	7,872	資本財・サービス	
TELSTRA CORP LTD	1,345	425	31,051	コミュニケーション・サービス	
AMP LTD	1,020	174	12,780	金融	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	133.5	345	25,251	素材	
MACQUARIE GROUP LTD	106.84	1,235	90,234	金融	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	184.5	475	34,763	一般消費財・サービス	
CSL LTD	142	4,037	294,968	ヘルスケア	
WESFARMERS LTD	360	1,528	111,702	一般消費財・サービス	
COCHLEAR LTD	20.5	392	28,677	ヘルスケア	
BLUESCOPE STEEL LTD	163	193	14,171	素材	
SUNCORP GROUP LTD	382.57	355	25,994	金融	
ASX LTD	62.5	532	38,872	金融	
COMPUTERSHARE LTD	159	201	14,753	情報技術	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	709.36	400	29,229	金融	
SONIC HEALTHCARE LTD	143.5	402	29,428	ヘルスケア	
AGL ENERGY LTD	190	331	24,236	公益事業	
BRAMBLES LTD	504	551	40,320	資本財・サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	57.5	377	27,549	ヘルスケア	
TPG TELECOM LTD	120	98	7,189	コミュニケーション・サービス	
REA GROUP LTD	16	164	11,995	コミュニケーション・サービス	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	38	211	15,469	金融	
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	20,811.7 53銘柄	35,531 <2.0% >	2,595,910	
(香港)	百株	千香港・ドル	千円		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	445	1,971	27,283	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	730	3,974	55,011	一般消費財・サービス	
MTR CORP	495	2,022	27,985	資本財・サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	430	4,312	59,690	不動産	
SINO LAND CO	1,040	1,005	13,918	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	861.69	4,485	62,073	資本財・サービス	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	155	691	9,567	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	525	4,097	56,711	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	485.07	1,433	19,838	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	3,393.58	4,255	58,896	公益事業	
HANG SENG BANK LTD	245	3,172	43,910	金融	
WHEELLOCK & CO LTD	270	1,626	22,514	不動産	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,980	1,829	25,320	不動産	
WH GROUP LTD	3,210	2,163	29,943	生活必需品	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	383	11,344	157,007	金融	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	660	1,149	15,912	不動産	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	93	703	9,730	情報技術	
NWS HOLDINGS LTD	425	303	4,199	資本財・サービス	
KERRY PROPERTIES LTD	175	359	4,977	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	452.4	834	11,545	金融	
SJM HOLDINGS LTD	580	536	7,425	一般消費財・サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	382	744	10,298	不動産	
CK ASSET HOLDINGS LTD	866.69	4,073	56,376	不動産	

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千香港・ドル	千円	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	200	823	11,390	公益事業
PCCW LTD	1,170	522	7,238	コミュニケーション・サービス
AIA GROUP LTD	3,894	27,803	384,795	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	360	1,240	17,164	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	539	1,269	17,567	生活必需品
SANDS CHINA LTD	776	2,525	34,958	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	440	3,253	45,032	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,255	3,024	41,859	金融
WYNN MACAU LTD	540	790	10,941	一般消費財・サービス
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	27,456.43 32銘柄	98,344 1,361,087	<1.0%>
	百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)				
UNITED OVERSEAS BANK LTD	385	857	65,928	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	575	1,260	96,918	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	436.75	181	13,964	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	513	309	23,815	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	140	100	7,704	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	136	116	8,916	不動産
CAPITALAND LTD	829	248	19,115	不動産
YANGZIJANG SHIPBUILDING	693	67	5,219	資本財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	27	58	4,534	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,062	981	75,421	金融
GENTING SINGAPORE LTD	2,090	160	12,369	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	86	131	10,080	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,789.5	711	54,672	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	500	172	13,258	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	273	225	17,310	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD	589	233	17,927	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,124.25 16銘柄	5,817 447,156	<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	415	197	13,578	公益事業
MERCURY NZ LTD	230	106	7,351	公益事業
A2 MILK CO LTD	234	439	30,240	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	620.89	268	18,480	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	389	252	17,327	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	187	531	36,506	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	140	179	12,366	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,215.89 7銘柄	1,976 135,851	<0.1%>
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)				
BP PLC	6,470	2,090	280,370	エネルギー
UNILEVER PLC	373.1	1,605	215,405	生活必需品
BARCLAYS PLC	5,688	665	89,315	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	645	211	28,335	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	849	969	130,056	金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,457.91	173	23,213	金融
EVRAZ PLC	150	43	5,790	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	60.64	126	17,000	素材
BAE SYSTEMS PLC	1,023	516	69,271	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	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
AVIVA PLC	1,289.66	356	47,833	金融
AVEVA GROUP PLC	20	77	10,387	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,604	2,565	344,084	ヘルスケア
INFORMA PLC	499	229	30,830	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,455	172	23,137	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	319	169	22,679	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	31.5	211	28,318	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	152	297	39,922	一般消費財・サービス
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	16.67	179	24,038	一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	23	220	29,525	資本財・サービス
HALMA PLC	122.5	267	35,904	情報技術
GVC HOLDINGS PLC	191	142	19,102	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	130	81	10,954	一般消費財・サービス
M&G PLC	757	114	15,383	金融
RELX PLC	631.46	1,158	155,347	資本財・サービス
DIAGEO PLC	744	2,068	277,444	生活必需品
RIO TINTO PLC	357.5	1,643	220,401	素材
STANDARD CHARTERED PLC	868	370	49,705	金融
TESCO PLC	3,207	725	97,308	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	279.5	447	60,043	ヘルスケア
GLENCORE PLC	3,197.25	551	73,913	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	102.5	165	22,205	金融
SMITHS GROUP PLC	123.83	155	20,896	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	419.83	114	15,424	金融
PEARSON PLC	235.63	135	18,111	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	542.25	105	14,183	生活必需品
NEXT PLC	42	211	28,327	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	1,007	152	20,464	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	68.61	162	21,756	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	104.05	196	26,295	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	8,701.83	1,097	147,191	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	40.11	200	26,944	素材
KINGFISHER PLC	624.11	122	16,484	一般消費財・サービス
WPP PLC	384	237	31,863	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	206.27	186	24,957	公益事業
SEVERN TRENT PLC	71.33	171	23,021	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	612	294	39,437	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	226.5	1,564	209,883	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	165.5	153	20,570	金融
SCHRODERS PLC	41.5	120	16,227	金融
SSE PLC	339	419	56,318	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	310	162	21,864	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	420	3,444	462,034	ヘルスケア
FERGUSON PLC	74.87	454	60,941	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,955	441	59,162	金融
3I GROUP PLC	313.91	255	34,233	金融
ASHTED GROUP PLC	146.5	345	46,397	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	351.14	228	30,625	情報技術
NATIONAL GRID PLC	1,144.34	1,048	140,638	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	22,964.65	733	98,359	金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	317.6	128	17,279	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	304	451	60,576	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	41.5	173	23,274	一般消費財・サービス

銘柄	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	743.1	2,229	299,038	生活必需品
BHP GROUP PLC	687.27	1,145	153,718	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	115	221	29,741	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	6,496.5	2,470	331,452	金融
ANGLO AMERICAN PLC	403.83	737	98,870	素材
MONDI PLC	156.5	224	30,093	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	734	134	18,106	生活必需品
COMPASS GROUP PLC	521.39	599	80,430	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	99	230	30,862	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	2,901	334	44,867	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	65.5	134	18,064	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	121.89	194	26,062	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	56.36	217	29,121	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	52	274	36,815	資本財・サービス
ITV PLC	1,201	94	12,678	コミュニケーション・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	100.99	804	107,859	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,325	1,789	240,014	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,188.18	1,551	208,121	エネルギー
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	50	115	15,459	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	61.5	139	18,668	金融
ANTOFAGASTA PLC	114	98	13,273	素材
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	708.62	177	23,868	金融
EXPERIAN PLC	296.54	807	108,354	資本財・サービス
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	93,212.22 85銘柄	47,014 <4.8%>	6,306,525
	百株	千イスラエル・シケル	千円	
(イスラエル)				
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	345	403	12,452	金融
AZRIELI GROUP LTD	14	246	7,605	不動産
ICL GROUP LTD	236	289	8,918	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	7.5	374	11,557	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	357	778	24,009	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	512	997	30,769	金融
NICE LTD	20.5	1,319	40,709	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	41	314	9,687	金融
イスラエル・シケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,533 8銘柄	4,723 <0.1%>	145,709
	百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)				
UBS GROUP AG-REG	1,174	1,203	135,695	金融
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2.6	180	20,352	素材
ADECCO GROUP AG-REG	46.5	207	23,353	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	226.3	7,369	830,611	ヘルスケア
PARGESA HOLDING SA-BR	11	79	8,926	金融
SIKA AG-REG	41.6	702	79,192	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.03	243	27,489	生活必需品
ABB LTD-REG	601	1,187	133,817	資本財・サービス
SWISS RE AG	94	688	77,553	金融
NESTLE SA-REG	959	9,858	1,111,153	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	5.9	475	53,544	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	12.6	271	30,646	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	775.7	733	82,638	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	74	305	34,404	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千スイス・フラン	千円	
SGS SA-REG	1.9	420	47,434	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	5.8	124	14,002	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	14.5	200	22,626	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG	21.2	290	32,723	情報技術
ALCON INC	161.3	885	99,772	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	8.5	161	18,173	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	48.62	1,589	179,194	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	15.7	221	25,021	金融
CLARIANT AG-REG	57	101	11,429	素材
NOVARTIS AG-REG	692	5,553	625,990	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	180	20,377	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	166.6	1,012	114,167	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	8.3	404	45,577	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1.1	9	1,092	金融
GEBERIT AG-REG	11.9	538	60,718	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	3	1,018	114,761	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	3.4	251	28,388	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	18.1	359	40,464	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	55	303	34,193	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	23.6	1,098	123,820	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	15.2	56	6,342	一般消費財・サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	172.9	695	78,437	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	10.4	366	41,319	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	16.7	235	26,511	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	23.3	208	23,543	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.34	262	29,545	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,581.59 40銘柄	40,058 <3.5% >	4,515.013
(デンマーク)	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	572	24,716	400,153	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	227	1,994	32,289	金融
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	1.05	736	11,916	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	23	574	9,298	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	65	4,306	69,728	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S	43	1,512	24,491	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B	34.5	2,991	48,426	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	72.5	2,710	43,887	素材
COLOPLAST-B	38.5	4,021	65,105	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	68.1	5,235	84,763	資本財・サービス
DEMANT A/S	34.25	626	10,147	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2	1,508	24,414	資本財・サービス
TRYG A/S	40	774	12,531	金融
PANDORA A/S	31.5	1,069	17,308	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	34.5	2,286	37,021	素材
GENMAB A/S	21	4,155	67,284	ヘルスケア
ORSTED A/S	61	4,570	73,990	公益事業
AMBU A/S-B	56	1,204	19,501	ヘルスケア
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,424.9 18銘柄	64,994 <0.8% >	1,052,260
(ノルウェー)	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORSK HYDRO ASA	417	1,122	12,426	素材

銘柄	2020年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千円	千円	
DNB ASA	308	4,148	45,926	金融
ORKLA ASA	244.5	2,097	23,217	生活必需品
TELENOR ASA	232	3,480	38,523	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	338.23	4,872	53,935	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	57.1	1,994	22,079	素材
MOWI ASA	141	2,644	29,274	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	73.5	1,342	14,857	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	31	730	8,091	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,842.33 9銘柄	22,432 248,332	<0.2%>
	百株	千円	千円	
(スウェーデン)		千スウェーデン・クローネ		
ICA GRUPPEN AB	33	1,408	16,168	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	944.3	7,894	90,627	情報技術
VOLVO AB-B SHS	478.5	6,545	75,146	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES	122	2,066	23,718	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	66.5	1,018	11,691	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	54.5	3,412	39,178	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	156	1,897	21,786	コミュニケーション・サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	524	4,101	47,089	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	501.5	4,469	51,308	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	292.5	3,604	41,376	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	259	3,725	42,771	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSEA AB SCA-B	207	2,281	26,187	素材
SKANSKA AB-B SHS	115.5	2,113	24,264	資本財・サービス
SANDVIK AB	364.5	5,675	65,152	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	147	7,100	81,509	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	216	8,026	92,144	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	95.5	1,140	13,090	資本財・サービス
TELIA CO AB	820	2,596	29,803	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	100.5	1,908	21,915	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	126	4,078	46,822	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	324.5	6,084	69,848	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS	22	905	10,395	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	52	877	10,070	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	104	2,023	23,227	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB	63.5	1,408	16,168	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	196	5,595	64,239	生活必需品
BOLIDEN AB	93	1,947	22,356	素材
EPIROC AB-A	206.5	2,284	26,230	資本財・サービス
EPIROC AB-B	116	1,267	14,548	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS	114.5	833	9,564	一般消費財・サービス
NORDEA BANK ABP	1,041	7,044	80,870	金融
EQT AB	81	1,225	14,069	金融
EVOLUTION GAMING GROUP	44	2,383	27,357	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B	73	1,650	18,948	金融
HEXAGON AB-B SHS	93	4,750	54,535	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	57	1,165	13,375	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,304.8 36銘柄	116,512 1,337,558	<1.0%>
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (アイルランド)				
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	68	185	22,353	素材

外国株式インデックスマザーファンド

銘 柄	2020年6月15日現在			業 種 等	
	株 数	評 価 額			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
KINGSPAN GROUP PLC	50	千ユーロ	千円	資本財・サービス	
KERRY GROUP PLC-A	51.5	261	31,557	生活必需品	
CRH PLC	253.5	562	67,868	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	26.43	750	90,553	一般消費財・サービス	
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	449.43	2,078	250,831	
		5 銘柄		<0.2%>	
ユーロ (オランダ)		百株	千ユーロ	千円	
QIAGEN N. V.	72.98	278	33,599	ヘルスケア	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	288.26	1,158	139,844	ヘルスケア	
NN GROUP NV	90.5	272	32,895	金融	
HEINEKEN NV	82	667	80,610	生活必需品	
AEGON NV	582.44	149	18,085	金融	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	350.33	820	99,014	生活必需品	
AKZO NOBEL N. V.	65.38	485	58,575	素材	
KONINKLIJKE DSM NV	54.5	648	78,201	素材	
WOLTERS KLUWER	89	592	71,531	資本財・サービス	
ING GROEP NV	1,262.5	804	97,082	金融	
KONINKLIJKE KPN NV	1,146.5	257	31,117	コミュニケーション・サービス	
ASML HOLDING NV	136.2	4,167	502,960	情報技術	
ABN AMRO BANK NV-CVA	130.5	99	12,038	金融	
ADYEN NV	5.9	690	83,341	情報技術	
UNILEVER NV	465	2,200	265,597	生活必需品	
JUST EAT TAKEAWAY	40	328	39,679	一般消費財・サービス	
PROSUS NV	155	1,193	144,031	一般消費財・サービス	
VOPAK	23	110	13,275	エネルギー	
RANDSTAD NV	37	142	17,199	資本財・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	37.5	274	33,104	生活必需品	
ALTICE EUROPE NV	205	73	8,906	コミュニケーション・サービス	
STMICROELECTRONICS NV	201.5	461	55,685	情報技術	
AIRBUS SE	189.5	1,268	153,107	資本財・サービス	
EXOR NV	32.3	156	18,932	金融	
CNH INDUSTRIAL NV	328	199	24,058	資本財・サービス	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	341	279	33,715	一般消費財・サービス	
FERRARI NV	41.45	616	74,357	一般消費財・サービス	
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	6,453.24	18,400	2,220,551	
		27 銘柄		<1.7%>	
ユーロ (ベルギー)		百株	千ユーロ	千円	
GALAPAGOS NV	13.9	239	28,885	ヘルスケア	
UCB SA	41.3	362	43,720	ヘルスケア	
KBC GROUP NV	77	377	45,597	金融	
COLRUYT SA	16	85	10,353	生活必需品	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	24.5	179	21,636	金融	
SOLVAY SA	22	154	18,696	素材	
UMICORE	63.5	264	31,978	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	244	1,102	133,095	生活必需品	
AGEAS	57.9	189	22,911	金融	
PROXIMUS	49.5	96	11,600	コミュニケーション・サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	14.5	54	6,547	コミュニケーション・サービス	
ELIA GROUP SA/NV	10.5	99	11,974	公益事業	

銘	柄	2020年6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
SOFINA		百株 5.5	千ユーロ 125	千円 15,166	金融
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	640.1 13 銘柄	3,332	402,165 <0.3%>	
ユーロ (ルクセンブルグ)		百株	千ユーロ	千円	
AROUNDTOWN SA		370	203	24,540	不動産
ARCELORMITTAL		233	221	26,788	素材
EUROFINS SCIENTIFIC		3.7	211	25,478	ヘルスケア
SES		110	74	9,024	コミュニケーション・サービス
TENARIS SA		133	83	10,037	エネルギー
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	849.7 5 銘柄	794	95,869 <0.1%>	
ユーロ (フランス)		百株	千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA		27	49	6,014	コミュニケーション・サービス
TOTAL SA		796.5	2,795	337,338	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		54.5	490	59,154	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		152.77	1,879	226,858	素材
KERING		24	1,169	141,152	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		179	1,631	196,834	資本財・サービス
BOUYGUES SA		74	203	24,594	資本財・サービス
BNP PARIBAS		354.5	1,239	149,605	金融
PEUGEOT SA		191.5	257	31,117	一般消費財・サービス
NATIXIS		295.5	67	8,102	金融
THALES SA		35	247	29,811	資本財・サービス
DANONE		195	1,194	144,113	生活必需品
CARREFOUR SA		198	277	33,548	生活必需品
SUEZ		99.25	102	12,420	公益事業
VIVENDI		268.91	594	71,783	コミュニケーション・サービス
L'OREAL		80.7	2,125	256,521	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		168.5	503	60,820	資本財・サービス
LEGRAND SA		85.17	532	64,239	資本財・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		15.5	53	6,494	生活必需品
PERNOD RICARD SA		67.37	967	116,790	生活必需品
EURAZEO SE		12.54	57	6,973	金融
SOCIETE GENERALE SA		257.5	380	45,885	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		89	3,374	407,226	一般消費財・サービス
ACCOR SA		61.5	158	19,133	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		51.2	492	59,415	情報技術
VALEO SA		71.5	157	18,982	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		70.5	208	25,183	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA		97	182	22,054	資本財・サービス
EIFFAGE		27.4	221	26,737	資本財・サービス
SODEXO SA		27	172	20,853	一般消費財・サービス
IPSEN		11.5	81	9,818	ヘルスケア
INGENICO GROUP		19.7	251	30,371	情報技術
ORPEA		18	178	21,565	ヘルスケア
AMUNDI SA		19.5	128	15,531	金融
TELEPERFORMANCE		19.2	400	48,287	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		27.5	184	22,215	コミュニケーション・サービス
FAURECIA		22.5	73	8,925	一般消費財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		9	188	22,743	ヘルスケア
SEB SA		6.5	87	10,526	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	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
ESSILORLUXOTTICA	90	1,025	123,709	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA	0.8	67	8,186	資本財・サービス
WORLDLINE SA	45.14	306	36,934	情報技術
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	30	93	11,226	一般消費財・サービス
AXA SA	625.5	1,143	138,032	金融
EDENRED	79.5	311	37,627	情報技術
RENAULT SA	58	127	15,398	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	10.2	753	90,892	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	6.3	72	8,758	生活必需品
ATOS SE	29.6	205	24,833	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SA	41.8	615	74,228	情報技術
WENDEL	7.8	64	7,756	金融
ORANGE	633	658	79,522	コミュニケーション・サービス
ALSTOM	63	259	31,361	資本財・サービス
CNP ASSURANCES	48.5	53	6,426	金融
SANOFI	361.75	3,220	388,625	ヘルスケア
VINCI SA	166.5	1,381	166,733	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	175	357	43,188	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	376	305	36,872	金融
BIOMERIEUX	13.4	151	18,338	ヘルスケア
ENGIE	580.23	635	76,709	公益事業
EDF	185.5	151	18,276	公益事業
SAFRAN SA	104.2	936	112,972	資本財・サービス
ILIAD SA	4.9	78	9,502	コミュニケーション・サービス
ARKEMA	22.2	177	21,454	素材
ADP	9.1	90	10,866	資本財・サービス
SCOR SE	49.5	120	14,563	金融
GETLINK SE	142	184	22,208	資本財・サービス
BOLLORE	241	67	8,096	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,481.63 68銘柄	36,982 4,463,054	<3.4%>
ユーロ (ドイツ)	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG	316.7	2,065	249,304	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	65	147	17,829	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	639.5	529	63,885	金融
COMMERZBANK AG	329.35	137	16,534	金融
VOLKSWAGEN AG	10.1	147	17,844	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	59.2	793	95,704	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	245.5	2,419	292,003	資本財・サービス
E.ON SE	716	697	84,143	公益事業
UNIPER SE	66.5	182	22,037	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	106	595	71,827	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	45	121	14,613	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	35.9	309	37,388	一般消費財・サービス
BASF SE	291.7	1,491	179,954	素材
ALLIANZ SE-REG	132.4	2,357	284,536	金融
THYSSENKRUPP AG	114.5	79	9,600	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	58	474	57,255	生活必需品
RWE AG	190	564	68,099	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	66.5	69	8,402	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	11.8	50	6,123	資本財・サービス
BRENNTAG AG	47	211	25,501	資本財・サービス

銘柄	株数	2020年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
FRESENIUS SE & CO KGAA	135.5	572	69,038	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	33.2	116	14,071	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG	7.1	53	6,516	資本財・サービス
SAP SE	334.42	3,855	465,325	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	46.1	1,035	125,008	金融
ZALANDO SE	49.5	305	36,917	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	49	223	26,964	素材
KION GROUP AG	18.5	95	11,573	資本財・サービス
WIRECARD AG	36.2	333	40,248	情報技術
COVESTRO AG	52	170	20,532	素材
SARTORIUS AG-VORZUG	11.5	331	39,969	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	50	250	30,242	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	41.5	349	42,219	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	12.5	108	13,033	ヘルスケア
METRO AG	50	42	5,121	生活必需品
NEMETSCHKE SE	20	119	14,469	情報技術
SCOUT24 AG	36	243	29,368	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	49	208	25,205	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	14.5	136	16,448	資本財・サービス
TEAMVIEWER AG	44.5	189	22,839	情報技術
BEIERSDORF AG	32.9	323	39,004	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE-PREF	19.5	69	8,410	素材
MERCK KGAA	42.5	430	51,955	ヘルスケア
ADIDAS AG	61.7	1,419	171,331	一般消費財・サービス
PUMA SE	27.1	177	21,454	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	34	251	30,342	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,059.5	1,545	186,548	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	69.2	513	61,998	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	272	979	118,235	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	405	790	95,453	情報技術
HANNOVER RUECK SE	18.5	286	34,538	金融
DEUTSCHE POST AG-REG	315	951	114,840	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	60.6	905	109,295	金融
LANXESS AG	25	113	13,697	素材
MTU AERO ENGINES AG	17.1	266	32,171	資本財・サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	106	420	50,720	不動産
SYMRISE AG	42.2	404	48,798	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	338	87	10,589	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	15.5	68	8,245	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	164.5	874	105,492	不動産
LEG IMMOBILIEN AG	23	269	32,474	不動産
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	7,786.47 61銘柄	33,338 <3.1%>	4,023,305
ユーロ (ポルトガル)	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	77	116	14,022	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	827	339	40,988	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	150.5	162	19,615	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,054.5 3銘柄	618 <0.1%>	74,626
ユーロ (スペイン)	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA	1,492.27	677	81,795	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	2020年6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千ユーロ	千円	
ENDESA SA		92.5	198	23,922	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		2,130.12	666	80,434	金融
IBERDROLA SA		1,854.34	1,807	218,187	公益事業
BANKINTER SA		183	77	9,357	金融
REPSOL SA		434	377	45,503	エネルギー
GRIFOLS SA		92	256	30,998	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA		5,277.5	1,167	140,943	金融
AMADEUS IT GROUP SA		140.5	680	82,064	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA		94	155	18,723	公益事業
MAPFRE SA		306.5	52	6,332	金融
CAIXABANK SA		1,093	203	24,514	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		78.76	178	21,509	資本財・サービス
AENA SME SA		22.5	279	33,669	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA		80	390	47,065	コミュニケーション・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		347	847	102,219	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		66.5	98	11,909	資本財・サービス
ENAGAS SA		79.5	164	19,878	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		139	226	27,292	公益事業
FERROVIAL SA		162.7	400	48,301	資本財・サービス
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	14,165.69 20 銘柄	8,904	1,074,622 <0.8%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (イタリア)					
PRYSMIAN SPA		78.5	150	18,193	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		357.43	479	57,908	金融
MEDIOBANCA SPA		188.65	128	15,499	金融
UNICREDIT SPA		696.56	553	66,761	金融
TELECOM ITALIA SPA		2,629.82	92	11,215	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP		1,719.5	63	7,723	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO		4,782.37	775	93,611	金融
ATLANTIA SPA		154.57	222	26,814	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		160	131	15,925	金融
MONCLER SPA		63	214	25,864	一般消費財・サービス
RECORDATI SPA		30.5	123	14,929	ヘルスケア
ENI SPA		813	698	84,249	エネルギー
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		187	139	16,835	生活必需品
PIRELLI & C SPA		110	42	5,177	一般消費財・サービス
DIASORIN SPA		8.5	141	17,130	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		83	74	8,969	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA		109	154	18,626	情報技術
LEONARDO SPA		131.75	81	9,851	資本財・サービス
ENEL SPA		2,587.34	1,900	229,340	公益事業
SNAM SPA		666	288	34,761	公益事業
TERNA SPA		463	279	33,759	公益事業
FINECOBANK SPA		197	228	27,530	金融
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	16,216.49 22 銘柄	6,966	840,678 <0.6%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (フィンランド)					
UPM-KYMMENE OYJ		169	434	52,476	素材
NOKIA OYJ		1,814	676	81,589	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		120	86	10,452	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		188.5	199	24,113	素材

銘	柄	2020年6月15日現在			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		百株	千ユーロ	千円	
METSO OYJ		34.5	102	12,402	資本財・サービス
ELISA OYJ		46	243	29,432	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		153	467	56,444	金融
FORTUM OYJ		138.5	231	27,912	公益事業
KONE OYJ-B		109.5	651	78,599	資本財・サービス
NESTE OYJ		139	485	58,559	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		32	138	16,686	ヘルスケア
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,944 11 銘柄	3,717	448,670	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オーストリア)					
VERBUND AG		20	78	9,413	公益事業
OMV AG		44.5	139	16,862	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		94.5	212	25,659	金融
VOESTALPINE AG		42.5	81	9,878	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		44	75	9,164	金融
ANDRITZ AG		21	68	8,292	資本財・サービス
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	266.5 6 銘柄	656	79,270	
ユ ー ロ 通 貨 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	59,307.75 241 銘柄	115,790	13,973,645	
フ ァ ン ド 合 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	339,025.82 1,215 銘柄	—	125,564,531	

(注1) 邦貨換算金額は、2020年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘	柄	2020年6月15日現在		
		□ 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
		千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
AVALONBAY COMMUNITIES INC		4.417	723	77,564
SIMON PROPERTY GROUP INC		9.687	736	78,930
BOSTON PROPERTIES INC		4.6	444	47,623
VORNADO REALTY TRUST		5.397	216	23,249
SBA COMMUNICATIONS CORP		3.55	1,055	113,209
EQUITY RESIDENTIAL		11.85	753	80,784
EQUINIX INC		2.748	1,859	199,402
AMERICAN TOWER CORP		14.1	3,638	390,238
HOST HOTELS & RESORTS INC		22.243	281	30,150
INVITATION HOMES INC		17.7	489	52,521
VICI PROPERTIES INC		14.4	320	34,421
VENTAS INC		12.2	480	51,561
WEYERHAEUSER CO		24.114	524	56,271
AGNC INVESTMENT CORP		16.8	228	24,520
CROWN CASTLE INTL CORP		13.35	2,194	235,320
IRON MOUNTAIN INC		8.91	247	26,582
VEREIT INC		33.5	218	23,387
SUN COMMUNITIES INC		2.9	401	43,051

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2020年6月15日現在		
		□ 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
		千□	千アメリカ・ドル	千円
PROLOGIS INC		23.702	2,238	240,098
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		3.97	632	67,808
CAMDEN PROPERTY TRUST		3.2	304	32,707
DUKE REALTY CORP		11.45	404	43,406
ESSEX PROPERTY TRUST INC		2.05	511	54,890
FEDERAL REALTY INVST TRUST		2.36	213	22,896
WELLTOWER INC		12.9	712	76,418
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		16.45	452	48,477
MID-AMERICA APARTMENT COMM		3.55	422	45,333
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		5.4	342	36,766
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		45.1	314	33,710
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		5.35	190	20,447
REALTY INCOME CORP		10.5	634	68,045
PUBLIC STORAGE		4.94	970	104,083
REGENCY CENTERS CORP		5.3	253	27,219
UDR INC		9.15	357	38,356
WP CAREY INC		5.4	373	40,021
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		6.9	209	22,413
DIGITAL REALTY TRUST INC		8.3	1,128	121,052
EXTRA SPACE STORAGE INC		4	386	41,484
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		16.05	311	33,356
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	428.488 39銘柄	26,182	2,807,787 <2.2%>
(カナダ)		千□	千カナダ・ドル	千円
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		4.8	70	5,546
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		2.1	45	3,579
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		2.4	117	9,267
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		4.7	78	6,159
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	14 4銘柄	312	24,552 <0.0%>
(オーストラリア)		千□	千オーストラリア・ドル	千円
LENLEASE GROUP		21.5	263	19,273
TRANSURBAN GROUP		86.3	1,224	89,469
SYDNEY AIRPORT		33.3	215	15,716
APA GROUP		38.1	427	31,231
SCENTRE GROUP		159.922	366	26,756
DEXUS		33.15	319	23,347
GPT GROUP		63.16	269	19,703
MIRVAC GROUP		126.1	297	21,742
STOCKLAND		72	259	18,989
GOODMAN GROUP		52.9	780	57,045
VICINITY CENTRES		99.273	156	11,459
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	785.705 11銘柄	4,581	334,735 <0.3%>
(香港)		千□	千香港・ドル	千円
LINK REIT		67	4,495	62,220
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		75	582	8,054
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		122	1,400	19,383
香港・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	264 3銘柄	6,478	89,659 <0.1%>

銘柄	数	2020年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	79.6	140	10,767
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	101	313	24,064
CAPITALAND MALL TRUST	77.2	158	12,163
SUNTEC REIT	63	92	7,118
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	69.8	131	10,139
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	65.5	133	10,270
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	456.1 6銘柄	969 <0.1%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	21.662	134	18,003
SEGRO PLC	35.25	307	41,213
BRITISH LAND CO PLC	25.55	105	14,151
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	82.462 3銘柄	546 <0.1%>
(ユーロ (フランス))	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4.2	240	29,063
ICADE	0.95	62	7,509
GECINA SA	1.4	163	19,699
KLEPIERRE	6.25	115	13,881
COVIVIO	1.5	98	11,838
ユーロ通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	14.3 5銘柄	679 <0.1%>
ファンド合計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,045.055 71銘柄	— 3,486,620 <2.7%>

(注1) 邦貨換算金額は、2020年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2020年6月15日現在		
	買建額	売建額	
外	百万円	百万円	
	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	650	—
	S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	14	—
	SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	53	—
国	FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	16	—
	SWISS MKT IX FUTR (スイス)	11	—
	EURO STOXX 50 (ドイツ)	34	—

(注1) 外貨建の評価額は、2020年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第20期 (決算日 2019年12月2日)

(作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2日)

外国株式インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

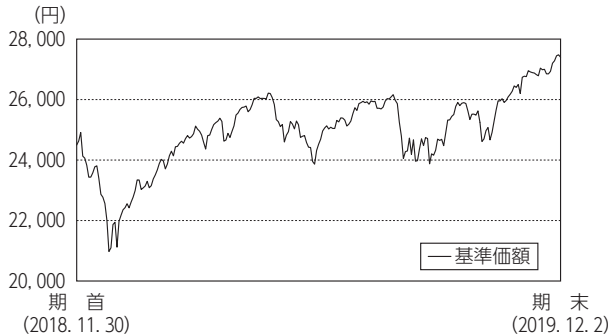
大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		MSCIコクサイ指数 (円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率			
(期首)2018年11月30日	24,496	—	16,678	—	95.1	2.3	2.6
12月末	21,941	△10.4	14,911	△10.6	96.2	1.2	2.7
2019年1月末	23,373	△4.6	15,850	△5.0	96.1	1.2	2.7
2月末	24,775	1.1	16,795	0.7	96.2	1.1	2.7
3月末	24,945	1.8	16,870	1.2	95.8	1.6	2.8
4月末	26,060	6.4	17,595	5.5	96.4	0.9	2.7
5月末	24,412	△0.3	16,406	△1.6	96.0	1.1	2.8
6月末	25,291	3.2	16,972	1.8	95.8	1.6	2.8
7月末	25,979	6.1	17,414	4.4	95.7	1.5	2.7
8月末	24,692	0.8	16,519	△1.0	95.1	2.0	2.9
9月末	25,483	4.0	17,023	2.1	95.8	1.2	3.0
10月末	26,498	8.2	17,659	5.9	91.1	6.1	2.8
11月末	27,482	12.2	18,297	9.7	90.6	6.6	2.7
(期末)2019年12月2日	27,400	11.9	18,243	9.4	90.5	6.7	2.7

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：24,496円 期末：27,400円 騰落率：11.9%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より、米中関係悪化への懸念が高まったことや、米国債券市場において景気後退の予兆とされる長短金利の逆転現象が見られたことを受け、下落して始まりまし。2019年1月以降は、米中通商協議の進展期待や米国企業を中心とした良好な1-3月決算の発表などを好感し、上昇しました。5月からは、米中関係の緊張が続いたことや世界的な景気減速懸念などを嫌気し、下落しました。6月以降は、世界的な金融緩和期待や英国の合意なきEU(欧州連合)離脱懸念の後退などを受け、上昇基調となりました。当作成期末にかけては、再度米中通商協議の進展期待が高まり、底堅い展開となりました。

○為替相場

為替相場は、当作成期を通して円高となりました。

当作成期首より、株価や原油価格が下落する中で市場のリスク回避姿勢が強まり、円高が進行しました。2019年1月に入ると、FRB(米国連邦準備制度理事会)が景気に配慮した金融政策を行うとの期待が市場で高まり、市場のリスク選好姿勢が回復したことなどから、米ドルを中心に上昇に転じました。4月以降は、米中の貿易摩擦への懸念や世界的な景気減速懸念などから、円高が進行しました。9月以降は、米中通商交渉や英国のEU(欧州連合)離脱交渉の進展期待が高まる中で、円安傾向となりました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は9.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は11.9%となりました。

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

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

《今後の運用方針》

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。

外国株式インデックスマザーファンド

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション) (投資信託証券)	1円 (1) (0) (0)
有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	2 (2) (0)
その他費用 (保管費用) (その他)	7 (7) (0)
合 計	10

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ (百株 11,284.7 91.07)	千アメリカ・ドル (△ 87,440 2,352)	百株 5,036.19	千アメリカ・ドル 33,749
	カナダ (△ 百株 2,159 105.59)	千カナダ・ドル (△ 8,134 292)	百株 1,118	千カナダ・ドル 2,686
	オーストラリア (△ 百株 2,768.05 317.2)	千オーストラリア・ドル (△ 4,668 442)	百株 931.73	千オーストラリア・ドル 1,768
	香港 (百株 3,954 286.09)	千香港・ドル (16,635 —)	百株 3,702	千香港・ドル 6,967
国	シンガポール (百株 1,359 —)	千シンガポール・ドル (704 —)	百株 1,899	千シンガポール・ドル 261
	ニュージーランド (百株 380 —)	千ニュージーランド・ドル (295 —)	百株 —	千ニュージーランド・ドル —
	イギリス (百株 10,885.98 625.28)	千イギリス・ポンド (△ 6,843 174)	百株 3,744.24	千イギリス・ポンド 3,634
	イスラエル (百株 441 —)	千イスラエル・シェケル (882 —)	百株 483	千イスラエル・シェケル 117
	スイス (百株 548.45 118.8)	千スイス・フラン (△ 3,988 153)	百株 148.5	千スイス・フラン 1,287

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
外	デンマーク (百株 142.3 5.3)	千デンマーク・クローネ (6,073 —)	百株 77.3	千デンマーク・クローネ 2,681
	ノルウェー (百株 201 24)	千ノルウェー・クローネ (2,524 —)	百株 117	千ノルウェー・クローネ 1,827
	スウェーデン (百株 809 151)	千スウェーデン・クローネ (11,020 —)	百株 369.5	千スウェーデン・クローネ 4,038
	ユーロ (百株 68.5 —)	千ユーロ (261 —)	百株 9	千ユーロ 27
	ユーロ (百株 1,022.6 7.62)	千ユーロ (△ 2,968 53)	百株 154	千ユーロ 601
	ユーロ (百株 63.5 —)	千ユーロ (574 —)	百株 14	千ユーロ 111
	ユーロ (百株 323.3 —)	千ユーロ (288 —)	百株 10	千ユーロ 42
	ユーロ (百株 860.1 23.48)	千ユーロ (△ 4,455 3)	百株 316	千ユーロ 1,505
	ユーロ (百株 864.4 21.24)	千ユーロ (△ 3,656 105)	百株 405.2	千ユーロ 1,606
	ユーロ (百株 110 —)	千ユーロ (61 —)	百株 —	千ユーロ —
国	ユーロ (百株 1,873 4,550.2)	千ユーロ (1,482 115)	百株 5,170.2	千ユーロ 677
	ユーロ (百株 1,853 —)	千ユーロ (841 —)	百株 994	千ユーロ 503
	ユーロ (百株 358.5 81.85)	千ユーロ (468 —)	百株 138.85	千ユーロ 126
	ユーロ (百株 50 —)	千ユーロ (△ 178 11)	百株 8	千ユーロ 24
	ユーロ (百株 7,446.9 4,669.15)	千ユーロ (△ 15,236 58)	百株 7,219.25	千ユーロ 5,226

(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、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

	買 付		売 付		
	口 数	金 額	口 数	金 額	
外 国	アメリカ	千口 91.22 (2.4)	千アメリカ・ドル 4,522 (—)	千口 13.479 (—)	千アメリカ・ドル 879 (—)
	カナダ	千口 3.8 (—)	千カナダ・ドル 173 (—)	千口 — (—)	千カナダ・ドル — (—)
	オーストラリア	千口 86 (—)	千オーストラリア・ドル 665 (—)	千口 6.4 (—)	千オーストラリア・ドル 90 (—)
	香港	千口 24 (—)	千香港・ドル 692 (—)	千口 — (—)	千香港・ドル — (—)
	シンガポール	千口 95.5 12.16)	千シンガポール・ドル 233 (△ 2)	千口 12.16 (—)	千シンガポール・ドル 3 (—)
	イギリス	千口 14.55 (—)	千イギリス・ポンド 89 (—)	千口 22.2 (—)	千イギリス・ポンド 61 (—)
ユーロ (フランス)	千口 1.79 (—)	千ユーロ 152 (—)	千口 0.25 (—)	千ユーロ 31 (—)	

(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

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 株式先物取引	百万円 25,361	百万円 19,425	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

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

銘 柄	当 期			銘 柄	期 付		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
MICROSOFT CORP (アメリカ)	千株 25	千円 346,644	円 13,865	CELGENE CORP (アメリカ)	千株 21.25	千円 249,796	円 11,755
AMAZON.COM INC (アメリカ)	1.57	311,915	198,672	APPLE INC (アメリカ)	8.3	188,085	22,660
APPLE INC (アメリカ)	10.85	226,791	20,902	SHIRE PLC (ジャージー)	24.324	154,583	6,355
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	8.1	156,863	19,365	MICROSOFT CORP (アメリカ)	8.55	124,832	14,600
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO (アメリカ)	25.8	153,804	5,961	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.54	106,160	196,593
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.99	121,219	122,444	ORACLE CORP (アメリカ)	15.8	92,082	5,827
PROSUS NV (オランダ)	14.5	120,665	8,321	WALT DISNEY CO/THE (アメリカ)	6.8	86,288	12,689
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.97	119,436	123,130	CISCO SYSTEMS INC (アメリカ)	11.8	65,328	5,536
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	8.1	117,384	14,491	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	4.75	58,661	12,349
BLACKSTONE GROUP INC/THE A (アメリカ)	19	111,097	5,847	FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	2.9	57,912	19,969

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	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 SOLUTION	30.5	33	408	44,776	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	25	28.5	647	71,026	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	48	55.5	594	65,151	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	—	41	298	32,719	情報技術
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	16	16	241	26,519	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	188	185	692	75,907	金融
ABBOTT LABORATORIES	456.66	499.16	4,265	467,820	ヘルスケア
ARCONIC INC	113.33	111.33	344	37,804	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	41.5	43.5	641	70,363	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	105	98	614	67,447	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	78	85.5	889	97,527	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	84.79	173.62	2,398	263,074	情報技術
QORVO INC	34	34	354	38,861	情報技術
AFLAC INC	203	216	1,184	129,920	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	31.5	36.5	432	47,415	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	39	42	293	32,158	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	127.8	137.5	4,256	466,802	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	59.5	64.5	298	32,690	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	26	31	699	76,736	一般消費財・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	100	113	186	20,449	金融
GARMIN LTD	29	39	380	41,787	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	58	61.3	1,448	158,893	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	192	205.5	3,669	402,438	資本財・サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	41.71	—	—	—	その他
WR BERKLEY CORP	25.5	41.75	283	31,138	金融
AUTOZONE INC	7	7.3	859	94,311	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	63.21	69.71	637	69,928	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	257	314	327	35,885	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	29.5	32	279	30,671	公益事業
CELANESE CORP	35.5	35	439	48,203	素材
DR HORTON INC	94.16	101.16	559	61,412	一般消費財・サービス
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	24.5	24.5	75	8,297	エネルギー
DENTSPLY SIRONA INC	59	70	395	43,409	ヘルスケア
AUTODESK INC	57.5	61	1,103	121,030	情報技術
MOODY'S CORP	44.5	48	1,088	119,333	金融
DEVON ENERGY CORP	139.5	116.5	255	27,970	エネルギー
ALBEMARLE CORP	28	31.5	205	22,588	素材
ATMOS ENERGY CORP	28	33.5	358	39,300	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	62.5	67	355	38,947	公益事業
CITIGROUP INC	660.73	653.73	4,910	538,618	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	115	122.5	2,092	229,456	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	130	142.5	1,301	142,774	公益事業
ALLEGHANY CORP	4.1	4.1	319	35,077	金融
DOMINO'S PIZZA INC	11	11	323	35,506	一般消費財・サービス
HESS CORP	72	78	484	53,118	エネルギー
DAVITA INC	35	35	251	27,551	ヘルスケア
DANAHER CORP	163	182	2,656	291,401	ヘルスケア
FORTIVE CORP	78	87	627	68,865	資本財・サービス
AVNET INC	32	—	—	—	情報技術
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	151.5	162.5	1,530	167,839	金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	49	49	92	10,152	一般消費財・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	47.28	56.28	97	10,678	一般消費財・サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	143.5	158	678	74,395	生活必需品
BUNGE LTD	36	40	213	23,418	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	89.25	98.25	910	99,904	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
APPLE INC	1,272.5	1,298	34,689	3,804,695	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	90	94	797	87,500	金融
BOEING CO/THE	143.1	149.9	5,489	602,037	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	39.15	44.65	477	52,424	金融
BECTON DICKINSON AND CO	70.19	76.49	1,977	216,866	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	67	67	142	15,637	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	38.5	38.5	349	38,358	情報技術
CDK GLOBAL INC	32	36	192	21,144	情報技術
NISOURCE INC	93.5	110.5	292	32,056	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	36	38.5	295	32,451	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	265.21	243.21	1,190	130,628	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,074.54	1,169.04	7,042	772,399	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	334.5	363.5	8,007	878,307	金融
ANSYS INC	22.5	24.5	623	68,439	情報技術
H&R BLOCK INC	51	—	—	—	一般消費財・サービス
BB&T CORP	200	215.5	1,179	129,336	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	190	1,030	112,990	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	421.5	668.5	3,806	417,490	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	877.7	910.7	11,999	1,316,092	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	63	69.5	858	94,186	金融
CIGNA HOLDING CO	64	—	—	—	その他
LKQ CORP	85	94	331	36,373	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	10	13.5	254	27,885	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	68.62	90.62	614	67,407	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	72.5	83	583	63,951	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	38.1	38.1	624	68,478	金融
DOLLAR GENERAL CORP	69.5	75	1,180	129,444	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	46.5	51.6	1,460	160,186	情報技術
CATERPILLAR INC	155.5	162	2,344	257,158	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	—	70	264	28,975	金融
AQUA AMERICA INC	—	63	278	30,589	公益事業
CMS ENERGY CORP	72	82	502	55,131	公益事業
MOSAIC CO/THE	97.5	109.5	208	22,878	素材
DELTA AIR LINES INC	47.5	47.5	272	29,857	資本財・サービス
CORNING INC	213	232	673	73,894	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,222.5	1,210.5	5,484	601,570	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	37	236	25,955	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	346	356.5	1,763	193,471	金融
WABCO HOLDINGS INC	14	15.5	208	22,908	資本財・サービス
MSCI INC	23	24.5	635	69,648	金融
LENNOX INTERNATIONAL INC	10	10	255	28,061	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	14.5	16	185	20,314	資本財・サービス
COTY INC-CL A	118.39	84.39	97	10,681	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	56	65	390	42,810	情報技術
BROADCOM INC	108.02	111.22	3,516	385,732	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	10.5	—	—	—	ヘルスケア
ACUITY BRANDS INC	10	11.5	150	16,495	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	24.3	33.3	390	42,783	ヘルスケア
ARAMARK	64.5	70.5	307	33,744	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	53.5	60.5	172	18,891	素材
DTE ENERGY COMPANY	46.5	52.5	655	71,942	公益事業
CENTENE CORP	54.5	121.5	734	80,583	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	30	32	380	41,731	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	129	130.5	501	55,048	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	46.5	53.5	498	54,729	金融
GARTNER INC	23.5	27.2	436	47,869	情報技術
SPLUNK INC	38	45	671	73,649	情報技術
AGCO CORP	17	—	—	—	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		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	
DOMINION ENERGY INC	172	226.41	1,881	206,384	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	111	117	699	76,764	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	36.5	41.5	200	22,030	資本財・サービス
DEERE & CO	80	87.5	1,470	161,277	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	42.5	81.84	1,482	162,559	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	19.5	25	389	42,671	情報技術
CHEMOURS CO/THE	45.5	—	—	—	素材
BURLINGTON STORES INC	—	19	427	46,888	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	31.5	34.5	361	39,655	金融
VAIL RESORTS INC	10.2	11.2	271	29,809	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	36.5	41	187	20,604	金融
TARGA RESOURCES CORP	58.5	65.5	239	26,243	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	16.5	18	297	32,665	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	19.8	21.8	239	26,231	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	10.5	10.5	72	7,909	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	80	92	799	87,676	公益事業
COGNEX CORP	45.5	50.5	253	27,793	情報技術
TELEFLEX INC	12.3	13.3	469	51,543	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	23	26	300	32,971	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	22	323	35,477	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	6.5	240	26,333	ヘルスケア
WELLCARE HEALTH PLANS INC	—	15.2	489	53,693	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	31.5	38	566	62,175	ヘルスケア
IDEX CORP	19.5	22.5	366	40,160	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	216.5	230.5	1,563	171,457	生活必需品
ROLLINS INC	25.5	43.25	155	17,006	資本財・サービス
AMETEK INC	61.75	65.25	646	70,857	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	65	73.5	516	56,623	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	32	36.5	135	14,808	資本財・サービス
HEICO CORP	—	12	155	17,095	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	31	25.5	210	23,127	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	11.5	298	32,750	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	85.5	75	694	76,123	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	11	319	35,008	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	114	124	3,717	407,751	生活必需品
SCANA CORP	35	—	—	—	その他
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	24	292	32,069	情報技術
GRUBHUB INC	—	26	112	12,296	一般消費財・サービス
EPAM SYSTEMS INC	—	16.5	349	38,338	情報技術
AFFILIATED MANAGERS GROUP	13.5	—	—	—	金融
RPM INTERNATIONAL INC	—	38	280	30,729	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6.5	6.9	561	61,596	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	76	69.5	145	15,931	金融
UGI CORP	46	52	226	24,838	公益事業
CUMMINS INC	40.5	43.5	795	87,243	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	191.5	215.5	1,181	129,596	コミュニケーション・サービス
SABRE CORP	68.5	76.5	171	18,819	情報技術
CDW CORP/DE	40.5	43.5	587	64,433	情報技術
SIGNATURE BANK	15	15	185	20,295	金融
COSTAR GROUP INC	9.7	9.9	606	66,546	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	13.9	14.9	345	37,870	金融
AMERCO	2.2	2.2	79	8,740	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	16.5	18.5	354	38,875	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	10.9	12.7	737	80,871	一般消費財・サービス
HANESBRANDS INC	95	110	165	18,181	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	19.5	23	349	38,328	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	74.16	81.66	857	94,042	一般消費財・サービス
COMMSCOPE HOLDING CO INC	46	—	—	—	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
IPG PHOTONICS CORP	10.2	10.2	144	15,896	情報技術
DEXCOM INC	—	27	613	67,314	ヘルスケア
COPART INC	54	58.5	520	57,104	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	26.5	46.5	359	39,444	エネルギー
SEATTLE GENETICS INC	29	32.5	391	42,899	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	19.5	22.7	629	69,050	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	12.8	13.3	754	82,725	資本財・サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	26	303	33,253	ヘルスケア
NIELSEN HOLDINGS PLC	90	99	193	21,228	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	509.81	575.81	1,129	123,846	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	73.5	79	1,095	120,145	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	11.5	464	50,934	金融
CABOT OIL & GAS CORP	120.5	120.5	192	21,067	エネルギー
T-MOBILE US INC	90	100	785	86,153	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	29	34.5	135	14,814	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	1,051	1,141.5	6,095	668,566	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	57.5	71	358	39,294	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	45.5	48.5	362	39,768	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	30.5	30.5	143	15,779	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	86.5	86.5	237	26,080	金融
CSX CORP	214	221.5	1,584	173,800	資本財・サービス
FLUOR CORP	36.5	—	—	—	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	26	26.8	461	50,643	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	32.25	40.75	414	45,436	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	21.5	24	196	21,511	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	107.4	117.7	21,195	2,324,713	一般消費財・サービス
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	66.5	—	—	—	エネルギー
FLOWSERVE CORP	32	35.5	172	18,962	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	54.5	60	1,469	161,190	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,099.05	1,196.55	8,152	894,121	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	34	37.5	200	22,029	情報技術
AES CORP	170	201	380	41,688	公益事業
L3 TECHNOLOGIES INC	20.5	—	—	—	その他
EVEREST RE GROUP LTD	10.2	12.4	336	36,892	金融
EOG RESOURCES INC	152.5	164	1,162	127,531	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	44.5	48.5	422	46,343	情報技術
ABIOMED INC	10.8	12.9	253	27,756	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	42.5	46.5	408	44,835	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	83.9	92.4	746	81,855	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	956.23	1,109.23	1,004	110,224	一般消費財・サービス
MACYS INC	80.98	—	—	—	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	39.9	46.9	154	16,944	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	—	37	299	32,875	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48.87	48.87	110	12,086	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	79.89	100.89	307	33,772	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	34	40	247	27,117	資本財・サービス
FORTINET INC	38	41.5	436	47,843	情報技術
MARKEL CORP	3.6	4.1	465	51,064	金融
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	44	—	—	—	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC	122.5	135.5	3,168	347,494	公益事業
FREEMPORT-MCMORAN INC	364.08	434.08	493	54,180	素材
INSULET CORP	—	17.5	324	35,643	ヘルスケア
US BANCORP	403.5	428	2,569	281,799	金融
UNITED RENTALS INC	21.5	23	352	38,609	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	16	17.5	254	27,967	情報技術
FASTENAL CO	77	163	578	63,502	資本財・サービス
FISERV INC	107	161.63	1,878	206,065	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	2,263.5	2,468.5	2,781	305,129	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		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	
NEKTAR THERAPEUTICS	44.5	—	—	—	ヘルスケア
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	56	61	327	35,887	一般消費財・サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	60.5	—	—	—	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	334	361	1,299	142,540	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	27.5	33	93	10,279	コミュニケーション・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	66	69	1,254	137,539	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	93.4	92.9	2,056	225,539	金融
ALPHABET INC-CL A	77.6	84	10,954	1,201,473	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	81.77	87.47	11,414	1,251,940	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	27.5	31.5	211	23,168	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	156.5	168.5	898	98,541	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	125.68	152.68	728	79,861	公益事業
GENUINE PARTS CO	37.5	43	448	49,223	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	101.84	106.34	772	84,734	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	176	207	624	68,542	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	30.5	64.1	1,288	141,376	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	30	30	86	9,456	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	234	248	520	57,094	エネルギー
HOME DEPOT INC	298.5	310	6,835	749,751	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	14	17.5	232	25,503	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	294	299	445	48,830	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	11.9	11.9	299	32,847	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	37.5	43.5	644	70,688	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	44.5	44.5	161	17,756	一般消費財・サービス
HUMANA INC	36	38.3	1,306	143,341	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	89.5	81.5	941	103,316	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	21	362	39,724	情報技術
HELMERICH & PAYNE	29	—	—	—	エネルギー
HENRY SCHEIN INC	40.5	45	310	34,006	ヘルスケア
HP INC	433	426	855	93,821	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	394	394	623	68,407	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	48	48	232	25,538	コミュニケーション・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	43	47	242	26,573	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	54.5	60	270	29,672	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	21	25	121	13,353	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	103.5	119	499	54,778	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	161.53	198.53	605	66,413	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	238.5	250	3,361	368,661	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	100	107	495	54,383	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	36	40	253	27,753	資本財・サービス
ZOETIS INC	126.5	135.5	1,633	179,112	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND PLC	65.79	69.79	915	100,359	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	54.5	65.5	396	43,492	エネルギー
ALLEGION PLC	24.5	26.5	318	34,886	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	35	35	183	20,084	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	136.73	117.73	253	27,762	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	68.57	75.57	684	75,052	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	89	96.5	241	26,523	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	22	247	27,143	ヘルスケア
JM SMUCKER CO/THE	29.2	34.2	359	39,419	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	696	748	10,284	1,127,976	ヘルスケア
ABBVIE INC	394.29	417.79	3,665	402,006	ヘルスケア
HOLOGIC INC	71	75.5	387	42,497	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	89.5	99.5	1,356	148,790	生活必需品
KROGER CO	218.5	229.5	627	68,819	生活必需品
KLA CORP	41	46.5	761	83,570	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	66.7	71.7	2,803	307,508	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	23.2	25.6	785	86,177	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
L BRANDS INC	59	—	—	—	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	212	224.5	2,633	288,854	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	252.5	246.05	2,887	316,689	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	42.3	42.3	1,128	123,794	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	12.5	14.5	241	26,452	不動産
LOEWS CORP	72.5	79	402	44,103	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	57.99	57.99	342	37,557	金融
MCDONALD'S CORP	203.5	216	4,200	460,740	一般消費財・サービス
3M CO	153.5	162.5	2,758	302,581	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	624.5	676.5	13,640	1,496,138	コミュニケーション・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	51.04	—	—	—	情報技術
MANPOWERGROUP INC	16	17.8	164	18,086	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	65	69.8	1,847	202,607	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	16	18.4	493	54,166	素材
CONCHO RESOURCES INC	52.5	58	420	46,158	エネルギー
FIRST DATA CORP- CLASS A	134.5	—	—	—	その他
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	53	66	225	24,785	コミュニケーション・サービス
PHILLIPS 66	116	128.5	1,474	161,684	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	111.5	121	227	25,003	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	134	144.5	461	50,636	一般消費財・サービス
MATTEL INC	87	—	—	—	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	73.38	77.88	290	31,886	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	32	33.5	566	62,187	生活必需品
MYLAN NV	137.5	148.5	278	30,587	ヘルスケア
METLIFE INC	227	235	1,172	128,642	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	157	181	477	52,349	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	13.9	15.1	294	32,316	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	42	48	216	23,701	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	42.78	47.78	799	87,673	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6.4	6.4	460	50,499	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	132.73	144.73	324	35,589	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	32.3	33.8	661	72,601	資本財・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	29.4	—	—	—	金融
MERCK & CO. INC.	696.21	727.21	6,339	695,351	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	598.55	211.68	1,371	150,469	素材
MASCO CORP	79	86	400	43,908	資本財・サービス
M & T BANK CORP	35.19	35.69	587	64,487	金融
MARSH & MCLENNAN COS	132.5	144.5	1,561	171,277	金融
BLACK KNIGHT INC	—	44	277	30,408	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	—	23	231	25,337	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	77.22	78.72	1,104	121,186	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	37.5	48	859	94,300	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	—	18.5	157	17,230	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	77.5	101	698	76,568	情報技術
TRANSUNION	47	55	474	52,065	資本財・サービス
VISTRA ENERGY CORP	87	100.5	266	29,243	公益事業
CAPRI HOLDINGS LTD	38.5	44.5	165	18,127	一般消費財・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	79.5	—	—	—	その他
BEIGENE LTD-ADR	—	10.5	213	23,411	ヘルスケア
NETAPP INC	68.5	74.5	451	49,509	情報技術
NIKE INC -CL B	332	355.5	3,323	364,529	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	74	75	1,451	159,173	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	60	68	642	70,510	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	34.5	37.5	336	36,942	金融
ALLY FINANCIAL INC	114.5	114.5	364	39,985	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	43	44.5	1,565	171,690	資本財・サービス
APTIV PLC	68.5	72	675	74,136	一般消費財・サービス
NEWMONT GOLDCORP CORP	140	231.61	889	97,547	素材

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
MCKESSON CORP	53	55.5	802	88,045	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	71	81	459	50,346	情報技術
XYLEM INC	48	51.5	399	43,781	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	404.5	440.5	3,653	400,668	生活必需品
NUCOR CORP	82	87	490	53,779	素材
WESTERN UNION CO	117.46	129.46	347	38,167	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	45	53	351	38,586	情報技術
NEWELL BRANDS INC	122.92	122.92	236	25,912	一般消費財・サービス
EVERGY INC	69.5	68.5	433	47,535	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	197	257.24	992	108,821	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	—	7	118	12,998	金融
OKTA INC	—	30	389	42,702	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	28.5	31.5	376	41,282	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	—	107.05	296	32,534	ヘルスケア
LINDE PLC	147.96	152.96	3,154	345,951	素材
WIX.COM LTD	—	14.5	175	19,225	情報技術
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	—	83	205	22,521	金融
KKR & CO INC -A	—	147	433	47,546	金融
PAYCHEX INC	83.5	93.5	805	88,316	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	21.2	22	973	106,720	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	491	528.5	2,626	288,090	生活必需品
P G & E CORP	132.5	—	—	—	公益事業
PFIZER INC	1,520.13	1,571.13	6,051	663,782	ヘルスケア
ALKERMES PLC	40	—	—	—	ヘルスケア
CIGNA CORP	—	106.8	2,135	234,182	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	—	45.51	220	24,203	情報技術
ALTICE USA INC- A	—	41	104	11,503	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	131.5	148.5	913	100,151	公益事業
STERIS PLC	—	25	377	41,442	ヘルスケア
FOX CORP - CLASS B	—	48.33	169	18,542	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	—	99.99	357	39,217	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	87	95	1,946	213,455	ヘルスケア
DOW INC	—	210.68	1,124	123,324	素材
PARKER HANNIFIN CORP	35	37.5	745	81,762	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	—	52	153	16,881	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	45	46.5	594	65,199	エネルギー
POLARIS INC	15.5	15.5	151	16,609	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	650.67	707.67	8,637	947,396	生活必需品
EXELON CORP	254.72	273.72	1,215	133,295	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	57.5	66	752	82,479	ヘルスケア
NVR INC	0.9	1	379	41,589	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	303	319	1,912	209,717	エネルギー
TWILIO INC - A	—	31.5	325	35,682	情報技術
DOCUSIGN INC	—	29	206	22,649	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	—	14	387	42,504	情報技術
MATCH GROUP INC	—	18	126	13,914	コミュニケーション・サービス
PEPSICO INC	366	395.5	5,372	589,209	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	—	11	134	14,785	情報技術
DROPPBOX INC-CLASS A	—	52	96	10,545	情報技術
MONGODDB INC	—	12.5	185	20,386	情報技術
SNAP INC - A	—	208	317	34,790	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	—	215.68	561	61,552	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	110	118	1,104	121,165	金融
AMCOR PLC	—	479	491	53,902	素材
ROKU INC	—	24	384	42,214	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	48.5	51.5	623	68,364	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	167	180.8	3,636	398,903	情報技術
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	22	—	—	—	金融

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
PENTAIR PLC	42.05	47.05	208	22,886	資本財・サービス
QUALCOMM INC	369.5	343.5	2,869	314,775	情報技術
INVESCO LTD	109.5	109.5	192	21,089	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	19	20.5	322	35,318	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	72	83.5	460	50,462	金融
PINTEREST INC- CLASS A	—	45	87	9,614	コミュニケーション・サービス
RAYTHEON COMPANY	75.2	79.2	1,721	188,865	資本財・サービス
DISH NETWORK CORP-RTS	—	3.49	0	26	コミュニケーション・サービス
RED HAT INC	45.5	—	—	—	その他
REGENERON PHARMACEUTICALS	20.9	22	811	89,038	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	60	67.5	598	65,631	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	12.5	12.3	2,341	256,865	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	99.5	107	1,242	136,310	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	24	26.5	296	32,523	素材
RESMED INC	37	41.5	620	68,093	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	35.5	38	404	44,408	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	30.5	33.5	194	21,384	資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP	14.5	14.5	155	17,070	一般消費財・サービス
PERKINELMER INC	—	31	287	31,586	ヘルスケア
REGIONS FINANCIAL CORP	288.35	302.35	503	55,181	金融
CHEVRON CORP	497.18	538.18	6,303	691,390	エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	83	103	711	78,062	公益事業
TESLA INC	33	37.7	1,243	136,428	一般消費財・サービス
NORTONLIFELOCK INC	161.5	184.5	459	50,387	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	39.22	44.22	697	76,504	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	37.5	43.5	613	67,291	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	45.05	44.15	2,075	227,596	コミュニケーション・サービス
CBRE GROUP INC - A	87	91.5	521	57,223	不動産
TWITTER INC	179	211.5	653	71,702	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	266.5	293.5	1,819	199,552	公益事業
SYSCO CORP	127	137	1,103	121,035	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	71.23	73.03	998	109,511	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	35.5	39.5	254	27,956	金融
STERICYCLE INC	21.5	—	—	—	資本財・サービス
STEEL DYNAMICS INC	62	62	209	22,936	素材
SCHLUMBERGER LTD	359.02	392.02	1,419	155,648	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	46	46	236	25,978	資本財・サービス
AT&T INC	1,887.91	2,065.91	7,722	846,989	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	36.5	40.5	233	25,603	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	110	123	264	28,964	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	21.9	23.3	1,358	149,021	素材
SEMPRA ENERGY	64.5	79	1,163	127,605	公益事業
TIFFANY & CO	29.5	32.5	434	47,694	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	70.5	71	423	46,474	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	253	265	3,185	349,392	情報技術
SALESFORCE.COM INC	186	234.21	3,815	418,434	情報技術
WESTROCK CO	66.3	71.3	287	31,538	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	238.84	229.84	984	107,969	資本財・サービス
TERADYNE INC	—	50	312	34,324	情報技術
UNION PACIFIC CORP	201.5	199.5	3,511	385,086	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	226	248	288	31,688	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	178.38	193.88	1,175	128,949	エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	214.37	231.37	3,432	376,437	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	179	197	2,358	258,700	資本財・サービス
UNUM GROUP	59	59	181	19,892	金融
SPRINT CORP	207.65	231.65	137	15,041	コミュニケーション・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	51	—	—	—	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	41.94	48.94	714	78,358	ヘルスケア

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		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	
VOYA FINANCIAL INC	43.5	43.5	253	27,805	金融
AMEREN CORPORATION	62.5	72	535	58,698	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	249.76	267.76	7,493	821,919	ヘルスケア
VERISIGN INC	29	30	572	62,761	情報技術
VALERO ENERGY CORP	112.92	117.42	1,121	122,977	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	15.1	16.1	376	41,296	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	68.38	81.88	389	42,774	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	23	25	348	38,248	ヘルスケア
ANTHEM INC	67.4	72.8	2,101	230,486	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	387	509.12	7,717	846,426	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,196.22	1,209.22	6,585	722,288	金融
WASTE MANAGEMENT INC	110.5	119.5	1,349	147,988	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	319	347	788	86,469	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	32	34.5	325	35,735	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	17	19	271	29,820	一般消費財・サービス
WALMART INC	382	405	4,823	529,002	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	29	29	252	27,669	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	53	58	842	92,419	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	26	29	350	38,439	一般消費財・サービス
XEROX HOLDINGS CORP	59.11	59.11	230	25,239	情報技術
WABTEC CORP	22.5	54.11	425	46,629	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	328	342.5	2,093	229,637	一般消費財・サービス
WATERS CORP	20.5	20.5	455	49,931	ヘルスケア
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	18	18	167	18,320	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	88.57	91.57	1,693	185,742	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	16.5	414	45,413	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	220	220	1,311	143,812	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	35.23	37.23	731	80,214	金融
WESTERN DIGITAL CORP	78	84	422	46,369	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	82.8	90.8	804	88,286	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	134	146	865	94,974	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	460.5	489.5	9,031	990,603	情報技術
PPL CORP	186	211	718	78,753	公益事業
PULTEGROUP INC	69	75	297	32,616	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	64.5	67.5	869	95,385	素材
NORTHERN TRUST CORP	56.5	60	643	70,572	金融
NVIDIA CORP	150	163	3,532	387,484	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	20.5	23.5	523	57,400	コミュニケーション・サービス
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	122.43	127.43	1,952	214,134	金融
QURATE RETAIL INC-SERIES A	114.5	—	—	—	一般消費財・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	47	53	211	23,147	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	79	83	746	81,830	生活必需品
NETFLIX INC	113.4	123.2	3,876	425,186	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	105	113	3,547	389,104	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	—	79.5	315	34,642	公益事業
GLOBE LIFE INC	29.25	29.25	300	32,966	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	42.5	48.5	533	58,461	金融
TEXTRON INC	68.5	68.5	316	34,740	資本財・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	275	—	—	—	コミュニケーション・サービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	116	—	—	—	その他
NEWS CORP - CLASS A	102.37	117.37	151	16,580	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	53	59.5	250	27,448	公益事業
OMNICOM GROUP	60.5	64	508	55,791	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	792.83	676.83	3,799	416,753	情報技術
MASTERCARD INC - A	240.5	255	7,451	817,320	情報技術
ONEOK INC	107.5	119	845	92,733	エネルギー
CENTURYLINK INC	253.52	294.52	426	46,806	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	27.2	30.2	1,088	119,366	資本財・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
YUM! BRANDS INC	83	89.5	900	98,821	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	30.5	30.5	370	40,594	コミュニケーション・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	13.3	13.3	142	15,595	情報技術
MOLSON COORS BREWING CO -B	50.5	56.5	285	31,282	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	124	145.5	302	33,129	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	2,491.01	2,554.01	8,509	933,372	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	10.5	359	39,384	資本財・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	46	52.5	423	46,474	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	30	114	12,559	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	190.5	200	2,402	263,495	金融
ANALOG DEVICES INC	95.49	106.49	1,202	131,923	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	238	291	1,139	124,954	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	72	83	430	47,183	金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	230.22	245.22	1,291	141,632	金融
ANADARKO PETROLEUM CORP	135	—	—	—	その他
SKYWORKS SOLUTIONS INC	48	51.5	506	55,524	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	44.5	49.5	594	65,160	一般消費財・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	51	—	—	—	その他
AVERY DENNISON CORP	23	25	325	35,747	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	153.5	165	1,057	116,021	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	165.5	174	1,285	140,956	資本財・サービス
AON PLC	63	69.7	1,419	155,653	金融
AMGEN INC	172.5	173	4,060	445,372	ヘルスケア
TAPESTRY INC	76.5	83.5	224	24,626	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	115.36	121.36	1,122	123,124	資本財・サービス
CELGENE CORP	192	—	—	—	その他
CONSTELLATION BRANDS INC-A	43.3	46.8	870	95,505	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	263	272	1,574	172,732	情報技術
CIT GROUP INC	33	—	—	—	金融
CIMAREX ENERGY CO	25	—	—	—	エネルギー
CME GROUP INC	93.5	101	2,047	224,577	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	98.94	116.94	263	28,922	エネルギー
ECOLAB INC	68.5	75.5	1,409	154,578	素材
EQUIFAX INC	31.5	33.5	467	51,307	資本財・サービス
GAP INC/THE	59.5	59.5	98	10,839	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	336	359.5	2,417	265,127	ヘルスケア
HORMEL FOODS CORP	77.5	83.5	371	40,781	生活必需品
STATE STREET CORP	97.43	109.43	821	90,137	金融
SUNTRUST BANKS INC	120.48	129.48	917	100,602	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	318	340	1,683	184,591	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	131	136	1,114	122,270	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	48.5	48.5	225	24,772	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	34.5	38.5	292	32,050	素材
CARDINAL HEALTH INC	83	90	495	54,321	ヘルスケア
FEDEX CORP	66	69	1,104	121,124	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	126.54	135.04	1,350	148,126	金融
FMC CORP	36	39.5	386	42,439	素材
FLEX LTD	129	147.5	175	19,203	情報技術
CERNER CORP	77.5	93.5	669	73,416	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	26.24	30.24	427	46,842	素材
CITRIX SYSTEMS INC	37	37	417	45,780	情報技術
INTEL CORP	1,205	1,266.5	7,352	806,370	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	102	115	257	28,253	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	91	103.5	640	70,222	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	79.5	94.5	1,647	180,688	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	417	461	321	35,292	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	38.7	40.4	1,295	142,131	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	44	44	166	18,208	素材

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
INTUITIVE SURGICAL INC	29.7	32.1	1,903	208,743	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	34.5	34.5	406	44,605	情報技術
SNAP-ON INC	15.5	15.5	248	27,278	資本財・サービス
CARMAX INC	46	49.5	481	52,804	一般消費財・サービス
COMERICA INC	45	45	316	34,751	金融
INGREDION INC	19	19	158	17,331	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	183.78	205.28	1,809	198,515	公益事業
TARGET CORP	132.5	144	1,800	197,439	一般消費財・サービス
DOVER CORP	39	42.5	473	51,965	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	13	14	443	48,668	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	34	39.5	363	39,896	資本財・サービス
CINTAS CORP	23.5	26.2	673	73,869	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	127	138	398	43,697	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	41	344	37,764	生活必需品
CLOROX COMPANY	33	37.5	555	60,966	生活必需品
ENTERGY CORP	47.5	54	628	68,934	公益事業
MICROSOFT CORP	1,892	2,056.5	31,131	3,414,480	情報技術
INCYTE CORP	46	53.5	503	55,251	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	335.69	367.69	2,767	303,550	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	349.88	379.38	4,225	463,498	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	305.5	312	1,482	162,579	情報技術
BLACKROCK INC	31.3	32	1,583	173,701	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	129	149	365	40,136	公益事業
HASBRO INC	31	36	366	40,156	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	68.5	73	475	52,139	生活必需品
KEYCORP	282	299	579	63,588	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	27.5	30	457	50,152	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	384.61	406.61	2,136	234,312	生活必需品
KOHL'S CORP	44.5	49.5	232	25,522	一般消費財・サービス
COOPER COS INC/THE	13	14	438	48,075	ヘルスケア
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	120	—	—	—	金融
APACHE CORP	98.6	106.1	236	25,927	エネルギー
CHUBB LTD	120.49	129.49	1,961	215,138	金融
ARROW ELECTRONICS INC	21.5	24	191	20,963	情報技術
ALLSTATE CORP	92	96	1,068	117,243	金融
EBAY INC	249	233.5	829	90,967	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	293	315	3,402	373,165	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	37.5	41.5	325	35,671	素材
XILINX INC	65.5	71.5	663	72,759	情報技術
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	147.1	—	—	—	その他
DISH NETWORK CORP-A	57.5	64.5	220	24,173	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA	52	52	258	28,391	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	57.5	61	1,192	130,778	生活必需品
TOLL BROTHERS INC	38	—	—	—	一般消費財・サービス
TRIMBLE INC	64	70.5	285	31,339	情報技術
LENNAR CORP-A	76	81	483	52,993	一般消費財・サービス
LEAR CORP	16.5	18	216	23,752	一般消費財・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	70	70	310	34,011	金融
PROGRESSIVE CORP	154	168	1,227	134,603	金融
PACCAR INC	91.37	100.37	816	89,576	資本財・サービス
PVH CORP	20	20	193	21,269	一般消費財・サービス
BIOGEN INC	54.6	56.1	1,681	184,474	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	22.2	25.2	633	69,535	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	354.5	342.5	2,925	320,921	一般消費財・サービス
PTC INC	—	31.5	241	26,464	情報技術
PERRIGO CO PLC	34	38	194	21,351	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	81.3	88.8	733	80,487	公益事業
INTUIT INC	63	73.4	1,900	208,419	情報技術

銘柄	株数	当株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
BORGWARNER INC	56	63	264	29,055	一般消費財・サービス	
BEST BUY CO INC	65	69	556	61,027	一般消費財・サービス	
BALL CORP	87.34	91.84	606	66,542	素材	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	360.47	392.97	1,699	186,411	ヘルスケア	
ELECTRONIC ARTS INC	78.5	86.5	873	95,831	コミュニケーション・サービス	
VULCAN MATERIALS CO	34.5	36.5	517	56,795	素材	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	66	72.5	1,607	176,331	ヘルスケア	
VF CORP	87	95	841	92,255	一般消費財・サービス	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	88.71	100.71	406	44,603	コミュニケーション・サービス	
VIACOM INC-CLASS B	92.71	100.71	242	26,587	コミュニケーション・サービス	
MOHAWK INDUSTRIES INC	15.7	17.2	239	26,292	一般消費財・サービス	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	24	26	347	38,135	ヘルスケア	
CARNIVAL CORP	112	118.5	534	58,590	一般消費財・サービス	
COMCAST CORP-CLASS A	1,188.9	1,281.9	5,659	620,743	コミュニケーション・サービス	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	61	67	212	23,331	資本財・サービス	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	59	67	376	41,313	資本財・サービス	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	90	90	52	5,774	生活必需品	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	313	353	194	21,294	不動産	
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	79,569.2 592銘柄	85,908.78 612銘柄	762,122	83,589,601 <62.4%>	
		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)						
IMPERIAL OIL LTD	76	83	276	22,807	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	5	6	852	70,392	情報技術	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	50.96	59.96	82	6,786	エネルギー	
RESTAURANT BRANDS INTERN	63.87	71.87	627	51,820	一般消費財・サービス	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	120	132	481	39,806	素材	
INTACT FINANCIAL CORP	38.5	40.5	554	45,831	金融	
BCE INC	41.3	45.3	289	23,930	コミュニケーション・サービス	
FRANCO-NEVADA CORP	51	57	744	61,536	素材	
SUNCOR ENERGY INC	429.3	444.3	1,840	152,081	エネルギー	
METRO INC/CN	62	77	447	37,012	生活必需品	
NATIONAL BANK OF CANADA	90	95	675	55,844	金融	
BANK OF NOVA SCOTIA	318	346	2,592	214,227	金融	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	118.5	125.5	1,449	119,718	金融	
TORONTO-DOMINION BANK	483	516	3,952	326,517	金融	
GREAT-WEST LIFECO INC	76	83	277	22,938	金融	
ROYAL BANK OF CANADA	383.5	405.5	4,409	364,271	金融	
TOURMALINE OIL CORP	66	—	—	—	エネルギー	
VERMILION ENERGY INC	37	—	—	—	エネルギー	
TC ENERGY CORP	238.5	261.5	1,757	145,186	エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	132.29	146.29	678	56,057	エネルギー	
BOMBARDIER INC-B	530	628	123	10,221	資本財・サービス	
BARRICK GOLD CORP	304	514	1,140	94,191	素材	
CAE INC	72	79	281	23,294	資本財・サービス	
THOMSON REUTERS CORP	68.12	58.12	539	44,599	資本財・サービス	
EMPIRE CO LTD 'A'	46	53	188	15,575	生活必需品	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	16	16	92	7,636	素材	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	38.5	46.5	264	21,825	素材	
LINAMAR CORP	13	—	—	—	一般消費財・サービス	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	64	—	—	—	エネルギー	
HYDRO ONE LTD	84	92	230	19,017	公益事業	
LOBLAW COMPANIES LTD	54.6	54.6	390	32,299	生活必需品	
WSP GLOBAL INC	27	30	257	21,249	資本財・サービス	
PARKLAND FUEL CORP	—	44	207	17,165	エネルギー	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		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	
QUEBECOR INC -CL B	—	53	174	14,423	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	13	72	393	32,491	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	33	40	156	12,908	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	95	106	682	56,417	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	59	72	568	46,946	素材
STARS GROUP INC/THE	—	63	200	16,567	一般消費財・サービス
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	—	150	279	23,088	公益事業
AIR CANADA	—	41	205	16,954	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	341	379	217	17,973	素材
BANK OF MONTREAL	171	180	1,839	152,017	金融
POWER CORP OF CANADA	94	94	303	25,038	金融
METHANEX CORP	22	17	84	6,942	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	23	28	1,247	103,048	情報技術
NUTRIEN LTD	165.19	165.19	1,035	85,572	素材
AURORA CANNABIS INC	175	198	65	5,431	ヘルスケア
CANOPY GROWTH CORP	55	62	151	12,555	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	—	55	49	4,103	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	58	323	26,734	素材
CAMECO CORP	106	106	128	10,596	エネルギー
TELUS CORP	54	54	270	22,374	コミュニケーション・サービス
POWER FINANCIAL CORP	62	80	259	21,467	金融
TECK RESOURCES LTD-CLS B	140	151	314	25,949	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	16	18	278	23,015	一般消費財・サービス
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	248	—	—	—	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	328	351	1,302	107,617	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	7	8	480	39,658	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	87	92	673	55,624	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	20.37	22.37	241	19,968	生活必需品
BLACKBERRY LTD	135	160	117	9,689	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	158.5	174.5	1,057	87,382	金融
ENBRIDGE INC	488	571	2,872	237,295	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	220.5	239.5	1,840	152,066	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	529	560	1,463	120,896	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	87	95	356	29,449	ヘルスケア
GOLDCORP INC	233.59	—	—	—	素材
ENCANA CORP	258	368	191	15,840	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	38	39	1,226	101,360	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	29	33	224	18,539	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	56	63	245	20,299	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	192.5	204.5	2,466	203,780	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	69	73	803	66,386	情報技術
HUSKY ENERGY INC	93.58	93.58	90	7,476	エネルギー
ONEX CORPORATION	22	26	205	16,991	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	116	138	378	31,297	コミュニケーション・サービス
FINNING INTERNATIONAL INC	44	—	—	—	資本財・サービス
SNC-LAVALIN GROUP INC	45	—	—	—	資本財・サービス
IGM FINANCIAL INC	19	24	91	7,574	金融
OPEN TEXT CORP	70	81	468	38,701	情報技術
CI FINANCIAL CORP	70	70	146	12,098	金融
SAPUTO INC	63	71	285	23,552	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	177	193	234	19,373	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	116	256	1,112	91,921	生活必需品
FORTIS INC	110	130	676	55,894	公益事業

銘柄	柄	期首		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
LUNDIN MINING CORP		161	194	139	11,524	素材
CRESCENT POINT ENERGY CORP		133	—	—	—	エネルギー
CENOVUS ENERGY INC		272	314	368	30,456	エネルギー
DOLLARAMA INC		83	90	437	36,130	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I		17	22	110	9,159	公益事業
ALTAGAS LTD		69	79	155	12,858	公益事業
FIRST CAPITAL REALTY INC		48	48	103	8,558	不動産
KEYERA CORP		53	60	194	16,066	エネルギー
INTER PIPELINE LTD		104	128	281	23,265	エネルギー
ARC RESOURCES LTD		97	—	—	—	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	10,989.17	11,924.58	55,981	4,625,219	
		89銘柄	86銘柄		<3.5%>	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
HEALTHSCOPE LTD		455	—	—	—	その他
MEDIBANK PRIVATE LTD		728	788	256	19,073	金融
BHP GROUP LTD		847.5	836.5	3,197	237,447	素材
SOUTH32 LTD		1,341	1,516	409	30,392	素材
ALUMINA LTD		623	693	160	11,886	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		245	266.5	919	68,287	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD		425	425	413	30,704	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK		133	133	133	9,904	金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		712.5	794.5	2,056	152,729	金融
WESTPAC BANKING CORP		902.48	973.48	2,386	177,232	金融
SANTOS LTD		452	531	432	32,132	エネルギー
AUSNET SERVICES		500	500	87	6,459	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP		770	798.5	1,983	147,272	金融
RIO TINTO LTD		109.5	105	1,017	75,545	素材
ORIGIN ENERGY LTD		462	535	465	34,559	エネルギー
AMCOR LIMITED		314	—	—	—	素材
AURIZON HOLDINGS LTD		543	600	346	25,749	資本財・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		—	34	75	5,634	エネルギー
COLES GROUP LTD		297.45	345.45	561	41,706	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD		—	45	122	9,114	情報技術
OIL SEARCH LTD		353	384	285	21,212	エネルギー
SEEK LTD		83	96	222	16,529	資本財・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		191	205	383	28,463	生活必需品
NEWCREST MINING LTD		197.5	234	719	53,443	素材
INCITEC PIVOT LTD		423	498	160	11,943	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		462	501.5	4,053	300,944	金融
CALTEX AUSTRALIA LTD		71.5	71.5	247	18,347	エネルギー
ORICA LTD		101	115	273	20,305	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		360.5	384.5	487	36,200	金融
CIMIC GROUP LTD		24	28	94	6,993	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD		351	362	1,439	106,868	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD		137	137	155	11,576	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD		484	577	276	20,521	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD		96	116	149	11,119	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD		—	240	175	13,008	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD		1,105	1,202	463	34,449	コミュニケーション・サービス
AMP LTD		750	1,020	199	14,806	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		120.5	133.5	386	28,706	素材
MACQUARIE GROUP LTD		85.84	91.84	1,267	94,137	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
ARISTOCRAT LEISURE LTD	152.5	174.5	591	43,948	一般消費財・サービス	
BANK OF QUEENSLAND LTD	108	—	—	—	金融	
CSL LTD	120.5	127.5	3,614	268,366	ヘルスケア	
WESFARMERS LTD	297.45	323	1,368	101,614	一般消費財・サービス	
COCHLEAR LTD	15	16.5	386	28,666	ヘルスケア	
BLUESCOPE STEEL LTD	144	163	237	17,609	素材	
SUNCORP GROUP LTD	343	382.57	511	38,006	金融	
BORAL LTD	305	358	184	13,662	素材	
ASX LTD	50	58	473	35,188	金融	
COMPUTERSHARE LTD	122.5	139	246	18,298	情報技術	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	140	60	4,469	一般消費財・サービス	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	595.36	709.36	559	41,556	金融	
SONIC HEALTHCARE LTD	104	132.5	399	29,632	ヘルスケア	
CHALLENGER LTD	139	174	141	10,516	金融	
WORLEY LTD	—	94	141	10,469	エネルギー	
AGL ENERGY LTD	174	190	387	28,793	公益事業	
BRAMBLES LTD	415	474	594	44,169	資本財・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	14	14	61	4,576	一般消費財・サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	38.5	42.5	310	23,029	ヘルスケア	
TPG TELECOM LTD	87	87	60	4,515	コミュニケーション・サービス	
REA GROUP LTD	13.5	16	166	12,397	コミュニケーション・サービス	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	38	199	14,810	金融	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	16.5	—	—	—	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	18,651.08	20,170.2	37,167	2,759,714	
	銘柄数 < 比率 >	57 銘柄	58 銘柄		< 2.1% >	
(香港)		百株	百株	千香港・ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	375	405	2,205	30,895	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	650	650	3,328	46,625	一般消費財・サービス	
MTR CORP	400	455	1,997	27,984	資本財・サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	420	455	5,182	72,606	不動産	
SINO LAND CO	900	900	1,056	14,802	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	706.69	771.69	5,486	76,868	資本財・サービス	
WHARF HOLDINGS LTD	320	—	—	—	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	125	155	1,091	15,298	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	435	470	3,792	53,138	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	359.16	435.07	1,638	22,948	不動産	
HANG LUNG GROUP LTD	210	—	—	—	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	2,481.81	2,901.99	4,329	60,660	公益事業	
HANG SENG BANK LTD	204	225	3,591	50,309	金融	
WHEELOCK & CO LTD	220	240	1,167	16,358	不動産	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,590	1,830	1,870	26,202	不動産	
WH GROUP LTD	2,225	2,950	2,371	33,228	生活必需品	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	313	337	8,330	116,712	金融	
MINH GROUP LTD	180	—	—	—	一般消費財・サービス	
LI & FUNG LTD	1,520	—	—	—	一般消費財・サービス	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	500	570	914	12,809	不動産	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	76	93	950	13,315	情報技術	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	190	190	439	6,162	一般消費財・サービス	
NWS HOLDINGS LTD	425	425	446	6,251	資本財・サービス	
KERRY PROPERTIES LTD	175	175	441	6,190	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	326.4	366.4	647	9,065	金融	
HYSAN DEVELOPMENT CO	170	—	—	—	不動産	
SJM HOLDINGS LTD	470	580	462	6,484	一般消費財・サービス	

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港・ドル	千円	
SWIRE PROPERTIES LTD	288	326	793	11,121	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	696.69	741.69	3,860	54,085	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	180	200	1,060	14,850	公益事業
PCCW LTD	1,170	1,170	552	7,736	コミュニケーション・サービス
AIA GROUP LTD	3,212	3,730	29,243	409,697	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	330	360	1,564	21,914	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	—	220	662	9,277	生活必需品
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	344	959	13,446	生活必需品
SANDS CHINA LTD	644	720	2,664	37,322	一般消費財・サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	300	—	—	—	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	355	410	2,412	33,804	資本財・サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	236	—	—	—	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	960	1,075	2,859	40,061	金融
WYNN MACAU LTD	420	420	723	10,132	一般消費財・サービス
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	24,758.75 39銘柄	25,296.84 34銘柄	99,098 <1.0%>	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	359	348	898	72,071	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	473	497	1,254	100,657	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	136.7	149.7	137	11,034	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	395	429	288	23,123	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	140	140	108	8,714	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	104	136	140	11,279	不動産
CAPITALAND LTD	689	775	285	22,875	不動産
YANGZIJANG SHIPBUILDING	568	693	71	5,725	資本財・サービス
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	410	514	113	9,070	コミュニケーション・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	27	27	82	6,635	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	828	937	1,010	81,018	金融
GENTING SINGAPORE LTD	1,530	1,700	157	12,613	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	72	86	136	10,947	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,209.5	2,254.5	762	61,121	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	395	440	181	14,575	資本財・サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	227	288	63	5,059	資本財・サービス
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,644	—	—	—	生活必需品
SATS LTD	160	196	97	7,829	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	208	233	206	16,539	金融
COMFORTDELGRO CORP LTD	553	648	152	12,214	資本財・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	492	589	240	19,322	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,620.2 21銘柄	11,080.2 20銘柄	6,388 <0.4%>	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	345	345	162	11,477	公益事業
MERCURY NZ LTD	—	230	110	7,797	公益事業
A2 MILK CO LTD	190	214	332	23,458	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	526.89	526.89	239	16,895	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	234	294	265	18,750	資本財・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	201	201	105	7,424	素材
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	151	187	414	29,255	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	88	118	178	12,584	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,735.89 7銘柄	2,115.89 8銘柄	1,807 <0.1%>	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)					
MERLIN ENTERTAINMENT	193	—	—	—	その他
TUI AG-DI	118.97	137.97	146	20,775	一般消費財・サービス
BP PLC	5,300	5,750	2,761	390,951	エネルギー
UNILEVER PLC	323.1	317.6	1,453	205,868	生活必需品
BARCLAYS PLC	4,500	4,968	852	120,664	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	440	527	375	53,098	資本財・サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	421	561	109	15,437	一般消費財・サービス
RANDGOLD RESOURCES LTD	24.8	—	—	—	その他
PRUDENTIAL PLC	690	757	1,042	147,538	金融
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,267.91	1,457.91	329	46,693	金融
EVRAZ PLC	—	150	55	7,866	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	49.64	60.64	174	24,676	素材
BAE SYSTEMS PLC	856	943	540	76,560	資本財・サービス
AVIVA PLC	1,075.66	1,138.66	459	65,101	金融
AVEVA GROUP PLC	—	20	91	12,907	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,309.02	1,410	2,473	350,171	ヘルスケア
INFORMA PLC	320	362	286	40,563	コミュニケーション・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	115	105.4	119	16,905	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,263	1,455	334	47,300	資本財・サービス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	93	—	—	—	ヘルスケア
AUTO TRADER GROUP PLC	253	283	159	22,519	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	26	28	185	26,197	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	—	135	178	25,326	一般消費財・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	21	187	26,537	資本財・サービス
HALMA PLC	—	110	231	32,800	情報技術
GVC HOLDINGS PLC	140	167	142	20,136	一般消費財・サービス
CONVATEC GROUP PLC	330	—	—	—	ヘルスケア
ROYAL MAIL PLC	223	—	—	—	資本財・サービス
NMC HEALTH PLC	27	27	67	9,591	ヘルスケア
JD SPORTS FASHION PLC	—	130	98	14,000	一般消費財・サービス
M&G PLC	—	757	178	25,295	金融
RELX PLC	528.46	555.46	1,040	147,306	資本財・サービス
DIAGEO PLC	653	675	2,136	302,489	生活必需品
RIO TINTO PLC	314.5	322.5	1,354	191,852	素材
STANDARD CHARTERED PLC	813	821	572	81,069	金融
TESCO PLC	2,548	2,817	646	91,498	生活必需品
FRESNILLO PLC	56	—	—	—	素材
SMITH & NEPHEW PLC	235.5	264.5	457	64,826	ヘルスケア
GLENCORE PLC	3,066.25	3,245.25	791	112,070	素材
JOHN WOOD GROUP PLC	180	—	—	—	エネルギー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	74	81.5	151	21,405	金融
SMITHS GROUP PLC	102.33	113.83	189	26,770	資本財・サービス
BABCOCK INTL GROUP PLC	61	—	—	—	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	368.83	419.83	128	18,154	金融
PEARSON PLC	201.63	235.63	152	21,572	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	452.25	542.25	116	16,453	生活必需品
NEXT PLC	35.5	42	283	40,188	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	842	932	162	22,994	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	49.61	38.61	177	25,152	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	88.55	96.05	203	28,872	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	7,021.83	7,661.83	1,175	166,370	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	34.43	36.61	182	25,814	素材

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
KINGFISHER PLC	554.11	624.11	131	18,548	一般消費財・サービス	
WPP PLC	331	384	384	54,397	コミュニケーション・サービス	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	171.27	206.27	176	24,924	公益事業	
SEVERN TRENT PLC	63.33	71.33	159	22,653	公益事業	
RENTOKIL INITIAL PLC	—	540	240	34,016	資本財・サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	178.5	203	1,231	174,353	生活必需品	
ST JAMES'S PLACE PLC	136	151.5	164	23,349	金融	
SCHRODERS PLC	30.5	34.5	113	16,115	金融	
SSE PLC	264	300	390	55,220	公益事業	
WEIR GROUP PLC/THE	61.5	79.5	110	15,708	資本財・サービス	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	259	310	206	29,267	一般消費財・サービス	
ASTRAZENECA PLC	334	370.5	2,763	391,239	ヘルスケア	
FERGUSON PLC	62.37	70.87	476	67,451	資本財・サービス	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,551	1,830	514	72,783	金融	
3I GROUP PLC	253.91	293.91	314	44,569	金融	
ASHTED GROUP PLC	127	136.5	320	45,418	資本財・サービス	
SAGE GROUP PLC/THE	276.14	323.14	243	34,488	情報技術	
NATIONAL GRID PLC	900.34	981.34	873	123,621	公益事業	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	19,199.65	20,814.65	1,272	180,217	金融	
RSA INSURANCE GROUP PLC	262.6	317.6	175	24,795	金融	
IMPERIAL BRANDS PLC	254	288	490	69,452	生活必需品	
CENTRICA PLC	1,526.6	1,761.6	141	20,008	公益事業	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	32	36	165	23,375	一般消費財・サービス	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	605.1	650.1	1,989	281,665	生活必需品	
BHP GROUP PLC	565.77	605.27	1,035	146,547	素材	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	91	106	272	38,556	生活必需品	
HSBC HOLDINGS PLC	5,302.5	5,716.5	3,294	466,456	金融	
SHIRE PLC	243.24	—	—	—	その他	
ANGLO AMERICAN PLC	328.83	310.83	629	89,187	素材	
MONDI PLC	93.5	142.5	238	33,805	素材	
WM MORRISON SUPERMARKETS	593	663	131	18,615	生活必需品	
CARNIVAL PLC	48.61	48.61	158	22,389	一般消費財・サービス	
EASYJET PLC	40	40	53	7,577	資本財・サービス	
COMPASS GROUP PLC	422.39	464.89	880	124,703	一般消費財・サービス	
PERSIMMON PLC	85	93	237	33,683	一般消費財・サービス	
BT GROUP PLC	2,224	2,461	471	66,749	コミュニケーション・サービス	
COCA-COLA HBC AG-DI	52	58	149	21,179	生活必需品	
BURBERRY GROUP PLC	113.39	121.89	256	36,311	一般消費財・サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	46.36	51.36	257	36,411	一般消費財・サービス	
TRAVIS PERKINS PLC	69	—	—	—	資本財・サービス	
INTERTEK GROUP PLC	44	48	264	37,488	資本財・サービス	
ITV PLC	931	1,021	148	20,976	コミュニケーション・サービス	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	83.49	91.99	632	89,506	金融	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,217	1,233	2,726	385,997	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	995.68	1,057.18	2,314	327,737	エネルギー	
MEGGITT PLC	195	241	154	21,941	資本財・サービス	
G4S PLC	378	435	90	12,878	資本財・サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	49.5	55.5	118	16,816	金融	
INVESTEC PLC	183	—	—	—	金融	
ANTOFAGASTA PLC	98	114	98	14,010	素材	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	587.62	708.62	224	31,795	金融	
EXPERIAN PLC	240.54	261.54	670	94,911	資本財・サービス	
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額	79,841.11	87,608.13	51,516	7,294,232	
	銘柄数 < 比率 >	96銘柄	93銘柄		< 5.4% >	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	柄	期首		期末		業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		百株	百株	千イスラエル・シケル	千円		
(イスラエル)							
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		—	345	548	17,312	金融	
AZRIELI GROUP LTD		10	10	272	8,606	不動産	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		483	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
ISRAEL CHEMICALS LTD		176	176	280	8,865	素材	
ELBIT SYSTEMS LTD		6	6	339	10,700	資本財・サービス	
BANK HAPOALIM BM		266	307	848	26,789	金融	
BANK LEUMI LE-ISRAEL		410	452	1,125	35,534	金融	
NICE LTD		16.5	18.5	962	30,360	情報技術	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		30	41	373	11,775	金融	
イスラエル・シケル通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,397.5 8銘柄	1,355.5 8銘柄	4,751	149,944 <0.1%>	
		百株	百株	千スイス・フラン	千円		
(スイス)							
DUFREY AG-REG		8.5	12.5	121	13,367	一般消費財・サービス	
UBS GROUP AG-REG		1,022.5	1,104	1,338	146,636	金融	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		2	2.3	142	15,640	素材	
ADECCO GROUP AG-REG		42.5	46.5	287	31,503	資本財・サービス	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN		185.2	199.4	6,145	673,486	ヘルスケア	
PARGESA HOLDING SA-BR		9.5	11	86	9,511	金融	
SIKA AG-REG		33.6	38.4	668	73,244	素材	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.03	0.03	255	28,044	生活必需品	
ABB LTD-REG		487	538	1,176	128,944	資本財・サービス	
SWISS RE AG		84	90	974	106,817	金融	
NESTLE SA-REG		820	869	9,030	989,668	生活必需品	
PARTNERS GROUP HOLDING AG		4.5	5.2	438	48,051	金融	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		10.5	12.6	314	34,424	資本財・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		671.2	751.7	985	107,957	金融	
JULIUS BAER GROUP LTD		59	64	301	33,020	金融	
SGS SA-REG		1.4	1.6	416	45,624	資本財・サービス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG		5	5.8	138	15,204	資本財・サービス	
VIFOR PHARMA AG		12	13	231	25,401	ヘルスケア	
TEMENOS AG - REG		15.5	19.7	298	32,750	情報技術	
ALCON INC		—	124.3	686	75,207	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-BR		8.5	8.5	238	26,082	一般消費財・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG		40.22	44.72	1,754	192,260	金融	
BALOISE HOLDING AG - REG		13	13.9	241	26,474	金融	
CLARIANT AG-REG		57	57	117	12,905	素材	
NOVARTIS AG-REG		574	610.5	5,620	615,924	ヘルスケア	
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.6	0.7	140	15,419	生活必需品	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG		139.6	153.1	1,166	127,782	一般消費財・サービス	
SWISSCOM AG-REG		7.1	7.7	398	43,677	コミュニケーション・サービス	
GEBERIT AG-REG		9.9	11.3	606	66,475	資本財・サービス	
GIVAUDAN-REG		2.5	2.6	764	83,742	素材	
STRAUMANN HOLDING AG-REG		2.7	2.9	278	30,573	ヘルスケア	
SONOVA HOLDING AG-REG		14.2	16.9	385	42,282	ヘルスケア	
LONZA GROUP AG-REG		20.1	22	747	81,876	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-REG		15.2	15.2	81	8,878	一般消費財・サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG		127.9	142.9	736	80,745	素材	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		9	10.4	515	56,508	金融	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		14.9	16.7	271	29,758	資本財・サービス	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
SWISS PRIME SITE-REG CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	百株 20.3 0.29	百株 23.3 0.34	千スイス・フラン 246 259	千円 26,964 28,411	不動産 生活必需品	
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,550.94 38銘柄	5,069.69 39銘柄	38,609	4,231,250 <3.2%>	
(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	482	506	19,288	311,898	ヘルスケア	
DANSKE BANK A/S	188	184	1,684	27,241	金融	
ISS A/S	44	44	684	11,074	資本財・サービス	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.95	0.95	836	13,525	資本財・サービス	
H LUNDBECK A/S	17	17	441	7,141	ヘルスケア	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	52.5	56	3,614	58,442	資本財・サービス	
CARLSBERG AS-B	27.5	30	2,926	47,326	生活必需品	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	58	64	2,073	33,530	素材	
COLOPLAST-B	31	33.5	2,684	43,400	ヘルスケア	
DSV PANALPINA A/S	50.1	62.1	4,585	74,146	資本財・サービス	
DEMANT A/S	26.75	34.25	710	11,491	ヘルスケア	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1.7	2	1,895	30,651	資本財・サービス	
TRYG A/S	33	33	643	10,405	金融	
PANDORA A/S	27.5	31.5	859	13,905	一般消費財・サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	25.5	30.5	1,570	25,399	素材	
GENMAB A/S	17	19.5	3,081	49,819	ヘルスケア	
ORSTED A/S	50.5	55	3,437	55,584	公益事業	
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,133 17銘柄	1,203.3 17銘柄	51,019	824,985 <0.6%>	
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORSK HYDRO ASA	352	417	1,359	16,177	素材	
DNB ASA	261.5	281	4,349	51,763	金融	
ORKLA ASA	208.5	219.5	1,959	23,315	生活必需品	
TELENOR ASA	199	208	3,498	41,632	コミュニケーション・サービス	
EQUINOR ASA	312.23	279.73	4,749	56,522	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	45.6	49.6	1,723	20,510	素材	
MOWI ASA	110.5	128.5	2,937	34,956	生活必需品	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	48.5	55.5	962	11,455	金融	
SCHIBSTED ASA-B SHS	24	31	736	8,765	コミュニケーション・サービス	
AKER BP ASA	29	29	766	9,120	エネルギー	
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,590.83 10銘柄	1,698.83 10銘柄	23,043	274,220 <0.2%>	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB	19	27	1,128	12,933	生活必需品	
ERICSSON LM-B SHS	811.3	856.3	7,389	84,687	情報技術	
VOLVO AB-B SHS	421	414	6,129	70,241	資本財・サービス	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	18	18	771	8,837	コミュニケーション・サービス	
SKF AB-B SHARES	97.5	105.5	1,929	22,113	資本財・サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	59.5	66.5	1,636	18,755	一般消費財・サービス	
SWEDISH MATCH AB	46	49	2,247	25,757	生活必需品	
TELE2 AB-B SHS	137	156	2,204	25,261	コミュニケーション・サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	430.5	482.5	3,962	45,407	金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	410.5	465.5	4,375	50,145	金融	
SWEDBANK AB - A SHARES	235	266	3,317	38,013	金融	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	235.5	235.5	4,352	49,885	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	株数	当 株数	期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円		
SKANSKA AB-B SHS	91.5	102.5	2,168	24,855	資本財・サービス	
SANDVIK AB	298.5	331.5	5,773	66,159	資本財・サービス	
INVESTOR AB-B SHS	123	127	6,428	73,673	金融	
ATLAS COPCO AB-A SHS	173.5	184.5	6,474	74,193	資本財・サービス	
SECURITAS AB-B SHS	84.5	95.5	1,516	17,379	資本財・サービス	
TELIA CO AB	770	830	3,440	39,426	コミュニケーション・サービス	
ALFA LAVAL AB	77	88	2,073	23,759	資本財・サービス	
ATLAS COPCO AB-B SHS	103	112.5	3,483	39,915	資本財・サービス	
ASSA ABLOY AB-B	268.5	293.5	6,674	76,486	資本財・サービス	
LUNDBERGS AB-B SHS	18	22	835	9,570	金融	
LUNDIN PETROLEUM AB	46.5	52.5	1,549	17,760	エネルギー	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	157	168.5	5,071	58,123	生活必需品	
BOLIDEN AB	70	78	1,926	22,078	素材	
EPIROC AB-A	179.5	206.5	2,308	26,457	資本財・サービス	
EPIROC AB-B	97	116	1,248	14,310	資本財・サービス	
HUSQVARNA AB-B SHS	114.5	114.5	856	9,812	一般消費財・サービス	
NORDEA BANK ABP	794	897	6,084	69,726	金融	
KINNEVIK AB - B	60.5	73	1,600	18,346	金融	
HEXAGON AB-B SHS	69	72	3,898	44,671	情報技術	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	46	46	1,021	11,708	金融	
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,562.3 32銘柄	7,152.8 32銘柄	103,879	1,190,454 <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	60	68	218	26,463	素材	
AIB GROUP PLC	230	230	68	8,255	金融	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	274.6	274.6	125	15,133	金融	
KINGSPAN GROUP PLC	—	44	215	26,014	資本財・サービス	
KERRY GROUP PLC-A	42.2	45.7	531	64,291	生活必需品	
CRH PLC	227	231	802	96,961	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	22	22	228	27,652	一般消費財・サービス	
国 小 計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	855.8 6銘柄	915.3 7銘柄	2,190	264,773 <0.2%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オランダ)						
QIAGEN N. V.	59.98	64.98	252	30,518	ヘルスケア	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	245.26	264.26	1,113	134,604	ヘルスケア	
NN GROUP NV	80.5	90.5	315	38,107	金融	
UNILEVER NV-CVA	411	—	—	—	その他	
HEINEKEN NV	67	76	714	86,379	生活必需品	
AEGON NV	447.44	536.44	219	26,530	金融	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	334.83	336.33	786	95,057	生活必需品	
AKZO NOBEL N. V.	66	65.38	568	68,682	素材	
KONINKLIJKE DSM NV	47.5	53	616	74,496	素材	
WOLTERS KLUWER	78	83	540	65,364	資本財・サービス	
ING GROEP NV	1,034.5	1,110.5	1,159	140,174	金融	
KONINKLIJKE KPN NV	842.5	1,009.5	282	34,113	コミュニケーション・サービス	
ASML HOLDING NV	109	120.6	2,978	360,020	情報技術	
ABN AMRO BANK NV-CVA	110.5	117	181	21,903	金融	
ADYEN NV	—	3	208	25,242	情報技術	
UNILEVER NV	—	416	2,238	270,494	生活必需品	
PROSUS NV	—	145	897	108,425	一般消費財・サービス	
VOPAK	19	19	91	11,111	エネルギー	

銘柄	株数	首 株数	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		
RANDSTAD NV	32	32	169	20,443	資本財・サービス		
HEINEKEN HOLDING NV	31.5	34	295	35,750	生活必需品		
ALTICE EUROPE NV	—	205	110	13,384	コミュニケーション・サービス		
STMICROELECTRONICS NV	185.5	199.5	444	53,768	情報技術		
AIRBUS SE	154.5	165.5	2,207	266,831	資本財・サービス		
EXOR NV	28.8	32.3	224	27,107	金融		
CNH INDUSTRIAL NV	272	298	289	35,036	資本財・サービス		
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	285.5	323.5	434	52,469	一般消費財・サービス		
FERRARI NV	31.45	34.95	536	64,797	一般消費財・サービス		
国 小 計	株 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	4,974.26 23 銘柄	5,835.24 26 銘柄	17,878	2,160,816		
		百株	百株	千ユーロ	千円		
ユーロ (ベルギー)							
GALAPAGOS NV	—	13	232	28,100	ヘルスケア		
UCB SA	32.5	35.5	261	31,561	ヘルスケア		
KBC GROUP NV	65	74.5	492	59,552	金融		
COLRUYT SA	16	16	75	9,088	生活必需品		
GRUPE BRUXELLES LAMBERT SA	20	22	202	24,488	金融		
SOLVAY SA	19.5	22	228	27,652	素材		
UMICORE	54	58	226	27,324	素材		
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	203.5	216	1,552	187,622	生活必需品		
AGEAS	49.4	52.4	285	34,502	金融		
PROXIMUS	41	41	112	13,567	コミュニケーション・サービス		
TELENET GROUP HOLDING NV	14.5	14.5	59	7,178	コミュニケーション・サービス		
国 小 計	株 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	515.4 10 銘柄	564.9 11 銘柄	3,728	450,639		
		百株	百株	千ユーロ	千円		
ユーロ (ルクセンブルグ)							
AROUNDTOWN SA	—	271	213	25,815	不動産		
RTL GROUP	10	—	—	—	コミュニケーション・サービス		
ARCELORMITTAL	177	203	315	38,097	素材		
EUROFINS SCIENTIFIC	2.9	3.2	152	18,432	ヘルスケア		
SES	97	110	132	16,013	コミュニケーション・サービス		
TENARIS SA	120	133	128	15,514	エネルギー		
国 小 計	株 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	406.9 5 銘柄	720.2 5 銘柄	942	113,874		
		百株	百株	千ユーロ	千円		
ユーロ (フランス)							
JCDECAUX SA	19	19	49	5,970	コミュニケーション・サービス		
TOTAL SA	636.5	679.5	3,237	391,240	エネルギー		
MICHELIN (CGDE)	45	50	544	65,808	一般消費財・サービス		
AIR LIQUIDE SA	112.92	134.77	1,658	200,427	素材		
KERING	19.8	21.8	1,191	144,041	一般消費財・サービス		
SCHNEIDER ELECTRIC SE	145	156.5	1,370	165,691	資本財・サービス		
BOUYGUES SA	56	67	248	30,025	資本財・サービス		
BNP PARIBAS	299	320.5	1,633	197,435	金融		
PEUGEOT SA	154.5	175.5	384	46,494	一般消費財・サービス		
NATIXIS	253.5	295.5	112	13,546	金融		
THALES SA	28.5	32.3	287	34,712	資本財・サービス		
DANONE	162	176	1,315	158,939	生活必需品		
CARREFOUR SA	158	170	254	30,778	生活必需品		
SUEZ	99.25	99.25	133	16,115	公益事業		
L'OREAL	279.91	268.91	670	80,991	コミュニケーション・サービス		
	67.3	71.7	1,854	224,180	生活必需品		

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	130.5	145.5	534	64,625	資本財・サービス	
LEGRAND SA	72.17	80.17	574	69,453	資本財・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	15.5	15.5	61	7,482	生活必需品	
PERNOD RICARD SA	56.17	60.87	1,014	122,636	生活必需品	
SOCIETE BIC SA	7	—	—	—	資本財・サービス	
EURAZEO SE	11.95	12.54	77	9,373	金融	
REXEL SA	78.5	—	—	—	資本財・サービス	
SOCIETE GENERALE SA	200.5	220.5	629	76,111	金融	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	73.5	79.3	3,229	390,364	一般消費財・サービス	
ACCOR SA	49.5	53.5	207	25,107	一般消費財・サービス	
CAPGEMINI SE	42.2	47.7	512	61,887	情報技術	
VALEO SA	64	71.5	255	30,901	一般消費財・サービス	
PUBLICIS GROUPE	56	64	255	30,893	コミュニケーション・サービス	
BUREAU VERITAS SA	71	88	209	25,270	資本財・サービス	
EIFFAGE	21.4	23.4	231	28,026	資本財・サービス	
SODEXO SA	25	27	285	34,524	一般消費財・サービス	
IPSEN	10	11.5	117	14,246	ヘルスケア	
INGENICO GROUP	16	18	174	21,071	情報技術	
AMUNDI SA	15	17	116	14,115	金融	
TELEPERFORMANCE	15	17.7	380	45,993	資本財・サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT	20	24.5	134	16,315	コミュニケーション・サービス	
FAURECIA	19	22.5	108	13,090	一般消費財・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	—	8	115	13,932	ヘルスケア	
SEB SA	5.6	6.5	91	11,076	一般消費財・サービス	
ESSILORLUXOTTICA	54.3	83	1,170	141,442	一般消費財・サービス	
DASSAULT AVIATION SA	0.7	0.8	98	11,940	資本財・サービス	
WORLDLINE SA	—	23.64	138	16,785	情報技術	
AXA SA	518	553.5	1,366	165,199	金融	
EDENRED	64	69	310	37,568	資本財・サービス	
RENAULT SA	50	58	252	30,461	一般消費財・サービス	
HERMES INTERNATIONAL	8.6	9	612	73,966	一般消費財・サービス	
REMY COINTREAU	5.5	6.3	73	8,900	生活必需品	
ATOS SE	25	29.6	228	27,575	情報技術	
DASSAULT SYSTEMES SA	33.8	39.8	569	68,786	情報技術	
WENDEL	6.8	7.8	95	11,529	金融	
ORANGE	536.5	583	874	105,692	コミュニケーション・サービス	
ALSTOM	40.5	44.5	176	21,287	資本財・サービス	
CNP ASSURANCES	43	48.5	86	10,504	金融	
SANOFI	296.75	318.75	2,693	325,567	ヘルスケア	
VINCI SA	134.5	145.5	1,440	174,057	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	144.5	164.5	382	46,204	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA	301	343	425	51,466	金融	
BIOMERIEUX	11.5	11.5	94	11,404	ヘルスケア	
ENGIE	478.73	521.23	748	90,462	公益事業	
IMERYS SA	9	—	—	—	素材	
EDF	159.5	170.5	158	19,213	公益事業	
SAFRAN SA	88	93.2	1,383	167,216	資本財・サービス	
ILIAD SA	6.5	7.4	85	10,334	コミュニケーション・サービス	
ARKEMA	17.7	19.2	180	21,826	素材	
ADP	8.1	9.1	161	19,521	資本財・サービス	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	47	47	69	8,458	コミュニケーション・サービス	
SCOR SE	41.5	49.5	193	23,326	金融	
GETLINK SE	124	124	189	22,944	資本財・サービス	
BOLLORE	241	241	93	11,301	資本財・サービス	
国小計	株数、金額	7,107.65	7,675.23	38,621	4,667,848	
	銘柄数 < 比率 >	68銘柄	67銘柄		< 3.5% >	

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ドイツ)					
BAYER AG-REG	246.7	268.2	1,842	222,688	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	42.5	53	139	16,872	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	531.5	593.5	388	46,940	金融
COMMERZBANK AG	263.35	281.35	148	17,889	金融
VOLKSWAGEN AG	8.9	8.9	154	18,624	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	49.7	52.7	924	111,768	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	202	217.5	2,547	307,873	資本財・サービス
E.ON SE	591	642	609	73,696	公益事業
UNIPER SE	53.5	59.5	174	21,070	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	86.5	98.5	722	87,261	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	45	45	131	15,864	資本財・サービス
OSRAM LICHT AG	25.6	—	—	—	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	29.7	31.7	375	45,438	一般消費財・サービス
BASF SE	244.2	261.7	1,785	215,773	素材
K+S AG-REG	48	—	—	—	素材
ALLIANZ SE-REG	116.3	120.4	2,616	316,277	金融
THYSSENKRUPP AG	114.5	114.5	130	15,748	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	46.5	52	498	60,257	生活必需品
RWE AG	141.5	162.5	437	52,850	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	61	66.5	114	13,840	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	10	11.8	91	11,026	資本財・サービス
BRENNTAG AG	39.5	47	227	27,498	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	112.5	122	605	73,193	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	33.2	33.2	102	12,338	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG	5.3	7.1	79	9,567	資本財・サービス
SAP SE	261.42	279.92	3,456	417,746	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	39.8	41.6	1,084	131,023	金融
SCHAEFFLER AG - PREF	38	—	—	—	一般消費財・サービス
ZALANDO SE	29	35.5	138	16,775	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	39	45	301	36,493	素材
KION GROUP AG	18.5	18.5	111	13,464	資本財・サービス
WIRECARD AG	30.7	34.7	415	50,242	情報技術
COVESTRO AG	52	52	221	26,710	素材
INNOGY SE	37.3	—	—	—	公益事業
SARTORIUS AG-VORZUG	9.5	10.5	200	24,276	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	40	46.5	312	37,755	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	25	32	153	18,564	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	—	12.5	138	16,769	ヘルスケア
METRO AG	50	50	73	8,837	生活必需品
1&1 DRILLISCH AG	13	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	40	45	198	23,941	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	—	14.5	128	15,470	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	26.9	30.9	327	39,530	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE -PREF	17	19.5	76	9,238	素材
MERCK KGAA	34.5	37.5	397	48,041	ヘルスケア
ADIDAS AG	49.3	51.2	1,447	174,966	一般消費財・サービス
PUMA SE	2.06	23.6	160	19,452	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	28.5	31	272	32,895	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	878	959.5	1,461	176,684	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	58.7	62.7	417	50,438	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	238.5	261	1,336	161,507	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	300.5	371.5	720	87,051	情報技術
HANNOVER RUECK SE	16.1	17.3	291	35,231	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE POST AG-REG	263.5	292	988	119,425	資本財・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	51	56.4	785	94,919	金融	
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE	59.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
LANXESS AG	22	25	151	18,280	素材	
MTU AERO ENGINES AG	14.3	15.3	376	45,470	資本財・サービス	
AXEL SPRINGER SE	12	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN SE	94	106	375	45,415	不動産	
SYMRISE AG	32	39.2	345	41,710	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	188	263	72	8,807	コミュニケーション・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	13.5	15.5	86	10,490	一般消費財・サービス	
HUGO BOSS AG -ORD	15.9	—	—	—	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	132	153	723	87,446	不動産	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,419.43 63銘柄	6,899.87 57銘柄	32,595	3,939,443 <2.9%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ポルトガル)						
JERONIMO MARTINS	60	60	86	10,511	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	660	747	274	33,133	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	116.5	139.5	206	24,910	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	836.5 3銘柄	946.5 3銘柄	567	68,555 <0.1%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (スペイン)						
TELEFONICA SA	1,250.27	1,320.27	917	110,931	コミュニケーション・サービス	
ENDESA SA	82.5	92.5	228	27,591	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,748.12	1,910.12	913	110,384	金融	
IBERDROLA SA	1,621.34	1,703.34	1,520	183,796	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	1,449.09	1,601.09	161	19,486	金融	
BANKINTER SA	183	183	116	14,040	金融	
REPSOL SA	366.5	418	597	72,192	エネルギー	
GRIFOLS SA	77.5	85	263	31,856	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	4,264.5	4,772.5	1,688	204,015	金融	
AMADEUS IT GROUP SA	117	123.5	892	107,916	情報技術	
NATURGY ENERGY GROUP SA	90.5	94	221	26,811	公益事業	
MAPFRE SA	254.5	306.5	78	9,479	金融	
CAIXABANK SA	941	1,093	292	35,389	金融	
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	152	—	—	—	資本財・サービス	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	67.26	78.76	278	33,630	資本財・サービス	
AENA SME SA	18.5	20	333	40,294	資本財・サービス	
CELLNEX TELECOM SA	—	58	226	27,338	コミュニケーション・サービス	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	285	323	912	110,320	一般消費財・サービス	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	56	66.5	96	11,641	資本財・サービス	
ENAGAS SA	59	69	156	18,855	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	115	125.5	222	26,923	公益事業	
FERROVIAL SA	134	142	382	46,251	資本財・サービス	
BANKIA SA	301.05	301.05	52	6,398	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	13,633.63 22銘柄	14,886.63 22銘柄	10,553	1,275,547 <1.0%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (イタリア)						
PRYSMIAN SPA	61.5	68.5	141	17,129	資本財・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI	313.43	315.43	584	70,641	金融	
MEDIOBANCA SPA	152.65	170.65	173	20,934	金融	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
UNICREDIT SPA	531.56	576.56	724	87,535	金融	
TELECOM ITALIA SPA	2,827.82	2,629.82	149	18,059	コミュニケーション・サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	1,469.5	1,719.5	96	11,617	コミュニケーション・サービス	
INTESA SANPAOLO	3,962.37	4,262.37	980	118,510	金融	
ATLANTIA SPA	134.57	146.57	294	35,641	資本財・サービス	
POSTE ITALIANE SPA	135	160	169	20,478	金融	
MONCLER SPA	47	51.5	204	24,754	一般消費財・サービス	
RECORDATI SPA	26	30.5	116	14,033	ヘルスケア	
ENI SPA	682	725	994	120,166	エネルギー	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	143	162	134	16,221	生活必需品	
PIRELLI & C SPA	110	110	56	6,846	一般消費財・サービス	
LEONARDO SPA	109.75	109.75	116	14,080	資本財・サービス	
ENEL SPA	2,154.34	2,307.34	1,581	191,189	公益事業	
SNAM SPA	616	616	277	33,591	公益事業	
LUXOTTICA GROUP SPA	45	—	—	—	その他	
TERNA SPA	389	428	249	30,157	公益事業	
FINCOBANK SPA	—	180	202	24,495	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	13,910.49 19銘柄	14,769.49 19銘柄	7,248	876,085 <0.7%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (フィンランド)						
UPM-KYMMENE OYJ	137	156	472	57,165	素材	
NOKIA OYJ	1,467.5	1,585	509	61,520	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP	120	120	109	13,250	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS	138	170.5	208	25,140	素材	
METSO OYJ	28	28	97	11,776	資本財・サービス	
ELISA OYJ	36.5	41.5	201	24,331	コミュニケーション・サービス	
SAMPO OYJ-A SHS	116.5	125	458	55,444	金融	
FORTUM OYJ	122.5	138.5	296	35,804	公益事業	
KONE OYJ-B	88	99	562	67,985	資本財・サービス	
NOKIAN RENKAAT OYJ	30.5	36.5	89	10,834	一般消費財・サービス	
NESTE OYJ	34.5	120.5	369	44,681	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	27.5	27.5	108	13,128	ヘルスケア	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,346.5 12銘柄	2,648 12銘柄	3,483	421,063 <0.3%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オーストリア)						
VERBUND AG	—	20	94	11,404	公益事業	
OMV AG	35.5	44.5	230	27,827	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	74	87	282	34,173	金融	
VOESTALPINE AG	28.5	28.5	68	8,284	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	34	34	72	8,756	金融	
ANDRITZ AG	21	21	74	8,984	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	193 5銘柄	235 6銘柄	822	99,430 <0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	51,199.56 236銘柄	56,096.36 235銘柄	118,633	14,338,077 <10.7%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	293,599.53 1,242銘柄	316,681.1 1,252銘柄	—	121,306,145 <90.5%>	

(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。

外国株式インデックスマザーファンド

(2) 外国投資信託証券

銘 柄	期 首		期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3.617	3.867	829	90,938
SIMON PROPERTY GROUP INC	8.137	8.887	1,343	147,388
BOSTON PROPERTIES INC	4	4.25	588	64,579
VORNADO REALTY TRUST	4.347	5.097	329	36,097
SBA COMMUNICATIONS CORP	3.05	3.15	744	81,698
EQUITY RESIDENTIAL	9.8	10.7	910	99,871
EQUINIX INC	2.088	2.288	1,296	142,249
AMERICAN TOWER CORP	11.45	12.45	2,664	292,261
HOST HOTELS & RESORTS INC	20.043	21.943	383	42,093
KIMCO REALTY CORP	11.1	12.6	272	29,878
INVITATION HOMES INC	8.3	12.7	387	42,526
VICI PROPERTIES INC	—	13.5	333	36,617
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	6.279	—	—	—
VENTAS INC	9.15	10.5	612	67,152
WEYERHAEUSER CO	20.064	21.164	624	68,500
AGNC INVESTMENT CORP	12.3	15.3	264	29,064
CROWN CASTLE INTL CORP	10.9	11.75	1,570	172,252
IRON MOUNTAIN INC	6.76	8.21	263	28,923
VEREIT INC	24.4	29.3	285	31,364
SUN COMMUNITIES INC	—	2.75	452	49,679
PROLOGIS INC	16.412	17.812	1,630	178,853
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2.72	3.07	498	54,723
CAMDEN PROPERTY TRUST	2.35	2.9	323	35,480
DUKE REALTY CORP	9.4	10.2	358	39,357
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.7	1.95	608	66,767
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1.85	2.2	290	31,867
WELLTOWER INC	9.7	11.45	968	106,206
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	12.4	14.35	500	54,897
LIBERTY PROPERTY TRUST	3.95	4.4	271	29,737
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3	3.25	442	48,517
MACERICH CO/THE	2.9	—	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	4.8	355	39,000
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	33.6	43.7	407	44,718
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4.15	4.55	253	27,816
REALTY INCOME CORP	7.55	8.9	682	74,802
PUBLIC STORAGE	4.15	4.37	920	100,979
REGENCY CENTERS CORP	4.05	4.95	321	35,311
SL GREEN REALTY CORP	2.4	2.4	204	22,461
UDR INC	6.8	8.1	389	42,688
WP CAREY INC	4.3	5.1	425	46,662
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	6.4	268	29,503
DIGITAL REALTY TRUST INC	5.5	6.05	731	80,258
EXTRA SPACE STORAGE INC	3.25	3.75	397	43,618
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	13	269	29,600
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	317.917 39銘柄	398.058 42銘柄	25,683 <2.1%>
(カナダ)				
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1.5	2.1	67	5,557
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	—	2.4	133	10,993
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3.7	3.7	79	6,596
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	3.9	4.7	127	10,538
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	9.1 3銘柄	12.9 4銘柄	407 <0.0%>

銘	柄	期 首		期 末	
		□ 数	□ 数	評 価	額
		千□	千□	外貨建金額	邦貨換算金額
				千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)					
LENLEASE GROUP		14.9	17	328	24,374
TRANSURBAN GROUP		68.1	76.5	1,174	87,189
SYDNEY AIRPORT		30.3	33.3	305	22,697
APA GROUP		31.2	35.8	393	29,239
SCENTRE GROUP		143.322	153.922	606	45,029
DEXUS		25.85	33.15	405	30,102
GPT GROUP		47.56	56.16	345	25,644
MIRVAC GROUP		98.8	111.6	376	27,924
STOCKLAND		66	72	363	26,997
GOODMAN GROUP		43.9	50.1	742	55,129
VICINITY CENTRES		89.273	99.273	266	19,754
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	659.205 11 銘柄	738.805 11 銘柄	5,307	394,083 <0.3%>
(香港)					
LINK REIT		57	62.5	5,000	70,050
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		64.5	75	575	8,059
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		99	107	1,228	17,209
香 港 ・ ド ル 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	220.5 3 銘柄	244.5 3 銘柄	6,803	95,318 <0.1%>
(シンガポール)					
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		70.1	79.6	159	12,833
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		69.5	76	226	18,165
CAPITALAND MALL TRUST		63.2	77.2	194	15,604
SUNTEC REIT		63	63	115	9,297
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		—	65.5	154	12,398
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	265.8 4 銘柄	361.3 5 銘柄	851	68,300 <0.1%>
(イギリス)					
LAND SECURITIES GROUP PLC		19.662	21.662	207	29,395
SEGRO PLC		25.75	33.15	296	41,961
HAMMERSON PLC		19.2	—	—	—
BRITISH LAND CO PLC		23.4	25.55	147	20,823
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	88.012 4 銘柄	80.362 3 銘柄	651	92,180 <0.1%>
ユーロ (フランス)					
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		3.61	3.95	560	67,742
ICADE		0.8	0.95	86	10,431
GECINA SA		1.25	1.4	219	26,531
KLEPIERRE		5.65	6.25	203	24,602
COVIVIO		0.97	1.27	127	15,410
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	12.28 5 銘柄	13.82 5 銘柄	1,197	144,718 <0.1%>
合 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,572.814 69 銘柄	1,849.745 73 銘柄	—	3,645,255 <2.7%>

(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。

外国株式インデックスマザーファンド

(3) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
外 S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	6,654	—
S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	336	—
SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	190	—
国 FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	479	—
SWISS MKT IX FUTR (スイス)	264	—
EURO STOXX 50 (ドイツ)	993	—

(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) 単位未满是切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	121,306,145	90.5
投資信託証券	3,645,255	2.7
コール・ローン等、その他	9,152,768	6.8
投資信託財産総額	134,104,169	100.0

(注1) 評価額の単位未满是切捨て。

(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、12月2日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.68円、1カナダ・ドル=82.62円、1オーストラリア・ドル=74.25円、1香港・ドル=14.01円、1シンガポール・ドル=80.21円、1ニュージーランド・ドル=70.63円、1イギリス・ポンド=141.59円、1イスラエル・シェケル=31.56円、1スイス・フラン=109.59円、1デンマーク・クローネ=16.17円、1ノルウェー・クローネ=11.90円、1スウェーデン・クローネ=11.46円、1ユーロ=120.86円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(127,572,094千円)の投資信託財産総額(134,104,169千円)に対する比率は、95.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	140,417,534,982円
コール・ローン等	6,979,983,687
株式(評価額)	121,306,145,522
投資信託証券(評価額)	3,645,255,546
未収入金	6,783,395,334
未収配当金	214,896,369
差入委託証拠金	1,487,858,524
(B) 負債	6,448,920,207
未払金	6,390,634,815
未払解約金	58,281,600
その他未払費用	3,792
(C) 純資産総額(A-B)	133,968,614,775
元本	48,893,612,273
次期繰越損益金	85,075,002,502
(D) 受益権総口数	48,893,612,273口
1万口当り基準価額(C/D)	27,400円

* 期首における元本額は43,964,024,902円、当作成期間中における追加設定元本額は10,527,862,672円、同解約元本額は5,598,275,301円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国株式インデックスV A466,203,951円、ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)12,135,579円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)136,414,008円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)19,175,184円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)467,869,193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)8,549,100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)538,132,530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)1,863,069,978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)538,513,489円、D-I's 外国株式インデックス2,768,783円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 2,115,496円、iFree 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)1,146,595,215円、iFree 8資産バランス816,785,041円、iFree 年金バランス26,201,082円、DCダイワ 外国株式インデックス29,501,748,908円、ダイワ・ライフ・バランス30 576,429,097円、ダイワ・ライフ・バランス50 874,085,645円、ダイワ・ライフ・バランス70 675,316,597円、大和DC海外株式インデックスファンド1,500,453,033円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 3,017,912円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 14,368,992円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 5,760,550円、ダイワつみたてインデックス外国株式136,727,006円、ダイワつみたてインデックスバランス30 88,638円、ダイワつみたてインデックスバランス50 86,527円、ダイワつみたてインデックスバランス70 530,015円、ダイワ世界バランスファンド40VA184,271,979円、ダイワ世界バランスファンド60VA323,611,524円、ダイワ・バランスファンド35VA2,650,169,104円、ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)127,631,309円、ダイワ・インデックスセレクト 外国株式677,239,222円、ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド111,772,535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)2,632,754,719円、ダイワ投信倶楽部 外国株式インデックス2,712,848,524円、ダイワライフスタイル25 18,663,687円、ダイワライフスタイル50 67,445,810円、ダイワライフスタイル75 54,062,311円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は27,400円です。

■損益の状況

当期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,549,233,818円
受取配当金	2,536,822,509
受取利息	2,018,549
その他収益金	11,188,012
支払利息	△ 795,252
(B) 有価証券売買損益	10,836,018,993
売買益	18,159,378,903
売買損	△ 7,323,359,910
(C) 先物取引等損益	573,606,102
取引益	720,048,944
取引損	△ 146,442,842
(D) その他費用	△ 33,986,973
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	13,924,871,940
(F) 前期繰越損益金	63,729,500,967
(G) 解約差損益金	△ 8,614,819,683
(H) 追加信託差損益金	16,035,449,278
(I) 合計 (E + F + G + H)	85,075,002,502
次期繰越損益金 (I)	85,075,002,502

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

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

ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)

運用報告書(全体版)

第4期

(決算日 2020年6月15日)

(作成対象期間 2019年6月18日～2020年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公社債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6 月15日)	10,065	0	0.7	521.587	0.7	99.4	—	24
2 期末 (2018年 6 月15日)	10,124	0	0.6	525.468	0.7	99.4	—	279
3 期末 (2019年 6 月17日)	10,363	0	2.4	538.684	2.5	99.4	—	5,116
4 期末 (2020年 6 月15日)	10,235	0	△ 1.2	532.954	△ 1.1	99.4	—	18,594

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

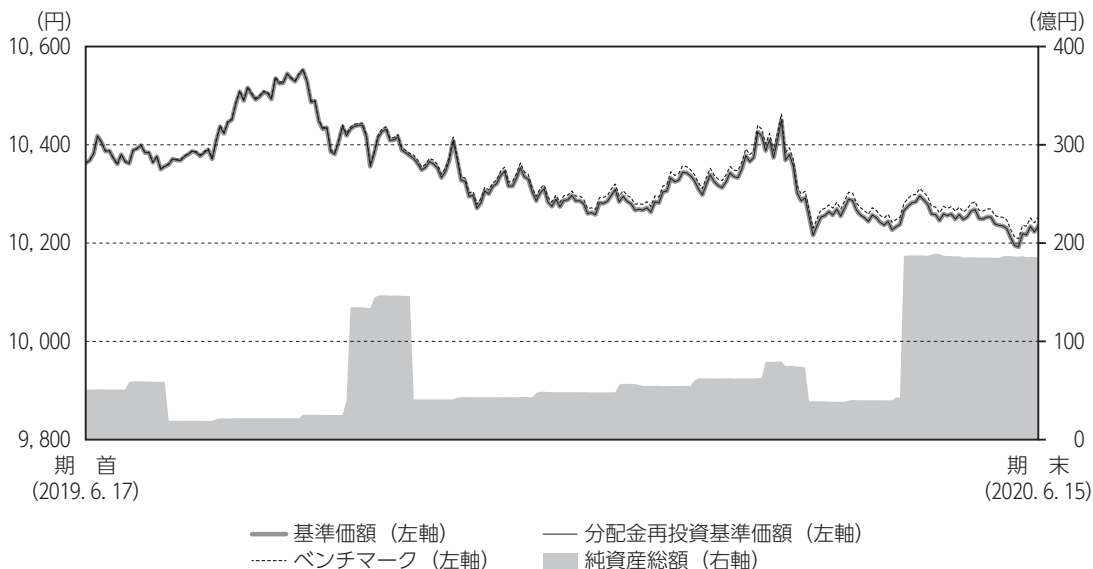
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率 - 売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

* ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数です。

■ 基準価額・騰落率

期首：10,363円

期末：10,235円(分配金0円)

騰落率：△1.2%(分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (D B I) 総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2019年 6月17日	円	%		%	%	%
	10,363	—	538.684	—	99.4	—
6月末	10,380	0.2	539.597	0.2	99.1	—
7月末	10,390	0.3	540.217	0.3	99.3	—
8月末	10,535	1.7	547.729	1.7	99.5	—
9月末	10,417	0.5	541.725	0.6	99.5	—
10月末	10,368	0.0	539.302	0.1	99.5	—
11月末	10,330	△ 0.3	537.478	△ 0.2	99.0	—
12月末	10,297	△ 0.6	535.929	△ 0.5	99.5	—
2020年 1月末	10,343	△ 0.2	538.313	△ 0.1	99.2	—
2月末	10,426	0.6	542.689	0.7	99.3	—
3月末	10,255	△ 1.0	533.796	△ 0.9	99.4	—
4月末	10,288	△ 0.7	535.588	△ 0.6	99.4	—
5月末	10,239	△ 1.2	533.139	△ 1.0	99.4	—
(期末)2020年 6月15日	10,235	△ 1.2	532.954	△ 1.1	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

(2019. 6. 18 ~ 2020. 6. 15)

国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇（債券価格は下落）しました。

当作成期首より、欧米の経済指標の下振れや米中貿易摩擦の激化などを背景に、世界的に景気減速懸念が高まったことから、長期金利は低下しました。また、日銀の追加金融緩和観測が高まったことも、金利低下要因となりました。2019年9月以降は、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待を背景に、長期金利は上昇しました。2020年1月以降は、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、市場のリスク回避姿勢が強まったことから、長期金利は低下しました。その後は、日本政府の経済対策に伴う国債増発懸念などを受けて金利は上昇しました。

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（ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数）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（ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数）との高い連動性を維持するように運用を行います。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流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

(2019. 6. 18 ~ 2020. 6. 15)

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

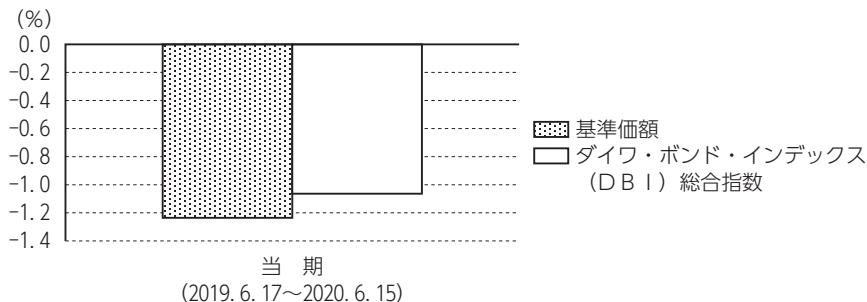
当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は $\Delta 1.1\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 1.2\%$ 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異は $\Delta 0.2\%$ 程度でした。差異の内訳は、信託報酬要因によるベンチマークとの差異が $\Delta 0.1\%$ 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 $\Delta 0.0\%$ 程度となっており、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。

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。



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	
	2019年6月18日 ～2020年6月15日	
当期分配金 (税込み) (円)	—	
対基準価額比率 (%)	—	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	326	

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

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

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



今後の運用方針

当ファンド

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

日本債券インデックスマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2019. 6. 18~2020. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	15円	0. 147%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10, 340円です。
(投 信 会 社)	(8)	(0. 082)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0. 054)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(1)	(0. 011)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0. 005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0. 000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	16	0. 152	

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

(注 2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

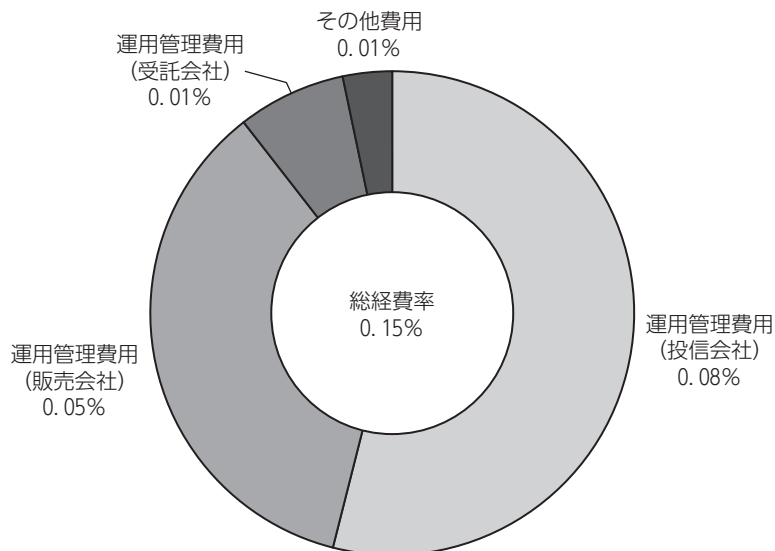
(注 3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.15%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日本債券インデックスマザーファンド	23,027,723	33,012,724	13,519,428	19,427,053

(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

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況 B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況 D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	51,886	2,284	4.4	32,297	1,021	3.2
コール・ローン	134,978	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合8.6%

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

(3) 利害関係人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

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

種 類	当 期	
	日本債券インデックスマザーファンド	買 付 額
	百万円	
公社債	197	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■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	3,556,309	13,064,603	18,576,559

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本債券インデックスマザーファンド	18,576,559	99.9
コール・ローン等、その他	25,210	0.1
投資信託財産総額	18,601,770	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	18,601,770,286円
コール・ローン等	25,210,357
日本債券インデックス マザーファンド (評価額)	18,576,559,929
(B) 負債	7,114,732
未払信託報酬	6,860,658
その他未払費用	254,074
(C) 純資産総額 (A - B)	18,594,655,554
元本	18,167,937,521
次期繰越損益金	426,718,033
(D) 受益権総口数	18,167,937,521口
1万口当り基準価額 (C / D)	10,235円

* 期首における元本額は4,937,687,762円、当作成期間中における追加設定元本額は32,014,941,813円、同解約元本額は18,784,692,054円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,235円です。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	49,051,353円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	539,632,677
(d) 分配準備積立金	4,126,286
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	592,810,316
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	592,810,316
(h) 受益権総口数	18,167,937,521口

■損益の状況

当期 自 2019年6月18日 至 2020年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,477円
受取利息	1,506
支払利息	△ 3,983
(B) 有価証券売買損益	△ 49,578,788
売買益	53,608,025
売買損	△ 103,186,813
(C) 信託報酬等	△ 10,941,169
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 60,522,434
(E) 前期繰越損益金	4,126,286
(F) 追加信託差損益金	483,114,181
(配当等相当額)	(539,632,677)
(売買損益相当額)	(△ 56,518,496)
(G) 合計 (D + E + F)	426,718,033
次期繰越損益金 (G)	426,718,033
追加信託差損益金	483,114,181
(配当等相当額)	(539,632,677)
(売買損益相当額)	(△ 56,518,496)
分配準備積立金	53,177,639
繰越損益金	△ 109,573,787

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

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

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

《お知らせ》

■商号変更について

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

<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（2019年12月2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（2020年6月15日）現在における日本債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■日本債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄 公 社 債

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
142 5年国債 0.1% 2024/12/20	2,347,143	127 5年国債 0.1% 2021/3/20	2,087,520
135 5年国債 0.1% 2023/3/20	2,135,436	134 5年国債 0.1% 2022/12/20	1,354,543
410 2年国債 0.1% 2022/3/1	2,008,960	130 5年国債 0.1% 2021/12/20	1,310,504
357 10年国債 0.1% 2029/12/20	1,756,675	138 5年国債 0.1% 2023/12/20	1,219,380
341 10年国債 0.3% 2025/12/20	1,597,882	128 5年国債 0.1% 2021/6/20	1,003,540
138 5年国債 0.1% 2023/12/20	1,474,034	125 5年国債 0.1% 2020/9/20	943,600
134 5年国債 0.1% 2022/12/20	1,212,657	129 5年国債 0.1% 2021/9/20	802,712
12 40年国債 0.5% 2059/3/20	1,127,609	126 5年国債 0.1% 2020/12/20	792,156
130 5年国債 0.1% 2021/12/20	1,109,217	357 10年国債 0.1% 2029/12/20	739,027
409 2年国債 0.1% 2022/2/1	1,107,601	353 10年国債 0.1% 2028/12/20	715,234

(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、2020年6月15日現在における日本債券インデックスマザーファンド（69,278,918千円）の内容です。

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

作 成 期	2020年6月15日現在						
	区 分	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残存期間別組入比率	
5年以上						2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	81,073,000	87,708,826	89.0	—	59.4	21.4	8.3
地方債証券	4,100,000	4,340,851	4.4	—	2.1	1.9	0.4
特殊債券（除く金融債券）	3,100,000	3,206,637	3.3	—	1.5	1.3	0.4
金融債券	100,000	99,696	0.1	—	0.1	—	—
普通社債券	2,600,000	2,671,610	2.7	—	1.7	1.0	—
合 計	90,973,000	98,027,620	99.5	—	64.8	25.6	9.1

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

日本債券インデックスマザーファンド

(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）

2020年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国債証券	402 2年国債	0.1000	150,000	150,429	2021/07/01
	129 5年国債	0.1000	540,000	541,809	2021/09/20
	317 10年国債	1.1000	214,000	217,426	2021/09/20
	318 10年国債	1.0000	200,000	202,948	2021/09/20
	52 20年国債	2.1000	52,000	53,497	2021/09/21
	405 2年国債	0.1000	150,000	150,534	2021/10/01
	406 2年国債	0.1000	700,000	702,653	2021/11/01
	407 2年国債	0.1000	100,000	100,395	2021/12/01
	130 5年国債	0.1000	680,000	682,781	2021/12/20
	319 10年国債	1.1000	100,000	101,925	2021/12/20
	320 10年国債	1.0000	230,000	234,077	2021/12/20
	53 20年国債	2.1000	66,000	68,265	2021/12/20
	54 20年国債	2.2000	65,000	67,330	2021/12/20
	408 2年国債	0.1000	150,000	150,627	2022/01/01
	409 2年国債	0.1000	1,100,000	1,104,851	2022/02/01
	410 2年国債	0.1000	2,000,000	2,009,240	2022/03/01
	131 5年国債	0.1000	1,170,000	1,175,463	2022/03/20
	321 10年国債	1.0000	175,000	178,596	2022/03/20
	322 10年国債	0.9000	130,000	132,441	2022/03/20
	55 20年国債	2.0000	140,000	145,355	2022/03/21
	132 5年国債	0.1000	880,000	884,699	2022/06/20
	323 10年国債	0.9000	380,000	388,162	2022/06/20
	133 5年国債	0.1000	550,000	553,245	2022/09/20
	325 10年国債	0.8000	310,000	316,758	2022/09/20
	58 20年国債	1.9000	200,000	209,356	2022/09/20
	134 5年国債	0.1000	470,000	473,078	2022/12/20
	326 10年国債	0.7000	30,000	30,650	2022/12/20
	327 10年国債	0.8000	450,000	460,894	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	47,110	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,393	2022/12/20
	135 5年国債	0.1000	2,840,000	2,840,304	2023/03/20
	328 10年国債	0.6000	350,000	357,371	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	103,214	2023/03/20
	136 5年国債	0.1000	950,000	957,467	2023/06/20
	329 10年国債	0.8000	500,000	514,440	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	97,743	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	137,688	2023/06/20
	137 5年国債	0.1000	700,000	705,852	2023/09/20
	330 10年国債	0.8000	612,000	631,167	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	365,000	374,037	2023/09/20
64 20年国債	1.9000	90,000	96,049	2023/09/20	
138 5年国債	0.1000	900,000	907,938	2023/12/20	
332 10年国債	0.6000	250,000	256,620	2023/12/20	
65 20年国債	1.9000	175,000	187,633	2023/12/20	
66 20年国債	1.8000	185,000	197,702	2023/12/20	
139 5年国債	0.1000	700,000	706,475	2024/03/20	
333 10年国債	0.6000	700,000	719,705	2024/03/20	
67 20年国債	1.9000	55,000	59,239	2024/03/20	
68 20年国債	2.2000	120,000	130,610	2024/03/20	

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	69 20年国債	2.1000	110,000	119,310	2024/03/20
	140 5年国債	0.1000	600,000	605,808	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	900,000	926,856	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	91,485	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	136,770	2024/06/20
	141 5年国債	0.1000	920,000	929,264	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	690,000	708,933	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	105,000	115,061	2024/09/20
	142 5年国債	0.1000	1,750,000	1,767,867	2024/12/20
	336 10年国債	0.5000	275,000	282,925	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	400,000	407,804	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	131,571	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	80,370	2024/12/20
	143 5年国債	0.1000	520,000	525,470	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	580,000	594,575	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	88,500	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	55,930	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	143,189	2025/03/20
	339 10年国債	0.4000	590,000	605,463	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	67,194	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	55,329	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	58,916	2025/06/20
	340 10年国債	0.4000	760,000	781,135	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	76,000	84,533	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	97,229	2025/09/20
	341 10年国債	0.3000	1,500,000	1,535,370	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	104,455	2025/12/20
	342 10年国債	0.1000	1,080,000	1,094,094	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	65,485	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	91,252	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	62,417	2026/03/20
	343 10年国債	0.1000	920,000	932,530	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	114,652	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	88,955	2026/06/20
	344 10年国債	0.1000	820,000	831,644	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	20,000	22,928	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	60,000	69,162	2026/09/20
	345 10年国債	0.1000	850,000	862,265	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	310,000	355,052	2026/12/20
	346 10年国債	0.1000	700,000	710,493	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	114,407	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	149,614	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	950,000	964,772	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	58,534	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	55,000	63,610	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	550,000	558,657	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	46,764	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	320,000	371,776	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	1,050,000	1,066,695	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	100,000	116,696	2027/12/20

日本債券インデックスマザーファンド

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	350 10年国債	0.1000	430,000	436,720	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	155,000	182,803	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	350,000	418,257	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	93,983	2028/04/20
	351 10年国債	0.1000	800,000	812,264	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	170,000	202,702	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	10,000	11,762	2028/06/20
	11 フィリピン共和国	0.9900	100,000	99,909	2028/08/15
	352 10年国債	0.1000	690,000	700,329	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	148,785	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	178,372	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	750,000	760,590	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	90,000	106,632	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	462,000	539,472	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	600,000	607,914	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	55,000	64,406	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	260,000	309,041	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	760,000	769,272	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	200,000	240,406	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	150,000	178,948	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	510,000	515,676	2029/09/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	20,168	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	310,000	370,989	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	1,000,000	1,010,470	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	70,000	84,063	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	217,875	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	29,591	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	590,000	595,752	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	200,000	242,938	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	900,000	1,084,437	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	36,830	2030/05/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	113,905	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	109,647	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	280,000	324,522	2030/06/20
	121 20年国債	1.9000	200,000	238,386	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	160,000	189,072	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	46,742	2030/11/20
	123 20年国債	2.1000	200,000	243,256	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	300,000	361,743	2030/12/20
	125 20年国債	2.2000	130,000	159,994	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	133,025	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	165,000	197,770	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	34,522	2031/05/20
	128 20年国債	1.9000	150,000	180,190	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	230,000	273,775	2031/06/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	167,064	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	177,322	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	30,323	2031/11/20
	133 20年国債	1.8000	430,000	514,366	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	650,000	779,330	2032/03/20

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	135 20年国債	1.7000	92,000	109,234	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	145,000	170,476	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	69,301	2032/05/20
	138 20年国債	1.5000	100,000	116,615	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	370,000	435,867	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	400,000	476,952	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	32,557	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	49,754	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	200,000	238,954	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	240,000	289,701	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	50,446	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	248,742	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	200,000	234,388	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	47,973	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	380,000	455,745	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	75,263	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	280,000	336,436	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	93,313	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	700,000	833,315	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	106,727	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	500,000	589,405	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	50,000	65,943	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	402,000	474,516	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	250,000	330,652	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	200,000	233,604	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	130,000	170,574	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	400,000	456,408	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	104,084	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	500,000	570,860	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	74,390	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	400,000	463,108	2035/06/20
	154 20年国債	1.2000	500,000	571,935	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	78,720	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	400,000	445,796	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	170,000	228,859	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	200,000	204,392	2036/03/20
	157 20年国債	0.2000	400,000	396,004	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	124,543	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	400,000	414,332	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	198,919	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	280,000	294,372	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	180,000	242,247	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	260,000	277,479	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	600,000	630,150	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	205,342	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	350,000	367,230	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	290,000	304,221	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	170,000	234,044	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	600,000	618,666	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	270,000	278,275	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	273,430	2038/09/20

日本債券インデックスマザーファンド

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	166 20年国債	0.7000	600,000	639,336	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	300,000	308,628	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	298,139	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	370,000	373,914	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	300,000	297,591	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	300,000	403,431	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	140,000	138,735	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	300,000	296,988	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	285,000	390,230	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	115,000	115,847	2040/03/20
	33 30年国債	2.0000	311,000	410,031	2040/09/20
	34 30年国債	2.2000	270,000	368,091	2041/03/20
	35 30年国債	2.0000	300,000	398,748	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	350,000	467,236	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	400,000	527,504	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	200,000	260,308	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	192,000	254,563	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	200,000	260,978	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	170,000	218,433	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	176,000	226,378	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	200,000	257,804	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	200,000	258,072	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	200,000	249,110	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	140,000	174,496	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	400,000	508,556	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	290,000	355,313	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	120,000	147,098	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	400,000	432,316	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	240,000	230,008	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	300,000	302,103	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	250,000	257,660	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	365,000	394,565	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	260,000	280,898	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	300,000	324,315	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	230,000	248,489	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	104,586	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	370,000	399,489	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	300,000	316,296	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	210,000	232,528	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	210,770	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	160,035	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	200,000	200,000	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	230,000	223,606	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	330,000	320,347	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	100,000	97,053	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	220,045	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	320,000	310,502	2050/03/20
	4 40年国債	2.2000	107,000	158,448	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	125,000	179,336	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	148,678	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	165,083	2054/03/20

2020年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	8 40年国債	1.4000 %	230,000 千円	293,907 千円	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	211,083	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	275,000	309,155	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	349,936	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	620,000	614,017	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	230,000	227,359	2060/03/20
種別小計	銘柄数 金 額	257銘柄			
			81,073,000	87,708,826	
地方債証券	699 東京都公債	1.0200	100,000	101,264	2021/09/17
	23-2 島根県公債	1.0300	100,000	101,471	2021/11/25
	108 共同発行地方	1.0100	100,000	101,760	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0.9900	100,000	101,812	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	101,634	2022/06/20
	361 大阪府公債	0.9200	100,000	101,824	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0.8400	100,000	101,787	2022/08/31
	713 東京都公債	0.7700	100,000	101,687	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0.8200	100,000	101,795	2022/09/20
	24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	101,806	2022/10/21
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	101,737	2022/12/22
	24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	101,757	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	101,907	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	101,205	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	102,525	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	204,515	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	102,330	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	102,136	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	101,886	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	204,815	2025/04/16
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	108,740	2025/11/21
	751 東京都公債	0.3700	100,000	101,719	2025/12/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,880	2026/06/19
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,599	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,802	2027/03/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	200,782	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,740	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	101,057	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	117,897	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	116,057	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	119,186	2029/06/20
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	118,732	2029/12/14
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	118,607	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	116,565	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	116,867	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	109,643	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	133,187	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	118,120	2045/12/20
種別小計	銘柄数 金 額	38銘柄			
			4,100,000	4,340,851	

日本債券インデックスマザーファンド

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千円	千円		
特殊債券 (除く金融債券)	29 地方公共団体	1.0250	100,000	101,369	2021/10/28	
	81 道路機構	1.0300	100,000	101,535	2021/12/20	
	33 地方公共団体	1.0350	100,000	101,711	2022/02/28	
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	101,853	2022/05/10	
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	101,780	2022/07/29	
	39政保地方公共団	0.8010	100,000	101,740	2022/08/15	
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	101,866	2022/09/30	
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	101,856	2022/10/31	
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	102,158	2023/02/24	
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	101,790	2023/03/15	
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	101,800	2023/03/17	
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	102,227	2023/05/26	
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	101,706	2023/05/31	
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	102,505	2023/08/28	
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	102,082	2024/10/28	
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,406	2025/01/31	
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	101,912	2025/04/28	
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	203,800	2025/11/28	
	127 都市再生	0.0750	100,000	99,825	2026/09/18	
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	108,869	2027/08/25	
	1 地方公共団15年	1.3340	100,000	109,251	2028/01/28	
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	117,434	2029/07/31	
	47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	108,254	2029/09/20	
	31 地方公共団20	1.7440	100,000	118,573	2033/09/28	
	223 政保道路機構	1.4270	100,000	116,075	2034/07/31	
	284 政保道路機構	0.1490	200,000	194,225	2036/07/31	
	298 政保道路機構	0.5470	100,000	103,228	2036/12/26	
	247 道路機構	0.3420	200,000	195,796	2040/03/19	
	種別小計	銘柄数 金額	28銘柄	3,100,000	3,206,637	
	金融債券	19 利付商工債	0.1000	100,000	99,696	2026/09/18
種別小計	銘柄数 金額	1銘柄	100,000	99,696		
普通社債券	11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	100,868	2022/06/20	
	11三菱UFJ信託BK	1.3600	100,000	102,370	2022/06/27	
	372 中国電力	1.2040	100,000	102,366	2022/08/25	
	4 JXホールディングス	1.1450	100,000	102,385	2022/12/14	
	30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	101,657	2022/12/14	
	175 オリックス	1.0640	100,000	102,816	2023/11/24	
	21 西日本高速道	0.7540	100,000	102,484	2023/12/20	
	1 三菱UFJFG 劣後	0.9400	100,000	101,119	2024/06/26	
	482 九州電力	0.1700	100,000	99,482	2024/08/23	
	5 野村不動産HD	0.9240	100,000	102,570	2025/05/30	
	11日本たばこ産業	0.5990	100,000	102,252	2025/07/15	
	63 中日本高速道	0.5760	100,000	102,524	2025/11/13	
	4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	102,428	2025/12/18	
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,944	2026/08/21	

2020年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	17 パナソニック	0.4700 %	100,000 千円	100,704 千円	2026/09/18
	509 関西電力	0.4700	100,000	100,144	2027/05/25
	12 アサヒグループHD	0.3300	100,000	100,003	2027/06/11
	15 デンソー	0.2450	100,000	99,758	2027/06/18
	78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	99,900	2027/07/23
	11 東京電力パワー	0.7900	100,000	99,770	2028/01/25
	41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	116,239	2029/01/29
	13 NTT ファイナンス	1.0900	100,000	105,805	2029/09/20
	7 凸版印刷	1.1040	100,000	106,224	2029/12/12
	332 北海道電力	0.9070	100,000	102,196	2036/04/25
	23 森ビル	0.9700	100,000	99,591	2038/05/17
	107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	116,000	2045/01/27
種別小計	銘柄数	26銘柄			
	金額		2,600,000	2,671,610	
合 計	銘柄数	350銘柄			
	金額		90,973,000	98,027,620	

(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20期 (決算日 2019年12月2日)

(作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2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

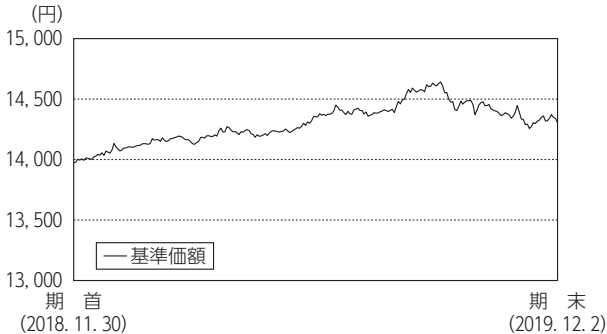
大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：13,974円 期末：14,303円 騰落率：2.4%

【基準価額の主な変動要因】

金利の低下（債券価格が上昇）および債券の利息収入がいずれもプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内債券市場

国内債券市場では、当作成期を通してみると長期金利は低下しました。

当作成期首より、世界的な株安により市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、長期金利は低下しました。また、米国を中心とした世界的な景気悪化懸念や米国の利上げ停止観測の高まりも、金利の低下要因となりました。その後も、米国で利下げ観測が高まったことや米中貿易摩擦への懸念によるリスク回避姿勢などを受けて、長期金利はさらに低下しました。2019年9月に入ると、米中通商交渉などへの懸念が和らいだことなどから金利は上昇しました。当作成期末にかけても、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待が高まる中で、長期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」

今後も、ベンチマーク（ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数）との高い連動性を維持するように運用を行います。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流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の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

◆ベンチマークとの差異について

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

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差は0.01%程度で、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。金利や信用スプレッドの変動に対する感応度を適切にコントロールしたことから、目立った超過損益は発生しませんでした。

《今後の運用方針》

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

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
	円	騰落率 %	総合指数	騰落率 %		
(期首) 2018年11月30日	13,974	—	523.683	—	99.6	—
12月末	14,078	0.7	527.623	0.8	99.6	—
2019年1月末	14,134	1.1	529.658	1.1	99.5	—
2月末	14,163	1.4	530.781	1.4	99.5	—
3月末	14,264	2.1	534.623	2.1	99.5	—
4月末	14,218	1.7	532.961	1.8	99.6	—
5月末	14,310	2.4	536.316	2.4	99.3	—
6月末	14,398	3.0	539.597	3.0	99.2	—
7月末	14,415	3.2	540.217	3.2	99.4	—
8月末	14,617	4.6	547.729	4.6	99.5	—
9月末	14,456	3.4	541.725	3.4	99.6	—
10月末	14,390	3.0	539.302	3.0	99.6	—
11月末	14,340	2.6	537.478	2.6	99.1	—
(期末) 2019年12月2日	14,303	2.4	536.068	2.4	99.6	—

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注5) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

日本債券インデックスマザーファンド

■1万口当りの費用の明細

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

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	31,899,723	(28,250,264 —)
	地方債証券	556,957	(607,484 —)
	特殊債券	106,387	(404,282 —)
	社債券	305,424	(711,033 —)

(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

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	千円	銘 柄	千円
138 5年国債 0.1% 2023/12/20	1,829,518	124 5年国債 0.1% 2020/6/20	1,343,825
127 5年国債 0.1% 2021/3/20	1,106,169	130 5年国債 0.1% 2021/12/20	1,310,504
140 5年国債 0.1% 2024/6/20	1,020,813	138 5年国債 0.1% 2023/12/20	1,219,380
130 5年国債 0.1% 2021/12/20	1,008,762	125 5年国債 0.1% 2020/9/20	943,600
355 10年国債 0.1% 2029/6/20	783,145	126 5年国債 0.1% 2020/12/20	892,662
345 10年国債 0.1% 2026/12/20	739,269	134 5年国債 0.1% 2022/12/20	860,472
332 10年国債 0.6% 2023/12/20	735,894	345 10年国債 0.1% 2026/12/20	818,945
139 5年国債 0.1% 2024/3/20	710,096	332 10年国債 0.6% 2023/12/20	798,058
353 10年国債 0.1% 2028/12/20	709,640	123 5年国債 0.1% 2020/3/20	782,195
406 2年国債 0.1% 2021/11/1	703,822	339 10年国債 0.4% 2025/6/20	726,611

(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 区分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちB B 格 以下組入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	65,466,000	71,946,332	87.2	—	58.3	20.2	8.7
地方債証券	4,000,000	4,253,511	5.2	—	2.8	2.1	0.2
特殊債券（除く金融債券）	2,800,000	2,921,624	3.5	—	1.6	1.7	0.2
金融債券	100,000	99,005	0.1	—	0.1	—	—
普通社債券	2,800,000	2,898,205	3.5	—	2.1	1.0	0.4
合 計	75,166,000	82,118,679	99.6	—	64.9	25.1	9.6

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

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

区 分	当 期		年 利 率	末		償還年月日
	銘 柄	額 面 金 額		評 価 額	額 面 金 額	
		千円	%	千円	千円	
国債証券	398 2年国債	250,000	0.1000	250,822	250,822	2021/03/01
	127 5年国債	1,580,000	0.1000	1,585,308	1,585,308	2021/03/20
	313 10年国債	200,000	1.3000	203,756	203,756	2021/03/20
	314 10年国債	260,000	1.1000	264,209	264,209	2021/03/20
	49 20年国債	64,000	2.1000	65,882	65,882	2021/03/22
	50 20年国債	107,000	1.9000	109,867	109,867	2021/03/22
	399 2年国債	100,000	0.1000	100,358	100,358	2021/04/01
	400 2年国債	200,000	0.1000	200,762	200,762	2021/05/01
	128 5年国債	1,000,000	0.1000	1,004,180	1,004,180	2021/06/20
	315 10年国債	221,000	1.2000	225,671	225,671	2021/06/20
	316 10年国債	250,000	1.1000	254,897	254,897	2021/06/20
	51 20年国債	82,000	2.0000	84,754	84,754	2021/06/21
	402 2年国債	150,000	0.1000	150,651	150,651	2021/07/01
	129 5年国債	1,340,000	0.1000	1,346,633	1,346,633	2021/09/20
	317 10年国債	214,000	1.1000	218,879	218,879	2021/09/20
	318 10年国債	200,000	1.0000	204,200	204,200	2021/09/20
	52 20年国債	52,000	2.1000	54,126	54,126	2021/09/21
	405 2年国債	150,000	0.1000	150,756	150,756	2021/10/01
	406 2年国債	700,000	0.1000	703,689	703,689	2021/11/01
	130 5年国債	580,000	0.1000	583,271	583,271	2021/12/20
	319 10年国債	100,000	1.1000	102,597	102,597	2021/12/20
	320 10年国債	230,000	1.0000	235,501	235,501	2021/12/20
	53 20年国債	66,000	2.1000	69,076	69,076	2021/12/20
	54 20年国債	65,000	2.2000	68,163	68,163	2021/12/20
	131 5年国債	1,170,000	0.1000	1,177,534	1,177,534	2022/03/20
	321 10年国債	175,000	1.0000	179,712	179,712	2022/03/20
	322 10年国債	130,000	0.9000	133,201	133,201	2022/03/20
	55 20年国債	140,000	2.0000	147,018	147,018	2022/03/21
	132 5年国債	880,000	0.1000	886,292	886,292	2022/06/20
	323 10年国債	380,000	0.9000	390,393	390,393	2022/06/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
	133 5年国債		0.1000	430,000	433,689	2022/09/20
	325 10年国債		0.8000	310,000	318,494	2022/09/20
	58 20年国債		1.9000	200,000	211,664	2022/09/20
	134 5年国債		0.1000	350,000	353,164	2022/12/20
	326 10年国債		0.7000	30,000	30,808	2022/12/20
	327 10年国債		0.8000	450,000	463,509	2022/12/20
	59 20年国債		1.7000	45,000	47,591	2022/12/20
	60 20年国債		1.4000	10,000	10,484	2022/12/20
	135 5年国債		0.1000	880,000	888,456	2023/03/20
	328 10年国債		0.6000	350,000	359,040	2023/03/20
	61 20年国債		1.0000	100,000	103,909	2023/03/20
	136 5年国債		0.1000	700,000	707,245	2023/06/20
	329 10年国債		0.8000	500,000	517,480	2023/06/20
	62 20年国債		0.8000	95,000	98,321	2023/06/20
	63 20年国債		1.8000	130,000	139,158	2023/06/20
	137 5年国債		0.1000	700,000	707,357	2023/09/20
	330 10年国債		0.8000	612,000	634,809	2023/09/20
	331 10年国債		0.6000	365,000	375,811	2023/09/20
	64 20年国債		1.9000	90,000	97,119	2023/09/20
	138 5年国債		0.1000	600,000	606,600	2023/12/20
	332 10年国債		0.6000	250,000	257,895	2023/12/20
	65 20年国債		1.9000	175,000	189,759	2023/12/20
	66 20年国債		1.8000	185,000	199,848	2023/12/20
	139 5年国債		0.1000	700,000	708,169	2024/03/20
	333 10年国債		0.6000	600,000	620,112	2024/03/20
	67 20年国債		1.9000	55,000	59,923	2024/03/20
	68 20年国債		2.2000	120,000	132,298	2024/03/20
	69 20年国債		2.1000	110,000	120,798	2024/03/20
	140 5年国債		0.1000	600,000	607,140	2024/06/20
	334 10年国債		0.6000	900,000	931,527	2024/06/20
	70 20年国債		2.4000	83,000	92,727	2024/06/20
	71 20年国債		2.2000	125,000	138,506	2024/06/20
	141 5年国債		0.1000	650,000	658,164	2024/09/20
	335 10年国債		0.5000	690,000	712,183	2024/09/20
	72 20年国債		2.1000	175,000	194,118	2024/09/20
	336 10年国債		0.5000	275,000	284,377	2024/12/20
	337 10年国債		0.3000	300,000	307,176	2024/12/20
	73 20年国債		2.0000	120,000	133,220	2024/12/20
	74 20年国債		2.1000	73,000	81,413	2024/12/20
	338 10年国債		0.4000	580,000	597,492	2025/03/20
	75 20年国債		2.1000	80,000	89,651	2025/03/20
	76 20年国債		1.9000	51,000	56,608	2025/03/20
	77 20年国債		2.0000	130,000	144,989	2025/03/20
	339 10年国債		0.4000	590,000	608,649	2025/06/20
	78 20年国債		1.9000	61,000	68,030	2025/06/20
	79 20年国債		2.0000	50,000	56,042	2025/06/20
	80 20年国債		2.1000	53,000	59,701	2025/06/20
	340 10年国債		0.4000	700,000	723,149	2025/09/20
	81 20年国債		2.0000	76,000	85,605	2025/09/20
	82 20年国債		2.1000	87,000	98,504	2025/09/20

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
			%	千円	千円	
	341 10年国債		0.3000	440,000	452,491	2025/12/20
	83 20年国債		2.1000	93,000	105,800	2025/12/20
	342 10年国債		0.1000	1,000,000	1,016,850	2026/03/20
	85 20年国債		2.1000	58,000	66,311	2026/03/20
	86 20年国債		2.3000	80,000	92,480	2026/03/20
	87 20年国債		2.2000	55,000	63,231	2026/03/20
	343 10年国債		0.1000	700,000	712,271	2026/06/20
	88 20年国債		2.3000	100,000	116,233	2026/06/20
	89 20年国債		2.2000	78,000	90,145	2026/06/20
	344 10年国債		0.1000	700,000	712,502	2026/09/20
	90 20年国債		2.2000	20,000	23,227	2026/09/20
	91 20年国債		2.3000	60,000	70,094	2026/09/20
	345 10年国債		0.1000	650,000	662,044	2026/12/20
	92 20年国債		2.1000	310,000	359,674	2026/12/20
	346 10年国債		0.1000	700,000	713,426	2027/03/20
	93 20年国債		2.0000	100,000	115,853	2027/03/20
	94 20年国債		2.1000	130,000	151,568	2027/03/20
	347 10年国債		0.1000	500,000	509,730	2027/06/20
	95 20年国債		2.3000	50,000	59,326	2027/06/20
	96 20年国債		2.1000	55,000	64,419	2027/06/20
	348 10年国債		0.1000	600,000	611,832	2027/09/20
	97 20年国債		2.2000	40,000	47,378	2027/09/20
	98 20年国債		2.1000	320,000	376,505	2027/09/20
	349 10年国債		0.1000	1,050,000	1,070,937	2027/12/20
	99 20年国債		2.1000	100,000	118,181	2027/12/20
	350 10年国債		0.1000	270,000	275,319	2028/03/20
	100 20年国債		2.2000	155,000	185,198	2028/03/20
	101 20年国債		2.4000	350,000	424,056	2028/03/20
	27 メキシコ国債		1.0500	100,000	99,011	2028/04/20
	351 10年国債		0.1000	800,000	815,192	2028/06/20
	103 20年国債		2.3000	170,000	205,341	2028/06/20
	104 20年国債		2.1000	10,000	11,906	2028/06/20
	11 フィリピン共和国		0.9900	100,000	103,251	2028/08/15
	352 10年国債		0.1000	690,000	702,558	2028/09/20
	105 20年国債		2.1000	126,000	150,668	2028/09/20
	106 20年国債		2.2000	150,000	180,699	2028/09/20
	353 10年国債		0.1000	250,000	254,447	2028/12/20
	107 20年国債		2.1000	90,000	107,976	2028/12/20
	108 20年国債		1.9000	477,000	563,575	2028/12/20
	354 10年国債		0.1000	600,000	610,110	2029/03/20
	109 20年国債		1.9000	55,000	65,165	2029/03/20
	110 20年国債		2.1000	260,000	312,920	2029/03/20
	355 10年国債		0.1000	460,000	467,286	2029/06/20
	111 20年国債		2.2000	200,000	243,392	2029/06/20
	112 20年国債		2.1000	150,000	181,104	2029/06/20
	356 10年国債		0.1000	420,000	426,199	2029/09/20
	1 30年国債		2.8000	16,000	20,479	2029/09/20
	113 20年国債		2.1000	310,000	375,617	2029/09/20
	114 20年国債		2.1000	70,000	85,067	2029/12/20
	115 20年国債		2.2000	180,000	220,559	2029/12/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当 銘 柄	期		末		償還年月日
		年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	評 価 額	
	2 30年国債	2.4000	24,000	29,961		2030/02/20
	116 20年国債	2.2000	140,000	172,145		2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	215,000	262,147		2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	37,275		2030/05/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	115,217		2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	110,827		2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	280,000	327,759		2030/06/20
	121 20年国債	1.9000	170,000	204,984		2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	160,000	191,198		2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	47,420		2030/11/20
	123 20年国債	2.1000	200,000	246,258		2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	193,000	235,508		2030/12/20
	125 20年国債	2.2000	85,000	105,938		2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	134,615		2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	165,000	200,064		2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	34,979		2031/05/20
	128 20年国債	1.9000	119,000	144,684		2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	230,000	276,995		2031/06/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	169,129		2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	179,446		2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	30,762		2031/11/20
	133 20年国債	1.8000	370,000	448,070		2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	80,000	97,104		2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	110,546		2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	200,000	237,874		2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	70,324		2032/05/20
	138 20年国債	1.5000	100,000	118,003		2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	300,000	357,747		2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	300,000	362,250		2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	33,024		2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	50,393		2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	200,000	242,146		2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	240,000	293,678		2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	51,037		2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	251,983		2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	300,000	356,031		2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	48,650		2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	380,000	462,178		2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	76,383		2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	230,000	280,273		2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	94,738		2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	150,000	181,167		2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	108,499		2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	330,000	394,544		2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	100,000	134,119		2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	272,000	325,660		2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	250,000	336,507		2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	200,000	237,046		2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	130,000	173,678		2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	370,000	428,108		2034/12/20

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
			%	千円	千円	
	18 30年国債		2.3000	80,000	106,031	2035/03/20
	152 20年国債		1.2000	350,000	405,545	2035/03/20
	19 30年国債		2.3000	57,000	75,731	2035/06/20
	153 20年国債		1.3000	400,000	470,232	2035/06/20
	154 20年国債		1.2000	380,000	441,229	2035/09/20
	21 30年国債		2.3000	60,000	80,150	2035/12/20
	155 20年国債		1.0000	275,000	310,895	2035/12/20
	22 30年国債		2.5000	170,000	233,166	2036/03/20
	156 20年国債		0.4000	200,000	206,964	2036/03/20
	157 20年国債		0.2000	400,000	400,640	2036/06/20
	24 30年国債		2.5000	92,000	126,902	2036/09/20
	158 20年国債		0.5000	100,000	104,960	2036/09/20
	25 30年国債		2.3000	150,000	202,593	2036/12/20
	159 20年国債		0.6000	280,000	298,460	2036/12/20
	26 30年国債		2.4000	180,000	246,808	2037/03/20
	160 20年国債		0.7000	210,000	227,360	2037/03/20
	161 20年国債		0.6000	260,000	276,923	2037/06/20
	27 30年国債		2.5000	150,000	209,469	2037/09/20
	162 20年国債		0.6000	350,000	372,778	2037/09/20
	163 20年国債		0.6000	290,000	308,858	2037/12/20
	28 30年国債		2.5000	170,000	238,790	2038/03/20
	164 20年国債		0.5000	400,000	418,588	2038/03/20
	165 20年国債		0.5000	200,000	209,232	2038/06/20
	29 30年国債		2.4000	200,000	278,700	2038/09/20
	166 20年国債		0.7000	300,000	324,528	2038/09/20
	167 20年国債		0.5000	300,000	313,350	2038/12/20
	30 30年国債		2.3000	220,000	304,125	2039/03/20
	168 20年国債		0.4000	300,000	307,716	2039/03/20
	169 20年国債		0.3000	300,000	301,950	2039/06/20
	31 30年国債		2.2000	300,000	411,516	2039/09/20
	170 20年国債		0.3000	90,000	90,506	2039/09/20
	32 30年国債		2.3000	285,000	398,221	2040/03/20
	33 30年国債		2.0000	311,000	418,179	2040/09/20
	34 30年国債		2.2000	180,000	250,707	2041/03/20
	35 30年国債		2.0000	195,000	264,718	2041/09/20
	36 30年国債		2.0000	350,000	477,319	2042/03/20
	37 30年国債		1.9000	300,000	404,580	2042/09/20
	38 30年国債		1.8000	190,000	252,874	2043/03/20
	39 30年国債		1.9000	192,000	260,417	2043/06/20
	40 30年国債		1.8000	200,000	267,228	2043/09/20
	41 30年国債		1.7000	170,000	223,629	2043/12/20
	42 30年国債		1.7000	176,000	231,792	2044/03/20
	43 30年国債		1.7000	200,000	263,710	2044/06/20
	44 30年国債		1.7000	230,000	303,616	2044/09/20
	45 30年国債		1.5000	200,000	255,018	2044/12/20
	46 30年国債		1.5000	140,000	178,655	2045/03/20
	47 30年国債		1.6000	210,000	273,474	2045/06/20
	48 30年国債		1.4000	290,000	363,767	2045/09/20
	49 30年国債		1.4000	100,000	125,663	2045/12/20
	50 30年国債		0.8000	215,000	238,007	2046/03/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当 期		末		償還年月日
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	
		%	千円	千円	
	51 30年国債	0.3000	240,000	235,368	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	300,000	309,129	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	250,000	263,812	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	218,000	241,236	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	200,000	221,220	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	300,000	331,677	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	230,000	254,483	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	107,356	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	320,000	353,881	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	200,000	215,924	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	180,000	204,030	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	215,612	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	164,067	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	200,000	204,706	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	230,000	228,790	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	100,000	99,338	2049/09/20
	3 40年国債	2.2000	74,000	111,342	2050/03/20
	4 40年国債	2.2000	107,000	162,371	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	125,000	184,040	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	152,618	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	169,458	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	301,596	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	216,568	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	275,000	317,047	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	358,339	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	200,000	202,662	2059/03/20
種別小計	銘柄数	256銘柄			
	金額		65,466,000	71,946,332	
地方債証券					
	699 東京都公債	1.0200	100,000	101,743	2021/09/17
	23-2 島根県公債	1.0300	100,000	101,940	2021/11/25
	108 共同発行地方	1.0100	100,000	102,210	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0.9900	100,000	102,243	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	102,003	2022/06/20
	361 大阪府公債	0.9200	100,000	102,229	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0.8400	100,000	102,160	2022/08/31
	713 東京都公債	0.7700	100,000	102,016	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0.8200	100,000	102,155	2022/09/20
	24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	102,149	2022/10/21
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	102,049	2022/12/22
	24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	102,080	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	102,246	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	101,413	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	102,935	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	205,212	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	102,625	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	102,356	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	102,101	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	205,308	2025/04/16

区 分	当 期		末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	751 東京都公債	0.3700	100,000	101,818	2025/12/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,812	2026/06/19
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,618	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,847	2027/03/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	200,895	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,721	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	101,147	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	119,074	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	116,982	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	120,402	2029/06/20
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	119,997	2029/12/14
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	119,584	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	117,730	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	118,079	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	110,833	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	135,281	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	120,503	2045/12/20
種別小計	銘柄数 金 額	37銘柄	4,000,000	4,253,511	
特殊債券 (除く金融債券)	3 公営企業15年	2.2000	100,000	103,245	2021/05/21
	29 地方公共団体	1.0250	100,000	101,878	2021/10/28
	81 道路機構	1.0300	100,000	102,012	2021/12/20
	33 地方公共団体	1.0350	100,000	102,212	2022/02/28
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	102,315	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	102,194	2022/07/29
	39政保地方公共団	0.8010	100,000	102,122	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	102,265	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	102,237	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	102,556	2023/02/24
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	102,115	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	102,125	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	102,682	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	102,053	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	102,995	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	102,357	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,481	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	102,164	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	204,111	2025/11/28
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	109,700	2027/08/25
	1 地方公共団15年	1.3340	100,000	110,161	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	118,467	2029/07/31
	31 地方公共団20	1.7440	100,000	119,825	2033/09/28
	223 政保道路機構	1.4270	100,000	117,581	2034/07/31
	284 政保道路機構	0.1490	200,000	196,229	2036/07/31
	298 政保道路機構	0.5470	100,000	104,530	2036/12/26
種別小計	銘柄数 金 額	26銘柄	2,800,000	2,921,624	

日本債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			末	
		銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
金融債券		19 利付商工債	0.1000 %	100,000 千円	99,005 千円	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄				
	金額			100,000	99,005	
普通社債券		44 野村ホールディング	0.7230	100,000	100,715	2021/02/25
		2 イオンFS	0.5720	100,000	100,554	2021/03/18
		9三菱UFJ信託BK劣	1.6800	100,000	102,173	2021/04/28
		11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,155	2022/06/20
		11三菱UFJ信託BK	1.3600	100,000	103,096	2022/06/27
		372 中国電力	1.2040	100,000	103,118	2022/08/25
		4 JXホールディングス	1.1450	100,000	103,108	2022/12/14
		30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	102,151	2022/12/14
		175 オリックス	1.0640	100,000	103,655	2023/11/24
		21 西日本高速道	0.7540	100,000	102,745	2023/12/20
		1 三菱UFJFG劣後	0.9400	100,000	102,377	2024/06/26
		5 野村不動産HD	0.9240	100,000	103,370	2025/05/30
		11日本たばこ産業	0.5990	100,000	102,415	2025/07/15
		63 中日本高速道	0.5760	100,000	102,778	2025/11/13
		4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	103,235	2025/12/18
		20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,811	2026/08/21
		17 パナソニック	0.4700	100,000	100,878	2026/09/18
		509 関西電力	0.4700	100,000	100,636	2027/05/25
		12 アサヒグループHD	0.3300	100,000	100,305	2027/06/11
		15 デンソー	0.2450	100,000	100,246	2027/06/18
		78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	100,404	2027/07/23
		11 東京電力パワー	0.7900	100,000	100,337	2028/01/25
		41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	117,722	2029/01/29
		18 エヌティティ都市開	1.0900	100,000	106,548	2029/09/20
		7 凸版印刷	1.1040	100,000	107,356	2029/12/12
		332 北海道電力	0.9070	100,000	104,473	2036/04/25
		23 森ビル	0.9700	100,000	101,800	2038/05/17
		107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	121,036	2045/01/27
種別小計	銘柄数	28銘柄				
	金額			2,800,000	2,898,205	
合 計	銘柄数	348銘柄				
	金額			75,166,000	82,118,679	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	82,118,679	97.2
コール・ローン等、その他	2,340,049	2.8
投資信託財産総額	84,458,729	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

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	84,458,729,704円
コール・ローン等	277,498,394
公社債(評価額)	82,118,679,960
未収入金	1,861,375,540
未収利息	188,754,567
前払費用	12,421,243
(B) 負債	1,970,494,415
未払金	1,951,218,000
未払解約金	19,276,281
その他未払費用	134
(C) 純資産総額 (A - B)	82,488,235,289
元本	57,670,399,195
次期繰越損益金	24,817,836,094
(D) 受益権総口数	57,670,399,195口
1万口当り基準価額 (C / D)	14,303円

* 期首における元本額は56,170,487,793円、当作成期間中における追加設定元本額は19,864,910,379円、同解約元本額は18,364,998,977円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)109,396,910円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)596,838,676円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)82,263,337円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)882,267,553円、DCダイワ日本債券インデックス7,293,354,645円、ダイワ・バランスファンド35VA11,302,866,367円、ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)1,855,649,526円、ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)265,692,526円、ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)369,416,535円、ダイワ・ノーロード日本債券ファンド81,822,975円、ダイワファンドラップ日本債券インデックス21,258,481,478円、ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)3,005,941,387円、ダイワファンドラップオンライン日本債券インデックス1,491,311,778円、ダイワ・インデックスセレクト日本債券1,129,962,205円、ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス6,866,925,426円、ダイワライフスタイル25450,390,874円、ダイワライフスタイル50491,002,347円、ダイワライフスタイル75136,814,650円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,303円です。

■損益の状況

当期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	668,724,518円
受取利息	669,001,286
支払利息	△ 276,768
(B) 有価証券売買損益	1,086,219,610
売買益	1,551,391,130
売買損	△ 465,171,520
(C) その他費用	△ 11,078
(D) 当期損益金 (A + B + C)	1,754,933,050
(E) 前期繰越損益金	22,319,404,672
(F) 解約差損益金	7,944,362,524
(G) 追加信託差損益金	8,687,860,896
(H) 合計 (D + E + F + G)	24,817,836,094
次期繰越損益金 (H)	24,817,836,094

(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4期

(決算日 2020年6月15日)

(作成対象期間 2019年6月18日～2020年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6月15日)	10,212	0	2.1	10,230	2.3	93.8	4.0	20
2 期末 (2018年 6月15日)	9,966	0	△ 2.4	10,037	△ 1.9	95.4	2.1	1,398
3 期末 (2019年 6月17日)	10,418	0	4.5	10,544	5.1	97.3	1.4	12,750
4 期末 (2020年 6月15日)	10,992	0	5.5	11,190	6.1	97.5	—	22,300

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

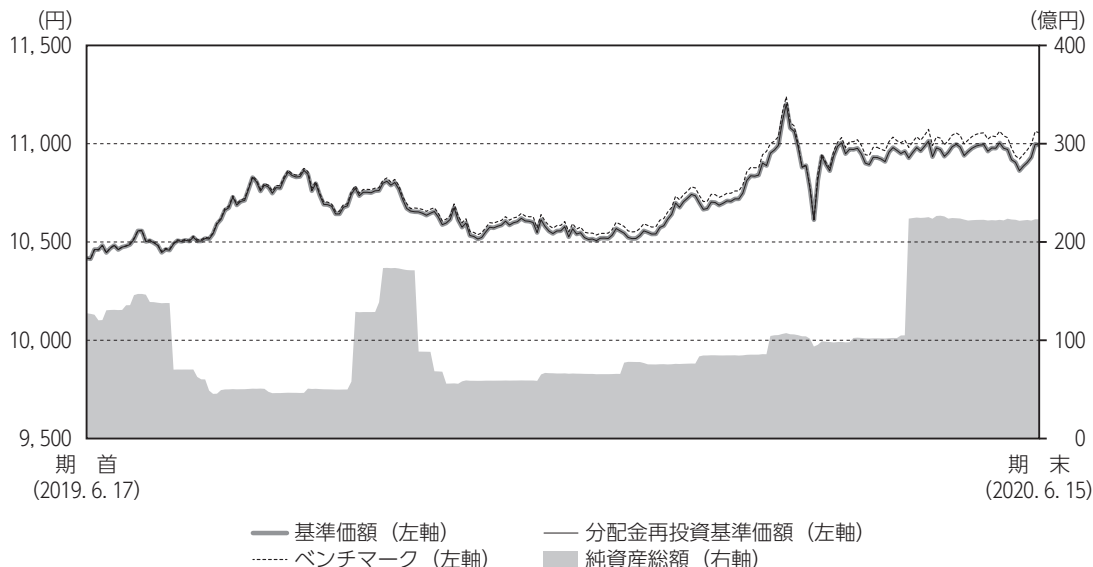
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注7) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：10,418円

期末：10,992円（分配金0円）

騰落率：5.5%（分配金込み）

■ 基準価額の変動要因

日本を除く先進国国債に投資した結果、利息収入を得たことや各国の金利が低下（債券価格は上昇）したため、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

年 月 日	基 準 価 額		FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2019年 6月17日	円	%		%	%	%
	10,418	—	10,544	—	97.3	1.4
6月末	10,474	0.5	10,600	0.5	97.2	0.7
7月末	10,515	0.9	10,648	1.0	97.2	—
8月末	10,838	4.0	10,979	4.1	95.1	1.2
9月末	10,753	3.2	10,898	3.4	97.1	1.0
10月末	10,615	1.9	10,764	2.1	99.2	—
11月末	10,605	1.8	10,757	2.0	96.1	1.6
12月末	10,535	1.1	10,691	1.4	97.0	2.0
2020年 1月末	10,723	2.9	10,889	3.3	96.6	1.1
2月末	10,840	4.1	11,010	4.4	97.0	1.5
3月末	11,005	5.6	11,165	5.9	97.7	—
4月末	10,987	5.5	11,177	6.0	91.1	3.2
5月末	10,977	5.4	11,170	5.9	97.8	—
(期末)2020年 6月15日	10,992	5.5	11,190	6.1	97.5	—

(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

（2019. 6. 18 ～ 2020. 6. 15）

■海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると低下しました。

当作成期首より、世界的な景気悪化懸念などが金利の低下要因となりました。その後も、米国で利下げ観測が高まったことや、米中貿易摩擦への懸念によるリスク回避姿勢などを受けて、金利はさらに低下しました。2019年9月以降は、米中通商交渉などへの懸念が和らいだことなどから金利は上昇しました。しかし2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済の減速懸念の高まりから、金利は米国を中心に大きく低下しました。その後は、おおむねレンジ内での推移となりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

外貨建資産については為替ヘッジを行い、またファンドとベンチマーク（FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース））の金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

ポートフォリオについて

（2019. 6. 18 ～ 2020. 6. 15）

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

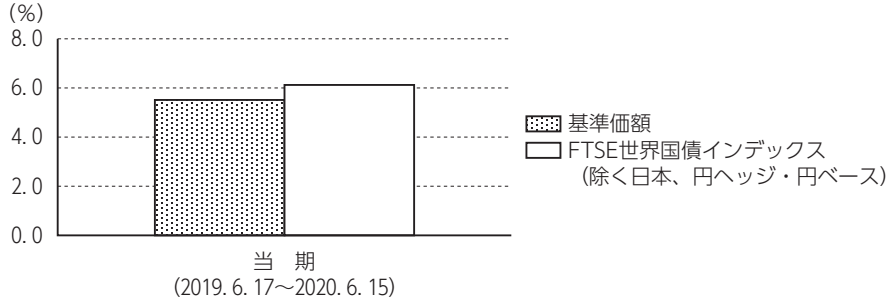
外貨建資産については為替ヘッジを行い、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

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（FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース））の騰落率は6.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は5.5%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0.3%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。



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（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2019年 6月18日 ～2020年 6月15日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	991

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2019. 6. 18～2020. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	44円	0. 413%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10, 724円です。
（投 信 会 社）	(30)	(0. 283)	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. 109)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(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. 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
（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	2	0. 020	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. 011)	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	47	0. 434	

(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。

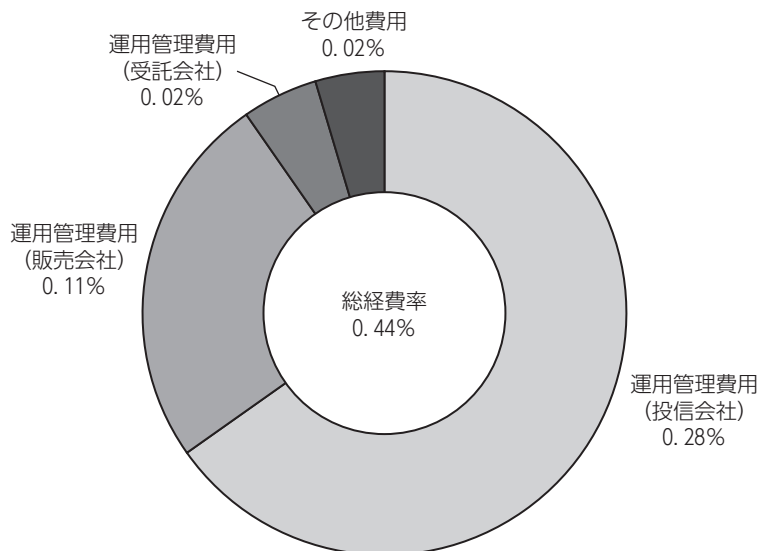
(注 3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

（2019年6月18日から2020年6月15日まで）

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス （為替ヘッジあり） マザーファンド	32,800,220	34,138,510	24,522,387	24,982,148

（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	12,717,767	20,995,600	22,280,531

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス （為替ヘッジあり）マザーファンド	22,280,531	99.8
コール・ローン等、その他	46,445	0.2
投資信託財産総額	22,326,976	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。

（注2）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.24円、1カナダ・ドル=78.66円、1オーストラリア・ドル=73.06円、1シンガポール・ドル=76.86円、1イギリス・ポンド=134.14円、1イスラエル・シケル=30.85円、1デンマーク・クローネ=16.19円、1ノルウェー・クローネ=11.07円、1スウェーデン・クローネ=11.48円、1メキシコ・ペソ=4.76円、1マレーシア・リンギット=25.05円、1南アフリカ・ランド=6.24円、1ポーランド・ズロチ=27.11円、1ユーロ=120.68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（112,698,626千円）の投資信託財産総額（114,217,362千円）に対する比率は、98.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	22,326,976,774円
コール・ローン等	46,445,254
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）	22,280,531,520
(B) 負債	26,649,077
未払信託報酬	26,133,272
その他未払費用	515,805
(C) 純資産総額（A－B）	22,300,327,697
元本	20,288,495,945
次期繰越損益金	2,011,831,752
(D) 受益権総口数	20,288,495,945口
1万口当り基準価額（C/D）	10,992円

* 期首における元本額は12,238,138,887円、当作成期間中における追加設定元本額は31,728,087,266円、同解約元本額は23,677,730,208円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,992円です。

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

■損益の状況

当期 自 2019年6月18日 至 2020年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 6,021円
受取利息	2,941
支払利息	△ 8,962
(B) 有価証券売買損益	336,155,154
売買益	422,283,808
売買損	△ 86,128,654
(C) 信託報酬等	△ 44,212,204
(D) 当期損益金 (A + B + C)	291,936,929
(E) 前期繰越損益金	29,342,908
(F) 追加信託差損益金	1,690,551,915
(配当等相当額)	(1,225,422,554)
(売買損益相当額)	(465,129,361)
(G) 合計 (D + E + F)	2,011,831,752
次期繰越損益金 (G)	2,011,831,752
追加信託差損益金	1,690,551,915
(配当等相当額)	(1,225,422,554)
(売買損益相当額)	(465,129,361)
分配準備積立金	321,279,837

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	199,240,253円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	92,696,676
(c) 収益調整金	1,690,551,915
(d) 分配準備積立金	29,342,908
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,011,831,752
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,011,831,752
(h) 受益権総口数	20,288,495,945口

《お知らせ》

■商号変更について

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

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4期（決算日 2020年6月15日）

（作成対象期間 2019年6月18日～2020年6月15日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

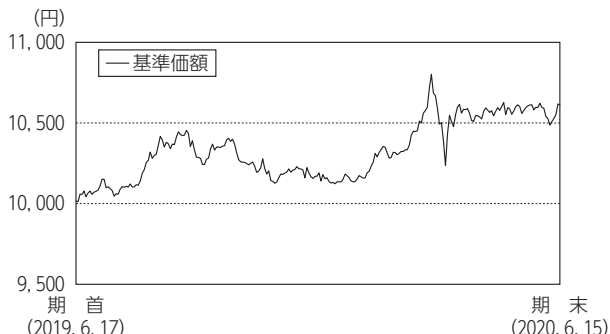
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,016円 期末：10,612円 騰落率：6.0%

【基準価額の主な変動要因】

日本を除く先進国国債に投資した結果、利息収入を得たことや各国の金利が低下（債券価格は上昇）したため、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通してみると低下しました。

当作成期首より、世界的な景気悪化懸念などが金利の低下要因となりました。その後も、米国で利下げ観測が高まったことや米中貿易摩擦への懸念によるリスク回避姿勢などを受けて、金利はさらに低下しました。2019年9月以降は、米中通商交渉などへの懸念が和らいだことなどから、金利は上昇しました。しかし2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済の減速懸念の高まりから、金利は米国を中心に大きく低下しました。その後は、おおむねレンジ内での推移となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は6.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は6.0%となりました。当作成期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.3%程度でした。

《今後の運用方針》

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

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）		公社債組入率	債券先物比率
	円	%	円	%		
(期首)2019年6月17日	10,016	—	10,050	—	97.4	1.4
6月末	10,071	0.5	10,104	0.5	97.3	0.7
7月末	10,114	1.0	10,149	1.0	97.2	—
8月末	10,428	4.1	10,465	4.1	95.1	1.2
9月末	10,350	3.3	10,388	3.4	97.2	1.0
10月末	10,221	2.0	10,259	2.1	99.4	—
11月末	10,215	2.0	10,253	2.0	96.2	1.6
12月末	10,151	1.3	10,190	1.4	97.1	2.0
2020年1月末	10,336	3.2	10,378	3.3	96.6	1.1
2月末	10,452	4.4	10,494	4.4	97.1	1.5
3月末	10,615	6.0	10,642	5.9	97.8	—
4月末	10,602	5.9	10,653	6.0	91.1	3.2
5月末	10,596	5.8	10,646	5.9	97.9	—
(期末)2020年6月15日	10,612	6.0	10,666	6.1	97.6	—

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

(注5) 公社債組入率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

■1万口当りの費用の明細

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

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 公 社 債

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカ・ドル 226,208	千アメリカ・ドル 164,401 (—)
	カナダ	千カナダ・ドル 16,003	千カナダ・ドル 10,803 (—)
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 14,638	千オーストラリア・ドル 6,518 (—)
	シンガポール	千シンガポール・ドル 1,414	千シンガポール・ドル — (—)
	イギリス	千イギリス・ポンド 22,835	千イギリス・ポンド 13,044 (—)
	イスラエル	千イスラエル・シェケル 13,855	千イスラエル・シェケル — (—)
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 7,849	千デンマーク・クローネ 2,221 (—)
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 3,175	千ノルウェー・クローネ 2,711 (—)
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ —	千スウェーデン・クローネ 2,913 (—)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 48,672	千メキシコ・ペソ 5,511 (—)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 9,274	千マレーシア・リンギット — (—)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 12,801	千南アフリカ・ランド 63,787 (—)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 7,005	千ポーランド・ズロチ 2,030 (—)
	国	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 1,859
ユーロ (オランダ)		千ユーロ 7,639	千ユーロ 4,893 (—)
ユーロ (ベルギー)		千ユーロ 11,438	千ユーロ 5,995 (—)

			買付額	売付額
外	ユーロ (フランス)	国債証券	千ユーロ 43,306	千ユーロ 18,506 (—)
	ユーロ (ドイツ)	国債証券	千ユーロ 33,755	千ユーロ 12,652 (—)
	ユーロ (スペイン)	国債証券	千ユーロ 27,529	千ユーロ 13,852 (—)
	ユーロ (イタリア)	国債証券	千ユーロ 37,380	千ユーロ 17,099 (—)
	ユーロ (フィンランド)	国債証券	千ユーロ 1,772	千ユーロ 127 (—)
	ユーロ (オーストリア)	国債証券	千ユーロ 6,508	千ユーロ 3,537 (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	国債証券	千ユーロ 171,190	千ユーロ 77,624 (—)

(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

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
債券先物取引	31,643	32,961	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

■主要な売買銘柄

公 社 債

（2019年6月18日から2020年6月15日まで）

当 期		期	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2021/9/30	3,423,640	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2020/11/15	3,575,671
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.625% 2021/2/15	2,241,700	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.625% 2021/2/15	3,347,966
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2023/2/15	1,223,376	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.875% 2020/6/30	2,662,432
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.125% 2028/11/15	1,130,922	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2024/11/15	782,843
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.125% 2024/7/31	1,010,493	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 6.25% 2030/5/15	719,749
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2024/2/15	922,647	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2021/5/15	603,435
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.875% 2026/6/30	821,003	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2021/11/15	548,091
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2029/11/15	813,075	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2.5% 2020/10/25	535,002
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/2/28	803,100	CANADIAN GOVERNMENT BOND (カナダ) 3.5% 2020/6/1	489,010
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.875% 2024/8/31	765,178	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2025/3/31	474,369

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	当 期		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額					
アメリカ	千アメリカ・ドル 422,788	千アメリカ・ドル 477,166	千円 51,171,292	45.0%	—%	20.3%	15.4%	9.4%
カナダ	千カナダ・ドル 24,104	千カナダ・ドル 28,143	2,213,748	1.9	—	0.9	0.5	0.6
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 27,027	千オーストラリア・ドル 31,695	2,315,704	2.0	—	1.5	0.6	—
シンガポール	千シンガポール・ドル 4,942	千シンガポール・ドル 5,569	428,063	0.4	—	0.2	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 39,119	千イギリス・ポンド 55,879	7,495,704	6.6	—	5.2	1.1	0.3
イスラエル	千イスラエル・シユケル 11,600	千イスラエル・シユケル 13,854	427,422	0.4	—	0.3	0.1	—
デンマーク	千デンマーク・クローネ 23,450	千デンマーク・クローネ 30,703	497,096	0.4	—	0.4	0.0	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 13,990	千ノルウェー・クローネ 15,243	168,748	0.1	—	0.1	0.0	—
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 25,870	千スウェーデン・クローネ 28,771	330,292	0.3	—	0.1	0.1	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 140,030	千メキシコ・ペソ 153,494	730,634	0.6	—	0.4	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 20,180	千マレーシア・リンギット 21,496	538,475	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 19,715	千ポーランド・ズロチ 21,659	587,179	0.5	—	0.3	0.2	0.1
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 5,388	千ユーロ 6,408	773,332	0.7	—	0.5	0.2	—
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 13,620	千ユーロ 16,919	2,041,892	1.8	—	1.3	0.4	0.1

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	額 面 金 額	当 期			未				
		評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 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 (ベルギー)	千ユーロ 19,136	千ユーロ 23,248	千円 2,805,614	% 2.5	% —	% 2.0	% 0.4	% 0.1	
ユーロ (フランス)	千ユーロ 77,610	千ユーロ 94,421	11,394,736	10.0	—	6.8	2.3	0.9	
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 51,505	千ユーロ 65,044	7,849,521	6.9	—	5.0	1.5	0.4	
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 45,498	千ユーロ 55,385	6,683,897	5.9	—	4.0	1.4	0.5	
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 74,017	千ユーロ 85,040	10,262,671	9.0	—	5.4	2.8	0.8	
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 4,800	千ユーロ 5,345	645,074	0.6	—	0.4	0.2	—	
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 10,930	千ユーロ 13,842	1,670,548	1.5	—	1.0	0.3	0.2	
ユーロ (小計)	302,504	365,655	44,127,290	38.8	—	26.4	9.5	2.9	
合計	—	—	111,031,651	97.6	—	56.4	27.7	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）

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期			未		償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額				
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円			
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	13,946	14,302	1,533,825		2021/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	15,000	15,513	1,663,694		2022/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	11,000	11,525	1,236,038		2023/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	11,020	11,513	1,234,681		2023/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	11,310	12,122	1,300,054		2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	12,905	14,005	1,501,995		2023/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	10,500	11,456	1,228,589		2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	12,580	13,670	1,466,057		2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	20,990	21,414	2,296,504		2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	3,300	3,929	421,379		2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	4,750	6,690	717,480		2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	3,800	5,293	567,647		2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	2,700	3,734	400,479		2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	1,400	2,154	230,997		2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	1,130	1,675	179,716		2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	700	1,065	114,267		2036/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	2,630	3,699	396,707		2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	2,410	3,764	403,742		2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,390	2,239	240,131		2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,770	2,915	312,623		2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,170	2,921	313,303		2042/02/15	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	7,500	9,731	1,043,635	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,100	1,595	171,102	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,532	3,741	401,272	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,000	1,454	156,017	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,200	4,493	481,934	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	5,040	6,823	731,790	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	7,810	8,476	909,062	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	22,750	23,350	2,504,118	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	8,300	9,022	967,619	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,970	5,292	567,566	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	9,020	9,776	1,048,384	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	16,720	17,318	1,857,208	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	10,700	11,767	1,261,939	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,300	4,418	473,882	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,000	6,404	686,769	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,165	5,523	592,318	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,070	2,549	273,423	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,750	6,111	655,360	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,000	5,189	556,473	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	31,700	32,081	3,440,404	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,850	6,411	687,536	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,980	6,575	705,177	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	8,470	9,440	1,012,353	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	8,000	8,218	881,375	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,500	4,734	507,733	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,350	3,771	404,494	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,250	3,045	326,549	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	12,200	13,127	1,407,774	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,310	4,295	460,647	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	7,000	7,464	800,525	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	5,300	5,832	625,470	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,773	297,422	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,500	6,261	671,481	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,400	5,180	555,534	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,500	2,047	219,554	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	7,800	9,408	1,008,927	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	1,850	2,700	289,591	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	4,000	4,676	501,479	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,200	4,387	470,514	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	2,686	288,072	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,000	4,338	465,284	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,100	2,504	268,555	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	6,900	7,586	813,603	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	3,432	368,136	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,500	2,691	288,582	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,841	304,711	2050/02/15
通貨小計	銘柄数 金 額	67銘柄		422,788	477,166	51,171,292	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	当 期				末			償還年月日
	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	千カナダ・ドル 680	千カナダ・ドル 1,089	千円 85,662	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	907	1,324	104,215	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,250	2,030	159,720	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	648	1,067	83,992	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	770	1,208	95,053	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	419	33,007	2022/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	740	1,145	90,079	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,238	1,283	100,950	2023/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	230	249	19,656	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,100	1,558	122,589	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,492	1,631	128,344	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	820	874	68,806	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,959	3,986	313,585	2021/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	930	967	76,083	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,940	3,958	311,392	2022/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	672	52,904	2028/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,100	1,144	90,019	2023/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	300	346	27,252	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,000	1,072	84,345	2024/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,469	115,592	2024/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	600	641	50,491	2030/06/01	
通貨小計	銘柄数 金 額	21銘柄		24,104	28,143	2,213,748		
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	千オーストラリア・ドル 1,080	千オーストラリア・ドル 1,202	87,867	2022/07/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,383	1,588	116,087	2023/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,289	2,925	213,708	2027/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,156	2,357	172,272	2024/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,620	1,953	142,708	2029/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,000	2,276	166,318	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	859	1,216	88,876	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,598	1,946	142,180	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	725	981	71,733	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	800	965	70,530	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	684	876	64,071	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,300	1,494	109,187	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,158	2,406	175,848	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,075	1,364	99,716	2047/03/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	500	579	42,333	2028/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,258	91,917	2022/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,200	2,572	187,932	2029/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,100	2,416	176,556	2030/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	300	307	22,499	2032/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,000	1,004	73,356	2030/12/21	
通貨小計	銘柄数 金 額	20銘柄		27,027	31,695	2,315,704		
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 203	千シンガポール・ドル 239	18,426	2027/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	1,000	1,061	81,602	2022/09/01	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
通貨小計		銘柄数 金 額			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
		15銘柄			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	150	165	12,742	2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	300	354	27,243	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	390	397	30,541	2021/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	89	113	8,687	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	214	16,474	2023/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	120	153	11,773	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	400	436	33,520	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	330	428	32,896	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	200	217	16,697	2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	260	298	22,925	2036/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	800	909	69,868	2028/05/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	300	355	27,291	2039/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	200	226	17,372	2050/03/01
					4,942	5,569	428,063	
イギリス		United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	千イギリス・ポンド 750	千イギリス・ポンド 830	111,411	2025/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	960	1,735	232,746	2065/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,025	1,119	150,123	2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	250	252	33,918	2022/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,850	2,261	303,349	2047/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	720	864	116,003	2037/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,100	1,553	208,405	2057/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	650	705	94,667	2027/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	800	903	121,154	2028/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	797	1,231	165,218	2071/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	400	415	55,774	2024/04/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	1,131	151,769	2054/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	1,600	1,707	229,040	2029/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	150	169	22,730	2041/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	350	377	50,604	2021/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	513	766	102,854	2028/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	900	1,316	176,537	2032/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	2,075	2,565	344,115	2025/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,265	3,563	478,011	2036/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	950	1,658	222,485	2038/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	850	1,865	250,248	2055/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	770	1,453	194,924	2046/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,100	1,443	193,691	2027/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	911	1,659	222,663	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	907	1,334	179,055	2030/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	843	1,671	224,248	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,130	1,894	254,105	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,040	1,112	149,234	2022/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	300	469	62,990	2034/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	787	1,773	237,834	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,000	1,709	229,325	2040/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	742	775	104,079	2021/09/07

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	当 期			末			償還年月日
	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	700	1,353	181,570	2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,880	1,954	262,215	2022/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,175	1,852	248,558	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,790	1,921	257,701	2023/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	798	1,828	245,277	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,900	2,123	284,800	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,540	2,551	342,254	2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	39銘柄		39,119	55,879	7,495,704	
				千イスラエル・シェケル	千イスラエル・シェケル		
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	4.2500	3,500	3,898	120,269	2023/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,200	2,097	64,696	2042/01/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	4,000	4,393	135,535	2027/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	1,200	1,724	53,189	2047/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	1,700	1,741	53,732	2030/03/31
通貨小計	銘柄数 金 額	5銘柄		11,600	13,854	427,422	
				千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	6,740	12,643	204,699	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,310	2,426	39,290	2021/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,670	2,859	46,295	2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,330	4,863	78,742	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,200	5,544	89,773	2027/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	2,365	38,296	2029/11/15
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		23,450	30,703	497,096	
				千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,610	1,694	18,756	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,300	1,433	15,873	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	150	160	1,774	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,430	1,522	16,857	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,000	3,266	36,156	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	4,000	4,470	49,482	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	2,500	2,696	29,847	2030/08/19
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄		13,990	15,243	168,748	
				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	1,920	2,977	34,180	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	12,950	13,919	159,793	2022/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,150	4,405	50,580	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,020	2,295	26,353	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,280	2,452	28,154	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,550	2,720	31,229	2028/05/12
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		25,870	28,771	330,292	
				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	9,200	9,330	44,412	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	11,450	12,560	59,788	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	12,900	14,307	68,105	2024/09/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	6,740	7,370	35,081	2023/12/07

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

		当 期			未			
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円		
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,340	7,551	35,947	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	11,800	12,992	61,846	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	2,750	3,645	17,354	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,500	7,615	36,251	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	5,000	5,802	27,620	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	13,700	13,897	66,153	2021/06/10	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,700	25,395	120,882	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	15,900	16,382	77,982	2022/06/09	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	4,750	5,071	24,139	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,300	11,569	55,071	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄		140,030	153,494	730,634		
				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	1,974	49,473	2030/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	1,250	1,333	33,395	2027/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	600	632	15,835	2033/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,500	1,577	39,516	2028/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,150	1,229	30,805	2025/09/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,100	1,137	28,499	2022/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,600	1,665	41,732	2023/08/17	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	1,420	1,574	39,447	2046/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	2,600	2,655	66,530	2021/11/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	2,000	2,124	53,213	2024/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,000	1,157	29,003	2037/04/07	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	1,000	1,064	26,666	2026/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,200	1,292	32,377	2029/08/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,360	34,092	2034/07/05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	700	714	17,886	2040/05/22	
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		20,180	21,496	538,475		
				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ			
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,200	1,348	36,557	2022/09/23	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,640	2,877	78,021	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	1,520	1,547	41,954	2021/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,815	1,985	53,825	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	800	829	22,501	2022/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,166	85,834	2023/01/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,400	1,502	40,725	2024/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	2,300	2,607	70,676	2029/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	600	826	22,418	2029/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	710	793	21,509	2023/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	1,500	1,672	45,351	2028/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,230	2,501	67,802	2025/07/25	
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄		19,715	21,659	587,179		
				千ユーロ	千ユーロ			
ユーロ（アイルランド）	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	688	876	105,779	2025/03/13	
	IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	420	470	56,803	2023/03/20	
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	600	686	82,823	2024/03/18	
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	680	835	100,862	2030/05/15	

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				未		償還年月日
	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	710	940	113,481	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	320	343	41,448	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	570	687	83,001	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	500	538	64,984	2028/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	150	170	20,533	2033/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	600	677	81,807	2031/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	150	180	21,808	2050/05/15
国 小 計	銘柄数 金 額	11銘柄		5,388	6,408	773,332	
ユーロ (オランダ)				千ユーロ	千ユーロ		
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	580	843	101,816	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,200	2,014	243,140	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,170	1,304	157,375	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	830	1,498	180,861	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,100	1,145	138,296	2021/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	500	530	63,996	2022/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	290	388	46,903	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	750	805	97,192	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,140	1,944	234,668	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	480	531	64,152	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	690	718	86,717	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,170	1,241	149,821	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	470	509	61,543	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	408	49,339	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	600	655	79,126	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,000	2,103	253,876	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	273	33,063	2040/01/15
国 小 計	銘柄数 金 額	17銘柄		13,620	16,919	2,041,892	
ユーロ (ベルギー)				千ユーロ	千ユーロ		
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	670	711	85,922	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	622	689	83,158	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	610	768	92,682	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	595	643	77,671	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	414	510	61,644	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	370	566	68,390	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	400	410	49,499	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	730	784	94,728	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	500	521	62,959	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	310	462	55,788	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	700	824	99,535	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	580	626	75,651	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	500	572	69,094	2033/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	700	764	92,299	2029/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	650	827	99,813	2050/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	300	304	36,756	2030/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	3,000	3,049	367,966	2027/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,000	1,449	174,879	2028/03/28

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		償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	750	1,268	153,050	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	550	595	71,836	2022/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	815	1,409	170,134	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	700	899	108,541	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	730	811	97,923	2022/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	300	438	52,917	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,000	1,085	131,043	2023/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	540	933	112,713	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	800	901	108,757	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	300	416	50,253	2034/06/22
国 小 計	銘柄数 金 額	28銘柄		19,136	23,248	2,805,614	
ユーロ（フランス）				千ユーロ	千ユーロ		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,415	4,609	556,253	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,000	1,508	182,065	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,700	2,899	349,891	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,710	4,527	546,360	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,232	2,497	301,406	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,065	1,761	212,563	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,200	1,397	168,645	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,143	3,885	468,953	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	650	1,387	167,410	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,540	4,360	526,195	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,314	3,486	420,730	2021/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	2,027	244,661	2022/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,910	2,344	282,886	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,195	2,343	282,809	2022/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,190	1,939	234,001	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,730	5,056	610,202	2023/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,200	2,445	295,122	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,686	3,382	408,259	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,360	1,498	180,886	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,400	4,618	557,307	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,500	1,751	211,335	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,800	1,897	228,936	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,250	1,441	173,904	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	900	1,256	151,615	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,970	3,085	372,340	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,100	2,632	317,742	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,528	184,407	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,300	3,118	376,368	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,219	147,122	2023/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,500	1,619	195,387	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,300	1,494	180,327	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,250	2,432	293,515	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,700	2,756	332,623	2024/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,029	365,559	2022/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	500	616	74,411	2050/05/25

外国債券インデックス（為替ヘッジあり） マザーファンド

区 分		当 期				末		償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,000	2,119	255,759	2029/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	4,243	512,162	2029/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	200	203	24,600	2052/05/25
国 小 計	銘柄数 金 額	38銘柄			77,610	94,421	11,394,736	
ユ ー ロ (ド イ ツ)					千ユーロ	千ユーロ		
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,955	2,950	356,088	2027/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	800	1,180	142,471	2028/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	896	1,484	179,134	2030/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,660	2,717	327,988	2031/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	3,270	5,646	681,396	2034/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	690	1,179	142,401	2037/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	420	778	93,959	2039/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,510	5,016	605,353	2040/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	606	1,060	127,948	2042/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,542	1,619	195,445	2022/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,648	2,673	322,578	2044/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,150	1,218	147,089	2023/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,460	1,586	191,458	2023/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,000	2,181	263,277	2024/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,225	2,036	245,720	2046/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	990	1,076	129,866	2024/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,000	2,142	258,556	2024/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,256	151,648	2025/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	6,100	6,635	800,803	2025/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	883	941	113,671	2026/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,050	2,132	257,309	2026/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,150	1,217	146,986	2027/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,100	1,188	143,385	2027/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,260	1,698	205,021	2048/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	750	813	98,130	2028/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	2,025	244,484	2028/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,800	2,989	360,773	2029/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	750	742	89,586	2050/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,815	219,057	2021/10/08
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,518	183,239	2022/04/08
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,828	220,714	2022/10/07
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	150	153	18,466	2023/04/14
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,023	123,564	2023/10/13
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	513	61,940	2024/04/05
国 小 計	銘柄数 金 額	34銘柄			51,505	65,044	7,849,521	
ユ ー ロ (ス ペ イ ン)					千ユーロ	千ユーロ		
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,420	2,092	252,515	2029/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,400	1,510	182,321	2025/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,610	2,970	358,535	2030/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,365	1,520	183,456	2025/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,000	1,109	133,912	2026/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,000	1,012	122,239	2021/07/30

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千 円	千 円	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	689	926	111,796	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	830	1,309	158,039	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	3,249	3,484	420,531	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	1,250	1,267	152,996	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,100	1,197	144,480	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,320	1,578	190,547	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,170	1,269	153,147	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,650	1,787	215,730	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	550	718	86,768	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	1,500	1,508	182,008	2021/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	870	105,046	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	600	679	82,002	2035/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,200	1,214	146,542	2029/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	998	120,456	2030/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	980	1,560	188,327	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	800	1,198	144,611	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	900	1,505	181,653	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	2,343	3,884	468,737	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,000	1,352	163,184	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	600	660	79,748	2022/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	4,310	4,951	597,531	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,588	1,834	221,399	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	2,100	2,925	353,035	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	890	1,605	193,780	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	2,200	2,536	306,095	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,084	2,342	282,717	2024/10/31
国 小 計	銘柄数 金 額	32銘柄		45,498	55,385	6,683,897	
ユーロ（イタリア）				千ユーロ	千ユーロ		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,600	2,211	266,919	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,635	2,241	270,447	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,100	3,338	402,876	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	705	829	100,154	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	920	950	114,731	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,000	1,007	121,586	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	500	529	63,894	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	821	99,148	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	2,200	2,369	285,904	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,200	1,220	147,273	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,750	1,833	221,234	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	2,400	2,417	291,699	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	3,000	3,012	363,491	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,400	1,496	180,553	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,300	1,408	169,986	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,200	1,285	155,170	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,500	1,527	184,300	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	350	426	51,496	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,550	1,644	198,469	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	700	710	85,711	2022/08/01

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千 円	千 円	
			%	千 円 □	千 円 □	千 円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,200	3,384	408,415	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,400	1,569	189,403	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,500	2,710	327,085	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	500	594	71,766	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	200	260	31,472	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,000	1,141	137,792	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	200	212	25,680	2026/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	1,910	230,535	2030/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,040	2,731	329,602	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	1,588	2,289	276,267	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,000	1,456	175,757	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,450	2,015	243,258	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	1,270	1,624	196,103	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,640	2,384	287,770	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	3,870	4,390	529,833	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,700	2,031	245,147	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,714	2,497	301,361	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	3,250	3,888	469,267	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,320	1,395	168,371	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	780	844	101,930	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	500	558	67,355	2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	6,770	7,603	917,560	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	80	101	12,265	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	725	1,051	126,877	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	830	948	114,507	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,610	1,812	218,791	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,370	1,626	196,332	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	700	721	87,104	2021/12/15
国 小 計	銘 柄 数 金 額	48 銘柄		74,017	85,040	10,262,671	
ユーロ（フィンランド）				千 円 □	千 円 □		
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	690	755	91,200	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	800	857	103,457	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	180	189	22,918	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	270	346	41,789	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	200	212	25,601	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	150	172	20,778	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	531	64,198	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	150	150	18,114	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	200	246	29,713	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	120	149	18,060	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	980	1,028	124,167	2022/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	210	320	38,629	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	350	384	46,444	2024/04/15
国 小 計	銘 柄 数 金 額	13 銘柄		4,800	5,345	645,074	
ユーロ（オーストリア）				千 円 □	千 円 □		
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	140	152	18,434	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	490	526	63,529	2026/10/20

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	120	155	18,709	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	280	404	48,809	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	400	424	51,169	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	50	94	11,347	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	648	78,313	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	700	744	89,876	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	658	79,521	2051/03/20
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	380	558	67,434	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	660	693	83,699	2021/09/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,110	1,849	223,143	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	700	916	110,572	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	900	970	117,147	2022/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	860	944	113,973	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	420	944	114,041	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	530	885	106,833	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	680	733	88,552	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	430	570	68,897	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	880	965	116,541	2024/10/21
国 小 計	銘柄数 金 額	20銘柄		10,930	13,842	1,670,548	
通 貨 小 計	銘柄数 金 額	241銘柄		302,504	365,655	44,127,290	
合 計	銘柄数 金 額	468銘柄				111,031,651	

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	111,031,651	97.2
コール・ローン等、その他	3,185,711	2.8
投資信託財産総額	114,217,362	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝107.24円、1カナダ・ドル＝78.66円、1オーストラリア・ドル＝73.06円、1シンガポール・ドル＝76.86円、1イギリス・ポンド＝134.14円、1イスラエル・シェケル＝30.85円、1デンマーク・クローネ＝16.19円、1ノルウェー・クローネ＝11.07円、1スウェーデン・クローネ＝11.48円、1メキシコ・ペソ＝4.76円、1マレーシア・リンギット＝25.05円、1南アフリカ・ランド＝6.24円、1ポーランド・ズロチ＝27.11円、1ユーロ＝120.68円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産（112,698,626千円）の投資信託財産総額（114,217,362千円）に対する比率は、98.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	226,318,554,508円
コール・ローン等	2,014,158,376
公社債（評価額）	111,031,651,188
未収入金	112,349,851,437
未取利息	606,778,700
前払費用	92,992,972
差入委託証拠金	223,121,835
(B) 負債	112,592,336,351
未払金	112,555,882,580
未払解約金	36,450,567
その他未払費用	3,204
(C) 純資産総額（A－B）	113,726,218,157
元本	107,167,679,077
次期繰越損益金	6,558,539,080
(D) 受益権総口数	107,167,679,077口
1万口当り基準価額（C/D）	10,612円

* 期首における元本額は88,872,666,940円、当作成期間中における追加設定元本額は53,233,783,948円、同解約元本額は34,938,771,811円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）82,592,446,809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）3,579,631,514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）20,995,600,754円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,612円です。

■損益の状況

当期 自 2019年6月18日 至 2020年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,158,722,754円
受取利息	2,160,932,072
その他収益金	635,495
支払利息	△ 2,844,813
(B) 有価証券売買損益	3,253,313,970
売買益	13,071,413,177
売買損	△ 9,818,099,207
(C) 先物取引等損益	58,793,877
取引益	154,196,973
取引損	△ 95,403,096
(D) その他費用	△ 11,967,812
(E) 当期損益金（A+B+C+D）	5,458,862,789
(F) 前期繰越損益金	138,300,448
(G) 解約差損益金	△ 909,724,240
(H) 追加信託差損益金	1,871,100,083
(I) 合計（E+F+G+H）	6,558,539,080
次期繰越損益金（I）	6,558,539,080

(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4期

(決算日 2020年6月15日)

(作成対象期間 2019年6月18日～2020年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6 月15日)	10,065	25	0.9	10,071	0.7	98.8	—	1
2 期末 (2018年 6 月15日)	10,028	120	0.8	10,251	1.8	98.6	—	1
3 期末 (2019年 6 月17日)	10,184	100	2.6	10,530	2.7	98.5	—	11
4 期末 (2020年 6 月15日)	10,764	0	5.7	11,186	6.2	98.3	—	55

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

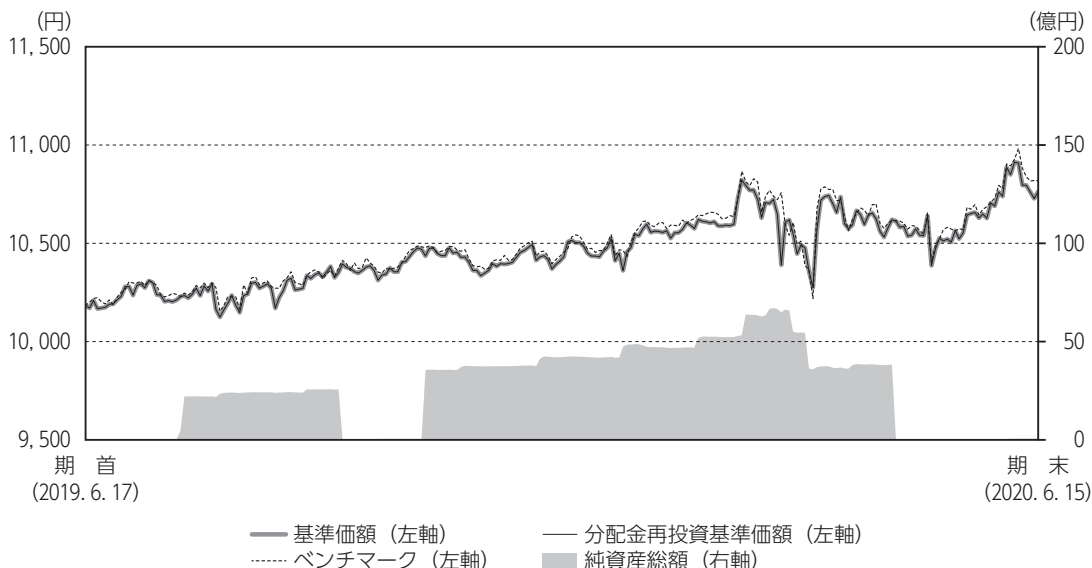
(注 6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注 7) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

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

基準価額・騰落率

期首：10,184円

期末：10,764円（分配金0円）

騰落率：5.7%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

日本を除く先進国国債に投資した結果、為替市場で円高が進んだものの、債券市場で金利が低下（債券価格は上昇）したことなどから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

年 月 日	基 準 価 額		FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2019年 6月17日	円	%		%	%	%
	10,184	—	10,530	—	98.5	—
6月末	10,230	0.5	10,598	0.6	98.3	—
7月末	10,257	0.7	10,624	0.9	97.9	—
8月末	10,322	1.4	10,707	1.7	98.1	—
9月末	10,379	1.9	10,780	2.4	98.3	—
10月末	10,477	2.9	10,840	2.9	98.2	—
11月末	10,479	2.9	10,859	3.1	98.1	—
12月末	10,523	3.3	10,903	3.5	98.1	—
2020年 1月末	10,604	4.1	10,962	4.1	98.2	—
2月末	10,725	5.3	11,180	6.2	98.1	—
3月末	10,736	5.4	11,083	5.2	98.3	—
4月末	10,539	3.5	10,905	3.6	97.7	—
5月末	10,690	5.0	11,093	5.4	97.9	—
(期末)2020年 6月15日	10,764	5.7	11,186	6.2	98.3	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2019. 6. 18 ~ 2020. 6. 15）

■海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると低下しました。

当作成期首より、世界的な景気悪化懸念などが金利の低下要因となりました。その後も、米国で利下げ観測が高まったことや、米中貿易摩擦への懸念によるリスク回避姿勢などを受けて、金利はさらに低下しました。2019年9月以降は、米中通商交渉などへの懸念が和らいだことなどから金利は上昇しました。しかし2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済の減速懸念の高まりから、金利は米国を中心に大きく低下しました。その後は、おおむねレンジ内での推移となりました。

■為替相場

為替相場は、当作成期を通してみると米ドルやユーロなどが円高となりました。

対円為替相場は、当作成期首より、米中の貿易摩擦への懸念や世界的な景気減速懸念などから、円高が進行しました。2019年9月以降は、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待が高まる中で円安傾向となりました。2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大への懸念が高まったことなどから円高傾向となりました。その後は、経済活動の再開期待を受けてユーロなどが上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

ポートフォリオについて

（2019. 6. 18 ～ 2020. 6. 15）

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れました。

■外国債券インデックスマザーファンド

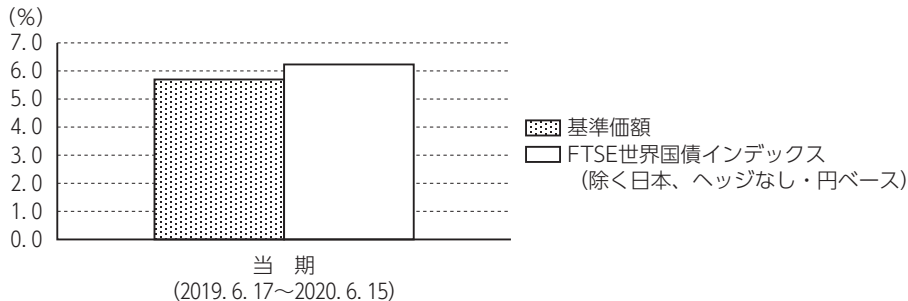
ファンドの通貨の比率をベンチマークに極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

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（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5.7%となりました。

当作成期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.2%程度でした。ただし、これらはファンドとベンチマークの為替評価レート的时间差による影響を修正しています。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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	
	2019年6月18日 ～2020年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	2,861

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



今後の運用方針

当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

外国債券インデックスマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2019. 6. 18～2020. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	43円	0. 413%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10, 461円です。
(投 信 会 社)	(30)	(0. 283)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(11)	(0. 109)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	3	0. 033	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. 025)	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	47	0. 446	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

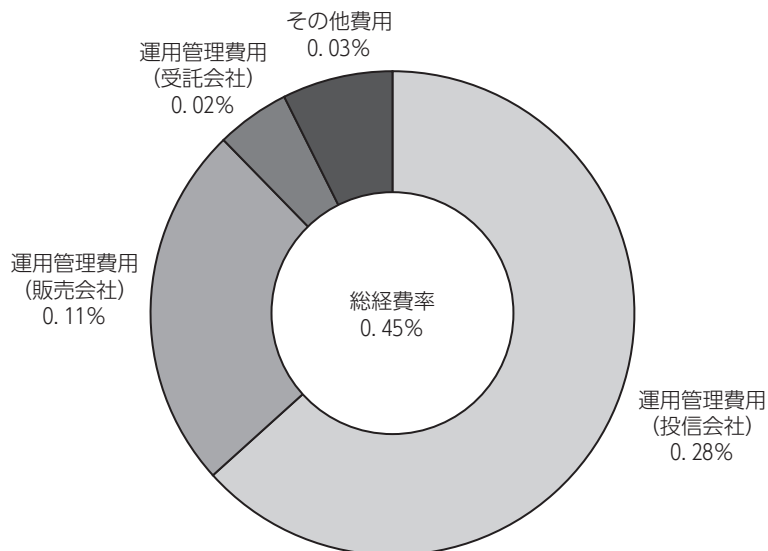
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.45%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券 インデックス マザーファンド	3,360,720	9,644,542	3,345,857	9,672,398

(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	評 価 額	口 数	評 価 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	3,934	18,798	55,620	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス マザーファンド	55,620	88.9
コール・ローン等、その他	6,946	11.1
投資信託財産総額	62,567	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価をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.24円、1カナダ・ドル=78.66円、1オーストラリア・ドル=73.06円、1シンガポール・ドル=76.86円、1イギリス・ポンド=134.14円、1イスラエル・シケル=30.85円、1デンマーク・クローネ=16.19円、1ノルウェー・クローネ=11.07円、1スウェーデン・クローネ=11.48円、1メキシコ・ペソ=4.76円、1マレーシア・リンギット=25.05円、1ポランド・ズロチ=27.11円、1ユーロ=120.68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（192,841,873千円）の投資信託財産総額（194,219,046千円）に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	62,567,491円
コール・ローン等	6,946,818
外国債券インデックス マザーファンド（評価額）	55,620,673
(B) 負債	6,899,581
未払信託報酬	6,766,106
その他未払費用	133,475
(C) 純資産総額（A－B）	55,667,910
元本	51,714,565
次期繰越損益金	3,953,345
(D) 受益権総口数	51,714,565口
1万円当り基準価額（C/D）	10,764円

* 期首における元本額は10,803,922円、当作成期間中における追加設定元本額は9,243,518,976円、同解約元本額は9,202,608,333円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,764円です。

ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

■損益の状況

当期 自 2019年6月18日 至 2020年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 542円
受取利息	1,412
支払利息	△ 1,954
(B) 有価証券売買損益	11,660,292
売買益	75,062,964
売買損	△ 63,402,672
(C) 信託報酬等	△ 10,963,871
(D) 当期損益金 (A + B + C)	695,879
(E) 前期繰越損益金	3
(F) 追加信託差損益金	3,257,463
(配当等相当額)	(14,101,555)
(売買損益相当額)	(△ 10,844,092)
(G) 合計 (D + E + F)	3,953,345
次期繰越損益金 (G)	3,953,345
追加信託差損益金	3,257,463
(配当等相当額)	(14,101,555)
(売買損益相当額)	(△ 10,844,092)
分配準備積立金	695,882

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	76,510円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	619,369
(c) 収益調整金	14,101,555
(d) 分配準備積立金	3
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	14,797,437
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	14,797,437
(h) 受益権総口数	51,714,565口

《お知らせ》

■商号変更について

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

<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（2019年12月2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（2020年6月15日）現在における外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■外国債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2029/11/15	781,461	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2021/4/30	869,839
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2024/5/31	750,158	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2024/5/31	573,867
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2029/8/15	750,065	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2020/11/15	498,328
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.375% 2049/11/15	643,775	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.625% 2021/2/15	454,267
GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 2023/4/14	608,569	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3% 2045/11/15	445,066
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.375% 2029/5/15	603,189	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2020/12/31	441,566
GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 0.25% 2027/2/15	583,154	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 3.75% 2021/4/25	400,662
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2021/9/30	554,385	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2020/11/15	394,785
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2022/11/15	548,227	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2.5% 2020/10/25	386,822
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2049/8/15	547,122	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2026/5/15	378,958

(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、2020年6月15日現在における外国債券インデックスマザーファンド（65,627,347千円）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	2020年6月15日現在						
		評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千アメリカ・ドル 728,228	千アメリカ・ドル 813,593	千円 87,249,797	44.9 %	— %	19.9 %	16.7 %	8.3 %
カナダ	千カナダ・ドル 40,429	千カナダ・ドル 46,667	3,670,901	1.9	—	0.9	0.6	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 48,264	千オーストラリア・ドル 55,554	4,058,847	2.1	—	1.5	0.6	0.0
シンガポール	千シンガポール・ドル 9,713	千シンガポール・ドル 10,976	843,636	0.4	—	0.2	0.1	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 67,791	千イギリス・ポンド 95,465	12,805,733	6.6	—	5.2	1.2	0.2
イスラエル	千イスラエル・シェケル 19,700	千イスラエル・シェケル 23,534	726,032	0.4	—	0.2	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーク・クローネ 47,361	千デンマーク・クローネ 61,028	988,058	0.5	—	0.4	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 33,234	千ノルウェー・クローネ 35,924	397,679	0.2	—	0.1	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 41,270	千スウェーデン・クローネ 46,578	534,716	0.3	—	0.1	0.1	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 279,660	千メキシコ・ペソ 307,978	1,465,978	0.8	—	0.4	0.2	0.2

外国債券インデックスマザーファンド

作成期		2020年6月15日現在						
区分	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
マレーシア	千マレーシア・リングギット 35,973	千マレーシア・リングギット 38,561	千円 965,963	% 0.5	% —	% 0.3	% 0.1	% 0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 38,664	千ポーランド・ズロチ 42,131	1,142,188	0.6	—	0.3	0.2	0.1
ユーロ	アイルランド 千ユーロ 10,693	千ユーロ 12,200	1,472,396	0.8	—	0.5	0.2	0.0
	オランダ 千ユーロ 25,068	千ユーロ 30,711	3,706,263	1.9	—	1.3	0.5	0.2
	ベルギー 千ユーロ 32,235	千ユーロ 39,873	4,811,937	2.5	—	1.9	0.4	0.2
	フランス 千ユーロ 132,257	千ユーロ 160,042	19,313,948	9.9	—	6.8	2.3	0.9
	ドイツ 千ユーロ 96,014	千ユーロ 116,373	14,043,913	7.2	—	4.5	2.1	0.6
	スペイン 千ユーロ 79,076	千ユーロ 93,788	11,318,418	5.8	—	4.0	1.3	0.5
	イタリア 千ユーロ 127,383	千ユーロ 144,217	17,404,133	9.0	—	5.3	2.7	1.0
	フィンランド 千ユーロ 8,564	千ユーロ 9,528	1,149,951	0.6	—	0.4	0.1	0.0
	オーストリア 千ユーロ 20,105	千ユーロ 24,290	2,931,417	1.5	—	1.0	0.4	0.1
	小計	531,395	631,027	76,152,379	39.2	—	25.8	10.0
合計	—	—	191,001,914	98.4	—	55.3	30.1	12.9

(注1) 邦貨換算金額は、2020年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国(外貨建)公社債(銘柄別)

2020年6月15日現在								
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	千アメリカ・ドル 2,534	千アメリカ・ドル 2,591	千円 277,879	2021/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,208	236,793	2021/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,320	356,044	2022/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,531	271,458	2022/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,621	281,094	2022/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,668	6,896	739,567	2022/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,557	488,797	2023/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,894	524,907	2023/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,568	4,896	525,079	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,449	584,387	2023/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,705	611,837	2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	5,337	572,438	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,485	3,555	381,291	2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.0000	2,106	2,340	250,945	2021/11/15	

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	778	83,509	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,122	120,421	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	998	107,093	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	975	104,566	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	1,020	109,464	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	473	659	70,677	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	1,098	117,808	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	891	1,321	141,705	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	676	1,028	110,349	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	1,381	148,162	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	846	90,781	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	813	87,277	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	1,475	158,230	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,721	184,568	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,676	179,795	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,890	202,709	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,627	174,483	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	2,632	282,350	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	591	874	93,812	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	2,279	244,462	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	2,065	221,485	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	2,154	231,083	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	2,217	237,771	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,948	208,961	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	2,185	234,327	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,788	191,764	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,231	2,836	304,175	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	2,071	222,174	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	3,535	379,097	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,898	2,462	264,109	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	4,661	499,929	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	3,075	329,797	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,707	5,393	578,355	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	4,672	501,061	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,834	2,899	310,944	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	6,696	718,111	2024/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	2,611	280,084	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,301	1,329	142,570	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,625	3,713	398,280	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,163	2,217	237,812	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	6,426	689,187	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,846	5,113	548,374	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,886	2,956	317,074	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,263	349,957	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,527	2,580	276,732	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	6,190	663,850	2025/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	3,137	336,440	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,809	3,909	419,260	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,970	318,507	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	6,292	674,768	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,835	3,779	405,302	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,688	288,292	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	1,326	1,369	146,881	2022/05/31

外国債券インデックスマザーファンド

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,931	314,410	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,179	4,338	465,311	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	6,224	667,502	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,873	5,066	543,315	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,535	271,890	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,560	274,582	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	6,422	688,759	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	709	949	101,812	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,659	285,163	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,287	6,564	703,923	2022/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,992	5,234	561,354	2022/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,366	4,660	499,739	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,664	285,734	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,648	4,484	480,943	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,962	3,064	328,635	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,623	3,753	402,552	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,729	3,987	427,638	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,153	230,986	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	4,216	452,139	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,603	279,220	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,500	2,524	270,716	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	3,105	333,028	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	5,739	615,469	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	4,096	439,347	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,741	401,251	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,738	400,970	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,868	307,652	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,487	266,785	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,599	278,793	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,042	3,078	330,148	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,808	622,895	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	3,045	326,619	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,616	280,644	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,500	4,621	495,606	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,651	284,384	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,400	3,477	372,962	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,000	4,111	440,936	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,677	287,094	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	6,140	6,843	733,866	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,092	331,617	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,659	285,151	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,545	4,795	514,261	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,096	332,095	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,458	263,685	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,550	4,869	522,210	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,987	320,325	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	7,205	772,766	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,500	4,736	507,966	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	3,094	331,809	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	3,200	343,181	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,090	331,394	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,800	4,058	435,206	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,094	331,873	2022/06/30

2020年6月15日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,566	275,230	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	6,610	708,932	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	3,003	322,073	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,228	346,173	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,450	4,477	480,131	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,200	3,300	353,916	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	2,132	228,721	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,595	278,381	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,500	2,695	289,105	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,606	279,513	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	6,177	662,438	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,500	4,544	487,352	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,797	407,243	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,458	370,889	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	3,044	326,497	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,699	396,715	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,650	6,575	705,123	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,515	377,004	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,861	306,834	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	3,006	322,414	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,800	5,165	553,910	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,900	3,084	330,821	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	3,217	345,009	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,200	5,844	626,715	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	7,652	820,676	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,681	287,577	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	2,133	228,842	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,992	428,167	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,686	288,121	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,000	3,073	329,573	2021/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,682	287,620	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	3,360	360,326	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,386	363,192	2021/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,850	4,153	445,416	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	7,916	848,960	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,220	5,759	617,680	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,574	276,089	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,820	302,427	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,890	417,219	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	4,043	433,596	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,500	3,611	387,347	2021/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,844	305,068	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,258	349,468	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,107	333,218	2021/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,848	305,486	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,353	466,828	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,152	445,294	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,900	5,910	633,813	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,520	6,597	707,543	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,402	364,875	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	2,180	233,881	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,800	2,902	311,213	2021/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,500	3,925	421,022	2025/12/31

外国債券インデックスマザーファンド

2020年6月15日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,708	290,510	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,108	333,392	2022/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	7,715	827,441	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,114	333,996	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	4,323	463,675	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,808	301,170	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	6,444	691,067	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,794	299,641	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,558	381,566	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,632	389,572	2022/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,761	296,103	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,700	3,838	411,651	2022/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,400	3,524	378,015	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	6,245	669,768	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	4,489	481,427	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,767	404,015	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	3,115	334,097	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,608	386,964	2022/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,297	353,589	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,707	397,593	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,700	2,740	293,879	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	3,037	325,699	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,000	4,128	442,746	2022/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,700	4,782	512,883	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,710	397,946	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,714	291,054	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,900	7,498	804,176	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,500	3,598	385,909	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	5,485	588,265	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,100	3,149	337,703	2021/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,955	316,997	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	4,160	446,217	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,087	331,156	2022/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,100	5,186	556,172	2021/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,678	287,202	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,154	338,256	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,900	2,978	319,436	2022/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	1,052	112,827	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,550	2,595	278,384	2021/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,214	344,768	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	6,450	7,091	760,542	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	5,517	591,647	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,500	1,528	163,932	2021/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	2,144	229,928	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,159	338,784	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,106	333,166	2022/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,701	289,757	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,662	285,505	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	1,500	1,533	164,410	2021/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	4,132	443,218	2023/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	4,700	4,928	528,518	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,500	2,547	273,239	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,250	2,320	248,801	2023/02/15

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,600	3,875	415,559	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,200	3,407	365,446	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,000	4,546	487,538	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	200	203	21,788	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	312	33,476	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	200	207	22,263	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	200	201	21,617	2023/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	200	201	21,625	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	200	200	21,517	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	200	200	21,472	2023/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	300	302	32,400	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	3,400	3,375	362,023	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	500	498	53,483	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,000	2,004	214,964	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	500	499	53,552	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,000	998	107,046	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,000	1,905	204,292	2050/05/15
通貨小計	銘柄数	243銘柄					
	金 額			728,228	813,593	87,249,797	
				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	405	648	51,019	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	586	889	69,981	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,435	112,948	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,814	142,725	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,667	131,173	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,363	2,139	168,257	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	956	984	77,454	2021/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,751	1,836	144,490	2022/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,461	2,260	177,846	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,298	102,173	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,526	120,077	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,894	149,001	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,264	99,441	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	1,033	81,309	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,480	2,497	196,436	2021/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,289	101,444	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,440	1,446	113,808	2022/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,750	1,778	139,933	2022/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,200	1,345	105,809	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,100	2,184	171,854	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,000	1,055	83,012	2023/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,390	1,739	136,833	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,408	110,826	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,286	101,214	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,469	115,592	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	400	406	31,937	2021/08/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,350	1,444	113,606	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	800	811	63,846	2021/11/01

外国債券インデックスマザーファンド

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,600	1,668	131,248	2025/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,100	1,122	88,331	2022/02/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5	5	402	2022/05/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	1,511	118,920	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,499	117,939	2022/08/01
通貨小計	銘柄数	33銘柄					
	金 額			40,429	46,667	3,670,901	
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,162	2,407	175,897	2022/07/15
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,568	4,099	299,493	2023/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,789	3,564	260,390	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,473	2,704	197,601	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,504	3,019	220,580	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,498	2,843	207,731	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,258	1,781	130,159	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,948	3,590	262,295	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,507	110,123	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,007	1,215	88,780	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	1,015	74,187	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,672	3,071	224,422	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,678	2,986	218,221	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,152	1,462	106,859	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	800	820	59,974	2021/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,300	2,665	194,735	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,550	1,625	118,726	2022/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,600	3,039	222,102	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4700	2,470	2,842	207,664	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	990	1,186	86,660	2041/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	2,995	218,825	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	500	513	37,499	2032/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,388	174,528	2024/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,200	2,208	161,384	2030/12/21
通貨小計	銘柄数	24銘柄					
	金 額			48,264	55,554	4,058,847	
シンガポール				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	911	70,075	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	438	465	35,741	2022/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	623	688	52,924	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	359	424	32,600	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	495	504	38,764	2021/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	508	39,044	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	671	719	55,270	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	725	55,727	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	729	56,078	2029/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	571	43,911	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	892	68,584	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	250	271	20,871	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	460	465	35,796	2021/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	500	513	39,433	2022/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	500	573	44,088	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	450	466	35,849	2023/02/01

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	千シンガポール・ドル 550	千シンガポール・ドル 624	千円 48,034	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	490	518	39,819	2024/02/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	150	177	13,645	2039/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	200	226	17,372	2050/03/01
通貨小計	銘柄数	20銘柄					
	金 額			9,713	10,976	843,636	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	千イギリス・ポンド 921	千イギリス・ポンド 1,019	136,813	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,682	3,040	407,791	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,599	214,566	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	2,320	2,346	314,761	2022/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,790	2,188	293,511	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,750	3,303	443,067	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,510	2,132	286,083	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,510	1,639	219,920	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	2,000	2,047	274,657	2023/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	2,500	2,822	378,606	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,060	1,638	219,737	2071/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	2,600	2,702	362,536	2024/04/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	930	1,208	162,100	2049/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	1,131	151,769	2054/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	2,100	2,241	300,615	2029/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	2,600	2,680	359,596	2025/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	90	101	13,638	2041/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	500	501	67,280	2023/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	500	506	67,988	2030/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	50	50	6,739	2061/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,102	1,187	159,333	2021/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,418	190,271	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,340	1,959	262,844	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,819	244,114	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,912	3,008	403,513	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,257	2,194	294,383	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,608	3,529	473,412	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,666	3,144	421,746	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,617	216,934	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,816	3,308	443,860	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,830	2,691	361,070	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	2,663	357,255	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	2,424	325,165	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,382	1,478	198,309	2022/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,260	1,972	264,561	2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,574	3,546	475,669	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,696	361,646	2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	803	839	112,635	2021/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	3,001	402,567	2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,331	312,705	2022/09/07
United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,166	3,415	458,192	2044/01/22	
United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,582	1,697	227,755	2023/09/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,586	3,630	486,933	2068/07/22	

外国債券インデックスマザーファンド

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	United Kingdom Gilt United Kingdom Gilt	国債証券 国債証券	2.7500 3.5000	千イギリス・ポンド 1,092 2,274	千イギリス・ポンド 1,220 3,767	千円 163,685 505,380	2024/09/07 2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	45銘柄		67,791	95,465	12,805,733	
イスラエル	Israel Government Bond — Fixed Israel Government Bond — Fixed Israel Government Bond — Fixed Israel Government Bond — Fixed Israel Government Bond — Fixed Israel Government Bond — Fixed Israel Government Bond — Fixed Israel Government Bond — Fixed Israel Government Bond — Fixed Israel Government Bond — Fixed Israel Government Bond — Fixed Israel Government Bond — Fixed Israel Government Bond — Fixed Israel Government Bond — Fixed Israel Government Bond — Fixed	国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券	6.2500 5.5000 4.2500 5.5000 3.7500 1.7500 2.0000 1.2500 3.7500 2.2500 1.5000 0.7500 1.0000	千イスラエル・シケル 1,500 2,000 1,800 1,900 1,500 1,900 1,800 1,000 1,500 1,500 1,000 800	千イスラエル・シケル 2,043 2,177 2,004 3,320 1,698 2,034 1,977 1,028 2,155 1,694 1,566 1,013 819	63,048 67,163 61,852 102,435 52,410 62,758 60,990 31,715 66,487 52,280 48,327 31,275 25,285	2026/10/30 2022/01/31 2023/03/31 2024/01/31 2024/03/31 2025/08/31 2027/03/31 2022/11/30 2047/03/31 2028/09/28 2023/11/30 2022/07/31 2030/03/31
通貨小計	銘柄数 金 額	13銘柄		19,700	23,534	726,032	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND DANISH GOVERNMENT BOND DANISH GOVERNMENT BOND DANISH GOVERNMENT BOND DANISH GOVERNMENT BOND DANISH GOVERNMENT BOND DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券	4.5000 3.0000 1.5000 1.7500 0.5000 0.5000 0.2500	千デンマーク・クローネ 12,662 7,550 4,846 6,013 7,900 7,590 800	千デンマーク・クローネ 23,752 7,931 5,189 6,754 8,424 8,160 815	384,555 128,415 84,025 109,347 136,385 132,122 13,204	2039/11/15 2021/11/15 2023/11/15 2025/11/15 2027/11/15 2029/11/15 2022/11/15
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄		47,361	61,028	988,058	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券	2.0000 3.0000 1.7500 1.5000 1.7500 2.0000 1.7500 1.3750	千ノルウェー・クローネ 8,204 4,095 3,395 3,340 3,450 3,500 3,250 4,000	千ノルウェー・クローネ 8,633 4,516 3,628 3,556 3,756 3,911 3,606 4,313	95,574 50,003 40,166 39,372 41,579 43,297 39,929 47,755	2023/05/24 2024/03/14 2025/03/13 2026/02/19 2027/02/17 2028/04/26 2029/09/06 2030/08/19
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄		33,234	35,924	397,679	
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND SWEDISH GOVERNMENT BOND SWEDISH GOVERNMENT BOND SWEDISH GOVERNMENT BOND SWEDISH GOVERNMENT BOND SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券 国債証券	3.5000 3.5000 1.5000 2.5000 1.0000 0.7500	千スウェーデン・クローネ 4,255 8,465 8,025 5,595 5,680 4,550	千スウェーデン・クローネ 6,598 9,098 8,519 6,358 6,109 4,853	75,749 104,451 97,809 72,992 70,139 55,723	2039/03/30 2022/06/01 2023/11/13 2025/05/12 2026/11/12 2028/05/12

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	千スウェーデン・クローネ 4,700	千スウェーデン・クローネ 5,039	千円 57,850	2029/11/12
通貨小計	銘柄数 金 額	7銘柄		41,270	46,578	534,716	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 20,290	千メキシコ・ペソ 20,577	97,947	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	16,300	17,880	85,113	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	7.2500	19,000	19,638	93,477	2021/12/09
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	16,300	18,078	86,055	2024/09/05
	Mexican Bonos	国債証券	6.7500	5,000	5,230	24,898	2023/03/09
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	25,033	27,373	130,295	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	23,919	28,491	135,617	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	26,468	29,143	138,723	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	11,764	56,000	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	25,044	29,343	139,672	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	14,894	17,284	82,275	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	16,326	16,561	78,833	2021/06/10
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,015	14,560	69,307	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	24,599	25,346	120,647	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	16,654	17,780	84,635	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,944	8,923	42,474	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄		279,660	307,978	1,465,978	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	千マレーシア・リンギット 1,273	千マレーシア・リンギット 1,332	33,376	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.2480	738	857	21,480	2028/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,321	33,113	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	916	936	23,459	2021/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,649	41,310	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,428	35,796	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	875	896	22,465	2022/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	779	19,529	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1270	618	671	16,830	2032/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	1,030	25,824	2023/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,503	37,660	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,186	1,247	31,244	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	600	702	17,597	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,122	28,108	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	857	878	22,001	2021/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,857	46,529	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161	1,200	30,079	2022/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,335	33,452	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,302	1,355	33,959	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	1,031	25,835	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650	695	17,412	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	352	359	9,007	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,600	1,646	41,248	2022/03/10
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	750	796	19,955	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	890	951	23,831	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,050	1,215	30,454	2037/04/07

外国債券インデックスマザーファンド

2020年6月15日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,266	31,720	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	800	830	20,806	2023/04/20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	700	794	19,902	2033/11/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	600	703	17,629	2038/06/08
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	691	17,333	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,910	2,057	51,533	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,000	1,140	28,573	2048/07/06
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400	413	10,364	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	800	837	20,980	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,000	1,020	25,551	2040/05/22
通貨小計	銘柄数	36銘柄					
	金額			35,973	38,561	965,963	
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	5.7500	2,309	2,594	70,343	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,377	4,771	129,356	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	3,051	3,106	84,212	2021/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	3,467	94,009	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	2,320	2,406	65,253	2022/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,850	3,007	81,542	2023/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,870	3,079	83,487	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,340	3,785	102,634	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	2,400	2,560	69,423	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	—	1,500	1,491	40,434	2022/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	1,139	30,900	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,684	1,812	49,142	2021/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,625	2,933	79,524	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	2,750	3,066	83,144	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,591	2,905	78,778	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金額			38,664	42,131	1,142,188	
ユーロ (アイルランド)				千ユーロ	千ユーロ		
	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,031	1,313	158,514	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	624	699	84,393	2023/03/20
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	694	83,790	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	961	1,181	142,541	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.8000	516	527	63,693	2022/03/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	781	1,034	124,829	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,151	138,981	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	663	80,088	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	—	350	353	42,714	2022/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	861	103,974	2028/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	550	623	75,288	2033/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	200	225	27,269	2031/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	1,200	1,317	159,012	2029/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	400	481	58,156	2050/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	250	251	30,341	2035/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	818	98,806	2027/05/15
国小計	銘柄数	16銘柄					
	金額			10,693	12,200	1,472,396	

2020年6月15日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	千ユーロ 548	千ユーロ 664	千円 80,199	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,139	1,656	199,946	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,485	2,493	300,886	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	881	106,396	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,779	3,212	387,654	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,463	1,524	183,934	2021/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,525	184,054	2022/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,565	188,909	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,487	179,481	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,579	2,693	325,037	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,676	202,348	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,291	1,344	162,249	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,638	1,738	209,749	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,211	146,204	2022/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,200	1,302	157,131	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,430	172,687	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,150	1,256	151,658	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,262	152,326	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	600	657	79,351	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,127	136,054	2030/07/15
国小計	銘柄数	20銘柄					
	金額			25,068	30,711	3,706,263	
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	千ユーロ 1,399	千ユーロ 1,486	179,411	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,074	1,189	143,588	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	758	954	115,169	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,283	1,387	167,482	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	1,534	185,229	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	640	980	118,296	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	490	502	60,636	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,400	1,505	181,670	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,095	132,214	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	460	685	82,783	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	400	471	56,877	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,340	1,448	174,780	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	550	629	76,004	2033/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,200	1,311	158,227	2029/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	600	763	92,135	2050/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,238	149,476	2030/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	660	646	78,010	2040/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,219	147,186	2027/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,472	298,344	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	2,104	3,557	429,357	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	877	949	114,546	2022/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	2,774	334,840	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,446	1,535	185,306	2021/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,286	155,214	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,462	176,530	2022/09/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	1,140	137,586	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,452	175,336	2023/06/22
Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	843	1,458	175,957	2045/06/22	

外国債券インデックスマザーファンド

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,695	204,600	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	1,036	125,130	2034/06/22
国小計	銘柄数	30銘柄					
	金 額			32,235	39,873	4,811,937	
ユーロ (フランス)				千ユーロ	千ユーロ		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	1,985	2,503	302,168	2023/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	4,082	492,728	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	5,013	605,002	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,927	4,991	602,430	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	4,442	536,078	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,514	3,069	370,397	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	3,926	473,827	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	4,097	4,771	575,783	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,764	6,825	823,677	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,287	2,746	331,472	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,146	3,874	467,630	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	4,150	4,365	526,864	2021/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,630	3,873	467,432	2022/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,699	4,539	547,852	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,694	2,876	347,102	2022/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,588	4,216	508,903	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,577	431,786	2023/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,086	3,430	413,976	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,387	5,525	666,803	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,899	4,297	518,586	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,665	442,299	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,101	3,345	403,792	2025/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,420	5,160	622,735	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,287	3,464	418,063	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,969	3,422	413,057	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,087	1,517	183,118	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,800	2,908	351,028	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	4,046	488,372	2022/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,170	2,720	328,334	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,711	447,847	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,300	3,118	376,368	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,438	294,245	2023/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,400	3,669	442,878	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	4,540	547,917	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,150	3,405	410,922	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,470	418,858	2024/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,413	170,594	2022/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,500	3,083	372,056	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,250	5,563	671,368	2029/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,130	3,202	386,442	2025/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,324	280,470	2029/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,436	294,011	2023/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,370	1,396	168,510	2052/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,067	370,149	2026/02/25
国小計	銘柄数	44銘柄					
	金 額			132,257	160,042	19,313,948	

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ (ドイツ)	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,216	146,833	2024/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,761	212,560	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	1,362	2,009	242,558	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,363	164,489	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	951	1,575	190,130	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,448	5,645	681,267	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,405	2,426	292,771	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,571	6,106	736,981	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	2,456	296,419	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,439	2,875	347,053	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,874	5,028	606,807	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,674	1,742	210,280	2021/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,415	1,465	176,800	2021/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,807	1,883	227,314	2022/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,333	281,633	2022/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,508	4,067	490,914	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,724	208,135	2022/09/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,494	180,344	2023/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,935	233,565	2023/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,737	209,686	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,702	205,488	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	4,452	537,375	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,732	209,097	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,542	1,651	199,347	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,316	279,593	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,321	280,150	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,368	2,526	304,839	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,516	303,750	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	6,200	6,566	792,450	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,484	299,805	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,750	2,359	284,751	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	2,059	248,598	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,400	4,691	566,175	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,348	283,464	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,985	239,575	2029/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,050	1,039	125,421	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,050	1,096	132,300	2030/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	722	87,218	2035/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	521	62,879	2027/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	12,146	2021/06/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	504	60,829	2021/09/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	808	97,512	2021/12/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	303	36,624	2022/03/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,411	170,377	2021/10/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,160	1,174	141,705	2022/04/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	2,133	257,500	2022/10/07
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,730	5,845	705,436	2023/04/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,945	234,772	2023/10/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,970	237,852	2024/04/05
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,750	211,247	2024/10/18
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,478	299,074	2025/04/11
国小計	銘柄数	51銘柄					
	金 額			96,014	116,373	14,043,913	

外国債券インデックスマザーファンド

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ (スペイン)	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,352	3,465	418,251	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	2,206	266,319	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	2,335	281,883	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,441	294,605	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,733	1,923	232,070	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,747	1,769	213,551	2021/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,652	2,221	268,052	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	950	1,498	180,888	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,030	2,177	262,751	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	2,080	2,109	254,586	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	2,067	249,556	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,700	2,033	245,401	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	2,223	268,335	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,600	1,629	196,609	2022/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	2,058	248,417	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,300	1,699	205,088	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,400	1,423	171,830	2023/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	2,060	248,651	2028/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	1,700	1,709	206,276	2021/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,900	2,067	249,485	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,200	1,359	164,004	2035/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,334	281,688	2024/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,900	1,922	232,025	2029/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,360	1,357	163,821	2030/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,460	2,474	298,612	2023/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	500	60,443	2025/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,200	1,076	129,872	2050/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,491	300,666	2027/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,900	3,092	373,199	2030/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	3,151	380,306	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,854	2,777	335,136	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	2,158	3,609	435,564	2040/07/30
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	1,985	239,602	2024/01/31	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,873	3,104	374,709	2041/07/30	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,189	2,710	327,130	2025/07/30	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,657	320,657	2026/07/30	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,178	262,904	2022/01/31	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	1,958	2,249	271,453	2023/01/31	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	2,196	265,038	2023/10/31	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,465	297,558	2028/10/31	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	2,343	282,832	2044/10/31	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,271	274,094	2024/04/30	
SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,357	284,481	2024/10/31	
国小計	銘柄数	43銘柄					
	金 額			79,076	93,788	11,318,418	
ユーロ (イタリア)	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,106	1,421	171,590	2023/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,534	185,175	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,278	395,663	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,953	235,747	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	1,776	214,373	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,629	1,663	200,725	2022/04/15

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,687	1,743	210,382	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,765	1,778	214,599	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,891	2,002	241,649	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,544	186,399	2022/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	1,733	209,230	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,359	1,382	166,787	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,786	1,851	223,431	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,674	1,681	202,884	2021/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,324	1,386	167,379	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	1,082	130,595	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	1,550	1,561	188,389	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,358	1,363	164,540	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	1,034	124,840	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,625	196,138	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,617	195,256	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,362	164,383	2024/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,250	1,272	153,583	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,850	2,255	272,193	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,700	1,803	217,676	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,700	1,724	208,155	2022/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,651	199,332	2024/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,474	177,882	2038/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	2,220	268,022	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,932	233,169	2023/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,339	161,687	2025/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,550	1,737	209,696	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,400	1,491	179,950	2023/10/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,680	202,792	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	1,200	1,235	149,121	2021/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,510	182,287	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,250	1,629	196,702	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,550	1,575	190,119	2022/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	2,169	261,805	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,200	2,296	277,161	2024/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	1,600	1,702	205,441	2026/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	850	981	118,409	2040/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	1,890	228,129	2030/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	740	735	88,753	2023/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,100	1,080	130,420	2025/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,316	279,502	2027/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,200	1,216	146,784	2050/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,416	170,980	2036/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,000	2,012	242,897	2023/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,300	2,411	290,970	2025/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,500	1,432	172,901	2030/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,754	3,687	444,963	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,107	495,647	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,628	317,241	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	3,194	385,522	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	3,505	423,090	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,734	2,848	343,770	2021/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	2,971	358,660	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,553	308,179	2023/08/01

外国債券インデックスマザーファンド

2020年6月15日現在

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,530	305,424	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,043	2,976	359,207	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,476	298,887	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,281	2,410	290,950	2021/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,178	262,929	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	1,849	223,216	2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,960	2,201	265,645	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	3,061	369,501	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,117	255,584	2023/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,613	2,339	282,279	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,508	302,687	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,478	299,105	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,838	3,370	406,710	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,642	198,225	2021/12/15
国小計	銘柄数	73銘柄					
	金額			127,383	144,217	17,404,133	
ユーロ (フィンランド)				千ユーロ	千ユーロ		
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	414	453	54,720	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	298	36,080	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	1,111	1,172	141,454	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	203	24,577	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	461	55,719	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	770	778	93,899	2022/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	848	102,405	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	370	424	51,253	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	531	64,198	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	532	64,280	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	204	24,681	2024/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	310	37,436	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	821	99,094	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	485	58,545	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	312	327	39,531	2022/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	472	57,006	2023/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	620	74,867	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	581	70,196	2024/04/15
国小計	銘柄数	18銘柄					
	金額			8,564	9,528	1,149,951	
ユーロ (オーストリア)				千ユーロ	千ユーロ		
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	873	952	114,949	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,209	145,988	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	634	819	98,850	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	346	41,837	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	—	900	915	110,524	2023/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	780	826	99,780	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	490	921	111,210	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	405	48,924	2022/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	900	973	117,470	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	980	1,042	125,827	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	800	817	98,693	2024/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	—	680	690	83,335	2030/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,000	1,016	122,659	2023/04/20

2020年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	768	92,774	2051/03/20
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,213	146,404	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,404	169,555	2021/09/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,273	2,120	255,911	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,145	138,215	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	859	103,740	2022/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	957	115,563	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	760	91,775	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	1,040	125,579	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,034	124,885	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	1,023	123,533	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,022	123,427	2024/10/21
国小計	銘柄数	25銘柄					
	金 額			20,105	24,290	2,931,417	
通貨小計	銘柄数	320銘柄					
	金 額			531,395	631,027	76,152,379	
合 計	銘柄数	787銘柄					
	金 額					191,001,914	

(注1) 邦貨換算金額は、2020年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第20期 (決算日 2019年12月2日)

(作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2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

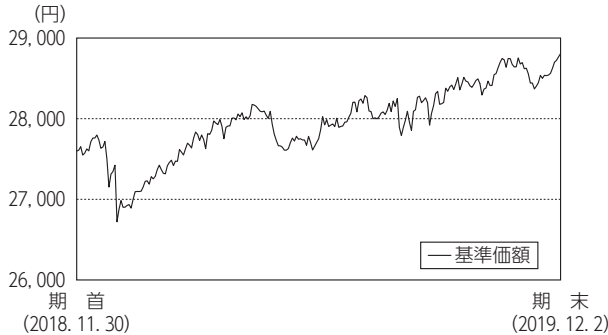
大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：27,598円 期末：28,807円 騰落率：4.4%

【基準価額の主な変動要因】

日本を除く先進国国債に主に投資した結果、為替市場で円高が進んだものの債券市場で金利が低下（債券価格は上昇）したため、基準価額は上昇しました。

◆ 投資環境について

○ 海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通してみると低下しました。

当作成期首より、世界的な株安により市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、金利は低下しました。また、米国を中心とした世界的な景気悪化懸念や米国の利上げ停止観測の高まりも、金利の低下要因となりました。その後も、米国で利下げ観測が高まったことや米中貿易摩擦への懸念によるリスク回避姿勢などを受けて、金利はさらに低下しました。しかし2019年9月に入ると、米中通商交渉などへの懸念が和らいだことなどから、金利は上昇しました。当作成期末にかけても、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待が高まる中で、金利は上昇しました。

○ 為替相場

為替相場は、当作成期を通してみると円高となりました。

当作成期首より、株価や原油価格が下落する中で市場のリスク回避姿勢が強まり、円高が進行しました。2019年1月に入ると、FRB（米連邦準備制度理事会）が景気に配慮した金融政策を行うとの期待が市場で高まり、市場のリスク選好姿勢が回復したことなどから、米ドルを中心に上昇に転じました。4月以降は、米中貿易摩擦への懸念や世界的な景気減速懸念などから、円高が進行しました。9月以降は、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待が高まる中で、円安傾向となりました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ ポートフォリオについて

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

◆ ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は4.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.4%となりました。

当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0.03%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ています。

《今後の運用方針》

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

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債 組入比率		債券 先物比率	
	円	騰落率 %	円	騰落率 %	%	%	%	%
(期首) 2018年11月30日	27,598	—	27,840	—	98.3	—	—	—
12月末	27,423	△ 0.6	27,597	△ 0.9	98.6	—	—	—
2019年1月末	27,253	△ 1.3	27,618	△ 0.8	98.2	—	—	—
2月末	27,636	0.1	27,940	0.4	98.2	—	—	—
3月末	28,006	1.5	28,200	1.3	98.4	—	—	—
4月末	27,927	1.2	28,146	1.1	98.4	—	—	—
5月末	27,705	0.4	28,117	1.0	98.2	—	—	—
6月末	28,067	1.7	28,358	1.9	98.3	—	—	—
7月末	28,151	2.0	28,429	2.1	98.0	—	—	—
8月末	28,338	2.7	28,650	2.9	98.2	—	—	—
9月末	28,474	3.2	28,848	3.6	98.4	—	—	—
10月末	28,753	4.2	29,007	4.2	98.3	—	—	—
11月末	28,767	4.2	29,059	4.4	98.2	—	—	—
(期末) 2019年12月2日	28,807	4.4	29,079	4.5	98.4	—	—	—

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

外国債券インデックスマザーファンド

■1万円当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	7 (7)
(その他)	(0)
合計	7

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万円当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況 公 社 債

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカ・ドル 245,163	千アメリカ・ドル 145,650 (—)
	カナダ	千カナダ・ドル 13,049	千カナダ・ドル 10,735 (—)
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 7,870	千オーストラリア・ドル 4,835 (—)
	シンガポール	千シンガポール・ドル 2,128	千シンガポール・ドル 930 (—)
	イギリス	千イギリス・ポンド 10,667	千イギリス・ポンド 7,560 (—)
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 9,790	千デンマーク・クローネ 12,592 (—)
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 4,460	千ノルウェー・クローネ — (—)
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 6,090	千スウェーデン・クローネ 1,428 (—)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 60,253	千メキシコ・ペソ 41,228 (—)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 6,155	千マレーシア・リンギット 2,409 (—)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 26,117	千南アフリカ・ランド 5,816 (—)

		買付額	売付額
外	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 10,324	千ポーランド・ズロチ 5,442 (—)
	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 1,797	千ユーロ 1,689 (—)
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 3,520	千ユーロ 2,577 (—)
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 4,744	千ユーロ 2,191 (—)
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 29,328	千ユーロ 16,185 (—)
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 16,941	千ユーロ 12,885 (—)
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 15,235	千ユーロ 10,441 (—)
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 26,499	千ユーロ 15,340 (—)
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 1,163	千ユーロ 1,412 (—)
	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 2,884	千ユーロ 1,837 (—)
国	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 102,115	千ユーロ 64,561 (—)

(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

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.125% 2028/11/15	834,759	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2020/11/15	498,874
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.375% 2029/5/15	768,259	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.625% 2020/2/15	479,739
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2029/8/15	750,065	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2019/11/30	466,429
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2029/2/15	734,613	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.375% 2019/11/15	448,780
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.375% 2048/11/15	611,832	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2020/1/31	434,765
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2021/4/30	596,079	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2020/5/15	428,195
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.875% 2049/5/15	570,800	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 3.5% 2020/4/25	427,619
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.875% 2023/11/30	560,746	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2020/11/15	395,218
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2021/9/30	554,385	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2.5% 2020/10/25	386,822
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2022/11/15	548,827	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2020/5/25	378,099

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国(外貨建)公社債(通貨別)

区 分	当 期			未				
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5年以上	2年以上	2年未満
			千円	%	%	%	%	%
アメリカ	千アメリカ・ドル 788,539	千アメリカ・ドル 827,399	90,749,185	47.6	—	20.7	17.6	9.4
カナダ	千カナダ・ドル 39,501	千カナダ・ドル 43,364	3,582,815	1.9	—	0.9	0.7	0.3
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 42,734	千オーストラリア・ドル 49,725	3,692,093	1.9	—	1.4	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 8,763	千シンガポール・ドル 9,383	752,624	0.4	—	0.2	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 64,723	千イギリス・ポンド 85,751	12,141,510	6.4	—	5.0	1.0	0.3
デンマーク	千デンマーク・クローネ 43,861	千デンマーク・クローネ 58,110	939,640	0.5	—	0.4	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 33,232	千ノルウェー・クローネ 34,453	409,991	0.2	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 48,465	千スウェーデン・クローネ 54,601	625,736	0.3	—	0.2	0.1	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 264,060	千メキシコ・ペソ 276,731	1,552,461	0.8	—	0.5	0.2	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 31,473	千マレーシア・リンギット 33,021	866,480	0.5	—	0.3	0.1	0.0
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 155,177	千南アフリカ・ランド 139,978	1,049,840	0.6	—	0.5	0.0	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 36,091	千ポーランド・ズロチ 37,959	1,063,629	0.6	—	0.2	0.2	0.1

外国債券インデックスマザーファンド

作成期		当 期				末			
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ユ ー ロ	アイルランド	千ユーロ 8,773	千ユーロ 10,203	千円 1,233,215	% 0.6	% —	% 0.5	% 0.1	% —
	オランダ	千ユーロ 23,278	千ユーロ 28,849	千円 3,486,703	1.8	—	1.2	0.6	0.1
	ベルギー	千ユーロ 28,635	千ユーロ 36,287	千円 4,385,678	2.3	—	1.7	0.5	0.1
	フランス	千ユーロ 124,587	千ユーロ 151,726	千円 18,337,689	9.6	—	6.5	2.3	0.8
	ドイツ	千ユーロ 79,375	千ユーロ 96,372	千円 11,647,594	6.1	—	3.7	1.8	0.7
	スペイン	千ユーロ 70,321	千ユーロ 86,239	千円 10,422,888	5.5	—	3.8	1.3	0.4
	イタリア	千ユーロ 119,626	千ユーロ 138,773	千円 16,772,188	8.8	—	5.2	2.6	1.0
	フィンランド	千ユーロ 7,553	千ユーロ 8,500	千円 1,027,361	0.5	—	0.3	0.2	0.0
	オーストリア	千ユーロ 17,305	千ユーロ 21,435	千円 2,590,703	1.4	—	0.9	0.4	0.1
	小計	479,453	578,388	69,904,023	36.7	—	23.9	9.6	3.2
合 計	—	—	187,330,033	98.4	—	54.3	30.3	13.8	

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ア メ リ カ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	千アメリカ・ドル 4,076	千アメリカ・ドル 4,170	千円 457,409	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,551	2,605	285,728	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,534	2,553	280,066	2021/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,153	2,168	237,845	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,249	356,384	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,467	270,660	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,544	279,122	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	8,168	8,171	896,242	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,403	482,995	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,704	516,014	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,568	4,711	516,790	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,234	574,108	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,501	2,509	275,220	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,006	2,020	221,641	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,463	599,187	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,647	1,655	181,602	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,734	1,740	190,883	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,821	2,841	311,665	2021/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	5,094	558,778	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	7,907	7,967	873,908	2021/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,732	2,745	301,108	2021/05/31

区 分	銘 柄	種 類	当 期		未			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,485	3,510	384,979	2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.0000	2,106	2,360	258,946	2021/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	762	83,591	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,071	117,476	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.5000	630	827	90,778	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	940	103,133	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	910	99,874	2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	950	104,258	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	773	1,001	109,852	2029/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	964	1,373	150,683	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	1,091	1,486	163,023	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,326	1,798	197,212	2036/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	747	1,082	118,722	2037/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	746	81,831	2038/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	718	78,799	2038/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,249	1,535	168,454	2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,513	166,032	2039/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,477	162,019	2039/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,663	182,407	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	2,010	2,852	312,892	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,478	2,037	223,516	2040/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,591	2,061	226,072	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,998	219,222	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,754	2,542	278,887	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,891	207,421	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,367	1,745	191,490	2041/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,693	185,736	2041/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,897	208,105	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,550	170,110	2042/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,231	2,457	269,566	2042/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,630	2,899	317,979	2042/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,826	3,309	363,035	2043/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,898	4,387	481,239	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,064	3,879	425,508	2043/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	3,581	4,625	507,278	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	4,117	5,224	572,975	2044/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,657	4,472	490,561	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,834	2,859	313,674	2021/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	6,367	698,340	2024/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,929	4,624	507,250	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	1,301	1,308	143,524	2021/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,625	3,654	400,850	2021/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,163	2,177	238,848	2021/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	6,089	667,930	2024/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,846	4,435	486,516	2044/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,886	2,899	317,970	2021/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,169	3,200	351,051	2021/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,427	2,420	265,485	2022/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,841	640,713	2025/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,763	3,978	436,358	2045/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	1,809	1,813	198,907	2022/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,891	2,900	318,147	2022/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,922	649,606	2025/05/15	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	当 期		未 評 価 額			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	外 貨 建 金 額			
					千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,835	4,435	486,538	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,612	2,620	287,423	2022/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,826	2,844	311,964	2022/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,821	2,858	313,516	2022/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,179	2,201	241,456	2022/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,843	640,959	2025/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,073	4,610	505,707	2045/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,445	2,462	270,071	2022/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,472	2,482	272,229	2022/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	6,022	660,496	2025/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,709	4,298	471,509	2045/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,577	282,685	2022/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,096	3,093	339,301	2020/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,287	6,357	697,260	2022/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,043	3,044	333,923	2020/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,992	5,068	555,948	2022/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,126	3,114	341,625	2021/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,366	5,339	585,641	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,571	282,073	2023/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,428	3,627	397,895	2046/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,309	3,285	360,376	2021/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,262	4,247	465,848	2023/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,002	2,983	327,277	2021/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,123	2,115	232,068	2023/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,029	6,994	767,139	2026/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,450	2,440	267,643	2021/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,070	227,126	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	3,623	397,431	2046/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,700	2,687	294,791	2021/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,500	274,263	2023/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	2,500	2,478	271,841	2021/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,975	326,364	2023/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	5,322	583,802	2026/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	3,507	384,697	2046/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,665	402,009	2021/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,700	3,666	402,135	2021/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,744	300,977	2023/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,379	260,928	2023/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,482	272,322	2023/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	3,042	3,013	330,490	2021/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,500	6,619	726,002	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,976	326,466	2021/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,500	274,241	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,350	3,809	417,776	2046/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,538	278,393	2023/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,400	2,405	263,805	2021/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,000	2,014	220,917	2021/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,561	280,945	2023/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,340	5,529	606,506	2027/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,025	331,810	2022/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,541	278,763	2024/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,545	4,128	452,787	2047/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,025	331,810	2022/02/28	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,346	257,309	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	7,550	7,704	845,026	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,917	319,958	2022/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,700	5,958	653,552	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,500	4,075	447,009	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	3,018	331,017	2022/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	3,046	334,153	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,010	330,194	2022/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,800	5,891	646,226	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,011	330,349	2022/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,437	267,385	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	6,119	671,171	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,920	320,282	2022/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,064	336,107	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,800	4,224	463,342	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,200	3,201	351,193	2022/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	2,021	221,757	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,519	276,297	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	1,500	1,533	168,144	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,528	277,284	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,707	626,048	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,500	3,893	427,035	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,600	394,943	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	2,003	219,761	2020/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,272	358,897	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	2,881	316,028	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,300	2,307	253,109	2021/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,581	392,816	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,300	6,782	743,885	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,516	276,009	2021/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,403	373,337	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,707	296,996	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,848	312,399	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,600	4,197	460,365	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,200	3,228	354,085	2021/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,900	2,982	327,140	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	3,040	333,476	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,500	2,523	276,758	2021/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,200	5,011	549,617	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	7,072	775,742	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,000	3,040	333,472	2021/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,593	284,438	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	2,018	221,416	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,774	413,940	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,595	284,674	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	5,000	5,071	556,258	2021/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,587	283,753	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	3,171	347,880	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,350	367,441	2021/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	4,550	4,730	518,885	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	7,302	800,934	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,200	4,904	537,958	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,545	279,179	2021/08/15

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,661	291,872	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,746	410,949	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,807	417,610	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,500	3,567	391,238	2021/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,680	293,950	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,138	344,205	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,066	336,351	2021/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,683	294,312	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,187	459,317	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,093	448,981	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	7,300	8,120	890,610	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,800	6,001	658,243	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,526	277,057	2020/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,200	350,990	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	5,000	5,240	574,745	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,800	2,855	313,160	2021/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	4,035	442,589	2020/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,500	3,685	404,240	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,597	284,932	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,054	334,962	2022/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	7,077	776,254	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,055	335,117	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,027	332,083	2021/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	4,138	453,869	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,633	288,872	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,600	5,379	590,060	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,029	332,290	2021/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,616	287,007	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,399	372,885	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,559	390,432	2022/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,580	283,067	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,700	3,753	411,728	2022/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,400	3,440	377,353	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,850	5,547	608,415	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,900	7,256	795,872	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,591	393,926	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,912	319,388	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,000	2,013	220,893	2021/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,513	385,361	2022/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,074	337,213	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,516	385,737	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,697	515,233	2021/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,000	4,038	442,931	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,000	4,014	440,277	2022/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,700	4,706	516,155	2021/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,518	385,887	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	2,018	221,432	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,900	6,799	745,735	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,500	3,489	382,755	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,850	4,891	536,474	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,100	3,090	339,011	2021/08/31

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期				末		償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,738	300,335	2026/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,930	431,042	2024/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,992	328,177	2022/09/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,100	5,087	557,947	2021/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,483	272,357	2026/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,981	326,957	2024/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,900	2,880	315,947	2022/10/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,980	326,878	2024/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,550	2,543	278,973	2021/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,500	4,468	490,124	2026/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	2,993	328,293	2029/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,000	2,073	227,430	2049/11/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	243銘柄		788,539	827,399	90,749,185		
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル			
	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	425	591	48,840	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	586	853	70,555	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,351	111,663	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,127	1,704	140,828	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,112	1,695	140,121	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,363	1,962	162,137	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	956	978	80,870	2021/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,751	1,801	148,831	2022/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,561	2,200	181,846	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,251	103,414	2023/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,466	121,157	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,297	1,656	136,851	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,202	99,384	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,369	1,370	113,260	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,837	1,816	150,062	2021/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,480	2,444	201,940	2021/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,198	98,981	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,440	1,405	116,156	2022/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,750	1,723	142,416	2022/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,200	1,250	103,276	2028/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,600	1,610	133,035	2023/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,000	1,017	84,069	2023/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	890	991	81,923	2051/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,305	107,837	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,237	102,235	2024/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	300	301	24,949	2021/02/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,050	1,051	86,888	2021/05/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,400	115,737	2024/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	400	399	32,990	2021/08/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	550	537	44,425	2030/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	800	795	65,686	2021/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	600	592	48,991	2025/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,200	2,196	181,447	2022/02/01	
通貨小計	銘柄数 金 額	33銘柄		39,501	43,364	3,582,815		

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円		
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,420	2,596	192,758	2021/05/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,162	2,447	181,759	2022/07/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,068	2,402	178,422	2023/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,589	3,297	244,830	2027/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,473	2,692	199,901	2024/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,304	2,760	205,002	2029/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,698	3,050	226,523	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,258	1,780	132,199	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,148	3,814	283,223	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,527	113,401	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	807	974	72,372	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	842	1,103	81,902	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,672	3,038	225,619	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,078	2,289	170,007	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	1,633	121,311	2047/03/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,800	1,848	137,247	2021/12/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,800	3,215	238,714	2028/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,550	1,622	120,506	2022/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,400	2,789	207,104	2029/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,770	3,168	235,256	2030/05/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	390	478	35,492	2041/05/21		
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,140	1,192	88,532	2031/06/21		
通貨小計	銘柄数 金 額	22銘柄		42,734	49,725	3,692,093		
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	868	69,631	2027/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	438	456	36,642	2022/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	623	662	53,132	2024/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	359	398	31,925	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	495	500	40,132	2021/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	452	36,287	2042/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	671	698	56,049	2023/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	618	733	58,807	2033/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	325	357	28,686	2029/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	544	43,669	2025/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	781	62,723	2046/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	250	257	20,630	2026/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	460	457	36,722	2021/10/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	500	502	40,325	2022/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	300	314	25,254	2036/08/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	450	452	36,329	2023/02/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	589	47,291	2028/05/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	190	193	15,494	2024/02/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	150	160	12,890	2039/07/01	
	通貨小計	銘柄数 金 額	19銘柄		8,763	9,383	752,624	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,821	1,979	280,223	2025/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	2,477	2,500	354,001	2021/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,682	2,531	358,398	2065/07/22	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,561	221,028	2026/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	2,320	2,319	328,475	2022/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,390	1,489	210,842	2047/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,650	1,824	258,387	2037/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,430	1,711	242,300	2057/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,510	1,590	225,192	2027/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	2,000	2,017	285,618	2023/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	2,300	2,502	354,392	2028/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	930	1,135	160,806	2071/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	1,900	1,940	274,729	2024/04/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	370	419	59,439	2049/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	962	136,229	2054/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	1,300	1,322	187,220	2029/10/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	100	100	14,230	2025/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	8.0000	1,102	1,225	173,498	2021/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,399	198,104	2028/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,340	1,883	266,704	2032/06/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,815	257,072	2025/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,032	3,017	427,250	2036/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,457	2,380	337,088	2038/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	3,288	465,606	2055/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,086	3,558	503,789	2046/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,591	225,395	2027/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,946	3,253	460,610	2042/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,330	1,897	268,612	2030/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,523	2,697	381,965	2049/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	2,251	318,799	2039/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,382	1,490	211,038	2022/03/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,510	2,251	318,798	2034/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,374	2,666	377,591	2060/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,490	352,615	2040/12/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	803	848	120,092	2021/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	2,646	374,713	2052/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,318	328,228	2022/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,066	2,953	418,252	2044/01/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,942	2,068	292,873	2023/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,641	3,124	442,392	2068/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,392	1,538	217,853	2024/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,124	3,185	451,045	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	42銘柄						
	金額				64,723	85,751	12,141,510	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	12,162	23,542	380,681	2039/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	7,550	8,103	131,030	2021/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,262	85,102	2023/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,513	7,420	119,984	2025/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	7,900	8,521	137,791	2027/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,090	4,437	71,752	2029/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	800	822	13,296	2022/11/15	
通貨小計	銘柄数	7銘柄						
	金額				43,861	58,110	939,640	

外国債券インデックスマザーファンド

		当 期			未		
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	千ノルウェー・クローネ 6,998	千ノルウェー・クローネ 7,254	千円 86,324	2021/05/25
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	5,204	5,335	63,492	2023/05/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,393	52,286	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,395	3,484	41,463	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,389	40,340	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,450	3,556	42,323	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,681	43,810	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,250	3,357	39,950	2029/09/06
	通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄		33,232	34,453	409,991
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	千スウェーデン・クローネ 9,095	千スウェーデン・クローネ 9,578	109,770	2020/12/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,155	6,581	75,426	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	9,277	106,319	2022/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	7,025	7,527	86,266	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,595	6,438	73,781	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,680	6,138	70,347	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,550	4,872	55,841	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,900	4,186	47,982	2029/11/12
	通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄		48,465	54,601	625,736
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 15,290	千メキシコ・ペソ 14,327	80,379	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	13,300	14,328	80,382	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	7.2500	13,000	13,088	73,423	2021/12/09
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	13,300	13,866	77,791	2024/09/05
	Mexican Bonos	国債証券	6.7500	5,000	4,977	27,924	2023/03/09
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	20,633	21,421	120,172	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	23,919	26,990	151,417	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	26,468	27,171	152,433	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	11,244	63,083	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	19,544	21,457	120,376	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	12,194	13,684	76,772	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	26,326	26,222	147,108	2021/06/10
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	13,015	13,624	76,435	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	24,599	24,424	137,023	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	18,654	19,472	109,238	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	9,944	10,427	58,497	2034/11/23
	通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄		264,060	276,731	1,552,461
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	千マレーシア・リンギット 573	千マレーシア・リンギット 576	15,134	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	5.2480	738	836	21,946	2028/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,272	33,402	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1600	1,916	1,948	51,119	2021/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,604	42,104	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,374	36,056	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	875	882	23,161	2022/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	754	19,790	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1270	618	646	16,963	2032/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	1,012	26,562	2023/03/15

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千円		
			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,447	37,988	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,186	1,209	31,746	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	600	682	17,897	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,099	28,852	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0480	857	871	22,864	2021/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	737	762	19,997	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161	1,182	31,031	2022/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	820	869	22,826	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,302	1,331	34,933	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	1,037	27,233	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650	670	17,593	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	352	355	9,340	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	900	916	24,051	2022/03/10
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	750	776	20,384	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	890	919	24,130	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,050	1,186	31,121	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,234	32,390	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	800	815	21,404	2023/04/20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	700	768	20,174	2033/11/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	600	685	17,994	2038/06/08
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	671	17,624	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	910	943	24,747	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,100	1,268	33,285	2048/07/06
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400	404	10,620	2024/06/14
通貨小計	銘柄数	34銘柄					
	金額			31,473	33,021	866,480	
				千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	21,934	24,289	182,172	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	11,612	8,234	61,756	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.7500	4,622	4,626	34,696	2021/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	8,904	6,100	45,750	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	9,999	8,330	62,480	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	8,439	8,523	63,925	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	21,552	18,646	139,850	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	11,021	9,668	72,511	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	14,862	13,693	102,701	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	12,644	10,957	82,183	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	10,743	9,717	72,881	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	10,166	9,380	70,357	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	8,679	7,809	58,572	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	13銘柄					
	金額			155,177	139,978	1,049,840	
				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	2,309	2,572	72,095	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,377	3,504	98,195	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.0000	2,127	2,147	60,186	2021/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.7500	3,051	3,069	86,017	2021/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,870	2,981	83,546	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	2,320	2,361	66,162	2022/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,850	2,929	82,073	2023/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,570	2,654	74,385	2024/04/25

外国債券インデックスマザーファンド

		当 期			未		
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	2,040	2,177	61,004	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	—	800	784	21,991	2021/05/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	1,900	1,944	54,472	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	1,104	30,961	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,084	1,172	32,850	2021/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,625	2,855	79,997	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	2,750	2,910	81,543	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,591	2,788	78,143	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄		36,091	37,959	1,063,629	
ユーロ (アイルランド)				千ユーロ	千ユーロ		
	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,131	1,469	177,645	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	504	576	69,706	2023/03/20
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	705	85,295	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	761	941	113,831	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.8000	516	531	64,210	2022/03/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	781	1,017	122,925	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,153	139,445	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	658	79,594	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	—	350	354	42,870	2022/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	500	539	65,237	2028/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	700	789	95,386	2033/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	200	225	27,303	2031/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	700	769	92,996	2029/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	400	469	56,767	2050/05/15
国小計	銘柄数 金 額	14銘柄		8,773	10,203	1,233,215	
ユーロ (オランダ)				千ユーロ	千ユーロ		
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	548	688	83,263	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,239	1,831	221,364	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,555	2,612	315,777	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	900	108,840	2023/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,549	2,790	337,266	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,463	1,555	188,007	2021/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,548	187,107	2022/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,564	189,132	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,504	181,857	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,549	2,610	315,519	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,693	204,669	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,291	1,343	162,404	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,338	1,420	171,662	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,215	146,952	2022/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,200	1,300	157,226	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,432	173,132	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,150	1,254	151,614	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,100	1,149	138,969	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	400	429	51,935	2040/01/15
国小計	銘柄数 金 額	19銘柄		23,278	28,849	3,486,703	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ (ベルギー)		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,399	1,489	180,036	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,274	1,410	170,444	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	758	957	115,755	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,283	1,392	168,256	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	944	1,168	141,198	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	440	640	77,406	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	490	503	60,836	2023/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,400	1,506	182,078	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,096	132,571	2024/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	460	665	80,398	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	300	353	42,750	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,640	1,771	214,144	2028/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	550	629	76,033	2033/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	800	873	105,608	2029/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	600	756	91,406	2050/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,520	304,614	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,704	2,915	352,333	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	877	971	117,425	2022/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,674	2,935	354,787	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,446	1,575	190,406	2021/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,307	158,073	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,497	181,016	2022/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	980	1,450	175,339	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,472	177,988	2023/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	953	1,663	201,032	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,715	207,355	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	1,045	126,376	2034/06/22
国 小 計	銘柄数	27銘柄						
	金 額				28,635	36,287	4,385,678	
ユーロ (フランス)		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	1,985	2,605	314,873	2023/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	4,173	504,376	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,023	4,633	559,975	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,807	4,855	586,882	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	4,483	541,907	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,664	3,319	401,212	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	3,230	3,427	414,288	2021/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,624	4,366	527,791	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	4,097	4,872	588,902	2023/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,084	5,631	680,597	2041/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,167	2,438	294,774	2060/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,146	3,929	474,859	2026/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	4,150	4,457	538,685	2021/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,630	3,946	477,026	2022/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,699	4,583	553,917	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,694	2,918	352,761	2022/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,438	3,968	479,592	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,620	437,583	2023/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,086	3,470	419,405	2024/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,087	5,174	625,346	2030/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,399	3,774	456,180	2024/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,292	3,457	417,884	2025/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,601	2,814	340,115	2025/11/25

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
						外 貨 建 金 額			邦 貨 換 算 金 額
						千 ユーロ	千 円		
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,420	5,162	623,936	2031/05/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,737	3,937	475,853	2026/05/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,969	3,414	412,726	2036/05/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,037	1,375	166,260	2066/05/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,770	2,795	337,842	2021/05/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,300	3,424	413,834	2026/11/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	4,060	490,773	2022/05/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,870	2,337	282,456	2039/06/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,735	330,600	2027/05/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,250	3,023	365,396	2048/05/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,446	295,676	2023/03/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,100	4,424	534,746	2028/05/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,417	292,213	2021/02/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,150	2,470	298,641	2034/05/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,950	3,184	384,917	2028/11/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,452	296,381	2024/03/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,418	171,430	2022/02/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,500	3,027	365,888	2050/05/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,500	2,640	319,109	2029/05/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,246	271,512	2025/03/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,808	218,548	2029/11/25	
国 小 計	銘柄数 金 額	44銘柄			124,587	151,726	18,337,689		
ユ ー ロ (ド イ ツ)					千ユーロ	千ユーロ			
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,251	151,283	2024/01/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,367	2,106	254,630	2027/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	1,362	2,047	247,451	2028/01/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,250	1,818	219,780	2028/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	951	1,599	193,300	2030/01/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,448	2,404	290,554	2031/01/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,775	3,083	372,660	2034/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,071	3,551	429,183	2037/01/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,225	2,272	274,599	2039/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,599	3,194	386,040	2040/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,374	2,385	288,306	2042/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,333	2,415	291,973	2021/01/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,674	1,778	214,895	2021/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,415	1,487	179,757	2021/09/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,807	2,965	358,452	2022/01/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,361	285,407	2022/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,438	3,899	471,270	2044/07/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,743	210,661	2022/09/04	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,508	182,314	2023/02/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,953	236,061	2023/05/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,757	212,398	2023/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,718	207,689	2024/02/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,609	4,270	516,074	2046/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,745	210,998	2024/05/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,542	1,659	200,585	2024/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,319	280,318	2025/02/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,327	281,313	2025/08/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,168	2,311	279,349	2026/02/15	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,850	2,952	356,816	2026/08/15	

区 分		当 期				未		償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,689	204,148	2027/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,478	299,585	2027/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,750	2,306	278,818	2048/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	1,620	195,896	2028/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	2,014	243,428	2028/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,544	307,528	2029/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,966	237,671	2029/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	382	46,183	2050/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	704	85,157	2020/12/11	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	403	48,739	2021/03/12	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	12,203	2021/06/11	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	505	61,109	2021/09/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	202	24,485	2021/12/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,578	1,591	192,351	2021/04/09	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,416	171,222	2021/10/08	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,160	1,178	142,381	2022/04/08	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	2,139	258,587	2022/10/07	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	730	746	90,184	2023/04/14	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,947	235,381	2023/10/13	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,250	2,310	279,187	2024/04/05	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,234	149,206	2024/10/18	
国 小 計	銘柄数 金 額	50銘柄		79,375	96,372	11,647,594		
ユーロ (スペイン)				千ユーロ	千ユーロ			
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,352	3,550	429,080	2029/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,445	2,659	321,379	2025/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	2,365	285,954	2030/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	1,792	2,013	243,359	2025/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,733	1,938	234,261	2026/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,747	1,781	215,333	2021/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,552	2,141	258,843	2046/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,150	1,844	222,967	2066/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,030	2,190	264,794	2026/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	2,080	2,118	255,994	2022/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,500	2,737	330,821	2027/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,850	2,253	272,300	2033/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	2,242	270,968	2027/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	1,300	1,307	158,030	2021/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,000	1,022	123,547	2022/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,600	1,745	211,013	2028/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,300	1,743	210,753	2048/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,400	1,428	172,623	2023/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	2,074	250,663	2028/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	1,200	1,210	146,253	2021/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,900	2,086	252,184	2029/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,100	1,267	153,187	2035/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	900	914	110,530	2024/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,200	2,239	270,651	2029/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	3,233	390,773	2032/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,654	2,544	307,557	2037/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,708	2,952	356,863	2040/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	2,028	245,204	2024/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,873	3,197	386,430	2041/07/30	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,189	2,761	333,711	2025/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,515	2,726	329,501	2021/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,716	328,260	2026/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,246	271,496	2022/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	2,608	3,076	371,829	2023/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	2,242	270,977	2023/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,516	304,086	2028/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	2,422	292,774	2044/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,310	279,196	2024/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,388	288,725	2024/10/31
国 小 計	銘柄数	39銘柄						
	金 額				70,321	86,239	10,422,888	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (イタリア)		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,106	1,475	178,337	2023/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,579	190,888	2026/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,378	408,277	2027/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,979	239,215	2024/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,629	1,961	237,123	2046/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,629	1,676	202,651	2022/04/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,687	1,756	212,299	2025/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,765	1,797	217,285	2032/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,891	2,023	244,574	2025/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,557	188,284	2022/09/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,440	1,583	191,351	2047/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,359	2,410	291,366	2023/03/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,786	1,870	226,042	2026/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,674	1,686	203,887	2021/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	924	979	118,422	2036/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,068	2,115	255,737	2026/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	1,550	1,568	189,567	2023/10/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,358	1,366	165,181	2021/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	1,034	125,006	2067/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,700	1,866	225,599	2033/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,641	198,346	2027/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,376	166,378	2024/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,250	1,282	155,008	2022/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,450	1,802	217,895	2048/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,700	1,828	220,933	2027/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,700	1,734	209,583	2022/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,900	1,978	239,131	2024/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,492	180,330	2038/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,000	2,148	259,633	2028/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	900	919	111,126	2023/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,350	163,168	2025/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	1,500	1,503	181,697	2021/04/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,550	1,767	213,668	2028/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,400	1,508	182,324	2023/10/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,500	1,646	198,958	2025/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	1,200	1,251	151,201	2021/10/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,000	1,206	145,795	2035/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,250	1,651	199,547	2049/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,050	1,073	129,776	2022/07/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	2,205	266,605	2029/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,200	1,264	152,804	2024/07/01

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期				未		償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	1,000	1,075	130,044	2026/07/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	700	813	98,333	2040/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,400	1,402	169,547	2030/04/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	740	735	88,895	2023/01/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	700	688	83,162	2025/02/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	300	297	35,963	2027/01/15	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,754	3,769	455,592	2029/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,220	510,149	2031/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	2,055	3,055	369,334	2033/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,498	3,546	428,582	2034/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,790	3,631	438,844	2037/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,734	2,905	351,198	2021/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,034	3,001	362,782	2039/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,609	315,424	2023/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,589	312,927	2025/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,043	3,017	364,750	2040/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,532	306,138	2026/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,144	2,248	271,779	2021/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,281	2,470	298,554	2021/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,235	270,162	2022/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,657	1,900	229,643	2022/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	2,710	3,126	377,872	2022/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	3,139	379,397	2028/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,162	261,340	2023/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,613	2,380	287,667	2044/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,562	309,691	2024/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	1,729	1,823	220,370	2021/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,525	305,236	2024/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,938	2,341	282,992	2030/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,661	200,789	2021/12/15	
国小計	銘柄数 金 額	71銘柄		119,626	138,773	16,772,188		
ユーロ (フィンランド)				千ユーロ	千ユーロ			
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	414	449	54,373	2031/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	299	36,198	2025/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	411	433	52,343	2026/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	204	24,674	2023/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	400	504	60,982	2047/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	—	770	781	94,401	2022/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	317	38,356	2027/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	370	423	51,145	2034/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	529	64,033	2028/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	530	64,061	2029/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	204	24,698	2024/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	834	100,909	2025/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	3.5000	459	485	58,626	2021/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	488	59,004	2028/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	312	331	40,065	2022/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	477	57,718	2023/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	618	74,768	2042/07/04	
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	587	70,999	2024/04/15	
国小計	銘柄数 金 額	18銘柄		7,553	8,500	1,027,361		

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千 円	千 円	
ユーロ (オーストリア)	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	873	954	115,396	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,208	146,051	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	534	677	81,869	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	200	270	32,742	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	—	900	917	110,901	2023/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	580	612	74,058	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	940	113,689	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	406	49,125	2022/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,000	1,078	130,333	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,200	1,269	153,468	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	300	306	37,053	2024/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,238	149,662	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.5000	1,337	1,435	173,473	2021/09/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,273	2,123	256,635	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,164	140,726	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	878	106,134	2022/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	975	117,943	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	388	850	102,773	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	1,031	124,632	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,044	126,265	2023/10/20
Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	1,021	123,491	2034/05/23	
Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,028	124,272	2024/10/21	
国 小 計	銘柄数	22銘柄					
	金 額			17,305	21,435	2,590,703	
通 貨 小 計	銘柄数	304銘柄					
	金 額			479,453	578,388	69,904,023	
合 計	銘柄数	765銘柄					
	金 額					187,330,033	

(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

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	187,330,033	96.4
コール・ローン等、その他	6,972,473	3.6
投資信託財産総額	194,302,507	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、12月2日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.68円、1カナダ・ドル=82.62円、1オーストラリア・ドル=74.25円、1シンガポール・ドル=80.21円、1イギリス・ポンド=141.59円、1デンマーク・クローネ=16.17円、1ノルウェー・クローネ=11.90円、1スウェーデン・クローネ=11.46円、1メキシコ・ペソ=5.61円、1マレーシア・リンギット=26.24円、1南アフリカ・ランド=7.50円、1ポーランド・ズロチ=28.02円、1ユーロ=120.86円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (188,734,538千円) の投資信託財産総額 (194,302,507千円) に対する比率は、97.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	198,068,481,215円
コール・ローン等	2,812,084,902
公社債（評価額）	187,330,033,946
未収入金	6,597,692,675
未収利息	1,281,708,922
前払費用	46,960,770
(B) 負債	7,603,880,942
未払金	7,600,474,286
未払解約金	3,405,669
その他未払費用	987
(C) 純資産総額（A－B）	190,464,600,273
元本	66,118,107,712
次期繰越損益金	124,346,492,561
(D) 受益権総口数	66,118,107,712口
1万口当り基準価額（C／D）	28,807円

* 期首における元本額は61,445,933,589円、当作成期間中における追加設定元本額は8,771,520,025円、同解約元本額は4,099,345,902円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国債券インデックスV A 653,486,435円、ダイワ国内重視バランスファンド30V A（一般投資家私募）22,093,366円、ダイワ国内重視バランスファンド50V A（一般投資家私募）128,330,909円、ダイワ国際分散バランスファンド30V A（一般投資家私募）41,751,987円、ダイワ国際分散バランスファンド50V A（一般投資家私募）442,528,295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）31,239,348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）413,208,724円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）1,427,469,459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）787,285,961円、D-1's 外国債券インデックス2,452,065円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 314,458円、iFree 外国債券インデックス600,033,543円、iFree 8資産バランス772,093,354円、iFree 年金バランス14,937,740円、DCダイワ外国債券インデックス45,506,848,020円、ダイワ・ライフ・バランス30 786,129,849円、ダイワ・ライフ・バランス50 407,847,078円、ダイワ・ライフ・バランス70 255,622,913円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）420,775,557円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）323,134,588円、DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）107,264,235円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 9,559,864円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 21,464,206円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 3,128,858円、ダイワつみたてインデックス外国債券59,508,551円、ダイワつみたてインデックスバランス30 125,482円、ダイワつみたてインデックスバランス50 40,800円、ダイワつみたてインデックスバランス70 199,958円、ダイワ世界バランスファンド40 V A 198,065,881円、ダイワ世界バランスファンド60 V A 149,085,433円、ダイワ・バランスファンド35 V A 4,935,026,873円、ダイワ・バランスファンド25 V A（適格機関投資家専用）282,957,531円、ダイワ・インデックスセレクト 外国債券144,999,465円、ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド32,445,382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）1,312,096,170円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5,710,869,559円、ダイワライフスタイル25 34,837,008円、ダイワライフスタイル50 61,720,946円、ダイワライフスタイル75 17,127,861円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は28,807円です。

■損益の状況

当期 自 2018年12月1日 至 2019年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	4,146,652,356円
受取利息	4,148,461,403
支払利息	△ 1,809,047
(B) 有価証券売買損益	3,627,775,822
売買益	12,242,413,117
売買損	△ 8,614,637,295
(C) その他費用	△ 44,112,764
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	7,730,315,414
(E) 前期繰越損益金	108,133,819,877
(F) 解約差損益金	△ 7,388,774,492
(G) 追加信託差損益金	15,871,131,762
(H) 合計（D＋E＋F＋G）	124,346,492,561
次期繰越損益金（H）	124,346,492,561

（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4期

(決算日 2020年6月15日)

(作成対象期間 2019年6月18日～2020年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果を東証REIT指数の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			東証REIT指数 (配当込み)		投資信託 証券 組入比率	不動産投信 指数 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末(2017年 6 月15日)	9,782	50	△ 1.7	3,274.94	△ 1.6	98.8	1.4	3
2 期末(2018年 6 月15日)	10,077	45	3.5	3,398.25	3.8	98.7	1.5	321
3 期末(2019年 6 月17日)	11,339	280	15.3	3,934.65	15.8	100.8	1.4	1,249
4 期末(2020年 6 月15日)	9,599	300	△ 12.7	3,448.87	△ 12.3	99.3	2.7	569

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

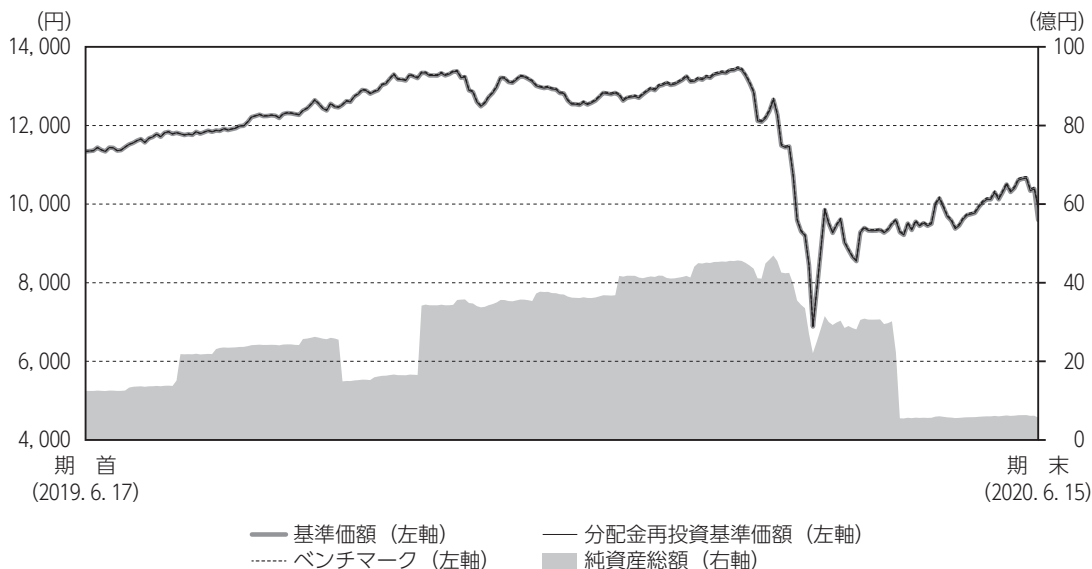
(注3) 投資信託証券および不動産投信指数先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注4) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

* ベンチマークは東証REIT指数 (配当込み) です。

■ 基準価額・騰落率

期首：11,339円

期末：9,599円 (分配金300円)

騰落率：△12.7% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

ベンチマーク (東証REIT指数 (配当込み)) の動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、国内リート市況が下落したことを反映して、基準価額も下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワJ-REITインデックス (ダイワSMA専用)

年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数 (配当込み)		投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指 数 先 物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2019年6月17日	円	%		%	%	%
	11,339	—	3,934.65	—	100.8	1.4
6月末	11,375	0.3	3,947.76	0.3	98.6	1.3
7月末	11,868	4.7	4,120.33	4.7	98.6	1.3
8月末	12,311	8.6	4,275.94	8.7	98.7	1.3
9月末	12,887	13.7	4,477.77	13.8	98.0	1.9
10月末	13,308	17.4	4,625.77	17.6	98.1	1.8
11月末	13,185	16.3	4,584.30	16.5	98.1	1.8
12月末	12,796	12.8	4,450.34	13.1	98.2	1.7
2020年1月末	13,247	16.8	4,608.85	17.1	98.0	1.7
2月末	12,120	6.9	4,218.40	7.2	98.2	1.8
3月末	9,607	△ 15.3	3,343.59	△ 15.0	97.1	2.8
4月末	9,517	△ 16.1	3,313.25	△ 15.8	97.2	2.8
5月末	10,296	△ 9.2	3,586.37	△ 8.9	97.2	2.8
(期末)2020年6月15日	9,899	△ 12.7	3,448.87	△ 12.3	99.3	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

（2019. 6. 18 ～ 2020. 6. 15）

■国内リート市況

国内リート市況は下落しました。

国内リート市況は、当作成期首より、米国の金融政策姿勢が緩和的になったことなどにより日米長期金利が低下したことやリート各社の好調な決算などを背景に上昇し、その後も堅調に推移しました。2020年2月には、新型コロナウイルスの感染拡大の影響により市場がリスク回避に転じ、再び世界的に長期金利が低下したことで国内リート市場はさらに上昇しました。しかし2月下旬に入り、世界景気の減速懸念により投資家のリスク回避姿勢がさらに強まると、大幅に下落しました。その後は、各国の金融・財政政策の発表などを背景に反発しました。5月中旬以降は、新型コロナウイルスの新規国内感染者数の減少や緊急事態宣言の全面解除が見込まれる中で、経済活動正常化への期待もあり、当作成期末にかけて上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■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（東証ＲＥＩＴ指数（配当込み））の動きに連動した投資成果をめざした運用を継続してまいります。

ポートフォリオについて

(2019. 6. 18 ~ 2020. 6. 15)

当ファンド

国内リートへの投資は、「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券を通じて行いました。なお、当作成期末のリート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）は102.0%となっておりますが、翌営業日計上のマザー解約金額を考慮したリート実質組入比率は100%程度となっております。

ダイワJ-REITマザーファンド

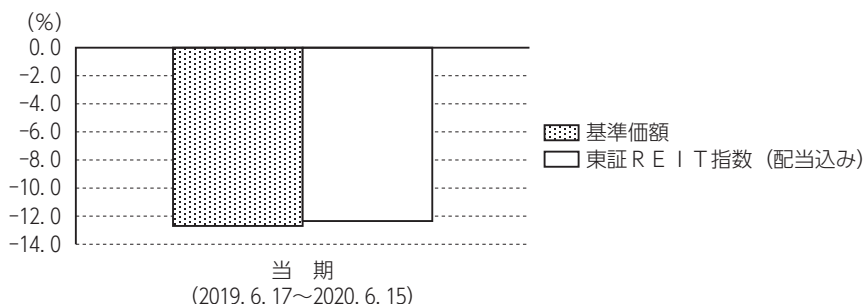
ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物含む。）については、当作成期を通じて99~100%程度としました。

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△12.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△12.7%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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	
	2019年6月18日 ～2020年6月15日	
当期分配金(税込み)	(円)	300
対基準価額比率	(%)	3.03
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)	1,046

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

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

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

収益分配金の計算過程(1万口当り)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 304.31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	900.55
(d) 分配準備積立金	141.43
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,346.30
(f) 分配金	300.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	1,046.30

(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 (2019. 6. 18~2020. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	40円	0.337%	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11,787円です。
(投 信 会 社)	(24)	(0.207)	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)	(0.109)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.003	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)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.006	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	41	0.346	

(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。

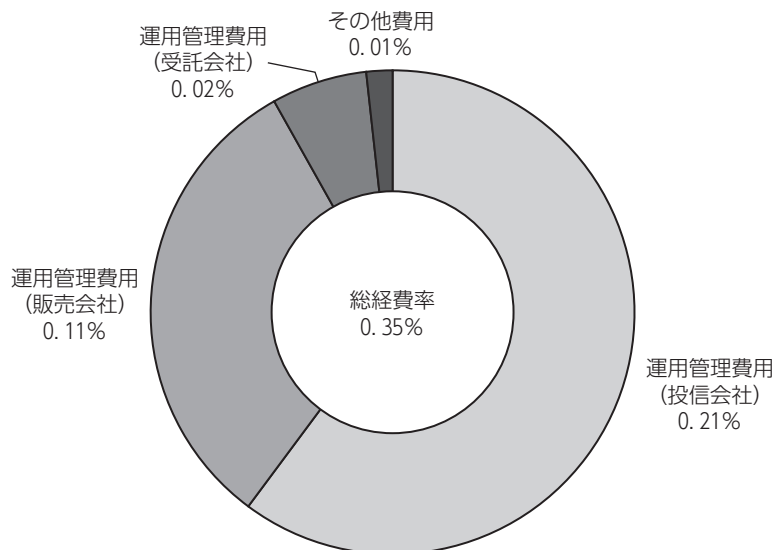
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ Ｊ－ＲＥＩＴ マザーファンド	1,495,222	4,843,120	1,704,037	4,521,453

(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

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	149,643	5,163	3.5	47,329	8,799	18.6
不動産投信 指数先物取引	49,067	8,958	18.3	43,275	8,815	20.4
コール・ローン	1,237,401	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.7%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

種 類	当 期		
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド 買付額	売付額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
投資信託証券	2,972	1,058	10,005

(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

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

種 類	当 期
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド 買付額
	百万円
投資信託証券	2,969

(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

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	67千円
うち利害関係人への支払額 (B)	39千円
(B) / (A)	57.8%

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

*利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、大和証券オフィス投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、大和証券リビング投資法人です。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

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

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワＪ－ＲＥＩＴ マザーファンド	438,357	229,542	586,895

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワＪ－ＲＥＩＴインデックス（ダイワＳＭＡ専用）

■投資信託財産の構成

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワＪ－ＲＥＩＴ マザーファンド	586,895	99.1
コール・ローン等、その他	5,063	0.9
投資信託財産総額	591,958	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	591,958,510円
コール・ローン等	5,057,185
ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド (評価額)	586,895,325
未収入金	6,000
(B) 負債	22,604,620
未払収益分配金	17,794,708
未払信託報酬	4,733,641
その他未払費用	76,271
(C) 純資産総額 (A - B)	569,353,890
元本	593,156,947
次期繰越損益金	△ 23,803,057
(D) 受益権総口数	593,156,947口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,599円

* 期首における元本額は1,101,807,931円、当作成期間中における追加設定元本額は3,863,471,660円、同解約元本額は4,372,122,644円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,599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23,803,057円です。

■損益の状況

当期 自 2019年6月18日 至 2020年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 475円
受取利息	842
支払利息	△ 1,317
(B) 有価証券売買損益	△ 140,755,636
売買益	733,652,826
売買損	△ 874,408,462
(C) 信託報酬等	△ 8,946,938
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 149,703,049
(E) 前期繰越損益金	8,389,206
(F) 追加信託差損益金	135,305,494
(配当等相当額)	(53,417,138)
(売買損益相当額)	(81,888,356)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 6,008,349
(H) 収益分配金	△ 17,794,708
次期繰越損益金 (G + H)	△ 23,803,057
追加信託差損益金	135,305,494
(配当等相当額)	(53,417,138)
(売買損益相当額)	(81,888,356)
分配準備積立金	8,645,335
繰越損益金	△ 167,753,886

(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	18,050,837円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	53,417,138
(d) 分配準備積立金	8,389,206
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	79,857,181
(f) 分配金	17,794,708
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	62,062,473
(h) 受益権総口数	593,156,947口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	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。

《お知らせ》

■商号変更について

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

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

<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（2020年3月16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（2020年6月15日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの主要な売買銘柄 投資信託証券

（2019年6月18日から2020年6月15日まで）

買 付				売 付			
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
日本ビルファンド	13.13	10,117,621	770,572	日本ビルファンド	4.806	3,564,779	741,735
ジャパンリアルエステイト	13.559	9,365,334	690,709	ジャパンリアルエステイト	4.963	3,319,351	668,819
野村不動産マスターＦ	46.726	8,002,539	171,265	野村不動産マスターＦ	15.653	2,446,322	156,284
日本プロロジスリート	24.939	7,093,495	284,433	日本プロロジスリート	7.364	2,075,095	281,789
大和ハウスリート投資法人	20.849	5,805,333	278,446	アドバンス・レジデンス	5.983	1,917,924	320,562
ユナイテッド・アーバン投資法人	31.575	5,513,175	174,605	オリックス不動産投資	9.888	1,840,135	186,097
オリックス不動産投資	27.016	5,499,128	203,550	ユナイテッド・アーバン投資法人	11.142	1,745,581	156,666
日本リテールファンド	25.627	5,166,132	201,589	日本リテールファンド	9.379	1,703,219	181,599
インヴェンシブル投資法人	85.493	4,648,784	54,376	大和ハウスリート投資法人	6.168	1,631,751	264,551
ＧＬＰ投資法人	33.802	4,566,534	135,096	ＧＬＰ投資法人	12.029	1,557,362	129,467

（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、2020年6月15日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（126,932,759千口）の内容です。

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	2020年6月15日現在				ファンド名	2020年6月15日現在			
	口 数	評価額	比 率			口 数	評価額	比 率	
	千口	千円	%		千口	千円	%		
不動産投信				イオンリート投資	39.923	4,367,576	1.3		
エスコンジャパンリート	4.5	463,950	0.1	ヒューリックリート投資法	31.461	4,133,975	1.3		
サンケイリアルエステート	5.361	511,439	0.2	日本リート投資法人	12.016	4,085,440	1.3		
SOSILA 物流リート投	8.242	1,017,062	0.3	インベスコ・オフィス・Jリート	237.663	3,465,126	1.1		
日本アコモデーションファンド投資法人	12.293	7,707,711	2.4	積水ハウス・リート投資	108.165	7,311,954	2.3		
MCUBS MidCity投資法人	47.461	3,739,926	1.2	トーセイ・リート投資法人	8.052	810,836	0.2		
森ヒルズリート	42.562	5,852,275	1.8	ケネディクス商業リート	14.288	2,807,592	0.9		
産業ファンド	47.642	7,713,239	2.4	ヘルスケア & メディカル投資	7.89	948,378	0.3		
アドバンス・レジデンス	35.087	10,392,769	3.2	サムティ・レジデンシャル	7.405	753,088	0.2		
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	24.134	4,276,544	1.3	野村不動産マスターＦ	119.426	16,289,706	5.0		
ＡＰＩ投資法人	18.537	6,784,542	2.1	いちごホテルリート投資	6.128	419,768	0.1		
ＧＬＰ投資法人	92.138	12,715,044	3.9	ラサールロジポート投資	34.395	5,296,830	1.6		
コンフォリア・レジデンシャル	16.107	5,001,223	1.5	スターアジア不動産投	12.277	1,119,662	0.3		
日本プロロジスリート	55.665	16,415,608	5.1	マリモ地方創生リート	3.646	397,414	0.1		
星野リゾート・リート	5.629	2,465,502	0.8	三井不ロジパーク	10.528	4,721,808	1.5		
Oneリート投資法人	5.766	1,455,915	0.4						

ファンド名	2020年6月15日現在		
	口数	評価額	比率
	千口	千円	%
大江戸温泉リート	6,285	415,438	0.1
さくら総合リート	8,004	628,314	0.2
投資法人みらい	42,07	1,623,902	0.5
森トラスト・ホテルリート投	8,679	838,391	0.3
三菱地所物流 REIT	7,282	2,818,134	0.9
CRE ロジスティクスファンド	6,955	1,014,039	0.3
ザイマックス・リート	5,369	510,055	0.2
タカラレーベン不動産投	10,499	930,211	0.3
伊藤忠アドバンスロジ	7,699	992,401	0.3
日本ビルファンド	35,823	23,213,304	7.2
ジャパンリアルエステイト	36,993	20,531,115	6.3
日本リテールファンド	69,917	9,627,570	3.0
オリックス不動産投資	73,708	10,407,569	3.2
日本プライムリアルティ	24,311	7,803,831	2.4
プレミア投資法人	33,413	3,708,843	1.1
東急リアル・エステート	24,802	3,588,849	1.1
グローバル・ワン不動産投資法人	25,688	2,442,928	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人	83,062	9,643,498	3.0
森トラスト総合リート	26,439	3,418,562	1.1
インヴィンシブル投資法人	162,268	4,868,040	1.5
フロンティア不動産投資	13,14	4,480,740	1.4
平和不動産リート	23,037	2,368,203	0.7
日本ロジスティクスファンド投資法人	24,171	6,775,131	2.1
福岡リート投資法人	19,132	2,351,322	0.7
ケネディクス・オフィス投資法人	11,444	6,637,520	2.0
いちごオフィスリート投資法人	28,645	2,114,001	0.7
大和証券オフィス投資法人	8,538	4,986,192	1.5
阪急阪神リート投資法人	16,709	2,132,068	0.7
スターツプロシード投資法人	5,761	1,139,525	0.4
大和ハウスリート投資法人	52,782	13,517,470	4.2
ジャパン・ホテル・リート投資法人	119,171	5,166,062	1.6
大和証券リビング投資法人	45,28605	4,265,945	1.3
ジャパンエクセレント投資法人	34,218	4,328,577	1.3
合計	口数、金額	2,175,68705	312,729,669
	銘柄数 < 比率 >	63 銘柄	< 96.4% >

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2020年6月15日現在	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
東証REIT	8,470	—

(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32期（決算日 2020年3月16日）

（作成対象期間 2019年9月18日～2020年3月16日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

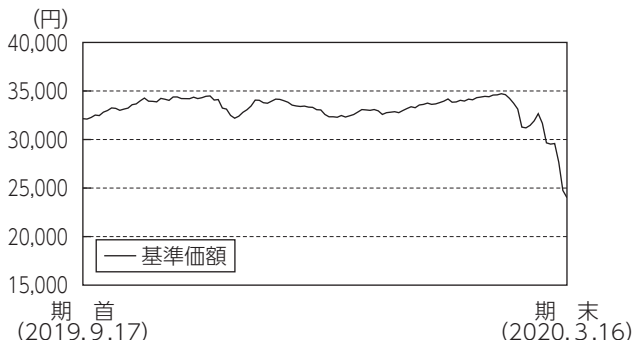
運用方針	東京証券取引所が算出・公表する「東証ＲＥＩＴ指数」（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数(配当込み)		投資信託	不動産投信
	円	%	(ベンチマーク)	騰落率	証券	指数先物
					組入比率	比率
(期首)2019年9月17日	32,146	-	4,334.17	-	%	%
9月末	33,208	3.3	4,477.77	3.3	98.1	1.9
10月末	34,305	6.7	4,625.77	6.7	98.1	1.8
11月末	33,997	5.8	4,584.30	5.8	98.2	1.7
12月末	33,004	2.7	4,450.34	2.7	98.2	1.7
2020年1月末	34,177	6.3	4,608.85	6.3	98.0	1.7
2月末	31,276	△ 2.7	4,218.40	△ 2.7	98.2	1.8
(期末)2020年3月16日	24,011	△25.3	3,237.59	△25.3	95.0	2.8

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
 (注3) 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：32,146円 期末：24,011円 騰落率：△25.3%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク（東証REIT指数（配当込み））の動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、新型コロナウイルスの感染拡大により市場がリスク回避に転じたことを背景に国内リート市況が下落し、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、当作成期首より上昇しました。その後は、米中通商協議の進展期待などを背景に世界的に長期金利や株式が上昇するなど、市場がリスク選好に転じる中で大きく下落する場面がありました。長期金利の上昇の落ち着いたことと相対的に高い配当利回りに再び注目が集まり、国内リート市場は再び上昇に転じました。2020年2月には、新型コロナウイルスの感染拡大により市場がリスク回避に転じ、再び世界的に長期金利が低下したことで、国内リート市場はさらに上昇しました。しかし、2月下旬に入り世界景気の減速懸念により投資家のリスク回避姿勢がさらに強まると、大幅に下落しました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ ポートフォリオについて

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

◆ ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は△25.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△25.3%となりました。

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

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

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

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。
 (注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

ダイワJ-REITマザーファンド

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2019年9月18日から2020年3月16日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内	437.793	83,750,669	189.727 (-)	31,797,757 (-)

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2019年9月18日から2020年3月16日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	百万円	百万円	百万円	百万円
不動産投信指数先物取引	29,208	25,568	-	-

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託証券

(2019年9月18日から2020年3月16日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘	柄	口 数	金 額	平均単価	銘	柄	口 数	金 額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
日本ビルファンド		6.633	5,490,541	827,761	日本ビルファンド		3.161	2,459,494	778,074
ジャパンリアルエステイト		6.85	5,091,514	743,286	ジャパンリアルエステイト		3.264	2,287,990	700,977
野村不動産マスターF		25.387	4,844,542	190,827	野村不動産マスターF		10.425	1,709,212	163,953
日本プロロジスリート		12.324	3,682,562	298,812	日本プロロジスリート		4.829	1,359,522	281,532
大和ハウスリート投資法人		11.494	3,350,187	291,472	オリックス不動産投資		6.504	1,313,582	201,965
オリックス不動産投資		13.649	3,190,953	233,786	ユナイテッド・アーバン投資法人		7.327	1,245,542	169,993
ユナイテッド・アーバン投資法人		15.378	3,125,055	203,215	日本リテールファンド		6.169	1,228,456	199,133
日本リテールファンド		12.946	3,020,657	233,327	大和ハウスリート投資法人		3.95	1,063,479	269,235
アドバンス・レジデンス		7.195	2,496,460	346,971	G L P 投資法人		8.129	1,047,228	128,826
日本プライムリアルティ		4.941	2,423,272	490,441	アドバンス・レジデンス		3.096	972,603	314,148

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当 期		末	
	口数	評 価 額	比 率	%
不動産投信	千口	千円		%
エスコンジャパンリート	4,191	364,617		0.1
サンケイリアルエステート	4,994	438,473		0.2
S O S I L A 物流リート投	7,677	773,073		0.3
日本アコモデーションファンド投資法人	11.45	6,263,150		2.2
MCUBS MidCity投資法人	44,209	3,227,257		1.1
森ヒルズリート	39,646	5,146,050		1.8
産業ファンド	44,378	5,764,702		2.0
アドバンス・レジデンス	32,683	8,834,214		3.0
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	22,481	3,228,271		1.1
API投資法人	17,267	6,311,088		2.2
GLP投資法人	85,825	9,397,837		3.2
コンフォリア・レジデンシャル	15,003	3,968,293		1.4
日本プロロジスリート	51,852	13,797,817		4.8
星野リゾート・リート	5,243	1,766,891		0.6
Oneリート投資法人	5,371	1,319,654		0.5
イオンリート投資	37,188	3,547,735		1.2
ヒューリックリート投資法	29,305	4,005,993		1.4
日本リート投資法人	11,193	3,497,812		1.2
インベスコ・オフィス・Jリート	221,381	3,225,521		1.1
日本ヘルスケア投資法	1,671	268,863		0.1
積水ハウス・リート投資	100,754	6,438,180		2.2
トーセイ・リート投資法人	7.5	731,250		0.3
ケネディクス商業リート	13,309	2,299,795		0.8
ヘルスケア&メディカル投資	7.35	741,615		0.3
サムティ・レジデンシャル	6,898	540,803		0.2
野村不動産マスターF	111,244	13,849,878		4.8
いちごホテルリート投資	5,709	340,827		0.1
ラサールロジポート投資	32,038	4,039,991		1.4
スターアジア不動産投	11,436	938,895		0.3
マリモ地方創生リート	3,397	295,199		0.1
三井不ロジパーク	9,806	3,794,922		1.3
大江戸温泉リート	5,855	319,097		0.1
さくら総合リート	7,455	509,176		0.2
投資法人みらい	39,188	1,491,103		0.5
森トラスト・ホテルリート投	8,085	683,182		0.2
三菱地所物流REIT	6,783	1,954,860		0.7
CREロジスティクスファンド	6,479	662,801		0.2
ザイマックス・リート	5,002	454,181		0.2
タカラレーベン不動産投	9,779	748,093		0.3
伊藤忠アドバンスロジ	7,172	636,873		0.2
日本ビルファンド	33,369	23,024,610		7.9
ジャパンリアルエステイト	34,459	21,536,875		7.4
日本リテールファンド	65,127	9,684,384		3.3

ファンド名	当 期		末	
	口数	評 価 額	比 率	%
オリックス不動産投資	千口	千円		%
オリックス不動産投資	68,659	10,642,145		3.7
日本プライムリアルティ	22,646	7,654,348		2.6
プレミアム投資法人	31,124	3,230,671		1.1
東急リアル・エステート	23,103	2,989,528		1.0
グローバル・ワン不動産投資法人	23,928	2,325,801		0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人	77,371	9,284,520		3.2
森トラスト総合リート	24,628	3,270,598		1.1
インヴィンシブル投資法人	151,151	4,513,368		1.6
フロンティア不動産投資	12,239	3,683,939		1.3
平和不動産リート	21,459	1,972,082		0.7
日本ロジスティクスファンド投資法人	22,515	4,678,617		1.6
福岡リート投資法人	17,821	1,938,924		0.7
ケネディクス・オフィス投資法人	10.66	6,225,440		2.1
いちごオフィスリート投資法人	26,682	2,019,827		0.7
大和証券オフィス投資法人	7,953	4,692,270		1.6
阪急阪神リート投資法人	15,565	1,808,653		0.6
スターツプロシード投資法人	5,366	886,999		0.3
大和ハウスリート投資法人	49,166	11,529,427		4.0
ジャパン・ホテル・リート投資法人	111,007	4,462,481		1.5
日本賃貸住宅投資法人	38,759	3,189,865		1.1
ジャパンエクセレント投資法人	31,874	3,901,377		1.3
合 計	口数、金額	2,024,878	275,764,804	
	銘柄数<比率>	64銘柄		<95.0%>

※エスコンジャパンリート、サンケイリアルエステート、S O S I L A 物流リート、産業ファンド、アドバンス・レジデンス、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人、API投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル、日本プロロジスリート、Oneリート投資法人、イオンリート投資、ヒューリックリート投資法人、日本ヘルスケア投資法人、積水ハウス・リート投資、トーセイ・リート投資法人、ケネディクス商業リート、サムティ・レジデンシャル、マリモ地方創生リート、三井不ロジパーク、三菱地所物流REIT、CREロジスティクスファンド、伊藤忠アドバンスロジ、オリックス不動産投資、日本プライムリアルティ、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、フロンティア不動産投資、平和不動産リート、大和証券オフィス投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、日本賃貸住宅投資法人につきましては、各ファンドで開示されている直近の有価証券報告書または有価証券届出書において、当社の利害関係人等（投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される法人等をいいます。）である大和証券、大和リアル・エステート・アセット・マネジメント・マネジメンが当該ファンドの運用会社または一般事務受託会社となっています。
 (注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。
 (注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別	当 期		末	
	買 建 額	売 建 額	買 建 額	売 建 額
国内	百万円	百万円	百万円	百万円
東証REIT	8,194	-	-	-

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

■投資信託財産の構成

2020年3月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託証券	千円 275,764,804	% 94.3
コール・ローン等、その他	16,597,486	5.7
投資信託財産総額	292,362,290	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年3月16日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	293,498,367,514円
コール・ローン等	2,580,386,975
投資信託証券(評価額)	275,764,804,130
未収入金	8,019,642,011
未収配当金	4,512,762,898
差入委託証拠金	2,620,771,500
(B) 負債	3,159,599,400
未払金	1,412,978,400
未払解約金	543,646,000
差入委託証拠金代用有価証券	1,202,975,000
(C) 純資産総額(A - B)	290,338,768,114
元本	120,918,340,404
次期繰越損益金	169,420,427,710
(D) 受益権総口数	120,918,340,404口
1万口当り基準価額(C/D)	24,011円

* 期首における元本額は104,880,003,327円、当作成期間中における追加設定元本額は23,899,836,933円、同解約元本額は7,861,499,856円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン5,662,998,815円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン(毎月分配型) 104,791,840,087円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン(年1回決算型) 294,605,633円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 632,670円、i F r e e J - R E I T インデックス126,766,257円、i F r e e 8資産バランス747,087,142円、DC・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン4,850,634,662円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 2,400,263円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 5,004,313円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 2,230,516円、ダイワ・ノーロード J - R E I T ファンド86,817,638円、ダイワファンドラップ J - R E I T インデックス1,449,810,932円、ダイワ J - R E I T インデックス(ダイワSMA専用) 1,431,060,162円、ダイワファンドラップオンライン J - R E I T インデックス355,872,964円、ダイワ・インデックスセレクト J - R E I T 1,110,578,350円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,011円です。

■損益の状況

当期 自2019年9月18日 至2020年3月16日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	6,953,065,250円
受取配当金	6,954,122,778
受取利息	9,625
その他収益金	292
支払利息	△ 1,067,445
(B) 有価証券売買損益	△105,826,004,248
売買益	563,985,248
売買損	△106,389,989,496
(C) 先物取引等損益	△ 1,970,135,910
取引益	495,865,210
取引損	△ 2,466,001,120
(D) その他費用	△ 2,879
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	△100,843,077,787
(F) 前期繰越損益金	232,267,935,574
(G) 解約差損益金	△ 17,674,067,144
(H) 追加信託差損益金	55,669,637,067
(I) 合計(E + F + G + H)	169,420,427,710
次期繰越損益金(I)	169,420,427,710

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

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

ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジあり) (ダイワSMA専用)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）	
信託期間	無期限	
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。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。） ロ. 先進国のリート指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券） ハ. 先進国のリートを対象としたリート指数先物取引 ニ. 国内の債券
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率 ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの投資信託証券組入上限比率 先進国REITマザーファンドの株式組入上限比率	無制限
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

運用報告書(全体版) 第4期

(決算日 2020年6月15日)

(作成対象期間 2019年6月18日～2020年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (現地通貨ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	不動産投信 指数 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6月15日)	10,195	80	2.8	10,387	3.9	—	98.7	—	10
2 期末 (2018年 6月15日)	9,848	110	△ 2.3	10,520	1.3	0.8	100.0	1.0	279
3 期末 (2019年 6月17日)	10,580	290	10.4	12,025	14.3	0.6	101.0	1.0	695
4 期末 (2020年 6月15日)	8,945	0	△ 15.5	10,437	△ 13.2	2.2	94.5	3.2	134

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P先進国REIT指数(除く日本)(現地通貨ベース)は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。同指数の所有権およびその他一切の権利は、S & P Dow Jones Indices LLCが有しています。S & P Dow Jones Indices LLCは、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。

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

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

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

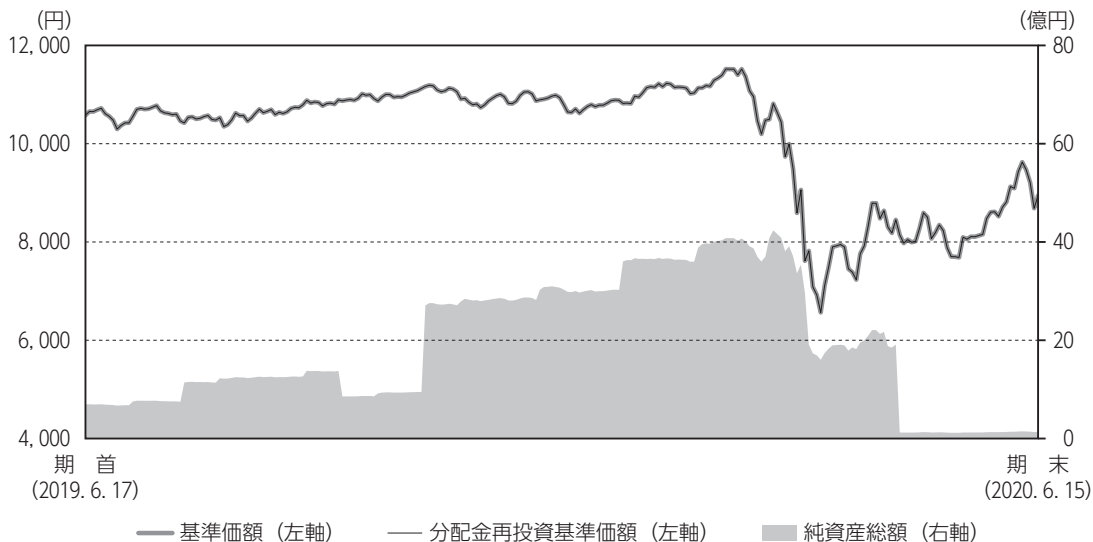
(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

S & P先進国REIT指数(除く日本)〔「当インデックス」〕はS&P Dow Jones Indices LLC(「SPDJI」)の商品であり、これを利用するライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®はStandard & Poor's Financial Services LLC(「S & P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P先進国REIT指数(除く日本)の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：10,580円

期末：8,945円（分配金0円）

騰落率：△15.5%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、米国を中心としたリート市況の下落の影響を受け、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用）

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (現地通貨ベース)		株式組入 比 率	株式先物 比 率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指 数 先 物 比 率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率					
(期首)2019年6月17日	10,580	—	12,025	—	—	—	0.6	101.0	1.0
6月末	10,371	△ 2.0	11,807	△ 1.8	—	—	0.9	97.5	1.2
7月末	10,574	△ 0.1	12,079	0.4	—	—	1.2	97.5	1.3
8月末	10,716	1.3	12,273	2.1	—	—	2.6	93.6	1.5
9月末	10,987	3.8	12,617	4.9	—	—	0.7	99.6	1.8
10月末	11,131	5.2	12,863	7.0	0.0	0.0	9.2	87.8	3.8
11月末	11,057	4.5	12,776	6.3	—	—	2.9	94.7	3.7
12月末	10,874	2.8	12,582	4.6	—	—	2.2	95.4	3.2
2020年1月末	11,133	5.2	12,928	7.5	—	—	1.3	94.7	2.6
2月末	10,466	△ 1.1	12,164	1.2	—	0.0	1.2	96.4	2.9
3月末	7,948	△24.9	9,242	△23.1	—	0.0	1.7	94.3	3.3
4月末	8,593	△18.8	10,018	△16.7	—	—	0.8	95.8	3.2
5月末	8,616	△18.6	10,042	△16.5	—	—	2.1	95.1	3.2
(期末)2020年6月15日	8,945	△15.5	10,437	△13.2	—	—	2.2	94.5	3.2

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

（2019. 6. 18 ~ 2020. 6. 15）

■海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、米中通商協議の行方への懸念はあったものの、米国の利下げ観測の高まりに伴う長期金利低下が支援材料となり、米国を中心に堅調な展開となりました。一方、香港については、民主化デモの影響で軟調に推移しました。その後は長期金利の上昇を背景に米国を中心として上値が重い展開となりましたが、2020年に入ると、米国の対中追加関税回避や長期金利の低下などが支援材料となり、堅調な推移となりました。しかし2月以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大の影響を受けて、大幅に下落しました。3月下旬以降は、各国の財政・金融政策やウイルス治療薬開発への期待などから上昇しました。その後は、新型コロナウイルスによる経済への長期的な影響が意識されて下落する局面はありましたが、当作成期末にかけては、世界的な経済活動の再開期待から、堅調な展開となりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」および「先進国REITマザーファンド」の受益証券に投資します。また、保有外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

■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

（2019. 6. 18 ~ 2020. 6. 15）

■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資を90~110%の範囲で行いました。「先進国REITマザーファンド」の受益証券への投資は、当作成期末現在行っておりません。また、保有外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。

なお、マザーファンドの組入比率が100%程度にならないのは、為替の売りヘッジ予約による評価損益が発生する影響が主要因です。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

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

■先進国REITマザーファンド

海外リート組入比率（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。

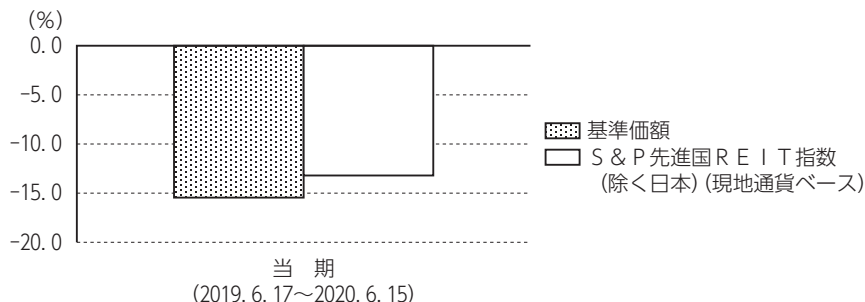
海外リートポートフォリオにつきましては、S & P先進国REIT指数（除く日本）採用銘柄の中から流動性の高い海外リートを中心に通常50銘柄程度で組成し、結果として時価総額の大きい海外リートを主としたポートフォリオとなりました。なお、運用の効率化を図るため、ETFおよび不動産投信指数先物取引も利用しました。

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。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」については、配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。また、組み入れている不動産投資信託証券ポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のズレも、かい離要因としてあげられます。なお、為替ヘッジを行う時に、通貨間の金利差などによる損益（為替ヘッジコスト）が発生します。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益を計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2019年6月18日 ～2020年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（%）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	1,412

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」および「先進国REITマザーファンド」の受益証券に投資します。また、保有外貨建資産については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

■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 (2019. 6. 18～2020. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	44円	0.430%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10,153円です。
（投 信 会 社）	(30)	(0.299)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(11)	(0.109)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(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	5	0.051	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）	(1)	(0.009)	
（投資信託受益証券）	(1)	(0.009)	
（投資信託証券）	(3)	(0.034)	
有 価 証 券 取 引 税	3	0.028	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株 式）	(0)	(0.000)	
（投資信託受益証券）	(0)	(0.001)	
（投資信託証券）	(3)	(0.027)	
そ の 他 費 用	8	0.079	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(6)	(0.062)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0.006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(1)	(0.011)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	60	0.588	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

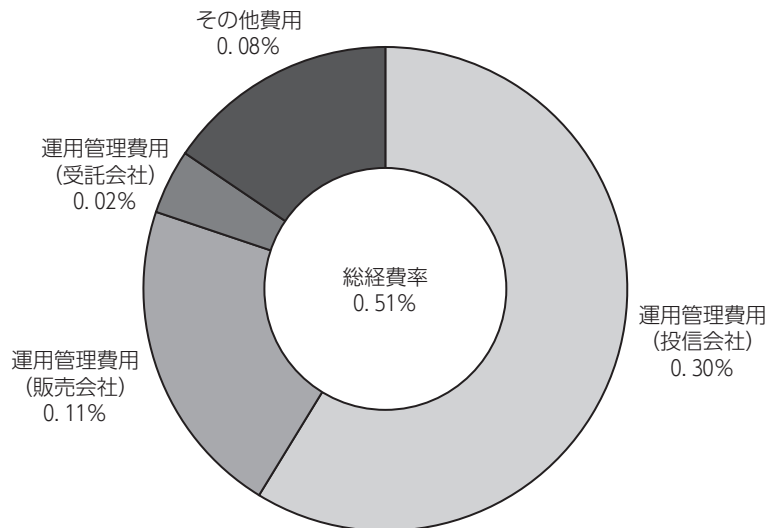
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

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



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2019年6月18日から2020年6月15日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
先進国REIT マザーファンド	622,694	1,114,000	622,694	755,697
ダイワ・グローバルREIT インデックス・ マザーファンド	1,352,978	3,327,820	1,582,490	3,192,520

（注）単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2019年6月18日から2020年6月15日まで）

項 目	当 期
	ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	1,078千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	89千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	11.98

（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	
10	—	—	10	当初設定時における取得

（注1）金額は元本ベース。

（注2）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	□ 数	金 額	□ 数	評 価 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	294,668	65,156	134,755	

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	134,755	96.2
コール・ローン等、その他	5,314	3.8
投資信託財産総額	140,070	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。

（注2）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.24円、1カナダ・ドル=78.66円、1オーストラリア・ドル=73.06円、1香港・ドル=13.84円、1シンガポール・ドル=76.86円、1ニュージーランド・ドル=68.74円、1イギリス・ポンド=134.14円、1イスラエル・シェケル=30.85円、100韓国・ウォン=8.88円、1ユーロ=120.68円です。

（注3）ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（24,335,641千円）の投資信託財産総額（24,807,553千円）に対する比率は、98.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	269,661,237円
コール・ローン等	4,858,236
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）	134,755,750
未収入金	130,047,251
(B) 負債	134,694,777
未払金	129,844,324
未払信託報酬	4,789,897
その他未払費用	60,556
(C) 純資産総額（A－B）	134,966,460
元本	150,887,999
次期繰越損益金	△ 15,921,539
(D) 受益権総口数	150,887,999口
1万口当り基準価額（C/D）	8,945円

* 期首における元本額は657,073,836円、当作成期間中における追加設定元本額は4,068,922,456円、同解約元本額は4,575,108,293円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は8,945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15,921,539円です。

■損益の状況

当期 自 2019年6月18日 至 2020年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 580円
受取利息	1,240
支払利息	△ 1,820
(B) 有価証券売買損益	△ 18,589,651
売買益	686,820,558
売買損	△ 705,410,209
(C) 信託報酬等	△ 8,281,124
(D) 当期繰越損益金 (A + B + C)	△ 26,871,355
(E) 前期繰越損益金	716,459
(F) 追加信託差損益金	10,233,357
(配当等相当額)	(20,591,728)
(売買損益相当額)	(△ 10,358,371)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 15,921,539
次期繰越損益金 (G)	△ 15,921,539
追加信託差損益金	10,233,357
(配当等相当額)	(20,591,728)
(売買損益相当額)	(△ 10,358,371)
分配準備積立金	716,459
繰越損益金	△ 26,871,355

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	20,591,728
(d) 分配準備積立金	716,459
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	21,308,187
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	21,308,187
(h) 受益権総口数	150,887,999口

《お知らせ》

■商号変更について

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

<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「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（2019年12月2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（2020年6月15日）現在におけるダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	483	4,460,146	9,234	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	434.8	4,041,545	9,295

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2019年6月18日から2020年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
EQUINIX INC (アメリカ)	18.3	1,134,713	62,006	PROLOGIS INC (アメリカ)	14.4	133,936	9,301
PROLOGIS INC (アメリカ)	35.5	331,702	9,343	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	12.6	106,219	8,430
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	23	326,648	14,202	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	8.3	89,416	10,773
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	16.9	236,827	14,013	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	5.6	82,808	14,787
WELLTOWER INC (アメリカ)	25.4	211,923	8,343	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	3.5	81,957	23,416
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	8.2	197,274	24,057	LINK REIT (香港)	72.2	75,557	1,046
REALTY INCOME CORP (アメリカ)	24.5	182,622	7,453	WELLTOWER INC (アメリカ)	10.1	69,463	6,877
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	7.7	166,903	21,675	BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)	5.2	65,768	12,647
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	19.5	164,875	8,455	EQUINIX INC (アメリカ)	0.9	65,316	72,573
INVITATION HOMES INC (アメリカ)	51.7	162,617	3,145	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	3.2	63,941	19,981

(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、2020年6月15日現在におけるダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド（11,968,050千円）の内容です。

(1) ファンド・オブ・ファンズが組み入れた外貨建ファンドの明細

(i) 外国投資信託受益証券

ファンド名	2020年6月15日現在			
	口数	評価額		比率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
(アメリカ) VANGUARD REAL ESTATE ETF	62.5	5,039	540,422	2.2

(注1) 邦貨換算金額は、2020年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(ii) 外国投資信託証券

ファンド名	2020年6月15日現在			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
不動産ファンド				
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
(シンガポール)				
MANULIFE US REAL ESTATE INV	279.462	210	22,626	0.1
ARA US HOSPITALITY TRUST	87.8	36	3,907	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90	12	1,322	0.0
PRIME US REIT	99	77	8,334	0.0
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	26.3	392	42,080	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13.7	48	5,186	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	21.982	244	26,237	0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	21.4	246	26,414	0.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC	27.6	4,519	484,671	2.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	60.347	4,585	491,713	2.0
BOSTON PROPERTIES INC	28.3	2,732	292,988	1.2
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	29.267	1,153	123,754	0.5
VORNADO REALTY TRUST	31.164	1,251	134,249	0.5
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	14.6	349	37,435	0.2
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11.7	352	37,791	0.2
NEXPOINT RESIDENTIAL	4.8	166	17,856	0.1
QTS REALTY TRUST INC-CL A	11.4	710	76,212	0.3
EQUITY RESIDENTIAL	68.9	4,379	469,708	1.9
APPLE HOSPITALITY REIT INC	43.8	492	52,795	0.2
EPR PROPERTIES	16.1	591	63,468	0.3
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.5	29	3,152	0.0
CITY OFFICE REIT INC	9.3	93	9,983	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	17.433	270	28,977	0.1
EQUINIX INC	17.4	11,773	1,262,594	5.1
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13.829	319	34,287	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	7.4	56	6,102	0.0
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	7.1	98	10,591	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	11.3	423	45,442	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22.7	261	27,995	0.1
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4.2	166	17,863	0.1
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4.113	16	1,773	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	141.1	1,783	191,262	0.8
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	50.108	1,360	145,892	0.6
CORESITE REALTY CORP	8.1	966	103,672	0.4
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	30.5	798	85,630	0.3
RLJ LODGING TRUST	35.871	398	42,738	0.2
FARMLAND PARTNERS INC	2.9	19	2,120	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	38.8	685	73,564	0.3
CYRUSONE INC	22.3	1,622	173,954	0.7
KIMCO REALTY CORP	83	1,142	122,476	0.5
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7	82	8,895	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	40.75	1,107	118,733	0.5
WHITESTONE REIT	8.5	61	6,645	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	40.1	1,535	164,616	0.7
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	25.4	441	47,368	0.2

ファンド名	2020年6月15日現在			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千□	千アメリカ・ドル	千円	%
PARK HOTELS & RESORTS INC	47.48	550	59,013	0.2
COLONY CAPITAL INC	93.511	257	27,577	0.1
INVITATION HOMES INC	105.897	2,930	314,231	1.3
JBG SMITH PROPERTIES	23.232	715	76,685	0.3
CLIPPER REALTY INC	1.4	10	1,120	0.0
GLADSTONE LAND CORP	2.5	38	4,115	0.0
AMERICOLD REALTY TRUST	37.7	1,312	140,735	0.6
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	12.3	245	26,315	0.1
VICI PROPERTIES INC	90.7	2,021	216,807	0.9
RETAIL VALUE INC	2.815	37	4,072	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12.5	147	15,791	0.1
BRT APARTMENTS CORP	1.3	14	1,594	0.0
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10.1	81	8,773	0.0
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3.4	306	32,848	0.1
SAFEHOLD INC	2.6	159	17,077	0.1
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29.96	31	3,405	0.0
AMERICAN FINANCE TRUST INC	22.4	190	20,418	0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17.5	300	32,185	0.1
CORECIVIC INC	25.224	312	33,488	0.1
COREPOINT LODGING INC	6.7	27	2,938	0.0
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3.4	49	5,261	0.0
STORE CAPITAL CORP	43.5	1,024	109,859	0.4
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	22.4	162	17,463	0.1
LIFE STORAGE INC	9.2	887	95,158	0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	10.1	302	32,439	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	20.082	226	24,314	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	9.2	73	7,853	0.0
PARAMOUNT GROUP INC	40.7	327	35,091	0.1
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29.2	209	22,483	0.1
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	23.3	955	102,421	0.4
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	23.7	328	35,226	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	29.2	807	86,646	0.4
VENTAS INC	73.279	2,887	309,701	1.3
CARETRUST REIT INC	19.603	367	39,458	0.2
GEO GROUP INC/THE	24.1	306	32,822	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	60.8	817	87,696	0.4
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	10.6	296	31,845	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	42.487	623	66,886	0.3
UMH PROPERTIES INC	5.6	71	7,704	0.0
IRON MOUNTAIN INC	56.5	1,571	168,563	0.7
TERRENO REALTY CORP	13.2	690	74,062	0.3
VEREIT INC	210.008	1,367	146,613	0.6
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	19.62	681	73,052	0.3
SUN COMMUNITIES INC	18.2	2,519	270,183	1.1
ACADIA REALTY TRUST	17.011	241	25,868	0.1
ALEXANDER'S INC	0.4	103	11,078	0.0
PROLOGIS INC	147.019	13,887	1,489,286	6.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	24.2	3,854	413,338	1.7
BRANDYWINE REALTY TRUST	34.7	373	40,003	0.2

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ファンド名	2020年6月15日現在			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千□	千アメリカ・ドル	千円	%
SAUL CENTERS INC	2.4	82	8,874	0.0
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22.945	7	819	0.0
MACK-CALI REALTY CORP	17.7	291	31,224	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	19	1,810	194,199	0.8
COUSINS PROPERTIES INC	28.906	926	99,382	0.4
SITE CENTERS CORP	31.878	256	27,485	0.1
DUKE REALTY CORP	72.3	2,555	274,084	1.1
EASTGROUP PROPERTIES INC	7.6	911	97,729	0.4
ESSEX PROPERTY TRUST INC	12.967	3,237	347,200	1.4
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	25	976	104,746	0.4
FEDERAL REALTY INVS TRUST	13.8	1,248	133,887	0.5
GETTY REALTY CORP	7.703	226	24,286	0.1
WELLTOWER INC	80	4,419	473,915	1.9
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	97.4	2,676	287,033	1.2
HIGHWOODS PROPERTIES INC	20.4	803	86,217	0.3
SERVICE PROPERTIES TRUST	31.7	310	33,281	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	26.3	813	87,291	0.4
EQUITY COMMONWEALTH	23.975	793	85,128	0.3
KILROY REALTY CORP	19.2	1,213	130,129	0.5
LTC PROPERTIES INC	8.4	316	33,888	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	48.8	499	53,589	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	22.428	2,670	286,408	1.2
MACERICH CO/THE	21.979	214	23,004	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	35.8	2,272	243,750	1.0
NATL HEALTH INVESTORS INC	8.8	520	55,858	0.2
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	33.8	1,204	129,184	0.5
REALTY INCOME CORP	67.517	4,080	437,544	1.8
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	22	566	60,798	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8.6	12	1,392	0.0
PUBLIC STORAGE	29.8	5,854	627,869	2.5
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3.9	515	55,248	0.2
REGENCY CENTERS CORP	33.02	1,581	169,581	0.7
RPT REALTY	17.8	131	14,049	0.1
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17.6	135	14,570	0.1
SL GREEN REALTY CORP	16	835	89,566	0.4
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	49	220	23,672	0.1
TAUBMAN CENTERS INC	12	444	47,717	0.2
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6	78	8,364	0.0
UDR INC	57.6	2,251	241,459	1.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2.6	237	25,434	0.1
WP CAREY INC	33.9	2,342	251,244	1.0
WASHINGTON REIT	15.9	366	39,354	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	23.8	481	51,684	0.2
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11.3	10	1,090	0.0
AGREE REALTY CORP	9.9	658	70,612	0.3
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	42.948	1,300	139,507	0.6
CUBESMART	38.1	1,058	113,463	0.5
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45.526	444	47,650	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	52.178	7,096	760,997	3.1

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ファンド名	2020年6月15日現在			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	千□	千アメリカ・ドル	千円	%
CEDAR REALTY TRUST INC	10.8	13	1,424	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	25.5	2,466	264,465	1.1
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7.875	57	6,173	0.0
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2.06	147	15,828	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	15.65	188	20,173	0.1
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	21	282	30,334	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2.2	39	4,220	0.0
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	27	978	104,961	0.4
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6.3	114	12,309	0.0
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	42.342	272	29,197	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	101.8	1,972	211,572	0.9
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21	112	12,070	0.0
DOUGLAS EMMETT INC	32.4	1,006	107,955	0.4
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	40.2	271	29,142	0.1
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	4,945,151 157銘柄	163,670 17,551,980	<70.9%>
	千□	千カナダ・ドル	千円	%
(カナダ)				
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13.1	104	8,202	0.0
SLATE RETAIL REIT - U	3.1	31	2,479	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10.2	181	14,305	0.1
SLATE OFFICE REIT	5.1	19	1,532	0.0
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4.2	88	6,987	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15.2	166	13,092	0.1
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	14.7	168	13,239	0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11.2	63	5,012	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6.2	413	32,558	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	14.9	160	12,634	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	13.5	196	15,450	0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	22.2	326	25,652	0.1
CHOICE PROPERTIES REIT	31	399	31,407	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4.2	64	5,087	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11.9	162	12,777	0.1
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	14.3	309	24,375	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	17.8	873	68,733	0.3
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	16.79	138	10,869	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	28.566	303	23,885	0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	31.7	528	41,542	0.2
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5.4	114	9,034	0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4.7	140	11,017	0.0
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	7.4	256	20,140	0.1
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9.5	123	9,736	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	12.3	515	40,577	0.2
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	329,156 25銘柄	5,852 460,332	<1.9%>
	千□	千オーストラリア・ドル	千円	%
(オーストラリア)				
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	47.52	114	8,332	0.0
CROMWELL PROPERTY GROUP	396.284	336	24,609	0.1

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ファンド名	2020年6月15日現在			
	□ 数	評 価 額		比 率
		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	%
RURAL FUNDS GROUP	78.595	156	11,426	0.0
WAYPOINT REIT	143.83	384	28,056	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	89.168	395	28,859	0.1
CENTURIA OFFICE REIT	84.95	164	12,009	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	222.86	514	37,611	0.2
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	57.547	180	13,201	0.1
NATIONAL STORAGE REIT	206.195	382	27,944	0.1
APN INDUSTRIA REIT	29.76	75	5,500	0.0
GDI PROPERTY GROUP	123.31	140	10,270	0.0
SCENTRE GROUP	1,111.44	2,545	185,952	0.8
ARENA REIT	59.89	138	10,107	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38.3	103	7,583	0.0
BWP TRUST	105.55	402	29,380	0.1
DEXUS	226.31	2,181	159,389	0.6
GPT GROUP	393.13	1,678	122,643	0.5
CHARTER HALL RETAIL REIT	95.4	322	23,558	0.1
MIRVAC GROUP	832.57	1,964	143,553	0.6
STOCKLAND	496.76	1,793	131,018	0.5
ABACUS PROPERTY GROUP	81.12	213	15,587	0.1
GOODMAN GROUP	333.73	4,925	359,882	1.5
VICINITY CENTRES	850.71	1,344	98,201	0.4
CHARTER HALL GROUP	94.46	909	66,459	0.3
INGENIA COMMUNITIES GROUP	45.22	193	14,107	0.1
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,244.609 25銘柄	21,561 1,575,248	<6.4%>
(香港)	千口	千香港・ドル	千円	%
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	287	1,024	14,180	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193	758	10,497	0.0
FORTUNE REIT	311	2,145	29,699	0.1
PROSPERITY REIT	300	684	9,466	0.0
LINK REIT	436.4	29,282	405,268	1.6
CHAMPION REIT	431	1,762	24,397	0.1
香港・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,958.4 6銘柄	35,658 493,509	<2.0%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT	249.483	611	46,979	0.2
FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	126.2	88	6,789	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	455	432	33,222	0.1
AIMS APAC REIT	89	110	8,482	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST	121.8	59	4,587	0.0
FRASERS LOGISTICS & COMMERC	515.89	593	45,599	0.2
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86	65	5,056	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	582.475	1,025	78,793	0.3
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	626.516	1,942	149,277	0.6
CAPITALAND MALL TRUST	599.5	1,228	94,459	0.4
SUNTEC REIT	474.3	697	53,588	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	634	1,198	92,098	0.4

ファンド名	2020年6月15日現在			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千□	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL REIT	388.4	446	34,330	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST	377.456	388	29,881	0.1
ESR-REIT	459.902	183	14,139	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS	161.6	179	13,786	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	148.168	354	27,217	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	308.8	165	12,697	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	149.396	198	15,271	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	86.3	292	22,485	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	467.2	66	5,134	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	309.78	830	63,809	0.3
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	244.5	129	9,959	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	438.484	894	68,751	0.3
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182.1	96	7,417	0.0
SPH REIT	166.6	144	11,140	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	202.1	77	5,980	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	219.4	78	6,070	0.0
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	541.063	216	16,634	0.1
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,411.413 29銘柄	12,797 983,645	<4.0%>
(ニュージーランド)	千□	千ニュージーランド・ドル	千円	%
ARGOSY PROPERTY LTD	158.52	183	12,640	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	320.92	328	22,611	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	76.8	195	13,409	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST	226.22	472	32,500	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	219.82	357	24,554	0.1
ニュージーランド・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,002.28 5銘柄	1,537 105,715	<0.4%>
(イギリス)	千□	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	467.55	375	50,424	0.2
CAPITAL & REGIONAL PLC	10	10	1,381	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	129.57	76	10,271	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	177.71	115	15,447	0.1
PICTON PROPERTY INCOME LTD	121.11	82	11,128	0.0
REGIONAL REIT LTD	81.31	64	8,638	0.0
NEWRIVER REIT PLC	69.33	46	6,240	0.0
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	166.29	279	37,541	0.2
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	135.49	146	19,592	0.1
LXI REIT PLC	94.038	104	14,052	0.1
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	75.2	71	9,582	0.0
AEW UK REIT PLC	25.61	17	2,301	0.0
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	150	113	15,191	0.1
RDI REIT PLC	41.036	31	4,238	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	150.491	932	125,077	0.5
SEGRO PLC	217.46	1,895	254,246	1.0
HAMMERSON PLC	159.92	177	23,746	0.1
UNITE GROUP PLC/THE	73.16	670	89,893	0.4
BRITISH LAND CO PLC	188.77	779	104,552	0.4

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ファンド名	2020年6月15日現在			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	49.381	323	43,400	0.2
INTU PROPERTIES PLC	145.67	10	1,450	0.0
DERWENT LONDON PLC	21.19	636	85,443	0.3
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	236.37	361	48,447	0.2
WORKSPACE GROUP PLC	26.46	183	24,650	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	40.73	284	38,108	0.2
SHAFTESBURY PLC	43.05	251	33,695	0.1
BIG YELLOW GROUP PLC	30.17	302	40,510	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	171.34	354	47,529	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121.6	41	5,554	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC	332.26	461	61,951	0.3
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,752.266 30銘柄	9,201 1,234,291	<5.0%>
(イスラエル)	千口	千イスラエル・シケル	千円	%
REIT 1 LTD	28.84	413	12,758	0.1
イスラエル・シケル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	28.84 1銘柄	413 12,758	<0.1%>
(韓国)	千口	千韓国・ウォン	千円	%
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6	40,500	3,596	0.0
韓国・ウォン通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	6 1銘柄	40,500 3,596	<0.0%>
ユーロ (アイルランド)	千口	千ユーロ	千円	%
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	82.05	112	13,545	0.1
HIBERNIA REIT PLC	116.24	125	15,122	0.1
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	198.29 2銘柄	237 28,667	<0.1%>
ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ	千円	%
WERELDHAVE NV	6.47	53	6,468	0.0
EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	8.23	106	12,792	0.1
NSI NV	3.231	118	14,270	0.1
VASTNED RETAIL NV	3.75	75	9,051	0.0
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	21.681 4銘柄	352 42,583	<0.2%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千円	%
AEDIFICA	4.744	459	55,475	0.2
COFINIMMO	4.24	528	63,755	0.3
BEFIMMO	4.42	177	21,469	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4.61	105	12,684	0.1
RETAIL ESTATES	1.94	113	13,742	0.1
WAREHOUSES DE PAUW SCA	23.34	573	69,191	0.3
MONTEA	2.15	191	23,092	0.1
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	45.444 7銘柄	2,149 259,412	<1.0%>
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千円	%
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	24.53	1,406	169,742	0.7

ファンド名	2020年6月15日現在				
	口数	評価額		比率	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
ICADE	千口 4.85	千ユーロ 317	千円 38,337	% 0.2	
ALTAREA	0.74	104	12,573	0.1	
GECINA SA	9.471	1,104	133,269	0.5	
KLEPIERRE	37.56	691	83,425	0.3	
COVIVIO	7.662	501	60,472	0.2	
MERCIALYS	4.03	32	3,890	0.0	
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	88.843 7銘柄	4,157 501,710	<2.0%>	
ユーロ（ドイツ）		千口	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	27.21	368	44,461	0.2	
HAMBORNER REIT AG	11.98	102	12,392	0.1	
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	39.19 2銘柄	471 56,854	<0.2%>	
ユーロ（スペイン）		千口	千ユーロ	千円	%
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10.53	51	6,220	0.0	
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	42.053	343	41,487	0.2	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	66.1	532	64,214	0.3	
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	118.683 3銘柄	927 111,922	<0.5%>	
ユーロ（イタリア）		千口	千ユーロ	千円	%
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6.24	21	2,579	0.0	
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	6.24 1銘柄	21 2,579	<0.0%>	
ユーロ通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	518.371 26銘柄	8,317 1,003,729	<4.1%>	
合計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	28,196.486 305銘柄	— 23,424,809	<94.6%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2020年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別	2020年6月15日現在	
	買建額	売建額
外	百万円	百万円
DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	543	—
国		
STOXX 600 REAL（ドイツ）	243	—

(注1) 外貨建の評価額は、2020年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

運用報告書 第15期 (決算日 2019年12月2日)

(作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

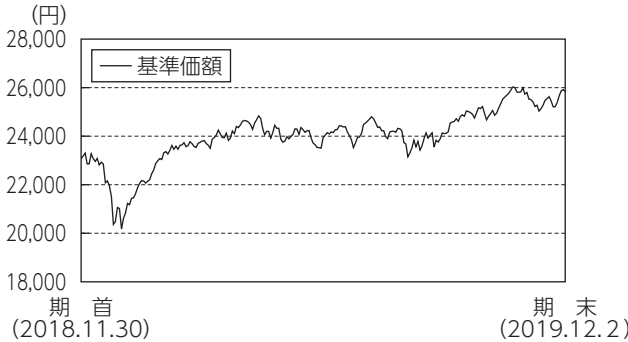
運用方針	S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) に連動した投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場 (上場予定を含みます。) および店頭登録 (登録予定を含みます。) の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		株式 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	不動産 投信指数 先物比率
	円	騰落率	円	騰落率				
(期首)2018年11月30日	23,067	-	26,534	-	-	0.8	97.9	0.9
12月末	21,021	△ 8.9	24,151	△ 9.0	-	0.9	98.2	0.6
2019年1月末	22,989	△ 0.3	26,640	0.4	-	0.7	98.2	0.8
2月末	23,535	2.0	27,167	2.4	-	1.1	97.9	0.8
3月末	24,402	5.8	28,053	5.7	-	0.4	98.4	1.0
4月末	24,325	5.5	27,986	5.5	-	0.5	98.5	1.0
5月末	23,647	2.5	27,421	3.3	-	0.8	98.2	1.0
6月末	23,713	2.8	27,403	3.3	-	0.9	97.8	1.2
7月末	24,306	5.4	28,108	5.9	-	1.2	97.4	1.3
8月末	24,131	4.6	27,908	5.2	-	2.7	95.8	1.5
9月末	25,140	9.0	29,167	9.9	-	0.7	97.5	1.7
10月末	25,993	12.7	30,076	13.3	0.0	0.9	95.5	3.6
11月末	25,916	12.4	30,002	13.1	-	2.0	95.0	2.9
(期末)2019年12月2日	25,842	12.0	29,879	12.6	-	2.0	95.1	2.9

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

《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：23,067円 期末：25,842円 騰落率：12.0%

【基準価額の主な変動要因】

海外リート市場の上昇が主な要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

◆ 投資環境について

○ 海外リート市況

海外リート市況は上昇しました。

米国リート市況は、当作成期首から、米中貿易摩擦問題に加えてFRB (米国連邦準備制度理事会) の利上げ継続姿勢に対する投資家懸念の高まりなどにより株価が急落し、リスク回避の動きが強まったため、下落しました。2019年に入ると、米中貿易摩擦の緩和期待や年内の利上げ停止が示唆され長期金利が低下したこと、また米中貿易交渉の進展期待などから、米国リート市況は上昇に転じました。4月以降しばらくは、米中貿易摩擦が悪材料となったものの好調な決算発表などもあり一進一退の展開となりましたが、その後はFRBによる利下げ観測や好調な住宅市場などが支援材料となり、米国リート市場は堅調に推移しました。当作成期末にかけては、長期金利の上昇や米国議会において香港人権法案が可決された影響などを嫌気して、軟調に推移しました。

欧州リート市況は、当作成期首より、イタリアや英国等の政治的不安定さが嫌気され、総じて下落しました。2019年に入ると、欧米の長期金利低下や好調な業績見通しなどを受けて、フランスや英国を中心に欧州リート市況は上昇しました。しかし2月以降は、英国のEU (欧州連合) 離脱交渉への不透明感に加えて、ユーロ圏の経済見通しの引き下げなどから、上値が重い展開となりました。その中で、好調なオフィス市況などからドイツは上昇しました。その後は、ECB (欧州中央銀行) による金融緩和政策やEU離脱に対する懸念が緩和されたことを受け、英国やフランスを中心に欧州リート市況は上昇しました。

アジア・オセアニアリート市況は、香港は大型商業施設リートの業績への期待継続や中国の景気刺激策で買われましたが、2019年7月以降は反政府デモの影響から売られました。シンガポールは、中国の景気刺激策への期待から堅調に推移しました。オーストラリアは、好調な業績見通しを反映した商業施設リートや低金利の長期化見通しが好感され、上昇しました。

○ 為替相場

為替相場は下落しました。

米ドルは、当作成期首から、米中貿易摩擦の激化が悪材料となって米ドル安となりました。2019年に入ると、米中貿易摩擦に対する懸念が後退しFRB (米国連邦準備制度理事会) が穏健的なスタンスに転じたことから、リスク回避の動きが後退して、米ドル高となりました。しかし5月に入ると、再び激化した米中貿易摩擦が、同じく対米貿易黒字が大きい日本に対する圧力になり、円高が進行しました。当作成期末にかけては、米中貿易摩擦に対する懸念が後退したことでリスク回避の動きが弱まり、米ドル高となりました。

ユーロは、当作成期首から、リスク回避が強まった局面での円への資金流入を受けて、ユーロ安となりました。しかしその後は、日銀総裁がさらなる金融緩和についても言及したことなどによる円に対する警戒感もあり、ボックス圏の推移となりました。2019年5月以降は、英国およびイタリアでの政局混乱や欧州の景況感悪化による金融緩和期待から、ユーロ安が進みました。当作成期末にかけては、米ドル同様にユーロ高となりました。英ポンドもユーロとほぼ同じ動きとなりました。

豪ドルは、当作成期首から他通貨同様に売られました。2019年1月には買い戻された局面もありましたが、4月中旬からは、世界経済の減速懸念が強まったことやオーストラリアの金利低下が続いたことから、再び下落しました。9月以降はそれまでの反動もあり緩やかな豪ドル高となりましたが、11月には市場の利下げ観測の高まりから下落しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

◆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12.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は12.0%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。

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

《今後の運用方針》

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

S & P先進国REIT指数（除く日本）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和証券投資信託委託株式会社に付与されています。Standard & Poor's®およびS & P®はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和証券投資信託委託株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P先進国REIT指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	3円
（株式）	（ 0）
（先物・オプション）	（ 1）
（投資信託受益証券）	（ 0）
（投資信託証券）	（ 2）
有価証券取引税	2
（株式）	（ 0）
（投資信託受益証券）	（ 0）
（投資信託証券）	（ 2）
その他費用	10
（保管費用）	（ 12）
（その他）	（△ 2）
合計	15

（注1）費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

（注2）項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株 式

（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 (0.37)	千アメリカ・ドル — (1)	百株 0.37	千アメリカ・ドル 0

（注1）金額は受渡し代金。

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

（注3）金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託受益証券

（2018年12月1日から2019年12月2日まで）

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 223.6 (—)	千アメリカ・ドル 20,114 (—)	千口 186.1 (—)	千アメリカ・ドル 16,686 (—)

（注1）金額は受渡し代金。

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

（注3）売付()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

（注4）金額の単位未満は切捨て。

(3) 投資信託証券

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
	1,111.2 (△ 176,493)	44,239 (△ 1,368)	183.57 (-)	10,387 (-)
	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
	79.8 (△ 2.7)	1,583 (△ 38)	7.2 (-)	125 (-)
	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
	1,288.09 (△ 27,821)	5,780 (△ 340)	334.08 (-)	1,492 (-)
	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	372.5 (-)	9,517 (-)	54 (-)	3,188 (-)
	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
	2,059 (- 216,674)	2,935 (- 248)	123.7 (-)	251 (-)
千口	千ニューージーランド・ドル	千口	千ニューージーランド・ドル	
204.89 (-)	349 (-)	71.48 (-)	161 (-)	
千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド	
913.9 (△ 164,144)	2,181 (△ 11)	113.31 (-)	534 (-)	
千口	千イスラエル・シケル	千口	千イスラエル・シケル	
19.5 (-)	301 (-)	- (-)	- (-)	
千口	千韓国ウォン	千口	千韓国ウォン	
6 (-)	33,858 (-)	- (-)	- (-)	
千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	
32.81 (△ 111,57)	49 (△ 160)	- (-)	- (-)	
千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	
2.82 (-)	84 (-)	- (-)	- (-)	
千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	
4.54 (- 1,986)	411 (- 67)	1 (-)	0 (-)	

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘	柄	口 数	金 額	平均単価	銘	柄	口 数	金 額	平均単価
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)		千口 223.6	千円 2,187,996	円 9,785	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)		千口 186.1	千円 1,817,478	円 9,766

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	12.96 (- 1,182)	1,140 (-)	15.69 (-)	1,134 (-)
	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	2.28 (-)	30 (△ 13)	- (-)	- (-)
	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
10.84 (-)	123 (△ 6)	11.71 (-)	127 (-)	
国	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	- (△ 143.4)	- (△ 0)	- (-)	- (-)
千口	千ユーロ	千口	千ユーロ	
66.25 (△ 251,802)	1,840 (△ 112)	28.4 (-)	1,262 (-)	

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2018年12月1日から2019年12月2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 2,201	百万円 1,629	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。

(2) 投資信託証券

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
EQUINIX INC (アメリカ)		14.8	904,204	61,094	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		4.8	84,446	17,593
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		11.4	201,937	17,713	PROLOGIS INC (アメリカ)		9.1	80,565	8,853
PROLOGIS INC (アメリカ)		23.2	193,526	8,341	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)		8.3	75,603	9,108
WELLTOWER INC (アメリカ)		18.6	164,254	8,830	PUBLIC STORAGE (アメリカ)		2.1	54,730	26,062
INVITATION HOMES INC (アメリカ)		50.9	154,394	3,033	BOSTON PROPERTIES INC (アメリカ)		3.8	53,870	14,176
PUBLIC STORAGE (アメリカ)		5.4	135,121	25,022	COVIVIO (フランス)		4.29	48,737	11,360
REALTY INCOME CORP (アメリカ)		14.5	111,271	7,673	WELLTOWER INC (アメリカ)		4.7	44,419	9,451
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)		13.1	110,274	8,417	LINK REIT (香港)		34	41,796	1,229
VENTAS INC (アメリカ)		15.3	109,783	7,175	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		1.7	38,339	22,552
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		5	109,042	21,808	ESSEX PROPERTY TRUST INC (アメリカ)		1.1	37,396	33,996

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

(i) 外国投資信託受益証券

ファンド名	口数	当期		比率
		評価額	比率	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
VANGUARD REAL ESTATE ETF	54.5	5,072	556,331	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) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(ii) 外国投資信託証券

ファンド名	口数	当期		比率
		評価額	比率	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
不動産ファンド	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
(シンガポール)				
MANULIFE US REAL ESTATE INV	281.462	271	29,790	0.1
ARA US HOSPITALITY TRUST	87.8	75	8,233	0.0
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22.3	584	64,081	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13.7	107	11,795	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	19,582	405	44,522	0.2
XENIA HOTELS & RESORTS INC	19.1	402	44,118	0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	24.4	5,231	573,802	2.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	53.847	8,142	893,037	3.3
BOSTON PROPERTIES INC	25.2	3,491	382,915	1.4
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	26.067	1,401	153,729	0.6
VORNADO REALTY TRUST	27.464	1,773	194,501	0.7
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	12.1	281	30,868	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10.2	341	37,477	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	3.7	177	19,418	0.1
QTS REALTY TRUST INC-CL A	10.4	551	60,535	0.2
EQUITY RESIDENTIAL	60.9	5,182	568,426	2.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	36.2	588	64,558	0.2
EPR PROPERTIES	13.6	964	105,787	0.4
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.5	42	4,706	0.0
CITY OFFICE REIT INC	9.3	124	13,698	0.1

ファンド名	口数	当期		比率
		評価額	比率	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
GLOBAL NET LEASE INC	15.133	308	33,843	0.1
EQUINIX INC	14.8	8,389	920,147	3.4
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11.829	334	36,742	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	7.4	135	14,852	0.1
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5.7	240	26,432	0.1
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8.8	785	86,123	0.3
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	19.7	359	39,411	0.1
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2.9	138	15,140	0.1
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4.113	40	4,425	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	126.4	2,210	242,473	0.9
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	44.508	1,188	130,388	0.5
CORESITE REALTY CORP	6.4	725	79,594	0.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	27.4	980	107,587	0.4
RLJ LODGING TRUST	29.371	501	55,053	0.2
FARMLAND PARTNERS INC	2.9	19	2,121	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	31.9	612	67,141	0.2
CYRUSONE INC	19.8	1,233	135,294	0.5
KIMCO REALTY CORP	73.8	1,595	175,000	0.6
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7	97	10,687	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	35.95	1,091	119,669	0.4
WHITESTONE REIT	5.8	81	8,931	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	35.7	1,506	165,237	0.6

ファンド名	当 期 末			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22.6	499	54,830	0.2
PARK HOTELS & RESORTS INC	42.48	1,004	110,190	0.4
COLONY CAPITAL INC	83,511	407	44,698	0.2
INVITATION HOMES INC	93,897	2,866	314,416	1.2
JBG SMITH PROPERTIES	20,132	802	88,058	0.3
CLIPPER REALTY INC	1.4	12	1,374	0.0
GLADSTONE LAND CORP	2.5	31	3,476	0.0
AMERICOLD REALTY TRUST	33.9	1,275	139,876	0.5
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	10.5	227	24,921	0.1
VICI PROPERTIES INC	79.8	1,973	216,448	0.8
RETAIL VALUE INC	2,709	96	10,550	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12.5	237	26,076	0.1
BRT APARTMENTS CORP	1.3	23	2,617	0.0
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	7.3	84	9,287	0.0
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1.9	147	16,131	0.1
SAFEHOLD INC	1.3	53	5,824	0.0
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29.96	124	13,669	0.1
AMERICAN FINANCE TRUST INC	18.1	267	29,361	0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	14.2	370	40,634	0.1
CORECIVIC INC	21,424	324	35,599	0.1
COREPOINT LODGING INC	6.7	67	7,429	0.0
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3.4	63	6,913	0.0
STORE CAPITAL CORP	36.4	1,481	162,528	0.6
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	17.8	215	23,661	0.1
LIFE STORAGE INC	8.2	898	98,499	0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	8.7	413	45,353	0.2
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	16,182	241	26,516	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	6.6	90	9,967	0.0
PARAMOUNT GROUP INC	36.3	493	54,107	0.2
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	25.7	358	39,350	0.1
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	18.7	894	98,161	0.4
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	21.1	438	48,043	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	22.6	700	76,817	0.3
VENTAS INC	65,179	3,800	416,848	1.5
CARETRUST REIT INC	17,203	359	39,396	0.1
GEO GROUP INC/THE	20.9	289	31,771	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	52.1	1,143	125,372	0.5
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	9	300	32,930	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,887	732	80,364	0.3
UMH PROPERTIES INC	5.6	87	9,587	0.0
IRON MOUNTAIN INC	50.2	1,612	176,850	0.6
TERRENO REALTY CORP	11.4	658	72,170	0.3
VEREIT INC	184,508	1,800	197,511	0.7
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17.62	923	101,266	0.4
SUN COMMUNITIES INC	15.9	2,618	287,239	1.1
ACADIA REALTY TRUST	14,911	400	43,960	0.2
ALEXANDER'S INC	0.4	130	14,318	0.1
PROLOGIS INC	110,302	10,098	1,107,564	4.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19.8	3,217	352,938	1.3
BRANDYWINE REALTY TRUST	30.3	467	51,278	0.2
SAUL CENTERS INC	1.7	90	9,908	0.0
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	22,945	33	3,623	0.0
MACK-CALI REALTY CORP	15.6	333	36,598	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	16.8	1,874	205,544	0.8
COUSINS PROPERTIES INC	26,006	1,052	115,491	0.4
SITE CENTERS CORP	27,078	392	43,034	0.2
DUKE REALTY CORP	62.6	2,202	241,544	0.9
EASTGROUP PROPERTIES INC	6.6	898	98,586	0.4

ファンド名	当 期 末			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,567	3,610	396,052	1.5
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	22.5	958	105,078	0.4
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12.2	1,611	176,722	0.6
GETTY REALTY CORP	5,703	191	20,991	0.1
WELLTOWER INC	70.8	5,987	656,715	2.4
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	86	2,999	329,004	1.2
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17.7	859	94,251	0.3
SERVICE PROPERTIES TRUST	28	652	71,524	0.3
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22	730	80,086	0.3
EQUITY COMMONWEALTH	20,775	682	74,852	0.3
KILROY REALTY CORP	16.2	1,348	147,902	0.5
LIBERTY PROPERTY TRUST	27.3	1,682	184,506	0.7
LTC PROPERTIES INC	7.2	337	36,965	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	42.2	467	51,283	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	20,028	2,726	298,988	1.1
MACERICH CO/THE	19.1	514	56,415	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	31.5	2,333	255,940	0.9
NATL HEALTH INVESTORS INC	7.4	599	65,734	0.2
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	30	1,672	183,406	0.7
REALTY INCOME CORP	55,617	4,261	467,448	1.7
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	19.3	563	61,768	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8.6	49	5,433	0.0
PUBLIC STORAGE	26.2	5,519	605,413	2.2
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3.4	600	65,852	0.2
REGENCY CENTERS CORP	29.02	1,887	207,016	0.8
RPT REALTY	13.8	203	22,370	0.1
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15.1	229	25,206	0.1
SL GREEN REALTY CORP	14.4	1,228	134,769	0.5
SENIOR HOUSING PROP TRUST	41	300	32,917	0.1
TAUBMAN CENTERS INC	10.5	341	37,405	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6	146	16,037	0.1
UDR INC	50.7	2,436	267,195	1.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2.2	262	28,762	0.1
WP CAREY INC	29.6	2,469	270,825	1.0
WASHINGTON REIT	13.8	428	47,027	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20.6	655	71,939	0.3
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11.3	31	3,408	0.0
AGREE REALTY CORP	7.4	553	60,693	0.2
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	37,848	1,590	174,473	0.6
CUBESMART	34.1	1,051	115,344	0.4
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	38,326	536	58,850	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	36,478	4,412	483,909	1.8
CEDAR REALTY TRUST INC	10.8	28	3,162	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	22.3	2,364	259,383	1.0
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,275	74	8,204	0.0
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2.06	159	17,469	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	15.65	302	33,214	0.1
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	17	260	28,583	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2.2	60	6,589	0.0
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	24.1	1,157	126,983	0.5
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4.7	107	11,742	0.0
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	36,342	374	41,055	0.2
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	86.8	1,801	197,639	0.7
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21	182	20,061	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	28.8	1,269	139,207	0.5
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	36.8	523	57,435	0.2
アメリカ・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	4,202,749 156銘柄	173,820 19,064,636	<70.1%>

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

ファンド名	当 期 末			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	%
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13.1	154	12,782	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	18.4	308	25,509	0.1
SLATE RETAIL REIT - U	3.1	40	3,350	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7.7	153	12,666	0.0
SLATE OFFICE REIT	5.1	30	2,511	0.0
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4.2	96	7,960	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	13.7	170	14,058	0.1
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	10.7	137	11,350	0.0
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4.2	30	2,553	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4.6	315	26,052	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	9.4	131	10,880	0.0
INTERREIT REAL ESTATE INVEST	10.4	171	14,160	0.1
CHOICE PROPERTIES REIT	27.4	376	31,081	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4.2	80	6,610	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11.9	181	14,983	0.1
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12.6	403	33,343	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14.1	781	64,584	0.2
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	16.79	238	19,725	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	26.066	562	46,474	0.2
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	27.6	749	61,887	0.2
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5.4	163	13,549	0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4.7	228	18,844	0.1
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	4.9	148	12,286	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9.5	151	12,503	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10.2	544	45,001	0.2
カナダ・ドル 通 貨 計	□数、金額 25銘柄数<比率>	279,956 6,350	524,713	< 1.9%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	47.52	164	12,208	0.0
CROWMELL PROPERTY GROUP	338.284	414	30,769	0.1
RURAL FUNDS GROUP	50.595	94	7,024	0.0
VIVA ENERGY REIT	76.33	212	15,812	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	68.595	388	28,878	0.1
CENTURIA METROPOLITAN REIT	64.95	205	15,239	0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	170.86	464	34,506	0.1
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	57.547	253	18,800	0.1
NATIONAL STORAGE REIT	135.195	260	19,373	0.1
APN INDUSTRIA REIT	29.76	86	6,408	0.0
GDI PROPERTY GROUP	83.31	128	9,557	0.0
SCENTRE GROUP	985.27	3,881	288,235	1.1
ARENA REIT	59.89	177	13,162	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21.3	69	5,139	0.0
BWP TRUST	90.55	385	28,641	0.1
DEXUS	199.22	2,436	180,907	0.7
GPT GROUP	354.21	2,178	161,745	0.6
CHARTER HALL RETAIL REIT	59.4	273	20,288	0.1
MIRVAC GROUP	728.04	2,453	182,171	0.7
STOCKLAND	442.42	2,234	165,890	0.6
ABACUS PROPERTY GROUP	64.12	248	18,424	0.1
GOODMAN GROUP	296.45	4,393	326,209	1.2
VICINITY CENTRES	584.59	1,566	116,327	0.4
CHARTER HALL GROUP	82.96	896	66,587	0.2
INGENIA COMMUNITIES GROUP	45.22	212	15,780	0.1
オーストラリア・ドル 通 貨 計	□数、金額 25銘柄数<比率>	5,136,586 24,082	1,788,091	< 6.6%>
(香港)	千口	千香港ドル	千円	%
YUEXU REAL ESTATE INVESTMEN	287	1,486	20,828	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193	965	13,519	0.0
FORTUNE REIT	245	2,227	31,200	0.1

ファンド名	当 期 末			
	□ 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
PROSPERITY REIT	千口	千香港ドル	千円	%
LINK REIT	195	579	8,113	0.0
CHAMPION REIT	387.5	31,000	434,310	1.6
香港ドル 通 貨 計	□数、金額 6銘柄数<比率>	1,682.5 38,147	534,451	< 2.0%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT	220.083	440	35,305	0.1
FIRST REAL ESTATE INVST TRUST	126.2	129	10,426	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	409	482	38,710	0.1
AIMS APAC REIT	89	127	10,208	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST	121.8	86	6,936	0.0
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	271.65	336	27,018	0.1
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86	73	5,897	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	520.575	1,046	83,928	0.3
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	539.516	1,607	128,958	0.5
CAPITALAND MALL TRUST	531.5	1,339	107,431	0.4
SUNTEC REIT	419.4	771	61,897	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	528	892	71,572	0.3
KEPPEL REIT	343.4	422	33,879	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST	129.96	217	17,408	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST	213.6	288	23,129	0.1
ESR-REIT	374.902	200	16,087	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS	157.6	255	20,478	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	130.668	360	28,927	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	243.8	175	14,079	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	145.396	231	18,542	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	69.3	225	18,065	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	267.2	64	5,143	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	273.58	686	55,079	0.2
CACHE LOGISTICS TRUST	174.5	124	10,007	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	395.284	932	74,825	0.3
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182.1	134	10,808	0.0
SPH REIT	166.6	176	14,164	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	112.1	58	4,720	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	124.4	58	4,689	0.0
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	148.9	168	13,495	0.0
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	436.063	244	19,586	0.1
シンガポール・ドル 通 貨 計	□数、金額 31銘柄数<比率>	7,952,077 12,360	991,413	< 3.6%>
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
ARGOSY PROPERTY LTD	158.52	223	15,786	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	273.92	432	30,568	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	56.8	151	10,731	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST	188.25	401	28,387	0.1
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	190.24	345	24,387	0.1
ニュージーランド・ドル 通 貨 計	□数、金額 5銘柄数<比率>	867.73 1,555	109,861	< 0.4%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	413.93	313	44,425	0.2
CAPITAL & REGIONAL PLC	59.27	16	2,366	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	99.57	96	13,675	0.1
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	142.71	125	17,720	0.1
PICTON PROPERTY INCOME LTD	88.11	81	11,539	0.0
REGIONAL REIT LTD	81.31	87	12,433	0.0
NEWRIVER REIT PLC	51.33	99	14,099	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	100.49	88	12,577	0.0
LXI REIT PLC	94.038	119	16,989	0.1
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	54.33	48	6,846	0.0

ファンド名	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千円	千円	%
AEW UK REIT PLC	25.61	23	3,372	0.0
RDI REIT PLC	41.036	52	7,413	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	134.841	1,292	182,979	0.7
HANSTEEN HOLDINGS PLC	70.79	73	10,383	0.0
SEGRO PLC	193.21	1,727	244,568	0.9
HAMMERSON PLC	133.92	398	56,354	0.2
UNITE GROUP PLC/THE	52.72	659	93,382	0.3
BRITISH LAND CO PLC	165.49	952	134,873	0.5
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	48.391	402	56,923	0.2
INTU PROPERTIES PLC	145.67	50	7,218	0.0
DERWENT LONDON PLC	18.69	691	97,860	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	213.44	314	44,485	0.2
WORKSPACE GROUP PLC	24.16	268	38,005	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	36.39	275	38,952	0.1
SHAFTESBURY PLC	40.68	368	52,242	0.2
BIG YELLOW GROUP PLC	27.81	307	43,510	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	154.34	358	50,830	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121.6	65	9,297	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC	296.77	439	62,273	0.2
イギリス・ボンド 通 貨 計	3,130.646 29銘柄	9,800	1,387,601	< 5.1% >
(イスラエル) REIT 1 LTD	千口 28.84	千イスラエル・シェケル 657	千円 20,761	% 0.1
イスラエル・シェケル 通 貨 計	28.84 1銘柄	657	20,761	< 0.1% >
(韓国) SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	千口 6	千韓国ウォン 49,740	千円 4,635	% 0.0
韓国ウォン 通 貨 計	6 1銘柄	49,740	4,635	< 0.0% >
ユーロ (アイルランド) IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES HIBERNIA REIT PLC	千口 58.05 116.24	千ユーロ 102 169	千円 12,348 20,483	% 0.0 0.1
国 小 計	174.29 2銘柄	271	32,831	< 0.1% >
ユーロ (オランダ) WERELDHAVE NV EUROCOMMERCIAL PROPRIETE-CV NSI NV VASTNED RETAIL NV	千口 6.47 6.53 3.231 3.75	千ユーロ 140 170 130 103	千円 16,968 20,614 15,776 12,509	% 0.1 0.1 0.1 0.0
国 小 計	19.981 4銘柄	544	65,868	< 0.2% >
ユーロ (ベルギー) AEDIFICA COFINIMMO BEFIMMO INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES RETAIL ESTATES WAREHOUSES DE PAUW SCA MONTEA	千口 4.144 4.07 3.72 3.31 1.94 3.17 1.65	千ユーロ 459 546 217 90 172 509 130	千円 55,593 66,013 26,301 10,901 20,891 61,530 15,774	% 0.2 0.2 0.1 0.0 0.0 0.2 0.1
国 小 計	22.004 7銘柄	2,126	257,004	< 0.9% >
ユーロ (フランス) UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD ICADE ALTAREA GECINA SA KLEPIERRE COVIVIO	千口 23.2 4.56 0.54 9.241 35.24 7.562	千ユーロ 3,292 414 105 1,448 1,147 759	千円 397,880 50,069 12,778 175,124 138,719 91,759	% 1.5 0.2 0.0 0.6 0.5 0.3

ファンド名	当 期 末			
	口 数	評 価 額		比 率
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千ユーロ	千円	%
MERCIALYS	4.03	48	5,844	0.0
国 小 計	84.373 7銘柄	7,216	872,177	< 3.2% >
ユーロ (ドイツ) ALSTRIA OFFICE REIT-AG HAMBORNER REIT AG	千口 26.6 11.98	千ユーロ 441 114	千円 53,302 13,827	% 0.2 0.1
国 小 計	38.58 2銘柄	555	67,130	< 0.2% >
ユーロ (スペイン) LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	千口 10.53 39.553 61.77	千ユーロ 82 452 801	千円 10,028 54,735 96,827	% 0.0 0.2 0.4
国 小 計	111.853 3銘柄	1,337	161,591	< 0.6% >
ユーロ (イタリア) IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	千口 6.24	千ユーロ 40	千円 4,856	% 0.0
国 小 計	6.24 1銘柄	40	4,856	< 0.0% >
ユーロ通貨計	457.321 26銘柄	12,092	1,461,460	< 5.4% >
合 計	23,744.405 305銘柄	-	25,887,626	< 95.1% >

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

(注2) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	601	-
STOXX 600 REAL (ドイツ)	192	-

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

(注2) 単位未満は切捨て。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

■投資信託財産の構成

2019年12月2日現在

項目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	556,331	2.0
投資信託証券	25,887,626	94.8
コール・ローン等、その他	876,644	3.2
投資信託財産総額	27,320,601	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、12月2日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=109.68円、1カナダ・ドル=82.62円、1オーストラリア・ドル=74.25円、1香港ドル=14.01円、1シンガポール・ドル=80.21円、1ニュージーランド・ドル=70.63円、1イギリス・ポンド=141.59円、1イスラエル・シケル=31.56円、100韓国ウォン=9.32円、1ユーロ=120.86円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(26,571,729千円)の投資信託財産総額(27,320,601千円)に対する比率は、97.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2019年12月2日現在

項目	当 期 末	
	(A) 資産	27,977,862,671円
コール・ローン等	697,302,399	
投資信託受益証券(評価額)	556,331,509	
投資信託証券(評価額)	25,887,626,426	
未収入金	680,451,599	
未収配当金	49,262,263	
差入委託証拠金	106,888,475	
(B) 負債	766,513,878	
未払金	766,067,473	
未払解約金	446,040	
その他未払費用	365	
(C) 純資産総額(A-B)	27,211,348,793	
元本	10,530,038,419	
次期繰越損益金	16,681,310,374	
(D) 受益権総口数	10,530,038,419口	
1万口当り基準価額(C/D)	25,842円	

*期首における元本額は8,618,915,071円、当作成期間中における追加設定元本額は3,230,356,134円、同解約元本額は1,319,232,786円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり)4,865,906,045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)735,435,579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)329,451,568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)230,518,876円、D-1's グローバルREITインデックス1,341,811円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 351,124円、iFree 外国REITインデックス98,214,754円、iFree 8資産パランス868,450,594円、グローバル・リート・インデックスファンド(資産形成型)386,949円、DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド2,208,215,204円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 2,681,724円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 6,545,141円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 2,040,991円、ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT 241,290,100円、ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド34,970,209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)690,658,642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)213,192,159円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は25,842円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月1日 至2019年12月2日

項目	当 期	
	(A) 配当等収益	849,462,134円
受取配当金	848,497,084	
受取利息	264,153	
その他収益金	818,968	
支払利息	△	118,071
(B) 有価証券売買損益	1,886,640,609	
売買益	3,314,451,189	
売買損	△	1,427,810,580
(C) 先物取引等損益	33,505,859	
取引益	53,026,668	
取引損	△	19,520,809
(D) その他費用	△	9,633,676
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	2,759,974,926	
(F) 前期繰越損益金	11,262,455,896	
(G) 解約差損益金	△	1,883,826,114
(H) 追加信託差損益金	4,542,705,666	
(I) 合計(E+F+G+H)	16,681,310,374	
次期繰越損益金(I)	16,681,310,374	

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

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

先進国REITマザーファンド

運用報告書 第7期 (決算日 2020年5月8日)

(作成対象期間 2019年5月9日～2020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

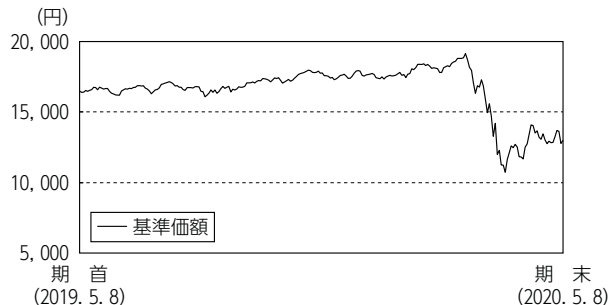
大和アセットマネジメント

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



《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：16,478円 期末：12,975円 騰落率：△21.3%

【基準価額の主な変動要因】

海外リート市況が2020年2月から3月にかけて急落したことで参考指数（S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円ベース））が下落した影響が大きく、当ファンドの基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

◆ 投資環境について

○ 海外リート市況

海外リート市況は、当作成期を通じて下落しました。

米国リート市況は、当作成期首より米中通商協議の行方への懸念があったものの、利下げ観測の高まりに伴う長期金利低下や株価上昇が支援材料となり、上昇しました。2019年11月からは、長期金利が上昇したことや米国議会で香港人権法案が可決された影響などを嫌気して、上値が重い展開となりましたが、2020年に入ると、長期金利の低下などが支援材料となり、堅調に推移しました。しかし2月下旬からは、新型コロナウイルスの米国国内における感染拡大懸念から、複数の州で外出禁止令や在宅勤務令が出されるなど景気後退への懸念が広がり、リスク回避姿勢の高まりもあって大幅な下落となりました。3月末からは、財政・金融支援の拡大を受けてリスク嗜好機運が回復し、上昇に転じて当作成期末を迎えました。カナダリート市況は、当作成期を通じては下落となりました。

欧州リート市況は、当作成期首より、英国のEU（欧州連合）離脱に対する不透明感や欧州圏の景況感の悪化が悪材料となって多くの国では下落したものの、ドイツでは好調なオフィス市況などから上昇しました。2019年9月以降は、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和政策などが好感され上昇基調となりました。2020年2月下旬以降は、イタリアやスペインで感染者が急増したことを嫌気し、大幅な下落となりました。当作成期末にかけては、感染拡大が抑制されたドイツなどは上昇に転じた一方、深刻な状況が続くイタリアなどは横ばいの推移となりました。

アジア・オセアニアリート市況は、香港は、当作成期首からしばらくは堅調な業績見通しを背景に堅調に推移しましたが、2019年7月以降は民主化デモの影響などで下落に転じました。当作成期末にかけても、新型コロナウイルス感染拡大懸念などで軟調でした。シンガポールは、オフィスおよび住宅とも需要が根強く2020年1月までは堅調に推移しましたが、3月には他国同様リスク回避の動きから大幅に下落しました。オーストラリアは、当作成期首から長期金利の低下と中国の景気対策に対する期待で堅調に推移しましたが、2019年9月以降は長期金利が下げ止まって上値が重い展開になりました。2020年2月下旬以降は、新型コロナウイルスによる景気悪化懸念で他国同様下落に転じました。

○ 為替相場

為替相場は対円で下落しました。

対円為替相場において、米ドルは、当作成期首から米中貿易摩擦への懸念が再燃したことやF R B（米国連邦準備制度理事会）関係者が利下げに前向きな姿勢を示し市場の利下げ期待が高まったことから、米ドル安となりました。2019年9月以降は、米中貿易摩擦への懸念が後退したことでリスク嗜好の動きが強まり、緩やかな米ドル高となりました。しかし2020年2月下旬からは、新型コロナウイルスに関する懸念が拡大し市場のリスク回避姿勢が強まったことで円が買われたことから、米ドル安が進みました。その後は、危機時

年月日	基準価額		S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円ベース)		投資信託 受益証券	投資信託 証券先物	不動産投資 指数先物
	円	%	参考指数	騰落率	組入比率	組入比率	比率
(期首) 2019年5月8日	16,478	—	18,270	—	39.4	56.9	3.4
5月末	16,287	△ 1.2	18,142	△ 0.7	22.6	70.7	5.7
6月末	16,424	△ 0.3	18,130	△ 0.8	35.0	59.0	5.3
7月末	16,805	2.0	18,596	1.8	29.3	65.7	4.9
8月末	16,789	1.9	18,464	1.1	15.1	79.5	5.4
9月末	17,374	5.4	19,298	5.6	29.2	67.0	3.5
10月末	17,904	8.7	19,899	8.9	21.3	74.6	4.0
11月末	17,943	8.9	19,850	8.6	4.1	91.1	4.8
12月末	17,813	8.1	19,648	7.5	3.8	90.8	5.3
2020年1月末	18,073	9.7	19,942	9.1	0.3	90.2	3.8
2月末	17,062	3.5	18,920	3.6	—	96.6	3.5
3月末	12,708	△ 22.9	14,007	△ 23.3	7.9	77.3	14.0
4月末	13,692	△ 16.9	15,022	△ 17.8	5.6	85.0	9.3
(期末) 2020年5月8日	12,975	△ 21.3	14,264	△ 21.9	4.5	87.3	8.3

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円ベース）は、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円ベース）の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円ベース）の所有権およびその他一切の権利は、S & P Dow Jones Indices LLC が有しています。S & P Dow Jones Indices LLC は、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。

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

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

(注5) 不動産投資指数先物比率は買建比率－売建比率です。

の米ドル買いから米ドルは急反発し、当作成期末にかけては日米金利差の縮小から緩やかな米ドル安が進みました。

ユーロは、2019年7月以降は、E C B（欧州中央銀行）の金融緩和観測が強まったことや米中貿易摩擦への懸念によるリスク回避の動きから、ユーロ安が進みました。9月以降は、英国のE U（欧州連合）離脱懸念の後退から緩やかなユーロ高となりましたが、2020年に入ると新型コロナウイルスに関する懸念が強まり、最終的には欧州での感染拡大と感染防止のための外出禁止措置による景気の急激な悪化予想から、ユーロ安が進んで当作成期末を迎えました。英ポンドもユーロと同様動きとなりましたが、2020年3月は合意なきE U離脱懸念が強まりユーロ以上に売られる局面がありました。

オーストラリア・ドルは、当作成期首から2020年1月まではボックス圏での推移となりましたが、2020年2月下旬からは世界的なリスク回避の動きを受けて、急激なオーストラリア・ドル安となりました。当作成期末にかけては、自律反発的なオーストラリア・ドル高となりました。

◆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R E I T指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、E T F（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物取引を利用することがあります。また、保有外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行いません。

◆ポートフォリオについて

海外リーートの組入比率（E T F（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物取引を含む。）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R E I T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ートを主としたポートフォリオとなりました。なお、運用の効率化を図るため、E T F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

当作成期を通じて、海外リート組入比率（E T F（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物取引を含む。）を基本的に99%台で推移させました。その結果、参考指数（S & P先進国R E I T指数（除く日本、配当込み、円ベース））の下落に対しプラスのかい離が発生しました。

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

なお、組み入れている流動性の高い海外リートポートフォリオと参考指数との騰落率の差異、参考指数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。

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

《今後の運用方針》

日本を除く先進国の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、S & P先進国R E I T指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、E T F（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投資信託証券)	25円 (3) (5) (17)
有価証券取引税 (投資信託受益証券) (投資信託証券)	16 (1) (15)
その他費用 (保管費用) (その他)	16 (13) (3)
合計	57

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2019年5月9日から2020年5月8日まで)

		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
		294.28 (—)	26,786 (—)	422.6 (—)	38,098 (—)

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2019年5月9日から2020年5月8日まで)

		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
		586.3 (0.393)	20,937 (△71)	597.218 (—)	21,551 (—)
	カナダ	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
		82.4 (—)	1,921 (—)	103.2 (—)	2,373 (—)
オーストラリア	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル	
	1,464.08 (—)	7,024 (—)	1,788.61 (—)	8,621 (—)	
香港	千口	千香港・ドル	千口	千香港・ドル	
346.1 (—)	10,925 (—)	313.4 (—)	13,530 (—)		

先進国REITマザーファンド

	買 付		売 付		
	□ 数	金 額	□ 数	金 額	
外 国	シンガポール	千口 1,186.8 (52,864)	千シンガポール・ドル 2,940 (△4)	千口 1,515.064 (—)	千シンガポール・ドル 3,658 (—)
	イギリス	千口 235.74 (—)	千イギリス・ポンド 2,128 (—)	千口 343.83 (—)	千イギリス・ポンド 2,836 (—)
	ユーロ (ベルギー)	千口 4.89 (—)	千ユーロ 614 (—)	千口 7.52 (—)	千ユーロ 955 (—)
	ユーロ (フランス)	千口 12.16 (—)	千ユーロ 1,514 (—)	千口 19.12 (—)	千ユーロ 2,111 (—)
	ユーロ (スペイン)	千口 53.44 (—)	千ユーロ 605 (—)	千口 69.67 (—)	千ユーロ 808 (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千口 70.49 (—)	千ユーロ 2,734 (—)	千口 96.31 (—)	千ユーロ 3,875 (—)

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の種類別取引状況

(2019年5月9日から2020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 2,443	百万円 2,458	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1)投資信託受益証券

(2019年5月9日から2020年5月8日まで)

買 付	当			平均単価	売 付	期		
	銘 柄	□ 数	金 額			銘 柄	□ 数	金 額
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 294.28	千円 2,898,276	円 9,848	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 422.6	千円 4,134,252	円 9,782	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2019年5月9日から2020年5月8日まで)

銘柄	当 期			期 末			
	買 付		平均単価	売 付		平均単価	
	口 数	金 額		口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	円	千口	千円	円	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD (フランス)	9.24	149,136	16,140	12.36	177,532	14,363	
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	8.6	141,170	16,415	147.4	170,930	1,159	
PROLOGIS INC (アメリカ)	14.7	137,259	9,337	112.05	163,228	1,456	
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS (カナダ)	73.8	134,518	1,822	18.4	161,457	8,774	
UNITE GROUP PLC/THE (イギリス)	89.77	133,289	1,484	132.07	153,067	1,158	
LAND SECURITIES GROUP PLC (イギリス)	106.64	128,310	1,203	144.71	150,426	1,039	
LINK REIT (香港)	100.1	122,635	1,225	530.57	135,641	255	
EQUITY COMMONWEALTH (アメリカ)	34.5	121,908	3,533	81.8	135,441	1,655	
SCENTRE GROUP (オーストラリア)	419.76	120,070	286	570.5	133,787	234	
EQUINIX INC (アメリカ)	1.9	118,751	62,500	615.8	122,249	198	

(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		評 価 額	
		口 数	口 数	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	133.2	4.88	357	38,019	
合 計	口 数、金額	133.2	4.88	357	38,019
	銘柄数 < 比率 >	1銘柄	1銘柄		< 4.5% >

(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) 外国投資信託証券

銘柄	期 首	当 期 末		評 価 額	
		口 数	口 数	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)					
URBAN EDGE PROPERTIES	7.5	9.1	86	9,185	
SIMON PROPERTY GROUP INC	3.9	3.5	199	21,218	
BOSTON PROPERTIES INC	2.5	—	—	—	
VORNADO REALTY TRUST	3.4	—	—	—	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	—	5.1	141	15,047	
EQUITY RESIDENTIAL	5.6	3.7	233	24,812	
EQUINIX INC	—	0.6	405	43,097	

銘柄	期 首	当 期 末		評 価 額	
		口 数	口 数	外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	—	11.3	99	10,552	
HOST HOTELS & RESORTS INC	11.8	8.6	95	10,107	
PHYSICIANS REALTY TRUST	—	8.8	135	14,395	
CYRUSONE INC	2.1	1.6	116	12,370	
KIMCO REALTY CORP	9	6.5	65	6,947	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	—	8.8	144	15,349	
PARK HOTELS & RESORTS INC	5	—	—	—	
INVITATION HOMES INC	6.5	4.8	118	12,564	
VICI PROPERTIES INC	—	7.4	122	13,041	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	0.6	—	—	—	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	8.4	—	—	—	
PARAMOUNT GROUP INC	—	15.4	130	13,922	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	5.5	3.9	157	16,720	
STAG INDUSTRIAL INC	—	5.5	139	14,858	
VENTAS INC	5.3	2.4	64	6,912	
CARETRUST REIT INC	—	3.9	61	6,591	
GEO GROUP INC/THE	3.5	—	—	—	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7.7	—	—	—	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	2.425	—	—	—	
IRON MOUNTAIN INC	4.9	—	—	—	
TERRENO REALTY CORP	—	3	154	16,407	
SUN COMMUNITIES INC	2.5	1.3	170	18,108	
PROLOGIS INC	9.4	5.7	501	53,392	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2.3	—	—	—	
BRANDYWINE REALTY TRUST	—	12.2	123	13,170	
CAMDEN PROPERTY TRUST	—	1.4	122	12,993	

先進国REITマザーファンド

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
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	—	—	—
WELLTOWER INC	4.9	2.3	96	10,274
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	8.5	4.3	100	10,724
SERVICE PROPERTIES TRUST	7.1	7.3	45	4,860
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	—	4.5	132	14,085
EQUITY COMMONWEALTH	11.2	13.3	455	48,463
LEXINGTON REALTY TRUST	22.9	—	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2.6	2.7	163	17,437
NATL HEALTH INVESTORS INC	—	1.6	78	8,369
PUBLIC STORAGE	1.9	1	183	19,518
SL GREEN REALTY CORP	2	—	—	—
AGREE REALTY CORP	4.5	—	—	—
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	4.7	—	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	2.4	2.3	342	36,456
EXTRA SPACE STORAGE INC	2.4	1.6	141	15,004
アメリカ・ドル	□数、金額	185.925	175.4	5,330
通貨計	銘柄数<比率>	34銘柄	33銘柄	<66.8%>
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12.8	—	—	—
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	23	15	136	10,404
カナダ・ドル	□数、金額	35.8	15	136
通貨計	銘柄数<比率>	2銘柄	1銘柄	<1.2%>
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
SCENTRE GROUP	208.48	97.67	207	14,374
GPT GROUP	—	59.32	229	15,936
CHARTER HALL RETAIL REIT	—	17.96	54	3,752
MIRVAC GROUP	189.28	—	—	—
GOODMAN GROUP	67.96	—	—	—
CHARTER HALL GROUP	57.01	23.25	170	11,814
オーストラリア・ドル	□数、金額	522.73	198.2	660
通貨計	銘柄数<比率>	4銘柄	4銘柄	<5.4%>
(香港)	千口	千口	千香港・ドル	千円
FORTUNE REIT	—	66	473	6,501
LINK REIT	69	21.7	1,484	20,364
CHAMPION REIT	—	14	62	858
香港・ドル	□数、金額	69	101.7	2,020
通貨計	銘柄数<比率>	1銘柄	3銘柄	<3.3%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	250.9	87.8	259	19,585
CAPITALAND MALL TRUST	242.2	—	—	—
ASCOTT RESIDENCE TRUST	—	76.8	66	4,977

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	千シンガポール・ドル	千円
MAPLE TREE COMMERCIAL TRUST	—	53.1	101	7,683
シンガポール・ドル	□数、金額	493.1	217.7	427
通貨計	銘柄数<比率>	2銘柄	3銘柄	<3.8%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	42.99	17.56	113	14,893
UNITE GROUP PLC/THE	39.72	17.44	143	18,839
BRITISH LAND CO PLC	60.38	—	—	—
イギリス・ポンド	□数、金額	143.09	35	256
通貨計	銘柄数<比率>	3銘柄	2銘柄	<4.0%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円
COFINIMMO	3.35	0.72	88	10,266
国小計	□数、金額	3.35	0.72	88
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄	<1.2%>
ユーロ (フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4.44	1.32	66	7,622
COVIVIO	3.95	0.11	5	670
国小計	□数、金額	8.39	1.43	71
	銘柄数<比率>	2銘柄	2銘柄	<1.0%>
ユーロ (スペイン)	千口	千口	千ユーロ	千円
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	—	5.27	42	4,863
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	21.5	—	—	—
国小計	□数、金額	21.5	5.27	42
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄	<0.6%>
ユーロ	□数、金額	33.24	7.42	203
通貨計	銘柄数<比率>	4銘柄	4銘柄	<2.8%>
合計	□数、金額	1,482.885	750.42	—
	銘柄数<比率>	50銘柄	50銘柄	<87.3%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は四捨五入。

(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）	52	—
STOXX 600 REAL（ドイツ）	18	—

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年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	38,019	4.3
投資信託証券	740,372	84.4
コール・ローン等、その他	98,891	11.3
投資信託財産総額	877,283	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=106.36円、1カナダ・ドル=76.31円、1オーストラリア・ドル=69.42円、1香港・ドル=13.72円、1シンガポール・ドル=75.36円、1イギリス・ポンド=131.74円、1ユーロ=115.36円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(830,010千円)の投資信託財産総額(877,283千円)に対する比率は、94.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年5月8日現在

項目	当期末
(A)資産	918,551,618円
コール・ローン等	49,072,083
投資信託受益証券（評価額）	38,019,446
投資信託証券（評価額）	740,372,344
未収入金	60,890,520
未収配当金	493,495
差入委託証拠金	29,703,730
(B)負債	69,987,754
未払金	41,987,666
未払解約金	28,000,000
その他未払費用	88
(C)純資産総額（A－B）	848,563,864
元本	653,979,840
次期繰越損益金	194,584,024
(D)受益権総口数	653,979,840口
1万口当り基準価額（C／D）	12,975円

* 期首における元本額は1,939,346,316円、当作成期間中における追加設定元本額は3,722,809,307円、同解約元本額は5,008,175,783円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、先進国REIT（為替ヘッジなし）資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用）19,594,588円、先進国REITファンド（適格機関投資家専用）584,243,417円、堅実バランスファンドーハジメの一步ー1,909,047円、DCダイナミック・アロケーション・ファンド2,390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）48,230,398円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,975円です。

■損益の状況

当期 自2019年5月9日 至2020年5月8日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	92,574,740円
受取配当金	92,149,570
受取利息	85,618
その他収益金	404,685
支払利息	△ 65,133
(B) 有価証券売買損益	△ 558,096,946
売買益	243,965,712
売買損	△ 802,062,658
(C) 先物取引等損益	△ 16,678,376
取引益	40,869,916
取引損	△ 57,548,292
(D) その他費用	△ 2,762,475
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 484,963,057
(F) 前期繰越損益金	1,256,293,519
(G) 解約差損益金	△ 3,163,144,331
(H) 追加信託差損益金	2,586,397,893
(I) 合計 (E + F + G + H)	194,584,024
次期繰越損益金 (I)	194,584,024

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

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

ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）	
信託期間	無期限	
運用方針	海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	イ. ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券 ロ. 先進国REITマザーファンドの受益証券
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
	先進国REITマザーファンド	イ. 先進国（日本を除きます。以下同じ。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。） ロ. 先進国のリート指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券） ハ. 先進国のリートを対象としたリート指数先物取引 ニ. 国内の債券
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率 ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの投資信託証券組入上限比率 先進国REITマザーファンドの株式組入上限比率	無制限
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、配当等収益等を中心に分配を行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

運用報告書(全体版) 第4期

(決算日 2020年6月15日)

(作成対象期間 2019年6月18日～2020年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	不動産投信 指数 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1 期末 (2017年 6月15日)	9,897	100	△ 0.0	9,936	△ 0.6	—	100.1	—	9
2 期末 (2018年 6月15日)	9,694	330	1.3	10,224	2.9	0.8	101.1	1.0	9
3 期末 (2019年 6月17日)	10,304	310	9.5	11,335	10.9	0.6	101.1	1.0	518
4 期末 (2020年 6月15日)	8,440	300	△15.2	9,708	△14.4	2.3	98.0	3.3	424

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

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

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

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

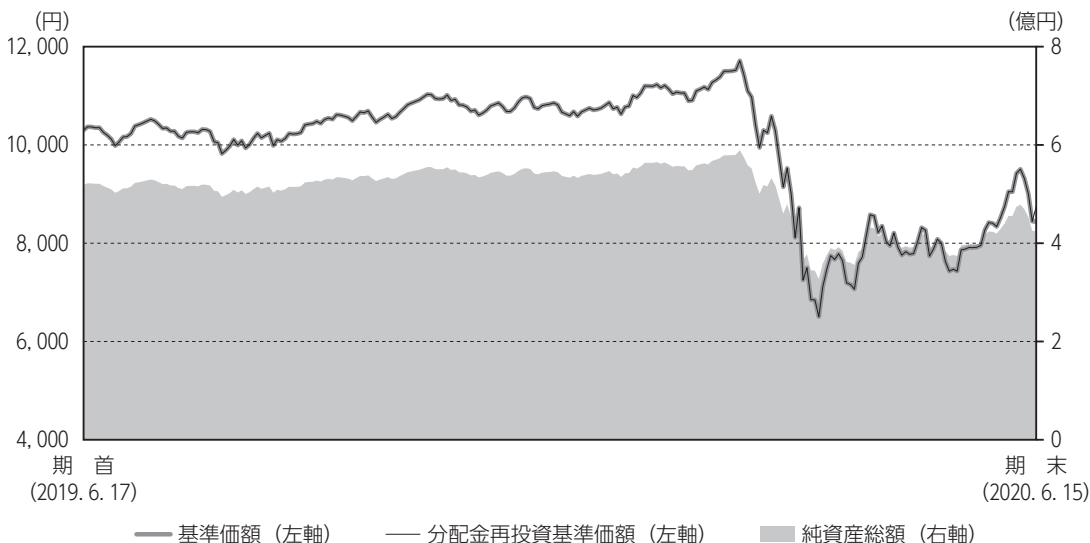
(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

S & P先進国REIT指数（除く日本）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが大和アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®] およびS & P[®] はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S & P」）の登録商標で、Dow Jones[®] はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが大和アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S & Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P先進国REIT指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

基準価額・騰落率

期首：10,304円

期末：8,440円（分配金300円）

騰落率：△15.2%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、米国を中心としたリート市況の下落の影響を受け、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		株 式 組入比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指 先 物 比 率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率				
(期首)2019年6月17日	10,304	—	11,335	—	—	0.6	101.1	1.0
6月末	10,063	△ 2.3	11,100	△ 2.1	—	0.9	97.8	1.2
7月末	10,311	0.1	11,385	0.4	—	1.2	97.4	1.3
8月末	10,233	△ 0.7	11,304	△ 0.3	—	2.7	95.8	1.5
9月末	10,657	3.4	11,814	4.2	—	0.7	97.5	1.8
10月末	11,014	6.9	12,182	7.5	0.0	0.9	95.5	3.6
11月末	10,978	6.5	12,153	7.2	—	2.0	94.9	2.9
12月末	10,863	5.4	12,029	6.1	—	1.2	97.1	1.9
2020年1月末	11,056	7.3	12,209	7.7	—	1.7	96.2	2.1
2月末	10,397	0.9	11,583	2.2	—	1.6	95.7	2.7
3月末	7,783	△ 24.5	8,575	△ 24.3	—	1.5	95.7	2.9
4月末	8,316	△ 19.3	9,197	△ 18.9	—	0.8	96.0	3.2
5月末	8,404	△ 18.4	9,324	△ 17.7	—	2.1	94.8	3.2
(期末)2020年6月15日	8,740	△ 15.2	9,708	△ 14.4	—	2.3	98.0	3.3

(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

（2019. 6. 18 ～ 2020. 6. 15）

海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、米中通商協議の行方への懸念はあったものの、米国の利下げ観測の高まりに伴う長期金利低下が支援材料となり、米国を中心に堅調な展開となりました。一方、香港については、民主化デモの影響で軟調に推移しました。その後は長期金利の上昇を背景に、米国を中心に上値が重い展開となりましたが、2020年に入ると、米国の対中追加関税回避や長期金利の低下などが支援材料となり、堅調な推移となりました。しかし2月以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大の影響を受けて、大幅に下落しました。3月下旬以降は、各国の財政・金融政策やウイルス治療薬開発への期待などから上昇しました。その後は、新型コロナウイルスの感染拡大による経済への長期的な影響が意識されて下落する局面はありましたが、当作成期末にかけては、世界的な経済活動の再開期待から、堅調な展開となりました。

為替相場

為替相場は円高となりました。

当作成期首より、米中貿易摩擦への懸念や世界的な景気減速懸念などから、円高が進行しました。2019年9月以降は、米中貿易摩擦への懸念が後退したことなどから、円安傾向となりました。2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大に関する懸念が拡大し、特に2月下旬から3月中旬にかけて大きく円高が進行しました。その後は、大幅な下落反発などから、円安となりました。当作成期末にかけては、世界的な経済活動の再開期待から、おおむね円安となりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

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。なお、「先進国REITマザーファンド」の受益証券に投資する場合があります。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

■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

(2019. 6. 18 ~ 2020. 6. 15)

■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ100%行いました。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

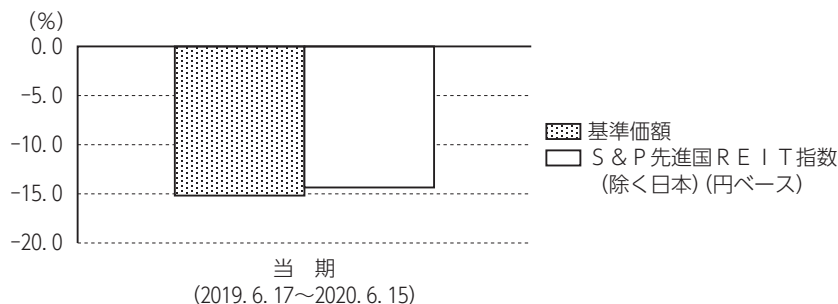
ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエイトで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

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

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

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

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■ 分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2019年6月18日 ～2020年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	300
対基準価額比率	（％）	3.43
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）	233

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

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

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

■ 収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 315.66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	0.91
(d) 分配準備積立金	216.59
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	533.18
(f) 分配金	300.00
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	233.18

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



今後の運用方針

■ 当ファンド

主として「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。ただし、「先進国REITマザーファンド」の受益証券に投資する場合があります。

■ ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

■ 先進国REITマザーファンド

日本を除く先進国の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）を参考に先進国リート市場の中長期的な値動きをおおむね捉える投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2019. 6. 18~2020. 6. 15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	43円	0.430%	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9,931円です。
（投 信 会 社）	(30)	(0.299)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販 売 会 社）	(11)	(0.109)	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	0.020	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)	(0.004)	
（投資信託受益証券）	(0)	(0.004)	
（投資信託証券）	(1)	(0.012)	
有 価 証 券 取 引 税	1	0.014	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株 式）	(0)	(0.000)	
（投資信託受益証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(1)	(0.013)	
そ の 他 費 用	7	0.069	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）	(5)	(0.054)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(1)	(0.009)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	53	0.532	

(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。

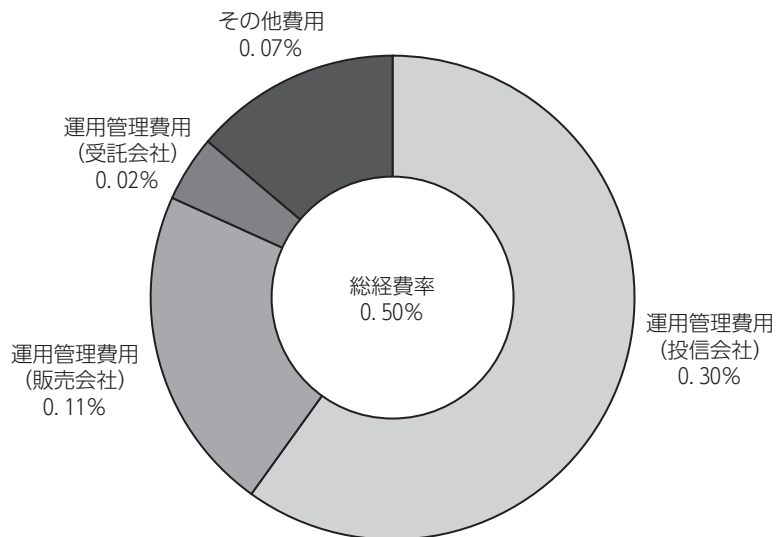
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.50%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

ダイワ外国REITインデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

（2019年6月18日から2020年6月15日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	9	22	7,351	17,780

（注）単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

（2019年6月18日から2020年6月15日まで）

項 目	当 期
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	1,078千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	89千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	11.98

（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	
10	—	—	10	当初設定時における取得

（注1）金額は元本ベース。

（注2）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	当 期 末		
	□ 数	□ 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	220,038	212,696	439,898

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	439,898	99.8
コール・ローン等、その他	1,057	0.2
投資信託財産総額	440,955	100.0

（注1）評価額の単位未満は切捨て。

（注2）外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.24円、1カナダ・ドル=78.66円、1オーストラリア・ドル=73.06円、1香港・ドル=13.84円、1シンガポール・ドル=76.86円、1ニュージーランド・ドル=68.74円、1イギリス・ポンド=134.14円、1イスラエル・シェケル=30.85円、100韓国・ウォン=8.88円、1ユーロ=120.68円です。

（注3）ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（24,335,641千円）の投資信託財産総額（24,807,553千円）に対する比率は、98.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	440,955,653円
コール・ローン等	1,049,400
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）	439,898,253
未収入金	8,000
(B) 負債	16,127,289
未払収益分配金	15,100,197
未払信託報酬	1,014,344
その他未払費用	12,748
(C) 純資産総額（A－B）	424,828,364
元本	503,339,911
次期繰越損益金	78,511,547
(D) 受益権総口数	503,339,911口
1万口当り基準価額（C/D）	8,440円

* 期首における元本額は503,339,911円、当作成期間中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は0円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は8,440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78,511,547円です。

■損益の状況

当期 自 2019年6月18日 至 2020年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 103円
支払利息	△ 103
(B) 有価証券売買損益	△ 76,530,710
売買益	63,450
売買損	△ 76,594,160
(C) 信託報酬等	△ 2,177,826
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 78,708,639
(E) 前期繰越損益金	10,902,230
(F) 追加信託差損益金	4,395,059
（配当等相当額）	(46,291)
（売買損益相当額）	(4,348,768)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 63,411,350
(H) 収益分配金	△ 15,100,197
次期繰越損益金 (G + H)	△ 78,511,547
追加信託差損益金	4,395,059
（配当等相当額）	(46,291)
（売買損益相当額）	(4,348,768)
分配準備積立金	11,690,648
繰越損益金	△ 94,597,254

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	15,888,615円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	46,291
(d) 分配準備積立金	10,902,230
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	26,837,136
(f) 分配金	15,100,197
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	11,736,939
(h) 受益権総口数	503,339,911口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金

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。

★「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の第15期にかかる運用状況については347～355ページ、「先進国REITマザーファンド」の第7期にかかる運用状況については356～363ページをご参照ください。

《お知らせ》

■商号変更について

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

<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（2019年12月2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（2020年6月15日）現在におけるダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。338～346ページをご参照ください。