

ダイワファンドラップオンライン インデックス・シリーズ

ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

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)

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)

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

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)

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)

ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス

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)

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)

運用報告書 (全体版)

第4期

(決算日 2020年11月30日)

(作成対象期間 2019年12月3日~2020年11月30日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップオンライン インデックス・シリーズ」は、このたび、第4期の決算を行ないました。

ここに、当作成期の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<4667>
<2768>
<2769>
<4668>
<2770>
<2771>
<4669>
<2772>
<2773>

ダイワファンドラップオンライン TOPIXインデックス

運用報告書（全体版） 第4期

（決算日 2020年11月30日）

（作成対象期間 2019年12月3日～2020年11月30日）

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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行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			T O P I X		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	(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11月30日)	円 11,827	円 0	% 18.3	1,792.08	% 16.2	% 98.7	% 1.3	百万円 1,308
2 期末(2018年11月30日)	11,209	0	△ 5.2	1,667.45	△ 7.0	98.7	1.3	2,014
3 期末(2019年12月 2 日)	11,793	0	5.2	1,714.49	2.8	98.7	1.4	2,849
4 期末(2020年11月30日)	12,343	0	4.7	1,754.92	2.4	97.9	1.8	2,646

(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。

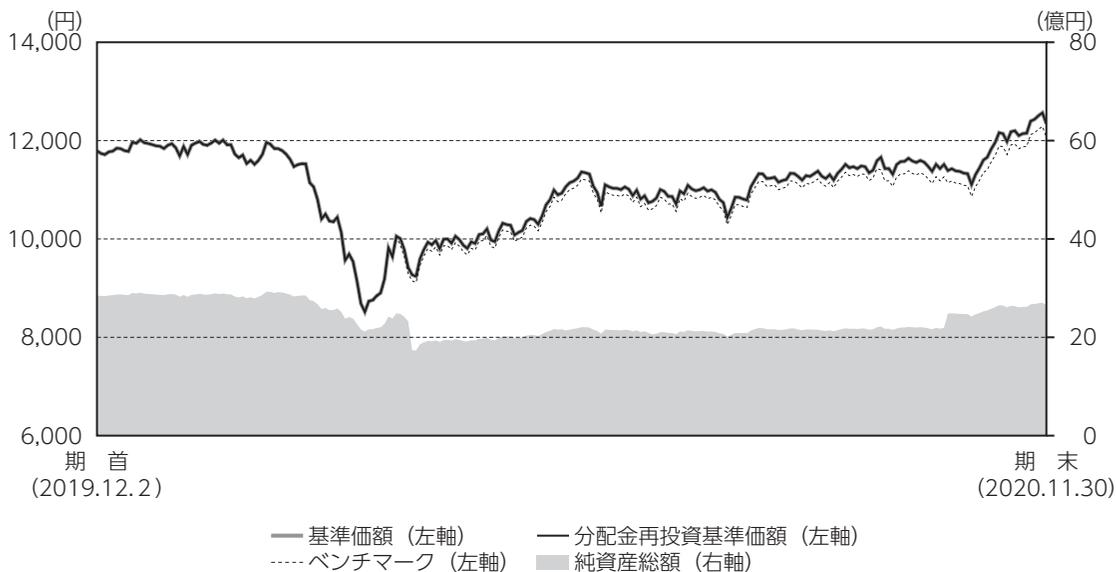
(注3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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：11,793円

期末：12,343円（分配金0円）

騰落率：4.7%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2019年12月 2 日	円	%		%	%	%
	11,793	—	1,714.49	—	98.7	1.4
12月末	11,855	0.5	1,721.36	0.4	98.5	1.5
2020年 1 月末	11,600	△ 1.6	1,684.44	△ 1.8	97.8	2.2
2 月末	10,406	△11.8	1,510.87	△11.9	97.1	3.0
3 月末	9,783	△17.0	1,403.04	△18.2	97.6	2.3
4 月末	10,204	△13.5	1,464.03	△14.6	98.0	1.8
5 月末	10,896	△ 7.6	1,563.67	△ 8.8	97.7	2.2
6 月末	10,877	△ 7.8	1,558.77	△ 9.1	97.8	2.1
7 月末	10,437	△11.5	1,496.06	△12.7	98.7	1.2
8 月末	11,288	△ 4.3	1,618.18	△ 5.6	99.1	0.8
9 月末	11,431	△ 3.1	1,625.49	△ 5.2	98.5	1.4
10月末	11,106	△ 5.8	1,579.33	△ 7.9	97.9	2.0
(期末) 2020年11月30日	12,343	4.7	1,754.92	2.4	97.9	1.8

(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せん。

投資環境について

(2019.12.3～2020.11.30)

■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、米中通商協議の合意に対する期待と不透明感が交錯し、横ばい圏で推移しました。その後は、新型コロナウイルスの感染拡大が懸念され、株価は2020年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、新規感染者数がピークアウトしてきた欧米で経済活動の再開が進展したこと、また国内でも5月下旬に緊急事態宣言が全面解除されたことなどが好感され、6月上旬まで株価は上昇基調で推移しました。6月中旬以降は、日米における感染状況などに一喜一憂する中、株価は横ばい圏で推移しました。11月に入ると、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通り当選確実となって選挙に対する不確実性が後退したことや、複数の開発企業が新型コロナウイルスワクチン開発において高い効果を確認したとの発表でワクチンの実用化期待が高まったことにより、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」の受益証券の組入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（TOP I X）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

(2019.12.3～2020.11.30)

■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、資金変動への対応や新規上場等によるベンチマークの構成変化に対応するため、随時、株式の売買を行いました。

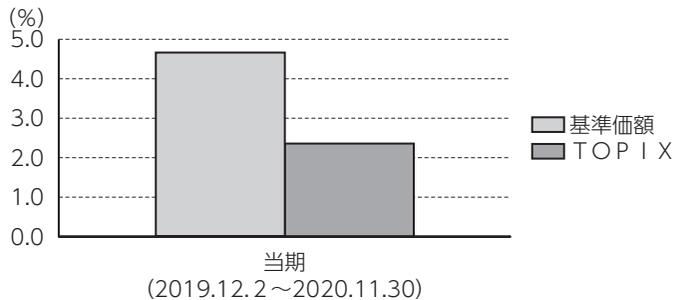
ベンチマークとの差異について

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4.7%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12月3日 ～2020年11月30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）	2,482

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

「トピックス・インデックス・マザーファンド」の受益証券の組入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 (2019.12.3~2020.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	25円	0.230%	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11,065円です。
(投 信 会 社)	(17)	(0.153)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(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)	(0.001)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.006	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	26	0.237	

(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。

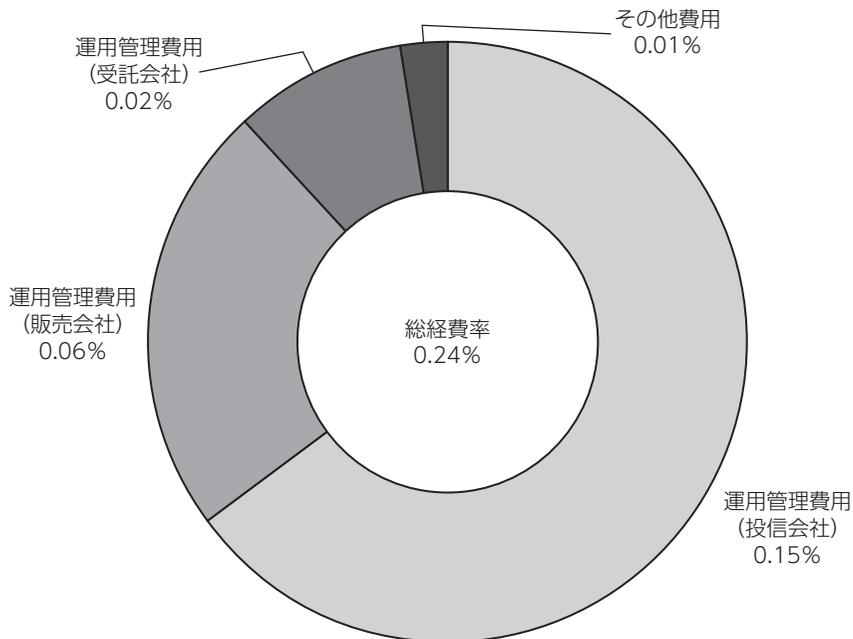
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.24%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12月3日から2020年11月30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	665,124	696,150	958,855	904,730

(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12月3日から2020年11月30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	31,710,022千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	147,238,197千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.21

(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12月3日から2020年11月30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 13,619	百万円 294	% 2.2	百万円 18,090	百万円 2,956	% 16.3
株式先物取引	31,398	4,632	14.8	30,460	3,820	12.5
コール・ローン	4,728,155	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合1.6%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2019年12月3日から2020年11月30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
株式	百万円 23	百万円 25	百万円 259

(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つて発行される有価証券

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

種 類	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
	買 付 額
株式	百万円 65

(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12月3日から2020年11月30日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	37千円
うち利害関係人への支払額 (B)	5千円
(B)/(A)	15.6%

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

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

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末
	口 数	口 数 評 価 額
	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	2,555,624	2,261,893 2,645,962

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	2,645,962	99.5
コール・ローン等、その他	14,546	0.5
投資信託財産総額	2,660,509	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,660,509,348円
コール・ローン等	3,906,545
トピックス・インデックス・マザーファンド(評価額)	2,645,962,803
未収入金	10,640,000
(B) 負債	14,356,719
未払解約金	11,743,586
未払信託報酬	2,552,443
その他未払費用	60,690
(C) 純資産総額(A - B)	2,646,152,629
元本	2,143,825,188
次期繰越損益金	502,327,441
(D) 受益権総口数	2,143,825,188口
1万口当り基準価額(C / D)	12,343円

* 期首における元本額は2,416,486,034円、当作成期間中における追加設定元本額は931,798,024円、同解約元本額は1,204,458,870円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,343円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月3日 至2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,139円
受取利息	352
支払利息	△ 1,491
(B) 有価証券売買損益	178,886,870
売買益	328,027,439
売買損	△149,140,569
(C) 信託報酬等	△ 5,539,059
(D) 当期損益金(A + B + C)	173,346,672
(E) 前期繰越損益金	105,623,869
(F) 追加信託差損益金	223,356,900
(配当等相当額)	(253,250,081)
(売買損益相当額)	(△ 29,893,181)
(G) 合計(D + E + F)	502,327,441
次期繰越損益金(G)	502,327,441
追加信託差損益金	223,356,900
(配当等相当額)	(253,250,081)
(売買損益相当額)	(△ 29,893,181)
分配準備積立金	278,971,680
繰越損益金	△ 1,139

(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	173,346,475
(c) 収益調整金	253,250,081
(d) 分配準備積立金	105,625,205
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	532,221,761
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	532,221,761
(h) 受益権総口数	2,143,825,188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（ダイワファンドラップオンライン TOP I Xインデックス）が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（2020年9月23日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2020年11月30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12月3日から2020年11月30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	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		千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	74.1	489,102	6,600	NTTドコモ	534.8	2,034,338	3,803	トヨタ自動車	73.7455	535,872	7,266	ソニー	42.2	295,826	7,010
ソニー	42.2	295,826	7,010	トヨタ自動車	73.7455	535,872	7,266	ソニー	45.7	333,284	7,292	ソフトバンクグループ	50.7	244,405	4,820
ソフトバンクグループ	50.7	244,405	4,820	ソニー	45.7	333,284	7,292	ソフトバンクグループ	50.3	243,643	4,843	キーエンス	6	226,799	37,799
キーエンス	6	226,799	37,799	ソフトバンクグループ	50.3	243,643	4,843	キーエンス	5.9	236,485	40,082	日本電信電話	88.2	214,726	2,434
日本電信電話	88.2	214,726	2,434	キーエンス	5.9	236,485	40,082	日本電信電話	68.2	230,617	3,381	武田薬品	55.7	194,968	3,500
武田薬品	55.7	194,968	3,500	日本電信電話	68.2	230,617	3,381	日本電信電話	455.3	226,257	496	三菱UFJフィナンシャルG	428.4	176,937	413
三菱UFJフィナンシャルG	428.4	176,937	413	三菱UFJフィナンシャルG	455.3	226,257	496	三菱UFJフィナンシャルG	55.4	223,943	4,042	任天堂	4	165,184	41,296
任天堂	4	165,184	41,296	三菱UFJフィナンシャルG	55.4	223,943	4,042	武田薬品	58.2	183,727	3,156	KDDI	47.8	148,361	3,103
KDDI	47.8	148,361	3,103	武田薬品	58.2	183,727	3,156	KDDI	23	183,345	7,971	リクルートホールディングス	43.8	144,863	3,307
リクルートホールディングス	43.8	144,863	3,307	KDDI	58.2	183,727	3,156	日立ハイテク							

（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11月30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（142,709,508千円）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30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%)			ファーストコーポレーション	3	2,085	不動産トラ	5.5	9,229	新日本建設	8.9	7,565
極洋	3.3	9,223	ベストテラ	1.6	2,452	大未建設	2.3	2,053	NIPPPO	17.4	47,449
日本水産	91.6	36,731	キャンディル	1.4	711	鉄建建設	4.6	8,293	東亜道路	1.3	4,803
マルハニチロ	13.3	28,249	スペースパリュウHD	11.1	6,782	西松建設	16.4	31,816	前田道路	18.7	31,359
カネコ種苗	2.8	4,320	ダイセイ環境ソリューション	1.8	1,227	三井住友建設	51.4	22,050	日本道路	2	14,780
サカタのタネ	11	37,015	第一カッター興業	1.1	2,439	大豊建設	4.8	16,656	東亜建設	6.7	13,333
ホクト	7.1	14,626	安藤・間	54.7	37,633	前田建設	52.7	43,108	日本国土開発	20.7	11,281
ホクリョウ	1.6	1,108	東急建設	27.1	12,709	佐田建設	4.5	2,011	若築建設	3.7	4,258
鉱業 (0.1%)			コムシスホールディングス	32.5	100,425	ナカノフードー建設	5.7	2,331	東洋建設	23.9	9,488
住石ホールディングス	18.4	2,152	ピーアールホールディングス	9.9	7,029	興村組	9.9	24,165	五洋建設	83.8	65,112
日鉄鉱業	2.1	11,109	高松コンストラクションGP	5.6	11,407	東鉄工業	9	25,200	世紀東急	10.2	8,231
三井松島HLDGS	3.4	2,509	東建コーポレーション	2.8	22,652	イチケン	1.5	2,632	福田組	2.5	13,225
国際石油開発帝石	336.2	196,340	ソネック	0.9	779	富士ピー・エス	3	1,818	住友林業	53.5	101,703
石油資源開発	12.1	21,271	ヤマウラ	4	3,624	浅沼組	2.4	9,540	日本基礎技術	7.3	3,591
K&Oエナジーグループ	4.5	6,570	大成建設	70.3	259,407	戸田建設	87.5	53,637	巴コーポレーション	9.2	3,900
建設業 (2.4%)			大林組	210.6	193,752	熊谷組	9.8	23,147	大和ハウス	208.7	667,840
ヒノキャブグループ	2.3	5,002	清水建設	213.7	169,464	北野建設	1.3	3,542	ライト工業	12.2	20,435
ショボンHD	14.3	74,360	飛鳥建設	5.9	6,354	植木組	0.9	2,470	積水ハウス	228.6	429,310
ミライト・ホールディングス	27.1	42,411	長谷工コーポレーション	81.6	92,126	矢作建設	9.3	8,388	日特建設	5.5	4,405
タマホーム	5	7,195	松井建設	8.3	6,083	ピーエス三菱	7	3,976	北陸電気工事	3.7	4,421
サンヨーホームズ	0.5	348	銭高組	0.9	4,135	日本ハウスHLDGS	14.2	3,379	ユアテック	11.7	7,780
日本アーク	3.8	2,413	鹿島建設	165.4	227,094	大東建託	23	235,520	日本リーテック	4.5	11,200

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
四電工	1.1	2,845	六甲バター	4.5	8,491	ピックスコーポレーション	1.5	4,386	大王製紙	30.5	55,083
中電工	8.2	17,482	ヤクルト	46.5	231,337	北の達人コーポ	23.8	12,114	阿波製紙	2	904
関電工	29.8	23,780	明治ホールディングス	44.7	329,886	ユープレナ	29.4	24,137	レンゴー	62.5	49,687
きんでん	50	83,650	雪印メグミルク	16.3	36,463	ミヨシ油脂	2.5	3,082	トーモク	4.1	7,093
東京エネクス	7	6,230	プリマハム	10.7	30,890	理研ビタミン	6.5	8,658	ザ・パップ	5	14,460
トーエネック	2	7,420	日本ハム	25.8	114,939	繊維製品 (0.5%)			化学 (7.6%)		
住友電設	5.9	15,304	林兼産業	2.3	1,389	片倉工業	8.9	12,175	クラレ	103.6	107,329
日本電設工業	11.5	24,805	丸大食品	7.3	12,096	グンゼ	4.8	17,280	旭化成	436.4	417,678
協和エクシオ	32	85,984	S Foods	5.5	17,270	東洋紡	26.2	34,191	共和レザー	3.6	2,178
新日本空調	5.6	12,538	柿安本店	2.3	5,773	ユニチカ	19.8	7,484	昭和電工	49.8	96,462
九電工	14.8	44,178	伊藤ハム米久HLDGS	43.4	28,383	富士紡ホールディングス	3.2	11,536	住友化学	482.9	178,673
三機工業	15.2	17,464	サッポロホールディングス	23.2	45,240	倉敷紡績	6.6	12,157	住友精化	3	12,450
日揮ホールディングス	64.9	60,681	アサヒグループホールディング	147.6	595,861	シキボウ	4	4,164	日産化学	36.4	227,136
中外炉工業	2.3	3,707	キリンHD	286.4	651,130	日本毛織	21.3	22,492	ラサ工業	2.3	4,597
ヤマト	6.8	5,038	宝ホールディングス	50.2	60,189	ダイトウボウ	12.1	1,391	クレハ	5.6	29,680
太平電業	5.1	12,296	オエノンホールディングス	18	7,398	トア紡コーポレーション	2.6	1,268	多木化学	2.6	17,290
高砂熱学	16.2	23,214	養命酒	2.1	3,945	グایدローリミテツド	9.7	1,910	テイカ	4.9	7,168
三晃金属	0.8	2,105	コカ・コーラボトラーズHD	51.3	82,387	帝國繊維	7.5	19,297	石原産業	11.9	6,854
朝日工業社	1.4	4,508	サントリー食品インター	45.2	172,438	帝人	53.6	95,622	片倉コープアグリ	1.6	1,995
明星工業	13.6	10,567	グایدローグループHD	3.5	19,530	東レ	476.4	269,690	日本曹達	9.8	26,920
大気社	10.2	28,325	伊藤園	20.6	166,036	サカイ オーベックス	1.7	3,466	東ソー	101.8	167,562
ダイダグ	5	13,910	キーコーヒー	6.7	14,123	住江織物	1.4	3,049	トクヤマ	19	42,123
日比谷総合設備	6.9	12,647	ユニカフェ	1.6	1,832	日本フェルト	3.5	1,592	セントラル硝子	13.4	29,801
フィル・カンパニー	1.2	2,474	ジャパンフーズ	0.9	1,125	イチカワ	0.9	1,212	東亞合成	41.1	51,375
OS J B HD	33.3	7,858	日清オイリオグループ	8.8	25,572	日東製網	0.8	1,186	大阪ソーダ	6.7	16,394
東洋エンジニア	8.7	3,053	不二製油グループ	16.6	46,413	アツギ	5.3	2,782	関東電化	15.8	11,091
レイズネクスト	11.2	12,443	かどや製油	0.8	3,104	ダイニック	2.4	2,090	デンカ	24.1	77,843
食料品 (3.6%)			J-オイルミルズ	3.6	12,816	セーレン	16.3	24,873	信越化学	113.1	1,937,968
日本製粉	20	32,540	キッコーマン	48.6	315,414	ソトー	2.4	2,222	日本カーバイド	2.1	2,748
日清製粉G本社	76.4	129,650	味の素	149.2	325,330	東海染工	0.9	1,000	堺化学	4.2	8,160
日東富士製粉	0.5	3,275	キューピー	37.7	81,959	小松マテーレ	10.8	10,292	第一稀元素化学工	7.1	4,948
昭和産業	6.3	19,908	ハウス食品G本社	25.3	91,080	ワコールホールディングス	16.4	32,816	エア・ウォーター	61.3	105,497
鳥越製粉	6	6,306	ガゴメ	27.5	104,775	ホギメモリアル	7.5	23,700	日本酸素HLDGS	63.3	110,395
中部飼料	8.4	11,734	焼津水産化工	3.2	3,171	クラウドディアHLDGS	1.7	513	日本化学工業	2.1	5,363
フィード・ワン	9.1	8,053	アリアケジャパン	6.2	42,842	T S Iホールディングス	20.9	4,200	東邦アセチレン	0.8	984
東洋精糖	1.2	1,453	ピエトロ	0.8	1,364	マツオカコーポレーション	1.9	4,810	日本パーカライジング	33	36,135
日本甜菜糖	3.5	5,586	エバラ食品工業	1.7	4,046	ワールドガス	9.4	12,050	高圧ガス	10.4	7,872
三井製糖	6	10,734	やまみ	0.6	1,219	三陽商会	3.5	1,851	チタン工業	0.9	1,752
塩水港精糖	6.9	1,545	ニチレイ	32.3	91,538	ナイガイ	2.5	882	四国化成	9.6	11,443
日新製糖	3.1	5,735	東洋水産	34.9	179,037	オンワードホールディングス	40.1	7,418	戸田工業	1.5	3,277
森永製菓	15.9	60,579	イートアンドHLDGS	2.3	4,186	ルックホールディングス	2.1	2,049	ステラ ケミファ	3.6	12,060
中村屋	1.8	7,281	大冷	0.8	1,585	ゴールドウイン	11.9	83,538	保土谷化学	2.5	11,512
江崎グリコ	18.7	81,251	ヨシムラ・フード・HLDGS	3.8	3,298	デサント	12.8	22,067	日本触媒	10.2	53,244
名糖産業	3.3	4,851	日清食品HD	28.8	248,256	キング	3	1,638	大日精化	5.8	13,850
井村屋グループ	3.8	9,758	永谷園ホールディングス	3.4	7,650	ヤマトインターナショナル	5.7	1,920	カネカ	17.1	53,694
不二家	3.8	8,983	一正蒲鉾	2.6	2,997	パルプ・紙 (0.2%)			三菱瓦斯化学	61.4	135,939
山崎製パン	50.8	87,985	フジッコ	7.4	14,496	特種東海製紙	4.1	21,935	三井化学	61.1	179,206
第一屋製パン	1.3	1,296	ロックフィールド	7.3	10,636	王子ホールディングス	275.6	130,634	J S R	61.5	177,427
モロゾフ	1.1	6,831	日本たばこ産業	361.8	767,016	日本製紙	29.3	32,962	東京応化工業	11.4	75,012
亀田製菓	3.9	19,168	ケンコーマヨネーズ	3.8	6,786	三菱製紙	7.3	2,343	大阪有機化学	6.1	17,683
寿スプリッツ	6.5	34,710	わらべや日洋HD	4.4	6,124	北越コーポレーション	39.9	14,004	三菱ケミカルHLDGS	439.8	253,984
カルビー	31	95,635	なつり	3.9	7,761	中越パルプ	2.8	3,771	K Hネオケム	10.9	30,378
森永乳業	12.6	63,882	イフジ産業	1	826	巴川製紙	2.1	1,858	ダイセル	82.4	60,481

銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
住友ベークライト	10.4	33,488	ファンケル	27.3	115,615	日本新薬	17.6	131,296	ガラス・土石製品 (0.8%)		
積水化学	139	250,617	コーサー	12.7	202,438	ピオフェルミン製薬	1.2	2,881		日東紡績	10.1
日本ゼオン	59.6	77,062	コタ	3.9	5,300	中外製薬	210.4	1,061,257	A G C	61.8	214,755
アイカ工業	19.8	73,062	シーボン	0.8	1,577	科研製薬	11.6	44,196	日本板硝子	32.3	12,952
宇部興産	33.2	58,930	ポーラ・オルビスHD	28.8	60,048	エーザイ	80.6	635,692	石塚硝子	1.2	2,300
積水樹脂	11.8	25,842	ノビアホールディングス	5.7	24,481	ロート製薬	34.6	118,505	日本山村硝子	2.8	2,416
タキロンシーアイ	14	9,912	アジupanコスメジャパン	1.4	1,425	小野薬品	154.5	510,313	日本電気硝子	25	57,050
旭有機材	3.8	5,536	エステー	4.4	8,962	久光製薬	17.7	108,324	オハラ	2.7	4,071
ニチパン	3.5	5,673	アプロカネショウ	2.6	4,537	持田製薬	9.3	37,293	住友大阪セメント	12.7	39,243
リケンテクノス	16.4	7,314	ゴニシ	1.1	17,512	参天製薬	125.6	217,916	太平洋セメント	42.4	118,974
大倉工業	3.1	5,818	長谷川香料	11.7	23,540	扶桑薬品	2.4	6,799	日本ヒューム	6.7	5,226
積水化成成品	8.9	4,788	星光PMC	3.8	2,728	日本ケミファ	0.9	2,223	日本コンクリート	14.6	4,642
群栄化学	1.4	3,546	小林製薬	18.9	237,195	ツムラ	20.8	63,336	三谷セキサン	3.1	12,942
タイガース ポリマー	3.4	1,434	荒川化学工業	6	6,720	日医工	19.2	19,200	アジアパイルHD	9.6	4,368
ミライアル	2.3	2,785	メック	4.6	10,483	キッセイ薬品工業	11.8	24,662	東海カーボン	66.1	75,750
ダイキアクシス	2.4	2,512	日本高純度化学	1.8	4,851	生化学工業	13	12,909	日本カーボン	3.5	13,072
ダイキョーニシカワ	13.8	9,453	タカラバイオ	17.7	52,622	栄研化学	11.9	23,050	東洋炭素	4	7,136
竹本容器	2.2	2,162	J C U	8.2	30,217	日水製薬	2.8	2,769	ノリタケ	3.7	10,844
森六ホールディングス	3.6	7,160	新田ゼラチン	4	2,808	鳥居薬品	4.2	13,293	T O T O	48	283,680
日本化薬	41	37,597	O A T アグリオ	1.2	1,706	J C R ファーマ	19.1	51,952	日本碍子	80.6	133,715
カーリットホールディングス	6.9	4,140	デクセラリアルズ	17.6	22,440	東和薬品	8.6	16,348	日本特殊陶業	51.4	97,197
日本精化	5.4	7,846	アース製薬	4.8	29,520	富士製薬工業	4.6	5,740	ダントーホールディングス	5.6	2,727
扶桑化学工業	6.7	23,148	北興化学	6.5	7,306	沢井製薬	13.8	65,067	M A R U W A	2.6	28,808
トリケミカル	1.5	21,165	大成ラミック	2.2	6,388	ゼリア新薬工業	12.1	22,602	品川リフラクトリーズ	1.7	4,180
A D E K A	30.3	50,237	クミアイ化学	28	28,588	第一三共	577.5	2,133,285	黒崎播磨	1.3	4,673
日油	24.8	114,824	日本農薬	12	6,372	キョーリン製薬HD	15	28,155	ヨータイ	5.3	4,372
新日本理化	10.7	1,776	アキレス	4.7	6,692	大幸薬品	8.3	13,985	イソライト	3.4	1,502
ハリマ化成グループ	5.5	5,621	有沢製作所	10.7	9,811	ダイト	4.2	15,204	東京薬業	8.4	2,898
花王	161	1,257,088	日東電工	46.4	400,896	大塚ホールディングス	139.7	592,607	ニッカトー	3	2,124
第一工業製薬	2.5	11,275	レック	7.2	11,145	大正製薬HD	14.1	93,624	フジミンコーポレートッド	6.1	22,204
石原ケミカル	1.8	3,774	三光合成	7.5	2,190	ペプチドリーム	34.2	181,944	クニミネ工業	2.8	3,074
日華化学	2.2	2,109	きもと	12.4	2,256	石油・石炭製品 (0.4%)			エーアンドエーマテリアル	1.1	1,137
ニイタカ	1.4	4,354	藤森工業	6	28,350		日本コークス工業	56	3,976	ニチアス	18.5
三洋化成	3.9	17,472	前澤化成工業	4.3	4,222	ニチレキ	8	13,088	ニチハ	9.4	30,644
有機合成薬品	5.9	1,805	未来工業	3.6	6,768	ユシロ化学	3.7	4,306	鉄鋼 (0.6%)		
大日本塗料	7.5	6,922	ウェーブロックHLDGS	2.3	1,697	ピーピー・カストロール	2.4	3,038		日本製鉄	297.6
日本ペイントHOLD	54.4	727,328	ジェイ エス ピー	3.9	5,877	富士石油	17.7	3,256	神戸製鋼所	122.1	61,660
関西ペイント	74	234,210	エフピコ	14.2	59,427	M O R E S C O	2.3	2,325	中山製鋼所	8.7	3,271
神東塗料	6.8	1,230	天馬	4.5	8,581	出光興産	74.7	162,397	合同製鐵	3.6	6,678
中国塗料	18.8	18,687	信越ポリマー	12.1	11,374	ENEOSホールディングス	1,011.5	362,622	J F E ホールディングス	179.7	171,793
日本特殊塗料	5	5,725	東リ	16.8	4,300	コスモエネルギーHLDGS	19.6	34,770	東京製鋼	32.6	21,385
藤倉化成	8.9	4,512	ニフコ	24.7	90,772	ゴム製品 (0.5%)			共英製鋼	7.6	11,354
太陽ホールディングス	4.9	31,409	バルカー	5.5	10,285		横浜ゴム	39	59,397	大和工業	14.2
D I C	27.8	71,362	ユニ・チャーム	142.7	722,490	T O Y O T I R E	35.5	58,468	東京製鋼	2.7	5,958
サカタインクス	14.4	16,675	ショーエイコーポ	0.9	924	ブリヂストン	178.7	651,182	大阪製鐵	3.5	4,158
東洋インキSCホールディン	13.7	26,865	医薬品 (6.1%)			住友ゴム	60.5	55,841	淀川製鋼所	8.9	17,559
T & K T O K A	5	4,300		協和キリン	67.6	191,646	藤倉コンビジット	6.2	2,393	丸一鋼管	21.7
富士フイルムHLDGS	129	725,625	武田薬品	559.6	2,095,702	オカモト	4.1	16,707	モリ工業	2	4,882
資生堂	133.7	984,032	アステラス製薬	583.1	865,028	フコク	3	2,091	大同特殊鋼	10.8	46,872
ライオン	87.5	215,950	大日本住友製薬	49.7	65,753	ニッタ	7.6	16,765	日本高周波	2.4	808
高砂香料	4.2	10,584	塩野義製薬	84.6	473,167	住友理工	12.8	6,566	日本冶金工	5.5	9,075
マンダム	15.3	25,046	わかもと製薬	8.5	2,320	三ツ星ベルト	8.8	14,352	山陽特殊製鋼	4.5	5,625
ミルボン	9	53,640	あすか製薬	7.7	13,120	バンドー化学	11.8	6,796	愛知製鋼	3.6	9,180

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
日立金属	71.8	110,069	三和ホールディングス	62.9	79,883	東洋機械金属	4.6	1,863	日本ギア工業	2.4	753
日本金属	1.6	1,953	文化シヤッター	19.8	18,057	津田駒工業	1.2	1,087	酒井重工業	1.2	2,982
大平洋金属	4.5	8,325	三協立山	8.7	6,655	エンシュウ	1.5	1,372	荏原製作所	27.9	93,186
新日本電工	43.6	9,940	アルシヤクト	4.9	4,449	島精機製作所	10.5	18,280	石井鉄工所	0.9	2,511
栗本鉄工所	3.3	5,646	東洋シヤッター	1.7	1,264	オプトラン	7.9	17,253	西島製作所	6.8	5,712
虹技	1	1,257	L I X I Lグループ	98.2	245,991	NCホールディングス	2	2,208	北越工業	7	7,287
日本鑄鉄管	0.8	1,052	日本フィルコン	5	2,645	イワキポンプ	4.2	3,364	ダイキン工業	85.7	2,028,090
三菱製鋼	4.9	2,714	ノーリツ	13.8	22,231	フリュウ	6.5	7,676	オルガン	2.4	14,232
日亜銅業	9.6	2,956	長府製作所	6.8	13,872	ヤマシンフィルタ	14.6	15,563	トーヨーカネツ	3	6,393
日本精線	1.1	3,641	リンナイ	13	158,340	日阪製作所	8.4	7,039	栗田工業	36.5	140,525
エンビプロHD	3	1,677	ダイニチ工業	3.5	3,360	やまびこ	13	18,382	椿本チエイン	9.5	24,025
シンニッタン	10.4	1,903	日東精工	8.9	3,827	平田機工	3.1	25,854	大同工業	3.2	2,163
新家工業	1.5	1,728	三洋工業	0.8	1,532	ペガサスミシン製造	6.6	1,933	木村化工工業	5.7	2,867
非鉄金属 (0.7%)			岡部	13.7	11,042	マルエ	2.7	2,894	アネスト岩田	10.5	10,363
大紀アルミニウム	11	7,491	ジーテクト	8.2	11,398	タツモ	3	4,518	ダイフク	34.4	416,240
日本軽金属HD	16.9	30,284	東プレ	12.5	16,300	ナプテスコ	39.2	168,952	サムコ	1.8	6,417
三井金属	18	53,244	高周波熱練	12.9	5,753	三井海洋開発	7.1	12,567	加藤製作所	3.7	3,759
東邦亜鉛	3.4	6,936	東京製鋼	4.7	3,510	レオン自動車	6.6	7,306	油研工業	1.1	1,665
三菱マテリアル	44	87,208	サンコール	4.9	2,038	S M C	21.1	1,399,352	タダノ	32.8	26,994
住友鉱山	85	330,395	モリテックスチル	5.4	2,673	ホンカワミクロン	2.4	15,192	フジテック	24.6	52,447
DOWAホールディングス	16.8	57,960	パイオラックス	9.9	15,453	ユニオンツール	2.4	7,356	C K D	18.5	41,162
古河機金	11.8	13,404	エイチワン	6.4	4,480	ユニレス工業	8.6	13,708	キトー	5.2	8,247
エス・サイエンス	37.6	1,654	日本発条	71	44,943	日精工エースビー	2	11,400	平和	18.6	26,430
大阪チタニウム	6.9	5,796	中央発條	0.7	2,074	サトールディングス	9.6	19,420	理想科学工業	6	7,746
東邦チタニウム	12	8,268	アドパネクス	0.9	1,161	技研製作所	5.9	24,190	S A N K Y O	15	38,520
U A C J	10.1	18,089	立川プラインド	3	3,738	日本金銭機械	2.3	3,654	マースグループ機械	7.3	3,949
C K サンエツ	1.4	5,397	三益半導体	5.3	14,840	カワタ	1.9	1,740	マースグループHDGS	4.1	6,551
古河電工	20.8	54,995	機械 (5.8%)			日精樹脂工業	5.6	4,827	フクシマガリレイ	4.2	18,459
住友電工	248.2	296,350	日本ドライケミカル	1.7	2,629	オカダアイヨン	2	1,994	オーイズミ	2.8	1,117
フジクラ	81	32,967	日本製鋼所	20.3	51,765	ワイエイシホールディングス	2.8	2,422	ダイコク電機	3.1	2,731
昭和電線 H L D G S	7.8	12,573	三浦工業	28.8	158,112	小松製作所	304.8	774,192	竹内製作所	11.4	28,009
東京特殊電線	1	2,407	タクマ	22.7	40,701	住友重機械	38.6	86,965	アマノ	17.8	43,681
タツタ電線	13.3	8,246	ツガミ	13.9	22,935	日立建機	27.2	78,635	J U K I	9.3	5,040
カナレ電気	1.1	1,939	オークマ	7.8	46,956	日工	9.2	6,099	サンデンホールディングス	9	3,348
平河ヒューテック	3.3	3,498	芝浦機械	7.6	17,487	巴工業	2.7	5,181	蛇の目マシン	6	5,124
リョービ	8.2	9,971	アマダ	82.5	82,995	井関農機	6.8	9,309	マックス	10.4	14,560
アールステイ	8.6	2,769	アイダエンジニア	17.4	15,381	T O W A	6.8	12,335	グローリー	17.5	36,750
アサヒHD	11.8	36,639	滝澤鉄工所	2	2,006	丸山製作所	1.7	2,305	新晃工業	6.3	10,823
金属製品 (0.6%)			F U J I	28.7	72,582	北川鉄工所	3	3,837	大和冷機工業	9.8	10,054
稲葉製作所	3.7	5,039	牧野フライス	7.8	32,760	ローツェ	3	16,260	セガサマーホールディングス	66.6	97,702
宮地エンジニアリング	2	4,320	オーエスジー	31.5	59,440	タカキタ	2.5	1,727	日本ピストンリング	2.4	2,244
トーカロ	18.6	23,157	ダイジェット	0.7	988	クボタ	357	739,168	リケン	3.1	6,866
アルファCO	2.2	2,134	旭ダイヤモンド	17.6	7,462	荏原実業	1.7	6,239	T P R	9.1	11,902
S U M C O	84.3	178,210	DMG森精機	42.2	65,072	三菱化工機	2.3	5,163	ツバキ・ナカシマ	13.3	11,717
川田テクノロジーズ	1.4	5,901	ソデイツク	14.9	12,411	月島機械	12.3	14,772	ホシザキ	21.2	218,996
RS TECHNOLOGIES	1.9	8,483	ディスク	9	299,250	帝国電機製作所	5.6	6,972	大豊工業	5.4	3,283
信和	3.6	2,462	日東工具	3.7	6,156	東京機械	3.1	821	日本精工	126.6	106,977
東洋製鐵グループHD	42.4	42,696	日進工業	2.6	7,620	新東工業	16	11,376	N T N	157.3	34,291
ホッカンホールディングス	3.7	5,106	パンチ工業	5.9	2,596	渋谷工業	5.9	21,535	ジェイテクト	64.5	52,309
コロナ	3.4	3,070	富士ダイス	2.9	1,925	アイチ コーポレーション	11.6	10,764	不二越	6.2	26,722
横河ブリッジ H L D G S	12.5	24,775	豊和工業	3.9	3,159	小森コーポレーション	17.2	12,263	日本トムソン	19.9	6,527
駒井ハルテック	1.2	1,989	OK K	2.7	1,036	鶴見製作所	5.1	8,726	T H K	41.4	133,515
高田機工	0.6	1,529	石川製作所	1.7	2,871	住友精密	1	2,003	ユースン精機	5.3	4,171

銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30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
前澤給装工業	2.4	5,544	富士通	64.8	939,924	東亜ディーケーケー	3.3	2,808	市光工業	10.2	5,385
イーグル工業	8.5	7,675	沖電気	27.7	25,096	日本光電工業	27.8	91,740	小糸製作所	40.3	253,084
前澤工業	4	1,832	岩崎通信機	3	2,550	チノー	2.3	3,275	ミツバ	12.4	6,361
日本ピラー工業	6.8	11,022	電気興業	3.3	9,570	共和電業	6.9	2,773	SCREENホールディングス	11.7	81,432
キッツ	27.5	15,482	サンケン電気	7.4	28,231	日本電子材料	2.7	4,230	キャノン電子	6.1	8,863
マキタ	87.7	473,580	ナカオ	1.3	1,917	堀場製作所	13.3	74,480	キャノン	334.3	619,625
日立造船	53.5	21,507	アイホン	3.8	5,848	アドバンテスト	50.1	363,726	リコー	172.1	119,953
三菱重工業	112.7	265,014	ルネサスエレクトロニクス	287.9	267,171	小野測器	2.7	1,409	象印マホービン	18.4	34,702
IHI	48.6	75,378	セイコーエプソン	83.6	130,165	エスパック	6	11,640	MUTOHホールディングス	1	1,461
スター精密	10.5	15,445	ワコム	45.6	44,004	キーエンス	61	3,250,690	東京エレクトロン	42.7	1,514,569
電気機器 (17.0%)			アルパック	12.4	52,328	日置電機	3.3	12,952	輸送用機器 (7.0%)		
日清紡ホールディングス	40.9	30,266	アクセル	2.7	2,178	シスメックス	48.1	525,733	トヨタ紡織	19.5	26,715
イビデン	41.3	201,957	EIZO	5.3	19,239	日本マイクロニクス	11.8	11,623	芦森工業	1.3	1,276
コニカミノルタ	148.3	49,532	ジャパンディスプレイ	61.7	3,085	メガチップス	6.3	17,999	ユニプレス	13.2	11,814
ブラザー工業	82.1	164,200	日本信号	17.4	16,199	OBARA GROUP	4	13,560	豊田自動織機	54.4	410,176
ミネベアミツミ	124.8	271,315	京三製作所	15.8	6,651	澤藤電機	0.9	1,631	モリタホールディングス	11.8	21,051
日立	323.1	1,281,414	能美防災	8.9	20,140	原田工業	3.2	2,723	三桜工業	8.6	5,684
三菱電機	672.1	1,030,665	ホーチキ	4.9	6,105	コーセル	9	9,945	デンソー	148	729,492
富士電機	40.6	150,626	星和電機	3.5	2,149	イリソ電子工業	5.7	24,082	東海理化電機	17.8	28,426
東洋電機製造	2.4	2,652	エレコム	7.6	36,290	オプテックスグループ	11.1	20,945	三井E&SHD	21.7	7,399
安川電機	72.4	364,172	パナソニック	768.7	855,178	千代田インテグラー	2.9	4,428	川崎重工業	52.5	79,537
シフォニア テクノロジー	8.7	11,466	シャープ	78.2	109,480	アイ・オー・データ	2.3	2,228	名村造船所	22.2	3,352
明電舎	12.4	22,543	アンリツ	43.5	103,486	レーザーテック	29.6	325,600	サナリスホールディングス	9.4	1,466
オリジン	1.8	2,467	富士通ゼネラル	18.5	58,552	スタンレー電気	47.2	144,904	日本車輛	2.5	6,205
山洋電気	3.3	17,028	ソニー	421.4	4,089,265	岩崎電気	2.6	3,603	三菱ロジスネクスト	9	9,972
デンヨー	5.8	12,116	TDK	32.5	478,400	ウシオ電機	37.3	49,049	近畿車輛	1	1,303
東芝テック	8.5	31,875	帝国通信工業	3	3,504	岡谷電機	5.2	2,225	日産自動車	793.3	390,700
芝浦メカトロニクス	1.2	4,662	タムラ製作所	22.7	12,144	ヘリオステクノH	6.3	1,902	いすゞ自動車	195	198,510
パプモーター	18.7	87,142	アルプスアルパイン	59.8	78,218	エノモト	2	2,544	トヨタ自動車	750.5	5,252,749
日本電産	161.9	2,154,079	池上通信機	2.1	1,992	日本セラミック	6.9	19,782	日野自動車	84.1	76,110
ユーエムシーエレクトロニクス	4.2	1,717	日本電波工業	6.3	3,219	遠藤照明	3.3	1,864	三菱自動車工業	250.5	47,094
トレッサ・セミコンダクター	3.9	5,089	鈴木	3.3	2,960	古河電池	4.8	8,140	エフテック	4.8	2,726
東光高岳	3.7	4,928	日本トリム	0.9	3,658	双信電機	3.3	1,643	レシップホールディングス	2.6	1,411
ダブル・スコープ	10.7	8,410	ローランド ディー. ジー.	3.7	6,315	山一電機	4.9	7,413	GMB	1.5	951
宮越ホールディングス	2.6	1,781	フオスター電機	7.1	7,937	図研	4.4	11,624	ファルテック	1.4	821
ダイヘン	7.4	33,596	SMK	1.7	5,176	日本電子	13.3	54,463	武蔵精密工業	15.1	23,238
ヤーマン	11.1	25,796	ヨコオ	4.4	10,683	カシオ	59.7	111,937	日産車体	13.1	11,816
JVCケンウッド	55.1	7,769	ティアック	4.9	519	ファナック	63.3	1,605,604	新明和工業	18.3	15,115
ミマキエンジニアリング	6	3,060	ホシデン	18.6	16,293	日本シイエムケイ	15.9	6,375	極東開発工業	12.5	17,262
IPEX	2.8	5,502	ヒロセ電機	10.4	153,504	エンプラス	3.5	9,901	トピー工業	5.6	6,036
日新電機	15.7	18,290	日本航空電子	15.5	21,700	大真空	2.5	5,365	ティラド	2.4	3,069
大崎電気	13.3	7,341	TOA	7.2	6,264	ローム	28	243,880	タチエス	11.1	12,487
オムロン	60.3	568,629	マクセルホールディングス	14.6	17,520	浜松ホトニクス	48.3	283,521	NOK	36.1	41,587
日東工業	10	18,560	古野電気	8.7	10,335	三井ハイテック	7.5	21,592	フタバ産業	18.9	9,544
IDEC	9.8	18,081	ユニデンホールディングス	1.9	4,539	新光電気工業	22.7	52,459	KYB	7.6	19,136
正興電機製作所	1.7	3,648	スミダコーポレーション	5.2	5,470	京セラ	94.6	564,099	大同メタル工業	13.1	6,117
不二電機工業	1	1,301	アイコム	3.8	10,100	太陽誘電	30	142,050	プレス工業	33.6	10,180
ジーエス・ユアサ コーポ	22.6	57,042	リオン	2.8	8,974	村田製作所	197.6	1,803,890	ミクニ	8.4	2,326
サクサホールディングス	1.5	2,161	本多通信工業	5.8	2,743	双葉電子工業	10.8	9,342	太平洋工業	14.3	15,343
メルコホールディングス	2.3	7,038	船井電機	6.8	2,856	北陸電気工業	2.7	2,470	河西工業	9.2	3,192
テクノメディカ	1.5	2,236	横河電機	61.7	113,774	ニチコン	22.9	25,052	アイシン精機	55.4	171,463
ダイヤモンドエレクトリックHD	1.4	1,808	新電元工業	2.4	5,630	日本ケミコン	5.1	7,711	マツダ	198.2	122,289
日本電気	81.6	459,408	アズビル	42.5	199,112	KOA	10.2	14,596	今仙電機製作所	6.1	5,319

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30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
本田技研	529.5	1,520,459	パラマウントベッドHD	7.1	30,281	関西電力	254.5	243,123	ニッコンホールディングス	22.7	46,126
スズキ	133.4	747,573	トランザクション	4	3,752	中国電力	97.1	128,851	日石輸送	0.6	1,549
SUBARU	208.8	432,842	粧美堂	2	784	北陸電力	61.4	45,129	福山通運	8.1	37,503
安永	3.3	3,795	ニホンフラッシュ	6.3	8,593	東北電力	167.7	146,737	セイノーホールディングス	47.8	69,883
ヤマハ発動機	94.3	189,543	前田工業	7.5	19,477	四国電力	60.4	42,884	エスライ	2	1,864
TBK	7.9	3,570	永大産業	8.6	2,494	九州電力	138.5	122,018	神奈川中央交通	1.6	6,176
エクセディ	9.3	11,476	アートネイチャー	7.2	4,816	北海道電力	63.6	24,931	日立物流	11.7	36,387
豊田合成	21.8	61,737	パンダナムHLDGS	69.6	663,288	沖縄電力	13.2	19,153	丸和運輸機関	6.8	31,450
愛三工業	10.6	4,695	アイフィスジャパン	1.8	1,425	電源開発	53.5	75,114	C&Fロジホールディングス	6.4	11,891
盟和産業	1	873	共立印刷	11.3	1,401	エフオン	3.7	4,366	九州旅客鉄道	55.9	122,868
日本プラスト	5	2,250	SHOEI	6	21,630	イーレックス	9.7	19,050	SGホールディングス	133.9	417,768
ヨロズ	6.4	7,232	フランスベッドHLDGS	9.2	7,829	レノバ	11.3	29,267	海運業 (0.2%)		
エフ・シー・シー	11.2	22,310	パイロットコーポレーション	11.5	34,028	東京瓦斯	129.4	303,378	日本郵船	53.4	121,538
シマノ	25.2	623,448	萩原工業	3.7	5,672	大阪瓦斯	130.5	261,522	商船三井	40.4	110,211
テイ・エス テック	15.7	47,885	トッパン・フォームズ	14.4	14,371	東邦瓦斯	33.1	226,073	川崎汽船	19.7	33,273
ジャムコ	3.3	2,049	フジシールインターナショナル	15.2	29,442	北海道瓦斯	3.6	5,472	NSユナイテッド海運	3.6	4,770
精密機器 (2.8%)			タカラトミー	30.3	28,269	広島ガス	14.2	5,268	明治海運	6.6	2,699
テルモ	190.3	789,174	廣済堂	4.9	3,091	西部瓦斯	7.5	26,625	飯野海運	30.2	11,687
クリエートメディック	2.1	2,020	エステルホールディングス	2	1,234	静岡ガス	19.3	19,087	共栄タンカー	1.2	979
日機装	20.6	20,497	タカノ	2.6	1,552	メタウォーター	6.6	15,595	乾汽船	3.7	3,470
日本エム・ディ・エム	3.9	9,145	プロネクサス	5.7	6,127	陸運業 (3.5%)			空運業 (0.4%)		
島津製作所	80.4	301,902	ホクソン	5.7	627	SBSホールディングス	5.1	12,841	日本航空	142.6	281,920
JMS	5.7	5,352	ウッドワン	2.4	2,803	東武鉄道	70	219,100	ANAホールディングス	116.6	293,540
クボテック	1.9	701	大建工業	4.5	8,887	相鉄ホールディングス	21.4	54,548	パスコ	1.3	1,667
長野計器	5	3,925	凸版印刷	94.7	134,947	東急	169.4	214,629	倉庫・運輸関連業 (0.2%)		
プイ・テクノロジー	3.2	16,864	大日本印刷	87.8	171,736	京浜急行	86.2	154,039	トランコム	1.8	15,084
東京計器	4.2	3,750	共同印刷	2.1	6,127	小田急電鉄	100	316,500	日新	5.6	6,787
愛知時計	0.9	3,964	NISSHA	13.9	19,126	京王電鉄	34.9	258,609	三菱倉庫	20.2	60,398
インターアクション	3.6	6,768	光村印刷	0.6	1,077	京成電鉄	46.8	164,034	三井倉庫HOLD	7.4	16,627
オーバル	6.4	1,465	TAKARA & COMPANY	3.3	6,395	富士急行	9.2	44,390	住友倉庫	22.6	30,510
東京精密	12.3	56,641	アシックス	59.2	111,296	新京成電鉄	1.7	3,655	渋沢倉庫	3.5	7,861
マニー	26.8	68,554	ツツミ	2.1	4,433	東日本旅客鉄道	118.4	768,179	東陽倉庫	11.3	3,435
ニコン	102.7	66,652	小松ウオール工業	1.9	3,309	西日本旅客鉄道	60	285,840	日本トランスシティ	13.8	7,810
トプコン	34	45,118	ヤマハ	40	238,400	東海旅客鉄道	55.9	743,470	ケイヒン	1.2	1,654
オリンパス	372.3	840,094	河合楽器	2.1	5,670	西武ホールディングス	88.2	91,287	中央倉庫	3.9	4,680
理研計器	6	16,788	クリナップ	6.3	2,910	鴻池運輸	10.6	10,992	川西倉庫	1.1	1,255
タムロン	5.5	8,794	ピジョン	43.3	201,778	ピジョン	18.6	55,037	安田倉庫	5.1	5,038
HOYA	133.5	1,856,985	オリパー	1.4	3,305	ハマキョウレックス	5.2	15,189	ファイズホールディングス	1.4	1,555
シート	2.9	1,734	兼松サステック	0.4	644	サカイ引越センター	3.6	18,612	東洋埠頭	2	2,888
ノーリツ鋼機	4.6	10,248	キングジム	5.7	5,101	近鉄グループHLDGS	63.7	294,931	宇徳	5.5	2,546
エー・アンド・デイ	6.1	5,551	リントック	16	34,480	阪急阪神HLDGS	84.7	288,827	上組	35.6	64,258
朝日インテック	76.3	291,847	イトーキ	13.7	4,630	南海電鉄	30.1	78,922	サンリツ	1.5	1,024
シチズン時計	79.6	21,890	任天堂	41.3	2,447,438	京阪ホールディングス	28.3	139,094	キムラユニティー	1.6	1,651
リズム	2.1	1,337	三菱鉛筆	10.8	15,573	神戸電鉄	1.5	5,392	キューソー流通システム	1.6	2,640
大研医器	5.1	2,611	タカラスタンダード	13.7	18,906	名古屋鉄道	52.3	150,205	近鉄エクスプレス	13.6	29,512
メニコン	9.6	62,208	コクヨ	32.2	43,212	山陽電鉄	4.6	9,351	東海運	3.6	1,101
シンシア	0.9	344	ナカバヤシ	6.6	4,006	日本通運	22	153,560	エーアイティ	4.5	4,473
松風	3	5,469	グローブライド	3	12,135	ヤマトホールディングス	111.8	294,816	内外トランスライン	2.1	2,667
セイコーHD	9.5	12,768	オカムラ	23.4	21,925	山丸	17.7	68,056	日本コンセプト	2	3,486
ニプロ	46.4	51,968	美津濃	6.1	11,053	丸運	3.5	868	情報・通信業 (9.1%)		
その他製品 (2.7%)			電気・ガス業 (1.3%)			丸全昭和運輸	5.2	17,394	NECネットエスアイ	18.9	34,719
中本パックス	1.6	2,539	東京電力HD	537.1	146,091	センプーグループHLDGS	35.1	34,047	クロスキャット	1.8	2,484
スノーピーク	3.5	5,477	中部電力	205.5	258,416	トナミホールディングス	1.5	8,775	システナ	23.7	50,955

銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
デジタルアーツ	千株	千円	ザッパラス	千株	千円	フェイス	千株	千円	IMAGIA GROUP	千株	千円
日鉄ソリューションズ	3.3	29,469	システムリサーチ	2.9	1,403	プロトコーポレーション	2.3	1,835	ネットワークシステムズ	5.7	2,297
キューブシステム	9.8	30,233	インターネットアジアティブ	1.8	2,941	ハイマックス	6	6,318	システムソフト	25.2	93,744
エイジア	3.5	5,061	さくらインターネット	9.9	49,252	野村総合研究所	1.6	1,852	アルゴグラフィックス	20.3	1,867
コア	1.4	2,903	ヴィンクス	7	5,152	サイバネットシステム	93.5	329,587	マーベラス	5.7	18,240
ラクーンホールディングス	2.8	3,906	GMOグローバルサインHD	1.9	2,365	C Eホールディングス	5.1	4,936	エイブックス	10	9,070
ソリトンシステムズ	3.2	6,960	S R Aホールディングス	1.4	14,448	日本システム技術	4	2,404	日本ユニシス	11.5	10,833
ソフトクリエイイトHD	3.1	6,674	システムインテグレータ	3.5	8,680	インテジホールディングス	1.2	1,905	兼松エレクトロニクス	20.6	79,516
T I S	2.9	9,236	朝日ネット	2.3	1,527	東邦システムサイエンス	8.3	8,590	TBSホールディングス	3.6	14,544
JNSホールディングス	66.1	137,355	e B A S E	4.7	4,121	ソースネクスト	1.7	1,584	日本テレビHD S	40	74,760
電算システム	2.8	1,699	アバント	8	8,472	インフォコム	31.6	9,890	朝日放送グループHD	54.9	62,421
グリー	2.5	8,312	アドソル日進	6.3	6,961	H E R O Z	7.3	26,718	テレビ朝日HD	6.4	4,435
コーエーテックモHD	40.9	23,926	フリーベック	2.4	7,099	ラクスル	0.9	2,617	スカパー J S A T H D	18.1	30,480
三菱総合研究所	13.6	75,480	コムチュア	3.7	3,404	F I G	5.3	26,871	テレビ東京HD	43.6	20,622
ボルテージ	2.8	11,648	サイバーコム	7.5	24,225	システムサポート	7.7	2,102	日本BS放送	5.4	12,684
電算	1.9	1,052	アステリア	1.2	2,122	イーソル	1.4	2,081	ビジョン	2.1	2,230
AGS	0.7	1,688	アイル	4.4	4,818	アルテリア・ネットワークス	3.1	4,389	スマートバリュー	6.7	7,745
ファンデックス	3.7	3,189	マークライズ	3	5,283	東海ソフト	7.4	11,773	USEN-NEXT HLDGS	1.8	1,737
ブレインパッド	5.7	7,763	メディカル・データ・ビジ	3.7	8,151	ヒト・コミュニケーションズHD	0.4	446	ワイヤレスゲート	2.6	3,520
K L a b	7.4	23,088	g u m i	7.4	23,088	トビラシステムズ	1.3	1,950	コネクシオ	3.2	2,080
ポルトワイン・ピットクル	12.2	12,419	ショーケース	8.6	7,464	フォーカスシステムズ	0.8	1,382	日本通信	3.8	4,662
イーブイアジアティブ	8	7,680	モバイルファクトリー	1.6	1,200	クロスコム	4.2	3,792	クロップス	51.7	10,495
ネクソン	0.9	2,628	テラスカイ	1.6	1,588	フジ・メディア・HD	4	5,120	日本電信電話	1.3	1,045
アイスタイル	166.7	525,938	デジタル・インフォメーション	2.4	11,736	オービック	63.5	69,024	K D D I	882.2	2,174,623
エムアップホールディングス	18.4	8,335	PCIホールディングス	2.9	4,376	ジャストシステム	22.9	537,463	ソフトバンク	481.2	1,435,179
エイチーム	1.9	4,995	パイプHD	2.8	3,696	T D Cソフト	10.8	75,924	光通信	600.7	171,599
エニゴモ	4.5	4,396	アイビージー	0.9	1,527	Zホールディングス	5.9	6,159	エムティーアイ	6.8	170,476
テクノシージャパン	6.3	8,347	ネオジャパン	1.4	1,667	トレンドマイクロ	908.8	597,081	GMOインターネット	6.4	5,388
en i s h	5.3	4,022	P R T I M E S	1.2	3,307	日本オラクル	35.2	199,584	ファイバーゲート	24	70,464
コプロラ	3.5	1,655	ランドコンピュータ	1.2	4,260	アルファシステムズ	2.5	3,060	アイドマーケティングコム	2.1	4,468
オルトプラス	21.7	19,833	ダブルスタンダード	1	1,126	フューチャー	13.4	155,038	K A D O K A W A	2.1	800
ブロードリーフ	4.4	1,944	オープンドア	0.9	3,982	C A C H O L D I N G S	2.1	7,392	学研ホールディングス	17.9	59,249
クロス・マーケティングG	32.9	21,319	マイネット	3.4	4,287	S B テクノロジー	8	14,216	ゼンリン	8.9	14,542
デジタルハーツHLDGS	3.2	1,132	アカツキ	2.1	2,018	トーセ	4.4	6,468	昭文社ホールディングス	13.3	17,236
システム情報	3.7	4,384	ベネフィットジャパン	2.4	10,764	イービックビジネスC	2.4	8,688	インプレスホールディングス	3.1	1,522
メディアアド	4.9	5,733	UBICOMホールディングス	0.5	1,037	オイビックテクノソリューション	1.8	1,569	アイネット	5.3	922
じげん	2.1	15,750	L I N E	1.6	5,728	アイティフォー	6.7	49,580	松竹	3.4	5,059
ブイキューブ	16.5	5,395	カナミックネットワーク	15.3	82,314	東計電算	30.1	110,918	東宝	4.4	57,244
エンカレッジ・テクノロジ	3.6	12,132	ノムラシステムコーポレーション	6	4,884	エックスネット	8.1	7,460	東映	39	172,380
サイバーリンクス	1.3	1,012	チェンジ	3.4	1,315	大塚商会	1	4,355	N T T データ	2.5	41,850
ディー・エル・イー	4.2	8,004	シンクロ・フード	4.6	37,260	サイボウズ	1.1	1,079	ピー・シー・イー	175.5	243,594
フィックスターズ	1.3	1,487	オークネット	2.7	837	電通国際情報S	35.7	180,642	ビジネスB太田昭和	1.1	4,988
CARTA HOLDINGS	7.1	7,376	セグエグループ	3.6	4,928	A C C E S S	7.8	22,386	D T S	2.2	3,799
オプティム	2.9	3,694	イトレッド	1.3	1,764	デジタルガレージ	4.1	28,659	スクウェア・エニックス・HD	14.8	32,560
セレス	3.5	10,780	AOI TYO HOLDINGS	6.1	3,078	イーエムシステムズ	6.1	5,002	シーイーシー	28.2	180,762
S H I F T	2.3	6,479	マクロミル	1.7	2,793	ウェザーニューズ	11.9	50,277	カプコン	7.1	10,770
ティーガイア	2.7	41,769	ビーグリーン	13.5	8,775	C I J	9.3	7,626	アイ・エス・ビー	31.2	183,456
セック	5.9	10,850	オロ	1.3	2,561	ビジネスエン지니어リング	2.3	12,880	ジャストテック	1.4	4,190
日本アジアグループ	1	3,030	ユーザローカル	1.9	7,391	日本エンタープライズ	4.7	4,573	S C S K	4.2	5,733
テクマトリックス	7.3	6,095	テモナ	0.6	2,427	WOWOW	0.8	2,772	日本システムウエア	15.2	94,696
プロシッパ	9.4	21,582	ニーズウェル	1.3	1,790	スカラ	7.3	1,635	アイネス	2.2	4,626
ガンホー・オンライン・エンター	1.9	2,703	サインポスト	1	753	インテリジェント ウェイ	3.2	9,078	T K C	6.5	9,256
GMOペイメントゲートウェイ	16	42,448	ソルコムシーズン	1.3	1,284		4.6	3,979	富士ソフト	5.6	38,864
	14	204,960		2.9	3,062		3.7	2,627		7.1	35,926

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
NSD	千株	千円	小野建	千株	千円	山善	千株	千円	ヤマシタヘルスケアHLDGS	千株	千円
コナミホールディングス	21.2	42,294	南陽	5.5	6,682	椿本興業	26.1	25,943	国際紙/パルプ商事	0.7	993
福井コンピュータHLDGS	24	131,280	佐島電機	1.4	2,457	住友商事	1.2	4,374	ヤマタネ	15.9	4,054
JBCホールディングス	2.6	8,723	エコトレーディング	4.5	3,478	内田洋行	418.2	538,014	丸紅建材リース	3.3	4,524
ミロク情報サービス	4.5	6,664	伯東	1.5	927	三菱商事	2.6	13,338	日鉄物産	0.7	1,206
ソフトバンクグループ	5.9	12,030	コンドーテック	4.1	4,329	第一実業	434.6	1,057,381	泉州電業	4.7	16,685
卸売業 (4.5%)	523.9	3,809,800	中山福	5.2	5,283	キャンマーケティングJPN	3.3	13,282	トラスコ中山	2	5,750
ハウスイ	3.7	1,857	ナガイレベ	3.7	1,857	西華産業	16.5	36,019	オートバックスセブン	14.9	38,829
高千穂交易	8.7	23,507	三菱食品	8.7	23,507	佐藤商事	3.7	4,662	モリト	24.6	31,881
カワニホールディングス	2.5	2,727	三菱産業	7.2	19,857	菱洋エレクトロ	5.4	5,551	加藤産業	4.9	2,998
伊藤忠食品	0.7	996	第一興商	4.9	8,432	東京産業	6.8	18,713	北恵	9.6	33,168
エシマテック	1.6	8,992	メディアパルHD	9.9	33,363	ユアサ商事	6	3,342	イノテック	1.6	1,524
JALUX	6.2	5,939	SPK	71.4	140,158	神鋼商事	6.4	20,960	イエローハット	3.8	3,442
あらた	1.8	2,421	萩原電気HLDGS	2.8	3,494	阪和興業	1.6	2,976	JKホールディングス	12.6	20,286
トーメンデバイス	5.3	26,288	アズワン	2.5	6,040	正栄食品	3.9	1,072	日伝	6	14,148
東京エレクトロデバイス	4.3	68,972	スズデン	2.3	2,760	カナデン	12.5	31,250	北沢産業	5.2	1,456
フィールズ	1.9	2,804	尾家産業	1.9	2,804	三菱商事	4.3	16,211	杉本商事	3.5	8,347
双日	4.9	1,822	シモジマ	4.1	5,448	菱物商事	5.4	6,960	因幡電機産業	18.8	45,063
アルフレッサホールディングス	366.9	84,020	ドウシシャ	4.9	1,822	フルサト工業	4.8	7,238	東テク	2.2	5,544
横浜冷凍	73.6	153,824	小津産業	3.4	4,260	岩谷産業	14.9	84,632	ミスミグループ本社	83	271,825
神栄	17.5	14,875	高速	1.5	2,760	ナイス	2.5	3,902	アルテック	5.6	1,635
ラサ商事	1	691	たけびし	4	6,304	昭光通商	2.3	1,396	タキヨー	2	3,748
アルコニックス	3.4	3,066	リックス	2.4	3,595	ニチモウ	1	1,976	蔵王産業	1.1	1,438
神戸物産	7.1	9,790	丸文	1.5	2,475	極東貿易	1.9	2,616	スズケン	28	111,720
ハイパー	45.9	167,076	ハピネット	5.6	2,727	イワキ	8.7	4,576	ジェコス	4.5	4,306
あいホールディングス	0.9	525	橋本総業HLDGS	5.5	7,843	三愛石油	16.3	18,810	グローセル	6.5	2,730
ディー・ブイエックス	9.5	18,496	日本ライフライン	1.3	3,012	稲畑産業	14.8	20,394	小売業 (4.8%)		
ダイワボウHD	2.3	2,364	タカショー	19.7	28,328	G S Iフレオス	1.6	2,878	ローソン	16.8	79,464
マクニカ・富士ELHLDGS	5.7	37,164	マルカ	3.9	3,139	明和産業	6.3	2,564	サンエー	5.5	22,192
ラクト・ジャパン	15.8	32,658	I DOM	2.3	4,554	クワザホールディングス	6.3	2,564	カワチ薬品	5.2	15,589
バイタルK S K HD	2.6	7,651	進和	18	10,296	ヤマエ久野	2.3	1,340	エーピーシー・マート	10.3	56,032
八洲電機	12.7	10,934	エスケイジャパン	4	8,628	ワキタ	4.9	5,835	ハードオフコーポレーション	2.5	1,685
メディアスホールディングス	1.4	4,804	グイトロン	1.6	721	東邦ホールディングス	14.2	16,259	アスクル	7	29,225
レスタールホールディングス	2.8	3,333	シーク	2.8	4,130	サンゲツ	21.2	40,343	ゲオホールディングス	11.9	15,101
ジューテックHD	8.5	15,469	田中商事	8.5	13,311	ミツウロコグループ	9.8	12,661	アダストリア	9.3	15,810
大光	2.1	1,904	オーハシテクニカ	2.1	1,461	シナネンホールディングス	2.8	8,282	ジューフト	4.4	1,918
OCHIホールディングス	1.9	2,479	白銅	3.5	4,725	伊藤忠エネクス	14.7	14,700	シー・ワイ・エス・バイエリア	1	423
TOKAIホールディングス	3.2	2,079	ダイコー通産	2.3	3,295	サンリオ	18.6	29,295	くら寿司	3.7	20,905
黒谷	0.4	561	伊藤忠	0.4	561	サンワ テクノス	4.7	4,422	キャンドウ	3.2	5,894
Cominix	463.6	1,278,840	丸紅	689.3	419,439	リョーサン	7.2	13,356	パルグループHLDGS	6.9	7,866
三洋貿易	6.7	6,827	高島	1	1,574	新光商事	10	7,680	エディオン	30.4	29,640
ビューティガレージ	1.1	851	長瀬産業	36.9	52,951	トーホー	3	6,102	サラーコーポレーション	13.4	7,557
ウイン・パートナーズ	6.1	6,827	蝶理	4.3	6,622	三信電気	3.6	7,725	ワッツ	2.8	2,290
ミタチ産業	4.7	5,381	豊田通商	73.9	266,779	東陽テクノニカ	7.4	7,829	ハローズ	2.5	8,650
シッパヘルスケアHD	2	1,204	三共生興	9.3	4,064	モスフード サービス	8.7	23,516	フジオフードG本社	5.6	7,963
明治電機工業	10.7	55,640	兼松	6.6	14,289	加賀電子	6.6	14,289	あみやき亭	1.4	3,992
デリカフーズHLDGS	2.1	2,969	ツカモトコーポレーション	25	30,125	ソーダニツカ	6.8	3,672	ひらまつ	11.8	2,171
スターティアホールディングス	2.2	1,339	三井物産	1.3	1,821	立花エレクトック	4.9	8,070	大黒天物産	1.6	9,184
コマダホールディングス	1.7	1,234	日本紙/パルプ	573.9	1,021,542	フオーバル	2.9	2,549	ハニーズホールディングス	5.8	5,539
ピーバンドットコム	14.6	27,156	カメイ	3.8	13,091	PAL TAC	10.6	63,388	ファーマライズHD	1.5	1,170
アセンテック	0.6	547	東都水産	8.5	9,970	三谷産業	8.7	3,680	アルペン	5.1	11,143
富士興産	1.4	2,713	OUGホールディングス	0.8	3,640	太平洋興発	2.6	1,606	ハブ	1.9	1,126
協栄産業	2.2	2,024	スターゼン	2.5	10,612	西本WISMETTAC HD	1.2	2,706	クオールホールディングス	9.8	10,211

銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
ジンスホールディングス	3.5	24,885	JMホールディングス	5.1	12,418	千趣会	12.2	4,050	関西スーパーマーケット	5.5	6,886
ビックカメラ	39.4	44,167	サッドラホールディングス	0.9	1,818	タカキュー	6.1	847	王将フードサービス	4.9	29,400
DCMホールディングス	39.8	47,202	アレンザホールディングス	3.3	4,560	リテールパートナーズ	8.9	13,180	アプレナス	7.2	12,506
ペッパーフードサービス	5.7	1,607	串カツ田中HLDGS	1.3	2,080	ケーヨー	13.7	10,165	ミニストップ	5	6,750
Monotaro	47.2	300,664	パロックジャパン	4.6	3,095	上新電機	7.7	21,113	アークス	13.6	29,675
東京一番フーズ	1.5	832	クサリのアオキHLDGS	6	52,200	パローマス	10.5	55,440	パローホールディングス	14.7	38,102
DDホールディングス	2.7	1,671	カの源HD	3	1,764	ロイヤルホールディングス	11.7	20,849	藤久	1.2	1,069
きちりホールディングス	1.7	1,106	スシログローバルHLDGS	36.5	121,180	東天紅	0.5	463	ベルク	3.3	20,163
アークランドサービスHD	4.9	10,098	メディアシステムネットワーク	6.4	4,006	いなげや	8.2	16,719	大庄	3.5	3,360
J. フロント リテイリング	79.3	66,374	J. フロント HLDGS	3.1	2,139	島恋	12.5	68,500	ファーストリテイリング	8.9	764,866
ドトール・日レスHD	9.7	13,997	ノジマ	12	32,760	チヨダ	7	6,251	サンドラッグ	25	109,500
マツモトキヨシHLDGS	27.4	133,849	カップ・クリエイト	9.4	13,225	リンコーボレーション	5.1	18,793	サックスホールディング	5.5	2,920
プロンコピリー	3.5	8,053	ライトオン	4.9	3,028	ライフガーハット	8.3	18,359	ヤマザワ	1.4	2,416
ZOZO	45.7	119,002	ジーンズメイト	2.7	907	MrMa x HD	9.2	7,856	やまや	1.3	2,743
トレジャー・ファクトリー	2	1,386	良品計画	88.1	189,150	テンアライド	5.9	2,065	ペルーナ	14.4	13,766
物語コーポレーション	1.8	20,754	三城ホールディングス	6.9	2,007	AOKIホールディングス	13.5	5,521	銀行業 (4.6%)		
ココカラファイン	6.9	52,371	アドヴァン	10.3	13,400	オークワ	10.5	14,059	島根銀行	1.5	955
三越伊勢丹HD	116.4	65,300	アルビス	2.5	6,390	コムリ	10.3	29,200	じもとホールディングス	4.5	4,036
Hamee	2.4	4,231	コナカ	7.7	1,986	青山商事	13.8	6,154	めびきフィナンシャルG	344.9	73,808
ウエルシアHD	39.5	165,702	ハウス ローゼ	0.8	1,333	しまむら	7.7	83,160	東京きらぼしFG	9	10,260
クリエイティブSDH	11.2	41,552	G-7ホールディングス	3.9	9,500	はせがわ	3.4	1,006	九州フィナンシャルG	145	73,950
丸善CHI HD	7.2	2,592	イオン北海道	8.6	8,221	高島屋	48.7	39,106	ゆうちょ銀行	187.1	153,796
ミサワ	1.6	1,299	コジマ	11.4	8,607	松屋	13.5	9,706	富山第一銀行	15.7	4,584
ティーライフ	0.9	1,197	ヒマラヤ	2.2	1,993	Eイチ・ツー・オーリテイリング	31.8	20,447	コンコディア・フィナンシャル	378.6	140,460
エー・ピーホールディングス	1.5	618	コーナン商事	9.5	30,685	近鉄百貨店	2.5	8,237	西日本フィナンシャルHD	44.3	32,028
チムニー	2	2,462	エオン	2.4	5,529	丸井グループ	60.8	115,884	関西みらいFG	39.5	20,619
シュッピン	4.6	3,831	ワタミ	7.9	7,007	アクシアL リテイリング	5.5	26,097	33FG	6.2	7,942
オイシックス・ラ・大地	6.6	21,285	マルシェ	1.5	757	井筒屋	4	716	第四北越フィナンシャルG	11.5	27,186
ネクステージ	10.5	14,574	パナソニックHD	145.8	359,688	イオン	254.9	791,464	ひろぎんHLDGS	98.3	57,112
ジョイフル本田	19.4	28,188	西松屋チェーン	14.7	23,108	イズミ	13.5	48,600	新生銀行	48.9	60,733
鳥貴族	2.2	3,018	ゼンショーホールディングス	31.7	82,737	平和堂	13.4	28,461	あおぞら銀行	39.8	75,421
キリン堂ホールディングス	1.3	4,530	幸楽苑ホールディングス	4.2	7,450	フジ	8	15,368	三菱UFJフィナンシャルG	4,537.8	2,035,203
ホットランド	4.5	5,634	ハークスレイ	1.4	1,279	ヤオコー	7.6	54,264	リそなホールディングス	722.2	264,108
すかいらーくHD	74.4	117,626	サイゼリヤ	10	17,900	ゼビオホールディングス	8	6,080	三井住友トラストHD	125.4	382,595
SFPホールディングス	3.8	4,841	V Tホールディングス	27.6	10,350	ケースホールディングス	64	81,152	三井住友フィナンシャルG	458.8	1,391,081
縮半ホールディングス	5	6,875	魚力	1.9	3,237	OLYMPICグループ	3.4	3,400	千葉銀行	221.4	131,068
ヨシックス	1.1	1,905	ポプラ	1.8	734	日産東京販売HD	9.7	2,425	群馬銀行	127.5	41,437
ユナイテッド・スーパーマーケット	19.3	20,863	フジ・コーポレーション	1.8	4,195	シルバーライフ	0.9	1,773	武蔵野銀行	9.9	15,721
ゴルフダイジェスト・オン	2.9	2,682	ユナイテッドアローズ	7	10,241	一家ダイニングプロジ	0.5	275	千葉興業銀行	18	4,734
BEENOS	3	7,605	ハイデイ日高	9.6	16,252	GENKY DRUGSTORES	2.9	12,035	筑波銀行	28.1	5,507
あさひ	5	7,795	京都きもの友禅	3.9	881	ナルミヤ・インターナショナル	1.4	1,051	七十七銀行	22.4	32,838
日本調剤	4.1	6,211	コロナイド	22.1	34,078	ブックオフGHD	3.9	3,272	青森銀行	5.2	12,651
コスモス薬品	5.9	106,200	ピーシーデポコーポ	8.8	5,253	アインホールディングス	8.2	58,302	秋田銀行	4.3	5,989
トールール	3.2	2,457	壱番屋	4.6	23,552	元気寿司	1.7	3,952	山形銀行	7.5	8,857
オンリー	1.1	511	トップカルチャー	2.4	861	ヤマダホールディングス	201.9	100,142	岩手銀行	4.4	9,750
セブン&アイ・HLDGS	259.2	858,729	P L A N T	1.6	1,238	アークランドサカモト	10.5	18,784	東邦銀行	59.5	13,506
クリエイティブ・レストラン・ホール	36	19,836	スギホールディングス	13.3	92,169	ニトリホールディングス	28.7	638,001	東北銀行	3.1	3,335
ツルハホールディングス	14.5	221,560	薬王堂ホールディングス	2.9	6,962	グルメ軒屋	4.7	4,610	みちのく銀行	4.4	5,205
サンマルクホールディングス	5.3	7,616	ヴィア・ホールディングス	8.1	2,016	愛眼	5.4	1,220	ふくおかフィナンシャルG	56	104,328
フェリシモ	1.4	1,901	スクロール	10.1	7,807	ケーユーホールディングス	2.9	2,322	静岡銀行	161.6	119,907
トリドールホールディングス	16.5	23,133	ヨドンシーホールディングス	6.8	12,675	吉野家ホールディングス	22	41,932	十六銀行	8.3	16,458
TOKYO BASE	6	2,922	木曾路	8.8	20,759	松屋フーズHLDGS	3.2	10,976	スルガ銀行	63	21,231
ウィルプラスHLDGS	1.1	741	SR5ホールディングス	8.1	7,030	サガミホールディングス	8.9	11,062	八十二銀行	160.2	59,434

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在		銘柄	2020年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
山梨中央銀行	千株	千円	岡三証券グループ	千株	千円	日本駐車場開発	千株	千円	ランド	千株	千円
大垣共立銀行	7.8	5,764	丸三証券	56.4	20,811	スター・マイカ・HLDGS	66.2	8,407	カチタス	378.1	3,402
福井銀行	13.1	30,758	東洋証券	19.7	9,337	ADワークスグループ	3.3	4,554	トーセイ	16.5	51,150
北國銀行	5.7	11,371	東海東京HD	24.3	3,231	ヒューリック	14.3	2,216	穴吹興産	9.4	10,932
清水銀行	6.6	19,034	水戸証券	76.6	23,592	三栄建築設計	140.4	148,402	サンフロンティア不動産	1.5	2,521
富山銀行	2.7	5,103	いちよし証券	1.8	1,227	野村不動産HLDGS	2.7	4,684	インテリックス	9.4	8,657
滋賀銀行	1.3	4,498	松井証券	40.2	4,507	三重交通グループHD	40.2	90,852	ランドビジネス	2.4	1,344
南都銀行	13.3	31,560	マネックスG	12.2	5,734	サムティ	13.1	6,117	サンネクスタグループ	2.6	873
百五銀行	11.2	20,955	極東証券	37.7	31,668	日本商業開発	9.5	15,713	グランディアハウス	1.9	1,947
京都銀行	59.5	18,861	岩井コスモホールディング	50	17,450	ハウスコム	4.5	7,704	日本空港ビルデング	5.3	2,014
紀陽銀行	23.8	123,998	藍澤證券	8.7	6,281	日本管理センター	11	19,294	サービス業 (6.1%)	21.2	128,896
ほくほくフィナンシャルG	23.5	37,365	マナーパートナーズGP	6.3	8,391	サンセイラニディック	0.9	1,165	明豊ファシリティアークス	2.7	1,676
山陰合同銀行	44	45,628	スパークス・グループ	12	8,688	エストラスト	3.8	4,943	日本工営	4.4	12,474
中国銀行	39.5	21,527	小林洋行	30.8	7,238	フージャースHD	2.5	1,837	LIFFULL	22.6	8,836
鳥取銀行	57	52,497	かんぽ生命保険	2.8	744	オープンハウス	1.4	1,016	ミクシィ	12.4	35,352
伊予銀行	2.2	2,607	SOMPOホールディングス	23.4	40,716	東急不動産HD	20.7	85,594	ジェイエイワールコートメント	4.3	7,972
百十四銀行	94.8	65,601	アニコムホールディングス	124.8	500,448	イーブランド	180.2	91,181	日本M&Aセンター	49.3	359,890
阿波銀行	7.1	11,487	MS & AD	22	24,046	ピーロット	55.2	115,809	メンパーズ	1.9	4,351
大分銀行	10.2	7,221	第一生命HLDGS	173.5	526,572	ファーストブラザーズ	1	782	中広	0.6	231
宮崎銀行	10.8	27,734	東京海上HD	234.6	1,217,574	ハウスドゥ	3.4	2,822	UTグループ	10.2	33,609
佐賀銀行	3.9	9,067	T&Dホールディングス	375.5	617,509	シーアールイー	1.5	1,417	アイティメディア	2.6	6,656
沖縄銀行	4.5	10,350	アドバンスクリエイト	234.6	1,217,574	プロパティエージェン	3.5	4,140	E・Jホールディングス	6.2	8,078
琉球銀行	6.1	18,013	その他金融業 (1.1%)	198.4	241,849	ケイアイスター不動産	1.8	2,367	ビーネックスグループ	2.4	2,481
セブン銀行	15.5	13,531	全国保証	1.6	3,072	ジェイ・エス・ピー	1.1	1,731	コンダカホールディングス	8.1	9,234
みずほフィナンシャルG	222.8	51,021	ジェイリース	18.8	89,770	テンポイノベーション	2.2	5,585	アルトナー	15.5	6,153
高知銀行	901.1	1,196,210	イントラスト	2.3	1,545	リンクアンドモチベーション	1.7	1,096	パソナグループ	1.8	1,612
山口フィナンシャルG	2.5	1,965	日本モーゲージサービス	2.5	2,245	パーク24	1.3	4,244	CD S	7	12,628
長野銀行	82.6	53,855	Casa	2.8	3,189	パラカ	1.7	1,434	リンクアンドモチベーション	1.6	2,064
名古屋銀行	2.1	3,045	アルヒ	2.3	2,944	三井不動産	1.4	1,159	GCA	12.3	6,863
北洋銀行	5.1	13,800	プレミアグループ	10.7	20,554	平和不動産	35.8	55,704	エス・エム・エス	7.8	5,545
愛知銀行	101	23,533	クレディセゾン	3.6	8,082	東京建物	1.7	2,791	サニーサイドアップG	20.1	76,078
中京銀行	2.4	7,392	芙蓉総合リース	46.6	55,687	ダイビル	322.4	703,315	パーソルホールディングス	2.1	1,371
大光銀行	2.7	5,775	みずほリース	7	44,660	スターツコーポレーション	464.7	838,318	リニカル	64.4	123,132
愛媛銀行	2.2	2,756	東京証券シュリー	10.2	28,325	フジ住宅	12.2	41,724	クックパッド	3.2	2,259
トマト銀行	9	9,675	日本証券金融	13.4	92,594	空港施設	65.3	93,574	エスクリ	22.4	7,168
京葉銀行	2.5	2,752	アイフル	29.5	14,750	明和地所	17	22,831	アイ・ケイ・ケイ	2	620
栃木銀行	28	12,796	リコーリース	102	27,234	住友不動産	10.5	20,139	学情	3.1	1,912
北日本銀行	31.6	5,782	オンフィナンシャルサービス	5.2	15,085	テアオーシー	149	507,345	スタジオアリス	2.4	2,611
東和銀行	11.7	7,511	イオンコム	40.9	46,544	東京楽天地	12.5	7,987	シミックホールディングス	3.2	6,025
福島銀行	2.1	3,045	ジャックス	133	66,633	スターツコーポレーション	1.1	4,790	エプロ	3.3	4,524
大東銀行	7.3	1,642	オリコ	7.4	13,438	フジ住宅	8.9	25,089	NJS	1.3	1,313
トモニホールディングス	3.3	2,029	日立キャピタル	7.4	13,438	空港施設	7.7	4,735	総合警備保障	1.4	2,731
フィデアホール	51.5	17,201	オリックス	180.9	20,803	明和地所	6.3	2,923	カカココム	25.5	142,545
池田泉州HD	64.4	7,019	三菱UFJリース	15.7	37,585	グローバルクレスト	5	2,132	アイロムグループ	47.8	140,006
証券・商品先物取引業 (0.8%)	76.9	11,688	九州リースサービス	411.5	639,059	エスリード	4	7,025	セントレア・ホールディング	2.4	4,356
FPG	20.6	10,238	日本取引所グループ	167.9	80,424	日神グループHLDGS	2.7	3,555	サイネックス	4	3,596
マキャリアインベストメント	2.8	1,836	イー・ギャランティ	2.9	1,763	日本エスコン	10.3	3,883	ルネサンス	1.1	811
SBIホールディングス	75.1	212,533	アサックス	190.6	492,415	タカラレバン	12.2	11,248	ディップ	3.5	3,027
日本アジア投資	6.3	1,417	NECキャピタルソリューション	7.4	15,295	イオンモール	30.2	8,939	デジタルホールディングス	9.1	22,149
ジャフコグループ	10.3	46,144	不動産業 (2.0%)	2.7	4,895	毎日コムネット	3.8	3,059	新日本科学	3.8	7,094
大和証券G本社	534.4	242,671	いちご	84.9	28,017	ファースト住建	33.1	55,442	ツワイホールディングス	7.1	4,806
野村ホールディングス	1,166.9	611,455				2	1,430	キャリアデザインセンター	15.2	8,785	
						2.9	3,100		1.7	1,677	

2020年11月30日現在			2020年11月30日現在			2020年11月30日現在			2020年11月30日現在		
銘柄	株数	評価額	銘柄	株数	評価額	銘柄	株数	評価額	銘柄	株数	評価額
ベネフィット・ワン	23.5	79,195	りらいぬコミュニケーション	11.4	14,067	アトラエ	1.9	5,833	乃村工藝社	27.7	21,606
エムスリー	142	1,366,324	リソー教育	29.6	9,324	ストライク	2.4	15,168	藤田観光	2.9	4,277
ツカダ・グローバルHOLD	4	1,024	早稲田アカデミー	2.8	2,668	ソラスト	17.9	27,154	KNT-CTホールディングス	3.9	3,467
プラス	0.7	280	ユー・エス・エス	71.8	156,811	セラク	2.1	5,205	日本管財	6.9	14,310
アウトソーシング	37	53,058	東京個別指導学院	2.3	1,409	インソース	2.8	10,332	トイカイ	6.2	12,604
ウエルネット	6.6	3,240	サイバーエージェント	39.8	284,570	イカルストコンサルティング	3.9	67,782	白洋舎	0.8	1,957
ワールドホールディングス	2.3	4,678	楽天	300.7	351,518	ORCHESTRA HLDGS	1.6	4,048	セコム	68.2	708,939
ディー・エヌ・エー	27.5	50,325	クリーク・アンド・リバー社	3.4	3,515	アイモバイル	2.2	2,866	セントラル警備保障	3.1	10,772
博報堂D Y H L D G S	89.2	134,692	テー・オー・ダブリュー	10.4	2,912	キャリアインデックス	2.8	2,032	丹青社	12.2	9,296
ぐるなび	11.3	5,842	山田コンサルティングGP	4.1	3,977	MS - J a p a n	2.2	1,742	メイテック	8	38,440
タカミヤ	6.7	3,664	セントラルスポーツ	2.4	5,160	船場	1.1	995	応用地質	6.9	8,383
ジャパネットホスチエ	5	4,800	フルキャストホールディングス	5.8	9,819	グレイステクノロジー	3	24,990	船井総研ホールディング	13.3	33,462
ラジオコミュニケーションズ	17.8	7,440	エン・ジャパン	11.5	37,375	ジャパンエレベーターSHD	7.1	34,541	進学会ホールディングス	2.5	1,112
ライク	2.2	4,604	リソルホールディングス	0.7	2,635	フルテック	0.9	1,296	オオバ	4.8	3,614
ビジネス・ブレイクスルー	3.2	1,347	テクノプロ・ホールディング	12.9	113,520	グリーンズ	1.8	824	いであ	1.5	2,604
エスポール	16.6	12,632	アトラ	1.7	455	ツナググループHLDGS	0.9	318	学究社	1.8	2,181
WDBホールディングス	3	8,520	インターワークス	1.6	516	GAMEWITH	1.7	979	ベネッセホールディングス	21.5	47,128
手問いらず	0.4	2,128	アイ・アールジャパンHD	2.6	43,290	ソウルドアウト	1.3	2,021	イオンデライト	7.9	20,808
ティア	3.6	1,486	Keepert 技研	4.8	10,104	MS&CONSULTING	1	620	ナック	3.6	3,294
CDG	0.7	1,048	ファーストロジック	1.4	1,145	ミダック	0.8	2,708	ダイセキ	10.8	31,978
パルユーコマース	4.1	14,268	三機サービス	1.3	1,298	日総工産	4.5	3,384	ステップ	2.4	3,746
インフォーマット	65.2	69,829	Gunosy	4	3,004	キュービernetHLDGS	2.9	4,602			
JPホールディングス	20.2	5,676	デザインワン・ジャパン	1.5	336	RPAホールディングス	4.8	3,230	合計	株数	千円
Eコナックホールディングス	13.5	1,215	イー・ガーディアン	3.2	10,144	スプリックス	2.1	1,768		金額	千円
E P S ホールディングス	8.8	8,439	リブセンス	4.4	1,104	マジメントソリューションズ	2.8	4,222		70,971.9	163,479,342
レックス	1.7	2,538	ジャパンマテリアル	19.9	28,874	プロレド・パートナーズ	0.9	4,383		2,143銘柄	<97.9%>
プレステージ・インター	24.3	23,376	ベクトル	8.2	7,544	AND FACTORY	0.5	395			
アミューズ	3.5	9,012	ウチヤマホールディングス	3.2	953	ギークス	0.6	721			
ドリームインキュベータ	1.9	2,756	チャームケアソリューション	5.5	7,419	カープスホールディングス	17.8	12,851			
クイック	3.9	4,387	キャリアリンク	2.3	4,480	フォーラムエンジニアリング	3.3	2,692			
TAC	4.4	963	I B J	4.5	3,451	アドバンテッジリスクマネ	3.3	2,283			
ケネディクス	55.8	42,352	アサンテ	2.7	3,798	リログループ	35.2	102,537			
電通グループ	72.2	245,480	N・フィールド	4.3	3,375	東祥	4	5,320			
ティクアンドギヴェニス	2.4	1,382	バリューHR	2.6	4,825	エイチ・アイ・エス	10.1	16,261			
ぴあ	1.8	4,887	M&Aキャピタルパートナー	5.3	33,390	ラックランド	1.5	3,504			
イオンファンタジー	2.5	5,500	ライオンエクスプレスHD	2.5	5,052	共立メンテナンス	10.7	38,894			
シーティーエス	7.3	6,862	ERIホールディングス	1.8	1,245	イチネンホールディングス	7.2	9,446			
ネクシィーズグループ	2.2	1,887	アピスト	0.9	2,697	建設技術研究所	4.2	8,883			
HUグループHD	18.1	51,150	シグマクシス	4.4	7,216	スペース	4.1	3,308			
アルプス技研	5.7	11,941	ウィルグループ	4.3	4,209	長大	2.5	3,257			
サニックス	11.4	3,169	エックローAJ	9	2,979	燦ホールディングス	2.8	3,416			
ダイオーズ	1.2	1,131	リクルートホールディングス	460.5	2,026,200	スバル興業	0.4	3,252			
日本空調サービス	6.8	5,181	エラン	4.2	13,398	東京テアトル	3.1	3,992			
オリエンタルランド	68.4	1,215,126	土木管理総合試験	2.9	1,044	タナベ経営	1.1	1,449			
ダスキン	15.9	44,106	ネットマーケティング	2.3	1,331	ナガワ	2	18,280			
明光ネットワークジャパン	8.1	4,276	日本郵政	525.5	406,053	よみうりランド	1.4	8,456			
ファルコホールディングス	3.5	5,554	ベルシステム24HLDGS	10.9	17,472	東京都競馬	4.2	21,714			
秀英予備校	1.4	588	鎌倉新書	4.9	5,252	常興興産	2.6	3,777			
田谷	1.2	656	SMN	1.3	998	カナモト	10.7	23,251			
ラウンドワン	18.1	15,547	一蔵	0.7	257	東京ドーム	26.4	35,560			
リゾートトラスト	29.6	48,188	LITALICO	2.2	7,810	西尾レントオール	6	12,198			
ビー・エム・エル	8.3	27,224	グローバルキッズCOMP	1	922	アゴラ・ホスピタリティG	47.5	1,140			
ワタベウェディング	1	289	エアトリ	3.3	4,049	トランス・コスモス	6.2	16,740			

(2) 先物取引の銘柄別残高
(評価額)

銘柄別	2020年11月30日現在	
	買建額	売建額
国内	百万円 2,966	百万円 -

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付および借入状況

区分	2020年11月30日現在	
	貸付	借入
株式	4,284,300 (47,400)	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47,400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32期（決算日 2020年9月23日）

（作成対象期間 2019年9月20日～2020年9月23日）

トピックス・インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

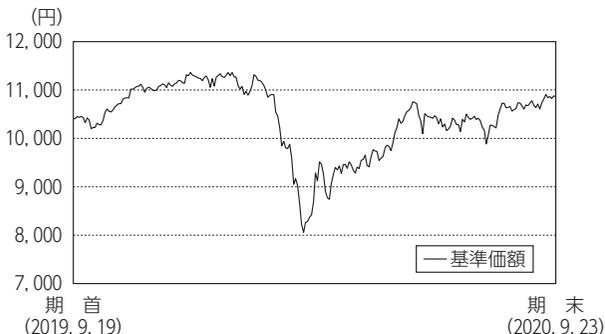
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



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

(注1) 騰落率は期首比。

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

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注4) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,406円 期末：10,865円 騰落率：4.4%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

株式ポートフォリオは、最適化の手法（株価変動を数理的にいくつかの要因に分解し、それに基づいて、ポートフォリオがベンチマークと同じように変動するよう、銘柄、株数を決定する体系的な手法）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1.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.4%となりました。

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

・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、売買コスト等が乖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)	0円 (0)
(先物・オプション)	(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

(2019年9月20日から2020年9月23日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 14,424.5 (815.35904)	千円 26,093,250 (—)	千株 9,136.059	千円 18,563,732

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2019年9月20日から2020年9月23日まで)

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

(2019年9月20日から2020年9月23日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2019年9月20日から2020年9月23日まで)

買 付	当 期			売 付	当 期		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
銘柄	株 数	金 額	平均単価	銘柄	株 数	金 額	平均単価
トヨタ自動車	千株 129.3	千円 908,611	円 7,027	トヨタ自動車	千株 71.8455	千円 521,789	円 7,262
ソニー	69	472,389	6,846	ソニー	64.6	444,591	6,882
NTTドコモ	148.9	440,065	2,955	キーエンス	7.7	363,514	47,209
ソフトバンクグループ	89.7	406,405	4,530	KDDI	97.8	300,687	3,074
任天堂	9.6	384,932	40,097	武田薬品	73.5	295,341	4,018
三菱UFJフィナンシャルG	765.7	370,857	484	日本電信電話	68.1	249,300	3,660
日本電信電話	114.1	362,502	3,177	本田技研	81.2	233,730	2,878
キーエンス	8.3	358,955	43,247	ソフトバンクグループ	49.4	231,915	4,694
武田薬品	90.7	338,265	3,729	三菱UFJフィナンシャルG	443.8	223,249	503
日立	74.9	284,250	3,795	ソフトバンク	140.7	208,345	1,480

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首			当期末			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	2.8	3.3	9,071					前田建設	49.1	53.5	42,372					中外炉工業	2	2.3	3,686		
日本水産	84.9	92.4	42,134					佐田建設	4.5	4.5	2,007					ヤマト	6.3	6.8	4,692		
マルハニチロ	12.3	13.4	33,057					ナカノフドー建設	5.4	5.7	2,274					太平電業	4.7	5.2	11,965		
カネコ種苗	2.6	2.8	4,365					奥村組	11.5	10	26,990					高砂熱学	17	17.7	26,974		
サカタのタネ	10.1	11	40,150					東鉄工業	8.4	9	25,551					三晃金属	0.8	0.8	1,743		
ホクト	7.1	7.1	15,982					イチケン	1.3	1.5	2,416					朝日工業社	1.5	1.4	4,452		
ホクリヨウ	1.1	1.6	1,076					富士ピー・エス	2.9	3	1,941					明星工業	12.7	13.8	11,426		
								浅沼組	2.4	2.4	10,068					大気社	9.5	10.4	30,357		
鉱業 (0.2%)								戸田建設	81.3	87.6	62,283					ダイダン	4.7	5.1	14,331		
住石ホールディングス	18.5	18.4	2,281					熊谷組	10	9.9	27,096					日比谷総合設備	6.3	6.9	12,275		
日鉄鉱業	1.9	2.1	9,996					青木あすなろ建設	3.6	—	—					東芝プラントシステム	15.2	—	—		
三井松島 HLDGS	3.6	3.4	2,594					北野建設	1.5	1.3	3,471					フィル・カンパニー	—	1.2	2,336		
国際石油開発帝石	340.3	339.1	196,203					植木組	0.9	0.9	2,538					OSJ B HD	31	33.3	8,125		
石油資源開発	12.2	12.1	20,509					矢作建設	9.5	9.3	8,472					東洋エンジニア	8.3	8.7	3,027		
K&O エナジーグループ	4.1	4.5	6,700					ピーエス三菱	7.4	7	4,333					レイズネクスト	12.5	11.2	14,459		
								日本ハウス HLDGS	13.4	14.2	3,961					食料品 (3.7%)					
建設業 (2.5%)								大東建託	24.9	23.1	215,684					日本製粉	19.8	20.1	34,672		
ヒノキヤグループ	2.1	2.3	4,503					新日本建設	8.3	9	7,992					日清製粉G本社	70.8	77.3	131,873		
ショーバンドHD	12.1	14.3	73,502					N I P P O	18.5	17.4	50,460					日東富士製粉	0.4	0.5	3,250		
ミライト・ホールディングス	23.8	27.4	44,168					東亜道路	1.3	1.3	4,732					昭和産業	5.7	6.3	21,829		
タマホーム	4.1	5	6,845					前田道路	20.8	18.8	36,716					鳥越製粉	5.6	6	6,360		
サンヨーホームズ	1.2	0.5	329					日本道路	1.9	2	15,740					中部飼料	7.6	8.4	14,968		
日本アーク	3.4	3.8	2,553					東亜建設	6.1	6.7	11,195					フィード・ワン	42.1	45.7	8,820		
ファーストコーポレーション	2.6	3	2,013					日本国土開発	11.5	20.8	13,187					東洋精糖	0.9	1.2	1,465		
ベステラ	1.6	1.6	1,920					若築建設	3.5	3.7	4,602					日本甜菜糖	3.6	3.5	6,485		
キャンディル	—	1.4	1,090					東洋建設	25.7	23.9	9,894					三井製糖	4.9	6	11,544		
スペースバリューHD	10.4	11.1	5,605					五洋建設	83.3	84.8	58,088					塩水港精糖	6.6	6.9	1,593		
ダイセキ環境ソリューション	1.6	1.8	1,285					世紀東急	10.2	10.2	8,160					日新製糖	2.9	3.3	6,270		
第一カッター興業	1	1.1	2,483					福田組	2.3	2.5	13,625					森永製菓	15.8	16	66,160		
明豊ファシリティワークス	—	2.7	1,873					住友林業	49.6	53.9	93,354					中村屋	1.6	1.8	7,641		
安藤・間	54.4	54.9	41,120					日本基礎技術	7.2	7.3	3,613					江崎グリコ	18.6	19	88,540		
東急建設	24.8	27.1	12,845					巴コーポレーション	8.7	9.2	3,578					名糖産業	3	3.3	5,260		
コムシスホールディングス	30.1	32.6	96,039					大和ハウス	193.8	209.9	595,171					井村屋グループ	2.7	3.8	9,640		
ミサワホーム	6.7	—	—					ライト工業	13.5	12.2	19,568					不二家	3.5	3.8	9,044		
ピーアルホールディングス	9.3	9.9	7,860					積水ハウス	214.2	229.3	442,434					山崎製パン	47.1	51.2	93,440		
高松コンストラクションGP	5.3	5.7	12,967					日特建設	6	5.5	4,411					第一屋製パン	1.1	1.3	1,293		
東建コーポレーション	2.6	2.8	21,924					北陸電気工事	3.4	3.6	4,140					モロゾフ	1.1	1.1	6,545		
ソネック	0.8	0.9	807					ユアテック	11.2	11.9	7,842					亀田製菓	3.9	3.9	20,982		
ヤマウラ	3.3	4	3,504					日本リーテック	—	4.5	13,405					寿スピリッツ	6.6	6.6	34,518		
大成建設	69.7	70.8	262,668					四電工	1	1.1	2,508					カルビー	28.6	31.2	107,328		
大林組	209.8	212.7	211,849					中電工	9	8.2	19,097					森永乳業	12.6	12.6	68,292		
清水建設	214.1	215.5	175,632					関電工	31.8	29.8	25,955					六甲バター	4.2	4.5	8,217		
飛島建設	6	5.9	6,531					きんでん	46.5	50.1	92,785					ヤクルト	46.4	46.8	274,716		
長谷工コーポレーション	87.4	81.8	119,755					東京エネシス	7.2	7	5,369					明治ホールディングス	44.4	45	364,500		
松井建設	7.7	8.3	5,511					トーエネック	2	2	7,070					雪印メグミルク	15.1	16.5	41,200		
銭高組	0.9	0.9	4,369					住友電設	4.8	6	14,796					プリマハム	8.8	10.7	33,651		
鹿島建設	164	166.7	216,376					日本電設工業	11.9	11.6	25,554					日本ハム	26	26.1	122,148		
不動テトラ	4.8	5.5	8,382					協和エクシオ	27.4	32.2	88,228					林業産業	2	2.3	1,357		
大末建設	2.5	2.3	2,116					新日本空調	5.6	5.6	12,381					丸大食品	6.7	7.3	13,578		
鉄建建設	4.3	4.6	9,788					九電工	13.8	14.9	46,115					S Foods	5.6	5.5	15,983		
西松建設	15.1	16.4	34,751					三機工業	15.3	15.3	18,329					柿安本店	—	2.3	6,124		
三井住友建設	50.5	51.7	22,386					日揮ホールディングス	60.4	65.8	69,616					伊藤ハム米久 HLDGS	40.3	44.2	33,592		
大豊建設	4.7	4.8	14,390																		

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
サッポロホールディングス	21.4	23.3	44,736		シキボウ	3.2	4	3,940		日産化学	37.1	36.8	199,456	
アサヒグループホールディング	131.3	143.3	533,935		日本毛織	20	21.4	21,143		ラサ工業	2.2	2.3	4,719	
キリンHD	265.9	288	565,776		ダイトウボウ	10.4	12.1	1,379		クレハ	5.7	5.7	27,388	
宝ホールディングス	47	50.7	57,798		トア紡コーポレーション	2.5	2.6	1,294		多木化学	1.8	2.6	17,446	
オエノンホールディングス	16.6	18	7,632		ダイドリーミテツド	7.2	9.7	1,940		テイカ	5	4.9	7,026	
養命酒	1.9	2.1	3,912		帝国繊維	6.9	7.5	20,272		石原産業	11.8	11.9	8,901	
コカ・コーラボラーツJHD	44	48	84,528		帝人	49.8	54.1	91,374		片倉コープアグリ	1.8	1.6	2,028	
サントリー食品インター	41.9	45.7	180,515		東レ	474.6	480.7	237,754		日本書達	9.7	9.9	30,888	
ダイドーグループHD	3.5	3.5	18,935		サカイオーベックス	1.5	1.7	3,578		東ソー	94.5	102.5	179,887	
伊藤園	19	20.8	154,336		住江織物	1.8	1.4	2,713		トクヤマ	17.6	19.2	50,419	
キーコーヒー	6.2	6.7	15,356		日本フェルト	3.5	3.5	1,725		セントラル硝子	13.4	13.5	30,550	
ユニカフェ	1.6	1.6	1,648		イチカフ	0.9	0.9	1,249		東亜合成	38.4	41.5	48,140	
ジャパンフーズ	0.9	0.9	1,170		日東製網	0.7	0.8	1,190		大阪ソーダ	6.8	6.7	17,641	
日清オイログループ	8	8.8	28,468		アツギ	5.1	5.3	2,883		関東電化	14.6	15.8	11,913	
不二製油グループ	15.3	16.7	54,108		ダイニツク	2.5	2.4	1,958		デンカ	24	24.2	78,892	
かどや製油	0.7	0.8	3,072		セーレン	15.1	16.4	24,731		信越化学	107.8	113.7	1,591,800	
J-オイルミルズ	3.2	3.6	14,130		ソトー	2.4	2.4	2,342		日本カーバイド	2.1	2.1	2,681	
キッコーマン	41.4	49.1	284,780		東海染工	0.8	0.9	1,026		堺化学	4.1	4.3	8,793	
味の素	138.5	150.4	326,969		小松マテーレ	10	10.8	9,644		第一稀元素化学工	6.6	7.1	5,360	
キュービー	34.9	38.1	80,352		ワコールホールディングス	17.3	16.7	32,915		エア・ウォーター	50.1	61.8	92,514	
ハウス食品G本社	23.4	25.6	93,952		ホギメディカル	7.6	7.5	27,750		太陽日酸	50.4	63.7	106,570	
カゴメ	23.8	26	93,730		レナウン	17.9	—	—		日本化学工業	2.1	2.1	5,033	
焼津水産化工	3.1	3.2	3,158		クラウディア HLDGS	1.5	1.7	540		東邦アセチレン	0.9	0.8	1,008	
アリアケジャパン	5.7	6.2	44,950		T S Iホールディングス	22.6	22.1	7,160		日本パーカラライジング	33.4	33.6	33,902	
ビエトロ	0.8	0.8	1,372		マツココーポレーション	1.9	1.9	4,164		高圧ガス	9.7	10.6	9,094	
エバラ食品工業	1.5	1.7	3,976		ワールド	8	9.5	13,471		チタン工業	0.8	0.9	1,528	
やまみ	0.3	0.6	1,323		三陽商会	3.2	3.5	2,093		四国化成	10.3	9.7	11,155	
ニチレイ	32.6	32.6	91,247		ナイガイ	2.2	2.5	970		戸田工業	1.3	1.5	3,726	
東洋水産	32.3	35.1	200,772		オンワードホールディングス	36.8	40.1	11,027		ステラケミファ	3.6	3.6	10,944	
イートアンド	2.2	2.3	4,574		ルックホールディングス	2.1	2.1	1,789		保土谷化学	2.1	2.5	12,125	
大冷	0.7	0.8	1,928		ゴールドウイン	5.5	12	94,440		日本触媒	10.3	10.2	58,956	
ヨシムラ・フード・HLDGS	1.7	3.8	3,564		デサント	14.9	13	23,270		大日精化	5.1	5.9	13,528	
日清食品HD	26.6	29	290,580		キング	3.3	3	1,764		カナカ	15.8	17.2	51,531	
永谷園ホールディングス	3.4	3.4	7,986		ヤマトインターナショナル	3.7	5.7	2,052		三菱瓦斯化学	62.1	61.8	122,858	
一正蒲鉾	2.4	2.6	2,810		バルブ・紙 (0.2%)					三井化学	55.5	61.5	50,004	
フジッコ	6.8	7.4	15,332		特種東海製紙	3.9	4.1	19,044		J S R	61.4	61.8	154,500	
ロックフィールド	6.8	7.3	10,555		王子ホールディングス	275.2	277.1	136,887		東京応化工業	10.5	11.4	61,104	
日本たばこ産業	361.9	364.8	713,366		日本製紙	29.4	29.3	38,646		大阪有機化学	5.6	6.1	17,037	
ケンコーマヨネーズ	3.5	3.8	7,037		三菱製紙	10	7.3	2,642		三菱ケミカル HLDGS	408.7	442.5	289,041	
わらべや日洋HD	4.1	4.4	6,846		北越コーポレーション	40.5	39.9	14,523		K Hネオケム	10.8	11	27,071	
なとり	3.5	3.9	7,998		中越パルプ	2.6	2.8	4,256		ダイセル	90.2	86.7	70,313	
イフジ産業	1	1	945		巴川製紙	2	2.1	1,942		住友ベークライト	10.6	10.5	30,922	
ピッルスコーポレーション	1.5	1.5	4,327		大王製紙	29.9	29	40,310		積水化学	131.5	139.9	237,550	
北の達人コーポ	24.6	23.8	13,542		阿波製紙	1.6	2	958		日本ゼオン	55.1	60.2	71,216	
ユウグレナ	26.8	29.4	27,224		レンゴー	63	62.5	50,250		アイカ工業	18.4	19.9	75,520	
ミヨシ油脂	2.4	2.5	2,875		トーモク	3.7	4.1	6,929		宇部興産	30.8	33.4	63,059	
理研ビタミン	3	6.5	14,534		ザ・バック	4.6	5	15,675		積水樹脂	10.1	11.9	26,739	
繊維製品 (0.5%)					化学 (7.4%)					タキロンシーアイ	13.1	14	9,856	
片倉工業	8.9	9.2	11,628		クラレ	96.3	104.8	112,869		旭有機材	4.2	3.8	5,316	
グンゼ	4.1	4.9	20,310		旭化成	435.1	439.2	408,324		日立化成	28.3	—	—	
東洋紡	26	26.4	43,876		共和レザー	3.8	3.6	2,347		ニチパン	3.2	3.5	6,121	
ユニチカ	18.1	19.8	7,246		昭和電工	43.5	47.5	98,325		リケンテクノス	16.7	16.6	6,839	
富士紡ホールディングス	3.2	3.2	11,888		住友化学	481.2	488.4	178,266		大倉工業	2.9	3.1	4,839	
倉敷紡績	5.8	6.6	13,391		住友精化	3	3	10,260		積水化成品	9.1	8.9	5,366	

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
群栄化学	1.6	1.4	3,710		荒川化学工業	5.6	6.1	7,759		日医工	16.5	19.2	23,347	
タイガースポリマー	3.1	3.4	1,472		メック	4.3	4.6	8,740		キッセイ薬品工業	11	12	28,344	
ミライアル	1.8	2.3	2,688		日本高純度化学	1.7	1.8	4,914		生化学工業	12.1	13.2	15,391	
ダイキアクシス	2.2	2.4	2,097		タカラバイオ	16.4	17.8	52,332		栄研化学	11	11.9	25,132	
ダイキョーニシカワ	12.9	14.1	8,093		JCU	8.1	8.2	28,659		日水製薬	2.6	2.8	3,292	
竹本容器	2.2	2.2	2,175		新田ゼラチン	4	4	2,896		鳥居薬品	3.9	4.3	12,900	
森六ホールディングス	3.3	3.6	6,595		OATアグリオ	1	1.2	1,473		JCRファーマ	4.4	4.8	59,136	
日本化薬	37.9	41.4	41,565		デクセリアルズ	16.2	17.6	20,380		東和薬品	9	8.6	18,885	
カーリットホールディングス	6.5	6.9	3,677		アース製薬	4.7	4.8	37,680		富士製薬工業	4.3	4.6	6,026	
日本精化	4.9	5.4	9,115		北興化学	6.4	6.6	4,732		沢井製薬	12.8	13.9	78,535	
扶桑化学工業	6.2	6.7	24,388		大成ラミック	2.1	2.2	6,263		ゼリア新薬工業	12.4	12.3	25,374	
トリケミカル	1.4	1.5	17,700		クマイ化学	25.9	28.1	30,348		第一三共	178.7	193.5	1,888,947	
ADEKA	30.1	30.5	48,708		日本農薬	11.2	12	6,132		キョーリン製薬HD	13.8	15	33,015	
日油	23	24.9	104,331		アキレス	4.3	4.7	8,300		大幸薬品	2.8	8.3	19,828	
新日本理化	10.9	10.7	1,744		有沢製作所	9.9	10.7	10,336		ダイト	3.7	4.2	14,742	
ハリマ化成グループ	5	5.5	6,044		日東電工	43.1	46.7	303,550		大塚ホールディングス	119	140.5	629,861	
花王	149.5	162	1,328,724		レック	6.7	7.2	12,168		大正製薬HD	13.2	14.3	97,383	
第一工業製薬	2.3	2.5	10,750		三光合成	7.2	7.5	2,092		ペプチドリーム	31.6	34.4	149,640	
石原ケミカル	1.6	1.8	4,213		きもと	10.7	12.4	2,083		石油・石炭製品 (0.4%)				
日華化学	2.1	2.2	2,065		藤森工業	5.6	6.1	25,955		日本コークス工業	52.6	56	3,416	
ニイタカ	1	1.4	4,753		前澤化成工業	4.3	4.3	4,403		ニチレキ	8	8	13,872	
三洋化成	4.1	3.9	19,578		未来工業	3.4	3.5	7,290		ユシロ化学	3.2	3.7	4,961	
有機合成薬品	4.8	5.9	2,023		ウェーブロックHLDGS	1.8	2.3	1,757		ビービー・カストロール	2.2	2.4	2,844	
大日本塗料	6.9	7.5	7,710		ジェイ エス ピー	3.7	4	6,320		富士石油	15.3	17.7	3,274	
日本ペイント HOLD	50.5	54.7	603,888		エフピコ	6.9	7.5	64,050		MORESCO	2.3	2.3	2,217	
関西ペイント	68.8	74.5	196,680		天馬	4.2	4.5	8,050		出光興産	72.1	74.9	181,108	
神東塗料	5	6.8	1,169		信越ポリマー	11.2	12.2	10,931		ENEOSホールディングス	1,033	1,014.5	406,814	
中国塗料	20.1	18.8	19,401		東リ	15.6	16.8	4,586		コスモエネルギーHLDGS	18.1	19.7	31,382	
日本特殊塗料	4.6	5	5,070		ニフコ	25	25.1	71,258		ゴム製品 (0.6%)				
藤倉化成	8.2	8.9	5,028		バルカー	5.1	5.5	10,439		横浜ゴム	36.1	39.4	60,715	
太陽ホールディングス	5.1	4.9	27,391		ユニ・チャーム	120.4	143.7	672,084		TOYO TIRE	35.9	35.9	61,604	
DIC	25.8	28.1	73,818		ショーエイコーポ	0.5	0.9	1,141		ブリヂストン	191.9	179.5	611,018	
サカタインクス	13.4	14.6	15,023		医薬品 (6.5%)					住友ゴム	56.1	61.2	58,507	
東洋インキSCホールディングス	12.9	13.9	27,494		協和キリン	62.8	68	195,500		藤倉コンポジット	5.5	6.2	2,256	
T&K TOKA	4.7	5.1	4,171		武田薬品	545.3	562.5	2,206,687		オカモト	4.2	4.1	17,445	
富士フィルムHLDGS	129.7	129.7	685,205		アステラス製薬	549.4	586.3	951,858		フコク	2.7	3	2,046	
資生堂	124.1	134.5	835,245		大日本住友製薬	46.3	50.2	69,426		ニッタ	7	7.7	17,586	
ライオン	81.2	88	196,152		塩野義製薬	79.8	85.1	490,941		住友理工	12.1	13.3	7,368	
高砂香料	4.3	4.3	9,210		田辺三菱製薬	65.4	—	—		三ツ星ベルト	8.2	9	15,219	
マンダム	14.1	15.3	28,029		わかもと製薬	7.5	8.5	2,405		バンドー化学	11.9	12	7,356	
ミルボン	8.3	9.1	52,598		あすか製薬	7.7	7.7	11,673		ガラス・土石製品 (0.8%)				
ファンケル	27.8	27.5	91,437		日本新薬	16.3	17.7	152,228		日東紡績	9.3	10.1	45,399	
コーセー	10.6	12.8	165,120		ピオファルミン製薬	1.1	1.2	2,984		AGC	61.7	62.1	196,546	
コタ	3.3	3.9	5,300		中外製薬	65.1	211.4	1,015,777		日本板硝子	30	32.3	13,113	
シーボン	0.8	0.8	1,565		科研製薬	10.7	11.6	56,260		石塚硝子	1.1	1.2	2,306	
ポーラ・オルビスHD	26.7	29.1	59,422		エーザイ	74.8	81	773,388		日本山村硝子	2.6	2.8	2,632	
ノエビアホールディングス	6	5.8	30,624		ロート製薬	32.1	34.7	125,440		日本電気硝子	25.1	25.5	52,530	
アジupanコスメジャパン	1.4	1.4	1,400		小野薬品	147.5	155.3	521,808		オハラ	2.5	2.7	3,369	
エステー	4.5	4.4	9,526		久光製薬	18.5	17.9	97,376		住友大阪セメント	12.6	12.8	46,208	
アグロカネショウ	2	2.7	4,533		持田製薬	9.4	9.3	37,432		太平洋セメント	39.5	43	120,357	
コニシ	11	11.1	16,894		参天製薬	116.3	126.1	267,458		日本ヒューム	6.2	6.7	5,366	
長谷川香料	8.3	11.7	24,382		扶桑薬品	2.2	2.4	6,960		日本コンクリート	13.4	14.6	4,745	
星光PMC	3.6	3.8	2,538		日本ケミファ	0.8	0.9	2,302		三谷セキサン	2.9	3.1	18,321	
小林製薬	17.5	19	191,900		ツムラ	19.4	21	68,985		アジアパイルHD	8.9	9.6	4,684	

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	千円			千株	千株	千円			千株	千株	千円	
東海カーボン	65.4	66.3	75,117		日本軽金属HD	168.1	170.7	30,043		東プレ	11.5	12.6	14,956	
日本カーボン	3.2	3.5	13,510		三井金属	16.7	18.2	48,029		高周波熱錬	11.9	12.9	6,669	
東洋炭素	3.7	4	7,200		東邦亜鉛	3.4	3.4	6,891		東京製鋼	3.8	4.7	2,655	
ノリタケ	3.7	3.8	13,224		三菱マテリアル	40.8	44.2	96,488		サンコール	3.5	4.9	2,200	
TOTO	48.1	48.3	232,564		住友鉱山	84.6	85.5	297,796		モリテックスチル	4.8	5.4	1,598	
日本碍子	76.3	81.6	119,788		DOWAホールディングス	14.4	17	54,485		パイオラックス	9.9	9.9	15,206	
日本特殊陶業	52.7	51.6	96,234		古河機金	10.2	12	13,884		エイチワン	6.1	6.4	3,699	
ダントーホールディングス	4.9	6.3	2,979		エス・サイエンス	27.6	37.6	1,729		日本発条	61.6	72	48,816	
MARUWA	2.2	2.6	24,206		大阪チタニウム	7.2	6.9	6,285		中央発條	0.7	0.7	2,096	
品川リフラクトリーズ	1.6	1.7	4,217		東邦チタニウム	11.1	12	8,208		アドパネクス	0.8	0.9	1,480	
黒崎播磨	1.2	1.3	3,854		UACJ	9.4	10.2	18,961		立川プラインド	2.7	3	4,005	
ヨータイ	5.5	5.3	3,927		CKサンエツ	1.2	1.4	5,236		三益半導体	5.4	5.3	13,515	
インソライト	3.2	3.4	1,577		古河電工	17.8	20.9	53,065		機械 (5.4%)				
東京窯業	8	8.4	2,788		住友電工	230.7	250.1	307,623		日本ドライケミカル	1.7	1.7	2,660	
ニッカトー	2.8	3	2,160		フジクラ	74.8	81.2	24,847		日本製鋼所	18.8	20.4	36,393	
フジミンコーポレートッド	5.6	6.1	22,753		昭和電線 HLDGS	7.2	7.8	9,336		三浦工業	26.7	28.9	137,853	
クニミネ工業	2.8	2.8	3,021		東京特殊電線	0.8	1	2,418		タクマ	22.5	22.7	40,360	
エーアンドエーマテリアル	1.2	1.1	1,221		タツタ電線	12.2	13.3	8,485		ツガミ	13.9	13.9	16,624	
ニチアス	17.1	18.6	46,481		カナレ電気	1.1	1.1	1,958		オークマ	7.9	7.9	40,764	
ニチハ	8.7	9.5	30,162		平河ヒューテック	2.6	3.3	3,333		芝浦機械	7	7.6	17,343	
鉄鋼 (0.6%)					リョービ	7.6	8.3	10,184		アマダ	92.7	83.3	85,299	
日本製鉄	286.9	299.9	310,396		アーレステイ	7.6	8.6	2,881		アイダエン지니어	16.7	17.7	12,797	
神戸製鋼所	113.2	123.2	51,128		アサヒHD	11.6	11.8	42,598		滝澤鉄工所	1.9	2	2,138	
中山製鋼所	8.5	8.7	3,079		金属製品 (0.6%)				FUJII	24.7	29	60,929		
合同製鐵	3	3.6	7,527		稲葉製作所	3.5	3.7	5,076		牧野フライス	7.2	7.9	31,323	
JFEホールディングス	166.8	181.8	142,349		宮地エンジニアリングG	1.9	2	3,350		オーエスジー	28.5	31.2	52,135	
東京製鐵	33.1	32.6	23,635		トーカロ	16	18.7	20,570		ダイジェット	0.7	0.7	996	
共英製鋼	7	7.6	10,678		アルファCO	2.2	2.2	2,206		旭ダイヤモンド	16.2	17.6	9,028	
大和工業	13.1	14.2	37,843		SUMCO	74	80.1	117,106		DMG森精機	39.1	42.6	64,965	
東京製鋼	2.5	2.7	4,625		川田テクノロジーズ	1.4	1.4	6,888		ソディック	14.5	15.4	11,550	
大阪製鐵	4.1	3.6	3,898		RS TECHNOLOGIES	1.7	1.9	6,574		ディスコ	8.4	9.1	233,688	
淀川製鋼所	8.3	8.9	16,438		信和	3.3	3.6	2,566		日東工器	3.4	3.7	7,758	
丸一鋼管	21.9	21.7	61,736		東洋製罐グループHD	39.3	42.9	45,988		日進工具	1.8	2.6	5,933	
モリ工業	1.9	2	5,126		ホクサンホールディングス	3.1	3.7	5,472		パンチ工業	4.3	5.9	2,430	
大同特殊鋼	10.1	11.1	37,018		コロナ	3.4	3.4	3,525		富士ダイス	2.7	2.9	1,980	
日本高周波	2.2	2.4	837		横河ブリッジHLDGS	11.5	12.5	24,562		豊和工業	3.4	3.9	3,295	
日本冶金工	51.2	5.5	8,926		駒井ハルテック	1.2	1.2	1,878		OKK	2.5	2.7	1,055	
山陽特殊製鋼	7.8	4.6	4,531		高田機工	0.6	0.6	1,512		石川製作所	1.5	1.7	3,150	
愛知製鋼	3.5	3.6	9,270		三和ホールディングス	63.8	63.4	74,558		東洋機械金属	4.4	4.6	1,913	
日立金属	66.5	72.1	118,532		文化シャッター	18.2	19.8	16,394		津田駒工業	1.2	1.2	994	
日本金属	1.5	1.6	979		三協立山	8.6	8.7	9,204		エンシュウ	1.6	1.5	1,408	
大平洋金属	4.2	4.5	7,533		アルインコ	4.9	4.9	4,797		島精機製作所	8.5	10.6	17,511	
新日本電工	40	43.6	9,635		東洋シャッター	1.5	1.7	1,324		オプトラン	6.9	7.5	16,282	
栗本鉄工所	3.1	3.3	6,649		LIXILグループ	91.2	98.8	205,701		NCホールディングス	2	2	1,250	
虹技	0.9	1	1,398		日本フィルコン	4.7	5	2,895		イワキポンプ	2.6	4.2	3,960	
日本鋳鉄管	0.6	0.8	999		ノーリツ	12.8	14	20,678		フリュー	5	6.5	7,618	
三菱製鋼	4.6	4.9	2,881		長府製作所	6.3	6.8	14,558		ヤマシンフィルタ	10.8	14.6	15,607	
日亜鋼業	9	9.6	3,014		リンナイ	11	13.1	131,917		日阪製作所	7.6	8.4	7,266	
日本精線	0.9	1.1	3,784		ダイニチ工業	3.3	3.5	2,628		やまびこ	12	13	16,146	
エンビプロHD	2.3	3	1,737		日東精工	8.5	9.2	4,462		平田機工	2.9	3.2	20,192	
シンニッタン	9.6	10.4	2,360		三洋工業	0.8	0.8	1,574		ペガサスミシン製造	5.8	6.6	1,980	
新家工業	1.4	1.5	1,699		岡部	12.5	13.7	10,946		マルマエ	2.5	2.7	2,648	
非鉄金属 (0.7%)					ジーテクト	6.8	8.4	10,180		タツモ	2.9	3.1	4,603	
大紀アルミニウム	10.1	11	6,259		中国工業	1	—	—		ナプテスコ	36.4	39.5	149,112	

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
三井海洋開発	6.6	7.1	11,984		加藤製作所	3.2	3.7	4,184		三菱電機	624.6	676.1	993,867	
レオン自動機	6.1	6.6	7,253		油研工業	1	1.1	1,714		富士電機	40.5	41	139,400	
S M C	18.3	21.2	1,232,144		タダノ	30.2	32.8	27,552		東洋電機製造	2.5	2.4	2,784	
ヤマハモーターロボHLDGS	4.7	—	—		フジテック	22.7	24.8	57,982		安川電機	72.4	72.9	290,506	
ホソカワミクロン	2.2	2.4	13,848		C K D	17.4	18.7	30,686		シンフォニアテクノロジー	8.7	8.8	9,952	
ユニオンツール	2.3	2.5	7,800		キトー	4.7	5.2	6,323		明電舎	12.4	12.5	20,850	
オイルス工業	8.7	8.8	13,340		平和	17.4	18.7	34,422		オリジン	1.7	1.8	2,419	
日精イーエスピー	2.1	2	8,280		理想科学工業	5.5	6	8,622		山洋電気	3	3.3	16,269	
サトーホールディングス	7.5	9.6	20,976		S A N K Y O	15.6	15	43,410		デンヨー	5.7	5.8	14,436	
技研製作所	5.4	5.9	23,423		日本金銭機械	6.9	7.3	4,255		東芝テック	7.8	8.5	38,292	
日本エアーテック	1.9	2.3	3,148		マースグループHLDGS	4	4.2	7,614		芝浦メカトロニクス	1.1	1.2	3,780	
カワタ	1.7	1.9	1,749		フクシマガリレイ	3.9	4.2	16,380		マブチモーター	17.3	18.8	76,892	
日精樹脂工業	5.2	5.6	4,950		オーイズミ	2.6	2.8	1,097		日本電産	75.2	162.7	1,576,237	
オカダアイオン	2.1	2	2,042		ダイコク電機	2.9	3.1	3,369		ユーエムシーエレクトロニクス	3.4	4.2	1,465	
ワイエイシホールディングス	2.5	2.8	1,887		竹内製作所	10.5	11.4	23,541		トレックス・セミコンダクター	2.8	3.9	4,722	
小松製作所	282.8	306.9	728,734		アマノ	17.9	17.8	43,823		東光高岳	3.2	3.7	3,999	
住友重機械	35.7	39	98,046		J U K I	8.7	9.3	4,268		ダブル・スコープ	8.6	10.7	9,983	
日立建機	25	27.3	100,600		サンデンホールディングス	7.7	9	2,934		宮越ホールディングス	2.3	2.7	1,965	
日工	1.7	9.2	6,624		蛇の目マシン	5.8	6	3,882		ダイヘン	6.8	7.5	32,137	
巴工業	2.7	2.7	5,305		マックス	9.5	10.4	16,296		ヤーマン	9.1	11.1	18,625	
井関農機	6.3	6.8	9,329		グローリー	17.4	17.5	41,982		J V C ケンウッド	47.8	55.1	8,430	
T O W A	5.4	6.8	7,969		新晃工業	5.8	6.3	9,519		ミマキエンジニアリング	5.6	6	2,616	
丸山製作所	1.3	1.8	2,530		大和冷機工業	9	9.8	9,163		I - P E X	2.3	2.8	6,344	
北川鉄工所	2.8	3	4,587		セガサミーホールディングス	61.9	67.1	89,108		日新電機	14.6	16	17,552	
ロージェ	2.7	3	14,985		日本ピストンリング	2.3	2.4	2,496		大崎電気	12.4	13.3	8,126	
タカキタ	2.2	2.5	1,890		リケン	2.9	3.1	7,967		オムロン	66.4	60.6	488,436	
クボタ	334.7	359	660,201		T P R	8.4	9.1	11,884		日東工業	10	10	20,860	
荏原実業	1.6	1.7	5,064		ツバキ・ナカシマ	12.8	13.8	11,095		I D E C	8.4	9.8	19,208	
三菱化工機	2.2	2.3	4,291		ホシザキ	18.3	19.9	166,762		正興電機製作所	1.4	1.8	1,927	
月島機械	12.4	12.6	16,972		大豊工業	5.1	5.4	3,083		不二電機工業	0.7	1	1,321	
帝国電機製作所	4.4	5.6	6,244		日本精工	128.4	128.4	107,984		ジーエス・ユアサコーポ	22.5	22.7	41,858	
東京機械	2.4	3.1	892		N T N	134.6	157.3	33,033		ジーサホールディングス	1.6	1.5	2,238	
新東工業	14.8	16.2	11,842		ジェイテクト	59.9	65.5	55,413		メルコホールディングス	2.6	2.3	5,708	
渋谷工業	5.4	5.9	21,210		不二越	5.8	6.4	23,712		テクノメディカ	1.4	1.5	2,766	
アイチコーポレーション	10.8	11.8	10,407		日本トムソン	18.6	19.9	7,800		ダイヤモンドエレクトロクHD	—	1.4	1,062	
小森コーポレーション	15.8	17.3	12,888		T H K	36.3	39.6	105,296		日本電気	80.9	82	484,620	
鶴見製作所	4.9	5.1	9,154		ユースン精機	4.8	5.3	3,826		富士通	60.2	65.2	937,576	
住友精密	1	1	2,387		前澤給装工業	2.4	2.4	4,977		沖電気	27.1	27.7	29,472	
日本ギア工業	1.7	2.4	715		イーグル工業	7.7	8.5	6,936		岩崎通信機	2.9	2.9	2,438	
酒井重工業	1.2	1.2	2,880		前澤工業	4.2	4	1,904		電気興業	3.3	3.3	8,844	
荏原製作所	27.7	28.1	80,815		日本ピラー工業	6.3	6.8	10,750		サンケン電気	7.3	7.4	17,826	
石井鉄工所	0.9	0.9	2,460		キッツ	25.4	27.7	17,063		ナカヨ	1.2	1.3	1,898	
西島製作所	6.4	6.8	5,650		マキタ	76	88.2	441,000		アイホン	3.5	3.8	5,779	
北越工業	6.4	7	7,665		日立造船	49.6	53.6	24,012		ルネサスエレクトロニクス	297.4	290.1	221,346	
ダイキン工業	85.3	86.2	1,682,624		三菱重工業	104.7	113.9	281,219		セイコーエプソン	77.6	84.4	104,571	
オルガノ	2.2	2.4	13,512		I H I	48	49.1	71,980		ワコム	45.3	45.8	32,609	
トーヨーカネツ	2.4	3	6,777		スター精密	9.8	10.5	14,952		アルバック	12.5	12.5	48,187	
栗田工業	33.8	36.7	130,468		電気機器 (15.3%)					アクセル	2.6	2.7	2,451	
椿本チエイン	8.2	9.8	24,705		日清紡ホールディングス	41.7	42.4	31,248		E I Z O	5.7	5.3	21,094	
大同工業	3	3.2	1,955		イビデン	38.3	41.5	150,852		ジャパンディスプレイ	61.7	61.7	3,640	
木村化工機	5.2	5.7	2,473		コニカミノルタ	136.7	148.9	44,967		日本信号	15.9	17.4	18,200	
アネスト岩田	9.7	10.6	8,882		ブラザー工業	81.5	83.1	140,937		京三製作所	13.4	15.8	7,710	
ダイフク	34.4	34.7	352,552		ミネベアミツミ	115.9	125.9	254,443		能美防災	8.2	9	20,448	
サムコ	1.7	1.9	5,403		日立	281.1	325	1,198,925		ホーチキ	4	4.9	6,389	

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
星和電機	3.3	3.5	2,124		オブテックスグループ	10.3	11.2	17,248		川崎重工業	48.7	53	78,599	
エレコム	5.9	7.6	38,760		千代田インテグレ	2.9	2.9	4,787		名村造船所	18.9	22.2	3,663	
パナソニック	714.1	773.4	716,477		アイ・オー・データ	2.3	2.3	2,472		サノヤスホールディングス	8.3	9.4	1,569	
シャープ	62.1	78.8	103,779		レーザーテック	12.8	29.8	255,982		日本車輻	2.3	2.5	7,107	
アンリツ	40.2	43.6	98,318		スタンレー電気	44.1	47.5	142,975		三菱ロジスネクスト	10.3	9	8,577	
富士通ゼネラル	19.1	18.5	55,500		岩崎電気	2.4	2.6	3,926		近畿車輻	1	1	1,357	
ソニー	419.2	423.6	3,475,214		ウシオ電機	36.3	37.6	49,707		日産自動車	736.8	799.9	297,562	
TDK	32.7	32.7	381,282		岡谷電機	4.5	5.2	1,877		いすゞ自動車	197.5	196.8	186,763	
帝国通信工業	2.7	3	3,690		ヘリオステクノH	5.8	6.3	2,060		トヨタ自動車	695.9	754.3	5,341,198	
タムラ製作所	24.1	22.7	12,189		エノモト	1.7	2	2,114		日野自動車	78	85.1	55,995	
アルプスアルパイン	65.1	60.3	92,078		日本セラミック	6.3	6.9	18,471		三菱自動車工業	231.5	252.4	58,809	
池上通信機	2	2.1	1,785		遠藤照明	3.2	3.3	2,194		エフテック	4.4	4.8	2,404	
日本電波工業	5.7	6.3	2,299		古河電池	4.5	4.8	5,059		レシップホールディングス	2.5	2.6	1,591	
鈴木	3.3	3.3	2,303		双信電機	3	3.3	1,428		GMB	1.2	1.5	972	
日本トリム	1.2	0.9	3,384		山一電機	4.5	4.9	6,561		ファルテック	1.1	1.4	869	
ローランドディー・ジー	3.4	3.7	4,787		図研	4.1	4.4	12,826		武蔵精密工業	15.2	15.1	15,251	
フオスター電機	7.1	7.1	8,165		日本電子	12.3	13.4	46,766		日産車体	12.2	13.3	11,890	
SMK	1.7	1.7	4,571		カシオ	55.4	60.3	100,881		新明和工業	26.1	18.3	16,817	
ヨコオ	4.5	4.4	11,932		ファナック	59.3	63.6	1,298,712		極東開発工業	12.4	12.6	17,110	
ティアック	4.5	4.9	622		日本シイエムケイ	15.9	15.9	7,997		日信工業	11.4	13.3	29,845	
ホシデン	18.3	18.6	18,283		エンプラス	2.8	3.5	7,801		トピー工業	5.2	5.6	6,580	
ヒロセ電機	8.9	10.4	139,984		大真空	2.3	2.5	4,642		ティラド	2.3	2.4	3,232	
日本航空電子	14.3	15.6	23,181		ローム	29.9	28.2	223,062		タチエス	10.3	11.1	10,545	
TOA	6.7	7.3	6,059		浜松ホトニクス	44.8	48.5	253,655		NOK	33.6	36.6	41,065	
マセルホールディングス	13.5	14.6	15,943		三井ハイテック	6.9	7.5	15,615		フタバ産業	17.4	18.9	10,017	
古野電気	8	8.7	8,813		新光電気工業	21	22.9	40,304		KYB	6.5	7.6	15,944	
ユニデンホールディングス	1.8	1.9	2,998		京セラ	95.2	95	585,865		大同メタル工業	10.2	13.1	6,916	
スミダコーポレーション	4.8	5.2	3,790		太陽誘電	27.8	30.2	98,603		プレス工業	30.9	33.6	9,710	
アイコム	3.4	3.8	10,400		村田製作所	196.6	198.6	1,353,856		ミクニ	7.9	8.4	2,335	
リオン	2.9	2.8	6,711		双葉電子工業	9.9	10.8	10,292		太平洋工業	13.1	14.3	14,085	
本多通信工業	5.3	5.8	2,917		北陸電気工業	2.3	2.7	2,632		ケーヒン	14.3	15	38,880	
船井電機	6.3	6.8	3,209		ニチコン	19.7	23.1	19,011		河西工業	7.7	9.2	3,192	
横河電機	62.5	62.5	104,812		日本ケミコン	4.4	5.1	7,282		アイシン精機	51.4	55.7	183,253	
新電元工業	2.2	2.4	4,663		KOA	9.4	10.2	11,169		マツダ	196	200.4	126,252	
アズビル	39.4	42.9	154,225		市光工業	9.4	10.2	4,661		今仙電機製作所	5.7	6.1	4,135	
東亜ディーケーケー	3.1	3.3	3,026		小糸製作所	37.4	40.6	222,082		本田技研	526.8	532.4	1,352,029	
日本光電工業	27.5	28	94,920		ミツバ	11.5	12.4	4,836		スズキ	114.3	134.2	556,661	
チノー	2.2	2.3	3,171		SCREENホールディングス	10.9	11.8	65,254		SUBARU	193.9	210.2	434,693	
共和電業	6.5	6.9	3,070		キヤノン電子	6.5	6.1	8,869		安永	3	3.3	3,857	
日本電子材料	2.5	2.7	5,470		キヤノン	336.4	336.3	579,781		ヤマハ発動機	81.4	88.9	139,839	
堀場製作所	12.4	13.5	74,655		リコー	188.2	173.2	123,664		ショーワ	14.7	15.4	35,312	
アドバンテスト	42.6	50.5	263,610		象印マホービン	18.3	18.4	31,960		TBK	7.4	7.9	3,713	
小野測器	2.6	2.7	1,455		MUTOHホールディングス	0.9	1	1,508		エクセディ	8.5	9.3	12,582	
エスベック	5.5	6	11,118		東京エレクトロン	41.6	43	1,157,560		豊田合成	20.2	22	51,348	
キーエンス	30.7	61.3	2,838,803		輸送用機器 (7.0%)					愛三工業	9.8	10.6	5,035	
日置電機	3.3	3.3	12,771		トヨタ紡織	21.8	19.8	29,403		盟和産業	1	1	1,003	
シスメックス	48.7	48.3	482,661		芦森工業	1.3	1.3	1,147		日本プラスト	4.9	5	2,105	
日本マイクロニクス	10.9	11.8	13,263		ユニプレス	12.1	13.2	11,576		ヨロズ	5.9	6.4	6,502	
メガチップス	4.9	6.3	17,268		豊田自動織機	50.6	54.8	356,748		エフ・シー・シー	11.2	11.2	21,716	
OBARA GROUP	3.2	4	14,800		モリタホールディングス	10.9	12	23,808		シマノ	23.4	25.3	540,155	
澤藤電機	0.8	0.9	1,822		三桜工業	8	8.6	5,056		テイ・エス・テック	14.5	15.7	48,277	
原田工業	2.5	3.2	2,921		デンソー	137.5	148.8	681,504		ジャムコ	3.1	3.3	2,240	
コーセル	7.6	9	9,990		東海理化電機	16.3	18	28,530		精密機器 (2.7%)				
イリソ電子工業	5.7	5.7	24,225		三井E&SHD	21.7	21.7	8,680		テルモ	176.7	191.4	793,353	

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	
クリエートメディック	2.1	2.1	2,192		アーク	23.8	—	—		メタウォーター	3	3.3	14,998	
日機装	18.7	20.4	22,664		タカノ	2.5	2.6	1,682		陸運業 (3.8%)				
日本エム・ディ・エム	3.6	3.9	8,634		プロネクサス	5.4	5.8	6,623		SBSホールディングス	5.4	5.1	10,980	
島津製作所	80.4	80.9	264,543		ホクシン	3.7	5.7	684		東武鉄道	65.9	70.4	237,600	
JMS	5.7	5.7	5,118		ウッドワン	2.1	2.4	3,129		相鉄ホールディングス	21.5	21.6	63,504	
クボテック	1.3	1.9	651		大建工業	4.7	4.6	8,109		東急	169.7	170.5	244,838	
長野計器	4.9	5	4,420		凸版印刷	92.8	95.9	152,097		京浜急行	85.6	87.1	145,805	
バイ・テクノロジ	2.9	3.2	13,776		大日本印刷	88	88.8	196,248		小田急電鉄	100.1	100.5	269,239	
東京計器	4	4.2	3,960		共同印刷	1.9	2.1	5,619		京王電鉄	34.9	35.1	231,309	
愛知時計	0.8	0.9	3,861		NISSHA	12.9	13.9	18,334		京成電鉄	46.8	47.1	145,303	
インターアクション	3.4	3.6	7,232		光村印刷	0.5	0.6	989		富士急行	8.5	9.3	36,688	
オーバル	6.1	6.4	1,529		TAKARA & COMPANY	3	3.3	7,477		新京成電鉄	1.6	1.7	4,301	
東京精密	11.3	12.4	41,230		アシックス	51.6	56.2	78,904		東日本旅客鉄道	109.9	119	815,150	
マニー	24.9	27	76,680		ツツミ	2	2.1	4,819		西日本旅客鉄道	55.6	60.4	342,468	
ニコン	108.8	104.1	74,639		小松ウオール工業	1.9	1.9	3,515		東海旅客鉄道	55.9	56.2	904,258	
トプコン	33.6	34.3	32,447		ヤマハ	37.2	40.3	205,530		西武ホールディングス	77.4	88.9	115,214	
オリンパス	372.2	374.2	778,710		河合楽器	1.9	2.1	5,833		鴻池運輸	9.9	10.9	12,774	
理研計器	5.5	6	17,346		クリナップ	5.8	6.3	3,263		西日本鉄道	17.4	18.8	61,194	
タムロン	5	5.5	9,097		ピジヨン	37.7	41.2	191,580		ハマキョウレックス	4.8	5.2	17,134	
HOYA	125.7	134.1	1,568,299		オリバー	—	1.4	3,570		サカイ引越センター	3.3	3.6	18,216	
シード	2.7	2.9	2,108		兼松サステック	0.4	0.4	643		近鉄グループHLDGS	59.2	64.1	307,039	
ノーリツ鋼機	4.9	4.6	7,732		キングジム	5.2	5.7	5,124		阪急阪神HLDGS	78.9	85.4	303,597	
エー・アンド・デイ	5.7	6.1	4,080		リンテック	14.8	16.1	40,121		南海電鉄	26.5	30.5	73,383	
朝日インテック	53	76.6	236,311		イトーキ	11.7	14.4	5,241		京阪ホールディングス	26.3	28.5	128,962	
シチズン時計	68.5	79.6	24,755		任天堂	35.7	41.5	2,507,430		神戸電鉄	1.5	1.5	5,835	
リズム時計	2.1	2.1	1,352		三菱鉛筆	10.3	11.3	15,390		名古屋鉄道	48.6	52.4	156,571	
大研医器	5	5.1	2,866		タカラスタンダード	12.9	13.7	18,878		山陽電鉄	4.6	4.7	10,711	
メニコン	8.6	9.6	67,488		コクヨ	29.9	32.3	42,409		日本通運	22.8	22.2	138,306	
シンシア	0.7	0.9	366		ナカバヤシ	6.1	6.6	4,375		ヤマトホールディングス	103.8	112.3	303,883	
松風	3	3	4,443		グローブライド	3	3	9,555		山九	16.4	17.8	80,100	
セイコーHD	9.7	9.6	14,371		オカムラ	21.8	23.5	17,883		丸運	3.2	3.5	850	
ニプロ	43.3	46.9	58,484		美津濃	6.2	6.2	12,108		丸全昭和運輸	4.8	5.2	17,732	
その他製品 (2.8%)					電気・ガス業 (1.4%)					センコーグループHLDGS	32.6	34.9	34,341	
中本バックス	1.7	1.6	2,537		東京電力HD	498.4	542	162,600		トナミホールディングス	1.4	1.5	9,210	
スノーピーク	2.8	3.5	6,636		中部電力	191	205.8	277,109		ニッコンホールディングス	22.4	22.9	54,387	
パラマウントベッドHD	7.2	7.1	30,814		関西電力	254.8	255.9	270,486		日石輸送	0.7	0.6	1,589	
トランザクション	4	4.4	5,064		中国電力	86.3	97.1	131,279		福山通運	7.6	8.2	43,214	
粧美堂	1.8	2	804		北陸電力	61.4	62.2	48,578		セイノーホールディングス	44.3	47.9	76,448	
ニホンフラッシュ	2.7	6.3	8,820		東北電力	146.4	168.3	183,278		エスライン	1.8	1.7	1,659	
前田工織	6.9	7.5	20,115		四国電力	56.3	61.1	50,163		神奈川中央交通	1.5	1.5	6,322	
永大産業	8.3	8.6	2,812		九州電力	128.8	139.3	135,121		日立物流	13	11.7	43,816	
アートネイチャー	6.6	7.2	4,795		北海道電力	58.5	63.7	28,728		丸和運輸機関	3.1	6.8	27,676	
パンダイナムコHLDGS	64.6	69.9	507,334		沖縄電力	11.6	13.2	22,440		C&Fロジホールディングス	6	6.5	11,433	
アイフィスジャパン	1.5	1.8	1,405		電源開発	49.7	54	90,180		九州旅客鉄道	49.6	56.3	130,672	
共立印刷	10.4	11.3	1,536		エフオン	3	3.7	2,390		SGホールディングス	55.9	67.2	324,912	
SHOEI	3	6	21,330		イーレックス	10.9	9.7	10,456		海運業 (0.2%)				
フランスベッドHLDGS	8.8	9.2	8,040		レノバ	10.3	11.3	12,181		日本郵船	49.5	53.7	101,224	
パイロットコーポレーション	10.9	11.1	34,687		東京瓦斯	120.1	130.1	313,931		商船三井	35.1	40.7	91,859	
萩原工業	3.5	3.7	5,920		大阪瓦斯	121.1	131.5	273,914		九州汽船	18.3	19.8	25,047	
トッパン・フォームズ	13.4	14.6	14,278		東邦瓦斯	31	33.3	169,164		NSユニテッド海運	3.3	3.6	5,198	
アジールインターナショナル	14	15.3	30,171		北海道瓦斯	3.3	3.6	5,677		明治海運	6.3	6.6	2,402	
タカラトミー	26.2	30.5	27,694		広島ガス	12.8	13	4,836		飯野海運	28.1	30.2	11,264	
廣済堂	5.8	4.9	3,371		西部瓦斯	7	7.6	20,474		共栄タンカー	0.5	1.2	927	
エステルホールディングス	1.6	2	1,370		静岡ガス	17.7	19.3	17,543		乾汽船	5.3	3.7	3,293	

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
			評価額	千円				評価額	千円				評価額	千円
空運業 (0.4%)														
日本航空	108.2	113.5	238,123		ポルトウウィン・ピットクル	8.2	8	7,664		メディカル・データ・ビジ	4.7	5	10,260	
ANAホールディングス	108	117.3	326,563		イーブックイニシアティブ	1	0.9	2,952		gumi	7.9	8.6	8,892	
パスコ	1.1	1.3	1,820		ネクソン	173.9	167.2	448,096		ショーケース	1.3	1.6	1,684	
倉庫・運輸関連業 (0.2%)					アイスタイル	15.8	18.4	5,704		モバイルファクトリー	1.4	1.6	2,089	
トランコム	1.7	1.8	13,680		エムアップホールディングス	2.1	1.9	6,213		テラスカイ	1	2.4	11,808	
日新	5.1	5.6	9,066		エイチーム	4.3	4.5	3,681		デジタル・インフォメーション	2.7	2.9	3,888	
三菱倉庫	20.5	20.4	62,118		エニゴモ	4.4	6.3	11,176		PCIホールディングス	1.3	2.8	3,628	
三井倉庫HOLD	7.3	7.4	14,326		テクノスジャパン	5.2	5.3	5,146		パイプドHD	1	0.9	1,699	
住友倉庫	21.7	23	31,418		enish	2.7	3.5	2,152		アイビーシー	1.1	1.4	1,562	
渋沢倉庫	3.2	3.5	8,155		コロプラ	20.1	21.9	20,148		ネオジャパン	1.2	1.2	2,571	
東陽倉庫	10.7	11.3	3,966		オルトプラス	4.1	4.6	2,451		PRTIME S	0.5	1.2	3,012	
日本トランスシティ	13	13.8	7,948		ブロードリーフ	30.4	32.9	18,226		ランドコンピュータ	0.9	1	1,071	
ケイヒン	1.1	0.9	1,255		クロス・マーケティングG	2.6	3.2	1,190		ダブルスタンダード	0.5	0.9	4,527	
中央倉庫	3.6	3.9	4,602		デジタルハーツHLDGS	2.8	3.7	3,992		オープンドア	3	3.4	4,804	
川西倉庫	1.2	1.1	1,257		システム情報	3.1	4.9	7,021		マイネット	2	2.1	3,047	
安田倉庫	4.8	5.1	4,845		メディアドゥ	2.2	2.1	16,296		アカツキ	2.2	2.4	10,752	
フェイスホールディングス	1.1	1.4	1,614		じげん	8.7	16.5	5,709		ベネフィットジャパン	0.4	0.5	956	
東洋埠頭	1.8	2	2,938		ブイキューブ	3.3	3.7	6,626		UBICOMホールディングス	1.1	1.6	3,648	
宇徳	5	5.5	2,722		エンカレッジ・テクノロジー	0.8	1.3	1,171		LINE	14.1	20.4	109,344	
上組	36.4	35.7	77,076		サイバーリンクス	0.9	1.2	2,826		カナミックネットワーク	3.7	6	4,860	
サンリツ	1.4	1.5	948		ディー・エル・イー	4.3	4.3	1,913		ノムラシステムコポレーション	1.4	3.6	1,544	
キムラユニティー	1.6	1.6	1,772		フィックスターズ	6.5	7.1	7,533		チェンジ	1.2	4.6	52,486	
キューソー流通システム	1.5	1.6	2,483		CARTA HOLDINGS	3	3.1	3,822		シンクロ・フード	2.6	2.7	909	
近鉄エクスプレス	11.2	13.7	30,277		オプティム	2.7	3.5	11,200		オークネット	3.4	3.6	4,752	
東海運	3.4	3.6	1,076		セレス	2	2.3	5,207		セグエグループ	0.2	1.3	1,950	
エーアイティー	3.8	4.5	4,824		S H I F T	—	2.7	41,175		エイトレッド	0.7	1.1	2,538	
内外トランスライン	2.1	2.1	2,608		ティーガイア	4.4	5.9	11,918		AOI TYO HOLDINGS	6.2	6.7	2,793	
日本コンセプト	1.9	2	2,958		セック	1	1	3,185		マクロミル	10.9	13.5	10,827	
情報・通信業 (9.8%)					日本アジアグループ	6.5	7.3	2,292		ビーグリー	1.3	1.3	2,635	
NEC ネットエスアイ	6.8	18.9	39,123		豆蔵ホールディングス	4.2	—	—		オロ	1.6	1.7	5,788	
クロスキャット	1.6	1.8	2,606		テクマトリックス	4.3	9.4	21,507		ユーザーローカル	—	0.6	2,643	
システナ	21.9	23.7	45,551		プロシップ	1.8	1.9	3,045		テモナ	0.8	1.3	1,765	
デジタルアーツ	3.3	3.3	27,390		ガンホー・オンライン・エンター	14.8	16.1	37,657		ニーズウェル	0.4	1	880	
日鉄ソリューションズ	9.2	9.9	31,680		GMOペイメントゲートウェイ	10.1	14.1	152,985		サインポスト	0.9	1.3	1,790	
キューブシステム	3.3	3.5	4,721		ザッパラス	3	2.9	1,374		ソルクシーズ	2.6	3	3,438	
エイジア	1.2	1.4	3,221		システムリサーチ	0.8	1.8	3,367		フェイス	2.4	2.3	2,490	
コア	2.6	2.8	3,911		インターネットイニシアティブ	10	9.9	47,421		プロトコポレーション	5.5	6	7,536	
ラクーンホールディングス	3	3.2	6,723		さくらインターネット	7.3	7	5,670		ハイマックス	0.7	0.8	1,908	
ソリトンシステムズ	2.7	3.1	6,590		ヴィンクス	1.7	1.9	2,490		野村総合研究所	116.9	94	301,740	
ソフトクリエイトHD	2.7	2.9	7,911		GMOグローバルサインHD	1.1	1.2	11,196		サイバネットシステム	4.4	5.1	4,523	
T I S	20.4	66.3	148,445		SRAホールディングス	3.3	3.6	8,636		C Eホールディングス	1.8	4	2,704	
JNSホールディングス	2.5	2.8	2,200		MINORIソリューションズ	1.2	—	—		日本システム技術	1	1.2	2,260	
電算システム	2.3	2.5	9,087		システムインテグレーター	1.7	2.3	1,676		インテジーホールディングス	7.7	8.4	7,946	
グリー	42.5	40.9	19,386		朝日ネット	4.9	4.7	4,601		東邦システムサイエンス	1.8	1.7	1,666	
コーエーテックモHD	12.5	13.6	66,640		e B A S E	3.7	8	10,992		ソースネクスト	23.8	31.6	10,870	
三菱総合研究所	2.6	2.9	12,948		アバント	2.2	6.3	6,652		インフォコム	6.7	7.3	29,455	
ボルテージ	1.2	1.9	1,046		アドソル日進	2.2	2.4	6,230		H E R O Z	—	0.9	3,415	
電算	0.7	0.7	1,649		フリービット	3.7	3.7	3,378		ラクスル	—	5.3	23,505	
AGS	3.5	3.7	3,426		コムチュア	3.4	7.5	20,325		F I G	6.4	7.7	2,094	
ファインデックス	5.2	5.7	7,717		サイバーコム	1.1	1.2	2,275		システムサポート	—	1.4	2,499	
ブレインパッド	1.2	1.7	7,539		アステリア	4.1	4.4	3,603		イースル	—	3.1	3,785	
K L a b	11.8	12.6	11,793		アイル	1	3.7	5,646		アルテリア・ネットワークス	6.8	7.4	13,423	
					マークラインズ	3.1	3.2	7,228		東海ソフト	—	0.4	538	

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
ヒト・コミュニケーションズHD	1.4	1.6	2,121		USEN-NEXT HLDGS	2.3	2.6	3,169		フィールズ	5.4	4.9	1,631	
トビラシシステムズ	—	0.8	1,659		ワイヤレスゲート	2.7	3.2	2,384		双日	340	368.1	91,656	
フォーカスシステムズ	4.2	4.2	4,288		コネクシオ	4.4	3.8	4,601		アルフレッサホールディングス	68.3	73.9	174,477	
フレスコ	1.9	4	5,280		日本通信	53.8	51.7	11,839		横浜冷凍	17.3	17.5	16,240	
フジ・メディア・HD	63.6	64.4	67,620		クロップス	1.1	1.3	1,004		神栄	0.8	1	658	
オービック	21.3	23	431,020		日本電信電話	419.2	886.5	1,985,316		ラサ商事	3.3	3.4	3,134	
ジャストシステム	8.7	10.8	79,920		KDDI	502.4	483.8	1,332,627		アルコニック	6.5	7.1	11,026	
TDCソフト	5.4	5.9	6,254		ソフトバンク	649.9	607.9	772,336		神戸物産	10.6	23	127,650	
Zホールディングス	399.9	912.6	629,694		光通信	7.2	6.8	165,036		ハイパー	—	0.9	505	
トレンドマイクロ	27.3	35.5	229,685		NTTドコモ	388	474.3	1,282,981		あいホールディングス	8.8	9.5	18,012	
IDホールディングス	2.4	2.5	3,750		エムティーアイ	6	6.4	5,395		ディービーエックス	2.4	2.3	2,295	
日本オラクル	12.4	13.4	172,458		GMOインターネット	24.2	24	65,424		ダイワボウHD	5.6	5.7	37,563	
アルファシステムズ	1.9	2.1	7,980		ファイバーゲート	1.2	2.1	3,885		マクニカ・富士EHLHLDGS	17.1	15.9	31,179	
フューチャー	7.4	8	18,384		アドママーケティングコム	1.3	2.1	928		ラクト・ジャパン	2.3	2.5	9,287	
CAC HOLDINGS	4	4.4	6,384		KADOKAWA	17.9	18	50,076		バイタルKSKHD	11.5	11.5	12,650	
SBCテクノロジー	2.6	2.4	8,724		学研ホールディングス	2.1	8.9	14,498		八洲電機	4.9	5.1	5,181	
トーセ	1.7	1.8	1,632		ゼンリン	12.3	13.3	15,135		メディアスホールディングス	3.5	3.7	3,304	
オービックビジネスC	6.3	6.8	41,344		昭文社ホールディングス	2.7	3.1	1,556		レスターホールディングス	6.8	7	15,295	
伊藤忠テクノソリューション	27.9	30.1	122,657		インプレスホールディングス	4.9	5.3	911		ジューテックHD	1.4	1.3	1,339	
アイティフォー	7.5	8.1	7,209		アイネット	3.5	3.4	5,650		大光	2.6	2.8	1,954	
東計電算	0.9	1	4,800		松竹	4.1	4.4	67,540		OCHIホールディングス	1.8	1.9	3,100	
エックスネット	1.1	1.1	1,105		東宝	40.3	39.2	169,344		TOKAIホールディングス	32.5	34.9	37,343	
大塚商会	33.2	35.9	198,527		東映	2.6	2.5	44,475		黒谷	1.4	1.6	814	
サイボウズ	7.2	7.8	27,378		NTTデータ	163.2	176.7	250,030		Cominix	1.1	1.1	796	
ソフトブレーン	3.6	4.1	3,558		ピー・シー・イー	0.8	1.1	5,280		三洋貿易	3.1	6.7	6,787	
電通国際情報S	3.8	4.1	26,445		ビジネスB太田昭和	1.1	2.2	3,031		ビューティガレージ	1	1.1	3,001	
ACCESS	—	6.1	5,581		DT S	13.7	14.9	33,972		ウイン・パートナーズ	4	4.8	4,785	
デジタルガレージ	12	12	41,520		スクウェア・エニックス・HD	28.5	28.3	195,553		ミタチ産業	1.8	2	1,244	
イーエムシステムズ	5	9.3	8,184		シーイーシー	6.6	7.1	11,707		シッパヘルスケアHD	12.8	10.7	55,640	
ウエザーニューズ	2.1	2.3	14,513		カプコン	26.3	31.3	184,983		明治電機工業	1.9	2	2,840	
C I J	4.6	4.8	4,497		アイ・エス・ビー	1.2	1.4	3,701		デリカフーズHLDGS	2.2	2.2	1,507	
ビジネスエンジニアリング	0.6	0.8	3,040		ジャステック	3.6	4.2	6,178		スターティアホールディングス	1.2	1.7	1,247	
日本エンタープライズ	6.1	7.3	2,219		S C S K	16.2	15.3	90,423		コメダホールディングス	14.3	14.6	28,236	
WOWOW	2.9	3.2	8,963		日本システムウエア	2	2.2	4,494		ピーバンドットコム	—	0.6	582	
スカラ	4.3	4.6	4,204		アイネス	7.8	6.5	11,050		アセンテック	—	1.4	3,176	
インテリジェントウェイブ	2.3	3.7	3,156		T K C	5.2	5.6	37,352		富士興産	2.4	2.2	1,480	
IMAGICA GROUP	5.1	5.7	2,205		富士ソフト	7.9	7.1	37,062		協栄産業	0.7	0.7	924	
ネットワンシステムズ	21.7	25.3	122,325		NSD	10.1	21.3	43,004		小野建	5.5	5.5	6,242	
システムソフト	14.5	22.4	2,396		コナミホールディングス	25	24.2	106,238		南陽	1.3	1.4	2,452	
アルゴラフィックス	5.2	5.7	20,548		福井コンピュータHLDGS	2	2.6	8,138		佐島電機	4.5	4.5	3,784	
マーベラス	9.4	10	8,060		JBCCホールディングス	4.8	4.5	7,915		エコートレーディング	1.5	1.5	879	
エイベックス	10.5	11.5	11,557		ミロク情報サービス	6.1	5.9	13,233		伯東	4.2	4.1	4,809	
日本ユニシス	19.1	20.7	69,448		ソフトバンクグループ	486.3	526.6	3,357,075		コンドーテック	4.7	5.2	6,708	
兼松エレクトロニクス	3.3	3.6	15,408		卸売業 (4.8%)					中山福	3.5	3.7	1,794	
東京放送HD	40.7	40.2	73,164		ハウスイ	0.5	0.5	456		ナガイレーベン	8.9	8.9	24,964	
日本テレビHLDGS	56.3	55.1	65,183		高千穂交易	2.4	2.5	2,517		三菱食品	6.7	7.4	20,757	
朝日放送グループHD	6	6.4	4,755		カワニシホールディングス	—	0.7	989		松田産業	4.5	4.9	7,428	
テレビ朝日HD	16.9	18.3	30,725		伊藤忠食品	1.5	1.7	9,265		第一興商	9.1	10	34,250	
スカパーJSATHD	40.5	43.9	19,755		エレマテック	5.7	6.3	6,192		メディアバルHD	66.3	71.5	151,866	
テレビ東京HD	5	5.5	12,919		JALUX	1.7	1.8	2,869		S P K	1.3	2.8	4,090	
日本BS放送	2	2.1	2,354		あらた	4.5	5.3	27,878		萩原電気HLDGS	2.3	2.5	5,480	
ビジョン	1.9	6.1	4,928		トーマンデバイス	0.9	1	4,100		アズワン	4.4	4.4	65,780	
スマートパリュウ	1.8	1.8	1,996		東京エレクトロンデバイス	2.2	2.4	7,716		スズデン	2.1	2.3	2,787	

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
尾家産業	2	1.9	3,135	3,135	阪和興業	10.7	12.5	27,950	27,950	日伝	5.1	6.1	14,249	14,249
シモジマ	3.8	4.1	5,936	5,936	正栄食品	4	4.3	19,113	19,113	北沢産業	4.6	5.2	1,466	1,466
ドウシシャ	5.8	6.3	13,230	13,230	カナデン	5.6	5.4	8,218	8,218	杉本商事	3.3	3.5	6,751	6,751
小津産業	1.4	1.5	2,757	2,757	菱電商事	4.9	4.8	7,171	7,171	因幡電機産業	8.7	19.1	51,608	51,608
高速	3.7	4	7,044	7,044	フルサト工業	3.4	3.4	4,947	4,947	東テク	2	2.2	5,440	5,440
たけびし	2.1	2.4	3,674	3,674	岩谷産業	13.6	14.9	60,047	60,047	ミスミグループ本社	77.1	83.6	255,398	255,398
リックス	1.4	1.5	2,473	2,473	ナイス	2.5	2.5	3,715	3,715	アルテック	4.5	5.6	1,506	1,506
丸文	5.4	5.6	2,788	2,788	昭光通商	2.1	2.3	1,389	1,389	タキヒヨー	1.9	2	3,688	3,688
ハピネット	5.1	5.5	7,243	7,243	ニチモウ	1	1	2,017	2,017	蔵王産業	1	1	1,482	1,482
橋本総業 HLDGS	1.2	1.3	3,247	3,247	極東貿易	1.9	1.9	2,728	2,728	スズケン	28	28.1	115,772	115,772
日本ライフライン	18.2	19.9	28,238	28,238	イワキ	8.1	8.7	4,454	4,454	ジェコス	4.2	4.6	4,328	4,328
タカショー	3	3.9	2,577	2,577	三菱石油	16.5	16.5	16,252	16,252	グローセル	5.6	6.7	2,747	2,747
エクセル	2.3	—	—	—	稲畑産業	14.8	14.8	20,453	20,453	小売業 (5.0%)				
マルカ	2.2	2.3	4,908	4,908	GS1フレオス	1.6	1.6	2,867	2,867	ローソン	15.6	16.9	85,683	85,683
IDOM	20.8	18	11,448	11,448	明和産業	5.7	6.3	3,068	3,068	サンエー	4.6	5.5	25,795	25,795
進和	3.6	4	8,696	8,696	クワザフ	2.2	2.1	1,104	1,104	カワチ薬品	4.8	5.2	15,449	15,449
エスケイジャパン	1.5	1.6	513	513	ヤマエ久野	—	4.9	6,188	6,188	エービーシー・マート	9.6	10.4	56,160	56,160
ダイトロン	2.6	2.8	4,239	4,239	ワキタ	13.1	14.2	14,484	14,484	ハードオフコーポレーション	2.4	2.5	1,657	1,657
シークス	7.8	8.5	10,506	10,506	東邦ホールディングス	18.2	21.1	48,446	48,446	アスクル	6.4	7	30,520	30,520
田中商事	2.1	2.1	1,575	1,575	サンゲツ	18.1	18.3	30,268	30,268	ゲオホールディングス	9.4	11.9	20,111	20,111
オーハシテクニカ	3.5	3.5	4,987	4,987	ミツウロコグループ	8.2	9.8	12,602	12,602	アダストリア	8.5	9.3	15,084	15,084
白銅	2	2.3	2,996	2,996	シナネンホールディングス	2.5	2.8	8,778	8,778	ジーフット	3.8	4.4	2,283	2,283
ダイコー通産	—	0.4	546	546	伊藤忠エネクス	13.5	14.1	13,944	13,944	シー・ヴィ・エス・バイエリア	0.8	1	450	450
伊藤忠	430.1	465.8	1,286,306	1,286,306	サンリオ	19	18.8	36,716	36,716	くら寿司	3.2	3.5	19,810	19,810
丸紅	606.5	693.5	438,361	438,361	サンワ テクノス	3.7	4.7	4,385	4,385	キャンドゥ	2.9	3.2	6,908	6,908
高島	1	1	1,909	1,909	リョーサン	6.8	7.4	15,688	15,688	パルグループ HLDGS	3.1	6.9	7,776	7,776
長瀬産業	34.5	37.3	58,598	58,598	新光商事	5.8	10.3	9,259	9,259	エディオン	26.1	30.8	34,742	34,742
蝶理	3.9	4.3	6,957	6,957	トーホー	2.8	3	5,985	5,985	サーヨーコーポレーション	12.5	13.4	7,825	7,825
豊田通商	68.7	74.5	226,107	226,107	三信電気	4.2	3.6	7,110	7,110	ワッツ	2.8	2.8	2,674	2,674
三共生興	10.5	10	4,250	4,250	東陽テクニカ	7.1	7.6	7,676	7,676	ハローズ	2.3	2.5	11,000	11,000
兼松	24.6	25	32,925	32,925	モスフード サービス	8.1	8.8	27,060	27,060	フジオフード G 本社	2.6	5.7	7,991	7,991
ツカモトコーポレーション	1.1	1.3	1,675	1,675	加賀電子	6.1	6.7	14,746	14,746	あみやき亭	1.3	1.4	4,197	4,197
三井物産	506.7	577	1,089,087	1,089,087	ソーダニツカ	6.4	6.8	3,774	3,774	ひらまつ	12.4	11.8	2,773	2,773
日本紙パルプ	3.5	3.8	14,231	14,231	立花エレテック	4.5	4.9	8,785	8,785	大黒天物産	1.5	1.6	9,344	9,344
日立ハイテック	18.7	—	—	—	フオーバル	2.7	2.9	2,844	2,844	ハニースホールディングス	5.4	5.8	5,834	5,834
カメイ	8	8.6	9,546	9,546	PAL TAC	11.1	10.7	59,200	59,200	ファーマライズ HD	1.4	1.5	1,192	1,192
東都水産	0.9	0.8	2,936	2,936	三谷産業	7.2	8.7	3,497	3,497	アルペン	4.7	5.1	10,072	10,072
OUG ホールディングス	1	1.1	3,126	3,126	太平洋興発	2.4	2.6	1,645	1,645	ハブ	2	1.9	1,318	1,318
スターゼン	2.3	2.5	10,250	10,250	西本 WISMETTAC HD	1.1	1.2	2,268	2,268	クオールホールディングス	9.1	9.8	12,259	12,259
山善	24	26.2	27,955	27,955	ヤマシタヘルスケア HLDGS	0.5	0.7	1,055	1,055	ジンスホールディングス	3.3	3.6	30,420	30,420
椿本興業	1.4	1.2	4,338	4,338	国際紙パルプ商事	14.4	15.9	4,801	4,801	ビックカメラ	36.5	39.8	44,814	44,814
住友商事	363.8	420.5	552,957	552,957	ヤマタネ	3.1	3.3	4,362	4,362	DCMホールディングス	33.2	37.3	56,882	56,882
内田洋行	2.6	2.7	13,932	13,932	丸紅建材リース	0.6	0.7	1,220	1,220	ペッパーフードサービス	4.9	5.7	2,034	2,034
三菱商事	431.6	436.9	1,145,333	1,145,333	日鉄物産	4.4	4.7	14,899	14,899	MonotaRO	43.7	47.5	239,400	239,400
第一実業	2.8	3.3	12,622	12,622	泉州電業	1.9	2	6,240	6,240	東京一番フーズ	1.6	1.5	877	877
キャンノマーケティング JPN	17.6	16.7	33,433	33,433	トラスコ中山	12.8	14	36,316	36,316	DD ホールディングス	2.7	2.7	2,025	2,025
西華産業	3.5	3.7	5,246	5,246	オートパックスセブン	24.5	24.6	34,759	34,759	きちりホールディングス	1.6	1.7	1,089	1,089
佐藤商事	5.5	5.6	5,768	5,768	モリト	4.5	4.9	3,537	3,537	アークランドサービス HD	4.5	4.9	10,353	10,353
菱洋エレクトロ	6.2	6.8	19,788	19,788	加藤産業	9.6	9.7	35,744	35,744	J. フロント リテイリング	78.7	79.8	56,179	56,179
東京産業	6.1	6	3,198	3,198	北恵	1.2	1.6	1,769	1,769	ドトール・日レス HD	10.8	9.7	16,121	16,121
ユアサ商事	6.3	6.4	21,248	21,248	イノテック	3.7	3.9	4,130	4,130	マツモトキヨシ HLDGS	25.4	27.5	104,225	104,225
神鋼商事	1.4	1.6	2,780	2,780	イエローハット	11.6	12.6	21,835	21,835	ブロンコビリー	3.2	3.5	8,326	8,326
トルク	3.7	3.9	1,189	1,189	JK ホールディングス	5.6	6	4,812	4,812	ZOZO	66.5	45.9	133,385	133,385

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
トレジャー・ファクトリー	1.8	2	1,556		ライトオン	4.7	4.9	2,729		ライフコーポレーション	4.7	5.1	24,709	
物語コーポレーション	1.5	1.8	17,802		ジーンズメイト	1.9	2.7	588		リンガーハット	7.6	8.3	21,920	
ココカラファイン	6.9	6.9	46,023		良品計画	87.2	88.9	156,375		MrMaxHD	8.4	9.2	8,445	
三越伊勢丹HD	115.2	117.3	64,866		三城ホールディングス	7.7	6.9	1,987		テナアライド	5.6	5.9	2,460	
Hamee	1.9	2.4	5,608		アドヴァン	9.4	10.3	13,688		AOKIホールディングス	12.3	13.5	7,735	
ウエルシアHD	16.3	39.6	180,576		アルビス	2.3	2.5	6,912		オークワ	8.8	10.5	15,519	
クリエイトSDH	9.1	11.2	42,056		コナカ	7.3	7.7	2,209		コメリ	9.5	10.3	34,659	
丸善CHIHD	7.2	5.6	2,156		ハウスローゼ	0.8	0.8	1,312		青山商事	10.8	13.8	7,921	
ミサワ	1.1	1.6	1,132		G-7ホールディングス	1.8	3.9	10,553		しまむら	7.2	7.8	69,810	
ティーライフ	0.8	0.9	1,146		イオン北海道	6	8.5	7,165		はせがわ	3.1	3.4	1,098	
イー・ピーカンパニー	1.1	1.5	655		コジマ	10.6	11.4	5,871		高島屋	48.3	48.9	40,440	
テムニー	1.9	2	2,864		ヒマラヤ	2.2	2.2	2,074		松屋	12.4	13.5	10,138	
シュッピン	4.2	4.6	3,850		コーナン商事	8.1	9.5	38,380		エイチ・ツー・オーリテイリング	31.6	31.8	23,373	
オイシックス・ラ・大地	—	6.6	21,615		エコス	2.3	2.4	5,260		近鉄百貨店	2.3	2.6	8,398	
ネクステージ	8.8	9.6	11,260		ワタミ	8.1	7.9	8,413		パルコ	5.9	—	—	
ジョイフル本田	18	19.6	33,084		マルシェ	1.5	1.5	903		丸井グループ	52.1	61.2	120,380	
鳥貴族	2	2.3	3,452		パンパシフィックHD	147.4	146.4	341,404		アクシアルリテイリング	5.1	5.5	27,032	
キリン堂ホールディングス	2.4	2.6	9,113		西松屋チェーン	13.6	14.7	19,992		井筒屋	3.3	4	696	
ホットランド	3.7	4.5	5,368		ゼンショーホールディングス	29.9	32	82,304		イオン	236.7	256.1	724,506	
すかいらーくHD	69	74.9	114,597		幸楽苑ホールディングス	3.9	4.2	7,501		イズミ	12.5	13.7	52,471	
SFPホールディングス	2.6	3.8	5,380		ハークスレイ	1.3	1.3	1,290		平和堂	12.5	13.4	29,681	
綿半ホールディングス	2.3	2.5	8,112		サイゼリヤ	10.2	10	21,620		フジ	7.4	8.1	15,260	
ヨシックス	1	1.1	1,992		V-Tホールディングス	27.8	27.6	11,785		ヤオコー	7	7.6	60,420	
ユナイテッド・スーパーマーケット	17.8	19.3	24,684		魚力	1.7	1.9	3,608		ゼビオホールディングス	7.4	8	6,320	
ゴルフダイジェスト・オン	2.5	2.9	1,954		ポプラ	1.6	1.8	759		ケーズホールディングス	64	64.4	90,417	
B E E N O S	2.2	3	5,253		フジ・コーポレーション	1.6	1.8	4,140		Olympicグループ	3.6	3.4	3,515	
あさひ	5.1	5	9,515		ユナイテッドアローズ	7.1	7	11,032		日産東京販売HD	9	9.7	2,473	
日本調剤	2.2	4.1	7,002		ハイデイ日高	8.9	9.7	18,362		シルバリアフ	—	0.9	1,798	
コスモス薬品	2.7	5.9	106,436		京都きもの友禅	4	3.9	889		一家ダイニングプロジ	—	0.5	306	
トーエル	3	3.2	2,640		コロワイド	20.5	22.3	44,087		GENKY DRUGSTORES	3	2.9	10,802	
オンリー	1	1.1	563		ピーシーデポコーポ	8.2	8.8	5,825		ナルミヤ・インターナショナル	—	1.4	814	
セブン&アイ・HLDGS	257.8	260.5	876,061		舌番屋	4.3	4.7	26,508		総合メディカルHD	5.4	—	—	
クリエイト・レストランツ・ホール	16.6	36.1	22,887		トップカルチャー	2.2	2.4	974		ブックオフGHD	3.2	3.9	3,584	
ツルハホールディングス	13.4	14.5	220,255		P L A N T	1.6	1.6	1,406		アインホールディングス	8.3	8.2	59,286	
サンマルクホールディングス	4.9	5.3	8,442		スギホールディングス	13.5	13.3	100,548		元気寿司	1.7	1.7	4,285	
フェリシモ	1.4	1.4	1,506		薬王堂ホールディングス	2.7	2.9	7,299		ヤマダ電機	187.6	203.4	107,191	
トリドールホールディングス	7.6	16.6	25,962		ヴィア・ホールディングス	7.6	8.1	2,770		アークランドサカモト	10.4	10.5	23,436	
TOKYO BASE	5.6	6	2,406		スクロール	9.5	10.1	9,079		ニトリホールディングス	26.6	28.8	624,240	
オイルプラスHLDGS	0.9	1.1	640		ヨンドシーホールディングス	6.8	6.8	12,478		グルメ軒屋	4.4	4.7	5,029	
JMホールディングス	3.1	5.1	15,555		ファミリーマート	68.8	53.2	124,488		愛眼	5	5.4	1,258	
サツドラホールディングス	0.9	0.9	1,854		木曽路	7.6	8.8	23,205		ケーユーホールディングス	3.1	2.9	2,372	
デファクトスタンダード	0.5	—	—		SRSホールディングス	7.3	8.1	8,075		吉野家ホールディングス	21.5	22	44,858	
アレンザホールディングス	3.3	3.3	5,613		千趣会	11.2	12.2	5,124		松屋フーズHLDGS	3	3.2	11,952	
串かき田中HLDGS	0.9	1.3	2,341		タカキユウ	4.8	6.1	841		サガミホールディングス	8.3	8.9	12,922	
パロックジャパン	5	4.6	2,907		リテールパートナーズ	—	8.9	16,251		関西スーパーマーケット	4.6	5.5	7,315	
クスリのアオキHLDGS	6.1	6	54,420		ケーヨー	11.4	13.7	13,549		王将フードサービス	4.5	4.9	29,988	
力の源HD	2.3	3	2,022		上新電機	7.3	7.9	19,726		プレナス	6.9	7.2	13,017	
スシローグローバルHLDGS	6.8	36.7	100,044		日本瓦斯	9.7	10.6	47,912		ミニストップ	4.6	5	7,620	
L I X I L ビバ	5.2	—	—		ロイヤルホールディングス	10.8	11.7	22,581		アークス	11.5	13.6	36,529	
メディカルシステムネットワーク	6.6	6.4	2,944		東天紅	0.5	0.5	500		パルコホールディングス	13.3	14.7	43,129	
はるやまHLDGS	2.9	3.1	2,306		いなげや	6.9	8.2	16,596		藤久	0.5	0.6	1,164	
ノジマ	10.9	12	34,620		島忠	13	12.5	42,250		ベルク	3	3.3	25,113	
カップ・クリエイト	8.7	9.4	15,604		チヨダ	6.5	7.1	6,830		大庄	3.3	3.5	4,445	

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
ファーストリテイリング	8.2	8.9	575.118		紀陽銀行	21.8	23.7	37,943		マネックスG	56.9	50	13,200	
サンドラッグ	23.2	25.1	101,027		ほくほくフィナンシャルG	41.1	44.5	48,416		極東証券	8.3	8.7	5,211	
サクスポールホールディング	5.2	5.5	3,129		広島銀行	91	99	59,499		岩井コスモホールディング	6.2	6.3	8,019	
ヤマザワ	1.3	1.4	2,520		山陰合同銀行	36.6	39.9	22,940		藍澤證券	11	12	8,280	
やまや	1	1.3	3,000		中国銀行	53.1	57.5	58,882		マネーパートナーズGP	7.3	6.6	1,405	
ペルーナ	15.1	14.4	13,737		鳥取銀行	2.1	2.2	2,763		スパークス・グループ	24.4	30.8	6,406	
銀行業 (4.9%)					伊予銀行	81.6	95.1	68,186		小林洋行	1.9	2.8	742	
島根銀行	1.4	1.5	1,045		百十四銀行	6.6	7.1	12,865		保険業 (1.9%)				
じもとホールディングス	42.1	45	5,355		四国銀行	8.8	10.2	7,690		かんぽ生命保険	21.9	23.5	39,973	
めびきフィナンシャルG	319.6	346	83,386		阿波銀行	9.4	10.9	28,209		SOMPOホールディングス	108.6	125.4	475,266	
東京きらぼしFG	8.4	9	10,692		大分銀行	3.8	3.9	9,344		アニコムホールディングス	5.1	5.5	23,320	
九州フィナンシャルG	101.2	146.2	71,491		宮崎銀行	4.1	4.5	11,011		MS & AD	161	174.3	516,363	
ゆうちょ銀行	174.3	187.6	156,833		佐賀銀行	3.8	4	5,512		SONY FH	50.6	—	—	
富山第一銀行	14.8	15.7	4,772		沖縄銀行	5.6	6.1	19,489		第一生命HLDGS	348.6	377.8	575,200	
コンコディア・フィナンシャル	386.4	380.6	147,292		琉球銀行	14.2	15.5	14,337		東京海上HD	220.3	235.9	1,144,822	
西日本フィナンシャルHD	38.9	44.6	33,316		セブン銀行	205.9	223	58,203		T&Dホールディングス	190.6	199.7	218,072	
関西みらいFG	28.8	39.5	17,459		みずほフィナンシャルG	8,369.9	9,059.1	1,255,591		アドバンスクリエイト	1.4	1.6	3,659	
33FG	5.3	6.2	8,698		高知銀行	2.3	2.5	2,055		その他金融業 (1.2%)				
第四北越フィナンシャルG	10.7	11.7	26,442		山口フィナンシャルG	76.8	83.5	59,285		全国保証	17.4	18.9	75,033	
新生銀行	45.3	49.1	65,843		長野銀行	2	2.1	2,971		ジェイリース	1.7	2.5	1,385	
あおぞら銀行	34.5	40	71,440		名古屋銀行	5	5.1	12,591		イントラスト	1.7	2.5	2,162	
三菱UFJフィナンシャルG	4,240.3	4,562.2	2,006,911		北洋銀行	93.2	101.3	23,602		日本モーゲージサービス	1.1	2.8	3,180	
りそなホールディングス	676	725.8	281,392		愛知銀行	2.2	2.4	7,860		Casa	2.8	2.3	2,831	
三井住友トラストHD	121.1	126	379,134		中京銀行	2.5	2.7	5,526		アルヒ	5.6	10.7	18,981	
三井住友フィナンシャルG	434.1	461	1,417,114		大光銀行	2.1	2.2	3,187		プレミアアグループ	3.5	3.6	7,617	
千葉銀行	211.9	222.5	133,055		愛媛銀行	8.6	9	10,683		クレディセゾン	43.2	47	52,734	
群馬銀行	123.3	128	46,336		トマト銀行	2.4	2.5	2,925		芙蓉総合リース	7	7	49,420	
武蔵野銀行	9.2	10	16,760		京葉銀行	26.1	28.5	14,250		みずほリース	11.6	10.2	28,141	
千葉興業銀行	17.1	18	4,716		栃木銀行	32.3	31.6	6,098		東京証券チェルシー	12.4	13.4	77,854	
筑波銀行	25.9	28.1	5,901		北日本銀行	1.9	2	3,934		日本証券金融	27.2	29.5	15,428	
七十七銀行	19.3	22.7	37,500		東和銀行	10.9	11.7	8,903		アイフル	94.3	102	28,050	
青森銀行	4.8	5.2	13,150		福島銀行	5.4	7.3	1,832		リコーリース	4.8	5.2	14,840	
秋田銀行	4	4.3	7,082		大東銀行	3	3.3	2,260		イオンフィナンシャルサービス	39.4	41.1	39,086	
山形銀行	6.9	7.5	10,140		トモニホールディングス	47.5	51.8	17,663		アコム	124.1	133.9	61,058	
岩手銀行	4.3	4.4	11,242		フィデアホール	60.4	64.4	7,470		ジャックス	6.8	7.4	13,009	
東邦銀行	55.3	59.7	13,850		池田泉州HD	65.9	76.9	14,226		オリコ	167.3	181.6	20,702	
東北銀行	3.2	3.1	3,565		証券、商品先物取引業 (0.8%)					日立キャピタル	14.5	15.8	40,953	
みちのく銀行	4	4.4	5,627		FPG	19.4	20.6	12,463		アプラスフィナンシャル	29.8	34.1	2,523	
ふくおかフィナンシャルG	54.3	56.3	107,138		マセリアインベストメント	2.6	2.8	1,775		オリックス	410.8	413.9	572,423	
静岡銀行	152.5	162.2	121,650		SBIホールディングス	73.4	74.6	204,478		三菱UFJリース	138.9	168.4	88,410	
十六銀行	8.3	8.4	17,035		日本アジア投資	5.2	6.3	1,493		九州リースサービス	3	2.9	1,856	
スルガ銀行	60.5	63	24,759		ジャフコ	10.1	10.3	43,929		日本取引所グループ	166.4	191.3	554,770	
八十二銀行	148.8	161	67,781		大和証券G本社	494.3	534.4	247,961		イー・ギャランティ	5.8	7.2	16,992	
山梨中央銀行	7.5	7.8	6,614		野村ホールディングス	1,084	1,174.1	586,462		アサックス	2.6	3.5	2,660	
大垣共立銀行	13	13.2	31,257		岡三証券グループ	52.6	57.3	20,398		NECキャピタルソリューション	2.5	2.7	5,105	
福井銀行	5.3	5.7	10,009		丸三証券	18.4	19.7	9,416		不動産業 (2.0%)				
北國銀行	6.4	6.7	20,602		東洋証券	22.4	24.3	2,745		いちご	78.5	85.5	26,248	
清水銀行	2.6	2.7	5,211		東海東京HD	71	76.9	21,532		日本駐車場開発	67.8	69.7	9,200	
富山銀行	1.2	1.3	4,095		光世証券	1.5	1.8	1,087		スター・マイカ・HLDGS	—	3.3	4,204	
滋賀銀行	12.4	13.4	34,143		水戸証券	18	19.1	4,125		ADワークスグループ	—	14.9	2,339	
南都銀行	9.6	11.2	22,635		いちよし証券	12.3	12.2	5,990		ヒューリック	131.6	141.5	139,943	
百五銀行	55.6	59.5	19,337		松井証券	30.2	37.7	36,003		三栄建築設計	2.4	2.7	3,855	
京都銀行	22.1	23.9	121,890		だいこう証券ビジ	2.5	—	—		野村不動産HLDGS	41	40.5	84,159	

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
三重交通グループHD	12.5	13.3	6,410	6,410	サンフロンティア不動産	8.5	9.5	8,236	8,236	ウェルネット	5.7	6.6	3,801	3,801
サムティ	8.7	9.5	14,449	14,449	インテリックス	1.8	2.8	1,338	1,338	ワールドホールディングス	1.9	2.3	4,652	4,652
エー・ディー・ワークス	191.5	—	—	—	ランドビジネス	2.6	2.6	988	988	ディー・エヌ・エー	32.2	27.5	51,700	51,700
日本商業開発	3.9	4.5	7,654	7,654	サンネクスグループ	1.6	1.9	1,922	1,922	博報堂DY HLDGS	82.9	90.5	130,410	130,410
プレサンスコーポレーション	9.8	11.1	16,006	16,006	グランディハウス	5.4	5.3	2,400	2,400	ぐるなび	8.5	11.3	8,271	8,271
ユニソホールディングス	9.4	—	—	—	日本空港ビルデング	19.7	21.4	100,473	100,473	タカミヤ	6.3	6.7	3,805	3,805
ハウスコム	—	0.9	1,192	1,192	サービス業 (5.7%)					ジャパンベストレスキューS	4	5	5,140	5,140
日本管理センター	4.1	3.9	5,073	5,073	日本工営	4	4.4	12,821	12,821	ファンコミュニケーションズ	16.5	18	8,604	8,604
サンセイランディック	1.8	2.5	1,837	1,837	L I F U L L	20.9	22.6	10,689	10,689	ライク	2.4	2.3	4,229	4,229
エストラスト	0.9	1.4	932	932	ミクシィ	—	12.4	33,033	33,033	ビジネス・ブレークスルー	2.5	3.2	1,222	1,222
フージャースHD	13.4	13.3	8,778	8,778	ジェイエイシ-リクルートメント	4	4.3	5,774	5,774	エスプール	2.3	16.6	13,246	13,246
オープンハウス	8.9	19.5	71,955	71,955	日本M&Aセンター	45.1	49.2	281,916	281,916	WDBホールディングス	2.7	3	9,210	9,210
東急不動産HD	165.8	181.9	86,220	86,220	メンバーズ	2	1.9	3,361	3,361	手間いらず	—	0.4	2,212	2,212
飯田GHD	51.3	55.5	120,157	120,157	中広	0.5	0.6	310	310	ティア	3.5	3.6	1,602	1,602
イーグランド	0.9	1	795	795	UTグループ	—	10.2	34,833	34,833	C DG	0.5	0.7	1,239	1,239
ビーロット	1.4	3.4	2,410	2,410	アイティメディア	1.1	2.6	6,814	6,814	パリュウコマース	3.4	3.6	12,798	12,798
ファーストブラザーズ	1.4	1.5	1,383	1,383	タケエイ	6.2	6.2	6,355	6,355	インフォーマット	32.7	65.6	63,566	63,566
ハウスドゥ	3.4	3.5	3,899	3,899	E・Jホールディングス	0.7	1.2	3,151	3,151	JPホールディングス	17.1	20.2	6,443	6,443
シアールイー	1.5	1.8	2,626	2,626	ビーネックスグループ	6.6	8.1	9,396	9,396	エコナックホールディングス	10.8	13.5	1,309	1,309
プロパティエージェント	0.8	1.1	1,499	1,499	コシダカホールディングス	14.4	15.5	6,711	6,711	EPSホールディングス	9	9	9,603	9,603
ケイアイスター不動産	1.7	2.2	5,863	5,863	アルトナー	1.4	1.8	1,614	1,614	レッグス	1.5	1.7	1,878	1,878
アグレ都市デザイン	1	1.7	1,064	1,064	パソナグループ	7.3	7	10,927	10,927	プレステージ・インター	11.2	24.3	22,356	22,356
ジェイ・エス・ビー	0.7	1.3	3,898	3,898	CD S	1.5	1.6	2,180	2,180	アミューズ	3.6	3.5	8,736	8,736
テンポイノベーション	0.7	1.7	1,269	1,269	リンクアンドモチベーション	13.2	13.7	5,671	5,671	ドリームインキュベータ	1.8	1.9	2,882	2,882
グローバルリンクマネジメント	0.9	1.4	932	932	G C A	7.1	7.8	5,171	5,171	クイック	3.7	3.9	4,761	4,761
パーク24	33.1	36	67,428	67,428	エス・エム・エス	22	20.2	59,590	59,590	T A C	3.1	4.4	1,003	1,003
パラカ	1.6	1.7	3,065	3,065	サニーサイドアップG	1.3	2.1	1,493	1,493	ケネディクス	56.8	56.8	30,558	30,558
三井不動産	326.8	329	641,221	641,221	パーソルホールディングス	59.7	65.1	113,143	113,143	電通グループ	61.5	67.1	214,720	214,720
三菱地所	431.6	467.2	756,163	756,163	リニカル	3.4	3.2	2,726	2,726	テイクアンドギヴニーズ	2.3	2.4	1,552	1,552
平和不動産	11.3	12.2	34,599	34,599	クックパッド	19.1	22.4	8,512	8,512	びあ	1.7	1.8	6,255	6,255
東京建物	67.4	66.1	85,930	85,930	エスクリ	1.6	2	760	760	イオンファンタジー	1.9	2.5	4,262	4,262
ダイビル	18.2	17	20,706	20,706	アイ・ケイ・ケイ	2.9	3.1	1,940	1,940	シーティーエス	6.7	7.3	6,920	6,920
京阪神ビルディング	10.8	10.5	17,713	17,713	学情	2.1	2.4	2,688	2,688	ネクシーズグループ	2.1	2.4	2,702	2,702
住友不動産	138.5	149.9	469,486	469,486	スタジオアリス	3	3.2	5,296	5,296	HUグループHD	16.7	18.2	52,179	52,179
テオーシー	14.1	12.9	8,668	8,668	ジミックホールディングス	3.3	3.6	4,975	4,975	アルプス技研	5.3	5.7	11,496	11,496
東京楽天地	0.9	1.2	5,382	5,382	エプロ	—	1.3	1,309	1,309	サンニクス	10.6	11.4	2,964	2,964
スターツコーポレーション	8.3	9	20,871	20,871	N J S	1.3	1.4	2,696	2,696	ダイオース	1.4	1.2	1,252	1,252
フジ住宅	7.9	7.7	4,158	4,158	総合警備保障	23.7	25.9	133,385	133,385	日本空調サービス	6.8	6.8	5,066	5,066
空港施設	7.2	6.8	3,141	3,141	カカコム	44.7	48	128,544	128,544	オリエンタルランド	70.5	68.7	1,039,431	1,039,431
明和地所	3.4	4.2	2,184	2,184	アイコムグループ	2.3	2.4	5,064	5,064	ダスキン	15.3	16.2	47,320	47,320
ゴールドクレスト	4.8	5	7,015	7,015	セントケア・ホールディング	4.4	4	3,196	3,196	明光ネットワークジャパン	7.1	8.1	6,050	6,050
エスリード	2.3	2.7	3,680	3,680	サイネックス	0.9	1.1	966	966	ファルコホールディングス	3.3	3.5	5,579	5,579
日神グループHLDGS	8.9	10.3	4,356	4,356	ルネサンス	3.3	3.5	3,405	3,405	秀英予備校	1.4	1.4	641	641
日本エスコン	11.1	12.2	10,309	10,309	ディップ	9.6	9.1	19,292	19,292	田谷	1.2	1.2	705	705
タカラレーベン	28.2	30.2	9,905	9,905	デジタルホールディングス	3.3	3.5	4,812	4,812	ラウンドワン	18.5	18.1	15,004	15,004
AVANTIA	3.5	3.8	3,040	3,040	新日本科学	8.1	7.1	5,609	5,609	リゾートトラスト	25.3	29.8	48,425	48,425
イオンモール	30.9	33.4	49,999	49,999	ツクイ	14.1	15.2	9,591	9,591	ピー・エム・エル	7.7	8.3	26,186	26,186
毎日コムネット	1.3	2	1,622	1,622	キャリアデザインセンター	1.5	1.7	1,761	1,761	ワタベウエディング	1	1	396	396
ファースト住建	2.6	2.9	3,007	3,007	ベネフィット・ワン	16.4	23.7	62,212	62,212	りらいあコミュニケーション	10.8	11.7	15,783	15,783
ランド	255.5	378.1	3,402	3,402	エムスリー	125.7	142.6	934,030	934,030	リソー教育	30.3	29.6	8,495	8,495
カチタス	6.9	16.6	47,907	47,907	ツカダ・グローバルHOLD	3.8	4	1,220	1,220	早稲田アカデミー	1.7	2.8	2,844	2,844
トーセイ	8.5	9.4	8,939	8,939	プラス	0.6	0.7	337	337	ユー・エス・エス	72.9	72.9	139,239	139,239
穴吹興産	0.7	1.5	2,338	2,338	アウトソーシング	34.2	37.1	34,132	34,132	東京個別指導学院	2.1	2.3	1,271	1,271

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
サイバーエージェント	34.3	39.9	248,178	千円	インソース	2.9	2.8	7,848	千円	トーカイ	5.8	6.3	13,519	千円
楽天	278.3	301.7	368,074		ペイカレントコンサルティング	4.2	3.9	50,622		白洋舎	0.7	0.8	2,107	
クレーク・アンド・リバー社	3.5	3.4	4,576		ORCHESTRA HLDGS	1.2	1.6	3,636		セコム	63.3	68.7	675,595	
テー・オー・ダブリュー	5.2	10.4	3,421		アイモバイル	1.9	2.2	2,721		セントラル警備保障	2.9	3.1	10,850	
山田コンサルティングGP	2.9	4.1	4,858		キャリアインデックス	2.1	2.8	1,624		丹青社	11.3	12.2	8,906	
セントラルスポーツ	2.2	2.4	6,060		MS - J a p a n	2.4	2.2	1,830		メイテック	7.4	8	43,440	
フロンティアホールディングス	6	6.2	10,558		船場	0.9	1.1	1,034		応用地質	6.4	6.9	8,673	
エル・ジャパン	8.7	11.5	33,154		グレイステクノロジー	2.2	3	14,520		船井総研ホールディング	12.3	13.4	32,361	
リソルホールディングス	0.7	0.7	2,646		ジャパエレベーターSHD	4.7	6.8	26,044		進学会ホールディングス	2.7	2.5	1,147	
テクノプロ・ホールディング	12	13	82,160		フルテック	0.8	0.9	1,235		オオバ	4.7	4.8	3,883	
アトラ	1.2	1.7	448		グリーンズ	2.3	1.8	959		いであ	1.1	1.5	2,976	
インターワークス	1.1	1.6	548		ツナググループHLDGS	0.7	0.9	416		学究社	2	1.8	2,030	
アイ・アールジャパンHD	2.4	2.6	31,590		GAMEWITH	—	1.7	1,110		ベネッセホールディングス	21.9	21.7	59,544	
Keeper 技研	2.2	2.4	7,392		ソウルダアウト	0.9	1.3	2,087		イオンディライト	7.4	8	23,448	
ファーストロジック	1.4	1.4	1,054		MS&CONSULTING	0.9	1	732		ナック	3.8	3.9	3,853	
三機サービス	1.3	1.3	1,440		ミダック	—	0.8	1,846		ニチイ学館	8.5	6.2	10,310	
Gunosy	4.2	4	3,796		日総工産	4	4.5	3,658		ダイセキ	10	10.9	28,983	
デザインワン・ジャパン	1.2	1.5	412		キュービーネットHLDGS	3.6	2.9	5,399		ステップ	2.2	2.4	3,837	
イー・ガーディアン	3.1	3.2	10,240		RPA ホールディングス	2.5	4.8	4,185						
リブセンス	3.3	4.5	1,296		スプリックス	2	2.2	1,909		株数、金額	73,677.7	79,781.50004	155,810.906	
ジャパンマテリアル	16.3	20	30,260		マネジメントソリューションズ	—	2.8	4,600		銘柄数<比率>	2,131銘柄	2,151銘柄	<99.4%>	
ベクトル	7.5	8.2	8,979		プロレド・パートナーズ	—	0.9	4,581						
ウチヤマホールディングス	3	3.2	1,024		AND FACTORY	—	0.5	521						
チャームケアソリューション	1.9	5.5	6,391		ギークス	—	0.6	727		(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する				
ライクキッズ	1.4	—	—		カープスホールディングス	—	17.8	12,121		各業種の比率。				
キャリアリンク	2.2	2.4	2,560		フォーラムエンジニアリング	—	3.3	2,877		(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価				
IBJ	4	4.5	4,972		アドバンテッジリスクマネ	2.3	3.3	2,537		額の比率。				
アサンテ	2.4	2.7	4,422		リログループ	32.6	35.4	88,535		(注3) 評価額の単位未満は切捨て。				
N・フィールド	4	4.3	2,992		東祥	3.7	4	5,148						
パリューHR	1.2	2.6	4,173		エイチ・アイ・エス	9.3	10.1	19,038						
M&Aキャピタルパートナー	2.1	5.3	22,313		ラックランド	1.2	1.5	3,546						
ライドオンエクスプレスHD	2.5	2.5	6,362		共立メンテナンス	9.1	10.8	43,686						
ERI ホールディングス	1.7	1.8	1,170		イチネンホールディングス	6.2	7.2	9,223						
アピスト	0.9	0.9	2,911		建設技術研究所	4.1	4.4	9,103						
シグマクシス	2.9	4.4	7,427		スペース	3.9	4.1	3,538						
ウィルグループ	3.9	4.3	3,766		長大	2.2	2.5	3,307						
エスクローAJ	8.3	9	3,366		燦ホールディングス	1.3	2.8	3,413						
リクルートホールディングス	427.5	463.1	1,986,699		スバル興業	0.4	0.4	3,200						
エラン	3.5	3.8	9,526		東京テアトル	2.4	3.1	4,042						
土木管理総合試験	2.6	2.9	1,107		タナベ経営	1.2	1.1	1,662						
ネットマーケティング	2.1	2.3	1,536		ナガワ	1.7	2	15,820						
日本郵政	489.1	527	391,877		よみうりランド	1.3	1.4	6,041						
ベルシステム24HLDGS	10	10.9	19,184		東京都競馬	3.9	4.2	22,218						
鎌倉新書	4.4	4.9	4,640		常磐興産	2.4	2.6	3,991						
S MN	0.7	1.3	1,198		カナモト	9.8	10.7	25,177						
一蔵	0.7	0.7	256		東京ドーム	22.4	26.4	20,882						
LITALICO	1.4	2.2	6,168		西尾レントオール	6.1	6	13,986						
グローバルキッズCOMP	0.9	1	888		アゴラ・ホスピタリティG	34.8	47.5	1,330						
エアトリ	2.7	3.3	4,890		トランス・コスモス	6.6	6.2	17,918						
アトラエ	1.5	1.9	5,523		乃村工藝社	27.9	27.8	21,962						
ストライク	2.3	2.4	13,104		藤田観光	2.6	2.9	4,776						
ソラスト	14.6	18	23,814		KNT-CT ホールディングス	3.2	3.9	4,356						
セラク	1.9	2.2	4,543		日本管財	6.4	7.2	14,760						

(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	912	—

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

項 目	当 期 末	
	貸 付	借 入
株式	株 7,142,800 (67,500)	株 — (—)

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

■投資信託財産の構成

2020年9月23日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 155,810,906	% 90.5
コール・ローン等、その他	16,291,853	9.5
投資信託財産総額	172,102,760	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年9月23日現在

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

*期首における元本額は139,218,477,453円、当期中間中における追加設定元本額は38,212,962,099円、同解約元本額は33,157,622,329円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、トピックス・インデックスファンド3,314,021,528円、ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA6,818,474,579円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドVA2 2,657,999円、ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)46,604,616円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)686,480,990円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)36,922,244円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)975,609,786円、日本株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)115,509,117円、D-1's T O P I Xインデックス

50,828,888円、為替ヘッジ付米国国債プラス日本株式ファンド12,744,127円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 22,523,341円、iFree T O P I Xインデックス1,984,833,386円、iFree 8資産バランス2,612,918,610円、iFree 年金バランス111,316,445円、DCダイワ日本株式インデックス65,911,437,637円、ダイワ・ライフ・バランス30 3,014,014,018円、ダイワ・ライフ・バランス50 3,718,178,204円、ダイワ・ライフ・バランス70 3,338,684,763円、年金ダイワ日本株式インデックス5,125,140,712円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 12,676,182円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 49,637,084円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 35,161,355円、ダイワつみたてインデックス日本株式742,243,077円、ダイワつみたてインデックスバランス30 11,325,834円、ダイワつみたてインデックスバランス50 7,141,239円、ダイワつみたてインデックスバランス70 10,260,361円、ダイワ世界バランスファンド40VA146,259,723円、ダイワ世界バランスファンド60VA156,097,901円、ダイワ・バランスファンド35VA8,172,743,694円、ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)711,092,768円、ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)105,455,426円、ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)194,955,500円、ダイワ・ノーロード T O P I Xファンド163,360,908円、ダイワファンドラップ T O P I Xインデックス10,589,328,266円、ダイワ T O P I Xインデックス(ダイワ S M A専用)8,840,247,711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2,003,637,126円、ダイワ・インデックスセレクト T O P I X1,325,135,081円、ダイワライフスタイル25 188,604,645円、ダイワライフスタイル50 670,194,395円、ダイワライフスタイル75 532,629,983円、DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド)11,706,727,974円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,865円です。

■損益の状況

当期自2019年9月20日至2020年9月23日

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

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

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

ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)

運用報告書 (全体版) 第4期

(決算日 2020年11月30日)

(作成対象期間 2019年12月3日~2020年11月30日)

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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行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					
1期末(2017年11月30日)	円 11,363	円 0	% 13.6	11,186	% 11.9	% 92.8	% 3.6	% 0.0	% 2.5	百万円 1,294
2期末(2018年11月30日)	11,423	0	0.5	11,049	△ 1.2	91.5	6.8	—	2.5	2,198
3期末(2019年12月2日)	13,050	0	14.2	12,386	12.1	93.4	3.8	—	2.8	2,353
4期末(2020年11月30日)	14,661	0	12.3	13,721	10.8	93.1	4.7	—	2.3	3,369

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

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

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

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

(注6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注7) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

*ベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)です。

■基準価額・騰落率

期首：13,050円

期末：14,661円(分配金0円)

騰落率：12.3%(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ワクチンの開発期待などを背景に海外株式市況が上昇したことから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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)

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 率 比	株 式 先 物 率 比	投 資 信 託 組 入 証 券 比 率	投 信 託 証 組 入 証 券 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首) 2019年12月 2 日	円 13,050	% -	12,386	% -	% 93.4	% 3.8	% -	% 2.8
12月末	13,401	2.7	12,707	2.6	93.3	4.7	-	2.7
2020年 1 月末	13,498	3.4	12,787	3.2	90.5	6.7	-	2.7
2 月末	12,402	△ 5.0	11,727	△ 5.3	91.9	5.9	-	2.9
3 月末	10,664	△18.3	10,074	△18.7	90.3	7.5	-	2.6
4 月末	11,886	△ 8.9	11,209	△ 9.5	94.6	2.1	-	2.7
5 月末	12,281	△ 5.9	11,559	△ 6.7	95.6	2.3	-	2.7
6 月末	12,446	△ 4.6	11,697	△ 5.6	95.5	2.2	-	2.6
7 月末	13,041	△ 0.1	12,251	△ 1.1	91.6	4.3	-	2.5
8 月末	13,900	6.5	13,038	5.3	93.3	4.4	-	2.4
9 月末	13,378	2.5	12,539	1.2	94.2	2.4	-	2.4
10月末	13,155	0.8	12,325	△ 0.5	92.5	3.9	-	2.4
(期末) 2020年11月30日	14,661	12.3	13,721	10.8	93.1	4.7	-	2.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2019.12.3～2020.11.30)

■海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は上昇しました。

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

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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を高位に維持します。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマーク（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。

ポートフォリオについて

(2019.12.3～2020.11.30)

■当ファンド

当作成期を通じて、「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をおおむね100%程度に維持しました。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

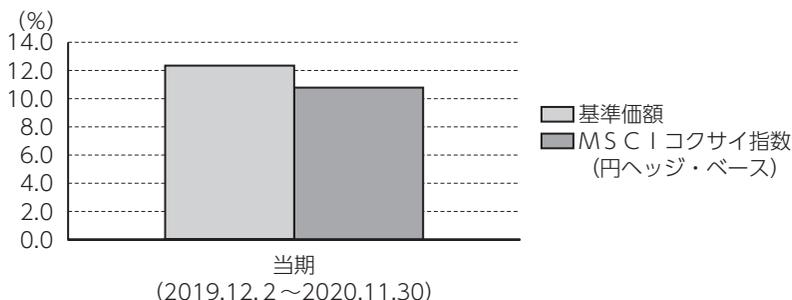
ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら、リスクモデルを利用して外国株式（投資信託証券、株式先物を含む。）等のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は10.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は12.3%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、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

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

分配原資の内訳 (1万口当り)

項目	当期 2019年12月3日 ~2020年11月30日	
	金額	比率
当期分配金 (税込み) (円)	—	—
対基準価額比率 (%)	—	—
当期の収益 (円)	—	—
当期の収益以外 (円)	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	4,661	—

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2019.12.3~2020.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	43円	0.334%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12,868円です。
(投 信 会 社)	(33)	(0.257)	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)	(7)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(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	0.008	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(1)	(0.005)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.003)	
(投資信託証券)	(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)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
そ の 他 費 用	4	0.031	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)	(0.023)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.003)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	49	0.379	

(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。

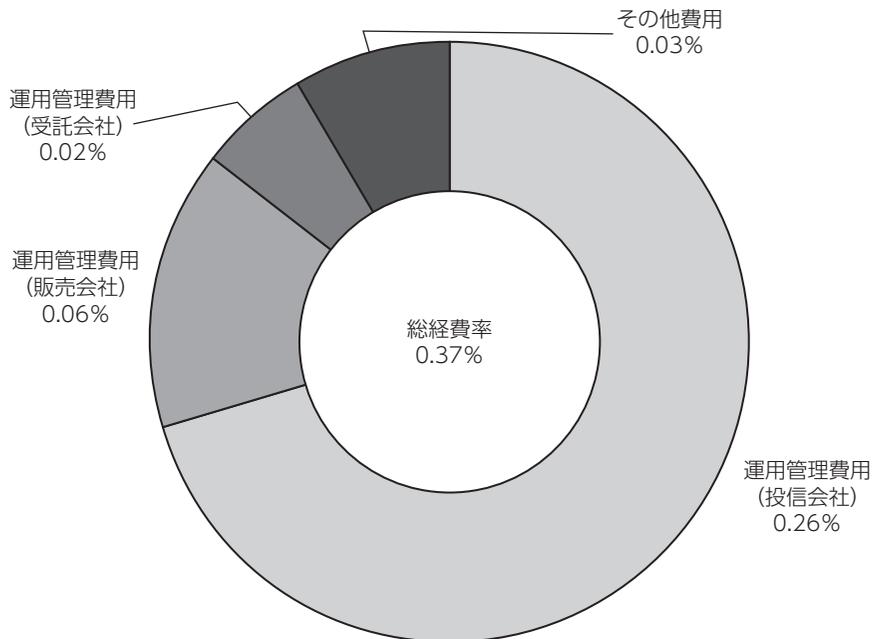
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.37%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定、解約状況

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	573,350	1,028,150	268,782	555,530

(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12月3日から2020年11月30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	13,862,844千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	51,622,817千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.26

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	1,127,210	1,431,778	3,369,117

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	3,369,117	99.7
コール・ローン等、その他	8,906	0.3
投資信託財産総額	3,378,023	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=103.89円、1カナダ・ドル=79.95円、1オーストラリア・ドル=76.91円、1香港ドル=13.40円、1シンガポール・ドル=77.69円、1ニュージーランド・ドル=73.11円、1イギリス・ポンド=138.55円、1イスラエル・シェケル=31.34円、1スイス・フラン=114.97円、1デンマーク・クローネ=16.71円、1ノルウェー・クローネ=11.76円、1スウェーデン・クローネ=12.22円、1ユーロ=124.38円です。

(注3) 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(60,785,197千円)の投資信託財産総額(62,880,307千円)に対する比率は、96.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,378,023,889円
コール・ローン等	6,646,461
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)	3,369,117,428
未収入金	2,260,000
(B) 負債	8,596,535
未払解約金	3,407,283
未払信託報酬	5,105,638
その他未払費用	83,614
(C) 純資産総額(A - B)	3,369,427,354
元本	2,298,185,009
次期繰越損益金	1,071,242,345
(D) 受益権総口数	2,298,185,009口
1万口当り基準価額(C / D)	14,661円

* 期首における元本額は1,803,208,621円、当作成期間中における追加設定元本額は1,186,063,315円、同解約元本額は691,086,927円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,661円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月3日 至2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,661円
受取利息	262
支払利息	△ 1,923
(B) 有価証券売買損益	521,332,663
売買益	577,050,683
売買損	△ 55,718,020
(C) 信託報酬等	△ 9,352,040
(D) 当期繰越損益金(A + B + C)	511,978,962
(E) 前期繰越損益金	213,989,560
(F) 追加信託差損益金	345,273,823
(配当等相当額)	(259,833,872)
(売買損益相当額)	(85,439,951)
(G) 合計(D + E + F)	1,071,242,345
次期繰越損益金(G)	1,071,242,345
追加信託差損益金	345,273,823
(配当等相当額)	(259,833,872)
(売買損益相当額)	(85,439,951)
分配準備積立金	725,970,183
繰越損益金	△ 1,661

(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	511,978,636
(c) 収益調整金	345,273,823
(d) 分配準備積立金	213,991,547
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	1,071,244,006
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	1,071,244,006
(h) 受益権総口数	2,298,185,009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））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11月30日）現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2019年12月3日から2020年11月30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	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		千株	千円	円		千株	千円	円
MICROSOFT CORP (アメリカ)	16.824	307,438	18,273	APPLE INC (アメリカ)	15.554	221,958	14,270	MICROSOFT CORP (アメリカ)	6.958	150,838	21,678	APPLE INC (アメリカ)	10.291	280,992	27,304
AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.942	227,384	241,384	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.337	111,876	331,976	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.337	111,876	331,976	FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	5.14	104,840	20,397
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	5.14	104,840	20,397	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.352	56,311	159,974	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.352	56,311	159,974	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.715	101,233	141,585
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.715	101,233	141,585	FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	1.807	51,218	28,344	FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	1.807	51,218	28,344	JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	5.681	88,689	15,611
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	5.681	88,689	15,611	BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)	15.9	41,894	2,634	BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)	15.9	41,894	2,634	NESTLE SA-REG (スイス)	7.355	85,300	11,597
NESTLE SA-REG (スイス)	7.355	85,300	11,597	NESTLE SA-REG (スイス)	3.345	41,382	12,371	NESTLE SA-REG (スイス)	3.345	41,382	12,371	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	3.943	83,306	21,127
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	3.943	83,306	21,127	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	3.273	34,684	10,597	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	3.273	34,684	10,597	ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.574	74,824	130,356
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.574	74,824	130,356	NOVO NORDISK A/S-B (デンマーク)	4.964	34,486	6,947	NOVO NORDISK A/S-B (デンマーク)	4.964	34,486	6,947	PROCTER & GAMBLE CO/THE (アメリカ)	5.186	66,239	12,772
PROCTER & GAMBLE CO/THE (アメリカ)	5.186	66,239	12,772	JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	2.102	33,011	15,704	JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	2.102	33,011	15,704				

(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11月30日現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（26,586,986千円）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	2020年11月30日現在				業 種 等
	株 数	評 価 額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円		
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	12.95	190	19,830	情報技術	
PALO ALTO NETWORKS INC	12.2	360	37,429	情報技術	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22.71	270	28,092	情報技術	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	15.94	140	14,594	情報技術	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7.46	106	11,104	ヘルスケア	
SYNCHRONY FINANCIAL	62	192	20,025	金融	
ABBOTT LABORATORIES	223.7	2,407	250,110	ヘルスケア	
HOWMET AEROSPACE INC	39.5	97	10,094	資本財・サービス	
VERISK ANALYTICS INC	19.43	385	40,014	資本財・サービス	
LAS VEGAS SANDS CORP	47.29	267	27,802	一般消費財・サービス	
AMPHENOL CORP-CL A	41.67	549	57,122	情報技術	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	77.66	1,151	119,633	情報技術	
QORVO INC	12.83	192	20,008	情報技術	
AFLAC INC	84.71	383	39,848	金融	
DARDEN RESTAURANTS INC	12.48	137	14,255	一般消費財・サービス	
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	18.35	123	12,816	コミュニケーション・サービス	
ADOBE INC	60.97	2,908	302,159	情報技術	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	28.72	111	11,567	素材	

銘柄	2020年11月30日現在				業 種 等
	株 数	評 価 額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	千アメリカ・ドル	千円		
LULULEMON ATHLETICA INC	16.07	587	61,002	一般消費財・サービス	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	44.09	56	5,890	金融	
GARMIN LTD	15.27	178	18,568	一般消費財・サービス	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	28.19	783	81,366	素材	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	88.26	1,848	192,014	資本財・サービス	
VR BERKLEY CORP	17.71	114	11,850	金融	
AUTOZONE INC	2.91	325	33,836	一般消費財・サービス	
DOLLAR TREE INC	33.98	373	38,796	一般消費財・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	123.65	121	12,614	ヘルスケア	
PINNACLE WEST CAPITAL	15.08	126	13,150	公益事業	
CELANESE CORP	12.97	173	18,012	素材	
DR HORTON INC	43.97	334	34,707	一般消費財・サービス	
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	126	13,149	ヘルスケア	
AUTODESK INC	26.84	732	76,070	情報技術	
MOODY'S CORP	21.43	594	61,719	金融	
ALBEMARLE CORP	16.68	229	23,854	素材	
ATMOS ENERGY CORP	16.54	160	16,636	公益事業	
ALLIANT ENERGY CORP	36.14	190	19,809	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11月30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	
CITIGROUP INC	261.68	1,482	154,062	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	53.55	938	97,496	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	59.18	502	52,210	公益事業
ALLEGHANY CORP	1.46	86	8,947	金融
DOMINO'S PIZZA INC	5.26	205	21,337	一般消費財・サービス
HESS CORP	34.26	173	18,070	エネルギー
DAVITA INC	10	109	11,415	ヘルスケア
DANAHER CORP	80.31	1,740	180,868	ヘルスケア
FORTIVE CORP	43.35	309	32,169	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	71.72	752	78,227	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	65.8	331	34,487	生活必需品
BUNGE LTD	18.38	111	11,617	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	42.21	486	50,565	情報技術
APPLE INC	2,191.06	25,545	2,653,929	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33.59	264	27,522	金融
BOEING CO/THE	67.41	1,459	151,619	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20.63	160	16,676	金融
BECTON DICKINSON AND CO	36.79	842	87,511	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	20	36	3,841	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	14	143	14,876	情報技術
CDK GLOBAL INC	11	51	5,341	情報技術
NISOURCE INC	40.26	98	10,251	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17.08	158	16,452	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	99.78	398	41,412	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	519.78	3,148	327,131	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	173.71	4,022	417,872	金融
ANSYS INC	10.38	342	35,630	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	171.23	830	86,277	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	81.93	495	51,521	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	286.15	1,804	187,435	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	382.84	4,640	482,131	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	30.13	438	45,585	金融
LKQ CORP	33	118	12,335	一般消費財・サービス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	5.47	93	9,739	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	36.65	297	30,879	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	36.14	421	43,770	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	16.11	307	31,925	金融
DOLLAR GENERAL CORP	30.52	665	69,124	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	24.19	1,275	132,560	情報技術
CATERPILLAR INC	68.56	1,200	124,704	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	28.86	131	13,678	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	24.78	113	11,788	公益事業
CMS ENERGY CORP	33.84	209	21,789	公益事業
MOSAIC CO/THE	52.09	118	12,273	素材
DELTA AIR LINES INC	16.5	67	7,038	資本財・サービス
CORNING INC	99.83	370	38,467	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	534.5	2,282	237,109	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	12.97	66	6,889	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	189.09	1,207	125,410	金融
MSCI INC	10.06	404	42,040	金融
FAIR ISAAC CORP	3.98	188	19,579	情報技術

銘柄	2020年11月30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	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4.5	130	13,555	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	27.8	193	20,107	情報技術
BROADCOM INC	50.58	1,997	207,536	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14.16	183	19,103	ヘルスケア
ARAMARK	31.73	114	11,926	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	16.12	46	4,841	素材
DTE ENERGY COMPANY	27.39	352	36,573	公益事業
CENTENE CORP	77.79	491	51,051	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	13.58	124	12,938	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	55.32	188	19,620	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	22.32	258	26,865	金融
GARTNER INC	11.74	179	18,606	情報技術
SPLUNK INC	20.29	413	43,008	情報技術
DOMINION ENERGY INC	109.95	869	90,285	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	47.68	401	41,683	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	14	79	8,302	資本財・サービス
DEERE & CO	36.23	949	98,596	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	38.66	761	79,134	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	8.92	126	13,166	情報技術
CABLE ONE INC	0.6	117	12,230	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	7.66	169	17,633	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	14.27	181	18,845	金融
VAIL RESORTS INC	5.53	156	16,239	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	14.61	63	6,639	金融
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	8.94	107	11,165	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	81	8,456	金融
CONSOLIDATED EDISON INC	46.02	357	37,181	公益事業
COGNEX CORP	24.39	181	18,877	情報技術
TELEFLEX INC	5.63	208	21,702	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	9.79	132	13,760	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8.52	236	24,603	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	3	160	16,676	ヘルスケア
CATALENT INC	20	194	20,237	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17.57	485	50,461	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	8	165	17,205	ヘルスケア
IDEX CORP	11.56	222	23,101	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	104.86	890	92,489	生活必需品
ROLLINS INC	17.19	102	10,605	資本財・サービス
AMETEK INC	25.97	311	32,314	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	30.47	262	27,309	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	16.44	67	7,041	資本財・サービス
HEICO CORP	11.58	67	7,062	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	10.6	112	11,653	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4.8	154	16,094	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	34.22	300	31,235	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	5.09	216	22,532	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	55.33	2,148	223,255	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	11.28	138	14,380	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	7.49	244	25,363	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	17.5	153	15,939	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3.53	458	47,593	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11月30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	
UGI CORP	20.85	77	8,049	公益事業
CUMMINS INC	17.63	403	41,948	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	99.82	779	81,033	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	17.92	236	24,617	情報技術
SIGNATURE BANK	7.69	88	9,203	金融
COSTAR GROUP INC	4.92	435	45,204	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	6.9	244	25,361	金融
AMERCO	0.7	28	2,963	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	12.39	250	26,000	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	6.03	912	94,809	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	132	13,721	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	38.01	396	41,230	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	2.5	50	5,285	情報技術
DEXCOM INC	11.88	378	39,273	ヘルスケア
NORDSON CORP	7.5	153	15,923	資本財・サービス
COPART INC	24.95	287	29,863	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	15.91	69	7,193	エネルギー
SEAGEN INC	15.45	261	27,145	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	9.63	457	47,571	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	6.98	412	42,895	資本財・サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	12.03	114	11,943	ヘルスケア
NIELSEN HOLDINGS PLC	43.47	70	7,334	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	278.51	410	42,678	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	32.61	499	51,851	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	5.44	290	30,173	金融
CABOT OIL & GAS CORP	46.08	81	8,506	エネルギー
T-MOBILE US INC	72.44	955	99,265	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	17.86	192	20,048	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	514.9	2,713	281,907	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	25.75	113	11,760	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.46	173	17,985	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	38.51	85	8,909	金融
CSX CORP	94.51	862	89,634	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11.66	233	24,227	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	15.63	193	20,091	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	8	73	7,592	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	53.52	17,101	1,776,670	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	81.09	691	71,826	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	529.46	2,127	221,067	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	16.13	63	6,557	情報技術
AES CORP	83.41	175	18,232	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	5.71	133	13,848	金融
EOG RESOURCES INC	76.55	393	40,901	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	19.14	199	20,743	情報技術
ABIOMED INC	5.55	150	15,677	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	19.89	205	21,324	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	36.83	420	43,653	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	475.97	432	44,948	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	15.21	41	4,342	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	17.21	203	21,131	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	54	5,692	コミュニケーション・サービス

銘柄	2020年11月30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 BROADBAND-A	5.95	93	9,713	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	45.54	111	11,614	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	18.24	70	7,325	資本財・サービス
FORTINET INC	15.95	197	20,512	情報技術
MARKEL CORP	1.77	177	18,467	金融
NEXTERA ENERGY INC	243.24	1,827	189,855	公益事業
MASIMO CORP	6.93	176	18,316	ヘルスケア
FREEMPORT-MCMORAN INC	197.64	464	48,293	素材
INSULET CORP	7.69	193	20,091	ヘルスケア
US BANCORP	180.05	796	82,696	金融
UNITED RENTALS INC	10.55	245	25,527	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	11.11	182	18,992	情報技術
FASTENAL CO	79.24	384	39,992	資本財・サービス
FISERV INC	73.39	847	88,085	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	1,169.58	1,216	126,367	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	165.43	745	77,442	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	32.11	488	50,725	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	41.76	983	102,127	金融
ALPHABET INC-CL A	36.37	6,499	675,221	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	39.68	7,115	739,216	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	17.63	130	13,608	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	78.49	471	49,031	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	76.12	203	21,130	公益事業
GENUINE PARTS CO	17.7	174	18,086	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	44.17	408	42,483	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	8.1	212	22,114	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	27.79	540	56,145	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	102.3	179	18,662	エネルギー
HOME DEPOT INC	135.34	3,735	388,054	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	8.4	112	11,675	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	166.84	207	21,596	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5	82	8,546	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	17.25	255	26,532	生活必需品
HUMANA INC	17.33	704	73,185	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	36.71	583	60,616	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9.17	268	27,888	情報技術
HENRY SCHEIN INC	18.7	119	12,371	ヘルスケア
HP INC	174.43	388	40,356	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	200.5	224	23,371	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	13.95	58	6,120	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	27.62	117	12,220	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20.28	85	8,861	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	50.11	165	17,195	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	83.9	275	28,624	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	110.82	1,378	143,165	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	205	21,312	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	127	13,247	資本財・サービス
ZOETIS INC	60.03	969	100,701	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	32.74	469	48,809	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	24.84	146	15,168	エネルギー
ALLEGION PLC	11.1	126	13,178	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11月30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 GLOBAL PLC- C	51.08	111	11,579	コミュニケーション・サービス	
WASTE CONNECTIONS INC	34.31	358	37,205	資本財・サービス	
JUNIPER NETWORKS INC	49.12	109	11,333	情報技術	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	8.64	120	12,490	ヘルスケア	
JM SMUCKER CO/THE	13.93	162	16,859	生活必需品	
JOHNSON & JOHNSON	332.56	4,788	497,515	ヘルスケア	
ABBVIE INC	223.87	2,348	243,951	ヘルスケア	
HOLOGIC INC	30.42	211	21,967	ヘルスケア	
KIMBERLY-CLARK CORP	44.29	626	65,048	生活必需品	
KROGER CO	100.13	324	33,735	生活必需品	
KLA CORP	19.19	487	50,664	情報技術	
LOCKHEED MARTIN CORP	31.47	1,178	122,387	資本財・サービス	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	9.76	261	27,133	情報技術	
LOWE'S COS INC	94.68	1,464	152,138	一般消費財・サービス	
ELI LILLY & CO	109.21	1,610	167,282	ヘルスケア	
LAM RESEARCH CORP	17.56	801	83,286	情報技術	
JONES LANG LASALLE INC	5.87	78	8,169	不動産	
LOEWS CORP	35.91	155	16,194	金融	
LINCOLN NATIONAL CORP	26.43	129	13,498	金融	
MCDONALD'S CORP	94.58	2,064	214,529	一般消費財・サービス	
3M CO	72.16	1,276	132,609	資本財・サービス	
FACEBOOK INC-CLASS A	303.64	8,435	876,356	コミュニケーション・サービス	
S&P GLOBAL INC	29.23	998	103,724	金融	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7.67	207	21,595	素材	
CONCHO RESOURCES INC	25.52	158	16,443	エネルギー	
PHILLIPS 66	51.07	333	34,608	エネルギー	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	56.59	161	16,826	一般消費財・サービス	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	14.96	278	28,982	生活必需品	
METLIFE INC	90.65	430	44,686	金融	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	86.17	388	40,383	情報技術	
ARISTA NETWORKS INC	5.93	161	16,791	情報技術	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	24.19	111	11,540	金融	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22.32	387	40,222	情報技術	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.84	319	33,242	ヘルスケア	
BAKER HUGHES CO	84.46	167	17,356	エネルギー	
ROCKWELL AUTOMATION INC	14.6	373	38,819	資本財・サービス	
MERCK & CO. INC.	318.87	2,546	264,555	ヘルスケア	
DUPONT DE NEMOURS INC	91.81	592	61,559	素材	
MASCO CORP	35.43	192	19,964	資本財・サービス	
M & T BANK CORP	19.84	240	24,936	金融	
MARSH & MCLENNAN COS	64.53	737	76,667	金融	
BLACK KNIGHT INC	16.44	148	15,462	情報技術	
HEICO CORP-CLASS A	10.18	115	12,027	資本財・サービス	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	33.61	431	44,816	一般消費財・サービス	
WORKDAY INC-CLASS A	21.23	475	49,374	情報技術	
WAYFAIR INC- CLASS A	8.8	229	23,832	一般消費財・サービス	
SQUARE INC - A	44.6	947	98,471	情報技術	
TRANSUNION	22.93	212	22,118	資本財・サービス	
VISTRA CORP	42.85	83	8,720	公益事業	
BEIGENE LTD-ADR	3.5	100	10,395	ヘルスケア	
NETAPP INC	27.03	143	14,956	情報技術	

銘柄	2020年11月30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		
NIKE INC -CL B	155.47	2,087	216,837	一般消費財・サービス	
NORFOLK SOUTHERN CORP	33.43	811	84,297	資本財・サービス	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	34.92	464	48,253	情報技術	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17.49	162	16,845	金融	
ALLY FINANCIAL INC	50.94	156	16,231	金融	
NORTHROP GRUMMAN CORP	20.25	619	64,381	資本財・サービス	
APTIV PLC	32.32	393	40,917	一般消費財・サービス	
NEWMONT CORP	104.13	608	63,264	素材	
MCKESSON CORP	21.61	388	40,411	ヘルスケア	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	32.57	268	27,885	情報技術	
XYLEM INC	19.72	191	19,901	資本財・サービス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	196.39	1,490	154,858	生活必需品	
NJCORP CORP	36.92	203	21,122	素材	
SUNRUN INC	15.18	100	10,401	資本財・サービス	
WESTERN UNION CO	68.11	153	15,935	情報技術	
GODADDY INC - CLASS A	19.3	153	15,940	情報技術	
NEWELL BRANDS INC	40.58	85	8,882	一般消費財・サービス	
EVERGY INC	32.43	180	18,789	公益事業	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	102.38	169	17,613	エネルギー	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	60	6,332	金融	
OKTA INC	13.76	324	33,742	情報技術	
COUPA SOFTWARE INC	8.8	287	29,889	情報技術	
LIBERTY BROADBAND-C	8.84	139	14,507	コミュニケーション・サービス	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	48.77	152	15,868	ヘルスケア	
LINDE PLC	65.58	1,688	175,389	素材	
WUX.COM LTD	7.85	203	21,091	情報技術	
EQUITABLE HOLDINGS INC	61.84	160	16,703	金融	
KKR & CO INC	64.89	251	26,096	金融	
PAYCHEX INC	46	429	44,620	情報技術	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9.16	405	42,171	一般消費財・サービス	
ALTRIA GROUP INC	232.79	939	97,633	生活必需品	
P G & E CORP	155.15	197	20,518	公益事業	
PFIZER INC	702.37	2,614	271,664	ヘルスケア	
CIGNA CORP	46.3	983	102,214	ヘルスケア	
DELL TECHNOLOGIES -C	32.76	228	23,762	情報技術	
ALTICE USA INC- A	41.47	142	14,790	コミュニケーション・サービス	
XCEL ENERGY INC	65.28	441	45,859	公益事業	
STERIS PLC	8.97	171	17,863	ヘルスケア	
FOX CORP - CLASS B	15.3	43	4,566	コミュニケーション・サービス	
FOX CORP - CLASS A	52.67	153	15,956	コミュニケーション・サービス	
STROYKER CORP	44.82	1,043	108,404	ヘルスケア	
DOW INC	96.64	535	55,621	素材	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	15.08	90	9,370	金融	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	19.79	933	96,962	情報技術	
PARKER HANNIFIN CORP	18.39	501	52,129	資本財・サービス	
UBER TECHNOLOGIES INC	116.86	592	61,577	資本財・サービス	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	22.03	242	25,191	エネルギー	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	310.59	4,305	447,255	生活必需品	
EXELON CORP	118.82	495	51,524	公益事業	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	26.52	328	34,117	ヘルスケア	
TELADOC HEALTH INC	9.05	177	18,470	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11月30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	
INGERSOLL-RAND INC	53.97	241	25,119	資本財・サービス
NVR INC	0.45	185	19,262	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	141.85	606	63,044	エネルギー
TWILIO INC - A	15.26	486	50,580	情報技術
DOCUSIGN INC	22.52	510	53,078	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	6.01	250	26,022	情報技術
PEPSICO INC	174.34	2,520	261,902	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4.09	46	4,809	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	23.92	46	4,855	情報技術
MONGODB INC	6.1	164	17,111	情報技術
SNAP INC - A	116.75	537	55,830	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	85.3	327	34,038	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	53.88	420	43,711	金融
AMCOR PLC	174.57	200	20,820	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	19.1	288	29,929	情報技術
ROKU INC	14.88	409	42,564	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20.92	321	33,411	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	79.88	1,997	207,567	情報技術
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	58.76	238	24,827	情報技術
PENTAIR PLC	15.75	83	8,688	資本財・サービス
QUALCOMM INC	142.14	2,044	212,392	情報技術
INVESCO LTD	37	62	6,538	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	8.19	122	12,756	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31.93	164	17,050	金融
DATADOG INC - CLASS A	18.25	175	18,281	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	52	362	37,664	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	12.57	212	22,073	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	13.27	682	70,867	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	26.67	258	26,887	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	5.01	1,028	106,839	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	48.88	535	55,625	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	9.98	132	13,765	素材
RESMED INC	19.83	415	43,188	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	18.12	226	23,493	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	14.99	98	10,201	資本財・サービス
MODERNA INC	33.62	427	44,368	ヘルスケア
RALPH LAUREN CORP	4	35	3,656	一般消費財・サービス
PERKINELMER INC	11.63	150	15,617	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	97.33	368	38,232	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	48.66	327	34,042	資本財・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	23	100	10,482	金融
AVANTOR INC	56	147	15,330	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	31.23	89	9,288	金融
DYNATRACE INC	23.39	89	9,336	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	5.4	471	48,981	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	153.5	239	24,909	金融
IAC/INTERACTIVECORP	10.21	145	15,113	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	31.62	441	45,868	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	234.68	2,142	222,622	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A	25.9	282	29,323	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	8.82	132	13,720	情報技術

銘柄	2020年11月30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	313	32,518	公益事業
TESLA INC	95.58	5,598	581,648	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3.63	119	12,399	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	79.44	143	14,946	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	22	412	42,902	資本財・サービス
SYNOPLYS INC	20.31	457	47,563	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	18.26	1,173	121,941	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	137.45	234	24,346	ヘルスケア
CBRE GROUP INC - A	38.49	235	24,444	不動産
TWITTER INC	105.16	489	50,899	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	139.16	844	87,683	公益事業
SYSCO CORP	61.6	438	45,590	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	29.58	397	41,314	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	19.25	107	11,121	金融
STEEL DYNAMICS INC	23	86	8,996	素材
SCHLUMBERGER LTD	178.99	391	40,686	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	102	10,639	資本財・サービス
AT&T INC	897.21	2,604	270,591	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	17.58	83	8,717	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	44.52	127	13,251	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10.19	749	77,895	素材
SEMPRA ENERGY	39.15	510	53,061	公益事業
TIFFANY & CO	10.86	143	14,861	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	26.06	152	15,832	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	114.44	1,819	189,025	情報技術
SALESFORCE.COM INC	114.15	2,826	293,665	情報技術
WESTROCK CO	26.18	115	11,983	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	99.06	455	47,309	資本財・サービス
TERADYNE INC	20.96	229	23,822	情報技術
UNION PACIFIC CORP	85.02	1,748	181,636	資本財・サービス
MARATHON PETROLEUM CORP	81.28	336	34,975	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	190.09	1,404	145,960	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	87.73	1,481	153,930	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	24.35	411	42,704	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	18	106	11,094	金融
AMEREN CORPORATION	28.61	225	23,478	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	119.3	4,031	418,845	ヘルスケア
VERISIGN INC	13.65	273	28,435	情報技術
VALERO ENERGY CORP	58.84	333	34,611	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	6.35	178	18,556	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	109	11,425	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9.92	131	13,615	ヘルスケア
ANTHEM INC	32.54	1,017	105,744	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	228.95	3,368	349,957	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	483.84	1,377	143,057	金融
WASTE MANAGEMENT INC	55.07	656	68,191	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	171.23	367	38,175	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	15.91	221	23,036	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	8.7	174	18,163	一般消費財・サービス
WALMART INC	178.52	2,706	281,164	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	24.92	373	38,839	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11月30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	
WYNN RESORTS LTD	11.45	115	12,040	一般消費財・サービス
WABTEC CORP	18.98	140	14,556	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	149.98	948	98,505	一般消費財・サービス
WATERS CORP	7.6	173	18,023	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5.55	209	21,737	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	86.95	339	35,229	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	18.68	391	40,666	金融
WESTERN DIGITAL CORP	35.31	161	16,819	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	41.89	401	41,665	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	68.77	408	42,402	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	212.64	4,486	466,123	情報技術
PPL CORP	101.94	296	30,829	公益事業
PULTEGROUP INC	35.56	157	16,388	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	32.34	477	49,651	素材
NORTHERN TRUST CORP	22.6	217	22,572	金融
NVIDIA CORP	77.62	4,117	427,751	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	51.6	721	74,937	金融
HD SUPPLY HOLDINGS INC	24.82	138	14,390	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	33.22	215	22,432	生活必需品
NETFLIX INC	55.58	2,730	283,721	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	49.85	2,260	234,812	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	30	97	10,132	公益事業
GLOBE LIFE INC	12.15	116	12,120	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	19.53	254	26,445	金融
TEXTRON INC	28.31	132	13,785	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	37.49	66	6,879	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	24.52	82	8,571	公益事業
OMNICOM GROUP	25.46	160	16,663	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	257.94	1,489	154,781	情報技術
MASTERCARD INC - A	112.66	3,819	396,855	情報技術
ONEOK INC	45.66	169	17,660	エネルギー
CENTURYLINK INC	110.62	115	12,020	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	12.69	531	55,213	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	41.58	445	46,299	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	14.13	249	25,896	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	33.74	157	16,404	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	980.93	2,843	295,433	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	4.18	161	16,772	資本財・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	29.08	233	24,289	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	88.35	1,065	110,685	金融
ANALOG DEVICES INC	48.3	665	69,121	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	146.31	1,275	132,530	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	100.84	400	41,601	金融
SKYWORX SOLUTIONS INC	22.83	310	32,294	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	21.47	174	18,174	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	11.31	169	17,660	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	65.6	514	53,437	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	78.46	613	63,709	資本財・サービス
AOI PLC-CLASS A	30.57	631	65,608	金融
AMGEN INC	73.75	1,657	172,246	ヘルスケア
EATON CORP PLC	50.56	616	64,030	資本財・サービス

銘柄	2020年11月30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	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	21.81	446	46,406	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	119.64	988	102,741	情報技術
CME GROUP INC	45.88	801	83,303	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	33.89	44	4,629	エネルギー
ECOLAB INC	33.15	745	77,423	素材
EIFIX INC	17.25	292	30,378	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	158.31	950	98,730	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	45.94	141	14,680	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	33.15	156	16,255	生活必需品
STATE STREET CORP	41.52	297	30,880	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	187.78	933	96,957	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	65.68	498	51,838	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	21.66	106	11,021	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	15.97	152	15,854	素材
CARDINAL HEALTH INC	33.19	178	18,543	ヘルスケア
FEDEX CORP	31.93	917	95,339	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	54.87	481	50,027	金融
FMC CORP	13.6	157	16,343	素材
CERNER CORP	41.33	306	31,816	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11.63	131	13,637	素材
CITRIX SYSTEMS INC	14.12	172	17,961	情報技術
INTEL CORP	534.49	2,536	263,481	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	52.31	119	12,390	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	48.66	223	23,168	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	40.4	857	89,076	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	15.3	100	10,411	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	17.87	566	58,857	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	14.5	64	6,708	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	15.22	1,110	115,399	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	13.3	159	16,542	情報技術
SNAP-ON INC	5	88	9,194	資本財・サービス
CARMAX INC	19.9	189	19,716	一般消費財・サービス
COMERICA INC	12.71	65	6,798	金融
INGREDION INC	5.3	42	4,402	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	89.87	850	88,324	公益事業
TARGET CORP	64.74	1,163	120,910	一般消費財・サービス
DOVER CORP	17.13	212	22,046	資本財・サービス
VW GRAINGER INC	5.88	243	25,325	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17.5	185	19,246	資本財・サービス
CINTAS CORP	11.62	419	43,590	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	55.67	200	20,786	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	15	109	11,405	生活必需品
CLOROX COMPANY	16.28	330	34,349	生活必需品
ENTERGY CORP	22.43	250	25,984	公益事業
MICROSOFT CORP	908.49	19,553	2,031,405	情報技術
INCYTE CORP	26.89	223	23,256	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	160.17	1,087	112,936	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	169.39	1,941	201,654	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	146.66	941	97,864	情報技術
BLACKROCK INC	19.59	1,400	145,539	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	56.36	135	14,093	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11月30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	
HASBRO INC	14.49	133	13,897	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	36.9	234	24,335	生活必需品
KEYCORP	117.82	192	19,988	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	11.76	222	23,152	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	183.59	1,054	109,594	生活必需品
COOPER COS INC/THE	6.47	220	22,901	ヘルスケア
CHUBB LTD	58.31	882	91,727	金融
ARROW ELECTRONICS INC	10	93	9,662	情報技術
ALLSTATE CORP	39.99	416	43,265	金融
EBAY INC	93.21	478	49,715	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	141.1	2,982	309,874	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	14.92	149	15,484	素材
XILINX INC	28.92	397	41,308	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	29.84	107	11,132	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA	19	74	7,789	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	27.83	684	71,107	生活必需品
TRIMBLE INC	29.38	177	18,451	情報技術
LENNAR CORP-A	33.94	263	27,400	一般消費財・サービス
LEAR CORP	6	87	9,138	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	73.91	653	67,901	金融
PACCAR INC	48.25	423	43,981	資本財・サービス
BIOMGEN INC	19.48	474	49,335	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	10.24	465	48,322	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	148.28	1,462	151,983	一般消費財・サービス
PTC INC	12	130	13,540	情報技術
PERRIGO CO PLC	19.29	92	9,625	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	42.9	377	39,189	公益事業
INTUIT INC	34.01	1,204	125,163	情報技術
BORGWARNER INC	30.81	121	12,643	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	29.87	336	34,951	一般消費財・サービス
BALL CORP	38.6	371	38,641	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	184.24	619	64,312	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	36.77	456	47,433	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	16.06	228	23,747	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	32.07	727	75,534	ヘルスケア
VF CORP	42.16	361	37,545	一般消費財・サービス
VIACOMCBS INC - CLASS B	72.02	252	26,236	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	9.42	122	12,776	一般消費財・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10.03	174	18,120	ヘルスケア
CARNIVAL CORP	49.92	107	11,191	一般消費財・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	574.77	2,974	309,014	コミュニケーション・サービス
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	21	50	5,214	資本財・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	36	190	19,784	資本財・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	56	22	2,379	生活必需品
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	231	97	10,127	不動産
アメリカ・ドル 通貨計	株数、金額 計	39,467.48 591銘柄	41,761,923 <66.8%>	
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル	千円	
IMPERIAL OIL LTD	23	55	4,455	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2.5	405	32,386	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	37.21	282	22,588	一般消費財・サービス

銘柄	2020年11月30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	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	63	321	25,692	素材
INTACT FINANCIAL CORP	17	244	19,530	金融
BCE INC	9	51	4,103	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	22	372	29,804	素材
SUNCOR ENERGY INC	218.12	488	39,080	エネルギー
METRO INC/CN	30	180	14,405	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	39.41	289	23,152	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	150.75	978	78,208	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	57	633	50,648	金融
TORONTO-DOMINION BANK	230.3	1,632	130,544	金融
GREAT-WEST LIFE CO INC	39	118	9,513	金融
ROYAL BANK OF CANADA	182.32	1,971	157,659	金融
TC ENERGY CORP	113.04	670	53,601	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	63.75	217	17,364	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	218.48	643	51,441	素材
CAE INC	23	76	6,154	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	22.84	236	18,936	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	18	64	5,131	生活必需品
CCL INDUSTRIES INC - CL B	15.6	93	7,482	素材
HYDRO ONE LTD	48	142	11,386	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	24.89	160	12,795	生活必需品
WSP GLOBAL INC	12	114	9,175	資本財・サービス
PARKLAND CORP	28	110	8,862	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	23	75	6,059	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	27.31	148	11,884	公益事業
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	32	2,623	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	56	341	27,266	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	29	244	19,519	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	70	143	11,439	公益事業
B2GOLD CORP	164	115	9,217	素材
AIR CANADA	17	42	3,378	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	147.57	137	11,007	素材
BANK OF MONTREAL	82	793	63,441	金融
POWER CORP OF CANADA	63	187	14,954	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	13.55	1,819	145,490	情報技術
NUTRIEN LTD	80.27	516	41,265	素材
CANOPY GROWTH CORP	20	75	5,996	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	34	36	2,946	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	31.93	166	13,279	素材
CAMECO CORP	28	37	2,961	エネルギー
TELUS CORP	6	15	1,210	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	44	91	7,341	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	7.43	123	9,876	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	152	476	38,122	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3	133	10,678	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	31	248	19,835	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	9.01	87	7,023	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	24	91	7,322	素材
BLACKBERRY LTD	64	51	4,088	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	72.66	430	34,378	金融
ENBRIDGE INC	267	1,113	88,994	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11月30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		
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	180	959	76,689	金融	
MANULIFE FINANCIAL CORP	266	596	47,679	金融	
BAUSCH HEALTH COS INC	43	108	8,704	ヘルスケア	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	18	759	60,701	資本財・サービス	
IA FINANCIAL CORP INC	11	64	5,142	金融	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	28	97	7,819	一般消費財・サービス	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	87.93	1,244	99,530	資本財・サービス	
CGI INC - CLASS A	28	273	21,866	情報技術	
ONEX CORPORATION	16	114	9,120	金融	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	68	154	12,330	コミュニケーション・サービス	
IGM FINANCIAL INC	3	10	837	金融	
TMX GROUP LTD	7.94	100	8,019	金融	
OPEN TEXT CORP	45	261	20,935	情報技術	
CI FINANCIAL CORP	20	34	2,790	金融	
SAPUTO INC	29	104	8,349	生活必需品	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63	113	9,086	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	100.13	430	34,423	生活必需品	
YAMANA GOLD INC	119	79	6,336	素材	
FORTIS INC	62	328	26,241	公益事業	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	13.55	120	9,607	資本財・サービス	
LUNDIN MINING CORP	66	68	5,445	素材	
CENOVUS ENERGY INC	141	98	7,845	エネルギー	
DOLLARAMA INC	35.29	186	14,877	一般消費財・サービス	
ATCO LTD -CLASS I	8	31	2,537	公益事業	
ALTAGAS LTD	47	89	7,165	公益事業	
KEYERA CORP	22	51	4,126	エネルギー	
INTER PIPELINE LTD	48	64	5,184	エネルギー	
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,860.78 81銘柄	24,879 < 3.2%>	1,989,104 < 3.2%>	
(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	65	5,073	金融	
BHP GROUP LTD	365.48	1,415	108,838	素材	
SOUTH32 LTD	563.87	138	10,668	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	156.53	355	27,364	エネルギー	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	205.54	381	29,355	素材	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	421.03	981	75,513	金融	
WESTPAC BANKING CORP	442.7	904	69,560	金融	
SANTOS LTD	182.7	114	8,782	エネルギー	
AUSNET SERVICES	285	53	4,076	公益事業	
AUST AND NZ BANKING GROUP	351.9	812	62,492	金融	
RIO TINTO LTD	41.69	425	32,705	素材	
ORIGIN ENERGY LTD	209.68	108	8,369	エネルギー	
AURIZON HOLDINGS LTD	290.47	124	9,606	資本財・サービス	
WASHINGTON H. SOUL PATINSON	9.53	27	2,148	エネルギー	
COLES GROUP LTD	166.96	299	23,036	生活必需品	
WISETECH GLOBAL LTD	25.09	75	5,779	情報技術	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	81.83	105	8,087	素材	
EVOLUTION MINING LTD	170.17	86	6,674	素材	
AFTERPAY LTD	30	284	21,850	情報技術	
TPG TELECOM LTD	50	38	2,987	コミュニケーション・サービス	
OIL SEARCH LTD	173.45	63	4,869	エネルギー	

銘柄	2020年11月30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		
SEEK LTD	26	67	5,211	コミュニケーション・サービス	
TREASURY WINE ESTATES LTD	101.73	93	7,221	生活必需品	
NEWCREST MINING LTD	119.81	324	24,962	素材	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	218.56	1,763	135,669	金融	
AMPOL LTD	20	61	4,711	エネルギー	
ORICA LTD	58.45	98	7,588	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	153.48	157	12,122	金融	
CIMIC GROUP LTD	10	25	1,965	資本財・サービス	
WOOLWORTHS GROUP LTD	169.8	637	49,050	生活必需品	
COCA-COLA AMATIL LTD	26	32	2,529	生活必需品	
TABCORP HOLDINGS LTD	173.52	68	5,244	一般消費財・サービス	
CROWN RESORTS LTD	30	29	2,295	一般消費財・サービス	
QANTAS AIRWAYS LTD	63.73	35	2,705	資本財・サービス	
TELSTRA CORP LTD	351.14	109	8,398	コミュニケーション・サービス	
AMP LTD	249.35	43	3,336	金融	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	67.33	262	20,205	素材	
MACQUARIE GROUP LTD	42.77	588	45,226	金融	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	61.63	204	15,727	一般消費財・サービス	
CSL LTD	55.5	1,681	129,335	ヘルスケア	
WESFARMERS LTD	137.98	688	52,943	一般消費財・サービス	
COCHLEAR LTD	8.05	178	13,757	ヘルスケア	
BLUESCOPE STEEL LTD	70.92	122	9,436	素材	
SUNCORP GROUP LTD	145.04	147	11,355	金融	
ASX LTD	22.6	174	13,425	金融	
COMPUTERSHARE LTD	60.54	86	6,616	情報技術	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	144	11,087	金融	
SONIC HEALTHCARE LTD	52.23	173	13,360	ヘルスケア	
AGL ENERGY LTD	84.66	116	8,933	公益事業	
BRAMBLES LTD	183.37	203	15,654	資本財・サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20.64	131	10,108	ヘルスケア	
REA GROUP LTD	6.08	85	6,610	コミュニケーション・サービス	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	15.51	94	7,274	金融	
オーストラリア・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	7,529.25 53銘柄	15,497 < 1.9%>	1,191,912 < 1.9%>	
(香港)	百株	千香港ドル	千円		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	235	968	12,973	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	230	1,420	19,031	一般消費財・サービス	
MTR CORP	165	707	9,474	資本財・サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	190	2,000	26,809	不動産	
SINO LAND CO	340	357	4,783	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	375.52	2,159	28,933	資本財・サービス	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	8	372	4,984	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	170	1,241	16,629	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	205.65	664	8,900	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	1,638.36	1,982	26,564	公益事業	
HANG SENG BANK LTD	8	1,100	14,750	金融	
NEW WORLD DEVELOPMENT	175	724	9,708	不動産	
WH GROUP LTD	1,695	1,111	14,899	生活必需品	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	149	5,754	77,108	金融	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	370	741	9,940	不動産	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	30	278	3,734	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	2020年11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千香港ドル	千円		
KERRY PROPERTIES LTD	75	150	2,010	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	86	141	1,894	金融	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	30	104	1,394	ヘルスケア	
SJM HOLDINGS LTD	100	91	1,220	一般消費財・サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	80	188	2,524	不動産	
CK ASSET HOLDINGS LTD	285.52	1,249	16,738	不動産	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	220	2,951	公益事業	
PCCW LTD	600	280	3,754	コミュニケーション・サービス	
AIA GROUP LTD	1,594	14,106	189,032	金融	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	200	753	10,090	不動産	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	192	532	7,139	生活必需品	
SANDS CHINA LTD	290	959	12,862	一般消費財・サービス	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	190	1,922	25,765	資本財・サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	450	1,134	15,195	金融	
WYNNJ MACAU LTD	168	230	3,088	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>	10,524.05 31銘柄	43,648 584,893 < 0.9%>		
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円		
UNITED OVERSEAS BANK LTD	179	412	32,068	金融	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	233	598	46,485	金融	
SINGAPORE AIRLINES LTD	177.5	80	6,219	資本財・サービス	
KEPPEL CORP LTD	173	90	7,042	資本財・サービス	
UOL GROUP LTD	30	22	1,759	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	40	3,179	不動産	
CAPITALAND LTD	334	104	8,147	不動産	
YANGZHUANG SHIPBUILDING	270	24	1,929	資本財・サービス	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9	18	1,468	一般消費財・サービス	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	447	453	35,248	金融	
GENTING SINGAPORE LTD	450	38	2,954	一般消費財・サービス	
VENTURE CORP LTD	32	61	4,765	情報技術	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,284	310	24,140	コミュニケーション・サービス	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	56	4,403	資本財・サービス	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	168	154	12,033	金融	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	67	5,265	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>	4,137.5 16銘柄	2,537 197,113 < 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	92	6,777	公益事業	
MERCURY NZ LTD	32.94	19	1,444	公益事業	
A2 MILK CO LTD	70	102	7,507	生活必需品	
SPARK NEW ZEALAND LTD	168.6	78	5,731	コミュニケーション・サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	132.89	101	7,437	資本財・サービス	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	92	312	22,835	ヘルスケア	
RYMAN HEALTHCARE LTD	44.19	66	4,846	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>	690.62 7銘柄	773 56,580 < 0.1%>		
(イギリス)	百株	千イギリス・ポンド	千円		
BP PLC	2,510.81	660	91,455	エネルギー	
UNILEVER PLC	151.43	694	96,217	生活必需品	
BARCLAYS PLC	2,413.6	336	46,649	金融	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	768.95	82	11,468	資本財・サービス	

銘柄	2020年11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千イギリス・ポンド	千円		
PRUDENTIAL PLC	314.21	380	52,762	金融	
NATWEST GROUP PLC	508.36	81	11,315	金融	
EVRAZ PLC	74.41	29	4,043	素材	
JOHNSON MATTHEY PLC	17.58	39	5,477	素材	
BAE SYSTEMS PLC	377.96	190	26,403	資本財・サービス	
AVIVA PLC	510.81	165	22,937	金融	
AVEVA GROUP PLC	11.4	38	5,330	情報技術	
GLAXOSMITHKLINE PLC	629.03	870	120,583	ヘルスケア	
INFORMA PLC	162	87	12,142	コミュニケーション・サービス	
MELROSE INDUSTRIES PLC	643.35	102	14,199	資本財・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	144.99	79	11,012	コミュニケーション・サービス	
DCC PLC	9.38	53	7,389	資本財・サービス	
OCADO GROUP PLC	62.34	138	19,157	一般消費財・サービス	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7.4	80	11,124	資本財・サービス	
HALMA PLC	39.78	88	12,235	情報技術	
GVC HOLDINGS PLC	88.05	91	12,717	一般消費財・サービス	
JD SPORTS FASHION PLC	64.11	47	6,512	一般消費財・サービス	
M&G PLC	259.64	50	6,958	金融	
RELX PLC	242.03	421	58,414	資本財・サービス	
DIAGEO PLC	293.51	860	119,272	生活必需品	
RIO TINTO PLC	145.2	714	99,028	素材	
STANDARD CHARTERED PLC	319.51	148	20,527	金融	
TESCO PLC	1,344.91	306	42,447	生活必需品	
SMITH & NEPHEW PLC	112.97	164	22,734	ヘルスケア	
GLENCORE PLC	1,292.26	275	38,234	素材	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	45	6,355	金融	
SMITHS GROUP PLC	40.8	59	8,295	資本財・サービス	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	168.79	50	6,947	金融	
PEARSON PLC	82.71	53	7,448	コミュニケーション・サービス	
SAINSBURY (J) PLC	176.31	38	5,288	生活必需品	
NEXT PLC	16.85	109	15,216	一般消費財・サービス	
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	50	7,021	一般消費財・サービス	
WHITBREAD PLC	17.85	56	7,819	一般消費財・サービス	
BUNZL PLC	31.59	73	10,136	資本財・サービス	
VODAFONE GROUP PLC	3,591.29	448	62,146	コミュニケーション・サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	17.49	104	14,418	素材	
KINGFISHER PLC	172.29	46	6,466	一般消費財・サービス	
WPP PLC	130.21	97	13,519	コミュニケーション・サービス	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	74	10,270	公益事業	
SEVERN TRENT PLC	43	102	14,226	公益事業	
RENTOKIL INITIAL PLC	222.42	109	15,124	資本財・サービス	
REKITT BENCKISER GROUP PLC	91.11	593	82,253	生活必需品	
ST JAMES'S PLACE PLC	48.83	49	6,897	金融	
SCHRODERS PLC	12.27	39	5,497	金融	
SSE PLC	124.6	171	23,823	公益事業	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	77	10,778	一般消費財・サービス	
ASTRAZENECA PLC	166.08	1,290	178,790	ヘルスケア	
FERGUSON PLC	27.24	226	31,415	資本財・サービス	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	682.32	174	24,229	金融	
3I GROUP PLC	132.93	143	19,817	金融	
ASHTREAD GROUP PLC	59.21	186	25,841	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11月30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		
SAGE GROUP PLC/THE NATIONAL GRID PLC	115.48	70	9,756	情報技術	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	451.05	394	54,606	公益事業	
RSA INSURANCE GROUP PLC	8,652.13	322	44,707	金融	
IMPERIAL BRANDS PLC	125.86	84	11,760	金融	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	137.85	194	26,987	生活必需品	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	19.63	91	12,741	一般消費財・サービス	
BHP GROUP PLC	286.95	768	106,429	生活必需品	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	269.34	468	64,849	素材	
HSBC HOLDINGS PLC	49.64	105	14,621	生活必需品	
ANGLO AMERICAN PLC	2,560.05	1,036	143,598	金融	
MONDI PLC	146.45	331	45,968	素材	
WM MORRISON SUPERMARKETS	59.21	100	13,859	素材	
COMPASS GROUP PLC	391.67	71	9,963	生活必需品	
PERSIMMON PLC	219.92	311	43,206	一般消費財・サービス	
BT GROUP PLC	49.69	133	18,560	一般消費財・サービス	
COCA-COLA HBC AG-DI	1,317.54	159	22,142	コミュニケーション・サービス	
BURBERRY GROUP PLC	25.74	56	7,785	生活必需品	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	51.36	88	12,250	一般消費財・サービス	
INTERTEK GROUP PLC	21.82	104	14,429	一般消費財・サービス	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	18.97	104	14,460	資本財・サービス	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	37.5	297	41,149	金融	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	495.26	663	91,907	エネルギー	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	482.46	629	87,165	エネルギー	
ADMIRAL GROUP PLC	20.39	53	7,435	ヘルスケア	
ANTOFAGASTA PLC	15.7	44	6,192	金融	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	34.6	42	5,929	素材	
EXPERIAN PLC	330.46	89	12,407	金融	
	121.19	313	43,404	資本財・サービス	
イギリス・ポンド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	36,644.56 83銘柄	18,888 < 4.2%>	2,617,065	
(イスラエル)	百株	イスラエル・シケル	千円		
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	120	137	4,302	金融	
AZRIELI GROUP LTD	5.3	106	3,343	不動産	
ICL GROUP LTD	110.96	172	5,407	素材	
ELBIT SYSTEMS LTD	3	128	4,018	資本財・サービス	
BANK HAPOALIM BM	151.6	336	10,547	金融	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	190.43	364	11,428	金融	
NICE LTD	8	636	19,962	情報技術	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	38.83	282	8,859	金融	
イスラエル・シケル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	628.12 8銘柄	2,165 < 0.1%>	67,869	
(スイス)	百株	千スイス・フラン	千円		
UBS GROUP AG-REG	464.78	611	70,321	金融	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1.3	106	12,240	素材	
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	94	10,869	資本財・サービス	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	88.76	2,684	308,693	ヘルスケア	
SIKA AG-REG	16.9	389	44,805	素材	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	82	9,427	生活必需品	
ABB LTD-REG	221.39	534	61,469	資本財・サービス	
SWISS RE AG	36.66	306	35,294	金融	
NESTLE SA-REG	375.55	3,841	441,700	生活必需品	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2.34	226	25,999	金融	

銘柄	2020年11月30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		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5.31	132	15,250	資本財・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	301.22	352	40,570	金融	
JULIUS BAER GROUP LTD	26.84	140	16,181	金融	
SGS SA-REG	0.65	168	19,340	資本財・サービス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	4.67	113	12,993	資本財・サービス	
VIFOR PHARMA AG	6.65	88	10,118	ヘルスケア	
TEMENOS AG - REG	7.93	91	10,493	情報技術	
ALCON INC	58.53	338	38,908	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	5	114	13,187	一般消費財・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	17.92	667	76,703	金融	
BALOISE HOLDING AG - REG	6.11	97	11,162	金融	
CLARIANT AG-REG	15.68	28	3,312	素材	
NOVARTIS AG-REG	278.51	2,257	259,556	ヘルスケア	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.56	110	12,696	生活必需品	
CIE FINANCIERE RICHEMOA-REG	67.1	515	59,231	一般消費財・サービス	
SWISSCOM AG-REG	2.76	132	15,266	コミュニケーション・サービス	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	7.84	75	8,644	金融	
GEBERIT AG-REG	4.56	247	28,477	資本財・サービス	
GIVAUDAN-REG	1.13	411	47,328	素材	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1.11	114	13,214	ヘルスケア	
SONOVA HOLDING AG-REG	6.72	150	17,283	ヘルスケア	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	21.65	169	19,504	情報技術	
LONZA GROUP AG-REG	9.13	503	57,921	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	19	2,298	一般消費財・サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	65.87	316	36,403	素材	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3.81	155	17,920	金融	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	6.4	129	14,907	資本財・サービス	
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	77	8,896	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.17	131	15,098	生活必需品	
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,173.02 39銘柄	16,732 < 3.1%>	1,923,693	
(デンマーク)	百株	千デンマーク・クローネ	千円		
NOVO NORDISK A/S-B	236.71	9,924	165,831	ヘルスケア	
DANSKE BANK A/S	72.36	752	12,575	金融	
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.39	449	7,507	資本財・サービス	
H LUNDBECK A/S	5	96	1,620	ヘルスケア	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	25.57	3,155	52,725	資本財・サービス	
GN STORE NORD A/S	11.59	581	9,710	ヘルスケア	
CARLSBERG AS-B	12.32	1,157	19,347	生活必需品	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	29.81	1,071	17,897	素材	
COLOPLAST-B	15.19	1,412	23,600	ヘルスケア	
DSV PANALPINA A/S	27.98	2,855	47,713	資本財・サービス	
DEMANT A/S	13.14	287	4,801	ヘルスケア	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.66	819	13,692	資本財・サービス	
TRYG A/S	17	307	5,144	金融	
PANDORA A/S	16.37	1,062	17,758	一般消費財・サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	12.62	769	12,859	素材	
GENMAB A/S	9.19	2,131	35,611	ヘルスケア	
ORSTED A/S	28.37	3,195	53,403	公益事業	
AMBU A/S-B	20.91	421	7,040	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>	555.18 18銘柄	30,451 < 0.8%>	508,840	

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11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(ノルウェー)	百株	千円			
NORSK HYDRO ASA	130.5	476	5,598	素材	
DNB ASA	128.38	2,099	24,691	金融	
ORKLA ASA	74.83	643	7,571	生活必需品	
TELENOR ASA	87.46	1,341	15,777	コミュニケーション・サービス	
EQUINOR ASA	142.48	2,092	24,605	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	27.56	1,003	11,797	素材	
MOWI ASA	46.77	856	10,073	生活必需品	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	384	4,515	金融	
SCHIBSTED ASA-B SHS	17	581	6,837	コミュニケーション・サービス	
ADEVINTA ASA	45.82	663	7,807	コミュニケーション・サービス	
ノルウェー・クロネ 通貨計	株数、金額 10銘柄	720.8	10,142	119,277	< 0.2% >
(スウェーデン)	百株	千円			
ICA GRUPPEN AB	7	288	3,520	生活必需品	
ERICSSON LM-B SHS	445.95	4,733	57,846	情報技術	
VOLVO AB-B SHS	188.73	3,772	46,102	資本財・サービス	
SKF AB-B SHARES	40	860	10,509	資本財・サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	26	533	6,519	一般消費財・サービス	
SWEDISH MATCH AB	21.88	1,514	18,502	生活必需品	
TELE2 AB-B SHS	70.26	778	9,513	コミュニケーション・サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	217.79	2,034	24,857	金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	241.45	2,130	26,029	金融	
SWEDBANK AB - A SHARES	108.21	1,691	20,670	金融	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	103.52	1,890	23,105	一般消費財・サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	82.01	1,140	13,935	素材	
SKANSKA AB-B SHS	37.09	769	9,404	資本財・サービス	
SANDVIK AB	146.57	2,875	35,141	資本財・サービス	
INVESTOR AB-B SHS	62.9	3,742	45,733	金融	
ATLAS COPCO AB-A SHS	85.75	3,770	46,074	資本財・サービス	
SECURITAS AB-B SHS	25	357	4,365	資本財・サービス	
TELIA CO AB	364.21	1,341	16,387	コミュニケーション・サービス	
ALFA LAVAL AB	48.4	1,075	13,147	資本財・サービス	
ATLAS COPCO AB-B SHS	48.13	1,838	22,467	資本財・サービス	
ASSA ABLOY AB-B	144.49	2,988	36,514	資本財・サービス	
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	424	5,192	金融	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	9.24	203	2,484	資本財・サービス	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	41.79	999	12,210	資本財・サービス	
LUNDIN ENERGY AB	19	408	4,991	エネルギー	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	72.6	1,987	24,281	生活必需品	
BOLIDEN AB	31.71	948	11,586	素材	
EPIROC AB-A	69.82	1,009	12,333	資本財・サービス	
EPIROC AB-B	40.15	551	6,743	資本財・サービス	
HUSQVARNA AB-B SHS	114	1,041	12,724	一般消費財・サービス	
NORDEA BANK ABP	435.48	3,245	39,661	金融	
EQT AB	38.45	734	8,976	金融	
EVOLUTION GAMING GROUP	20.64	1,424	17,408	一般消費財・サービス	
KINNEVIK AB - B	36.41	1,491	18,228	金融	
HEXAGON AB-B SHS	38.68	2,756	33,682	情報技術	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13	343	4,197	金融	
スウェーデン・クロネ 通貨計	株数、金額 36銘柄	3,505.79	57,696	705,050	< 1.1% >

銘柄	2020年11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
ユーロ (アイルランド)	百株	千ユーロ	千円		
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	30.55	108	13,519	素材	
KINGSPAN GROUP PLC	16	115	14,328	資本財・サービス	
KERRY GROUP PLC-A	18.22	212	26,378	生活必需品	
CRH PLC	105.17	359	44,671	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	22.04	339	42,216	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 5銘柄	191.98	1,134	141,115	< 0.2% >
ユーロ (オランダ)	百株	千ユーロ	千円		
QIAGEN N.V.	25.21	102	12,752	ヘルスケア	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	114.2	493	61,404	ヘルスケア	
NN GROUP NV	31	106	13,271	金融	
HEINEKEN NV	37.11	331	41,190	生活必需品	
AEGON NV	380.61	116	14,476	金融	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	138.93	330	41,143	生活必需品	
AKZO NOBEL N.V.	25.04	224	27,918	素材	
KONINKLIJKE DSM NV	22.3	305	37,999	素材	
WOLTERS KLUWER	33	230	28,633	資本財・サービス	
ING GROEP NV	456.01	383	47,734	金融	
KONINKLIJKE KPN NV	376.07	95	11,871	コミュニケーション・サービス	
ASML HOLDING NV	53.27	1,951	242,733	情報技術	
ABN AMRO BANK NV-CVA	90.53	85	10,694	金融	
ADYEN NV	2.15	347	43,214	情報技術	
UNILEVER NV	186.5	937	116,587	生活必需品	
JUST EAT TAKEAWAY	14	123	15,354	一般消費財・サービス	
PROSP NV	59.99	559	69,571	一般消費財・サービス	
VOPAK	6.3	28	3,584	エネルギー	
RANDSTAD NV	20.2	103	12,919	資本財・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	12.85	100	12,514	生活必需品	
ALTICE EUROPE NV	112.95	50	6,321	コミュニケーション・サービス	
STMICROELECTRONICS NV	85.75	284	35,420	情報技術	
AIRBUS SE	74.02	666	82,859	資本財・サービス	
ARGENX SE	5.16	121	15,082	ヘルスケア	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	85	81	10,100	生活必需品	
EXOR NV	10.88	63	7,946	金融	
CNH INDUSTRIAL NV	116.91	107	13,369	資本財・サービス	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	169.37	224	27,862	一般消費財・サービス	
FERRARI NV	17.22	307	38,242	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 29銘柄	2,762.53	8,866	1,102,776	< 1.8% >
ユーロ (ベルギー)	百株	千ユーロ	千円		
GALAPAGOS NV	5.57	58	7,281	ヘルスケア	
UCB SA	19.21	173	21,633	ヘルスケア	
KBC GROUP NV	30.11	179	22,350	金融	
COLRUYT SA	3.5	17	2,140	生活必需品	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11.39	94	11,747	金融	
SOLVAY SA	8.73	84	10,478	素材	
UMICORE	22.7	86	10,816	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	98.76	565	70,324	生活必需品	
AGEAS	16.54	69	8,609	金融	
PROXIMUS	22.69	40	5,078	コミュニケーション・サービス	
TELENOR GROUP HOLDING NV	4.62	16	2,014	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	2020年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
ELIA GROUP SA/NV	百株 7	千ユーロ 66	千円 8,314	公益事業
SOFINA	2.39	62	7,818	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	253.21 13銘柄	1,516 188,608 < 0.3%>	
ユーロ (ルクセンブルグ)	百株	千ユーロ	千円	
AROUNDTOWN SA	160.64	96	11,988	不動産
ARCELORMITTAL	80.31	122	15,277	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	14.8	99	12,427	ヘルスケア
SES	44.02	34	4,325	コミュニケーション・サービス
TENARIS SA	47	31	3,919	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	346.77 5銘柄	385 47,937 < 0.1%>	
ユーロ (フランス)	百株	千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA	8.45	15	1,880	コミュニケーション・サービス
TOTAL SE	307.62	1,159	144,246	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	21.46	232	28,894	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	61.19	845	105,105	素材
KERING	9.77	592	73,664	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	67.45	792	98,533	資本財・サービス
BOUYGUES SA	27.21	91	11,432	資本財・サービス
BNP PARIBAS	134	587	73,042	金融
PEUGEOT SA	64.97	129	16,153	一般消費財・サービス
NATIXIS	76.74	20	2,536	金融
THALES SA	14.04	112	13,945	資本財・サービス
DANONE	75.51	398	49,570	生活必需品
CARREFOUR SA	80.22	110	13,719	生活必需品
SUEZ	29.5	47	5,934	公益事業
VIVENDI	104.3	264	32,938	コミュニケーション・サービス
L'OREAL	32.05	991	123,298	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	69.75	281	34,962	資本財・サービス
LEGRAND SA	41.19	294	36,589	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA	27.44	438	54,505	生活必需品
EURAZEO SE	5.6	29	3,621	金融
SOCIETE GENERALE SA	110.65	191	23,847	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	34.42	1,707	212,345	一般消費財・サービス
ACCOR SA	18.5	55	6,958	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	19.81	237	29,506	情報技術
VALEO SA	37.03	124	15,438	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	29.18	112	13,958	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA	32.27	69	8,645	資本財・サービス
EIFFAGE	9.45	79	9,894	資本財・サービス
SODEXO SA	12.48	91	11,362	一般消費財・サービス
IPSEN	2.76	22	2,746	ヘルスケア
ORPEA	5.24	54	6,833	ヘルスケア
AMUNDI SA	4.37	29	3,687	金融
TELEPERFORMANCE	8.7	239	29,757	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	9.77	77	9,587	コミュニケーション・サービス
FAURECIA	5.6	23	2,975	一般消費財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3.99	117	14,570	ヘルスケア
SEB SA	1.97	29	3,663	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA	38.09	460	57,301	一般消費財・サービス

銘柄	2020年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
DASSAULT AVIATION SA	百株 0.22	千ユーロ 19	千円 2,449	資本財・サービス
WORLDLINE SA	31.35	245	30,516	情報技術
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	22.16	77	9,691	一般消費財・サービス
AXA SA	243.18	479	59,682	金融
EDENRED	30.07	146	18,203	情報技術
RENAULT SA	25.54	87	10,837	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	4.51	371	46,188	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	2.53	37	4,701	生活必需品
ATOS SE	9.46	72	8,984	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SE	16.33	253	31,543	情報技術
WENDEL	2.01	18	2,345	金融
ORANGE	257.92	275	34,293	コミュニケーション・サービス
ALSTOM	29.61	133	16,642	資本財・サービス
CNP ASSURANCES	13.49	18	2,261	金融
SANOFI	142.91	1,217	151,462	ヘルスケア
VINCI SA	69.25	609	75,779	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	73.51	145	18,098	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	146.09	144	17,923	金融
BIOMERIEUX	4.57	54	6,781	ヘルスケア
ENGIE	210.99	264	32,856	公益事業
EDF	67.6	87	10,922	公益事業
SAFRAN SA	43.81	538	67,023	資本財・サービス
ILIAD SA	2.19	38	4,728	コミュニケーション・サービス
ARKEMA	8.38	81	10,160	素材
ADP	3.5	37	4,723	資本財・サービス
SCOR SE	32.89	95	11,871	金融
GETLINK SE	49.73	70	8,801	資本財・サービス
BOLLORE	73	23	2,956	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>	3,259.54 66銘柄	16,804 2,090,091 < 3.3%>	
ユーロ (ドイツ)	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG	125.53	621	77,302	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	18	45	5,628	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	255.58	242	30,148	金融
COMMERZBANK AG	96.89	52	6,497	金融
VOLKSWAGEN AG	4.2	67	8,405	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	22.72	331	41,235	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	94.65	1,066	132,653	資本財・サービス
E.ON SE	300.06	274	34,111	公益事業
UNIPER SE	20.66	57	7,261	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	37.29	272	33,900	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	13	37	4,656	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	14.74	172	21,441	一般消費財・サービス
BASF SE	112.83	687	85,493	素材
ALLIANZ SE-REG	53.92	1,068	132,883	金融
THYSSENKRUPP AG	40.3	22	2,788	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	26.83	241	29,987	生活必需品
RWE AG	75.26	262	32,641	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	17	17	2,129	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	5.6	26	3,269	資本財・サービス
BRENTTAG AG	21.21	135	16,846	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11月30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	
FRESENIUS SE & CO KGAA	48.35	184	22,894	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9.59	32	3,998	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG	1.66	13	1,669	資本財・サービス
SAP SE	130.66	1,308	162,742	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	17.04	401	49,976	金融
ZALANDO SE	20.25	162	20,265	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	21.28	128	16,013	素材
KION GROUP AG	6	42	5,231	資本財・サービス
COVESTRO AG	19.45	92	11,479	素材
SARTORIUS AG-VORZUG	5.13	186	23,225	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	21.02	115	14,379	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	19.79	195	24,368	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	5.6	62	7,766	ヘルスケア
METRO AG	15	11	1,466	生活必需品
NEMETSCHKE SE	11.39	74	9,215	情報技術
SCOUT24 AG	14.6	92	11,449	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	15	57	7,153	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	5.49	59	7,352	資本財・サービス
TEAMVIEWER AG	14.61	57	7,188	情報技術
SIEMENS ENERGY AG	47.32	117	14,667	資本財・サービス
KION GROUP AG-RTS	6	-	-	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	12.75	120	15,049	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE-PREF	7	33	4,201	素材
MERCK KGAA	16.92	225	28,074	ヘルスケア
ADIDAS AG	23.85	646	80,450	一般消費財・サービス
PUMA SE	12.95	106	13,227	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	13.11	105	13,069	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	418.6	634	78,905	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	25.61	181	22,558	ヘルスケア
INFINEON TECHNOLOGIES AG	110.27	624	77,615	一般消費財・サービス
HANNOVER RUECK SE	164.97	488	60,746	情報技術
DEUTSCHE POST AG-REG	6.44	89	11,142	金融
DEUTSCHE BOERSE AG	131.16	532	66,200	資本財・サービス
LANXESS AG	24.04	329	40,979	金融
MTU AERO ENGINES AG	15.29	90	11,311	素材
DEUTSCHE WOHNEN SE	6.66	136	16,931	資本財・サービス
SYMRISE AG	47.96	196	24,457	不動産
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16.56	174	21,699	素材
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	62.4	14	1,858	コミュニケーション・サービス
VONOVIA SE	9	49	6,212	一般消費財・サービス
LEG IMMOBILIEN AG	71.86	406	50,553	不動産
	10.73	126	15,748	不動産
国小計	株数、金額 3,019.63 62銘柄	14,413	1,792,781 < 2.9% >	
ユーロ (ポルトガル)	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	29	41	5,111	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	275.76	126	15,777	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	71.83	68	8,539	エネルギー
国小計	株数、金額 376.59 3銘柄	236	29,428 < 0.0% >	
ユーロ (スペイン)	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA	570.39	213	26,505	コミュニケーション・サービス

銘柄	2020年11月30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	37.6	91	11,359	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	951.66	376	46,849	金融
IBERDROLA SA	720.39	826	102,773	公益事業
BANKINTER SA	67	27	3,478	金融
REPSOL SA	176.85	150	18,666	エネルギー
GRIFOLS SA	51.14	124	15,539	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	2,073.7	511	63,578	金融
AMADEUS IT GROUP SA	54	325	40,527	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA	39.78	79	9,851	公益事業
MAPFRE SA	80.05	12	1,572	金融
CAIXABANK SA	468.59	103	12,839	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	35.83	96	11,952	資本財・サービス
AENA SME SA	8.66	124	15,489	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA	45.46	233	29,085	コミュニケーション・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	142.55	403	50,141	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	17.93	51	6,436	資本財・サービス
ENAGAS SA	36.75	76	9,498	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	51.47	88	10,966	公益事業
FERROVIAL SA	60.55	142	17,781	資本財・サービス
国小計	株数、金額 5,690.35 20銘柄	4,059	504,892 < 0.8% >	
ユーロ (イタリア)	百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA	41.45	111	13,868	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	159.85	231	28,769	金融
MEDIOBANCA SPA	99.71	77	9,586	金融
UNICREDIT SPA	294.71	268	33,334	金融
TELECOM ITALIA SPA	1,085.03	43	5,414	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP	483.81	20	2,579	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO	2,135.25	415	51,645	金融
ATLANTIA SPA	60.27	92	11,446	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	77.27	67	8,457	金融
MONCLER SPA	24.35	99	12,420	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	12.85	58	7,241	ヘルスケア
ENI SPA	360.61	309	38,492	エネルギー
PIRELLI & C SPA	56.51	24	3,053	一般消費財・サービス
DIASORIN SPA	2.77	47	5,953	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	24.14	25	3,224	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA	35.53	56	7,022	情報技術
LEONARDO SPA	66.76	39	4,970	資本財・サービス
ENEL SPA	983.37	836	103,989	公益事業
SNAM SPA	243	114	14,208	公益事業
TERNA SPA	199	126	15,672	公益事業
FINCOBANK SPA	59.72	78	9,741	金融
国小計	株数、金額 6,505.96 21銘柄	3,144	391,095 < 0.6% >	
ユーロ (フィンランド)	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ	65.25	184	22,967	素材
NOKIA OYJ	652.61	223	27,744	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	41.16	33	4,122	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	88.53	128	15,971	素材
ELISA OYJ	17.34	78	9,795	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS	68.09	245	30,513	金融

銘柄	2020年11月30日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
FORTUM OYJ	百株 44	千ユーロ 84	千円 10,554	公益事業
KONE OYJ-B	45.43	316	39,339	資本財・サービス
NESTE OYJ	57.78	332	41,323	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	17.63	70	8,769	ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,097.82 10銘柄	1,697 211,102 < 0.3%>	
ユーロ (オーストリア)	百株	千ユーロ	千円	
VERBUND AG	12.16	71	8,923	公益事業
OMV AG	12.09	35	4,439	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	34.89	87	10,840	金融
VOESTALPINE AG	18	48	6,029	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	11	18	2,293	金融
ANDRITZ AG	5.5	19	2,390	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	93.64 6銘柄	280 34,915 < 0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	23,598.02 240銘柄	52,538 6,534,744 <10.4%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	135,035.17 1,213銘柄	- 58,258,068 <93.1%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2020年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国新株予約権証券

銘柄	2020年11月30日現在		
	証券数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(スイス)	証券	千スイス・フラン	千円
CIF -CW	13,420	2	339
ファンド合計	証券数、金額 銘柄数<比率>	13,420 1銘柄	2 339 <0.0%>

(注1) 邦貨換算金額は、2020年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 外国投資信託証券

銘柄	2020年11月30日現在		
	□ 数	評価額	
		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
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,679	281	29,281
SIMON PROPERTY GROUP INC	4,233	362	37,622
BOSTON PROPERTIES INC	2,356	241	25,071
VORNADO REALTY TRUST	2,128	85	8,916
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,501	428	44,556
EQUITY RESIDENTIAL	5,245	310	32,258
EQUINIX INC	1,081	757	78,671
AMERICAN TOWER CORP	5,555	1,300	135,095
HOST HOTELS & RESORTS INC	12,228	178	18,572
INVITATION HOMES INC	6,976	200	20,843
VICI PROPERTIES INC	5,464	140	14,577
VENTAS INC	4,401	210	21,900
WEYERHAEUSER CO	8,683	249	25,898
AGNC INVESTMENT CORP	7,559	117	12,227
CROWN CASTLE INTL CORP	5,102	852	88,607
IRON MOUNTAIN INC	3,474	92	9,607
VEREIT INC	13,632	100	10,395
SUN COMMUNITIES INC	1,214	168	17,481
PROLOGIS INC	9,436	949	98,618
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,648	267	27,760
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,177	115	11,951
DUKE REALTY CORP	4,971	190	19,826
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0,771	192	20,025
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0,974	86	8,942
WELLTOWER INC	4,901	316	32,861
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6,434	192	19,972
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,714	212	22,080
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,95	114	11,893
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15,632	127	13,251
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,552	59	6,189
REALTY INCOME CORP	4,587	282	29,374
PUBLIC STORAGE	2,105	463	48,118
REGENCY CENTERS CORP	1,939	90	9,445
UDR INC	4,752	186	19,362
WP CAREY INC	2,702	188	19,618
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,164	77	8,059
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,415	466	48,509
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,797	197	20,535
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,597	168	17,478
アメリカ・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	175,729 39銘柄	11,025 <1.8%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	2	31	2,494

銘柄	2020年11月30日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	千口 1.6	千カナダ・ドル 82	千円 6,567
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1.4	25	2,033
カナダ・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	5 3銘柄	138 <0.0%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円
LENLEASE GROUP	4.303	61	4,699
TRANSURBAN GROUP	33.406	473	36,380
SYDNEY AIRPORT	9.129	61	4,718
APA GROUP	14.243	150	11,578
SCENTRE GROUP	64.017	184	14,179
DEXUS	13.949	136	10,535
GPT GROUP	30.647	145	11,172
MIRVAC GROUP	61.117	159	12,268
STOCKLAND	18.729	86	6,654
GOODMAN GROUP	20.198	375	28,909
VICINITY CENTRES	50.371	84	6,469
オーストラリア・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	320.109 11銘柄	1,918 <0.2%>
(香港)	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT	32	2,192	29,372
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	52	405	5,428
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34	352	4,720
香港ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	118 3銘柄	2,949 <0.1%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30.5	92	7,156
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	51.66	102	7,986
SUNTEC REIT	26	39	3,090
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	46	90	7,004
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	37.6	77	6,046
(非上場)			
ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS	1.128	-	-
シンガポール・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	192.888 6銘柄	402 <0.1%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	10.295	68	9,486
SEGRO PLC	13.286	119	16,592
BRITISH LAND CO PLC	14.58	68	9,496
イギリス・ポンド 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	38.161 3銘柄	256 <0.1%>
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1.751	110	13,755
ICADE	0.406	24	3,024

銘柄	2020年11月30日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
GECINA SA	千口 0.578	千ユーロ 73	千円 9,137
KLEPIERRE	2.394	46	5,770
COVIVIO	0.353	25	3,161
ユ 通 貨 計	□数、金額 銘柄数<比率>	5.482 5銘柄	280 <0.1%>
合 計	□数、金額 銘柄数<比率>	855.369 70銘柄	- <2.3%>

(注1) 邦貨換算金額は、2020年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄	別	2020年11月30日現在	
		買 建 額	売 建 額
外	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	百万円 2,077	百万円 -
	S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	116	-
	SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	114	-
国	FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	167	-
	SWISS MKT IX FUTR (スイス)	108	-
	EURO STOXX 50 (ドイツ)	342	-

(注1) 外貨建の評価額は、2020年11月30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。

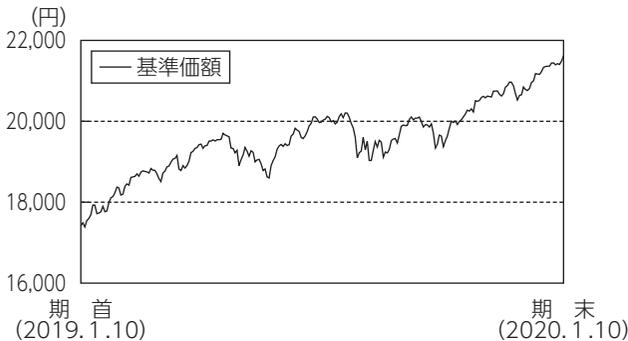
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）
株式組入制限	無制限

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	騰落率	ベンチマーク	騰落率					
(期首)2019年1月10日	17,415	-	13,628	-	90.1	6.6	2.4		
1月末	17,996	3.3	14,080	3.3	90.5	6.9	2.5		
2月末	18,750	7.7	14,636	7.4	91.6	7.5	2.6		
3月末	18,902	8.5	14,717	8.0	94.4	2.2	2.8		
4月末	19,641	12.8	15,257	11.9	96.0	2.1	2.7		
5月末	18,822	8.1	14,557	6.8	92.2	3.0	2.8		
6月末	19,642	12.8	15,168	11.3	91.0	6.0	2.7		
7月末	20,105	15.4	15,517	13.9	86.9	10.8	2.6		
8月末	19,521	12.1	15,028	10.3	91.6	3.5	2.8		
9月末	19,858	14.0	15,270	12.0	97.6	1.2	3.0		
10月末	20,307	16.6	15,596	14.4	90.8	8.0	2.8		
11月末	20,965	20.4	16,074	17.9	93.3	5.0	2.8		
12月末	21,441	23.1	16,416	20.5	93.3	4.7	2.7		
(期末)2020年1月10日	21,621	24.2	16,543	21.4	91.8	6.0	2.7		

- (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)	2円 (1)
(先物・オプション)	(1)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税 (株式)	2 (2)
(投資信託証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	6 (6)
(その他)	(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・シェケル 561 ()	百株 50	千イスラエル・シェケル 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 (1.7)	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 (ルクセンブルク)	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 ()	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。

(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	口数	金額	口数	金額	
外	アメリカ	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 -	千カナダ・ドル -	千口 -	千カナダ・ドル -
	カナダ	千口 1.6 (-)	千カナダ・ドル 87 (39)	千口 -	千カナダ・ドル -	千口 -	千オーストラリア・ドル -	千口 -	千オーストラリア・ドル -
	オーストラリア	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 -	千シンガポール・ドル -	千口 -	千シンガポール・ドル -
	シンガポール	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 -	千イギリス・ポンド -	千口 -	千イギリス・ポンド -
	イギリス	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 -	千ユーロ -	千口 -	千ユーロ -
国	千口 1,243 (-)	千ユーロ 183 (-)	千口 0,497 (-)	千ユーロ 71 (-)	千口 -	千ユーロ -	千口 -	千ユーロ -	

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

(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	柄	株 数	金 額	平均単価	銘柄	柄	株 数	金 額	平均単価
MICROSOFT CORP (アメリカ)		千株 14,645	千円 214,012	円 14,613	CELGENE CORP (アメリカ)		千株 7.75	千円 91,895	円 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		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			
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	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 INC	-	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		
VR 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/OK	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		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			
(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		
BUNGS 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	金融		
BECTON 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		
NISOURCE INC	40.26	40.26	111	12,241	公益事業		
CH. 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	79,796	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		
LENXO 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		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	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		
ACUIITY 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		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	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		
COMMSCOPE 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			
百株	百株	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-CLA	8	-	-	-	エネルギー		
NEXTERA ENERGY INC	43.99	51.64	1,255	137,545	公益事業		
FREEPORT-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		
FASTENCO	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 HOLDIN	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			
百株	百株	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		
LOEWS 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	
			千アメリカ・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-NONV 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	
			千アメリカ・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		
DROPOBOX 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		業種等
	株数	株数	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
MONGODB INC	-	3.9	58	6,408			情報技術
SNAP INC - A	-	68.89	119	13,103			コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	-	75.09	215	23,637			素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42.88	42.88	406	44,493			金融
AMCOR PLC	-	174.57	181	19,892			素材
ROKU INC	-	9.39	125	13,765			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			公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	62.13	72.8	1,500	164,439			情報技術
PENTAIR PLC	15.75	15.75	71	7,886			資本財・サービス
QUALCOMM INC	137.16	134.03	1,205	132,038			情報技術
INVESCO LTD	37	37	66	7,301			金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	8.19	8.19	125	13,718			一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23	31.93	179	19,654			金融
RAYTHEON COMPANY	25.67	31.16	712	78,065			資本財・サービス
RED HAT INC	15.3	-	-	-			その他
REGENERON PHARMACEUTICALS	7.45	9.25	354	38,865			ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	20.5	26.67	242	26,580			資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	4.5	4.86	1,012	110,990			一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	36.18	41.29	504	55,253			一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	8.44	8.44	88	9,712			素材
RESMED INC	13.83	13.83	217	23,878			ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	12	18.12	192	21,083			ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	8	14.99	95	10,439			資本財・サービス
RALPH LAUREN CORP	4	4	47	5,168			一般消費財・サービス
PERKINELMER INC	-	11.63	116	12,725			ヘルスケア
REGIONS FINANCIAL CORP	92.5	92.5	153	16,773			金融
CHEVRON CORP	180.78	213.52	2,509	274,919			エネルギー
EDISON INTERNATIONAL	31.03	38.64	294	32,236			公益事業
TESLA INC	11.94	16.51	794	87,074			一般消費財・サービス
NORTONLIFELOCK INC	54	79.44	212	23,231			情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	15.81	15.81	261	28,628			資本財・サービス
SYNOPSYS INC	11	15.82	235	25,770			情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	16.05	18.17	921	100,993			コミュニケーション・サービス
CBRE GROUP INC - A	28	38.49	233	25,540			不動産
TWITTER INC	57	84.84	281	30,881			コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	89.27	113.05	715	78,359			公益事業
SYSCO CORP	43.92	48.6	411	45,066			生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	24.82	28.6	393	43,126			金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	10	19.25	126	13,876			金融
STEEL DYNAMICS INC	23	23	77	8,452			素材
SCHLUMBERGER LTD	135.88	149.99	597	65,507			エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	20.26	106	11,649			資本財・サービス
AT&T INC	685.37	818.15	3,174	347,821			コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	17.58	17.58	95	10,459			資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	36.27	36.27	90	9,879			情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7.61	8.34	471	51,688			素材
SEMpra ENERGY	27.68	31.6	470	51,527			公益事業
TIFFANY & CO	10.86	10.86	145	15,920			一般消費財・サービス

銘柄	期首		当		期		業種等
	株数	株数	評価価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
SEAGATE TECHNOLOGY	23.49	23.49	142	15,561			情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	90.23	105.74	1,388	152,158			情報技術
SALESFORCE.COM INC	69.51	96.2	1,727	189,309			情報技術
WESTROCK CO	23.21	23.21	98	10,826			素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	83.88	99.06	409	44,859			資本財・サービス
TERADYNE INC	-	20.96	143	15,676			情報技術
UNION PACIFIC CORP	69.85	80.49	1,441	157,953			資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	102.44	102.44	137	15,096			エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	60.83	70.61	419	45,948			エネルギー
UNITED TECHNOLOGIES CORP	78.79	90.33	1,387	152,074			資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	64.48	80.87	945	103,610			資本財・サービス
UNUM GROUP	19	19	54	6,010			金融
SPRINT CORP	41.14	114.74	57	6,286			コミュニケーション・サービス
ANTERO RESOURCES CORP	10	-	-	-			エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	14.32	17.81	284	31,125			ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	18	18	112	12,277			金融
AMEREN CORPORATION	28.61	28.61	219	24,009			公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	90.73	107.26	3,155	345,781			ヘルスケア
VERISIGN INC	10.85	10.85	226	24,832			情報技術
VALERO ENERGY CORP	38.82	45.4	432	47,347			エネルギー
ULTA BEAUTY INC	4.8	6.35	167	18,333			一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	30.08	138	15,137			金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9.92	9.92	143	15,687			ヘルスケア
ANTHEM INC	23.46	29.08	891	97,631			ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	140.83	201.84	2,923	320,300			コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	432.75	476.67	2,513	275,402			金融
WASTE MANAGEMENT INC	42.25	46.9	544	59,677			資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	107.9	125.23	296	32,478			エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10.5	15.91	144	15,830			一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	5	8.7	130	14,333			一般消費財・サービス
WALMART INC	141.09	158.96	1,865	204,408			生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	9	9	65	7,178			資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	19.56	23.65	351	38,507			ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	11.45	11.45	162	17,833			一般消費財・サービス
XEROX HOLDINGS CORP	19.88	19.88	72	7,972			情報技術
WABTEC CORP	6.44	18.98	148	16,316			資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	112.06	131.81	825	90,467			一般消費財・サービス
WATERS CORP	6.5	6.5	148	16,295			ヘルスケア
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	3.5	9.92	87	9,559			資本財・サービス
ALLERGAN PLC	31.29	38.47	741	81,205			ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	-	5.55	136	14,989			情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	80.64	89.76	490	53,777			生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	15.36	15.11	309	33,939			金融
WESTERN DIGITAL CORP	25.45	35.31	242	26,548			情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	28.69	34.67	318	34,945			公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	42.5	50.77	296	32,498			公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	168.27	193.27	3,734	409,237			情報技術
PPL CORP	59	73.94	262	28,768			公益事業
PULTEGROUP INC	19	35.56	141	15,511			一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	20.12	24.34	313	34,312			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		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			
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		
ACON PLC	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		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
EATON CORP PLC	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		
VVV 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		
ENTERGY 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		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	
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
ESTEE 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		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	
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	株数、金額 銘柄数<比率>	28,351.43 594銘柄	33,749.8 608銘柄	313,580 <63.7%>	34,359,059
(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 LIFECO 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		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		
ALGONQUIN 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		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 88銘柄	株数・金額 85銘柄	20,902 < 3.3% >	1,753,064			
(オーストラリア)	株数	株数	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		
BENDIGO 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	
			千円	千円			
	百株	百株	オーストラリア・ドル	千円			
BLUESCOPE STEEL LTD	70.92	70.92	109	8,225	素材		
SUNCORP GROUP LTD	149.38	145.04	191	14,380	金融		
BORAL LTD	86	86	41	3,083	素材		
ASX LTD	13	22.6	183	13,769	金融		
COMPUTERSHARE LTD	37	20.61	35	2,701	情報技術		
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	270.97	205	15,480	金融		
SONIC HEALTHCARE LTD	25	52.23	157	11,801	ヘルスケア		
CHALLENGER LTD	63	63	52	3,921	金融		
WORLEY LTD	71.26	71.87	114	8,622	エネルギー		
AGL ENERGY LTD	47.39	84.66	172	12,944	公益事業		
BRAMBLES LTD	183.37	183.37	219	16,471	資本財・サービス		
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	8	8	35	2,653	一般消費財・サービス		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9	20.64	155	11,682	ヘルスケア		
REA GROUP LTD	6.08	6.08	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	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	1,087,595 < 2.0%>		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円			
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	145	235	1,357	19,149	公益事業		
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	220	220	1,324	18,687	一般消費財・サービス		
MTR CORP	165	165	759	10,721	資本財・サービス		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	160	190	2,245	31,688	不動産		
SINO LAND CO	340	340	386	5,459	不動産		
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	270.52	285.52	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	不動産		
CLP HOLDINGS LTD	190	190	1,565	22,090	公益事業		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	105.14	205.65	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	公益事業		
HANG SENG BANK LTD	64	90	1,467	20,699	金融		
WHEELOCK & CO LTD	60	160	858	12,112	不動産		
NEW WORLD DEVELOPMENT	580	580	622	8,789	不動産		
WH GROUP LTD	915	915	803	11,335	生活必需品		
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	119	139	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	不動産		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20	20	223	3,154	情報技術		
YUE YUEN INDUSTRIAL HDG	80	80	188	2,663	一般消費財・サービス		
NWS HOLDINGS LTD	150	150	170	2,400	資本財・サービス		
KERRY PROPERTIES LTD	75	75	183	2,582	不動産		
BANK OF EAST ASIA LTD	86	86	150	2,125	金融		
HYSAN DEVELOPMENT CO	60	-	-	-	不動産		
SJM HOLDINGS LTD	100	100	98	1,387	一般消費財・サービス		
SWIRE PROPERTIES LTD	80	80	207	2,929	不動産		
CK ASSET HOLDINGS LTD	230.52	305.52	1,686	23,796	不動産		
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	55	306	4,322	公益事業		
PCCW LTD	600	600	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			
	百株	百株	千香港ドル	千円			
AIA GROUP LTD	1,236	1,478	12,651	178,515	金融		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140	140	644	9,086	不動産		
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	-	120	328	4,630	生活必需品		
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	-	192	504	7,124	生活必需品		
SANDS CHINA LTD	230	238	1,023	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	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	金融		
WYNN MACAU LTD	168	168	334	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	598,608 < 1.1%>		
(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	133	129	345	28,027	金融		
DBS GROUP HOLDINGS LTD	171	211	545	44,251	金融		
SINGAPORE AIRLINES LTD	71	71	63	5,141	資本財・サービス		
KEPPEL CORP LTD	173	173	118	9,596	資本財・サービス		
UOL GROUP LTD	52	166	138	11,227	不動産		
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	52	58	4,714	不動産		
CAPITALAND LTD	190	334	128	10,401	不動産		
YANGZHUANG SHIPBUILDING	270	270	31	2,561	資本財・サービス		
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	120	120	26	2,121	コミュニケーション・サービス		
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	9	9	27	2,208	一般消費財・サービス		
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	348	348	383	31,129	金融		
GENTING SINGAPORE LTD	450	450	41	3,375	一般消費財・サービス		
VENTURE CORP LTD	32	32	52	4,258	情報技術		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	924	924	310	25,178	コミュニケーション・サービス		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	141	57	4,642	資本財・サービス		
SEMPACORP INDUSTRIES LTD	40	40	9	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	資本財・サービス		
SINGAPORE EXCHANGE LTD	69	168	147	11,989	金融		
COMFORTDELGRO CORP LTD	100	369	84	6,823	資本財・サービス		
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	158	67	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	217,077 < 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	150	150	73	5,320	公益事業		
MERCURY NZ LTD	-	217.05	111	8,091	公益事業		
A2 MILK CO LTD	70	70	103	7,499	生活必需品		
SPARK NEW ZEALAND LTD	168.6	168.6	76	5,553	コミュニケーション・サービス		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81	81	72	5,283	資本財・サービス		
FLETCHER BUILDING LTD	145.26	145.26	75	5,436	素材		
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	37	92	197	14,318	ヘルスケア		
RYMAN HEALTHCARE LTD	44.19	44.19	72	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	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
SPRAX-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
SCHROEDERS PLC	12.27	12.27	40	5,765			金融
SSE PLC	82.82	124.6	175	25,168			公益事業
VVEIR 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
ASHTREAD 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		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千円	千円			
STANDARD 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	27,729.14 92銘柄	33,125.03 93銘柄	20,605	2,950,852			< 5.5% >
(イスラエル)	株数	株数	千円	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	370.26 7銘柄	589.29 7銘柄	2,033	64,317			< 0.1% >
(スイス)	株数	株数	千円	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		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			
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	1,578.6 38銘柄	1,937.79 39銘柄	14,921	1,679,410			< 3.1% >
(デンマーク)	株数	株数	千円	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	428.5 17銘柄	486.02 17銘柄	21,008	342,017			< 0.6% >
(ノルウェー)	株数	株数	千円	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
GJENSIDIGE FORSKRING 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	570.99 10銘柄	676.85 10銘柄	9,678	119,531			< 0.2% >
(スウェーデン)	株数	株数	千円	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・クローネ	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・クローネ 通 貨 計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,469.2 32銘柄	2,965.74 32銘柄	44,681 516,076	44,681 < 1.0% >		
ユーロ (アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円			
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	19.95	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 銘柄数<比率>	319.3 7銘柄	334.42 7銘柄	809 98,459	809 < 0.2% >		
ユーロ (オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
QIAGEN N.V.	25.21	25.21	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 銘柄数<比率>	1,820.89 23銘柄	2,100.46 26銘柄	7,007 852,775	7,007 < 1.6% >		
ユーロ (ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円			
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 銘柄数<比率>	180.18 10銘柄	225.83 11銘柄	1,552 188,978	1,552 < 0.4% >		
ユーロ (ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
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 銘柄数<比率>	229.52 6銘柄	333.28 5銘柄	417 50,812	417 < 0.1% >		
ユーロ (フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円			
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 VUITTON	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	
CAPGEMINI 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	
EIFFAGE	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 総額数(比率)	2,450.52 68銘柄	2,987.76 67銘柄	15,305 < 3.5% >	1,862,569		
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	
UNIPER 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 LICHT 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	

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		業種等		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千ユーロ	千円			
ZALANDO SE	7	20.25	94	11,495	一般消費財・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	一般消費財・サービス		
DELIVERY HERO SE	10.56	10.56	69	8,442	一般消費財・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 -PRF	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	一般消費財・サービス		
PUMA SE	0.51	12.95	94	11,472	一般消費財・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 & DAIMLER 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	一般消費財・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		
LANXESS AG	15.6	-	-	-	コミュニケーション・サービス		
MTU AERO ENGINES AG	6	15.29	88	10,769	素材		
AXEL SPRINGER SE	4	6.66	180	21,906	資本財・サービス		
DEUTSCHE WOHNEN SE	4.7	-	-	-	コミュニケーション・サービス		
SYMRISE AG	32.85	47.96	171	20,899	不動産		
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	14.36	14.36	131	16,059	素材		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	62.4	62.4	16	2,060	コミュニケーション・サービス		
HUGO BOSS AG -ORD	2.5	9	51	6,242	一般消費財・サービス		
VONOVIA SE	8.11	-	-	-	一般消費財・サービス		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,256 61銘柄	2,607.29 57銘柄	12,812 1,559,147	< 2.9%>		
ユーロ (ポルトガル)	百株	百株	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 31,553	< 0.1%>		
ユーロ (スペイン)	百株	百株	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		業種等		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千ユーロ	千円			
ENDESA SA	21.5	21.5	49	6,072	公益事業		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTIA	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	金融		
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	一般消費財・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	4,202 511,409	< 0.9%>		
ユーロ (イタリア)	百株	百株	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	一般消費財・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	一般消費財・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	3,004 365,593	< 0.7%>		

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
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 1,087.39	1,466 1,266	178,423 < 0.3%>	
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 INTERNATIONAL	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	298 6銘柄	36,347 < 0.1%>	
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%>	
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	49,480,414 <91.8%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首		期末		業種等
	口数	口数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.372	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 IN	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 <2.0%>
(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 <0.0%>

銘柄	期首		期末	
	口数	口数	評価額	評価額
(オーストラリア)	千口	千口	外貨建金額	邦貨換算金額
LENDELEASE GROUP	4.303	4.303	オーストラリア・ドル	千円
TRANSURBAN GROUP	26.027	31.468	78	5,880
SYDNEY AIRPORT	9.129	9.129	482	36,285
APA GROUP	7.5	14.243	80	6,018
SCENTRE GROUP	43.529	64.017	162	12,237
DEXUS	6.5	13.949	252	18,959
GPT GROUP	14.648	30.647	168	12,634
MIRVAC GROUP	31.638	61.117	178	13,453
STOCKLAND	14.3	18.729	198	14,931
GOODMAN GROUP	14.731	20.198	89	6,757
VICINITY CENTRES	19.523	50.371	283	21,316
オーストラリア・ドル 通貨計	191,828 口数、金額 銘柄数<比率>	318,171 口数、金額 銘柄数<比率>	2,101	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	110 口数、金額 銘柄数<比率>	110 口数、金額 銘柄数<比率>	2,751	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	93.5 口数、金額 銘柄数<比率>	153.6 口数、金額 銘柄数<比率>	368	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	27,986 口数、金額 銘柄数<比率>	38,161 口数、金額 銘柄数<比率>	301	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	4,736 口数、金額 銘柄数<比率>	5,482 口数、金額 銘柄数<比率>	483	58,868 <0.1%>
合計	538,917 口数、金額 銘柄数<比率>	786,606 口数、金額 銘柄数<比率>	-	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	当期末	
	買建額	売建額
外	百万円	百万円
S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	2,225	-
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	-
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	当期末	
	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)

運用報告書 (全体版) 第4期

(決算日 2020年11月30日)

(作成対象期間 2019年12月3日～2020年11月30日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	投 信 託 証 券 率 組 入 比	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率				
1 期末(2017年11月30日)	円 11,391	円 0	% 13.9	% 93.0	% 1.5	% 4.5	百万円 915
2 期末(2018年11月30日)	11,550	0	1.4	92.1	2.0	5.0	1,637
3 期末(2019年12月 2 日)	12,622	0	9.3	90.2	5.5	3.4	1,845
4 期末(2020年11月30日)	13,420	0	6.3	92.7	4.3	2.5	2,513

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注3) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

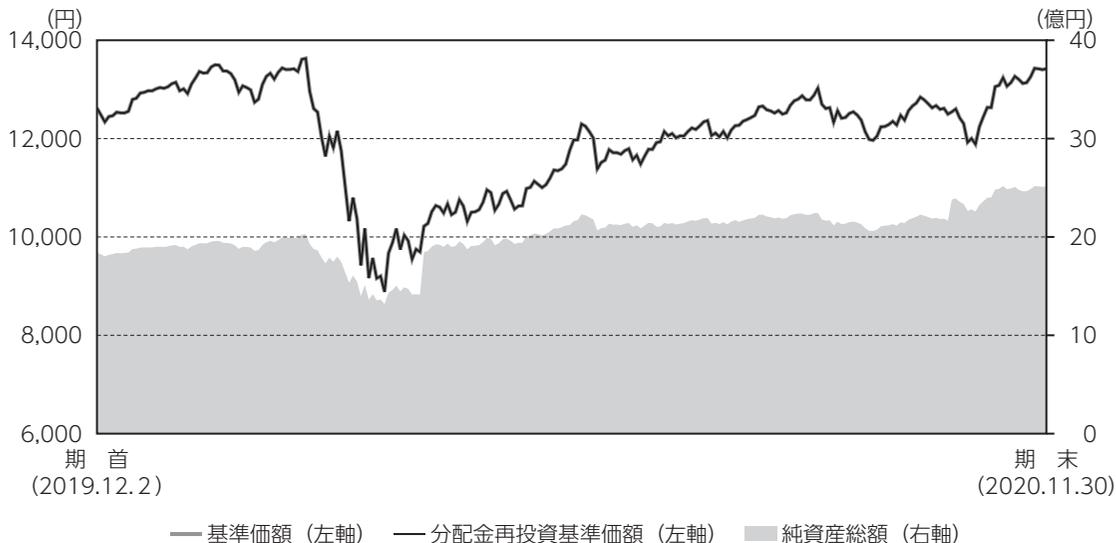
(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注5) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：12,622円

期末：13,420円（分配金0円）

騰落率：6.3%（分配金込み）

■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国株式インデックスマザーファンド	9.5%	79.1%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	△3.7%	20.1%

■ 基準価額の主な変動要因

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

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)

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 率 株 比	株 式 先 物 率 株 比	投 信 組 託 入 証 比	資 券 率 証 比
	円	騰 落 率 %				
(期首) 2019年12月 2 日	12,622	-	90.2	5.5		3.4
12月末	13,145	4.1	91.4	4.2		3.6
2020年 1 月末	12,991	2.9	90.0	5.1		3.9
2 月末	12,028	△ 4.7	88.2	6.6		4.4
3 月末	10,035	△20.5	88.9	8.0		2.4
4 月末	10,958	△13.2	93.7	2.2		3.5
5 月末	11,347	△10.1	91.7	3.3		4.2
6 月末	11,640	△ 7.8	93.1	1.3		4.8
7 月末	12,015	△ 4.8	90.9	4.4		3.8
8 月末	12,789	1.3	92.2	4.5		2.6
9 月末	12,246	△ 3.0	91.9	5.5		1.9
10月末	12,002	△ 4.9	92.4	4.4		2.4
(期末) 2020年11月30日	13,420	6.3	92.7	4.3		2.5

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2019.12.3~2020.11.30)

■先進国株式市況

先進国株式市況は上昇しました。

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

■先進国為替相場

先進国通貨の為替相場は、当作成期を通じた大きな流れで見ると米ドルなどが下落(円高)しました。

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

■新興国株式市況

新興国株式市況は、新型コロナウイルスの影響で大きく下落しましたが、その後戻りました。

新興国株式市況は、当作成期首より、米中通商協議の進展が好感されて買われました。しかし2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染拡大を嫌気したリスク回避の動きが広がり、新興国株式市況は上値が重い展開となりました。2月下旬から3月中旬にかけても、感染が欧米を中心に世界的に広がり各国で外出制限などが行われた結果、世界的な需要の減少が懸念されたことで、急落しました。その後は、FRB(米国連邦準備制度理事会)などの金融政策や各国政府の経済対策に対する期待が高まって新興国株式市況は上昇に転じ、また新型コロナウイルスのワクチン開発への期待の高まりなどで堅調に推移しました。9月に入ると、高まった期待に対して再流行懸念から下落しました。しかし11月には、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通り当選確実となって選挙に対する不確実性が後退したことや、複数の開発企業がワクチン開発において高い効果を確認したとの発表でワクチンの実用化期待が高まったことにより、株価は上昇しました。

■新興国為替相場

新興国通貨の為替相場は、対米ドルで上昇し、対円で下落しました。

新興国の為替相場は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大とその後の世界的な景気悪化懸念によるリスク回避の動きを受けて新興国からの資金流出が進み、新興国通貨全体としては対米ドル、

対円ともに下落しました。その後は、F R B（米国連邦準備制度理事会）などの金融政策や各国政府の経済対策に対する期待が高まったことを受けてリスク回避傾向が取り、対米ドルで上昇しました。9月に入ると、高まった期待に対して新型コロナウイルスの再流行懸念から横ばいの動きとなりました。しかし11月には、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通り当選確実となって選挙に対する不確実性が後退したことや、複数の開発企業が新型コロナウイルスワクチン開発において高い効果を確認したとの発表でワクチンの実用化期待が高まったことにより、対米ドルで上昇しました。当作成期では米ドルは円に対して弱かったため、新興国通貨は対円で下落しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

今後の運用にあたりましては、引き続き、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。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

今後の運用にあたりましては、引き続き、主として新興国の株式（DR（預託証券）を含む。）に投資し、投資成果をベンチマーク（FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算））の動きに連動させることをめざして運用を行うことを基本とします。また、効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF（上場投資信託証券）にも一部投資します。なお、株式およびETFの組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。さらに、リバランス時等に、株式実質組入比率の維持を目的に株価指数先物取引の利用も検討します。

ポートフォリオについて

（2019.12.3～2020.11.30）

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

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

外国株式等のポートフォリオ構築にはリスクモデルを利用し、ファンドの資産規模や資金動向、売買

コストの抑制等を勘案しながら、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

株式組入比率（D R（預託証券）、E T F（上場投資信託証券）、株価指数先物を含む。）は、ベンチマークのリバランス時や大量設定時を除き、当作成期を通じて原則として98%以上で運用を行いました。

ポートフォリオ構築にあたっては、FTSE RAFI エマージング インデックス採用銘柄の組入比率上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、D R等を組み入れることでベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

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

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および参考指数を設けておりません。

分配金について

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

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2019年12月3日 ～2020年11月30日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	3,420

(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

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

■外国株式インデックスマザーファンド

今後の運用にあたりましては、引き続き、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。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

今後の運用にあたりましては、引き続き、主として新興国の株式（DR（預託証券）を含む。）に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行うことを基本とします。また、効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすETF（上場投資信託証券）にも一部投資します。なお、株式およびETFの組入比率の合計は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。さらに、リバランス時等に、株式実質組入比率の維持を目的に株価指数先物取引の利用も検討します。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2019.12.3~2020.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	42円	0.344%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12,070円です。
(投 信 会 社)	(32)	(0.268)	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)	(7)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	3	0.023	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(2)	(0.014)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.004)	
(投資信託証券)	(1)	(0.005)	
有 価 証 券 取 引 税	1	0.010	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0.010)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
そ の 他 費 用	7	0.057	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(5)	(0.043)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(1)	(0.008)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	52	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。

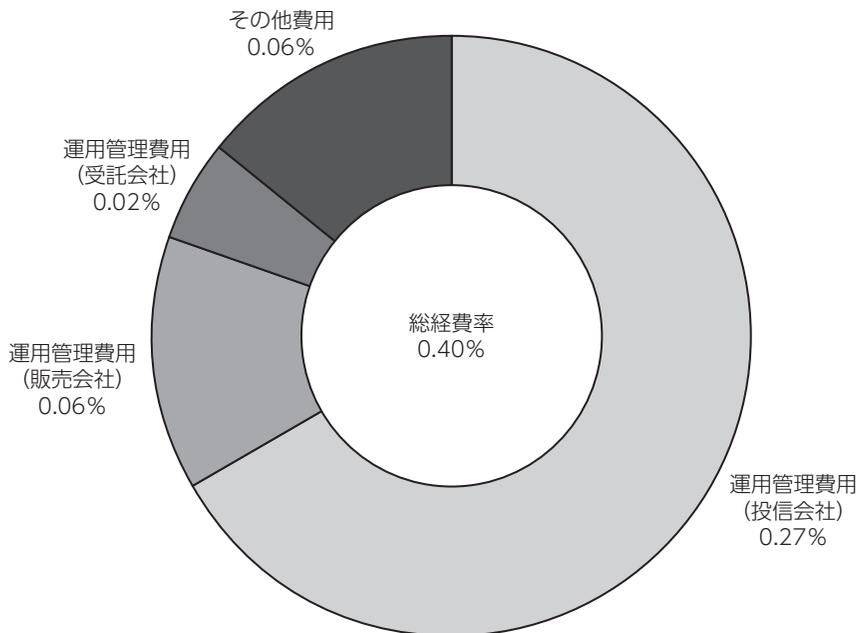
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.40%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12月3日から2020年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国株式ファン ダメンタル・インデック ス・マザーファンド	163,869	217,060	56,943	81,680
外国株式インデック スマザーファンド	235,340	568,230	111,312	292,490

(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12月3日から2020年11月30日まで)

項 目	当 期
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	4,287,237千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,159,449千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.52
	外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	20,318,301千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	128,052,463千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.15

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド	224,901	331,827	505,041			
外国株式インデックスマザーファンド	538,513	662,541	1,988,617			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド	505,041	20.0
外国株式インデックスマザーファンド	1,988,617	78.9
コール・ローン等、その他	28,165	1.1
投資信託財産総額	2,521,824	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=103.89円、1カナダ・ドル=79.95円、1オーストラリア・ドル=76.91円、1香港ドル=13.40円、1シンガポール・ドル=77.69円、1ニュージーランド・ドル=73.11円、1台湾ドル=3.64円、1イギリス・ポンド=138.55円、1イスラエル・シケル=31.34円、1スイス・フラン=114.97円、1トルコ・リラ=13.25円、1デンマーク・クローネ=16.71円、1ノルウェー・クローネ=11.76円、1スウェーデン・クローネ=12.22円、1メキシコ・ペソ=5.19円、100チリ・ペソ=13.54円、1サウジアラビア・リアル=27.74円、1インド・ルピー=1.41円、100インドネシア・ルピア=0.74円、1ブラジル・レアル=19.46円、1オフショア人民元=15.81円、1マレーシア・リンギット=25.53円、1南アフリカ・ランド=6.82円、1タイ・バーツ=3.43円、1ユーロ=124.38円です。

(注3) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(11,506,001千円)の投資信託財産総額(11,591,016千円)に対する比率は、99.3%です。外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(158,608,000千円)の投資信託財産総額(162,390,580千円)に対する比率は、97.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,521,824,598円
コール・ローン等	26,395,175
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド(評価額)	505,041,552
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	1,988,617,871
未収入金	1,770,000
(B) 負債	8,171,866
未払解約金	4,321,652
未払信託報酬	3,790,137
その他未払費用	60,077
(C) 純資産総額(A - B)	2,513,652,732
元本	1,873,069,139
次期繰越損益金	640,583,593
(D) 受益権総口数	1,873,069,139口
1万口当り基準価額(C / D)	13,420円

* 期首における元本額は1,462,100,428円、当作成期間中における追加設定元本額は950,256,999円、同解約元本額は539,288,288円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,420円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月3日 至2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 7,544円
受取利息	1,248
支払利息	△ 8,792
(B) 有価証券売買損益	264,391,670
売買益	299,398,152
売買損	△ 35,006,482
(C) 信託報酬等	△ 7,100,719
(D) 当期損益金(A + B + C)	257,283,407
(E) 前期繰越損益金	141,562,846
(F) 追加信託差損益金	241,737,340
(配当等相当額)	(211,933,425)
(売買損益相当額)	(29,803,915)
(G) 合計(D + E + F)	640,583,593
次期繰越損益金(G)	640,583,593
追加信託差損益金	241,737,340
(配当等相当額)	(211,933,425)
(売買損益相当額)	(29,803,915)
分配準備積立金	398,853,797
繰越損益金	△ 7,544

(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	257,283,549
(c) 収益調整金	241,737,340
(d) 分配準備積立金	141,570,248
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	640,591,137
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	640,591,137
(h) 受益権総口数	1,873,069,139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））が投資対象としている「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の決算日（2020年7月6日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2020年11月30日）現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

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

(1) 株 式

(2019年12月3日から2020年11月30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	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	84	131,783	1,568	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	46	44,150	959	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	46	44,150	959	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	46	44,150	959
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR (ケイマン諸島)	4.4	104,789	23,815	MEDIATEK INC (台湾)	10	11,865	1,186	MEDIATEK INC (台湾)	10	11,865	1,186	MEDIATEK INC (台湾)	10	11,865	1,186
GAZPROM PJSC-SPON ADR (ロシア)	201.52	100,839	500	LUKOIL PJSC-SPON ADR (ロシア)	1.86	10,704	5,755	LUKOIL PJSC-SPON ADR (ロシア)	1.86	10,704	5,755	LUKOIL PJSC-SPON ADR (ロシア)	1.86	10,704	5,755
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	1,291	98,921	76	BHARTI AIRTEL LTD (インド)	17.48	10,302	589	BHARTI AIRTEL LTD (インド)	17.48	10,302	589	BHARTI AIRTEL LTD (インド)	17.48	10,302	589
CHINA MOBILE LTD (香港)	124.5	92,452	742	AMERICA MOVIL SAB DE C-SEER L (メキシコ)	146.4	9,628	65	AMERICA MOVIL SAB DE C-SEER L (メキシコ)	146.4	9,628	65	AMERICA MOVIL SAB DE C-SEER L (メキシコ)	146.4	9,628	65
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	1,060	64,870	61	BANK OF CHINA LTD-H (中国)	235	9,158	38	BANK OF CHINA LTD-H (中国)	235	9,158	38	BANK OF CHINA LTD-H (中国)	235	9,158	38
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP (サウジアラビア)	28.123	59,196	2,104	CHINA RESOURCES BEER HOLDING (香港)	20	9,004	450	CHINA RESOURCES BEER HOLDING (香港)	20	9,004	450	CHINA RESOURCES BEER HOLDING (香港)	20	9,004	450
HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	220	58,493	265	NASPERS LTD-N SHS (南アフリカ)	0.64	8,316	12,993	NASPERS LTD-N SHS (南アフリカ)	0.64	8,316	12,993	NASPERS LTD-N SHS (南アフリカ)	0.64	8,316	12,993
TENCENT HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)	8.7	55,695	6,401	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR (ロシア)	3.76	8,271	2,199	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR (ロシア)	3.76	8,271	2,199	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR (ロシア)	3.76	8,271	2,199
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	114	54,892	481	CITIC LTD (香港)	69	7,647	110	CITIC LTD (香港)	69	7,647	110	CITIC LTD (香港)	69	7,647	110

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

買				付				売				付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	985.6	1,892,427	1,920	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	1,027	1,901,519	1,851	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	1,027	1,901,519	1,851	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	1,027	1,901,519	1,851
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	20.2	1,630	80	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI (トルコ)	171.87	3,071	17	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI (トルコ)	171.87	3,071	17	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI (トルコ)	171.87	3,071	17
				REDEFINE PROPERTIES LTD (南アフリカ)	105	1,060	10	REDEFINE PROPERTIES LTD (南アフリカ)	105	1,060	10	REDEFINE PROPERTIES LTD (南アフリカ)	105	1,060	10
				FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	8.2	618	75	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	8.2	618	75	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	8.2	618	75

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2020年11月30日現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド(7,600,562千口)の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	株数	2020年11月30日現在		業種等
		評価額	金額	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千円		
SURGUTNEFTGAS-SP ADR PREF	337	175	18,205	エネルギー
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	85	2,350	244,149	一般消費財・サービス
BAIDU INC - SPON ADR	57	794	82,560	コミュニケーション・サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	101	262	27,281	一般消費財・サービス
CANADIAN SOLAR INC	36	159	16,519	情報技術
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	30	88	9,197	資本財・サービス
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	199.5	171	17,782	コミュニケーション・サービス
JD.COM INC-ADR	107	956	99,390	一般消費財・サービス
NETEASE INC-ADR	30	280	29,091	コミュニケーション・サービス
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	70	239	24,878	一般消費財・サービス

銘柄	株数	2020年11月30日現在		業種等
		評価額	金額	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千円		
VTB BANK JSC -GDR-REG S	2,382.98	229	23,877	金融
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	67.6	176	18,315	素材
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	65.5	265	27,559	エネルギー
SURGUTNEFTGAS-SP ADR	479	229	23,856	エネルギー
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	123.1	351	36,486	素材
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	266.7	400	41,644	生活必需品
RUSHYDRO PJSC-ADR	839.95	82	8,604	公益事業
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	1,038	1,408	146,335	金融
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	16.2	264	27,433	エネルギー
LUKOIL PJSC-SPON ADR	206.3	1,425	148,141	エネルギー

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	2020年11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ROSNFT OIL CO PJSC-REGS GDR	686	414	43,017	エネルギー	
GAZPROM PJSC-SPON ADR	4,283.9	2,071	215,183	エネルギー	
SEVERSTAL - GDR REG S	142.7	215	22,371	素材	
TATNEFT PJSC - PREF	160.1	101	10,554	エネルギー	
SISTEMA PJSC	4,265	173	18,049	コミュニケーション・サービス	
ROSSETI PJSC	49,330	112	11,664	公益事業	
INTER RAO UES PJSC	15,770	108	11,292	公益事業	
ALROSA PJSC	1,332.6	159	16,527	素材	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	576.29	116	12,087	金融	
AEROFLOT PJSC	780.5	74	7,698	資本財・サービス	
アメリカ・ドル 通貨計	83,864.92 30銘柄	13,858	1,439,760 <12.4%>		
(香港)	百株	千香港ドル	千円		
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1,915	1,018	13,651	資本財・サービス	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	3,460	1,349	18,081	資本財・サービス	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	400	389	5,220	資本財・サービス	
GEELEY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	940	2,133	28,592	一般消費財・サービス	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	1,450	633	8,490	資本財・サービス	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	880	1,070	14,339	素材	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	1,980	601	8,065	公益事業	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	270	753	10,094	公益事業	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	22,758	8,579	114,968	エネルギー	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	155	399	5,358	公益事業	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,380	1,135	15,218	一般消費財・サービス	
CHINA COMMUNICATIONS SERV-H	1,320	554	7,428	資本財・サービス	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	185	663	8,887	資本財・サービス	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	1,255	1,388	18,599	資本財・サービス	
TENCENT HOLDINGS LTD	239	13,933	186,711	コミュニケーション・サービス	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	9,060	2,201	29,501	コミュニケーション・サービス	
AIR CHINA LTD-H	860	546	7,317	資本財・サービス	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	4,340	2,083	27,914	コミュニケーション・サービス	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	625	1,800	24,120	不動産	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	2,120	839	11,249	不動産	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	700	579	7,766	公益事業	
PETROCHINA CO LTD-H	16,540	4,350	58,290	エネルギー	
CNOOC LTD	7,730	7,304	97,884	エネルギー	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	1,140	770	10,326	不動産	
HUANENG POWER INTL INC-H	4,220	1,295	17,360	公益事業	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	255	1,300	17,426	素材	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,490	989	13,257	公益事業	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	50,100	30,561	409,517	金融	
CHINA MOBILE LTD	2,820	13,409	179,681	コミュニケーション・サービス	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	890	1,272	17,054	金融	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	6,670	2,301	30,835	金融	
GF SECURITIES CO LTD-H	438	495	6,643	金融	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	404	505	6,767	金融	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	190	1,054	14,130	生活必需品	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHIH-H	3,340	1,469	19,692	金融	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1,140	551	7,393	資本財・サービス	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	1,420	299	4,014	公益事業	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,240	3,440	46,104	エネルギー	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	691.2	528	7,085	ヘルスケア	
SINOPHARM GROUP CO-H	680	1,335	17,895	ヘルスケア	
CHINA RESOURCES LAND LTD	900	3,073	41,184	不動産	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	310	1,174	15,743	一般消費財・サービス	
YANZHOU COAL MINING CO-H	1,280	856	11,474	エネルギー	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	825	626	8,390	ヘルスケア	
BYD CO LTD-H	120	2,242	30,053	一般消費財・サービス	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	19,440	5,812	77,888	金融	
NEW CHINA LIFE INSURANCE CH	259	875	11,730	金融	
PEOPLES INSURANCE CO GROUP-H	2,770	700	9,390	金融	

銘柄	2020年11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千香港ドル	千円		
CITIC LTD	1,040	640	8,584	資本財・サービス	
IND & COMM BK OF CHINA-H	40,600	19,772	264,947	金融	
CHINA TOWER CORP LTD-H	7,960	979	13,119	コミュニケーション・サービス	
XIAOMI CORP-CLASS B	1,202	3,131	41,958	情報技術	
MEITUAN-CLASS B	140	4,368	58,531	一般消費財・サービス	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	560	724	9,710	公益事業	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	12.54	15	213	不動産	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	2,150	305	4,091	資本財・サービス	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	1,615	3,133	41,983	不動産	
CRRC CORP LTD - H	1,710	548	7,355	資本財・サービス	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	4,280	1,767	23,686	資本財・サービス	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,210	11,095	148,682	金融	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	390	1,166	15,625	不動産	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	5,070.8	2,266	30,373	金融	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2,880	3,041	40,753	不動産	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	90	972	13,036	一般消費財・サービス	
CHINA RES LAND LTD	6.92	-	-	不動産	
CHINA VANKE CO LTD-H	535	1,588	21,291	不動産	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	3,240	528	7,076	素材	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	840	736	9,871	一般消費財・サービス	
SHENZHEN INTERNATIONAL GROUP	68	920	12,337	一般消費財・サービス	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2,500	1,645	22,043	金融	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	1,450	2,331	31,243	一般消費財・サービス	
WEICHAI POWER CO LTD-H	630	1,086	14,554	資本財・サービス	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,500	994	13,319	素材	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	808	2,448	32,806	金融	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	469	620	8,308	ヘルスケア	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,590	2,941	39,416	金融	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	120	1,243	16,658	公益事業	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	820	865	11,603	素材	
KUNLUN ENERGY CO LTD	1,960	1,207	16,178	公益事業	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES -H	1,124	1,137	15,242	不動産	
ZUIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,460	1,102	14,770	素材	
CHINA NATIONAL BUILDING MAH	3,000	3,252	43,576	素材	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	5,831	2,536	33,988	金融	
CHINA EVERGRANDE GROUP	1,110	1,862	24,958	不動産	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	680	764	10,241	不動産	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	18,330	1,081	14,491	情報技術	
CHINA MERCHANTS BANK-H	1,185	6,079	81,459	金融	
BANK OF CHINA LTD-H	44,340	12,326	165,175	金融	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	440	771	10,341	金融	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO LH	2,170	687	9,217	金融	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	836	568	7,617	金融	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	380	1,915	25,663	不動産	
香港ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	354,927.46 92銘柄	2,38,426	3,194,910 <27.6%>	
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円		
YANGZHIJIANG SHIPBUILDING	1,217	111	8,698	資本財・サービス	
シンガポール・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,217 1銘柄	111	8,698 <0.1%>	
(台湾)	百株	千台湾ドル	千円		
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	240	3,048	11,094	情報技術	
TAIWAN CEMENT	1,781.45	7,713	28,077	素材	
ASIA CEMENT CORP	730	3,219	11,718	素材	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	1,260	9,374	34,122	情報技術	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	520	2,074	7,552	金融	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	1,111.12	7,366	26,814	生活必需品	
FORMOSA PLASTICS CORP	646	5,633	20,504	素材	
NAN YA PLASTICS CORP	641.4	4,207	15,315	素材	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	613.9	4,849	17,653	素材	
CHINA STEEL CORP	1,306.86	3,025	11,012	素材	

銘柄	2020年11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千台湾ドル	千円		
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	50	3,400	12,376	一般消費財・サービス	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	726.16	3,561	12,965	情報技術	
DELTA ELECTRONICS INC	620	13,640	49,649	情報技術	
YAGEO CORPORATION	80	3,488	12,696	情報技術	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	430	2,240	8,154	情報技術	
QUANTA COMPUTER INC	1,120	8,702	31,676	情報技術	
AU OPTRONICS CORP	9,760	11,712	42,631	情報技術	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	1,164	12,745	46,394	コミュニケーション・サービス	
MEDIATEK INC	360.03	26,102	95,011	情報技術	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	310	6,029	21,947	情報技術	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,524.11	6,957	25,325	金融	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	2,108.38	8,718	31,734	金融	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	3,000	2,622	9,544	金融	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,055.05	5,230	19,037	金融	
YUANFA FINANCIAL HOLDING CO	1,823.81	3,519	12,812	金融	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,199.93	6,401	23,302	金融	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,847.47	2,466	8,977	金融	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	5,113.34	4,443	16,174	金融	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	2,270	2,576	9,378	金融	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	3,370.28	6,656	24,228	金融	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,557.47	3,332	12,132	金融	
LARGAN PRECISION CO LTD	10	3,330	12,121	情報技術	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	140	4,256	15,491	情報技術	
TAIWAN MOBILE CO LTD	420	4,166	15,165	コミュニケーション・サービス	
WISTRON CORP	1,681.1	5,203	18,938	情報技術	
INNOLUX CORP	12,650	12,574	45,769	情報技術	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	420	2,570	9,356	コミュニケーション・サービス	
PEGATRON CORP	840	5,586	20,333	情報技術	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	190	2,318	8,437	情報技術	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	314.71	5,051	18,385	金融	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	274	2,493	9,075	情報技術	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	390	3,685	13,415	エネルギー	
COMPAL ELECTRONICS	1,420	2,733	9,949	情報技術	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,500	171,150	622,986	情報技術	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	4,829.02	39,887	145,191	情報技術	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	130	3,549	12,918	生活必需品	
ASUSTEK COMPUTER INC	167.6	4,215	15,343	情報技術	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	950	2,631	9,578	資本財・サービス	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	6,010	23,529	85,646	情報技術	
台湾ドル株数・金額 通貨計	84,677.19 <49銘柄>	493,989	1,798,123 <15.5%>		
(トルコ)	百株	千トルコ・リラ	千円		
TURKIYE GARANTI BANKASI	1,438.2	1,320	17,493	金融	
AKBANK T.A.S.	1,816.72	1,159	15,357	金融	
TURKIYE IS BANKASI-C	1,605	1,091	14,461	金融	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	877.6	1,379	18,279	コミュニケーション・サービス	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	125.9	1,185	15,705	エネルギー	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	1,178.81	1,392	18,446	素材	
HACI OMER SABANCI HOLDING	1,154.9	1,153	15,287	金融	
TURKIYE HALK BANKASI	1,623.3	879	11,657	金融	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	1,348.2	641	8,503	金融	
KOC HOLDING AS	509.15	951	12,601	資本財・サービス	
TURK HAVA YOLLARI AO	660.8	788	10,445	資本財・サービス	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	118.4	827	10,958	生活必需品	
トルコ・リラ株数・金額 通貨計	12,456.98 <12銘柄>	12,769	169,197 <1.5%>		
(メキシコ)	百株	千メキシコ・ペソ	千円		
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	190	1,676	8,701	生活必需品	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SE L	10,238	15,090	78,321	コミュニケーション・サービス	
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	895	2,875	14,924	コミュニケーション・サービス	
CEMEX SAB-CPO	13,187.19	12,277	63,719	素材	

銘柄	2020年11月30日現在				業種等
	株数	評価額		業種等	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千メキシコ・ペソ	千円		
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	566	8,226	42,697	生活必需品	
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	296.23	1,213	6,300	素材	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	885	6,311	32,758	素材	
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	1,254	6,631	34,415	生活必需品	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	855	8,981	46,615	金融	
メキシコ・ペソ株数・金額 通貨計	28,366.42 <9銘柄>	63,285	328,453 <2.8%>		
(チリ)	百株	千チリ・ペソ	千円		
ENEL CHILE SA	9,878.67	54,826	7,423	公益事業	
BANCO SANTANDER CHILE	31,303.8	104,836	14,194	金融	
ENEL AMERICAS SA	11,078.63	127,736	17,295	公益事業	
FALABELLA SA	343	93,982	12,725	一般消費財・サービス	
BANCO DE CHILE	16,370.92	111,125	15,046	金融	
チリ・ペソ株数・金額 通貨計	68,975.02 <5銘柄>	492,507	66,685 <0.6%>		
(サウジアラビア)	百株	千サウジアラビア・リアル	千円		
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	281.23	2,713	75,282	素材	
SAUDI TELECOM CO	99.31	1,066	29,587	コミュニケーション・サービス	
AL RAJHI BANK	229.18	1,695	47,045	金融	
SAMBA FINANCIAL GROUP	179.08	547	15,201	金融	
RIYAD BANK	206.66	426	11,820	金融	
ETIHAD ETISALAT CO	142.1	425	11,805	コミュニケーション・サービス	
SAVOLA	100.62	454	12,602	生活必需品	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	77.07	466	12,934	素材	
ALINMA BANK	227.04	368	10,228	金融	
NATIONAL COMMERCIAL BANK	173.48	739	20,524	金融	
SAUDI ARABIAN OIL CO	139.2	497	13,804	エネルギー	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	400.17	484	13,431	素材	
サウジアラビア・リアル株数・金額 通貨計	2,255.14 <12銘柄>	9,887	274,268 <2.4%>		
(インド)	百株	千インド・ルピー	千円		
TATA STEEL LTD	223.4	12,897	18,186	素材	
AXIS BANK LTD	298.9	17,981	25,354	金融	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	19.5	13,719	19,340	一般消費財・サービス	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	42.3	9,044	12,752	生活必需品	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	620.4	12,988	18,313	エネルギー	
STATE BANK OF INDIA	700.7	17,114	24,131	金融	
NTPC LTD	1,245	11,790	16,624	公益事業	
POWER FINANCE CORPORATION	552.4	5,976	8,427	金融	
JSW STEEL LTD	455.2	15,941	22,476	素材	
INDIAN OIL CORP LTD	1,380.7	11,680	16,469	エネルギー	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	555.05	20,703	29,191	エネルギー	
VODAFONE IDEA LTD	14,214.9	13,930	19,642	コミュニケーション・サービス	
JINDAL STEEL & POWER LTD	349.9	8,537	12,037	素材	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	30.5	3,264	4,602	金融	
TECH MAHINDRA LTD	80.2	7,032	9,915	情報技術	
YES BANK LTD	176.4	259	365	金融	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	611.2	4,776	6,734	一般消費財・サービス	
REC LTD	530.6	6,444	9,086	金融	
COAL INDIA LTD	935.1	11,740	16,553	エネルギー	
BHARTI INFRATEL LTD	288.8	6,313	8,901	コミュニケーション・サービス	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	298.4	5,581	7,870	金融	
GAIL INDIA LTD	571.66	5,868	8,274	公益事業	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	702	15,889	22,404	素材	
GRASIM INDUSTRIES LTD	152.8	13,381	18,867	素材	
WIPRO LTD	264.23	9,261	13,058	情報技術	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	111.16	29,786	41,999	情報技術	
INFOSYS LTD	620.4	68,244	96,224	情報技術	
LARSEN & TOUBRO LTD	69.72	7,825	11,033	資本財・サービス	
TATA MOTORS LTD	1,331.8	24,019	33,866	一般消費財・サービス	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	195.9	44,199	62,321	金融	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	2020年11月30日現在			業種等
	株数	評価額	金額	
	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	百株	千円	千円	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	525.4	101,391	142,962	エネルギー
ITC LTD	1,567.25	12,302	17,347	生活必需品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	589.9	11,423	16,107	一般消費財・サービス
BHERO MOTOCORP LTD	222.5	16,064	22,650	一般消費財・サービス
H BHARTI AIRTEL LTD	31.1	9,668	13,632	ヘルスケア
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	263.42	12,202	17,206	情報技術
HCL TECHNOLOGIES LTD	183.4	9,383	13,230	情報技術
VEDANTA LTD	195.4	16,063	22,650	情報技術
インド・ルビー	1,738.6	20,993	29,600	素材
通貨計	株数、金額 通貨計	32,946.19 645,689	910,422 < 7.9% >	
(インドネシア)	百株	千円	千円	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	3,171	1,759,905	13,023	一般消費財・サービス
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	12,420	4,297,320	31,800	コミュニケーション・サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	2,214	1,405,890	10,403	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	856	2,732,780	20,222	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	4,342	2,887,430	21,366	金融
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	10,484	4,476,668	33,127	金融
インドネシア・ルビー	株数、金額 通貨計	33,487 17,559,993	129,943 < 1.1% >	
(ブラジル)	百株	千円	千円	
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	6	38	755	公益事業
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	146	99	1,937	金融
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	53	429	8,355	金融
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	365	771	15,015	一般消費財・サービス
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	95	659	12,839	生活必需品
TIM SA	286.26	403	7,854	コミュニケーション・サービス
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	1,703	4,342	84,507	エネルギー
BANCO BRADESCO SA-PREF	1,858.26	4,578	89,102	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	2,426.36	7,026	136,740	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	331	794	15,465	素材
VALE SA	1,355.9	10,635	206,970	素材
GERDAU SA-PREF	479	1,090	21,215	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	1,107	2,867	55,794	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	508.04	632	12,308	公益事業
BRASKEM SA-PREF A	185	433	8,438	素材
CENTRAIS ELÉTRICAS BRAS-PR B	82	272	5,294	公益事業
BANCO DO BRASIL S.A.	607	2,100	40,882	金融
CENTRAIS ELÉTRICAS BRASILIEN	147	472	9,202	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGIA-PFB	33	224	4,359	公益事業
EMBRAER SA	377	311	6,052	資本財・サービス
METALURGICA GERDAU SA-PREF	999	1,032	20,101	素材
CCR SA	344	444	8,648	資本財・サービス
BRF SA	258	564	10,990	生活必需品
CIA SANÉAMENTO BASICO DE SP	92	417	8,128	公益事業
LOJAS RENNINER S.A.	72.05	333	6,498	一般消費財・サービス
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	128.84	304	5,927	一般消費財・サービス
JBS SA	578	1,333	25,948	生活必需品
SUZANO SA	113.45	629	12,259	素材
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	267	399	7,783	生活必需品
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	176	1,001	19,488	金融
CIELO SA	997.28	374	7,297	情報技術
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	126	278	5,428	公益事業
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	33.31	46	913	公益事業
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	175	707	13,765	金融
TELEFONICA BRASIL S.A.	206	908	17,674	コミュニケーション・サービス
KLABIN SA - UNIT	191	474	9,228	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	743	1,515	29,495	エネルギー
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	241	629	12,249	金融
LOJAS AMERICANAS SA	22.93	44	858	一般消費財・サービス
COGNA EDUCACAO	698	341	6,642	一般消費財・サービス
BANCO BRADESCO S.A.	539.41	1,187	23,114	金融

銘柄	2020年11月30日現在			業種等
	株数	評価額	金額	
	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
AMBEV SA	百株	千円	千円	生活必需品
	1,158	1,658	32,269	
ブラジル・リアル	株数、金額 通貨計	20,310.09 42,809	52,816 < 8.9% >	
(中国)	百株	千円	千円	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	815	1,679	26,556	金融
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	868.07	745	11,789	資本財・サービス
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	167	1,504	23,788	金融
IND & COMM BK OF CHINA-A	2,940	1,584	25,053	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	55	111	1,767	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	94	402	6,360	金融
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	84	229	3,626	一般消費財・サービス
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	7	1,216	19,233	生活必需品
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	71	394	6,229	素材
SHANGHAI PUDONG DEVELOP BANK-A	1,244	1,268	20,060	金融
HUADIAN POWER INTL CORP-A	828	305	4,830	公益事業
CITIC SECURITIES CO-A	146	437	6,920	金融
CHINA MERCHANTS BANK-A	484	2,219	35,084	金融
PING AN BANK CO LTD-A	455	896	14,171	金融
GF SECURITIES CO LTD-A	98	165	2,623	金融
CHINA STATE CONSTRUCTION-A	2,981	1,639	25,921	資本財・サービス
SAIC MOTOR CORP LTD-A	517	1,400	22,134	一般消費財・サービス
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-A	238	85	1,347	素材
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	291	183	2,907	資本財・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHINA-A	1,407	389	6,161	資本財・サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	621	252	3,995	素材
JIANXING COPPER CO LTD-A	96	200	3,164	素材
YANZHOU COAL MINING CO-A	49	55	880	エネルギー
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	303	213	3,367	金融
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	6,158	2,044	32,322	金融
BANK OF CHINA LTD-A	3,321	1,105	17,484	金融
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	2,413	1,032	16,327	エネルギー
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	2,273	1,079	17,069	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	332	640	10,130	エネルギー
CHINA VANKE CO LTD -A	248	783	12,393	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	186	715	11,315	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	749	408	6,465	金融
CHINA MINSHENG BANKING-A	1,991	1,065	16,840	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	1,829	823	13,012	金融
CRRC CORP LTD-A	829	467	7,392	資本財・サービス
CHINA UNITED NETWORK-A	1,200	590	9,334	コミュニケーション・サービス
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	90	173	2,746	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	229	310	4,909	金融
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	268	210	3,321	資本財・サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	1,118	706	11,170	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	35	217	3,431	金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	840	548	8,672	金融
AIR CHINA LTD-A	148	116	1,839	資本財・サービス
BYD CO LTD -A	18	313	4,954	一般消費財・サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	44	61	964	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-A	98	170	2,688	資本財・サービス
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	259	231	3,664	素材
HUANENG POWER INTL INC-A	665	343	5,425	公益事業
オフショア人民元	株数、金額 通貨計	40,200.07 48,809	31,742 < 4.3% >	
(マレーシア)	百株	千円	千円	
MISC BHD	549	389	9,951	資本財・サービス
MALAYAN BANKING BHD	925	766	19,577	金融
PUBLIC BANK BERHAD	449	835	21,321	金融
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	1,001	383	9,787	金融
TENAGA NASIONAL BHD	417	447	11,412	公益事業
マレーシア・リンギット	株数、金額 通貨計	3,341 5,809	2,822 < 0.6% >	

銘柄	2020年11月30日現在			業種等
	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
GOLD FIELDS LTD	207.2	2,694	18,377	素材
NEPI ROCKCASTLE PLC	78.21	629	4,295	不動産
MULTICHOICE GROUP LTD	151.3	2,044	13,941	コミュニケーション・サービス
OLD MUTUAL LTD	2,308.4	2,885	19,679	金融
VODACOM GROUP LTD	231.2	2,883	19,662	コミュニケーション・サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD	311.2	3,986	27,185	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD	184	2,386	16,274	金融
BIDVEST GROUP LTD	107.7	1,830	12,486	資本財・サービス
BID CORP LTD	99.1	2,817	19,215	生活必需品
NETCARE LTD	876.9	1,103	7,523	ヘルスケア
STANDARD BANK GROUP LTD	482.2	6,137	41,860	金融
SASOL LTD	315.4	4,180	28,514	素材
REMGRO LTD	164.1	1,576	10,751	金融
DISCOVERY LTD	119.4	1,509	10,292	金融
EXXARO RESOURCES LTD	106.3	1,311	8,943	エネルギー
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	210.2	810	5,529	一般消費財・サービス
SANLAM LTD	531.2	3,074	20,965	金融
TIGER BRANDS LTD	87.8	1,753	11,956	生活必需品
FIRSTRAND LTD	1,185.3	5,614	38,292	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	478.6	1,738	11,855	一般消費財・サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	126.4	1,276	8,706	一般消費財・サービス
ABSA GROUP LTD	329.6	3,790	25,850	金融
NASPERS LTD-N SHS	23.29	7,369	50,258	一般消費財・サービス
MTN GROUP LTD	485.9	3,359	22,908	コミュニケーション・サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	87.3	1,442	9,836	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	185.8	2,353	16,051	ヘルスケア
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	69.5	2,220	15,143	素材
SAPPI LIMITED	561.8	1,629	11,111	素材
TELKOM SA SOC LTD	478	1,473	10,050	コミュニケーション・サービス
SPAR GROUP LIMITED/THE	99.7	1,919	13,089	生活必需品
MR PRICE GROUP LTD	90	1,512	10,311	一般消費財・サービス
SIBANYE STILLWATER LTD	341	1,763	12,028	素材
南アフリカ・ランド 通貨計	11,114 32銘柄	81,077	552,948 <4.8%>	
(タイ)	百株	千タイ・バーツ	千円	
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	276	3,394	11,644	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR	404	15,230	52,241	素材
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	281	3,203	10,987	金融
KASIKORN BANK PCL-NVDR	209	2,372	8,136	金融
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,424	12,709	43,592	金融
THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	372	1,311	4,497	金融
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	1,018	3,079	10,562	素材
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	293	5,259	18,039	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	3,470	3,886	13,330	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	4,455	3,898	13,370	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	527	5,296	18,166	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	11,661	3,288	11,279	エネルギー
PTT PCL-NVDR	7,759	32,393	111,110	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	822	4,089	14,026	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	878	5,421	18,596	生活必需品
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,715	5,016	17,206	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,658	9,782	33,552	素材
タイ・バーツ 通貨計	37,222 17銘柄	119,633	410,341 <3.5%>	
ファンド合計	815,360.48 399銘柄	—	10,885,466 <94.1%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2020年11月30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	株数	2020年11月30日現在	
		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
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	167.6	3,403	353,636
アメリカ・ドル 通貨計	167.6 1銘柄	3,403	353,636 <3.1%>
(メキシコ)	千口	千メキシコ・ペソ	千円
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	100.4	1,999	10,379
メキシコ・ペソ 通貨計	100.4 1銘柄	1,999	10,379 <0.1%>
(南アフリカ)	千口	千南アフリカ・ランド	千円
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	76.93	954	6,511
南アフリカ・ランド 通貨計	76.93 1銘柄	954	6,511 <0.1%>
合計	344.93 3銘柄	—	370,527 <3.2%>

(注1) 邦貨換算金額は、2020年11月30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11月30日現在	
	買建額	売建額
外国 MSCI EMGMKT(アメリカ)	百万円 333	百万円 —

(注1) 外貨建の評価額は、2020年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第21期 (決算日 2020年11月30日)

(作成対象期間 2019年12月3日～2020年11月30日)

外国株式インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

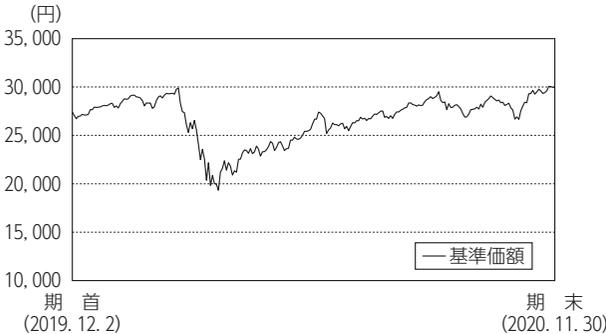
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



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

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：27,400円 期末：30,015円 騰落率：9.5%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外株式市況

米国・欧州を中心とする海外株式市況は上昇しました。

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

○為替相場

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

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

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

《今後の運用方針》

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

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)	1円 (1)
(新株予約権証券)	(0)
(先物・オプション)	(1)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税 (株式)	1 (1)
(新株予約権証券)	(0)
(投資信託証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	6 (5)
(その他)	(1)
合 計	9

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「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12月3日から2020年11月30日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外	アメリカ	百株 13,951.06 (5,785.26)	千アメリカ・ドル 120,851 (△ 1,850)	百株 3,579.94	千アメリカ・ドル 7,291
	カナダ	百株 2,300 (△ 531.9)	千カナダ・ドル 8,965 (△ 334)	百株 1,004.89	千カナダ・ドル 766
外	オーストラリア	百株 3,173.5 (168.63)	千オーストラリア・ドル 5,992 (29)	百株 2,203.5	千オーストラリア・ドル 784
	香港	百株 4,988 (△1,164.65)	千香港・ドル 19,598 (1)	百株 1,808.76	千香港・ドル 5,917
外	シンガポール	百株 2,172 (777.41)	千シンガポール・ドル 1,314 (78)	百株 2,279.36	千シンガポール・ドル 434
	ニュージーランド	百株 416 (1)	千ニュージーランド・ドル 336 (1)	百株 271	千ニュージーランド・ドル 95
国	イギリス	百株 11,087 (2,157.85)	千イギリス・ポンド 6,541 (△ 2)	百株 5,181.43	千イギリス・ポンド 898
	イスラエル	百株 181 (17.64)	千イスラエル・シェケル 825 (1)	百株 17.64	千イスラエル・シェケル 17
国	スイス	百株 749.8 (0.12)	千スイス・フラン 5,444 (△ 120)	百株 114.3	千スイス・フラン 248
	デンマーク	百株 332.9 (1)	千デンマーク・クローネ 13,986 (1)	百株 67.2	千デンマーク・クローネ 1,876
国	ノルウェー	百株 327.5 (1)	千ノルウェー・クローネ 5,160 (1)	百株 58	千ノルウェー・クローネ 821

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	スウェーデン	百株 2,038.7 (149.5)	千スウェーデン・クローネ 32,967 (1)	百株 492.5	千スウェーデン・クローネ 3,861
	ユーロ (アイルランド)	百株 52.3 (17.1)	千ユーロ 307 (148)	百株 504.6	千ユーロ 67
	ユーロ (オランダ)	百株 931.7 (△ 156.16)	千ユーロ 3,213 (△ 132)	百株 19	千ユーロ 73
	ユーロ (ベルギー)	百株 99.7 (1)	千ユーロ 704 (1)	百株 1	千ユーロ 1
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 130.2 (39.6)	千ユーロ 172 (1)	百株 1	千ユーロ 1
	ユーロ (フランス)	百株 1,114.6 (63)	千ユーロ 5,332 (△ 1)	百株 147.7	千ユーロ 407
	ユーロ (ドイツ)	百株 1,178 (143.75)	千ユーロ 5,396 (△ 89)	百株 63.2	千ユーロ 114
	ユーロ (ポルトガル)	百株 164 (827)	千ユーロ 99 (1)	百株 827	千ユーロ 7
	ユーロ (スペイン)	百株 1,954.7 (11,894.41)	千ユーロ 1,400 (244)	百株 13,870.5	千ユーロ 382
	国	ユーロ (イタリア)	百株 2,307.5 (1)	千ユーロ 1,399 (1)	百株 1
国	ユーロ (フィンランド)	百株 419 (1)	千ユーロ 479 (1)	百株 71	千ユーロ 180
	ユーロ (オーストリア)	百株 31.5 (1)	千ユーロ 65 (1)	百株 1	千ユーロ 1
国	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 8,383.2 (12,828.7)	千ユーロ 18,571 (168)	百株 15,503	千ユーロ 1,234

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 新株予約権証券

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外	アメリカ	証券 3,515	千アメリカ・ドル 54	証券 3,515 (1)	千アメリカ・ドル 16 (1)
	スイス	証券 34,320	千スイス・フラン 7	証券 1 (1)	千スイス・フラン 1 (1)

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 単位未満は切捨て。

(3) 投資信託証券

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

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

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

種 類 別	買 建		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 51,901	百万円 52,708	百万円 —	百万円 —

- (注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄
株 式

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

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 30.95	千円 593,011	円 19,160	BANK OF AMERICA CORP (アメリカ)	千株 15.2	千円 40,017	円 2,632
AMAZON.COM INC (アメリカ)	2.15	531,816	247,356	INGENICO GROUP (フランス)	1.97	32,329	16,410
APPLE INC (アメリカ)	18.5	428,420	23,157	POWER FINANCIAL CORP (カナダ)	8	23,323	2,915
FACEBOOK INC-CLASS A (アメリカ)	11.1	245,450	22,112	WHEELOCK & CO LTD (香港)	27	23,229	860
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	1.42	208,392	146,755	APPLE INC (アメリカ)	0.5	19,006	38,013
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	9.2	198,293	21,553	GRUBHUB INC (アメリカ)	3.1	18,947	6,111
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	11.4	175,993	15,438	FLEX LTD (シンガポール)	17.25	18,027	1,045
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	1.14	165,289	144,990	POLARIS INC (アメリカ)	1.75	16,465	9,408
NVIDIA CORP (アメリカ)	3.8	139,808	36,791	SUN HUNG KAI PROPERTIES (香港)	10.5	15,103	1,438
SALESFORCE.COM INC (アメリカ)	6	136,527	22,754	MICROSOFT CORP (アメリカ)	0.7	14,844	21,205

- (注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

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

銘柄	期首		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	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	158	184	928	96,439	生活必需品
BUNGE LTD	40	44.5	270	28,126	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	98.25	106.75	1,230	127,881	情報技術
APPLE INC	1,298	5,678	66,199	6,877,497	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	94	102	804	83,576	金融
BOEING CO/THE	149.9	175.6	3,801	394,962	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	44.65	51.65	401	41,752	金融
BECTON DICKINSON AND CO	76.49	94.19	2,156	224,046	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	67	67	123	12,870	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	38.5	43.5	444	46,222	情報技術
CDK GLOBAL INC	36	40	186	19,423	情報技術
NISOURCE INC	110.5	126	308	32,083	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	38.5	44.5	412	42,865	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	243.21	260.21	1,039	107,997	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,169.04	1,355.04	8,208	852,815	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	363.5	455.5	10,547	1,095,738	金融
ANSYS INC	24.5	27.8	918	95,427	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	215.5	444.17	2,154	223,802	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	190	222	1,343	139,603	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	668.5	740	4,665	484,719	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	910.7	997.7	12,094	1,256,458	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	69.5	77	1,121	116,497	金融
LKQ CORP	94	91.5	329	34,202	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	13.5	16.6	284	29,557	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	90.62	100.62	816	84,777	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	83	93	1,084	112,636	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	38.1	40.1	764	79,466	金融
DOLLAR GENERAL CORP	75	83.5	1,820	189,119	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	51.6	62.6	3,302	343,047	情報技術
CATERPILLAR INC	162	176.5	3,090	321,036	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	70	79.5	362	37,678	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	63	73	334	34,726	公益事業
CMS ENERGY CORP	82	93	576	59,883	公益事業
MOSAIC CO/THE	109.5	120.5	273	28,392	素材
DELTA AIR LINES INC	47.5	51.5	211	21,968	資本財・サービス
CORNING INC	232	246	912	94,790	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,210.5	1,382.5	5,903	613,291	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	37	42	214	22,309	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	356.5	459.02	2,930	304,437	金融
WABCO HOLDINGS INC	15.5	—	—	—	その他
MSCI INC	24.5	28.2	1,134	117,847	金融
FAIR ISAAC CORP	—	10	473	49,193	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	10	11	318	33,136	資本財・サービス
MIDDLEBY CORP	16	—	—	—	資本財・サービス
COTY INC-CL A	84.39	—	—	—	生活必需品
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	65	75	522	54,246	情報技術
BROADCOM INC	111.22	130.52	5,154	535,541	情報技術
ACUITY BRANDS INC	11.5	—	—	—	資本財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	33.3	37.8	490	50,996	ヘルスケア
ARAMARK	70.5	72	260	27,062	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	60.5	72.5	209	21,775	素材
DTE ENERGY COMPANY	52.5	62.5	803	83,456	公益事業
CENTENE CORP	121.5	189.87	1,199	124,606	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	32	35	320	33,347	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	130.5	143	488	50,719	金融

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	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	53.5	61.5	712	74,025	金融
GARTNER INC	27.2	29.2	445	46,277	情報技術
SPLUNK INC	45	51.8	1,056	109,798	情報技術
DOMINION ENERGY INC	226.41	276.41	2,184	226,973	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	117	128.5	1,081	112,339	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	41.5	42.5	242	25,202	資本財・サービス
DEERE & CO	87.5	96.5	2,527	262,614	資本財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	81.84	98.84	1,947	202,320	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	25	28.3	402	41,772	情報技術
CABLE ONE INC	—	1.7	333	34,652	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	19	21.9	485	50,413	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	34.5	37	470	48,864	金融
VAIL RESORTS INC	11.2	13.6	384	39,938	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	41	46	201	20,903	金融
TARGA RESOURCES CORP	65.5	—	—	—	エネルギー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	18	22.5	270	28,101	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	21.8	24.3	226	23,510	金融
WESTLAKE CHEMICAL CORP	10.5	—	—	—	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	92	109	847	88,066	公益事業
COGNEX CORP	50.5	55	409	42,568	情報技術
TELEFLEX INC	13.3	15	556	57,822	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	26	28	378	39,354	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	22	24	667	69,305	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	6.5	7.1	379	39,467	ヘルスケア
WELLCARE HEALTH PLANS INC	15.2	—	—	—	その他
CATALENT INC	—	51.5	501	52,112	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	38	44.8	1,238	128,667	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	—	20	414	43,014	ヘルスケア
IDEX CORP	22.5	25.2	484	50,360	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	230.5	268	2,275	236,382	生活必需品
ROLLINS INC	43.25	49.25	280	29,179	資本財・サービス
AMETEK INC	65.25	74.25	889	92,388	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	73.5	82	707	73,493	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	36.5	43.5	179	18,632	資本財・サービス
HEICO CORP	12	14	177	18,480	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	25.5	31	328	34,080	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	11.5	12.4	400	41,577	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	75	88.5	777	80,780	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	11	13	553	57,549	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	124	144.4	5,608	582,651	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	24	26	319	33,145	情報技術
GRUBHUB INC	26	—	—	—	一般消費財・サービス
EPAM SYSTEMS INC	16.5	18	586	60,953	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	38	43.5	381	39,619	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6.9	8.8	1,142	118,646	一般消費財・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	69.5	—	—	—	金融
UGI CORP	52	70.5	261	27,216	公益事業
CUMMINS INC	43.5	48.5	1,110	115,400	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	215.5	253	1,976	205,384	コミュニケーション・サービス
SABRE CORP	76.5	—	—	—	情報技術
CDW CORP/DE	43.5	46.5	614	63,878	情報技術
SIGNATURE BANK	15	16.5	190	19,747	金融
COSTAR GROUP INC	9.9	13.1	1,158	120,360	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	14.9	17.1	604	62,851	金融
AMERCO	2.2	2.9	118	12,275	資本財・サービス

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	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	18.5	31.5	636	66,101	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	12.7	14.8	2,239	232,700	一般消費財・サービス
HANESBRANDS INC	110	—	—	—	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	23	25	394	40,984	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	81.66	90.16	941	97,797	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	10.2	11.7	238	24,738	情報技術
DEXCOM INC	27	30	954	99,176	ヘルスケア
NORDSON CORP	—	17.3	353	36,731	資本財・サービス
COPART INC	58.5	68.5	789	81,988	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	46.5	51.5	224	23,284	エネルギー
SEAGEN INC	32.5	39.5	668	69,401	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	22.7	25.1	1,193	123,993	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	13.3	17.1	1,011	105,088	資本財・サービス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	26	28	267	27,797	ヘルスケア
NIELSEN HOLDINGS PLC	99	111	180	18,727	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	575.81	673.81	993	103,253	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	79	90	1,377	143,103	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	11.5	12.2	651	67,668	金融
CABOT OIL & GAS CORP	120.5	124	220	22,891	エネルギー
T-MOBILE US INC	100	183.27	2,417	251,136	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	34.5	45.5	491	51,075	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA CO/THE	1,141.5	1,336	7,040	731,460	生活必需品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	71	65	285	29,685	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	48.5	55.5	493	51,293	資本財・サービス
EATON VANCE CORP	30.5	—	—	—	金融
FRANKLIN RESOURCES INC	86.5	95	211	21,979	金融
CSX CORP	221.5	252.5	2,305	239,473	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	26.8	31.3	626	65,035	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	40.75	43.75	541	56,237	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	24	27.5	251	26,098	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	117.7	138.8	44,351	4,607,658	一般消費財・サービス
FLOWSERVE CORP	35.5	—	—	—	資本財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	60	202.4	1,725	179,279	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,196.55	1,384.05	5,562	577,887	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	37.5	42	164	17,073	情報技術
AES CORP	201	219	460	47,870	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	12.4	13.5	315	32,741	金融
EOG RESOURCES INC	164	193	992	103,121	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	48.5	52	542	56,356	情報技術
ABIOMED INC	12.9	15.2	413	42,936	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	46.5	49.5	510	53,071	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	92.4	101.4	1,156	120,187	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1,109.23	1,263.23	1,148	119,294	一般消費財・サービス
DISCOVERY INC - A	46.9	46.9	128	13,389	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	37	48.5	573	59,551	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48.87	48.87	110	11,514	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	—	8.5	133	13,876	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	100.89	103.89	255	26,497	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	40	40	154	16,065	資本財・サービス
FORTINET INC	41.5	48	594	61,730	情報技術
MARKEL CORP	4.1	4.6	461	47,994	金融
NEXTERA ENERGY INC	135.5	640.8	4,814	500,160	公益事業
MASIMO CORP	—	17	432	44,932	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	434.08	472.08	1,110	115,352	素材
INSULET CORP	17.5	22.2	558	58,000	ヘルスケア

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	
US BANCORP	428	441.5	1,951	202,779	金融
UNITED RENTALS INC	23	23.5	547	56,862	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	17.5	19	312	32,480	情報技術
FASTENAL CO	163	186	903	93,873	資本財・サービス
FISERV INC	161.63	185.83	2,146	223,040	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	2,468.5	2,880.5	2,995	311,225	資本財・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	61	—	—	—	一般消費財・サービス
GENERAL MOTORS CO	361	426	1,919	199,422	一般消費財・サービス
TRIPADVISOR INC	33	—	—	—	コミュニケーション・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	69	79.5	1,208	125,590	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	92.9	107.6	2,532	263,143	金融
ALPHABET INC-CL A	84	98.2	17,548	1,823,117	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	87.47	98.87	17,729	1,841,893	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	31.5	33.5	248	25,858	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	168.5	200.5	1,205	125,250	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	152.68	180.68	482	50,155	公益事業
GENUINE PARTS CO	43	48.5	477	49,560	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	106.34	125.84	1,165	121,034	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	207	230	604	62,795	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	64.1	71.6	1,392	144,656	資本財・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	30	—	—	—	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	248	276	484	50,350	エネルギー
HOME DEPOT INC	310	352	9,714	1,009,275	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	17.5	19	254	26,408	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	299	318	396	41,164	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	11.9	12.9	212	22,049	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	43.5	47.4	701	72,905	生活必需品
HARLEY-DAVIDSON INC	44.5	—	—	—	一般消費財・サービス
HUMANA INC	38.3	43.5	1,768	183,701	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	81.5	93	1,478	153,564	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	21	23.6	690	71,774	情報技術
HENRY SCHEIN INC	45	45	286	29,770	ヘルスケア
HP INC	426	473	1,053	109,434	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	394	419	470	48,840	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	48	59.78	252	26,227	コミュニケーション・サービス
HOLLYFRONTIER CORP	47	—	—	—	エネルギー
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	60	65	276	28,760	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	25	29.5	124	12,890	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	119	132	435	45,295	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	198.53	217.53	714	74,215	生活必需品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	250	291.5	3,624	376,580	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	107	122	618	64,247	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	40	43.5	369	38,417	資本財・サービス
ZOETIS INC	135.5	156	2,518	261,691	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	69.79	79.79	1,144	118,952	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	65.5	76.5	449	46,715	エネルギー
ALLEGION PLC	26.5	29	331	34,430	資本財・サービス
LEGGETT & PLATT INC	35	—	—	—	一般消費財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	117.73	129.73	283	29,408	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	75.57	85.07	887	92,250	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	96.5	105	233	24,227	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC	22	24	333	34,695	ヘルスケア
JM SMUCKER CO/THE	34.2	36.7	427	44,418	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	748	862	12,412	1,289,565	ヘルスケア
ABBVIE INC	417.79	577.72	6,059	629,542	ヘルスケア

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	
HOLOGIC INC	75.5	83.5	580	60,298	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	99.5	112.5	1,590	165,227	生活必需品
KROGER CO	229.5	255	826	85,913	生活必需品
KLA CORP	46.5	50.3	1,278	132,799	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	71.7	82.6	3,092	321,232	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	25.6	27.8	743	77,286	情報技術
LOWE'S COS INC	224.5	244.5	3,781	392,878	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	246.05	281.85	4,155	431,724	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	42.3	48.2	2,200	228,612	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	14.5	16.5	221	22,963	不動産
LOEWS CORP	79	83	360	37,431	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	57.99	62.49	307	31,915	金融
MCDONALD'S CORP	216	243	5,305	551,179	一般消費財・サービス
3M CO	162.5	188.5	3,334	346,408	資本財・サービス
FACEBOOK INC-CLASS A	676.5	787.5	21,877	2,272,857	コミュニケーション・サービス
MANPOWERGROUP INC	17.8	—	—	—	資本財・サービス
S&P GLOBAL INC	69.8	79	2,698	280,337	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	18.4	21.1	571	59,407	素材
CONCHO RESOURCES INC	58	62	384	39,948	エネルギー
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	66	—	—	—	その他
PHILLIPS 66	128.5	141.5	923	95,890	エネルギー
TECHNIPFMC PLC	121	—	—	—	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	144.5	152.5	436	45,343	一般消費財・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	77.88	—	—	—	情報技術
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	33.5	40.5	755	78,462	生活必需品
MYLAN NV	148.5	—	—	—	その他
METLIFE INC	235	255.5	1,212	125,950	金融
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	181	217	978	101,696	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	15.1	18.7	509	52,951	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	48	48	220	22,899	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	47.78	56.58	981	101,961	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6.4	8	901	93,640	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	144.73	213.73	422	43,920	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	33.8	37.6	962	99,973	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	727.21	826.21	6,598	685,477	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	211.68	242.18	1,563	162,383	素材
MASCO CORP	86	87	471	49,024	資本財・サービス
M & T BANK CORP	35.69	42.89	518	53,906	金融
MARSH & MCLENNAN COS	144.5	168.5	1,926	200,192	金融
BLACK KNIGHT INC	44	50	452	47,025	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	23	25	284	29,535	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	78.72	91.22	1,170	121,635	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	48	56.8	1,271	132,098	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	18.5	21	547	56,872	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	101	118	2,507	260,528	情報技術
TRANSUNION	55	61.5	571	59,324	資本財・サービス
VISTRA CORP	100.5	142.5	279	29,001	公益事業
CAPRI HOLDINGS LTD	44.5	—	—	—	一般消費財・サービス
BEIGENE LTD-ADR	10.5	14.5	414	43,066	ヘルスケア
NETAPP INC	74.5	74.5	396	41,222	情報技術
NIKE INC -CL B	355.5	406	5,450	566,257	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	75	84.5	2,050	213,076	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	68	80	1,064	110,547	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	37.5	41.5	384	39,971	金融
ALLY FINANCIAL INC	114.5	125.5	384	39,988	金融

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	
NORTHROP GRUMMAN CORP	44.5	52.2	1,597	165,961	資本財・サービス
APTIV PLC	72	87	1,060	110,142	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	231.61	264.61	1,547	160,763	素材
MCKESSON CORP	55.5	52.5	945	98,176	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	81	87	716	74,485	情報技術
XYLEM INC	51.5	58.7	570	59,239	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	440.5	510	3,870	402,147	生活必需品
NUCOR CORP	87	99	545	56,640	素材
SUNRUN INC	—	39	260	27,045	資本財・サービス
WESTERN UNION CO	129.46	129.46	291	30,288	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	53	57	453	47,077	情報技術
NEWELL BRANDS INC	122.92	125.42	264	27,453	一般消費財・サービス
EVERGY INC	68.5	74	412	42,875	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	257.24	302.24	500	51,997	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	7	8.2	185	19,302	金融
OKTA INC	30	38.6	911	94,655	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	—	21.8	712	74,045	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	31.5	36	568	59,081	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	107.05	133.55	418	43,454	ヘルスケア
LINDE PLC	152.96	171.96	4,426	459,896	素材
WIX.COM LTD	14.5	17.8	460	47,825	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	83	133	345	35,925	金融
KKR & CO INC	147	163	630	65,551	金融
PAYCHEX INC	93.5	107	999	103,792	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	22	24.1	1,067	110,953	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	528.5	611.5	2,468	256,465	生活必需品
P G & E CORP	—	355	451	46,949	公益事業
PFIZER INC	1,571.13	1,819.13	6,772	703,607	ヘルスケア
CIGNA CORP	106.8	121.6	2,584	268,451	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	45.51	78.51	548	56,948	情報技術
ALTICE USA INC- A	41	109	374	38,875	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	148.5	174.5	1,179	122,586	公益事業
STERIS PLC	25	28.5	546	56,756	ヘルスケア
FOX CORP - CLASS B	48.33	54.33	156	16,216	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	99.99	108.49	316	32,866	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	95	111.2	2,588	268,955	ヘルスケア
DOW INC	210.68	240.68	1,333	138,523	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	—	28	167	17,398	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	51.8	2,442	253,797	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	37.5	41.7	1,137	118,204	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	52	315	1,597	165,982	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	46.5	53.5	588	61,178	エネルギー
POLARIS INC	15.5	—	—	—	一般消費財・サービス
PROCTER & GAMBLE CO/THE	707.67	809.17	11,215	1,165,220	生活必需品
EXELON CORP	273.72	322.72	1,347	139,943	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	66	73.5	910	94,555	ヘルスケア
TELADOC HEALTH INC	—	23	451	46,941	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	—	113.58	508	52,863	資本財・サービス
NVR INC	1	1.1	453	47,085	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	319	355	1,518	157,776	エネルギー
TWILIO INC - A	31.5	40.5	1,292	134,241	情報技術
DOCUSIGN INC	29	57.5	1,304	135,524	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	14	16.1	670	69,710	情報技術
MATCH GROUP INC	18	—	—	—	その他
PEPSICO INC	395.5	454	6,564	682,021	生活必需品

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	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	11	13	147	15,288	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	52	80	156	16,240	情報技術
MONGODB INC	12.5	16.2	437	45,444	情報技術
SNAP INC - A	208	295	1,357	141,070	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	215.68	248.18	953	99,034	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	118	128	999	103,843	金融
AMCOR PLC	479	522	599	62,256	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	—	46.5	701	72,864	情報技術
ROKU INC	24	33.5	922	95,826	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	51.5	60	922	95,826	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	180.8	208.5	5,215	541,786	情報技術
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	—	126	512	53,237	情報技術
PENTAIR PLC	47.05	55.05	292	30,368	資本財・サービス
QUALCOMM INC	343.5	364.5	5,242	544,654	情報技術
INVESCO LTD	109.5	120	204	21,206	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	20.5	23.5	352	36,604	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	83.5	92	472	49,127	金融
DATADOG INC - CLASS A	—	43.5	419	43,574	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	45	131	913	94,886	コミュニケーション・サービス
RAYTHEON COMPANY	79.2	—	—	—	その他
DISH NETWORK CORP-RTS	3.49	—	—	—	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	—	25	422	43,901	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	22	33.2	1,706	177,303	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	67.5	74	718	74,602	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	12.3	13.5	2,771	287,890	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	107	118	1,292	134,285	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	26.5	31	411	42,759	素材
RESMED INC	41.5	48.5	1,016	105,630	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	38	43.5	542	56,399	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	33.5	36	235	24,501	資本財・サービス
MODERNA INC	—	88	1,117	116,134	ヘルスケア
RALPH LAUREN CORP	14.5	14.5	127	13,253	一般消費財・サービス
PERKINELMER INC	31	37.3	482	50,089	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	—	266.37	1,007	104,632	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	—	137.18	923	95,970	資本財・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	58	254	26,434	金融
AVANTOR INC	—	155	408	42,431	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	—	47	134	13,979	金融
DYNATRACE INC	—	61	234	24,347	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	—	13.3	1,161	120,639	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	302.35	321.35	501	52,147	金融
IAC/INTERACTIVECORP	—	25.3	360	37,449	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	—	81.7	1,140	118,515	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	538.18	610.18	5,571	578,828	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A	—	65	708	73,592	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	—	24	359	37,335	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	103	123.5	775	80,562	公益事業
TESLA INC	37.7	242.7	14,216	1,476,941	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	—	10	328	34,157	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	184.5	178.5	323	33,583	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	44.22	50.22	942	97,934	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	43.5	50.4	1,136	118,031	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	44.15	46.85	3,011	312,866	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	—	386.21	658	68,410	ヘルスケア
CBRE GROUP INC - A	91.5	108.5	663	68,906	不動産

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	
TWITTER INC	211.5	259.5	1,209	125,604	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	293.5	347.5	2,107	218,957	公益事業
SYSCO CORP	137	160	1,139	118,417	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	73.03	84.03	1,129	117,364	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	39.5	43	239	24,842	金融
STEEL DYNAMICS INC	62	66	248	25,815	素材
SCHLUMBERGER LTD	392.02	460.02	1,006	104,567	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	46	50.5	255	26,520	資本財・サービス
AT&T INC	2,065.91	2,332.91	6,772	703,588	コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	40.5	47	224	23,305	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	123	129	369	38,396	情報技術
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	23.3	26.9	1,979	205,632	素材
SEMPRA ENERGY	79	96.7	1,261	131,062	公益事業
TIFFANY & CO	32.5	36.5	480	49,948	一般消費財・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	71	76.5	447	46,477	情報技術
TEXAS INSTRUMENTS INC	265	297.5	4,729	491,394	情報技術
SALESFORCE.COM INC	234.21	294.21	7,285	756,892	情報技術
WESTROCK CO	71.3	85.3	375	39,045	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	229.84	244.84	1,125	116,931	資本財・サービス
TERADYNE INC	50	55	601	62,510	情報技術
UNION PACIFIC CORP	199.5	219.8	4,519	469,579	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	248	—	—	—	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	193.88	215.88	894	92,895	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	231.37	494.79	3,656	379,924	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	197	230.5	3,892	404,434	資本財・サービス
UNUM GROUP	59	—	—	—	金融
SPRINT CORP	231.65	—	—	—	その他
IQVIA HOLDINGS INC	48.94	62.44	1,054	109,505	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	43.5	43.5	258	26,812	金融
AMEREN CORPORATION	72	80.5	635	66,060	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	267.76	310.16	10,481	1,088,927	ヘルスケア
VERISIGN INC	30	33.7	675	70,203	情報技術
VALERO ENERGY CORP	117.42	131.42	744	77,304	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	16.1	17.6	495	51,432	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	81.88	86.88	317	32,998	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	25	25	330	34,312	ヘルスケア
ANTHEM INC	72.8	83	2,596	269,723	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	509.12	591.62	8,704	904,311	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,209.22	1,274.22	3,626	376,749	金融
WASTE MANAGEMENT INC	119.5	140	1,668	173,357	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	347	402	862	89,625	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	34.5	37	515	53,572	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	19	19.5	391	40,711	一般消費財・サービス
WALMART INC	405	464	7,034	730,787	生活必需品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	29	—	—	—	資本財・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	58	67.5	1,012	105,202	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	29	30.5	308	32,073	一般消費財・サービス
XEROX HOLDINGS CORP	59.11	—	—	—	情報技術
WABTEC CORP	54.11	58.61	432	44,948	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	342.5	394	2,490	258,776	一般消費財・サービス
WATERS CORP	20.5	20.5	467	48,615	ヘルスケア
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	18	—	—	—	資本財・サービス
ALLERGAN PLC	91.57	—	—	—	その他
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	16.5	17.6	663	68,933	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	220	247	963	100,077	生活必需品

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	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	37.23	41.73	874	90,846	金融
WESTERN DIGITAL CORP	84	97.5	447	46,442	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	90.8	104.8	1,003	104,238	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	146	168	997	103,586	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	489.5	552	11,647	1,210,027	情報技術
PPL CORP	211	248	721	75,001	公益事業
PULTEGROUP INC	75	89	394	41,016	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	67.5	78.5	1,160	120,519	素材
NORTHERN TRUST CORP	60	64	615	63,923	金融
NVIDIA CORP	163	201	10,662	1,107,679	情報技術
IAC/INTERACTIVECORP	23.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	127.43	138.43	1,935	201,038	金融
HD SUPPLY HOLDINGS INC	53	53	295	30,729	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	83	98	637	66,177	生活必需品
NETFLIX INC	123.2	144	7,075	735,082	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	113	129.2	5,857	608,580	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	79.5	79.5	258	26,850	公益事業
GLOBE LIFE INC	29.25	32.25	309	32,171	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	48.5	57	742	77,183	金融
TEXTRON INC	68.5	71.5	335	34,815	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	117.37	131.37	232	24,170	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	59.5	67.5	227	23,597	公益事業
OMNICOM GROUP	64	71.5	450	46,797	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	676.83	720.33	4,160	432,247	情報技術
MASTERCARD INC - A	255	292	9,900	1,028,598	情報技術
ONEOK INC	119	144	536	55,696	エネルギー
CENTURYLINK INC	294.52	311.52	325	33,852	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	30.2	34.2	1,432	148,801	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	89.5	98	1,050	109,122	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	30.5	37	652	67,810	コミュニケーション・サービス
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	13.3	—	—	—	情報技術
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	56.5	60.5	283	29,415	生活必需品
NOBLE ENERGY INC	145.5	—	—	—	その他
BANK OF AMERICA CORP	2,554.01	2,556.01	7,409	769,811	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	10.5	12.1	467	48,553	資本財・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	52.5	58.5	470	48,863	ヘルスケア
NORDSTROM INC	30	—	—	—	一般消費財・サービス
AMERICAN EXPRESS CO	200	226	2,725	283,134	金融
ANALOG DEVICES INC	106.49	121.99	1,680	174,578	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	291	383	3,339	346,927	情報技術
TD AMERITRADE HOLDING CORP	83	—	—	—	その他
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	245.22	283.22	1,124	116,841	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	51.5	55	748	77,801	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	49.5	59	480	49,943	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	25	27.5	413	42,940	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	165	179	1,403	145,813	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	174	197	1,539	159,964	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	69.7	76.2	1,574	163,537	金融
AMGEN INC	173	192.5	4,327	449,593	ヘルスケア
TAPESTRY INC	83.5	—	—	—	一般消費財・サービス
EATON CORP PLC	121.36	130.86	1,595	165,723	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	46.8	55.8	1,142	118,729	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	272	302	2,496	259,343	情報技術
CME GROUP INC	101	118	2,062	214,250	金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	116.94	116.94	153	15,975	エネルギー

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	
ECOLAB INC	75.5	84.5	1,899	197,354	素材
EQUIFAX INC	33.5	40.5	667	69,315	資本財・サービス
GAP INC/THE	59.5	—	—	—	一般消費財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	359.5	411.5	2,470	256,632	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	—	115	353	36,750	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	83.5	96	453	47,074	生活必需品
STATE STREET CORP	109.43	117.43	840	87,338	金融
SUNTRUST BANKS INC	129.48	—	—	—	その他
SCHWAB (CHARLES) CORP	340	502.9	2,499	259,664	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	136	169	1,283	133,383	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	48.5	60	293	30,531	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	38.5	45.5	434	45,171	素材
CARDINAL HEALTH INC	90	94.5	508	52,799	ヘルスケア
FEDEX CORP	69	82	2,356	244,844	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	135.04	151.04	1,325	137,709	金融
FMC CORP	39.5	42	485	50,471	素材
FLEX LTD	147.5	—	—	—	情報技術
CERNER CORP	93.5	100.5	744	77,367	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	30.24	28.24	318	33,114	素材
CITRIX SYSTEMS INC	37	38	465	48,337	情報技術
INTEL CORP	1,266.5	1,386	6,576	683,239	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	115	124	282	29,371	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	103.5	116.5	533	55,468	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	94.5	103	2,185	227,100	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	461	346	226	23,544	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	40.4	48.5	1,537	159,740	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	44	50	222	23,131	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	32.1	38.2	2,787	289,636	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	34.5	40.5	484	50,372	情報技術
SNAP-ON INC	15.5	16.3	288	29,973	資本財・サービス
CARMAX INC	49.5	53.5	510	53,007	一般消費財・サービス
COMERICA INC	45	45	231	24,071	金融
INGREDION INC	19	21.5	171	17,857	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	205.28	241.78	2,287	237,621	公益事業
TARGET CORP	144	162.8	2,926	304,050	一般消費財・サービス
DOVER CORP	42.5	48	594	61,775	資本財・サービス
VWV GRAINGER INC	14	14.9	617	64,175	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	39.5	42.5	449	46,740	資本財・サービス
CINTAS CORP	26.2	29.4	1,061	110,290	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	138	158	567	58,994	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	41	47.5	347	36,117	生活必需品
CLOROX COMPANY	37.5	40.5	822	85,451	生活必需品
ENERGY CORP	54	66.5	741	77,038	公益事業
MICROSOFT CORP	2,056.5	2,359	50,772	5,274,781	情報技術
INCYTE CORP	53.5	60	499	51,893	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	367.69	429.69	2,916	302,975	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	379.38	438.98	5,030	522,594	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	312	366.5	2,354	244,560	情報技術
BLACKROCK INC	32	50	3,575	371,463	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	149	158	380	39,509	公益事業
HASBRO INC	36	44	406	42,200	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	73	84	533	55,397	生活必需品
KEYCORP	299	326	532	55,306	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	30	31.5	596	62,014	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	406.61	468.11	2,689	279,439	生活必需品

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
KOHL'S CORP	49.5	—	—	—	一般消費財・サービス	
COOPER COS INC/THE	14	17.7	603	62,651	ヘルスケア	
APACHE CORP	106.1	—	—	—	エネルギー	
CHUBB LTD	129.49	148.69	2,251	233,904	金融	
ARROW ELECTRONICS INC	24	27	251	26,089	情報技術	
ALLSTATE CORP	96	102.5	1,067	110,895	金融	
EBAY INC	233.5	256.5	1,316	136,809	一般消費財・サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	315	365	7,715	801,587	情報技術	
EASTMAN CHEMICAL CO	41.5	45.5	454	47,222	素材	
XILINX INC	71.5	80	1,099	114,270	情報技術	
DISH NETWORK CORP-A	64.5	82	294	30,591	コミュニケーション・サービス	
ZIONS BANCORP NA	52	52	205	21,317	金融	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	61	74.5	1,832	190,352	生活必需品	
TRIMBLE INC	70.5	82.5	498	51,811	情報技術	
LENNAR CORP-A	81	90	699	72,659	一般消費財・サービス	
LEAR CORP	18	18	263	27,414	一般消費財・サービス	
E*TRADE FINANCIAL CORP	70	—	—	—	その他	
PROGRESSIVE CORP	168	193	1,706	177,308	金融	
PACCAR INC	100.37	114.87	1,007	104,707	資本財・サービス	
PVH CORP	20	—	—	—	一般消費財・サービス	
BIOGEN INC	56.1	56.2	1,370	142,333	ヘルスケア	
IDEXX LABORATORIES INC	25.2	27.7	1,258	130,716	ヘルスケア	
STARBUCKS CORP	342.5	383.5	3,783	393,079	一般消費財・サービス	
PTC INC	31.5	37	401	41,748	情報技術	
PERRIGO CO PLC	38	42	201	20,957	ヘルスケア	
EVERSOURCE ENERGY	88.8	109.8	965	100,302	公益事業	
INTUIT INC	73.4	85.7	3,035	315,393	情報技術	
BORGWARNER INC	63	82	323	33,649	一般消費財・サービス	
BEST BUY CO INC	69	76	855	88,928	一般消費財・サービス	
BALL CORP	91.84	105.84	1,019	105,954	素材	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	392.97	470.97	1,582	164,401	ヘルスケア	
ELECTRONIC ARTS INC	86.5	95.7	1,188	123,453	コミュニケーション・サービス	
VULCAN MATERIALS CO	36.5	43.5	619	64,321	素材	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	72.5	85.5	1,938	201,377	ヘルスケア	
VF CORP	95	109	934	97,069	一般消費財・サービス	
VIACOMCBS INC - CLASS B	100.71	183.75	644	66,938	コミュニケーション・サービス	
VIACOM INC-CLASS B	100.71	—	—	—	その他	
MOHAWK INDUSTRIES INC	17.2	19	248	25,769	一般消費財・サービス	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	26	30.7	533	55,464	ヘルスケア	
CARNIVAL CORP	118.5	153	330	34,301	一般消費財・サービス	
COMCAST CORP-CLASS A	1,281.9	1,490.9	7,715	801,553	コミュニケーション・サービス	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	67	72	172	17,877	資本財・サービス	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	67	75	396	41,218	資本財・サービス	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	90	90	36	3,824	生活必需品	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	353	403	170	17,668	不動産	
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	85,908.78	102,065.16	1,043,158	108,373,741	
	銘柄数 < 比率 >	612銘柄	591銘柄		< 66.8% >	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
IMPERIAL OIL LTD	83	83	201	16,078	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	6	7	1,134	90,681	情報技術	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	59.96	—	—	—	エネルギー	
RESTAURANT BRANDS INTERN	71.87	92.87	705	56,377	一般消費財・サービス	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	132	149	760	60,765	素材	
INTACT FINANCIAL CORP	40.5	46.5	668	53,422	金融	

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	
BCE INC	45.3	49.3	281	22,478	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	57	62	1,050	83,994	素材
SUNCOR ENERGY INC	444.3	501.3	1,123	89,816	エネルギー
METRO INC/CN	77	82	492	39,374	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	95	110	808	64,621	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	346	399	2,589	206,999	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	125.5	146.5	1,628	130,174	金融
TORONTO-DOMINION BANK	516	594	4,211	336,706	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	83	91	277	22,197	金融
ROYAL BANK OF CANADA	405.5	467.5	5,056	404,265	金融
TC ENERGY CORP	261.5	310.5	1,841	147,233	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	146.29	178.29	607	48,564	エネルギー
BOMBARDIER INC-B	628	—	—	—	資本財・サービス
BARRICK GOLD CORP	514	586	1,725	137,975	素材
CAE INC	79	79	264	21,139	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	58.12	57.12	592	47,357	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	53	53	188	15,110	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	16	—	—	—	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	46.5	46.5	278	22,302	素材
HYDRO ONE LTD	92	105	311	24,907	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	54.6	59.6	383	30,639	生活必需品
WSP GLOBAL INC	30	37	353	28,291	資本財・サービス
PARKLAND CORP	44	44	174	13,926	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	53	53	174	13,962	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	72	77	419	33,507	公益事業
SSR MINING INC	—	72	165	13,233	素材
CANADIAN UTILITIES LTD-A	40	40	131	10,492	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	106	116	706	56,479	コミュニケーション・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	72	78	656	52,501	素材
STARS GROUP INC/THE	63	—	—	—	その他
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	150	189	386	30,885	公益事業
B2GOLD CORP	—	347	243	19,503	素材
AIR CANADA	41	41	101	8,148	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	379	403	375	30,061	素材
BANK OF MONTREAL	180	211	2,041	163,245	金融
POWER CORP OF CANADA	94	181	537	42,964	金融
METHANEX CORP	17	—	—	—	素材
SHOPIFY INC - CLASS A	28	35	4,700	375,804	情報技術
NUTRIEN LTD	165.19	188.19	1,210	96,744	素材
AURORA CANNABIS INC	198	—	—	—	ヘルスケア
CANOPY GROWTH CORP	62	74	277	22,186	ヘルスケア
CRONOS GROUP INC	55	55	59	4,766	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	58	88	457	36,599	素材
CAMECO CORP	106	128	169	13,539	エネルギー
TELUS CORP	54	108	272	21,793	コミュニケーション・サービス
POWER FINANCIAL CORP	80	—	—	—	その他
TECK RESOURCES LTD-CLS B	151	151	315	25,195	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	18	18	299	23,926	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	351	389	1,220	97,562	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	8	9	400	32,034	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	92	92	736	58,865	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	22.37	25.37	247	19,776	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	—	70	267	21,356	素材
BLACKBERRY LTD	160	160	127	10,220	情報技術

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	千カナダ・ドル	千円		
SUN LIFE FINANCIAL INC	174.5	192.5	1,139	91,080	金融	
ENBRIDGE INC	571	665	2,772	221,652	エネルギー	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	239.5	434.25	2,314	185,013	金融	
MANULIFE FINANCIAL CORP	560	638	1,430	114,360	金融	
BAUSCH HEALTH COS INC	95	105	265	21,255	ヘルスケア	
ENCANA CORP	368	—	—	—	その他	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	39	45	1,898	151,753	資本財・サービス	
IA FINANCIAL CORP INC	33	33	192	15,426	金融	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	63	63	220	17,593	一般消費財・サービス	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	204.5	233.5	3,305	264,306	資本財・サービス	
CGI INC - CLASS A	73	79	771	61,695	情報技術	
HUSKY ENERGY INC	93.58	—	—	—	エネルギー	
ONEX CORPORATION	26	26	185	14,821	金融	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	138	151	342	27,380	コミュニケーション・サービス	
IGM FINANCIAL INC	24	24	83	6,698	金融	
TMX GROUP LTD	—	19	240	19,190	金融	
OPEN TEXT CORP	81	87	506	40,474	情報技術	
CI FINANCIAL CORP	70	70	122	9,765	金融	
SAPUTO INC	71	80	288	23,031	生活必需品	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	193	193	348	27,836	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	256	283	1,216	97,291	生活必需品	
YAMANA GOLD INC	—	323	215	17,198	素材	
FORTIS INC	130	150	794	63,488	公益事業	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	—	38	337	26,944	資本財・サービス	
LUNDIN MINING CORP	194	194	200	16,006	素材	
CENOVUS ENERGY INC	314	314	218	17,472	エネルギー	
DOLLARAMA INC	90	97	511	40,892	一般消費財・サービス	
ATCO LTD -CLASS I	22	22	87	6,977	公益事業	
ALTAGAS LTD	79	91	173	13,874	公益事業	
FIRST CAPITAL REALTY INC	48	—	—	—	不動産	
KEYERA CORP	60	74	173	13,879	エネルギー	
INTER PIPELINE LTD	128	128	172	13,825	エネルギー	
カナダ・ドル通貨計	株数、金額	11,924.58	12,687.79	64,939	5,191,951	
	銘柄数 < 比率 >	86銘柄	82銘柄		<3.2%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
MEDIBANK PRIVATE LTD	788	888	256	19,737	金融	
BHP GROUP LTD	836.5	957.5	3,707	285,139	素材	
SOUTH32 LTD	1,516	1,516	372	28,682	素材	
ALUMINA LTD	693	—	—	—	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	266.5	305.5	694	53,406	エネルギー	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	425	565	1,049	80,694	素材	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	133	—	—	—	金融	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	794.5	1,024.5	2,389	183,748	金融	
WESTPAC BANKING CORP	973.48	1,173.48	2,397	184,385	金融	
SANTOS LTD	531	531	331	25,524	エネルギー	
AUSNET SERVICES	500	650	120	9,298	公益事業	
AUST AND NZ BANKING GROUP	798.5	924.5	2,134	164,177	金融	
RIO TINTO LTD	105	122.5	1,249	96,099	素材	
ORIGIN ENERGY LTD	535	535	277	21,355	エネルギー	
AURIZON HOLDINGS LTD	600	600	258	19,842	資本財・サービス	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	34	34	99	7,664	エネルギー	
COLES GROUP LTD	345.45	430.45	772	59,392	生活必需品	
WISETECH GLOBAL LTD	45	45	134	10,365	情報技術	

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	千オーストラリア・ドル	千円		
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	—	250	321	24,707	素材	
EVOLUTION MINING LTD	—	530	270	20,788	素材	
AFTERPAY LTD	—	70	662	50,983	情報技術	
TPG TELECOM LTD	—	120	93	7,171	コミュニケーション・サービス	
OIL SEARCH LTD	384	642	234	18,022	エネルギー	
SEEK LTD	96	107	278	21,445	コミュニケーション・サービス	
TREASURY WINE ESTATES LTD	205	235	216	16,682	生活必需品	
NEWCREST MINING LTD	234	260	704	54,170	素材	
INCITEC PIVOT LTD	498	—	—	—	素材	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	501.5	574.5	4,636	356,615	金融	
AMPOL LTD	71.5	79.5	243	18,728	エネルギー	
ORICA LTD	115	131	221	17,006	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	384.5	464.5	477	36,689	金融	
CIMIC GROUP LTD	28	28	71	5,504	資本財・サービス	
WOOLWORTHS GROUP LTD	362	413	1,551	119,304	生活必需品	
COCA-COLA AMATIL LTD	137	157	198	15,274	生活必需品	
TABCORP HOLDINGS LTD	577	727.63	285	21,993	一般消費財・サービス	
CROWN RESORTS LTD	116	116	115	8,876	一般消費財・サービス	
QANTAS AIRWAYS LTD	240	305	168	12,948	資本財・サービス	
TELSTRA CORP LTD	1,202	1,345	418	32,171	コミュニケーション・サービス	
AMP LTD	1,020	1,020	177	13,649	金融	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	133.5	142.5	556	42,764	素材	
MACQUARIE GROUP LTD	91.84	110.84	1,523	117,206	金融	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	174.5	184.5	612	47,082	一般消費財・サービス	
CSL LTD	127.5	147.5	4,469	343,730	ヘルスケア	
WESFARMERS LTD	323	370	1,845	141,970	一般消費財・サービス	
COCHLEAR LTD	16.5	20.5	455	35,034	ヘルスケア	
BLUESCOPE STEEL LTD	163	163	281	21,687	素材	
SUNCORP GROUP LTD	382.57	412.57	419	32,301	金融	
BORAL LTD	358	—	—	—	素材	
ASX LTD	58	62.5	482	37,128	金融	
COMPUTERSHARE LTD	139	159	225	17,376	情報技術	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	140	—	—	—	一般消費財・サービス	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	709.36	709.36	377	29,024	金融	
SONIC HEALTHCARE LTD	132.5	143.5	477	36,707	ヘルスケア	
CHALLENGER LTD	174	—	—	—	金融	
WORLEY LTD	94	—	—	—	エネルギー	
AGL ENERGY LTD	190	190	260	20,048	公益事業	
BRAMBLES LTD	474	504	559	43,026	資本財・サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	14	—	—	—	一般消費財・サービス	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	42.5	57.5	366	28,161	ヘルスケア	
TPG CORP LTD	87	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
REA GROUP LTD	16	16	226	17,396	コミュニケーション・サービス	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	38	38	231	17,821	金融	
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	20,170.2 58 銘柄	21,308.83 53 銘柄	40,966 <1.9% >	3,150,719	
(香港)		百株	百株	千香港・ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	405	475	1,957	26,223	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	650	770	4,754	63,713	一般消費財・サービス	
MTR CORP	455	525	2,249	30,144	資本財・サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	455	445	4,685	62,790	不動産	
SINO LAND CO	900	1,040	1,092	14,632	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	771.69	956.69	5,500	73,712	資本財・サービス	

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 PACIFIC LTD - CL A	155	155	720	9,658	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	470	560	4,088	54,779	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	435.07	485.07	1,566	20,994	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	2,901.99	3,773.58	4,566	61,184	公益事業	
HANG SENG BANK LTD	225	261	3,591	48,124	金融	
WHEELOCK & CO LTD	240	—	—	—	その他	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,830	525	2,173	29,124	不動産	
WH GROUP LTD	2,950	3,210	2,105	28,217	生活必需品	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	337	419	16,181	216,835	金融	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	570	660	1,323	17,732	不動産	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	93	108	1,003	13,444	情報技術	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	190	—	—	—	一般消費財・サービス	
NWS HOLDINGS LTD	425	—	—	—	資本財・サービス	
KERRY PROPERTIES LTD	175	225	450	6,030	不動産	
BANK OF EAST ASIA LTD	366.4	452.4	743	9,966	金融	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	—	260	902	12,089	ヘルスケア	
SJM HOLDINGS LTD	580	580	528	7,080	一般消費財・サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	326	382	899	12,054	不動産	
CK ASSET HOLDINGS LTD	741.69	911.69	3,988	53,447	不動産	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	200	200	801	10,733	公益事業	
PCCW LTD	1,170	1,470	686	9,198	コミュニケーション・サービス	
AIA GROUP LTD	3,730	4,194	37,116	497,366	金融	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	360	570	2,146	28,757	不動産	
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	220	—	—	—	生活必需品	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	344	609	1,689	22,645	生活必需品	
SANDS CHINA LTD	720	824	2,727	36,547	一般消費財・サービス	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	410	470	4,756	63,735	資本財・サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,075	1,255	3,162	42,378	金融	
WYNN MACAU LTD	420	540	740	9,927	一般消費財・サービス	
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	25,296.84 34銘柄	27,311.43 31銘柄	118,901	1,593,274 <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	348	420	968	75,244	金融	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	497	629	1,615	125,490	金融	
SINGAPORE AIRLINES LTD	149.7	436.75	196	15,302	資本財・サービス	
KEPPEL CORP LTD	429	513	268	20,884	資本財・サービス	
UOL GROUP LTD	140	140	105	8,211	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	136	161	126	9,843	不動産	
CAPITALAND LTD	775	829	260	20,223	不動産	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	693	913	83	6,525	資本財・サービス	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	514	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	27	27	56	4,405	一般消費財・サービス	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	937	1,164	1,181	91,787	金融	
GENTING SINGAPORE LTD	1,700	2,090	176	13,720	一般消費財・サービス	
VENTURE CORP LTD	86	86	164	12,808	情報技術	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,254.5	2,909.5	704	54,701	コミュニケーション・サービス	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	440	500	201	15,615	資本財・サービス	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	288	—	—	—	資本財・サービス	
SATS LTD	196	—	—	—	資本財・サービス	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	233	273	251	19,555	金融	
COMFORTDELGRO CORP LTD	648	—	—	—	資本財・サービス	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	589	659	282	21,963	生活必需品	
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,080.2 20銘柄	11,750.25 16銘柄	6,645	516,283 <0.3%>	

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		
(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	415	256	18,750	公益事業	
MERCURY NZ LTD	230	230	138	10,089	公益事業	
A2 MILK CO LTD	214	262	384	28,100	生活必需品	
SPARK NEW ZEALAND LTD	526.89	620.89	288	21,107	コミュニケーション・サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	294	389	297	21,770	資本財・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD	201	—	—	—	素材	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	187	204	692	50,634	ヘルスケア	
RYMAN HEALTHCARE LTD	118	140	210	15,353	ヘルスケア	
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額	2,115.89	2,260.89	2,267	165,805	
	銘柄数 < 比率 >	8銘柄	7銘柄		<0.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
TUI AG-DI	137.97	—	—	—	一般消費財・サービス	
BP PLC	5,750	6,665	1,752	242,771	エネルギー	
UNILEVER PLC	317.6	384.1	1,761	244,053	生活必需品	
BARCLAYS PLC	4,968	5,688	793	109,936	金融	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	527	2,795	300	41,687	資本財・サービス	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	561	—	—	—	一般消費財・サービス	
PRUDENTIAL PLC	757	849	1,028	142,566	金融	
NATWEST GROUP PLC	1,457.91	1,597.91	256	35,566	金融	
EVRAZ PLC	150	150	58	8,150	素材	
JOHNSON MATTHEY PLC	60.64	60.64	136	18,895	素材	
BAE SYSTEMS PLC	943	1,065	536	74,397	資本財・サービス	
AVIVA PLC	1,138.66	1,289.66	417	57,910	金融	
AVEVA GROUP PLC	20	20	67	9,352	情報技術	
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,410	1,651	2,284	316,493	ヘルスケア	
INFORMA PLC	362	499	269	37,347	コミュニケーション・サービス	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	105.4	—	—	—	情報技術	
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,455	1,565	249	34,541	資本財・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	283	319	174	24,229	コミュニケーション・サービス	
DCC PLC	28	31.5	179	24,815	資本財・サービス	
OCADO GROUP PLC	135	152	337	46,710	一般消費財・サービス	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	21	24.5	265	36,830	資本財・サービス	
HALMA PLC	110	122.5	271	37,678	情報技術	
GVC HOLDINGS PLC	167	191	199	27,587	一般消費財・サービス	
NMC HEALTH PLC	27	—	—	—	その他	
JD SPORTS FASHION PLC	130	146	107	14,831	一般消費財・サービス	
M&G PLC	757	837	161	22,433	金融	
RELX PLC	555.46	631.46	1,100	152,405	資本財・サービス	
DIAGEO PLC	675	769	2,255	312,496	生活必需品	
RIO TINTO PLC	322.5	370	1,821	252,344	素材	
STANDARD CHARTERED PLC	821	868	402	55,765	金融	
TESCO PLC	2,817	3,207	730	101,218	生活必需品	
SMITH & NEPHEW PLC	264.5	290.5	421	58,461	ヘルスケア	
GLENCORE PLC	3,245.25	3,307.25	706	97,852	素材	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	81.5	102.5	146	20,357	金融	
SMITHS GROUP PLC	113.83	123.83	181	25,177	資本財・サービス	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	419.83	419.83	124	17,281	金融	
PEARSON PLC	235.63	235.63	153	21,220	コミュニケーション・サービス	
SAINSBURY (J) PLC	542.25	542.25	117	16,265	生活必需品	
NEXT PLC	42	44.5	290	40,186	一般消費財・サービス	
TAYLOR WIMPEY PLC	932	1,177	185	25,635	一般消費財・サービス	
WHITBREAD PLC	38.61	68.61	216	30,057	一般消費財・サービス	
BUNZL PLC	96.05	112.05	259	35,954	資本財・サービス	

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		
VODAFONE GROUP PLC	7,661.83	8,701.83	1,086	150,584	コミュニケーション・サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	36.61	42.61	253	35,126	素材	
KINGFISHER PLC	624.11	682.11	184	25,601	一般消費財・サービス	
WPP PLC	384	409	306	42,466	コミュニケーション・サービス	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	206.27	228.27	205	28,438	公益事業	
SEVERN TRENT PLC	71.33	78.33	187	25,916	公益事業	
RENTOKIL INITIAL PLC	540	612	300	41,616	資本財・サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	203	234.5	1,528	211,704	生活必需品	
ST JAMES'S PLACE PLC	151.5	165.5	168	23,377	金融	
SCHRODERS PLC	34.5	41.5	134	18,594	金融	
SSE PLC	300	339	467	64,816	公益事業	
WEIR GROUP PLC/THE	79.5	—	—	—	資本財・サービス	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	310	340	213	29,630	一般消費財・サービス	
ASTRAZENECA PLC	370.5	431.5	3,352	464,524	ヘルスケア	
FERGUSON PLC	70.87	74.87	623	86,346	資本財・サービス	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,830	1,955	501	69,422	金融	
3I GROUP PLC	293.91	313.91	337	46,797	金融	
ASHTAD GROUP PLC	136.5	146.5	461	63,937	資本財・サービス	
SAGE GROUP PLC/THE	323.14	351.14	214	29,667	情報技術	
NATIONAL GRID PLC	981.34	1,144.34	999	138,539	公益事業	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	20,814.65	22,964.65	856	118,663	金融	
RSA INSURANCE GROUP PLC	317.6	317.6	214	29,675	金融	
IMPERIAL BRANDS PLC	288	304	429	59,514	生活必需品	
CENTRICA PLC	1,761.6	—	—	—	公益事業	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	36	41.5	194	26,937	一般消費財・サービス	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	650.1	753.6	2,017	279,508	生活必需品	
BHP GROUP PLC	605.27	687.27	1,194	165,475	素材	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	106	115	244	33,874	生活必需品	
HSBC HOLDINGS PLC	5,716.5	6,696.5	2,711	375,619	金融	
ANGLO AMERICAN PLC	310.83	403.83	914	126,756	素材	
MONDI PLC	142.5	156.5	264	36,633	素材	
WM MORRISON SUPERMARKETS	663	734	134	18,671	生活必需品	
CARNIVAL PLC	48.61	—	—	—	一般消費財・サービス	
EASYJET PLC	40	—	—	—	資本財・サービス	
COMPASS GROUP PLC	464.89	589.39	835	115,793	一般消費財・サービス	
PERSIMMON PLC	93	106	285	39,594	一般消費財・サービス	
BT GROUP PLC	2,461	2,901	351	48,754	コミュニケーション・サービス	
COCA-COLA HBC AG-DI	58	65.5	142	19,810	生活必需品	
BURBERRY GROUP PLC	121.89	132.89	228	31,696	一般消費財・サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	51.36	56.36	269	37,270	一般消費財・サービス	
INTERTEK GROUP PLC	48	52	286	39,639	資本財・サービス	
ITV PLC	1,021	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	91.99	104.99	831	115,207	金融	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,233	1,350	1,808	250,524	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,057.18	1,223.18	1,595	220,990	エネルギー	
MEGGITT PLC	241	—	—	—	資本財・サービス	
G4S PLC	435	—	—	—	資本財・サービス	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	57	150	20,785	ヘルスケア	
ADMIRAL GROUP PLC	55.5	61.5	175	24,258	金融	
ANTOFAGASTA PLC	114	128	158	21,937	素材	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	708.62	708.62	192	26,606	金融	
EXPERIAN PLC	261.54	296.54	766	106,206	資本財・サービス	
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額	87,608.13	95,671.55	49,505	6,858,983	
	銘柄数 < 比率 >	93銘柄	83銘柄		<4.2%>	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	金額	期首		期末		業種等
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円			
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	345	345	394	12,369	金融		
AZRIELI GROUP LTD	10	14	281	8,832	不動産		
ICL GROUP LTD	176	236	366	11,501	素材		
ELBIT SYSTEMS LTD	6	9.5	406	12,724	資本財・サービス		
BANK HAPOALIM BM	307	357	792	24,838	金融		
BANK LEUMI LE-ISRAEL	452	512	980	30,728	金融		
NICE LTD	18.5	22	1,751	54,896	情報技術		
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	41	41	298	9,354	金融		
イスラエル・シェケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,355.5 8銘柄	1,536.5 8銘柄	5,272	165,244 <0.1%>		
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円			
DUFREY AG-REG	12.5	—	—	—	一般消費財・サービス		
UBS GROUP AG-REG	1,104	1,200	1,579	181,560	金融		
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2.3	2.8	229	26,364	素材		
ADECCO GROUP AG-REG	46.5	51.5	277	31,913	資本財・サービス		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	199.4	229.8	6,951	799,208	ヘルスケア		
PARGESA HOLDING SA-BR	11	—	—	—	金融		
SIKA AG-REG	38.4	47.1	1,086	124,871	素材		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.03	0.03	246	28,282	生活必需品		
ABB LTD-REG	538	601	1,451	166,869	資本財・サービス		
SWISS RE AG	90	97.5	816	93,868	金融		
NESTLE SA-REG	869	972	9,943	1,143,211	生活必需品		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	5.2	5.9	570	65,553	金融		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	12.6	12.6	314	36,186	資本財・サービス		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	751.7	799.7	936	107,709	金融		
JULIUS BAER GROUP LTD	64	74	388	44,614	金融		
SGS SA-REG	1.6	2	517	59,508	資本財・サービス		
SCHINDLER HOLDING AG-REG	5.8	6.9	166	19,197	資本財・サービス		
VIFOR PHARMA AG	13	14.5	191	22,063	ヘルスケア		
TEMENOS AG - REG	19.7	21.2	244	28,054	情報技術		
ALCON INC	124.3	161.3	932	107,225	ヘルスケア		
SWATCH GROUP AG/THE-BR	8.5	9.7	222	25,582	一般消費財・サービス		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	44.72	48.62	1,810	208,109	金融		
BALOISE HOLDING AG - REG	13.9	15.7	249	28,681	金融		
CLARIANT AG-REG	57	57	104	12,041	素材		
NOVARTIS AG-REG	610.5	726	5,884	676,593	ヘルスケア		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.7	1	197	22,672	生活必需品		
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	153.1	171.6	1,317	151,478	一般消費財・サービス		
SWISSCOM AG-REG	7.7	8.3	399	45,909	コミュニケーション・サービス		
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	10.1	96	11,135	金融		
GEBERIT AG-REG	11.3	11.9	646	74,317	資本財・サービス		
GIVAUDAN-REG	2.6	3	1,092	125,650	素材		
STRAUMANN HOLDING AG-REG	2.9	3.4	352	40,477	ヘルスケア		
SONOVA HOLDING AG-REG	16.9	18.22	407	46,859	ヘルスケア		
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	—	55	430	49,549	情報技術		
LONZA GROUP AG-REG	22	24	1,324	152,257	ヘルスケア		
SWATCH GROUP AG/THE-REG	15.2	15.2	67	7,762	一般消費財・サービス		
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	142.9	172.9	831	95,555	素材		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	10.4	10.4	425	48,915	金融		
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	16.7	18	364	41,927	資本財・サービス		
SWISS PRIME SITE-REG	23.3	25.1	205	23,605	不動産		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.34	0.34	262	30,196	生活必需品		
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,069.69 39銘柄	5,705.31 39銘柄	43,537	5,005,544 <3.1%>		

銘柄	株数	期首 株数	当期		業種等		
			株数	株数		期末 評価額	
						外貨建金額	邦貨換算金額
		百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円		
(デンマーク)							
NOVO NORDISK A/S-B	506	595	24,945	416,837	ヘルスケア		
DANSKE BANK A/S	184	227	2,360	39,448	金融		
ISS A/S	44	—	—	—	資本財・サービス		
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.95	1.05	1,209	20,212	資本財・サービス		
H LUNDBECK A/S	17	23	446	7,454	ヘルスケア		
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	56	68	8,391	140,216	資本財・サービス		
GN STORE NORD A/S	—	43	2,156	36,027	ヘルスケア		
CARLSBERG AS-B	30	36.5	3,430	57,319	生活必需品		
NOVOZYMES A/S-B SHARES	64	72.5	2,604	43,528	素材		
COLOPLAST-B	33.5	40.5	3,765	62,924	ヘルスケア		
DSV PANALPINA A/S	62.1	71.6	7,306	122,096	資本財・サービス		
DEMANT A/S	34.25	34.25	749	12,516	ヘルスケア		
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2	2.2	2,731	45,640	資本財・サービス		
TRYG A/S	33	40	724	12,104	金融		
PANDORA A/S	31.5	35	2,272	37,968	一般消費財・サービス		
CHR HANSEN HOLDING A/S	30.5	34.5	2,103	35,154	素材		
GENMAB A/S	19.5	22.9	5,310	88,738	ヘルスケア		
ORSTED A/S	55	66	7,434	124,237	公益事業		
AMBU A/S-B	—	56	1,128	18,855	ヘルスケア		
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,203.3 17銘柄	1,469 18銘柄	79,071	1,321,281 <0.8%>		
		百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円		
(ノルウェー)							
NORSK HYDRO ASA	417	417	1,521	17,889	素材		
DNB ASA	281	331	5,413	63,662	金融		
ORKLA ASA	219.5	244.5	2,103	24,739	生活必需品		
TELENOR ASA	208	254	3,896	45,821	コミュニケーション・サービス		
EQUINOR ASA	279.73	338.23	4,966	58,410	エネルギー		
YARA INTERNATIONAL ASA	49.6	57.1	2,078	24,442	素材		
MOWI ASA	128.5	141	2,582	30,369	生活必需品		
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	55.5	73.5	1,411	16,595	金融		
SCHIBSTED ASA-B SHS	31	31	1,060	12,467	コミュニケーション・サービス		
AKER BP ASA	29	—	—	—	エネルギー		
ADEVENTINA ASA	—	81	1,173	13,802	コミュニケーション・サービス		
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,698.83 10銘柄	1,968.33 10銘柄	26,207	308,201 <0.2%>		
		百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円		
(スウェーデン)							
ICA GRUPPEN AB	27	35.2	1,448	17,704	生活必需品		
ERICSSON LM-B SHS	856.3	996.3	10,575	129,235	情報技術		
VOLVO AB-B SHS	414	508.5	10,164	124,215	資本財・サービス		
MILICOM INTL CELLULAR-SDR	18	—	—	—	コミュニケーション・サービス		
SKF AB-B SHARES	105.5	133	2,859	34,943	資本財・サービス		
ELECTROLUX AB-SER B	66.5	76	1,559	19,057	一般消費財・サービス		
SWEDISH MATCH AB	49	56.5	3,909	47,777	生活必需品		
TELE2 AB-B SHS	156	168	1,861	22,746	コミュニケーション・サービス		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	482.5	574	5,361	65,513	金融		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	465.5	528.5	4,662	56,974	金融		
SWEDBANK AB - A SHARES	266	318	4,970	60,745	金融		
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	235.5	282	5,150	62,941	一般消費財・サービス		
SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	—	207	2,878	35,173	素材		
SKANSKA AB-B SHS	102.5	115.5	2,396	29,286	資本財・サービス		
SANDVIK AB	331.5	384.5	7,543	92,186	資本財・サービス		
INVESTOR AB-B SHS	127	156	9,282	113,426	金融		
ATLAS COPCO AB-A SHS	184.5	229.5	10,091	123,313	資本財・サービス		

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		当		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円			
SECURITAS AB-B SHS	95.5	109.5	1,564	19,121	資本財・サービス		
TELIA CO AB	830	862	3,173	38,784	コミュニケーション・サービス		
ALFA LAVAL AB	88	110	2,445	29,881	資本財・サービス		
ATLAS COPCO AB-B SHS	112.5	132.5	5,061	61,851	資本財・サービス		
ASSA ABLOY AB-B	293.5	341.5	7,062	86,300	資本財・サービス		
LUNDBERGS AB-B SHS	22	26	1,165	14,240	金融		
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	—	52	1,144	13,979	資本財・サービス		
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	—	104	2,486	30,386	資本財・サービス		
LUNDIN ENERGY AB	52.5	63.5	1,365	16,683	エネルギー		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	168.5	212	5,802	70,905	生活必需品		
BOLIDEN AB	78	93	2,780	33,980	素材		
EPIROC AB-A	206.5	222.5	3,216	39,302	資本財・サービス		
EPIROC AB-B	116	135	1,855	22,675	資本財・サービス		
HUSQVARNA AB-B SHS	114.5	141.5	1,292	15,793	一般消費財・サービス		
NORDEA BANK ABP	897	1,111	8,280	101,185	金融		
EQT AB	—	81	1,547	18,910	金融		
EVOLUTION GAMING GROUP	—	44	3,036	37,110	一般消費財・サービス		
KINNEVIK AB - B	73	83	3,400	41,554	金融		
HEXAGON AB-B SHS	72	99	7,054	86,208	情報技術		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	46	57	1,505	18,402	金融		
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	7,152.8 32銘柄	8,848.5 36銘柄	149,959	1,832,500	<1.1%>	
ユーロ (アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円			
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	68	75.5	268	33,412	素材		
AIB GROUP PLC	230	—	—	—	金融		
BANK OF IRELAND GROUP PLC	274.6	—	—	—	金融		
KINGSPAN GROUP PLC	44	50	360	44,776	資本財・サービス		
KERRY GROUP PLC-A	45.7	51.5	599	74,560	生活必需品		
CRH PLC	231	253.5	865	107,676	素材		
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	22	49.6	763	95,006	一般消費財・サービス		
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	915.3 7銘柄	480.1 5銘柄	2,857	355,432	<0.2%>	
ユーロ (オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
QIAGEN N. V.	64.98	72.98	296	36,917	ヘルスケア		
KONINKLIJKE PHILIPS NV	264.26	302.1	1,305	162,437	ヘルスケア		
NN GROUP NV	90.5	90.5	311	38,744	金融		
HEINEKEN NV	76	85.5	763	94,902	生活必需品		
AEGON NV	536.44	582.44	178	22,153	金融		
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	336.33	362.33	862	107,303	生活必需品		
AKZO NOBEL N. V.	65.38	65.38	586	72,894	素材		
KONINKLIJKE DSM NV	53	57	780	97,128	素材		
WOLTERS KLUWER	83	89	620	77,223	資本財・サービス		
ING GROEP NV	1,110.5	1,262.5	1,062	132,156	金融		
KONINKLIJKE KPN NV	1,009.5	1,146.5	290	36,192	コミュニケーション・サービス		
ASML HOLDING NV	120.6	139.3	5,103	634,742	情報技術		
ABN AMRO BANK NV-CVA	117	130.5	123	15,416	金融		
ADYEN NV	3	6	969	120,598	情報技術		
UNILEVER NV	416	479.5	2,409	299,751	生活必需品		
JUST EAT TAKEAWAY	—	40	352	43,871	一般消費財・サービス		
PROSUS NV	145	161	1,501	186,714	一般消費財・サービス		
VOPAK	19	23	105	13,085	エネルギー		
RANDSTAD NV	32	37	190	23,663	資本財・サービス		
HEINEKEN HOLDING NV	34	37.5	293	36,521	生活必需品		

銘柄	株数	金額	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	
ALTICE EUROPE NV	205	百株	205	百株	千ユーロ	千円	コミュニケーション・サービス
STMICROELECTRONICS NV	199.5		210.5		92	11,474	情報技術
AIRBUS SE	165.5		194		699	86,950	資本財・サービス
ARGENX SE	—		14.5		1,746	217,167	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	162		195		340	42,382	生活必需品
EXOR NV	32.3		35.3		186	23,172	金融
CNH INDUSTRIAL NV	298		328		207	25,781	資本財・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	323.5		360		301	37,508	一般消費財・サービス
FERRARI NV	34.95		41.45		476	59,221	一般消費財・サービス
					740	92,052	
国小計	株数、金額	5,997.24	6,753.78		22,898	2,848,130	
	銘柄数 < 比率 >	27 銘柄	29 銘柄			< 1.8% >	
ユーロ (ベルギー)		百株	百株		千ユーロ	千円	
GALAPAGOS NV	13		13.9		146	18,170	ヘルスケア
UCB SA	35.5		41.3		373	46,509	ヘルスケア
KBC GROUP NV	74.5		82.5		492	61,239	金融
COLRUYT SA	16		16		78	9,787	生活必需品
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	22		36		298	37,128	金融
SOLVAY SA	22		24.5		236	29,406	素材
UMICORE	58		63.5		243	30,257	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	216		249		1,425	177,306	生活必需品
AGEAS	52.4		57.9		242	30,138	金融
PROXIMUS	41		49.5		89	11,079	コミュニケーション・サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	14.5		14.5		50	6,323	コミュニケーション・サービス
ELIA GROUP SA/NV	—		10.5		100	12,472	公益事業
SOFINA	—		5.5		144	17,991	金融
国小計	株数、金額	564.9	664.6		3,921	487,811	
	銘柄数 < 比率 >	11 銘柄	13 銘柄			< 0.3% >	
ユーロ (ルクセンブルグ)		百株	百株		千ユーロ	千円	
AROUNDTOWN SA	271		370		222	27,612	不動産
ARCELORMITTAL	203		233		356	44,322	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	3.2		44		297	36,946	ヘルスケア
SES	110		110		86	10,808	コミュニケーション・サービス
TENARIS SA	133		133		89	11,090	エネルギー
国小計	株数、金額	720.2	890		1,051	130,780	
	銘柄数 < 比率 >	5 銘柄	5 銘柄			< 0.1% >	
ユーロ (フランス)		百株	百株		千ユーロ	千円	
JCDECAUX SA	19		27		48	6,007	コミュニケーション・サービス
TOTAL SE	679.5		810.5		3,055	380,053	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	50		57		617	76,745	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	134.77		155.77		2,151	267,564	素材
KERING	21.8		25		1,515	188,497	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	156.5		182		2,137	265,873	資本財・サービス
BOUYGUES SA	67		74		249	31,091	資本財・サービス
BNP PARIBAS	320.5		364.5		1,597	198,687	金融
PEUGEOT SA	175.5		191.5		382	47,613	一般消費財・サービス
NATIXIS	295.5		295.5		78	9,765	金融
THALES SA	32.3		35		279	34,765	資本財・サービス
DANONE	176		200		1,055	131,295	生活必需品
CARREFOUR SA	170		198		272	33,862	生活必需品
SUEZ	99.25		112.25		181	22,582	公益事業
VIVENDI	268.91		268.91		682	84,921	コミュニケーション・サービス
L'OREAL	71.7		82.3		2,545	316,614	生活必需品

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		
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	145.5	168.5	679	84,460	資本財・サービス	
LEGRAND SA	80.17	88.17	629	78,323	資本財・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	15.5	—	—	—	生活必需品	
PERNOD RICARD SA	60.87	69.37	1,107	137,793	生活必需品	
EURAZEO SE	12.54	12.54	65	8,110	金融	
SOCIETE GENERALE SA	220.5	269.5	466	58,084	金融	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	79.3	91	4,513	561,401	一般消費財・サービス	
ACCOR SA	53.5	61.5	185	23,131	一般消費財・サービス	
CAPGEMINI SE	47.7	53.2	637	79,238	情報技術	
VALEO SA	71.5	77	258	32,102	一般消費財・サービス	
PUBLICIS GROUPE	64	70.5	271	33,724	コミュニケーション・サービス	
BUREAU VERITAS SA	88	97	208	25,987	資本財・サービス	
EIFFAGE	23.4	27.4	230	28,688	資本財・サービス	
SODEXO SA	27	27	197	24,582	一般消費財・サービス	
IPSEN	11.5	11.5	92	11,442	ヘルスケア	
INGENICO GROUP	18	—	—	—	その他	
ORPEA	—	18	188	23,474	ヘルスケア	
AMUNDI SA	17	19.5	132	16,456	金融	
TELEPERFORMANCE	17.7	19.2	528	65,672	資本財・サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT	24.5	30	236	29,440	コミュニケーション・サービス	
FAURECIA	22.5	22.5	96	11,955	一般消費財・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	8	9	264	32,866	ヘルスケア	
SEB SA	6.5	6.5	97	12,086	一般消費財・サービス	
ESSILORLUXOTTICA	83	92.5	1,118	139,154	一般消費財・サービス	
DASSAULT AVIATION SA	0.8	1	89	11,132	資本財・サービス	
WORLDLINE SA	23.64	78.14	611	76,061	情報技術	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	—	30	105	13,119	一般消費財・サービス	
AXA SA	553.5	638.5	1,259	156,704	金融	
EDENRED	69	79.5	386	48,125	情報技術	
RENAULT SA	58	58	197	24,610	一般消費財・サービス	
HERMES INTERNATIONAL	9	10.2	839	104,462	一般消費財・サービス	
REMY COINTREAU	6.3	7.5	112	13,936	生活必需品	
ATOS SE	29.6	32	244	30,392	情報技術	
DASSAULT SYSTEMES SE	39.8	43.6	677	84,218	情報技術	
WENDEL	7.8	7.8	73	9,100	金融	
ORANGE	583	659	704	87,622	コミュニケーション・サービス	
ALSTOM	44.5	63	284	35,410	資本財・サービス	
CNP ASSURANCES	48.5	48.5	65	8,131	金融	
SANOFI	318.75	370.75	3,159	392,936	ヘルスケア	
VINCI SA	145.5	170	1,495	186,030	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	164.5	175	346	43,086	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA	343	376	370	46,130	金融	
BIOMERIEUX	11.5	13.4	159	19,883	ヘルスケア	
ENGIE	521.23	602.23	753	93,781	公益事業	
EDF	170.5	202.5	263	32,717	公益事業	
SAFRAN SA	93.2	104.2	1,281	159,412	資本財・サービス	
ILIAD SA	7.4	4.9	85	10,580	コミュニケーション・サービス	
ARKEMA	19.2	22.2	216	26,916	素材	
ADP	9.1	9.1	98	12,280	資本財・サービス	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	47	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
SCOR SE	49.5	49.5	143	17,867	金融	
GETLINK SE	124	142	202	25,132	資本財・サービス	
BOLLORE	241	286	93	11,582	コミュニケーション・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	7,675.23 67銘柄	8,705.13 66銘柄	43,379	5,395,493 <3.3%>	

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	268.2	322.7	1,597	198,720	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	53	65	163	20,324	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	593.5	639.5	606	75,436	金融
COMMERZBANK AG	281.35	329.35	177	22,088	金融
VOLKSWAGEN AG	8.9	10.1	162	20,212	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	52.7	61.2	893	111,075	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	217.5	250.5	2,822	351,079	資本財・サービス
E.ON SE	642	742	678	84,353	公益事業
UNIPER SE	59.5	66.5	187	23,374	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	98.5	110	803	100,000	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	45	50.5	145	18,089	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	31.7	35.9	419	52,221	一般消費財・サービス
BASF SE	261.7	301.2	1,834	228,226	素材
ALLIANZ SE-REG	120.4	134.7	2,668	331,963	金融
THYSSENKRUPP AG	114.5	114.5	63	7,923	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	52	58	521	64,825	生活必需品
RWE AG	162.5	212	739	91,947	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	66.5	96.5	97	12,086	資本財・サービス
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	11.8	11.8	55	6,889	資本財・サービス
BRENTAG AG	47	50	319	39,714	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	122	135.5	515	64,161	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	33.2	33.2	111	13,841	コミュニケーション・サービス
HOCHTIEF AG	7.1	7.1	57	7,139	資本財・サービス
SAP SE	279.92	341.92	3,423	425,875	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	41.6	46.1	1,087	135,205	金融
ZALANDO SE	35.5	49.5	398	49,537	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	45	49	296	36,872	素材
KION GROUP AG	18.5	21	147	18,309	資本財・サービス
WIRECARD AG	34.7	—	—	—	情報技術
COVESTRO AG	52	56	265	33,050	素材
SARTORIUS AG-VORZUG	10.5	12.1	440	54,781	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	46.5	50	275	34,204	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	32	41.5	410	51,101	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	12.5	12.5	139	17,335	ヘルスケア
METRO AG	50	50	39	4,888	生活必需品
NEMETSCHKE SE	—	20	130	16,181	情報技術
SCOUT24 AG	—	36	226	28,231	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	45	86	329	41,011	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	14.5	23	247	30,804	資本財・サービス
TEAMVIEWER AG	—	44.5	176	21,896	情報技術
SIEMENS ENERGY AG	—	131.25	327	40,681	資本財・サービス
KION GROUP AG-RTS	—	21	—	—	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	30.9	32.9	312	38,834	生活必需品
FUCHS PETROLUB SE-PREF	19.5	23.5	113	14,106	素材
MERCK KGAA	37.5	42.5	566	70,517	ヘルスケア
ADIDAS AG	51.2	61.7	1,673	208,125	一般消費財・サービス
PUMA SE	23.6	27.1	222	27,680	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	31	34	272	33,894	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	959.5	1,092.5	1,655	205,933	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	62.7	69.2	490	60,955	ヘルスケア
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	261	281	1,590	197,786	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	371.5	413	1,222	152,077	情報技術
HANNOVER RUECK SE	17.3	20	278	34,602	金融

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		
DEUTSCHE POST AG-REG	292	324	1,314	163,533	資本財・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	56.4	62.6	857	106,709	金融	
LANXESS AG	25	25	148	18,495	素材	
MTU AERO ENGINES AG	15.3	17.1	349	43,473	資本財・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN SE	106	110	451	56,095	不動産	
SYMRISE AG	39.2	42.2	444	55,296	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	263	338	80	10,064	コミュニケーション・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	15.5	19.5	108	13,461	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	153	170.5	964	119,945	不動産	
LEG IMMOBILIEN AG	—	23	271	33,756	不動産	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,899.87 57銘柄	8,158.42 62銘柄	37,393	4,651,011 <2.9%>	
ユーロ (ポルトガル)		百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	60	77	109	13,570	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	747	883	406	50,520	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	139.5	150.5	143	17,891	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	946.5 3銘柄	1,110.5 3銘柄	659	81,983 <0.1%>	
ユーロ (スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA	1,320.27	1,572.27	587	73,060	コミュニケーション・サービス	
ENDESA SA	92.5	103.5	251	31,269	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,910.12	2,205.12	872	108,557	金融	
IBERDROLA SA	1,703.34	1,944.34	2,230	277,387	公益事業	
BANCO DE SABADELL SA	1,601.09	—	—	—	金融	
BANKINTER SA	183	215	89	11,161	金融	
REPSOL SA	418	494	419	52,141	エネルギー	
GRIFOLS SA	85	98	239	29,778	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	4,772.5	5,477.5	1,350	167,938	金融	
AMADEUS IT GROUP SA	123.5	146	880	109,574	情報技術	
NATURGY ENERGY GROUP SA	94	94	187	23,278	公益事業	
MAPFRE SA	306.5	306.5	48	6,019	金融	
CAIXABANK SA	1,093	1,175	258	32,196	金融	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	78.76	88.76	238	29,609	資本財・サービス	
AENA SME SA	20	22.5	323	40,243	資本財・サービス	
CELLNEX TELECOM SA	58	104.55	537	66,892	コミュニケーション・サービス	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	323	360	1,018	126,628	一般消費財・サービス	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	66.5	77	222	27,639	資本財・サービス	
ENAGAS SA	69	79.5	165	20,547	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	125.5	139	238	29,615	公益事業	
FERROVIAL SA	142	162.7	384	47,778	資本財・サービス	
BANKIA SA	301.05	—	—	—	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	14,886.63 22銘柄	14,865.24 20銘柄	10,542	1,311,317 <0.8%>	
ユーロ (イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA	68.5	78.5	211	26,264	資本財・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI	315.43	372.43	538	67,029	金融	
MEDIOBANCA SPA	170.65	188.65	145	18,137	金融	
UNICREDIT SPA	576.56	696.56	633	78,788	金融	
TELECOM ITALIA SPA	2,629.82	2,629.82	105	13,123	コミュニケーション・サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	1,719.5	1,719.5	73	9,168	コミュニケーション・サービス	
INTESA SANPAOLO	4,262.37	5,507.37	1,070	133,206	金融	

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		
ATLANTIA SPA	146.57	172.57	263	32,775	資本財・サービス	
POSTE ITALIANE SPA	160	160	140	17,512	金融	
MONCLER SPA	51.5	63	258	32,135	一般消費財・サービス	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	30.5	34.5	156	19,443	ヘルスケア	
ENI SPA	725	841	721	89,770	エネルギー	
PIRELLI & C SPA	110	110	47	5,944	一般消費財・サービス	
DIASORIN SPA	—	8.5	146	18,268	ヘルスケア	
INFRASTRUTTURA WIRELESS ITAL	—	83	89	11,087	コミュニケーション・サービス	
NEXI SPA	—	120.5	191	23,815	情報技術	
LEONARDO SPA	109.75	131.75	78	9,809	資本財・サービス	
ENEL SPA	2,307.34	2,671.34	2,271	282,488	公益事業	
SNAM SPA	616	666	313	38,941	公益事業	
TERNA SPA	428	463	293	36,464	公益事業	
FINCOBANK SPA	180	197	258	32,135	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	14,607.49 18銘柄	16,914.99 21銘柄	8,010 <0.6%>	996,312	
ユーロ (フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UPM-KYMMENE OYJ	156	175.5	496	61,775	素材	
NOKIA OYJ	1,585	1,864	637	79,244	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP	120	147	118	14,722	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS	170.5	188.5	273	34,007	素材	
NELES OYJ	28	—	—	—	資本財・サービス	
ELISA OYJ	41.5	46	208	25,986	コミュニケーション・サービス	
SAMPO OYJ-A SHS	125	153	551	68,565	金融	
FORTUM OYJ	138.5	138.5	267	33,221	公益事業	
KONE OYJ-B	99	112.5	783	97,417	資本財・サービス	
NOKIAN RENKAAT OYJ	36.5	—	—	—	一般消費財・サービス	
NESTE OYJ	120.5	139	799	99,410	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	27.5	32	127	15,916	ヘルスケア	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,648 12銘柄	2,996 10銘柄	4,263 <0.3%>	530,268	
ユーロ (オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
VERBUND AG	20	20	118	14,676	公益事業	
OMV AG	44.5	44.5	131	16,339	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	87	94.5	236	29,361	金融	
VOESTALPINE AG	28.5	42.5	114	14,235	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	34	44	73	9,172	金融	
ANDRITZ AG	21	21	73	9,126	資本財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	235 6銘柄	266.5 6銘柄	746 <0.1%>	92,911	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	56,096.36 235銘柄	61,805.26 240銘柄	135,724 <10.4%>	16,881,454	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	316,681.1 1,252銘柄	354,388.8 1,214銘柄	— <93.3%>	151,364,986	

(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) 外国新株予約権証券

銘柄	当 期 末		
	証券数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
証券	千スイス・フラン	千円	
(スイス) CIF -CW	34,320	7	868

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

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 外国投資信託証券

銘柄	期 首		当 期 末	
	□ 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	3.867	4.587	770	79,997
SIMON PROPERTY GROUP INC	8.887	10.137	867	90,095
BOSTON PROPERTIES INC	4.25	4.95	507	52,675
VORNADO REALTY TRUST	5.097	5.397	217	22,612
SBA COMMUNICATIONS CORP	3.15	3.65	1,042	108,348
EQUITY RESIDENTIAL	10.7	12.35	731	75,956
EQUINIX INC	2.288	2.918	2,044	212,363
AMERICAN TOWER CORP	12.45	14.5	3,394	352,634
HOST HOTELS & RESORTS INC	21.943	22.243	325	33,784
KIMCO REALTY CORP	12.6	—	—	—
INVITATION HOMES INC	12.7	17.7	509	52,885
VICI PROPERTIES INC	13.5	15.4	395	41,085
VENTAS INC	10.5	12.2	584	60,711
WEYERHAEUSER CO	21.164	24.114	692	71,924
AGNC INVESTMENT CORP	15.3	18.1	281	29,277
CROWN CASTLE INTL CORP	11.75	13.75	2,298	238,800
IRON MOUNTAIN INC	8.21	9.71	258	26,853
VEREIT INC	29.3	33.5	245	25,545
SUN COMMUNITIES INC	2.75	3.25	450	46,800
PROLOGIS INC	17.812	24.402	2,454	255,033
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3.07	4.12	668	69,400
CAMDEN PROPERTY TRUST	2.9	3.2	312	32,493
DUKE REALTY CORP	10.2	12.15	466	48,458
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.95	2.17	542	56,362
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2.2	2.36	208	21,666
WELLTOWER INC	11.45	13.85	893	92,865
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	14.35	17.65	527	54,789
LIBERTY PROPERTY TRUST	4.4	—	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3.25	3.75	465	48,308
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4.8	5.8	340	35,376
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	43.7	45.1	368	38,233
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4.55	5.35	205	21,337
REALTY INCOME CORP	8.9	11.2	690	71,722
PUBLIC STORAGE	4.37	5.22	1,148	119,323
REGENCY CENTERS CORP	4.95	5.3	248	25,818
SL GREEN REALTY CORP	2.4	—	—	—
UDR INC	8.1	9.75	382	39,727
WP CAREY INC	5.1	5.8	405	42,113
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	6.4	7.6	272	28,305

銘柄	期首 □ 数	当 □ 数	期末 評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
DIGITAL REALTY TRUST INC	千□ 6.05	千□ 8.9	千アメリカ・ドル 1,216	千円 126,423
EXTRA SPACE STORAGE INC	3.75	4.25	467	48,568
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	13	17.25	337	35,071
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 > 398,058 42 銘柄	443,628 39 銘柄	28,239	2,933,750 <1.8%>
(カナダ)	千□	千□	千カナダ・ドル	千円
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	4.8	74	5,986
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2.1	2.1	50	4,071
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2.4	2.4	123	9,851
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	3.7	—	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4.7	4.7	85	6,827
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 > 12.9 4 銘柄	14 4 銘柄	334	26,736 <0.0%>
(オーストラリア)	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円
LENLEASE GROUP	17	21.5	305	23,480
TRANSURBAN GROUP	76.5	89.5	1,267	97,469
SYDNEY AIRPORT	33.3	42.5	285	21,965
APA GROUP	35.8	38.1	402	30,972
SCENTRE GROUP	153.922	159.922	460	35,422
DEXUS	33.15	33.15	325	25,036
GPT GROUP	56.16	63.16	299	23,025
MIRVAC GROUP	111.6	126.1	329	25,312
STOCKLAND	72	78	360	27,715
GOODMAN GROUP	50.1	52.9	984	75,715
VICINITY CENTRES	99.273	123.273	205	15,833
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 > 738,805 11 銘柄	828,105 11 銘柄	5,226	401,950 <0.2%>
(香港)	千□	千□	千香港・ドル	千円
LINK REIT	62.5	70.5	4,829	64,711
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	75	92	716	9,603
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	107	122	1,263	16,936
香港・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 > 244.5 3 銘柄	284.5 3 銘柄	6,809	91,251 <0.1%>
(シンガポール)	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	79.6	—	—	—
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	76	101	305	23,697
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	77.2	158.032	314	24,432
SUNTEC REIT	63	63	96	7,488
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	—	91.8	179	13,978
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST (非上場)	65.5	65.5	135	10,533
ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS	—	3.737	—	—
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 > 361.3 5 銘柄	483,069 6 銘柄	1,031	80,129 <0.0%>
(イギリス)	千□	千□	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	21.662	21.662	144	19,961
SEGRO PLC	33.15	38.45	346	48,019
BRITISH LAND CO PLC	25.55	29.55	138	19,246
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 > 80,362 3 銘柄	89,662 3 銘柄	629	87,227 <0.1%>

銘柄	期首 □ 数	当 □ 数	期末 評 価 額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (フランス)				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	3.95	4.2	265	32,994
ICADE	0.95	0.95	56	7,077
GECINA SA	1.4	1.4	177	22,132
KLEPIERRE	6.25	6.25	121	15,065
COVIVIO	1.27	1.5	108	13,433
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金 額 13.82	□ 数、金 額 14.3	729	90,703
	□ 銘柄 数 < 比 率 > 5 銘柄	□ 銘柄 数 < 比 率 > 5 銘柄		<0.1%>
合 計	□ 数、金 額 1,849,745	□ 数、金 額 2,157,264	—	3,711,750
	□ 銘柄 数 < 比 率 > 73 銘柄	□ 銘柄 数 < 比 率 > 71 銘柄		<2.3%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(4)先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
外		
S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	5,515	—
S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	281	—
SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	228	—
国		
FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	361	—
SWISS MKT IX FUTR (スイス)	264	—
EURO STOXX 50 (ドイツ)	931	—

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	151,364,986	93.2
新株予約権証券	868	0.0
投資信託証券	3,711,750	2.3
コール・ローン等、その他	7,312,974	4.5
投資信託財産総額	162,390,580	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=103.89円、1カナダ・ドル=79.95円、1オーストラリア・ドル=76.91円、1香港・ドル=13.40円、1シンガポール・ドル=77.69円、1ニュージーランド・ドル=73.11円、1イギリス・ポンド=138.55円、1イスラエル・シケル=31.34円、1スイス・フラン=114.97円、1デンマーク・クローネ=16.71円、1ノルウェー・クローネ=11.76円、1スウェーデン・クローネ=12.22円、1ユーロ=124.38円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (158,608,000千円) の投資信託財産総額 (162,390,580千円) に対する比率は、97.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

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

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

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国株式インデックスV A429,418,774円、ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)6,511,702円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)109,450,582円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)14,001,565円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)353,394,455円、外国株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)22,667,766円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)535,920,559円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)2,255,476,207円、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)662,541,353円、D-I's 外国株式インデックス11,396,584円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 6,026,400円、iFree 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)2,011,620,301円、iFree 8資産バランス1,021,183,359円、iFree 年金バランス49,879,929円、DCダイワ外国株式インデックス33,018,813,032円、ダイワ・ライフ・バランス30 579,030,840円、ダイワ・ライフ・バランス50 976,488,397円、ダイワ・ライフ・バランス70 722,361,053円、大和DC海外株式インデックスファンド1,541,641,973円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 2,282,168円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 11,422,149円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 7,627,380円、ダイワつみたてインデックス外国株式452,466,523円、ダイワつみたてインデックスバランス30 2,121,988円、ダイワつみたてインデックスバランス50 2,068,375円、ダイワつみたてインデックスバランス70 2,463,419円、ダイワ世界バランスファンド40VA161,683,743円、ダイワ世界バランスファンド60VA284,495,474円、ダイワ・バランスファンド35VA2,255,482,425円、ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)110,264,809円、ダイワバランスファンド2020-07(適格機関投資家専用)271,255,135円、ダイワ・インデックスセレクト 外国株式798,778,255円、ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド183,907,812円、ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)2,325,979,029円、ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス2,735,745,325円、ダイワライフスタイル25 17,629,498円、ダイワライフスタイル50 63,519,419円、ダイワライフスタイル75 50,437,420円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は30,015円です。

■損益の状況

当期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

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

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

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

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド

運用報告書 第10期 (決算日 2020年7月6日)

(作成対象期間 2019年7月6日～2020年7月6日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント

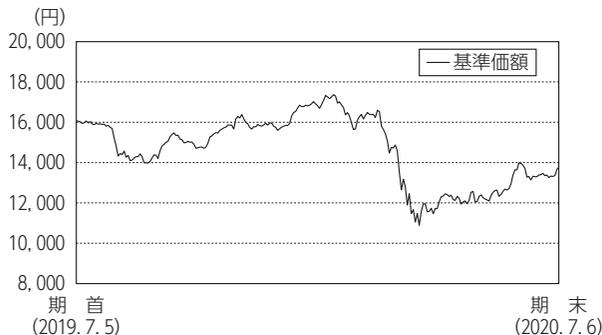
Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移

《運用経過》



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

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) は、FTSE International Limited の承諾を得て、FTSE RAFI エマージング インデックス (配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE International Limited と Research Affiliates LLC に帰属します。また、FTSE International Limited は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

(注5) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：16,061円 期末：13,774円 騰落率：△14.2%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○新興国株式市況

新興国株式市況は下落しました。

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

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

○為替相場

新興国為替相場は円高が進みました。

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

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

主として、新興国の株式 (D R (預託証券) を含む。) に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行うことを基本とします。また、効率性の観点から FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざす E T F (上場投資信託証券) にも一部投資します。なお、株式および E T F の組入比率の合計

は、通常の状態 で信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。さらに、株式実質組入比率の維持を目的に新興国株式市場を対象とした株価指数先物取引も利用します。

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

◆ポートフォリオについて

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

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

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

《今後の運用方針》

主として、新興国の株式 (D R (預託証券) を含む。) に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行うことを基本とします。また、効率性の観点からFTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざすE T F (上場投資信託証券) にも一部投資します。なお、株式およびE T Fの組入比率の合計は、通常の状態 で信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。さらに、株式実質組入比率の維持を目的に新興国株式市場を対象とした株価指数先物取引も利用します。

■1万口当りの費用の明細

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

(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7月6日から2020年7月6日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ	百株 44,547.97 (—)	千アメリカ・ドル 2,930 (—)	百株 1,136.7	千アメリカ・ドル 475
	香港	百株 86,002.52 (—)	千香港・ドル 50,727.25 (△)	百株 17,933	千香港・ドル 6,395
	シンガポール	百株 410 (—)	千シンガポール・ドル 33 (—)	百株 —	千シンガポール・ドル —
	台湾	百株 27,870 (493.87)	千台湾・ドル 80,389 (427)	百株 11,272.81	千台湾・ドル 37,818
	トルコ	百株 2,455.9 (34.4)	千トルコ・リラ 2,439 (—)	百株 1,210.6	千トルコ・リラ 315
国	メキシコ	百株 5,897 (—)	千メキシコ・ペソ 10,503 (—)	百株 3,569	千メキシコ・ペソ 5,692
	チリ	百株 23,476.1 (24.72)	千チリ・ペソ 189,429 (5,522)	百株 964.52	千チリ・ペソ 92,167
	サウジアラビア	百株 1,677.3 (43.56)	千サウジアラビア・リアル 5,499 (—)	百株 —	千サウジアラビア・リアル —
	インド	百株 15,305.7 (206.92)	千インド・ルピー 103,454 (—)	百株 1,133.99	千インド・ルピー 17,148
	インドネシア	百株 5,346 (—)	千インドネシア・ルピア 3,199,571 (—)	百株 11,695	千インドネシア・ルピア 2,520,415

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ブラジル	百株 5,466 (302.25)	千ブラジル・リアル 10,986 (2)	百株 1,932.55	千ブラジル・リアル 2,839
	中国	百株 30,501 (—)	千オフショア・人民元 21,085 (—)	百株 —	千オフショア・人民元 —
	マレーシア	百株 1,280 (—)	千マレーシア・リンギット 1,033 (—)	百株 9,507	千マレーシア・リンギット 1,241
	南アフリカ	百株 3,893.1 (6.39)	千南アフリカ・ランド 21,251 (△773)	百株 1,660	千南アフリカ・ランド 8,284
	タイ	百株 14,486 (—)	千タイ・バーツ 30,588 (—)	百株 27	千タイ・バーツ 513

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2019年7月6日から2020年7月6日まで)

	買 付		売 付		
	口 数	金 額	口 数	金 額	
外 国	アメリカ	千口 1,176 (—)	千アメリカ・ドル 21,983 (—)	千口 850 (—)	千アメリカ・ドル 15,091 (—)
	トルコ	千口 — (—)	千トルコ・リラ — (—)	千口 171.87 (—)	千トルコ・リラ 185 (—)
	メキシコ	千口 20.7 (—)	千メキシコ・ペソ 544 (△89)	千口 8.2 (—)	千メキシコ・ペソ 135 (—)
	南アフリカ	千口 17.5 (—)	千南アフリカ・ランド 401 (—)	千口 105 (—)	千南アフリカ・ランド 175 (—)

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2019年7月6日から2020年7月6日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	3,623	3,405	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2019年7月6日から2020年7月6日まで)

銘 柄	当 期			期 付		
	株 数	金 額	平均単価	株 数	金 額	平均単価
GAZPROM PJSC-SPON ADR (ロシア)	千株 139.33	千円 77,537	円 556	千株 46	千円 44,150	円 959
CHINA MOBILE LTD (香港)	84.5	67,238	795	10	11,865	1,186
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	720	57,050	79	82.3	10,875	132
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR (ケイマン諸島)	3	56,063	18,687	1.86	10,704	5,755
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	53	45,501	858	17.48	10,302	589
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	76	45,174	594	146.4	9,628	65
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP (サウジアラビア)	21.46	42,673	1,988	235	9,158	38
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	589	39,341	66	20	9,004	450
HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	149	37,051	248	0.64	8,316	12,993
PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)	28	30,867	1,102	3.76	8,271	2,199
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)				46	44,150	959
MEDIATEK INC (台湾)				10	11,865	1,186
BANCO SANTANDER MEXICO SA IN (メキシコ)				82.3	10,875	132
LUKOIL PJSC-SPON ADR (ロシア)				1.86	10,704	5,755
BHARTI AIRTEL LTD (インド)				17.48	10,302	589
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L (メキシコ)				146.4	9,628	65
BANK OF CHINA LTD-H (中国)				235	9,158	38
CHINA RESOURCES BEER HOLDING (香港)				20	9,004	450
NASPERS LTD-N SHS (南アフリカ)				0.64	8,316	12,993
MWC NORILSK NICKEL PJSC-ADR (ロシア)				3.76	8,271	2,199

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2019年7月6日から2020年7月6日まで)

当 期				期 末			
買 付		金 額		売 付		金 額	
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	1,176	2,374,104	2,018	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	850	1,620,498	1,906
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	20.7	2,874	138	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI (トルコ)	171.87	3,071	17
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)	17.5	2,789	159	REDEFINE PROPERTIES LTD (南アフリカ)	105	1,060	10
				FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	8.2	618	75

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘 柄	株 数	期 首 株 数	当 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	
(アメリカ)						
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	164	337	163	17,598	エネルギー	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	34	64	1,431	154,051	一般消費財・サービス	
BAIDU INC - SPON ADR	20	44	542	58,402	コミュニケーション・サービス	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	88	80	163	17,637	一般消費財・サービス	
CANADIAN SOLAR INC	—	28	56	6,040	情報技術	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	—	25	93	10,100	資本財・サービス	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	264.5	199.5	185	19,929	コミュニケーション・サービス	
JD.COM INC-ADR	79	82	503	54,190	一般消費財・サービス	
NETEASE INC-ADR	5	5	215	23,193	コミュニケーション・サービス	
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	36	56	148	16,011	一般消費財・サービス	
VTB BANK JSC -GDR-REG S	893.06	1,642.98	156	16,802	金融	
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	18.3	45.6	91	9,827	素材	
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	39.5	60.5	287	30,935	エネルギー	
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	155.3	296	158	17,031	エネルギー	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	104.9	92.1	243	26,224	素材	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	187	249.7	336	36,180	生活必需品	
RUSHYDRO PJSC-ADR	606.1	604.95	63	6,785	公益事業	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	704.5	811	954	102,756	金融	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	9.3	12.2	178	19,187	エネルギー	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	158.8	168.3	1,273	137,040	エネルギー	
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	462.7	487	246	26,537	エネルギー	
GAZPROM PJSC-SPON ADR	1,879.6	3,272.9	1,787	192,370	エネルギー	
SEVERSTAL - GDR REG S	61.8	102.7	126	13,620	素材	
TATNEFT PJSC - PREF	45.4	35.1	27	2,961	エネルギー	
SISTEMA PJSC	—	147	3	385	コミュニケーション・サービス	
ROSSETI PJSC	—	29,890	65	7,037	公益事業	
INTER RAO UES PJSC	—	10,160	71	7,749	公益事業	
ALROSA PJSC	391.8	791.6	73	7,901	素材	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	328.09	362.29	59	6,395	金融	
AEROFLOT PJSC	407	402.5	46	4,954	資本財・サービス	
アメリカ・ドル通貨計	株 数	金額	7,143.65	50,554.92	9,752	1,049,843
	銘柄数 < 比率 >		25 銘柄	30 銘柄		<11.4% >

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	千香港・ドル	千円	
(香港)					
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	950	1,410	908	12,612	資本財・サービス
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	1,650	2,770	1,157	16,082	資本財・サービス
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	240	400	377	5,239	資本財・サービス
KINGBOARD HOLDINGS LTD	160	—	—	—	情報技術
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	450	760	1,076	14,947	一般消費財・サービス
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	410	1,100	478	6,646	資本財・サービス
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	140	—	—	—	生活必需品
JIANGXI COPPER CO LTD-H	600	750	620	8,615	素材
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	—	1,400	446	6,203	公益事業
CHINA GAS HOLDINGS LTD	—	196	503	6,996	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	12,978	17,438	5,894	81,868	エネルギー
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	100	155	428	5,952	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	760	1,060	532	7,391	一般消費財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	560	980	502	6,983	資本財・サービス
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	135	135	468	6,506	資本財・サービス
FOSUN INTERNATIONAL LTD	610	930	941	13,072	資本財・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD	126	182	9,545	132,592	コミュニケーション・サービス
CHINA TELECOM CORP LTD-H	4,580	6,920	1,570	21,818	コミュニケーション・サービス
AIR CHINA LTD-H	420	600	289	4,016	資本財・サービス
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	2,100	3,320	1,470	20,428	コミュニケーション・サービス
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	410	470	1,628	22,620	不動産
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	1,500	1,500	915	12,709	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	600	580	538	7,476	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	6,860	12,580	3,396	47,178	エネルギー
CNOOC LTD	3,960	5,930	5,337	74,130	エネルギー
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	640	880	623	8,654	不動産
HUANENG POWER INTL INC-H	1,880	3,380	993	13,802	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	170	195	1,087	15,100	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	840	1,150	508	7,060	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	30,910	38,110	23,399	325,019	金融
CHINA MOBILE LTD	1,305	2,150	11,749	163,204	コミュニケーション・サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	330	656	906	12,592	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	3,420	5,380	1,926	26,752	金融
GF SECURITIES CO LTD-H	306	306	284	3,957	金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	—	284	404	5,625	金融
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	2,790	—	—	—	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	100	140	860	11,949	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	1,560	2,660	1,207	16,774	金融
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	—	700	252	3,500	資本財・サービス
HUADIAN POWER INTL CORP-H	—	1,420	313	4,358	公益事業
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1,120	1,705	2,264	31,450	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	220	312	461	6,405	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H	276	512	1,024	14,223	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	540	700	2,271	31,551	不動産
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	190	260	626	8,703	一般消費財・サービス
YANZHOU COAL MINING CO-H	580	1,000	632	8,778	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	—	430	639	8,887	ヘルスケア
BYD CO LTD-H	80	80	543	7,545	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	10,080	14,670	4,342	60,314	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	151	210	616	8,561	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,820	2,120	536	7,450	金融
CITIC LTD	1,220	880	682	9,485	資本財・サービス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	2,150	—	—	—	金融

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首 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	千香港・ドル	千円	
IND & COMM BK OF CHINA-H	24,940	30,830	15,168	210,688	金融
CHINA TOWER CORP LTD-H	3,860	5,820	907	12,611	コミュニケーション・サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	—	916	1,306	18,143	情報技術
MEITUAN DIANPING-CLASS B	—	106	2,032	28,224	一般消費財・サービス
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	740	—	—	—	素材
GUANGDONG INVESTMENT LTD	300	420	567	7,887	公益事業
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	—	2,150	281	3,912	資本財・サービス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	780	1,220	3,117	43,296	不動産
CRCR CORP LTD - H	640	1,240	429	5,959	資本財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1,670	3,110	1,436	19,957	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-H	1,850	—	—	—	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	635	915	7,420	103,072	金融
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	210	290	1,112	15,447	不動産
BAIC MOTOR CORP LTD-H	680	—	—	—	一般消費財・サービス
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	2,670.8	3,845.8	1,969	27,350	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,240	2,200	2,283	31,719	不動産
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	80	70	488	6,791	一般消費財・サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	253	409	1,102	15,310	不動産
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	920	1,940	389	5,416	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	380	560	334	4,651	一般消費財・サービス
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	40	55	515	7,165	一般消費財・サービス
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2,020	2,020	1,426	19,808	金融
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	1,000	1,075	566	7,869	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	410	440	708	9,839	資本財・サービス
ALUMINIUM CORP OF CHINA LTD-H	1,880	2,680	420	5,844	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	478	646	1,463	20,323	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	244	349	474	6,592	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,240	1,210	2,132	29,613	金融
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	74	100	910	12,639	公益事業
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	380	620	459	6,381	素材
KUNLUN ENERGY CO LTD	680	1,400	712	9,898	公益事業
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	508	804	771	10,709	不動産
CHINA OILFIELD SERVICES-H	440	—	—	—	エネルギー
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,140	1,140	434	6,032	素材
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	460	—	—	—	資本財・サービス
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	1,940	2,300	2,014	27,985	素材
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	2,961	4,381	2,225	30,912	金融
CHINA EVERGRANDE GROUP	380	800	2,064	28,668	不動産
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	520	520	513	7,136	不動産
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	4,650	12,260	272	3,780	情報技術
CHINA MERCHANTS BANK-H	765	915	3,426	47,596	金融
BANK OF CHINA LTD-H	30,130	33,860	10,225	142,035	金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	305	335	586	8,152	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	1,140	1,600	491	6,822	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	696	680	503	6,989	金融
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	670	—	—	—	金融
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	290	300	1,159	16,105	不動産
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	200,266.8 268,387.8 91銘柄	173,012 268,387.8 90銘柄	2,403,144 <26.1%>	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポール・ドル	千円
YANGJIJIANG SHIPBUILDING	477	887	83	6,477	資本財・サービス
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	477 1銘柄	887 1銘柄	83 <0.1%>	

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
(台湾)					
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	160	200	2,310	8,408	情報技術
TAIWAN CEMENT	946	1,272.32	5,591	20,354	素材
ASIA CEMENT CORP	550	630	2,835	10,319	素材
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	—	940	6,758	24,601	情報技術
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	—	420	1,974	7,185	金融
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	661.12	821.12	6,010	21,878	生活必需品
FORMOSA PLASTICS CORP	576	496	4,181	15,219	素材
NAN YA PLASTICS CORP	481.4	441.4	2,904	10,572	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	503.9	433.9	3,184	11,592	素材
WALSIN LIHWA CORP	930	—	—	—	資本財・サービス
CHINA STEEL CORP	1,306.86	976.86	2,026	7,378	素材
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	—	30	2,166	7,884	一般消費財・サービス
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	656.16	586.16	2,746	9,996	情報技術
DELTA ELECTRONICS INC	340	470	7,966	28,998	情報技術
YAGEO CORPORATION	—	60	2,262	8,233	情報技術
ACER INC	930	—	—	—	情報技術
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	—	300	1,710	6,224	情報技術
INVENTEC CORP	670	—	—	—	情報技術
TATUNG CO LTD	550	—	—	—	一般消費財・サービス
QUANTA COMPUTER INC	590	850	6,290	22,895	情報技術
AU OPTRONICS CORP	2,720	7,450	7,062	25,707	情報技術
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	684	884	9,900	36,038	コミュニケーション・サービス
MEDIATEK INC	310.03	280.03	16,381	59,629	情報技術
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	170	230	5,267	19,171	情報技術
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	611.87	—	—	—	金融
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,134.11	1,234.11	5,281	19,226	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,456.93	1,548.38	6,309	22,967	金融
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,720	2,240	2,121	7,721	金融
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,363.34	1,440.27	4,047	14,731	金融
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,698.28	1,388.28	2,485	9,045	金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,559.93	1,589.93	5,016	18,259	金融
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,535.75	1,287.68	1,738	6,327	金融
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	3,556.77	4,193.34	3,631	13,218	金融
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	—	1,670	1,820	6,625	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	2,420.28	2,720.28	5,658	20,595	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	962.1	1,191.72	2,734	9,955	金融
LARGAN PRECISION CO LTD	10	10	4,325	15,743	情報技術
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	100	110	2,865	10,430	情報技術
TAIWAN MOBILE CO LTD	240	310	3,565	12,976	コミュニケーション・サービス
WISTRON CORP	621.1	1,291.1	4,802	17,482	情報技術
INNOLUX CORP	2,190	9,660	7,583	27,602	情報技術
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	230	310	2,151	7,831	コミュニケーション・サービス
PEGATRON CORP	470	630	4,164	15,158	情報技術
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	—	150	2,025	7,371	情報技術
CHAILEASE HOLDING CO LTD	142.2	214.71	2,726	9,925	金融
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	618	—	—	—	金融
POWERTECH TECHNOLOGY INC	214	194	2,240	8,156	情報技術
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	220	320	2,844	10,355	エネルギー
POU CHEN	374.4	—	—	—	一般消費財・サービス
COMPAL ELECTRONICS	—	1,070	2,118	7,711	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,590	2,660	87,647	319,035	情報技術

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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		
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,189.02	3,679.02	31,382	114,230	情報技術	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	80	80	2,368	8,619	生活必需品	
ASUSTEK COMPUTER INC	107.6	137.6	2,979	10,843	情報技術	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	750	690	1,994	7,258	資本財・サービス	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	4,380	4,580	7,534	27,424	情報技術	
台湾・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	47,281.15 48銘柄	64,372.21 49銘柄	315,692	1,149,120 <12.5%>	
(トルコ)		百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
TURKIYE GARANTI BANKASI	945.5	1,060.2	871	13,673	金融	
AKBANK T. A. S.	1,226.92	1,492.72	880	13,818	金融	
TURKIYE IS BANKASI-C	995.1	1,271	683	10,728	金融	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	439.5	696.6	1,113	17,465	コミュニケーション・サービス	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	44.1	90.9	788	12,372	エネルギー	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	507.91	868.81	741	11,627	素材	
HACI OMER SABANCI HOLDING	631.8	803.9	732	11,490	金融	
TURKIYE HALK BANKASI	722	1,108.3	674	10,590	金融	
YAPI VE KREDI BANKASI	1,075.6	—	—	—	金融	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	795.1	961.2	493	7,736	金融	
KOC HOLDING AS	361.15	399.15	696	10,928	資本財・サービス	
TURK HAVA YOLLARI AO	356.2	567.8	676	10,619	資本財・サービス	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	34.4	94.4	634	9,960	生活必需品	
トルコ・リラ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,135.28 13銘柄	9,414.98 12銘柄	8,987	141,012 <1.5%>	
(メキシコ)		百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
BANCO SANTANDER MEXICO SA IN	621	—	—	—	金融	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	108	134	1,307	6,287	生活必需品	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	7,641	7,766	11,602	55,807	コミュニケーション・サービス	
GRUPO TELEvisa SAB-SER CPO	552	719	1,732	8,331	コミュニケーション・サービス	
CEMEX SAB-CPO	7,073.19	10,067.19	6,473	31,136	素材	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	309	430	6,108	29,382	生活必需品	
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	296.23	296.23	977	4,700	素材	
ALFA S. A. B. -A	716	—	—	—	資本財・サービス	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	735	648	3,509	16,881	素材	
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	804	956	5,407	26,008	生活必需品	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	481	648	5,242	25,215	金融	
メキシコ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	19,336.42 11銘柄	21,664.42 9銘柄	42,359	203,750 <2.2%>	
(チリ)		百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
ENEL CHILE SA	4,877.97	6,997.67	45,827	6,145	公益事業	
ENEL AMERICAS SA-RTS	1,722.93	—	—	—	公益事業	
LATAM AIRLINES GROUP SA	70	—	—	—	資本財・サービス	
CENCOSUD SA	414.5	—	—	—	生活必需品	
BANCO SANTANDER CHILE	9,830.9	21,058.8	74,864	10,039	金融	
ENEL AMERICAS SA	5,285	8,533.63	110,937	14,876	公益事業	
EMPRESAS CMPC SA	168.8	—	—	—	素材	
FALABELLA SA	86.4	218	61,912	8,302	一般消費財・サービス	
EMPRESAS COPEC SA	46.3	—	—	—	エネルギー	
BANCO DE CHILE	3,966.92	12,197.92	93,728	12,569	金融	
チリ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	26,469.72 10銘柄	49,006.02 5銘柄	387,269	51,932 <0.6%>	

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	千サウジアラビア・リアル	千円	
(サウジアラビア)					
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	—	214.6	1,916	55,076	素材
SAUDI TELECOM CO	—	75	742	21,339	コミュニケーション・サービス
AL RAJHI BANK	—	174	1,009	29,004	金融
SAMBA FINANCIAL GROUP	—	126.2	339	9,756	金融
RIYAD BANK	—	163.6	276	7,946	金融
ETIHAD ETISALAT CO	—	120.7	337	9,712	コミュニケーション・サービス
SAVOLA	—	71.2	320	9,208	生活必需品
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	—	62.1	329	9,477	素材
ALINMA BANK	—	174.26	256	7,382	金融
NATIONAL COMMERCIAL BANK	—	130.5	486	13,970	金融
SAUDI ARABIAN OIL CO	—	98.8	324	9,313	エネルギー
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	—	309.9	261	7,508	素材
サウジアラビア・リアル通貨計	株数、金額	1,720.86	6,600	189,696	
	銘柄数 < 比率 >	12銘柄		< 2.1% >	
	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
(インド)					
TATA STEEL LTD	121.5	185.4	6,116	8,868	素材
AXIS BANK LTD	184.6	233.9	10,021	14,531	金融
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	8.7	13.5	8,008	11,612	一般消費財・サービス
HINDUSTAN UNILEVER LTD	24.9	27.3	5,934	8,604	生活必需品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	456.1	469.4	10,131	14,691	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	527.8	554.7	10,245	14,855	金融
NTPC LTD	648.4	916	8,656	12,551	公益事業
POWER FINANCE CORPORATION	305.8	359.4	3,026	4,387	金融
JSW STEEL LTD	222.7	335.2	6,400	9,280	素材
INDIAN OIL CORP LTD	1,082.8	1,020.7	8,966	13,001	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	440.45	422.05	16,265	23,585	エネルギー
VODAFONE IDEA LTD	—	11,058.9	11,058	16,035	コミュニケーション・サービス
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	237.9	—	—	—	公益事業
JINDAL STEEL & POWER LTD	—	276.9	4,255	6,171	素材
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	30.5	30.5	2,122	3,078	金融
TECH MAHINDRA LTD	42.2	58.2	3,301	4,786	情報技術
YES BANK LTD	235.2	176.4	461	668	金融
TATA MOTORS LTD-A-DVR	318.2	318.2	1,318	1,912	一般消費財・サービス
REC LTD	331.1	383.6	4,154	6,023	金融
COAL INDIA LTD	375.7	725.1	9,806	14,220	エネルギー
BHARTI INFRATEL LTD	114.4	206.8	4,688	6,797	コミュニケーション・サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	79	217.4	5,023	7,283	金融
GAIL INDIA LTD	104.53	378.66	3,972	5,759	公益事業
HINDALCO INDUSTRIES LTD	374.5	528	7,729	11,208	素材
GRASIM INDUSTRIES LTD	81.2	106.8	6,708	9,727	素材
WIPRO LTD	136.53	204.23	4,591	6,657	情報技術
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	61.56	84.16	18,512	26,842	情報技術
INFOSYS LTD	362.4	472.4	36,029	52,243	情報技術
LARSEN & TOUBRO LTD	41.82	55.72	5,261	7,628	資本財・サービス
TATA MOTORS LTD	845.2	1,066.8	11,036	16,002	一般消費財・サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	124.7	147.9	27,882	40,429	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD	318.6	400.4	71,587	103,801	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	741.75	1,211.25	9,980	14,472	エネルギー
ITC LTD	236.4	432.9	8,984	13,028	生活必需品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	98.9	169.5	8,991	13,038	一般消費財・サービス
HERO MOTOCORP LTD	15.3	25.1	6,873	9,965	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD	386.22	211.42	12,293	17,824	コミュニケーション・サービス

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS HCL TECHNOLOGIES LTD VEDANTA LTD	百株 108.4 58.1 860.5	百株 152.4 151.4 1,334.6	千インド・ルピー 7,267 8,768 14,206	千円 10,537 12,714 20,599	ヘルスケア 情報技術 素材
インド・ルピー通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	25,123.19 39銘柄	410,641	595,430 <6.5%>	
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
UNITED TRACTORS TBK PT ASTRA INTERNATIONAL TBK PT SEMEN INDONESIA PERSERO TBK INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER BANK NEGARA INDONESIA PERSER BANK CENTRAL ASIA TBK PT BANK MANDIRI PERSERO TBK PT PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT BANK RAKYAT INDONESIA PERSER ADARO ENERGY TBK PT	284 3,084 470 770 7,956 1,252 515 2,977 3,015 6,605 4,729	— 2,563 — — 9,272 1,727 615 3,370 — 7,761 —	— 1,243,055 — — 2,892,864 787,512 1,805,025 1,685,000 — 2,367,105 —	— 9,198 — — 21,407 5,827 13,357 12,469 — 17,516 —	エネルギー 一般消費財・サービス 素材 生活必需品 コミュニケーション・サービス 金融 金融 金融 公益事業 金融 エネルギー
インドネシア・ルピア通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	25,308 6銘柄	10,780,561	79,776 <0.9%>	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
CIA PARANAENSE DE ENERGIA IRB BRASIL RESSEGUROS SA BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT CIA DE SANEAMENTO DO PA-UNIT PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR BANCO BRADESCO SA-PREF ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF CIA SIDERURGICA NACIONAL SA VALE SA GERDAU SA-PREF PETROBRAS - PETROLEO BRAS CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF ITAUSA SA BRASKEM SA-PREF A CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B BANCO DO BRASIL S. A. COSAN SA CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB EMBRAER SA METALURGICA GERDAU SA-PREF CCR SA BRF SA CIA SANEAMENTO BASICO DE SP CIA ENERGETICA DE SP-PREF B TIM PARTICIPACOES SA TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF LOJAS RENNER S. A. LOJAS AMERICANAS SA-PREF JBS SA	12 17 46 16 139 — 851 781.6 1,073.36 228 801.9 332 641 390.97 375.41 50 48 376 40 68 58 223 681 242 241 76 77 200.26 117 50.05 85 490	6 146 36 — 268 66 1,300 1,437.26 1,833.36 246 1,035.9 367 821 413.97 — 125 48 453 — 123 33 282 753 252 197 68 — 194.26 153 50.05 85.84 429	35 141 286 — 594 478 2,857 3,068 4,858 263 5,724 576 1,847 460 — 293 162 1,517 — 400 201 230 547 372 397 393 — 296 747 205 266 941	723 2,861 5,796 — 12,047 9,694 57,862 62,138 98,382 5,335 115,918 11,675 37,406 9,330 — 5,950 3,299 30,730 — 8,117 4,086 4,676 11,085 7,552 8,054 7,970 — 5,998 15,134 4,155 5,388 19,068	公益事業 金融 金融 公益事業 一般消費財・サービス 生活必需品 エネルギー 金融 金融 素材 素材 エネルギー 公益事業 金融 素材 公益事業 公益事業 資本財・サービス 素材 資本財・サービス 生活必需品 公益事業 公益事業 コミュニケーション・サービス コミュニケーション・サービス 一般消費財・サービス 一般消費財・サービス 生活必需品

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	千ブラジル・リアル	千円		
SUZANO SA	42.45	89.45	333	6,750	素材	
BANCO ESTADO RIO GRAN-PREF B	70	—	—	—	金融	
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	—	197	243	4,926	生活必需品	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	79	—	—	—	公益事業	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	150	141	796	16,132	金融	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	141.08	—	—	—	不動産	
CIELO SA	347.28	752.28	361	7,312	情報技術	
HYPERA SA	53	—	—	—	ヘルスケア	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	45	—	—	—	その他	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	18	90	218	4,417	公益事業	
SUL AMERICA SA - UNITS	45	—	—	—	金融	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	32	32	37	766	公益事業	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	82	146	415	8,408	金融	
TELEFONICA BRASIL S. A.	—	10	48	990	コミュニケーション・サービス	
KLABIN SA - UNIT	98	144	300	6,085	素材	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	292	565	1,041	21,086	エネルギー	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	—	199	488	9,889	金融	
LOJAS AMERICANAS SA	19	22.93	60	1,227	一般消費財・サービス	
COGNA EDUCACAO	317	475	342	6,925	一般消費財・サービス	
BANCO BRADESCO S. A.	202.65	382.41	743	15,046	金融	
AMBEV SA	650	878	1,241	25,140	生活必需品	
ブラジル・リアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,511.01 49銘柄	15,346.71 43銘柄	34,841	705,549 <7.6%>	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円		
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	—	650	1,103	16,799	金融	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	—	682	612	9,327	資本財・サービス	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	—	131	1,021	15,554	金融	
IND & COMM BK OF CHINA-A	—	2,318	1,196	18,216	金融	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	—	55	104	1,592	ヘルスケア	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	—	60	198	3,019	金融	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	—	84	70	1,077	一般消費財・サービス	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	—	4	616	9,392	生活必需品	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	—	46	261	3,977	素材	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	—	996	1,114	16,974	金融	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	—	404	145	2,221	公益事業	
CITIC SECURITIES CO-A	—	110	315	4,803	金融	
CHINA MERCHANTS BANK-A	—	359	1,318	20,087	金融	
PING AN BANK CO LTD-A	—	378	538	8,203	金融	
GF SECURITIES CO LTD-A	—	98	162	2,471	金融	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	—	2,175	1,104	16,827	資本財・サービス	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	—	379	706	10,765	一般消費財・サービス	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	—	238	86	1,319	素材	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	—	291	157	2,402	資本財・サービス	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	—	845	228	3,487	資本財・サービス	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	—	621	185	2,827	素材	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	—	96	139	2,117	素材	
YANZHOU COAL MINING CO-A	—	49	47	720	エネルギー	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	—	303	202	3,082	金融	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	—	4,834	1,696	25,841	金融	
BANK OF CHINA LTD-A	—	2,442	886	13,500	金融	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	—	1,704	695	10,588	エネルギー	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	—	1,733	927	14,120	金融	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	—	263	417	6,360	エネルギー	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首 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	千オフショア・人民元	千円	
CHINA VANKE CO LTD -A	—	191	547	8,334	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	—	122	374	5,704	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	—	412	230	3,507	金融
CHINA MINSHENG BANKING-A	—	1,525	905	13,796	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	—	1,551	623	9,495	金融
CRRC CORP LTD-A	—	552	324	4,943	資本財・サービス
CHINA UNITED NETWORK-A	—	913	463	7,063	コミュニケーション・サービス
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	—	90	198	3,030	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	—	123	182	2,774	金融
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	—	268	213	3,257	資本財・サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	—	815	392	5,970	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	—	35	176	2,694	金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	—	603	392	5,978	金融
AIR CHINA LTD-A	—	148	103	1,568	資本財・サービス
BYD CO LTD -A	—	18	142	2,175	一般消費財・サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	—	44	42	641	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-A	—	98	148	2,265	資本財・サービス
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	—	259	123	1,873	素材
HUANENG POWER INTL INC-A	—	386	172	2,627	公益事業
オフショア・人民元通貨計	株数、金額	30,501	22,021	335,382	
	銘柄数 < 比率 >	48銘柄		< 3.6% >	
	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
(マレーシア)					
MISC BHD	—	429	335	8,433	資本財・サービス
MALAYAN BANKING BHD	647	675	520	13,083	金融
GENTING BHD	450	—	—	—	一般消費財・サービス
PUBLIC BANK BERHAD	346	349	595	14,968	金融
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	391	—	—	—	素材
GENTING MALAYSIA BHD	675	—	—	—	一般消費財・サービス
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	737	691	255	6,427	金融
TENAGA NASIONAL BHD	441	347	408	10,258	公益事業
PETRONAS GAS BHD	103	—	—	—	公益事業
SAPURA ENERGY BHD	6,928	—	—	—	エネルギー
マレーシア・リンギット通貨計	株数、金額	10,718	2,491	2,115	53,172
	銘柄数 < 比率 >	9銘柄	5銘柄		< 0.6% >
	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
(南アフリカ)					
GOLD FIELDS LTD	254.9	154.2	2,478	15,665	素材
NEPI ROCKCASTLE PLC	49	75	706	4,467	不動産
MULTICHOICE GROUP LTD	—	127.3	1,382	8,736	コミュニケーション・サービス
OLD MUTUAL LTD	690	1,695.4	2,137	13,511	金融
VODACOM GROUP LTD	162.5	171.2	2,168	13,703	コミュニケーション・サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD	100.9	227.2	2,442	15,435	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD	100.1	119	1,247	7,886	金融
BIDVEST GROUP LTD	54.3	88.7	1,303	8,240	資本財・サービス
BID CORP LTD	51.1	73.1	2,088	13,201	生活必需品
NETCARE LTD	329.3	566.9	805	5,091	ヘルスケア
STANDARD BANK GROUP LTD	302.9	364.2	3,796	23,995	金融
SASOL LTD	151.9	236.4	3,208	20,275	素材
REMGRU LTD	75.4	124.1	1,247	7,885	金融
DISCOVERY LTD	—	89.4	936	5,921	金融
EXXARO RESOURCES LTD	46	80.3	1,030	6,513	エネルギー
PICK N PAY STORES LTD	85.7	—	—	—	生活必需品
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	96.4	210.2	709	4,482	一般消費財・サービス

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	千南アフリカ・ランド	千円	
SANLAM LTD	310.4	427.2	2,564	16,204	金融
TIGER BRANDS LTD	31.8	66.8	1,269	8,021	生活必需品
FIRSTRAND LTD	539	889.3	3,390	21,430	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	276.8	399.6	1,376	8,700	一般消費財・サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	43.3	78.4	517	3,270	一般消費財・サービス
ABSA GROUP LTD	251.3	254.6	2,136	13,500	金融
NASPERS LTD-N SHS	14.2	17.29	5,543	35,033	一般消費財・サービス
INVESTEC LTD	69.9	—	—	—	金融
MTN GROUP LTD	544.1	385.9	2,248	14,211	コミュニケーション・サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	137.8	64.3	737	4,663	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	70.3	132.8	1,913	12,091	ヘルスケア
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	57.9	54.5	2,705	17,096	素材
BARLOWORLD LTD	60.7	—	—	—	資本財・サービス
SAPPI LIMITED	157.1	470.8	1,306	8,259	素材
TELKOM SA SOC LTD	108.3	350	1,236	7,814	コミュニケーション・サービス
MONDI LTD	21.7	—	—	—	その他
SPAR GROUP LIMITED/THE	47.3	77.7	1,372	8,675	生活必需品
MR PRICE GROUP LTD	31.9	59	843	5,332	一般消費財・サービス
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	276.4	—	—	—	ヘルスケア
SIBANYE STILLWATER LTD	555.7	265	993	6,280	素材
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,156.3 35銘柄	8,395.79 32銘柄	57,848 <4.0%>	
(タイ)	百株	百株	千タイ・パーツ	千円	
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	102	208	2,236	7,736	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR	166	309	12,051	41,696	素材
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	110	227	2,105	7,284	金融
KASIKORNBANK PCL-NVDR	78	116	1,073	3,712	金融
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	571	1,068	7,849	27,160	金融
THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	302	372	1,348	4,665	金融
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	—	685	1,935	6,695	素材
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	200	221	4,154	14,375	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	1,790	2,994	3,143	10,877	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	1,233	3,163	1,992	6,894	エネルギー
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	299	384	3,657	12,655	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	2,843	8,853	2,425	8,392	エネルギー
PTT PCL-NVDR	3,860	5,902	23,165	80,152	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	347	706	3,282	11,358	エネルギー
CP ALLO PCL-NVDR	423	693	4,660	16,125	生活必需品
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,034	1,316	4,178	14,456	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	614	1,214	5,948	20,582	素材
タイ・パーツ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	13,972 16銘柄	28,431 17銘柄	85,208 <3.2%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	393,868.89 357銘柄	601,604.9 398銘柄	— <82.7%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首 □ 数	当期 □ 数	期末 評 価 額	
			外貨建金額 千円	邦貨換算金額 千円
(アメリカ) INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	千口 325	千口 651	千アメリカ・ドル 11,652	千円 1,254,434
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	325 1 銘柄	651 1 銘柄	11,652 <13.6%>
(トルコ) EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	千口 171.87	千口 —	千トルコ・リラ —	千円 —
トルコ・リラ通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	171.87 1 銘柄	— —	— <—>
(メキシコ) FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	千口 67.7	千口 80.2	千メキシコ・ペソ 1,479	千円 7,117
メキシコ・ペソ通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	67.7 1 銘柄	80.2 1 銘柄	1,479 <0.1%>
(南アフリカ) REDEFINE PROPERTIES LTD GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	千口 105 59.43	千口 — 76.93	千南アフリカ・ランド — 1,134	千円 — 7,171
南アフリカ・ランド通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	164.43 2 銘柄	76.93 1 銘柄	1,134 <0.1%>
合 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	729 5 銘柄	808.13 3 銘柄	— <13.8%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国 MSCI EMGMKT (アメリカ)	百万円 274	百万円 —

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年7月6日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 7,624,712	% 82.3
投資信託証券	1,268,723	13.7
コール・ローン等、その他	371,752	4.0
投資信託財産総額	9,265,188	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

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

(注3) 当期末における外貨建純資産(9,069,699千円)の投資信託財産総額(9,265,188千円)に対する比率は、97.9%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年7月6日現在

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

*期首における元本額は4,649,472,217円、当作成期間中における追加設定元本額は2,455,463,969円、同解約元本額は407,231,529円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、新興国株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)20,517,485円、ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)272,574,554円、ダイワファンドラップオンライン 外国株式インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)306,201,274円、D-1's 新興国株式インデックス121,622,083円、i F r e e 新興国株式インデックス2,442,811,336円、i F r e e 8資産バランス1,927,698,988円、新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド(為替ヘッジなし/適格機関投資家専用)73,329,223円、DCダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド1,048,944,143円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式389,621,996円、ダイワ・ノーロード新興国株式ファンド94,383,575円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は13,774円です。

■損益の状況

当期 自 2019年7月6日 至 2020年7月6日

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

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

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

【注記】

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

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

ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス

運用報告書（全体版） 第4期

（決算日 2020年11月30日）
（作成対象期間 2019年12月3日～2020年11月30日）

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/>

★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	30%以下	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行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			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			
1 期末(2017年11月30日)	円 10,010	円 0	% 0.1	522.295	% 0.2	% 99.3	% -	百万円 1,379
2 期末(2018年11月30日)	10,025	0	0.1	523.683	0.3	99.4	-	2,161
3 期末(2019年12月 2 日)	10,249	0	2.2	536.068	2.4	99.5	-	2,135
4 期末(2020年11月30日)	10,153	0	△0.9	531.781	△0.8	99.5	-	2,402

(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：10,249円

期末：10,153円（分配金0円）

騰落率：△0.9%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

金利の上昇（債券価格は下落）がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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 (ベンチマーク)		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率		
(期首) 2019年12月 2 日	10,249	% -	536.068	% -	% 99.5	% -
12月末	10,243	△0.1	535.929	△0.0	99.5	-
2020年 1 月末	10,289	0.4	538.313	0.4	99.2	-
2 月末	10,372	1.2	542.689	1.2	99.3	-
3 月末	10,202	△0.5	533.796	△0.4	99.4	-
4 月末	10,235	△0.1	535.588	△0.1	99.4	-
5 月末	10,187	△0.6	533.139	△0.5	99.4	-
6 月末	10,144	△1.0	531.018	△0.9	99.4	-
7 月末	10,180	△0.7	532.880	△0.6	99.4	-
8 月末	10,130	△1.2	530.432	△1.1	99.2	-
9 月末	10,159	△0.9	531.917	△0.8	99.3	-
10月末	10,140	△1.1	531.087	△0.9	99.5	-
(期末) 2020年11月30日	10,153	△0.9	531.781	△0.8	99.5	-

(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

(2019.12.3～2020.11.30)

■国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇しました。

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

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「日本債券インデックスマザーファンド」の受益証券を中心に組み入れ、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出や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

ポートフォリオについて

(2019.12.3～2020.11.30)

■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

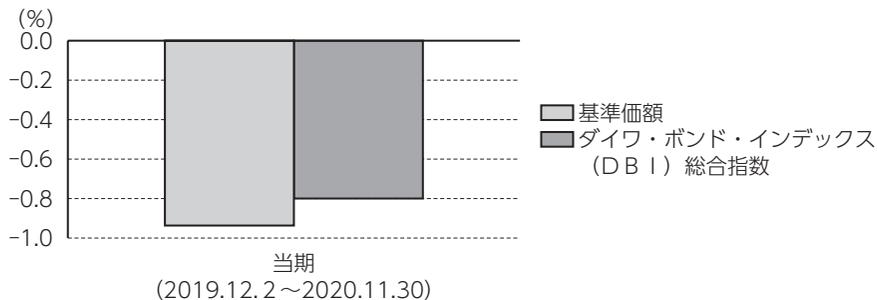
当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

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 $\Delta 0.8\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 0.9\%$ 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 $\Delta 0.1\%$ でした。差異の内訳は、運用管理費用等の要因によるベンチマークとの差異が $\Delta 0.1\%$ 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、信託報酬要因を除くと、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

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

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2019年12月3日 ～2020年11月30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）	180

（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」の受益証券を中心に組み入れ、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 (2019.12.3~2020.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	11円	0.109%	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10,195円です。
(投 信 会 社)	(7)	(0.071)	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)	(3)	(0.027)	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)	(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	12	0.115	

(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。

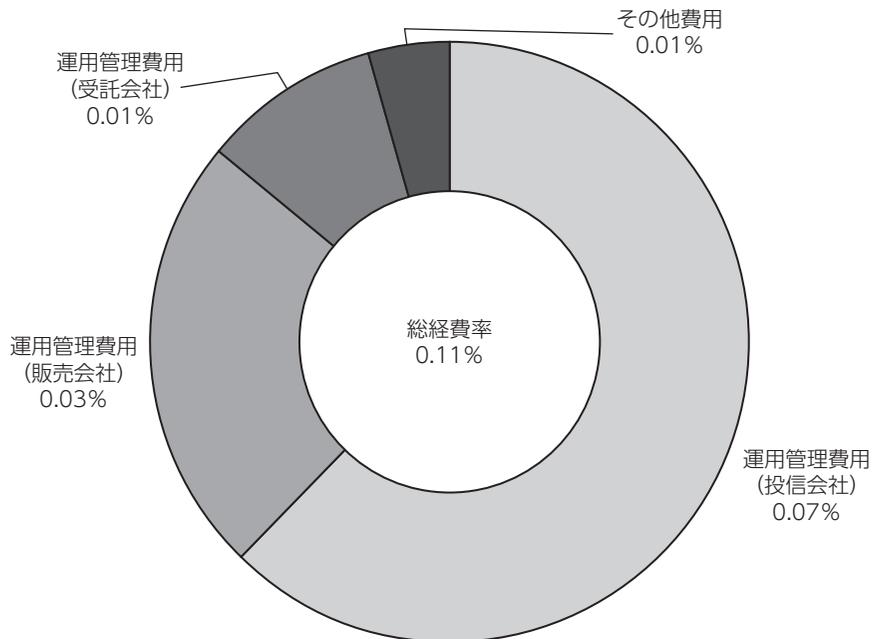
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.11%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12月3日から2020年11月30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	438,372	623,879	237,712	338,876

(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12月3日から2020年11月30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
公社債	百万円 39,235	百万円 1,793			% 4.6	百万円 30,025	
コール・ローン	127,895	-	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合2.5%

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

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

種 類	当 期	
	日本債券インデックスマザーファンド	
	買	付 額
公社債		百万円 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、当作成期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 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	1,491,311	1,691,971	2,400,061	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日本債券インデックスマザーファンド	千円 2,400,061	% 99.6
コール・ローン等、その他	9,150	0.4
投資信託財産総額	2,409,212	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,409,212,664円
コール・ローン等	5,048,214
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	2,400,061,917
未収入金	4,102,533
(B) 負債	6,771,575
未払解約金	5,442,381
未払信託報酬	1,265,985
その他未払費用	63,209
(C) 純資産総額(A - B)	2,402,441,089
元本	2,366,238,389
次期繰越損益金	36,202,700
(D) 受益権総口数	2,366,238,389口
1万口当り基準価額(C/D)	10,153円

*期首における元本額は2,083,243,207円、当作成期間中における追加設定元本額は862,550,219円、同解約元本額は579,555,037円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,153円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月3日 至2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,585円
受取利息	195
支払利息	△ 1,780
(B) 有価証券売買損益	△15,993,434
売買益	2,947,211
売買損	△18,940,645
(C) 信託報酬等	△ 2,594,906
(D) 当期損益金(A + B + C)	△18,589,925
(E) 前期繰越損益金	26,380,971
(F) 追加信託差損益金	28,411,654
(配当等相当額)	(16,278,613)
(売買損益相当額)	(12,133,041)
(G) 合計(D + E + F)	36,202,700
次期繰越損益金(G)	36,202,700
追加信託差損益金	28,411,654
(配当等相当額)	(16,278,613)
(売買損益相当額)	(12,133,041)
分配準備積立金	26,383,258
繰越損益金	△18,592,212

(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	16,278,613
(d) 分配準備積立金	26,383,258
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	42,661,871
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	42,661,871
(h) 受益権総口数	2,366,238,389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。

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第21期 (決算日 2020年11月30日)

(作成対象期間 2019年12月3日～2020年11月30日)

日本債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント

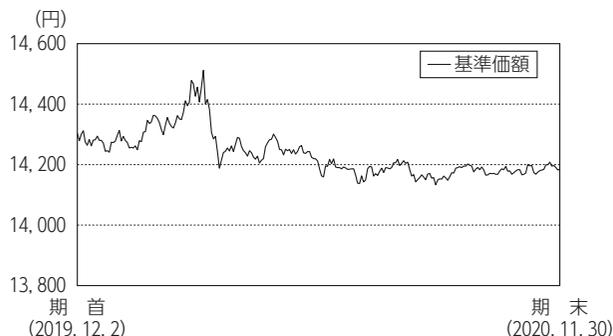
Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移

《運用経過》



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

(注1) 騰落率は期首比。

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

(注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は最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。

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：14,303円 期末：14,185円 騰落率：△0.8%

【基準価額の主な変動要因】

金利の上昇 (債券価格は下落) がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

国内債券市場では、長期金利は上昇しました。

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「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。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債券（転換社債券）は含まれておりません。

(注4) 単位未満は切捨て。

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

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(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		
国債証券		千円	%	千円	千円	
	407 2年国債	100,000	0.1000	100,230	100,230	2021/12/01
	319 10年国債	100,000	1.1000	101,279	101,279	2021/12/20
	53 20年国債	66,000	2.1000	67,539	67,539	2021/12/20
	54 20年国債	65,000	2.2000	66,584	66,584	2021/12/20
	408 2年国債	150,000	0.1000	150,382	150,382	2022/01/01
	409 2年国債	50,000	0.1000	50,137	50,137	2022/02/01
	410 2年国債	2,000,000	0.1000	2,006,360	2,006,360	2022/03/01
	131 5年国債	1,170,000	0.1000	1,173,346	1,173,346	2022/03/20
	321 10年国債	175,000	1.0000	177,548	177,548	2022/03/20
	322 10年国債	130,000	0.9000	131,723	131,723	2022/03/20
	55 20年国債	140,000	2.0000	143,868	143,868	2022/03/21
	413 2年国債	60,000	0.1000	60,225	60,225	2022/06/01
	132 5年国債	880,000	0.1000	883,071	883,071	2022/06/20
	323 10年国債	380,000	0.9000	386,049	386,049	2022/06/20
	415 2年国債	750,000	0.1000	753,067	753,067	2022/08/01
	133 5年国債	550,000	0.1000	552,381	552,381	2022/09/20
	325 10年国債	310,000	0.8000	315,208	315,208	2022/09/20
	58 20年国債	200,000	1.9000	207,336	207,336	2022/09/20
	417 2年国債	100,000	0.1000	100,450	100,450	2022/10/01
	134 5年国債	870,000	0.1000	874,289	874,289	2022/12/20
	326 10年国債	30,000	0.7000	30,512	30,512	2022/12/20
	327 10年国債	450,000	0.8000	458,608	458,608	2022/12/20
	59 20年国債	45,000	1.7000	46,694	46,694	2022/12/20
	60 20年国債	10,000	1.4000	10,314	10,314	2022/12/20
	135 5年国債	1,700,000	0.1000	1,709,401	1,709,401	2023/03/20
	328 10年国債	350,000	0.6000	355,890	355,890	2023/03/20
	61 20年国債	100,000	1.0000	102,617	102,617	2023/03/20
	136 5年国債	950,000	0.1000	955,709	955,709	2023/06/20
	329 10年国債	500,000	0.8000	511,900	511,900	2023/06/20
	62 20年国債	95,000	0.8000	97,273	97,273	2023/06/20

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	
	63 20年国債		1.8000	130,000	136,437	2023/06/20
	137 5年国債		0.1000	700,000	704,725	2023/09/20
	330 10年国債		0.8000	612,000	628,095	2023/09/20
	331 10年国債		0.6000	365,000	372,544	2023/09/20
	64 20年国債		1.9000	90,000	95,152	2023/09/20
	138 5年国債		0.1000	900,000	907,029	2023/12/20
	332 10年国債		0.6000	250,000	255,630	2023/12/20
	65 20年国債		1.9000	175,000	185,913	2023/12/20
	66 20年国債		1.8000	185,000	195,970	2023/12/20
	139 5年国債		0.1000	850,000	856,757	2024/03/20
	333 10年国債		0.6000	700,000	717,045	2024/03/20
	67 20年国債		1.9000	55,000	58,708	2024/03/20
	68 20年国債		2.2000	120,000	129,283	2024/03/20
	69 20年国債		2.1000	110,000	118,145	2024/03/20
	140 5年国債		0.1000	900,000	907,704	2024/06/20
	334 10年国債		0.6000	900,000	923,436	2024/06/20
	70 20年国債		2.4000	83,000	90,489	2024/06/20
	71 20年国債		2.2000	125,000	135,388	2024/06/20
	141 5年国債		0.1000	920,000	928,436	2024/09/20
	335 10年国債		0.5000	690,000	706,608	2024/09/20
	72 20年国債		2.1000	105,000	113,926	2024/09/20
	142 5年国債		0.1000	430,000	434,115	2024/12/20
	336 10年国債		0.5000	275,000	282,056	2024/12/20
	337 10年国債		0.3000	400,000	407,004	2024/12/20
	73 20年国債		2.0000	120,000	130,384	2024/12/20
	74 20年国債		2.1000	73,000	79,614	2024/12/20
	143 5年国債		0.1000	650,000	656,461	2025/03/20
	338 10年国債		0.4000	580,000	593,287	2025/03/20
	75 20年国債		2.1000	80,000	87,692	2025/03/20
	76 20年国債		1.9000	51,000	55,463	2025/03/20
	77 20年国債		2.0000	130,000	141,937	2025/03/20
	144 5年国債		0.1000	1,085,000	1,095,915	2025/06/20
	339 10年国債		0.4000	590,000	604,036	2025/06/20
	78 20年国債		1.9000	61,000	66,622	2025/06/20
	79 20年国債		2.0000	50,000	54,837	2025/06/20
	80 20年国債		2.1000	53,000	58,369	2025/06/20
	340 10年国債		0.4000	760,000	778,711	2025/09/20
	82 20年国債		2.1000	87,000	96,259	2025/09/20
	341 10年国債		0.3000	500,000	510,280	2025/12/20
	83 20年国債		2.1000	93,000	103,388	2025/12/20
	342 10年国債		0.1000	1,080,000	1,091,502	2026/03/20
	85 20年国債		2.1000	58,000	64,797	2026/03/20
	86 20年国債		2.3000	80,000	90,227	2026/03/20
	87 20年国債		2.2000	55,000	61,738	2026/03/20
	343 10年国債		0.1000	680,000	687,588	2026/06/20
	88 20年国債		2.3000	100,000	113,396	2026/06/20
	89 20年国債		2.2000	78,000	88,012	2026/06/20
	344 10年国債		0.1000	820,000	829,569	2026/09/20
	90 20年国債		2.2000	20,000	22,684	2026/09/20
	91 20年国債		2.3000	60,000	68,404	2026/09/20

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	
	345 10年国債		0.1000	650,000	657,910	2026/12/20
	92 20年国債		2.1000	310,000	351,524	2026/12/20
	346 10年国債		0.1000	700,000	708,869	2027/03/20
	93 20年国債		2.0000	100,000	113,310	2027/03/20
	94 20年国債		2.1000	130,000	148,127	2027/03/20
	347 10年国債		0.1000	950,000	962,521	2027/06/20
	95 20年国債		2.3000	50,000	57,912	2027/06/20
	96 20年国債		2.1000	55,000	62,978	2027/06/20
	348 10年国債		0.1000	600,000	608,214	2027/09/20
	97 20年国債		2.2000	40,000	46,285	2027/09/20
	98 20年国債		2.1000	320,000	368,092	2027/09/20
	349 10年国債		0.1000	1,050,000	1,064,532	2027/12/20
	99 20年国債		2.1000	100,000	115,542	2027/12/20
	350 10年国債		0.1000	700,000	709,765	2028/03/20
	100 20年国債		2.2000	155,000	181,010	2028/03/20
	101 20年国債		2.4000	350,000	413,875	2028/03/20
	27 メキシコ国債		1.0500	100,000	94,647	2028/04/20
	351 10年国債		0.1000	800,000	810,936	2028/06/20
	103 20年国債		2.3000	170,000	200,659	2028/06/20
	104 20年国債		2.1000	10,000	11,651	2028/06/20
	11 フィリピン共和国		0.9900	100,000	99,957	2028/08/15
	352 10年国債		0.1000	750,000	759,997	2028/09/20
	105 20年国債		2.1000	126,000	147,393	2028/09/20
	106 20年国債		2.2000	150,000	176,644	2028/09/20
	353 10年国債		0.1000	580,000	587,505	2028/12/20
	107 20年国債		2.1000	90,000	105,728	2028/12/20
	108 20年国債		1.9000	462,000	535,263	2028/12/20
	354 10年国債		0.1000	600,000	607,494	2029/03/20
	109 20年国債		1.9000	55,000	63,936	2029/03/20
	110 20年国債		2.1000	260,000	306,581	2029/03/20
	355 10年国債		0.1000	690,000	698,286	2029/06/20
	111 20年国債		2.2000	200,000	238,438	2029/06/20
	112 20年国債		2.1000	150,000	177,541	2029/06/20
	356 10年国債		0.1000	510,000	515,849	2029/09/20
	1 30年国債		2.8000	16,000	19,978	2029/09/20
	113 20年国債		2.1000	310,000	368,276	2029/09/20
	357 10年国債		0.1000	720,000	727,502	2029/12/20
	114 20年国債		2.1000	70,000	83,419	2029/12/20
	115 20年国債		2.2000	180,000	216,138	2029/12/20
	2 30年国債		2.4000	24,000	29,338	2030/02/20
	358 10年国債		0.1000	580,000	585,660	2030/03/20
	116 20年国債		2.2000	200,000	241,026	2030/03/20
	117 20年国債		2.1000	200,000	239,164	2030/03/20
	3 30年国債		2.3000	30,000	36,531	2030/05/20
	359 10年国債		0.1000	1,128,000	1,137,678	2030/06/20
	118 20年国債		2.0000	95,000	113,037	2030/06/20
	119 20年国債		1.8000	93,000	108,883	2030/06/20
	120 20年国債		1.6000	280,000	322,478	2030/06/20
	360 10年国債		0.1000	120,000	120,879	2030/09/20
	121 20年国債		1.9000	200,000	236,670	2030/09/20

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	
	122 20年国債		1.8000	160,000	187,771	2030/09/20
	4 30年国債		2.9000	36,000	46,270	2030/11/20
	123 20年国債		2.1000	200,000	241,368	2030/12/20
	124 20年国債		2.0000	300,000	359,049	2030/12/20
	125 20年国債		2.2000	130,000	158,798	2031/03/20
	126 20年国債		2.0000	110,000	132,112	2031/03/20
	127 20年国債		1.9000	165,000	196,475	2031/03/20
	5 30年国債		2.2000	28,000	34,285	2031/05/20
	128 20年国債		1.9000	250,000	298,540	2031/06/20
	129 20年国債		1.8000	100,000	118,366	2031/06/20
	130 20年国債		1.8000	140,000	166,145	2031/09/20
	131 20年国債		1.7000	150,000	176,403	2031/09/20
	6 30年国債		2.4000	24,000	30,103	2031/11/20
	132 20年国債		1.7000	40,000	47,150	2031/12/20
	133 20年国債		1.8000	430,000	511,583	2031/12/20
	134 20年国債		1.8000	200,000	238,518	2032/03/20
	135 20年国債		1.7000	92,000	108,687	2032/03/20
	136 20年国債		1.6000	145,000	169,679	2032/03/20
	7 30年国債		2.3000	55,000	68,833	2032/05/20
	138 20年国債		1.5000	100,000	116,118	2032/06/20
	139 20年国債		1.6000	370,000	433,869	2032/06/20
	140 20年国債		1.7000	400,000	474,656	2032/09/20
	8 30年国債		1.8000	27,000	32,412	2032/11/22
	9 30年国債		1.4000	43,000	49,597	2032/12/20
	141 20年国債		1.7000	200,000	237,824	2032/12/20
	142 20年国債		1.8000	240,000	288,242	2032/12/20
	10 30年国債		1.1000	45,000	50,314	2033/03/20
	143 20年国債		1.6000	210,000	247,667	2033/03/20
	144 20年国債		1.5000	240,000	280,140	2033/03/20
	11 30年国債		1.7000	40,000	47,755	2033/06/20
	145 20年国債		1.7000	380,000	453,674	2033/06/20
	12 30年国債		2.1000	60,000	74,837	2033/09/20
	146 20年国債		1.7000	280,000	334,936	2033/09/20
	13 30年国債		2.0000	75,000	92,820	2033/12/20
	147 20年国債		1.6000	300,000	355,686	2033/12/20
	14 30年国債		2.4000	82,000	105,986	2034/03/20
	148 20年国債		1.5000	280,000	328,854	2034/03/20
	15 30年国債		2.5000	50,000	65,517	2034/06/20
	149 20年国債		1.5000	402,000	473,129	2034/06/20
	16 30年国債		2.5000	250,000	328,777	2034/09/20
	150 20年国債		1.4000	200,000	233,018	2034/09/20
	17 30年国債		2.4000	130,000	169,669	2034/12/20
	151 20年国債		1.2000	400,000	455,604	2034/12/20
	18 30年国債		2.3000	80,000	103,569	2035/03/20
	152 20年国債		1.2000	300,000	341,940	2035/03/20
	19 30年国債		2.3000	57,000	73,976	2035/06/20
	153 20年国債		1.3000	400,000	461,884	2035/06/20
	154 20年国債		1.2000	550,000	627,715	2035/09/20
	21 30年国債		2.3000	60,000	78,239	2035/12/20
	155 20年国債		1.0000	400,000	444,808	2035/12/20

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	
	22 30年国債		2.5000	170,000	227,366	2036/03/20
	156 20年国債		0.4000	200,000	204,570	2036/03/20
	157 20年国債		0.2000	100,000	99,103	2036/06/20
	24 30年国債		2.5000	92,000	123,750	2036/09/20
	158 20年国債		0.5000	400,000	414,256	2036/09/20
	25 30年国債		2.3000	150,000	197,455	2036/12/20
	159 20年国債		0.6000	280,000	293,988	2036/12/20
	26 30年国債		2.4000	180,000	240,417	2037/03/20
	160 20年国債		0.7000	360,000	383,565	2037/03/20
	161 20年国債		0.6000	250,000	262,237	2037/06/20
	27 30年国債		2.5000	150,000	203,929	2037/09/20
	162 20年国債		0.6000	350,000	366,793	2037/09/20
	163 20年国債		0.6000	290,000	303,864	2037/12/20
	28 30年国債		2.5000	170,000	232,267	2038/03/20
	164 20年国債		0.5000	390,000	401,832	2038/03/20
	165 20年国債		0.5000	520,000	535,106	2038/06/20
	29 30年国債		2.4000	200,000	271,208	2038/09/20
	166 20年国債		0.7000	250,000	265,552	2038/09/20
	167 20年国債		0.5000	300,000	307,902	2038/12/20
	30 30年国債		2.3000	220,000	295,809	2039/03/20
	168 20年国債		0.4000	320,000	322,473	2039/03/20
	169 20年国債		0.3000	300,000	296,610	2039/06/20
	31 30年国債		2.2000	300,000	399,672	2039/09/20
	170 20年国債		0.3000	265,000	261,737	2039/09/20
	171 20年国債		0.3000	300,000	295,998	2039/12/20
	32 30年国債		2.3000	285,000	386,514	2040/03/20
	172 20年国債		0.4000	175,000	175,628	2040/03/20
	173 20年国債		0.4000	410,000	410,742	2040/06/20
	33 30年国債		2.0000	200,000	261,112	2040/09/20
	174 20年国債		0.4000	30,000	30,027	2040/09/20
	34 30年国債		2.2000	270,000	363,976	2041/03/20
	35 30年国債		2.0000	300,000	394,074	2041/09/20
	36 30年国債		2.0000	350,000	461,265	2042/03/20
	37 30年国債		1.9000	200,000	260,422	2042/09/20
	38 30年国債		1.8000	200,000	257,060	2043/03/20
	39 30年国債		1.9000	230,000	300,738	2043/06/20
	40 30年国債		1.8000	200,000	257,434	2043/09/20
	41 30年国債		1.7000	170,000	215,279	2043/12/20
	42 30年国債		1.7000	205,000	259,858	2044/03/20
	43 30年国債		1.7000	200,000	253,774	2044/06/20
	44 30年国債		1.7000	200,000	254,022	2044/09/20
	45 30年国債		1.5000	200,000	245,310	2044/12/20
	46 30年国債		1.5000	140,000	171,820	2045/03/20
	47 30年国債		1.6000	400,000	500,588	2045/06/20
	48 30年国債		1.4000	130,000	156,855	2045/09/20
	49 30年国債		1.4000	120,000	144,849	2045/12/20
	50 30年国債		0.8000	200,000	212,996	2046/03/20
	51 30年国債		0.3000	240,000	226,812	2046/06/20
	52 30年国債		0.5000	300,000	297,282	2046/09/20
	53 30年国債		0.6000	250,000	253,425	2046/12/20
	54 30年国債		0.8000	310,000	328,937	2047/03/20

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	
	55 30年国債	0.8000	260,000	275,696	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	100,000	105,963	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	230,000	243,540	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	102,314	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	370,000	391,023	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	300,000	309,285	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	210,000	226,902	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	205,542	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	155,778	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	200,000	194,924	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	230,000	217,724	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	330,000	311,493	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	200,000	188,472	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	212,988	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	235,000	220,810	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	164,000	162,571	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	70,000	69,212	2050/09/20
	4 40年国債	2.2000	107,000	152,652	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	125,000	172,705	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	143,091	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	158,820	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	282,336	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	201,889	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	345,000	370,875	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	333,408	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	350,000	329,353	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	310,000	291,338	2060/03/20
種別小計	銘柄数	258銘柄			
	金額		74,339,000	79,869,797	
地方債証券	108 共同発行地方	1.0100	100,000	101,290	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0.9900	100,000	101,347	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	101,272	2022/06/20
	361 大阪府公債	0.9200	100,000	101,422	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0.8400	100,000	101,433	2022/08/31
	713 東京都公債	0.7700	100,000	101,373	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0.8200	100,000	101,453	2022/09/20
	24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	101,467	2022/10/21
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	101,425	2022/12/22
	24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	101,446	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	101,593	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	101,053	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	102,240	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	204,030	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	102,063	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	101,959	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	101,851	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	204,676	2025/04/16
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	108,150	2025/11/21

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	
	751 東京都公債	0.3700	100,000	101,740	2025/12/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	100,121	2026/06/19
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,761	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,962	2027/03/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	201,266	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,915	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	101,267	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	117,165	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	115,381	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	118,478	2029/06/20
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	118,098	2029/12/14
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	118,447	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	116,738	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	116,983	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	110,064	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	132,043	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	116,726	2045/12/20
種別小計	銘柄数 金 額	36銘柄	3,900,000	4,128,711	
特殊債券 (除く金融債券)	33 地方公共団体	1.0350	100,000	101,238	2022/02/28
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	101,390	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	101,372	2022/07/29
	39政保地方公共団	0.8010	100,000	101,342	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	101,471	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	101,474	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	101,759	2023/02/24
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	101,475	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	101,477	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	101,927	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	101,426	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	102,222	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	101,956	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,321	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	101,900	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	203,702	2025/11/28
	127 都市再生	0.0750	100,000	100,023	2026/09/18
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	108,469	2027/08/25
	1 地方公共団15年	1.3340	100,000	108,858	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	116,636	2029/07/31
	47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	107,903	2029/09/20
	31 地方公共団20	1.7440	100,000	118,583	2033/09/28
	223 政保道路機構	1.4270	100,000	115,813	2034/07/31
	284 政保道路機構	0.1490	200,000	194,686	2036/07/31
	298 政保道路機構	0.5470	100,000	103,190	2036/12/26
	247 道路機構	0.3420	200,000	195,574	2040/03/19
種別小計	銘柄数 金 額	26銘柄	2,900,000	2,997,196	

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	99,942 千円	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄				
	金額			100,000	99,942	
普通社債券	11 セブンアンドアイ		0.5140	100,000	100,715	2022/06/20
	11三菱UFJ信託BK		1.3600	100,000	101,789	2022/06/27
	372 中国電力		1.2040	100,000	101,990	2022/08/25
	4 JXホールディングス		1.1450	100,000	102,104	2022/12/14
	30 大阪瓦斯		0.7590	100,000	101,426	2022/12/14
	175 オリックス		1.0640	100,000	102,662	2023/11/24
	21 西日本高速道		0.7540	100,000	102,091	2023/12/20
	1 三菱UFJFG 劣後		0.9400	100,000	101,696	2024/06/26
	482 九州電力		0.1700	100,000	100,278	2024/08/23
	5 野村不動産HD		0.9240	100,000	102,723	2025/05/30
	11日本たばこ産業		0.5990	100,000	102,243	2025/07/15
	63 中日本高速道		0.5760	100,000	102,447	2025/11/13
	4 ファーストリテイリング		0.7490	100,000	102,949	2025/12/18
	14 セブンアンドアイ		0.1900	100,000	100,009	2025/12/19
	20 成田国際空港		0.1050	100,000	99,909	2026/08/21
	17 パナソニック		0.4700	100,000	100,997	2026/09/18
	509 関西電力		0.4700	100,000	100,869	2027/05/25
	12 アサヒグループHD		0.3300	100,000	100,552	2027/06/11
	15 デンソー		0.2450	100,000	100,232	2027/06/18
	78 トヨタファイナンス		0.2650	100,000	100,334	2027/07/23
	11 東京電力パワー		0.7900	100,000	101,026	2028/01/25
	41 東海旅客鉄道		2.1660	100,000	115,988	2029/01/29
	13 NTTファイナンス		1.0900	100,000	106,475	2029/09/20
	7 凸版印刷		1.1040	100,000	106,929	2029/12/12
	332 北海道電力		0.9070	100,000	102,876	2036/04/25
	23 森ビル		0.9700	100,000	100,631	2038/05/17
	107東日本旅客鉄		1.4150	100,000	115,983	2045/01/27
種別小計	銘柄数	27銘柄				
	金額			2,700,000	2,777,936	
合 計	銘柄数	348銘柄				
	金額			83,939,000	89,873,584	

(注) 単位未満は切捨て。

日本債券インデックスマザーファンド

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

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

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

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

* 期首における元本額は57,670,399,195円、当作成期間中における追加設定元本額は27,218,615,082円、同解約元本額は21,256,844,603円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)65,126,538円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)505,967,183円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)62,478,037円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)718,126,297円、DCダイワ日本債券インデックス8,503,141,748円、ダイワ・バランスファンド35VA10,269,709,415円、ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)1,737,338,049円、ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)226,910,962円、ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)339,059,642円、ダイワ・ノーロード日本債券ファンド90,548,180円、ダイワファンドラップ日本債券インデックス23,601,367,986円、ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)6,701,446,457円、ダイワファンドラップオンライン日本債券インデックス1,691,971,743円、ダイワ・インデックスセレクト日本債券1,058,268,870円、ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス6,961,101,317円、ダイワライフスタイル25 459,018,956円、ダイワライフスタイル50 504,172,138円、ダイワライフスタイル75 136,416,156円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,185円です。

■損益の状況

当期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

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

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

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

ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)

運用報告書 (全体版) 第4期

(決算日 2020年11月30日)

(作成対象期間 2019年12月3日~2020年11月30日)

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F T S E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/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F T S E世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの受益証券
	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	外国の公社債
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の10%以下
	マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行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			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			
1 期末(2017年11月30日)	円 10,078	円 0	% 0.8	10,111	% 1.1	% 95.4	% 1.5	百万円 2,166
2 期末(2018年11月30日)	9,860	0	△2.2	9,927	△1.8	97.0	0.7	3,598
3 期末(2019年12月 2 日)	10,567	0	7.2	10,687	7.7	98.3	－	3,539
4 期末(2020年11月30日)	11,094	0	5.0	11,264	5.4	98.4	－	3,993

(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F T S E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：10,567円

期末：11,094円（分配金0円）

騰落率：5.0%（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主に投資した結果、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)

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース) (ベンチマーク)		公 社 債 率 組 入 比	債 券 先 物 率 比
		騰 落 率		騰 落 率		
(期首) 2019年12月 2 日	円 10,567	% -	10,687	% -	% 98.3	% -
12月末	10,505	△0.6	10,622	△0.6	97.0	2.0
2020年 1 月末	10,693	1.2	10,818	1.2	96.6	1.1
2 月末	10,811	2.3	10,939	2.4	97.0	1.5
3 月末	10,977	3.9	11,093	3.8	97.7	-
4 月末	10,961	3.7	11,104	3.9	91.1	3.2
5 月末	10,952	3.6	11,097	3.8	97.8	-
6 月末	11,027	4.4	11,182	4.6	97.7	-
7 月末	11,134	5.4	11,294	5.7	95.8	0.5
8 月末	10,993	4.0	11,154	4.4	97.6	-
9 月末	11,109	5.1	11,276	5.5	96.0	-
10月末	11,085	4.9	11,254	5.3	96.6	-
(期末) 2020年11月30日	11,094	5.0	11,264	5.4	98.4	-

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2019.12.3～2020.11.30)

■海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると低下しました。

当作成期首より、新型コロナウイルスによる世界経済の減速懸念の高まりから、金利は大きく低下しました。その後は、各国で段階的に経済活動が再開されたことやワクチン開発への期待から金利は一時的に上昇しましたが、感染再拡大への懸念が高まると金利は再び低下しました。2020年8月には、株価が上昇するなどリスクに対する市場心理が改善し、金利は上昇しました。10月には、米国大統領および連邦議会選挙を控えて、バイデン候補が大統領に当選し、民主党が上下院を制した場合の拡張的な財政政策を懸念する動きなどから、米国の金利を中心に上昇しました。

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

(2019.12.3～2020.11.30)

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

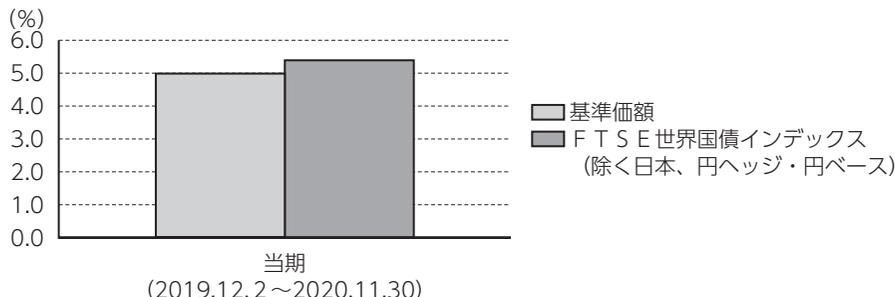
外国の公社債に投資し、外貨建資産については為替ヘッジを行い、またファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は5.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は5.0%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。

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12月3日 ~2020年11月30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)	1,094	

(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

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2019.12.3~2020.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	29円	0.262%	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10,907円です。
(投 信 会 社)	(20)	(0.186)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.000	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	2	0.018	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.009)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	31	0.281	

(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。

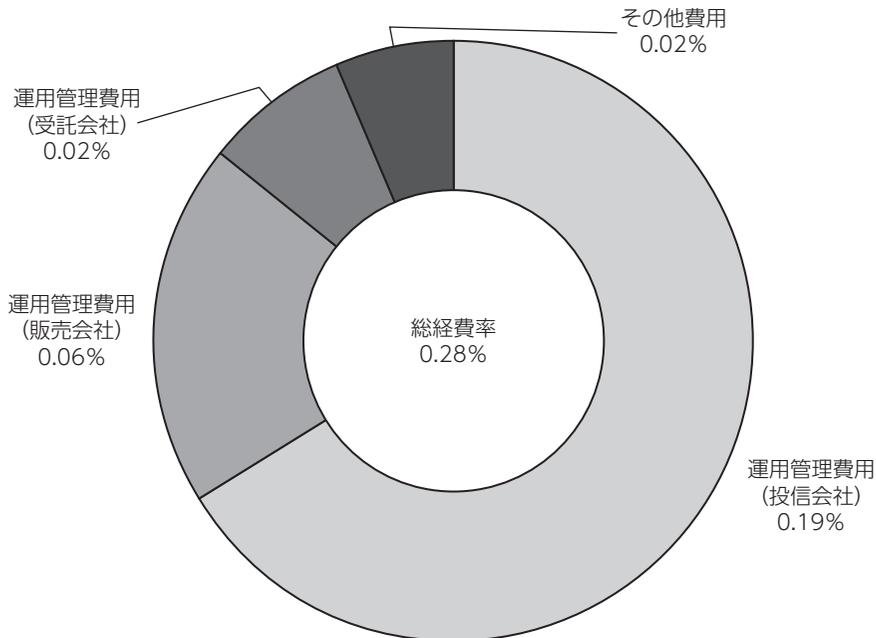
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.28%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12月3日から2020年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	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	739,973	779,219	491,198	519,423

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	□ 数	金 額	評 価 額	□ 数	金 額	評 価 額
	千□	千円	千円	千□	千円	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	3,463,394	3,712,169	3,989,839			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	3,989,839	99.7
コール・ローン等、その他	12,637	0.3
投資信託財産総額	4,002,477	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=103.89円、1カナダ・ドル=79.95円、1オーストラリア・ドル=76.91円、1シンガポール・ドル=77.69円、1イギリス・ポンド=138.55円、1イスラエル・シケル=31.34円、1デンマーク・クローネ=16.71円、1ノルウェー・クローネ=11.76円、1スウェーデン・クローネ=12.22円、1メキシコ・ペソ=5.19円、1マレーシア・リンギット=25.53円、1南アフリカ・ランド=6.82円、1ポーランド・ズロチ=27.71円、1ユーロ=124.38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 (111,533,870千円) の投資信託財産総額 (113,263,576千円) に対する比率は、98.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,002,477,234円
コール・ローン等	10,430,258
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)	3,989,839,661
未収入金	2,207,315
(B) 負債	8,824,338
未払解約金	3,552,887
未払信託報酬	5,111,797
その他未払費用	159,654
(C) 純資産総額(A-B)	3,993,652,896
元本	3,599,799,209
次期繰越損益金	393,853,687
(D) 受益権総口数	3,599,799,209□
1万口当り基準価額(C/D)	11,094円

* 期首における元本額は3,349,305,616円、当作成期間中における追加設定元本額は1,133,997,978円、同解約元本額は883,504,385円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,094円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月3日 至2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3,247円
受取利息	387
支払利息	△ 3,634
(B) 有価証券売買損益	167,282,037
売買益	194,301,837
売買損	△ 27,019,800
(C) 信託報酬等	△ 10,229,052
(D) 当期繰越損益金(A + B + C)	157,049,738
(E) 前期繰越損益金	128,839,005
(F) 追加信託差損益金	107,964,944
(配当等相当額)	(57,889,034)
(売買損益相当額)	(50,075,910)
(G) 合計(D + E + F)	393,853,687
次期繰越損益金(G)	393,853,687
追加信託差損益金	107,964,944
(配当等相当額)	(57,889,034)
(売買損益相当額)	(50,075,910)
分配準備積立金	285,891,990
繰越損益金	△ 3,247

(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	157,048,480
(c) 収益調整金	107,964,944
(d) 分配準備積立金	128,843,510
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	393,856,934
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	393,856,934
(h) 受益権総口数	3,599,799,209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

<補足情報>

当ファンド（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））が投資対象としている「外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の決算日（2020年6月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2020年11月30日）現在における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（為替ヘッジあり）マザーファンドの主要な売買銘柄 公 社 債

（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

買			付			売			付		
銘	柄	金額									
		千円			千円			千円			千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.125% 2021/9/30	1,822,925	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)	1.125% 2021/9/30	3,346,760	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.125% 2021/6/30	2,455,962
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2022/9/30	1,669,830	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.5% 2024/5/15	739,151	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.5% 2023/11/15	737,558	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.625% 2021/5/15	606,248
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2027/8/15	1,592,972	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.75% 2023/11/15	737,558	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	6.25% 2030/5/15	579,488	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2025/11/15	576,444
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.5% 2025/1/31	1,101,998	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2025/11/15	576,444	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ)	1% 2025/8/15	540,164	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.75% 2023/11/15	474,369
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2% 2023/2/15	1,005,588	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ)	1% 2025/8/15	540,164	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.625% 2025/3/31	474,369			
GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ)	1% 2025/8/15	948,336									
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2025/11/15	926,233									
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)	1.5% 2030/2/15	863,988									
United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.75% 2023/11/15	839,250									

(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11月30日現在における外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド（104,020,210千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	2020年11月30日現在							
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
アメリカ	千アメリカ・ドル 413,248	千アメリカ・ドル 459,576	千円 47,745,450	% 42.7	% -	% 18.8	% 15.2	% 8.7
カナダ	千カナダ・ドル 23,897	千カナダ・ドル 27,163	2,171,737	1.9	-	1.0	0.6	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 33,807	千オーストラリア・ドル 38,733	2,979,029	2.7	-	1.9	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 5,852	千シンガポール・ドル 6,613	513,766	0.5	-	0.3	0.1	0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 39,937	千イギリス・ポンド 53,288	7,383,098	6.6	-	5.0	1.1	0.4
イスラエル	千イスラエル・シケル 11,400	千イスラエル・シケル 13,399	419,953	0.4	-	0.3	0.1	-
デンマーク	千デンマーク・クローネ 26,950	千デンマーク・クローネ 34,845	582,263	0.5	-	0.4	0.1	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 14,961	175,949	0.2	-	0.1	0.0	-
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 25,970	千スウェーデン・クローネ 29,080	355,368	0.3	-	0.2	0.1	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

2020年11月30日現在								
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
メキシコ	千メキシコ・ペソ 131,330	千メキシコ・ペソ 147,171	千円 763,821	% 0.7	% -	% 0.5	% 0.1	% 0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 20,580	千マレーシア・リンギット 22,043	562,778	0.5	-	0.3	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 21,695	千ポーランド・ズロチ 23,958	663,888	0.6	-	0.3	0.3	0.1
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 5,888	千ユーロ 7,138	887,860	0.8	-	0.6	0.2	-
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 12,970	千ユーロ 16,267	2,023,369	1.8	-	1.3	0.4	0.1
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 17,736	千ユーロ 22,391	2,785,007	2.5	-	1.9	0.4	0.2
ユーロ (フランス)	千ユーロ 76,046	千ユーロ 94,923	11,806,624	10.6	-	7.1	2.7	0.8
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 50,155	千ユーロ 64,683	8,045,304	7.2	-	5.0	1.6	0.6
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 45,198	千ユーロ 57,463	7,147,312	6.4	-	4.2	1.9	0.3
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 69,897	千ユーロ 86,354	10,740,731	9.6	-	6.0	2.2	1.4
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 4,950	千ユーロ 5,587	694,949	0.6	-	0.3	0.2	0.1
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 10,660	千ユーロ 13,686	1,702,386	1.5	-	1.1	0.2	0.2
ユーロ (小計)	293,500	368,496	45,833,545	41.0	-	27.7	9.8	3.6
合 計	-	-	110,150,652	98.5	-	56.6	28.2	13.8

(注1) 邦貨換算金額は、2020年11月30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ある。

(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）

2020年11月30日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	%	千アメリカ・ドル 13,946	千アメリカ・ドル 14,197	千円 1,474,929	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250		15,000	15,429	1,602,965	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000		11,000	11,445	1,189,027	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500		15,520	16,117	1,674,465	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000		11,310	12,020	1,248,797	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500		13,905	14,951	1,553,266	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500		10,500	11,353	1,179,552	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000		6,080	6,555	681,096	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500		3,300	3,841	399,120	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250		3,250	4,482	465,679	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000		800	1,092	113,506	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500		2,700	3,661	380,342	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500		1,400	2,102	218,429	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750		1,130	1,638	170,186	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000		700	1,040	108,146	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000		2,630	3,624	376,566	2039/02/15

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

2020年11月30日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	4.3750	1,410	2,163	224,785	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	4.6250	1,390	2,199	228,466	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	4.7500	1,770	2,870	298,195	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	3.1250	2,170	2,886	299,888	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.8750	4,500	5,770	599,537	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	3.6250	1,100	1,575	163,677	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	3.7500	2,532	3,694	383,804	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	3.6250	1,000	1,435	149,154	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	3.3750	3,200	4,438	461,165	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	3.1250	3,940	5,268	547,310	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.2500	7,810	8,412	874,003	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	1.7500	22,750	23,208	2,411,121	2022/02/28
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.1250	8,300	8,963	931,200	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	3.0000	2,170	2,853	296,437	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.0000	14,820	15,971	1,659,326	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	1.7500	32,220	33,166	3,445,647	2022/09/30
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.2500	11,800	12,887	1,338,905	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	3.0000	1,700	2,241	232,880	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	1.6250	6,000	6,381	662,928	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	1.6250	5,165	5,498	571,218	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.5000	2,070	2,508	260,615	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	1.5000	5,750	6,086	632,367	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	1.3750	5,000	5,167	536,898	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.0000	5,850	6,366	661,409	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.8750	3,430	4,445	461,823	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.2500	4,670	5,164	536,559	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	1.8750	8,000	8,161	847,933	2022/01/31
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	3.0000	3,500	4,641	482,215	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.3750	7,550	8,434	876,219	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	3.0000	2,250	2,988	310,488	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.2500	13,500	15,001	1,558,544	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.1250	12,200	13,035	1,354,291	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.7500	3,310	4,211	437,582	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	1.8750	7,000	7,422	771,147	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.5000	11,300	12,335	1,281,538	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.6250	2,500	2,749	285,614	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	3.1250	4,500	6,130	636,863	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.8750	4,400	5,116	531,575	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	3.0000	1,500	2,003	208,100	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	3.1250	7,800	9,270	963,099	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	3.3750	1,850	2,638	274,149	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.6250	4,000	4,612	479,190	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	3.0000	3,200	4,286	445,324	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.8750	2,000	2,621	272,320	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	1.8750	4,000	4,316	448,476	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.2500	2,100	2,443	253,824	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	1.7500	5,400	5,867	609,566	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.3750	2,800	3,342	347,205	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	1.5000	4,500	4,787	497,341	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	2.0000	2,500	2,761	286,874	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	1.2500	3,400	3,137	325,988	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	1.1250	5,400	5,199	540,187	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	0.6250	4,000	3,924	407,668	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond		国債証券	1.3750	3,100	2,952	306,709	2050/08/15
通貨小計	銘 柄 数	70銘柄			413,248	459,576	47,745,450	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2020年11月30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		
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 1,044	千円 83,536	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	907	1,292	103,373	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,050	1,665	133,162	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	770	1,193	95,382	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,100	2,180	174,358	2022/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	740	1,124	89,868	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,238	1,276	102,071	2023/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	230	247	19,800	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,100	1,519	121,445	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,492	1,616	129,242	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	820	866	69,276	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	930	959	76,743	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,940	3,956	316,313	2022/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	664	53,121	2028/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,100	1,137	90,926	2023/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	300	340	27,260	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,000	1,063	85,048	2024/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,462	116,889	2024/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,400	1,473	117,785	2030/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	903	72,273	2025/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,173	93,857	2030/12/01	
通貨小計	銘 柄 数 額 金	21銘柄		23,897	27,163	2,171,737		
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 1,179	90,722	2022/07/15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,083	2,350	180,812	2023/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	889	1,128	86,830	2027/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,156	2,348	180,635	2024/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,620	1,952	150,159	2029/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,500	3,962	304,749	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	859	1,203	92,542	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	3,898	4,715	362,635	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	725	975	75,006	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	800	959	73,829	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	684	871	66,997	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,300	1,496	115,097	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,158	2,416	185,817	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	575	719	55,356	2047/03/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,250	1,450	111,554	2028/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,251	96,219	2022/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,200	2,572	197,815	2029/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,100	2,416	185,889	2030/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	130	154	11,885	2041/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	300	307	23,662	2032/05/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,300	3,331	256,234	2030/12/21		
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,000	969	74,575	2051/06/21		
通貨小計	銘 柄 数 額 金	22銘柄		33,807	38,733	2,979,029		
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 238	18,497	2027/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	1,000	1,050	81,583	2022/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	150	164	12,790	2024/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	300	355	27,600	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	89	113	8,850	2042/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	200	212	16,521	2023/07/01	

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

2020年11月30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	3.3750	420	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	400		535	41,635	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	330		435	33,867	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	200		217	16,861	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	260		300	23,338	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	800		907	70,467	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	1,000		1,053	81,830	2024/02/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	300		358	27,846	2039/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	200		236	18,340	2050/03/01
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄			5,852	6,613	513,766	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,350	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	204,981	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	960		1,589	220,237	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,025		1,110	153,829	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	250		252	34,951	2022/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,850		2,143	297,005	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	720		841	116,534	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,100		1,435	198,824	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	650		699	96,915	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	800		891	123,584	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	697		980	135,877	2021/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	400		414	57,383	2024/04/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	800		985	136,496	2049/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850		1,051	145,731	2054/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	1,000		1,055	146,175	2029/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	550		597	82,847	2041/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	1,400		1,407	195,067	2030/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	900		898	124,524	2035/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	513		749	103,863	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,300		1,862	258,032	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	2,075		2,521	349,307	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	915		1,402	194,344	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	950		1,608	222,794	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	850		1,744	241,695	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	770		1,387	192,176	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,100		1,419	196,632	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	911		1,595	221,072	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	907		1,306	181,047	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	843		1,588	220,075	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,130		1,833	254,003	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,040		1,093	151,495	2022/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	300		458	63,551	2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	337		703	97,520	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,000		1,651	228,815	2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	700		1,273	176,492	2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,080		2,146	297,362	2022/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,175		1,778	246,437	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	2,490		2,648	366,937	2023/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	858		1,803	249,902	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,900		2,099	290,893	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	490		777	107,673	2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	40銘柄			39,937	53,288	7,383,098	
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	4.2500	3,500	千イスラエル・シェケル	千イスラエル・シェケル	120,143	2023/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,200		2,055	64,414	2042/01/31

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2020年11月30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		
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	千イスラエル・シユケル 4,000	千イスラエル・シユケル 4,378	千円 137,227	2027/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	1,000	1,400	43,878	2047/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	1,700	1,732	54,289	2030/03/31	
通貨小計	銘 柄 数 額	5銘柄		11,400	13,399	419,953		
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 6,740	千デンマーク・クローネ 12,951	216,420	2039/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,310	2,390	39,941	2021/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,670	2,844	47,530	2023/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,330	4,850	81,044	2025/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,200	5,588	93,391	2026/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,700	5,121	85,584	2029/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,000	1,098	18,350	2052/11/15	
通貨小計	銘 柄 数 額	7銘柄		26,950	34,845	582,263		
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	千ノルウェー・クローネ 1,610	千ノルウェー・クローネ 1,679	19,745	2023/05/24	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,300	1,412	16,606	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	150	158	1,861	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,430	1,502	17,664	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,000	3,206	37,711	2027/02/17	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	4,000	4,375	51,458	2028/04/26	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	2,500	2,627	30,900	2030/08/19	
通貨小計	銘 柄 数 額	7銘柄		13,990	14,961	175,949		
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	千スウェーデン・クローネ 2,520	千スウェーデン・クローネ 3,956	48,350	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	6,950	7,358	89,920	2022/06/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,150	4,381	53,537	2023/11/13	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,020	2,279	27,855	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,780	5,141	62,831	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,550	2,729	33,352	2028/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,000	3,234	39,520	2029/11/12	
通貨小計	銘 柄 数 額	7銘柄		25,970	29,080	355,368		
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 9,200	千メキシコ・ペソ 9,482	49,213	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	11,450	12,843	66,656	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	12,900	14,342	74,440	2024/09/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	6,740	7,391	38,362	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,340	7,541	39,142	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	11,800	13,194	68,477	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	2,750	3,718	19,297	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,500	7,784	40,400	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	5,000	5,947	30,868	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,700	26,068	135,296	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	15,900	16,393	85,079	2022/06/09	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	9,750	10,703	55,553	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,300	11,759	61,033	2034/11/23	
通貨小計	銘 柄 数 額	13銘柄		131,330	147,171	763,821		
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	千マレーシア・リンギット 1,760	千マレーシア・リンギット 1,997	50,983	2030/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	1,250	1,354	34,568	2027/03/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	600	639	16,325	2033/04/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,500	1,608	41,057	2028/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,150	1,242	31,730	2025/09/15	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2020年11月30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		
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,100	1,140	29,117	2022/09/30	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,600	1,676	42,796	2023/08/17	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	1,420	1,573	40,163	2046/03/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	2,600	2,651	67,685	2021/11/30	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	2,000	2,144	54,749	2024/09/30	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,000	1,171	29,898	2037/04/07	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	1,000	1,078	27,526	2026/07/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,200	1,298	33,138	2029/08/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,354	34,577	2034/07/05	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	700	714	18,248	2040/05/22	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	400	399	10,211	2050/06/15	
通貨小計	銘柄数 金額	16銘柄		20,580	22,043	562,778		
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	1,200	1,324	36,688	2022/09/23	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,640	2,916	80,815	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,815	2,015	55,848	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	800	825	22,866	2022/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,157	87,481	2023/01/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,400	4,754	131,741	2024/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	2,300	2,622	72,655	2029/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	500	501	13,885	2030/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	600	837	23,200	2029/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	710	790	21,916	2023/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	1,500	1,695	46,980	2028/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,230	2,519	69,808	2025/07/25	
通貨小計	銘柄数 金額	12銘柄		21,695	23,958	663,888		
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	688	867	107,946	2025/03/13	
	IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	420	464	57,791	2023/03/20	
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	600	681	84,713	2024/03/18	
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	680	858	106,768	2030/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	710	1,015	126,337	2045/02/18	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	820	891	110,860	2026/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	570	729	90,724	2037/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	500	550	68,489	2028/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	150	177	22,093	2033/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	600	701	87,299	2031/03/18	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	150	199	24,835	2050/05/15	
国小計	銘柄数 金額	11銘柄		5,888	7,138	887,860		
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	839	104,386	2028/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,200	2,063	256,618	2037/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,170	1,282	159,547	2023/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	830	1,554	193,385	2042/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	500	524	65,231	2022/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	290	395	49,222	2033/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	750	799	99,483	2023/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	840	1,505	187,313	2047/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	480	528	65,705	2024/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	690	721	89,749	2025/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,170	1,249	155,433	2026/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	970	1,061	132,034	2027/07/15	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2020年11月30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		
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	400	409	50,922	2024/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	600	663	82,556	2028/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,100	1,179	146,694	2029/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	287	35,697	2040/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	750	787	97,903	2030/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	-	400	413	51,482	2052/01/15	
国小計	銘柄数 金 額	18銘柄		12,970	16,267	2,023,369		
ユーロ（ベルギー）	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	千ユーロ	千ユーロ			
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	670	715	89,045	2025/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	622	710	88,394	2031/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	610	814	101,270	2038/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	595	649	80,826	2026/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	414	555	69,040	2047/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	370	635	78,996	2066/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	400	410	51,081	2023/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	730	797	99,179	2027/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	500	523	65,142	2024/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	310	509	63,345	2057/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	700	873	108,600	2037/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	580	639	79,533	2028/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	500	595	74,058	2033/04/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	700	783	97,412	2029/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	350	487	60,621	2050/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	900	943	117,302	2030/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	500	529	65,851	2040/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	-	800	831	103,373	2027/10/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,000	1,452	180,678	2028/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	750	1,314	163,440	2035/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	550	584	72,707	2022/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	815	1,492	185,657	2041/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	700	895	111,334	2026/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	730	797	99,143	2022/09/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	300	449	55,874	2032/03/28	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,000	1,077	133,978	2023/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	540	997	124,017	2045/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	800	895	111,403	2024/06/22	
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	300	431	53,692	2034/06/22	
国小計	銘柄数 金 額	29銘柄		17,736	22,391	2,785,007		
ユーロ（フランス）	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	千ユーロ	千ユーロ			
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,415	4,553	566,303	2025/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,000	1,514	188,331	2029/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,000	3,466	431,215	2032/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,210	3,802	472,919	2035/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,232	2,691	334,713	2055/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,065	1,841	229,016	2038/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,200	1,375	171,107	2023/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,143	4,080	507,528	2041/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,000	2,319	288,534	2060/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,540	4,345	540,514	2026/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	1,999	248,672	2022/04/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,910	3,590	446,612	2027/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,195	2,320	288,625	2022/10/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,190	2,066	257,080	2045/05/25	

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

2020年11月30日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,730	5,023	624,798	2023/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,200	2,430	302,244	2024/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,686	3,440	427,945	2030/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,360	3,693	459,407	2024/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,700	2,844	353,826	2025/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,500	1,793	223,072	2031/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,800	1,913	237,964	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,250	1,510	187,861	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,000	1,548	192,621	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,370	2,492	310,047	2026/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	2,387	296,950	2039/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,545	192,259	2027/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,400	2,054	255,507	2048/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,200	1,220	151,762	2023/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,500	1,645	204,695	2028/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,300	1,552	193,130	2034/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,250	2,478	308,330	2028/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,700	2,764	343,882	2024/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	3,000	3,025	376,349	2022/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	800	1,073	133,550	2050/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	1,624	202,060	2029/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	4,200	4,361	542,440	2029/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	200	224	27,916	2052/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	600	649	80,838	2040/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,600	1,656	205,985	2030/11/25	
国小計	銘柄数 金 額	39銘柄			76,046	94,923	11,806,624	
ユーロ (ドイツ)				千ユーロ	千ユーロ			
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	955	1,425	177,292	2027/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	800	1,172	145,790	2028/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	800	1,143	142,228	2028/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	2,596	4,284	532,875	2030/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,660	2,718	338,188	2031/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	3,270	5,693	708,160	2034/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	690	1,199	149,216	2037/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	420	795	98,986	2039/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,810	3,697	459,920	2040/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	606	1,093	135,998	2042/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,542	1,604	199,540	2022/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,648	2,774	345,142	2044/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,150	1,208	150,331	2023/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,460	1,571	195,519	2023/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	800	866	107,767	2024/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,725	2,986	371,496	2046/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	990	1,069	133,043	2024/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,000	2,135	265,593	2024/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,255	156,200	2025/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,300	4,668	580,647	2025/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	883	942	117,283	2026/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,050	2,141	266,348	2026/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,150	1,223	152,172	2027/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,100	3,364	418,463	2027/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,260	1,785	222,079	2048/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	750	817	101,695	2028/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	2,042	254,060	2028/08/15	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2020年11月30日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,800	3,018	375,470	2029/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	900	949	118,132	2050/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,500	1,515	188,448	2022/04/08	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,800	1,825	227,081	2022/10/07	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	150	152	19,009	2023/04/14	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,000	1,023	127,259	2023/10/13	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	500	513	63,855	2024/04/05	
国小計	銘柄数 金 額	34銘柄		50,155	64,683	8,045,304		
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	2,133	265,365	2029/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,400	1,529	190,300	2025/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,410	1,673	208,172	2030/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,565	2,895	360,164	2025/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,000	1,128	140,316	2026/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	689	1,033	128,539	2046/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,230	2,243	279,101	2066/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	1,349	1,482	184,399	2026/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	250	253	31,537	2022/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,100	1,229	152,883	2027/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,320	1,666	207,243	2033/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,670	1,865	232,071	2027/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,150	2,404	299,012	2028/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	550	808	100,552	2048/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	1,500	1,508	187,637	2021/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	904	112,470	2029/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	900	1,089	135,541	2035/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,200	1,269	157,929	2029/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	1,047	130,273	2030/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,200	1,341	166,857	2030/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	980	1,615	200,892	2032/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	800	1,275	158,584	2037/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	900	1,629	202,622	2040/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	2,843	5,097	634,079	2041/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,000	1,359	169,089	2026/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	600	645	80,243	2022/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	4,310	4,873	606,223	2023/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,588	1,820	226,404	2023/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,300	1,847	229,778	2028/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	890	1,758	218,675	2044/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	3,200	3,679	457,658	2024/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,084	2,353	292,689	2024/10/31	
国小計	銘柄数 金 額	32銘柄		45,198	57,463	7,147,312		
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	2,274	282,893	2026/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,635	2,333	290,255	2027/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,100	3,431	426,780	2024/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,205	1,698	211,221	2046/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	920	986	122,679	2025/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,500	1,659	206,391	2032/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	500	550	68,527	2025/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	827	102,898	2022/09/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,000	1,290	160,531	2047/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,200	1,236	153,827	2023/03/15	

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

2020年11月30日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	1,850	2,192	272,701	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.6500	2,400	2,468	306,983	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.3500	400	403	50,141	2021/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.8000	1,400	1,864	231,849	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.4500	1,300	1,558	193,887	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2000	1,700	1,920	238,843	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.2000	1,500	1,533	190,743	2022/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.4500	350	512	63,778	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.0500	1,550	1,738	216,261	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.9000	700	715	89,050	2022/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.0000	700	786	97,765	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.8000	1,400	1,670	207,744	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	1,300	1,463	182,027	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.3500	500	663	82,465	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.8500	800	1,259	156,595	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.0000	1,000	1,220	151,783	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.1000	900	1,002	124,684	2026/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.9500	2,600	2,706	336,630	2030/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.2500	1,540	2,188	272,147	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	6.0000	1,588	2,452	305,009	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.7500	1,000	1,580	196,557	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.0000	1,450	2,222	276,451	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	4.0000	1,270	1,827	227,355	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.0000	1,640	2,708	336,872	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	4.7500	3,870	4,402	547,565	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.0000	1,700	2,072	257,731	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.0000	2,414	4,025	500,738	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	4.5000	3,250	4,012	499,129	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.0000	780	833	103,708	2022/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.5000	500	552	68,675	2022/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	5.5000	6,270	6,985	868,883	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	4.7500	1,080	1,443	179,599	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	4.7500	725	1,231	153,180	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	4.5000	830	959	119,288	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	3.7500	2,110	2,422	301,309	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	3.5000	1,370	1,745	217,098	2030/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro		国債証券	2.1500	700	719	89,484	2021/12/15
国小計	銘柄数額	47銘柄			69,897	86,354	10,740,731	
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	690	774	96,281	2031/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.8750	800	861	107,110	2025/09/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.5000	180	191	23,818	2026/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	1.3750	270	372	46,298	2047/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.5000	200	215	26,754	2027/09/15
	Finland Government Bond		国債証券	1.1250	150	178	22,166	2034/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.5000	500	541	67,346	2028/09/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.1250	150	157	19,553	2036/04/15
	Finland Government Bond		国債証券	0.2500	150	160	19,937	2040/09/15
	Finland Government Bond		国債証券	4.0000	200	244	30,349	2025/07/04
	Finland Government Bond		国債証券	2.7500	120	150	18,769	2028/07/04
	Finland Government Bond		国債証券	1.6250	980	1,022	127,150	2022/09/15
	Finland Government Bond		国債証券	2.6250	210	336	41,816	2042/07/04
	Finland Government Bond		国債証券	2.0000	350	382	47,595	2024/04/15
国小計	銘柄数額	14銘柄			4,950	5,587	694,949	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

2020年11月30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（オーストリア）	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	140	153	19,057	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	490	530	66,043	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	120	166	20,763	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	280	477	59,441	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	400	429	53,407	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	50	113	14,116	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	658	81,919	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	700	759	94,508	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	-	600	624	77,702	2030/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	722	89,837	2051/03/20
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	380	557	69,283	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	500	860	107,010	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	700	909	113,138	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	900	954	118,745	2022/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	860	930	115,756	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	420	1,032	128,482	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	630	1,114	138,620	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	680	729	90,690	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	730	998	124,159	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	880	962	119,700	2024/10/21
国 小 計	銘 柄 数 額	20銘柄		10,660	13,686	1,702,386	
通 貨 小 計	銘 柄 数 額	244銘柄		293,500	368,496	45,833,545	
合 計	銘 柄 数 額	479銘柄				110,150,652	

(注1) 邦貨換算金額は、2020年11月30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（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

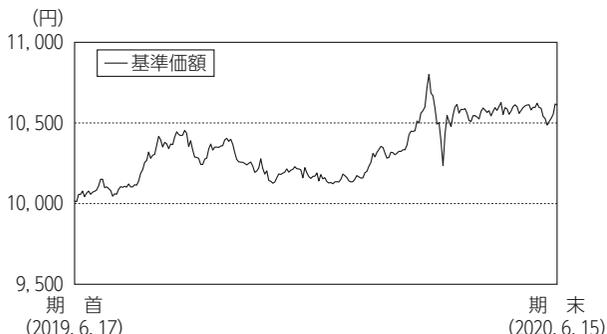
Daiwa Asset Management

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。

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

■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。

■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 末	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 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B B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			
アメリカ			%	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	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	
					千アメリカ・ドル	千円	
	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	
				%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	680	1,089	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	1,080	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	203	239	18,426	2027/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.1250	1,000	1,061	81,602	2022/09/01	

区 分		当 期				未		
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	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	
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		4,942	5,569	428,063		
イギリス				千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド			
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	750	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	11銘柄					
	金額			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	17銘柄					
	金額			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	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 円	千 円	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	
				千 円	千 円		
ユーロ（フランス）	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	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	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

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					末		
					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	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
					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	2.0000	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)				千ユーロ	千ユーロ		
	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)				千ユーロ	千ユーロ		
	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

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	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。

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）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)

運用報告書 (全体版) 第4期

(決算日 2020年11月30日)

(作成対象期間 2019年12月3日~2020年11月30日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額			公社債 組入比率	債券先物 比率	純資産 総額
		税金 分	入金 金	期騰 落 中率			
1期末 (2017年11月30日)	円 10,477		円 0	% 4.8	% 97.9	% -	百万円 1,406
2期末 (2018年11月30日)	10,222		0	△2.4	97.4	-	2,442
3期末 (2019年12月2日)	10,673		0	4.4	97.9	-	2,833
4期末 (2020年11月30日)	11,005		0	3.1	98.0	-	2,462

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)を除きます。

(注4) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

(注5) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：10,673円

期末：11,005円（分配金0円）

騰落率：3.1%（分配金込み）

■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国債券インデックスマザーファンド	4.5%	79.9%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	△2.2%	20.0%

■ 基準価額の主な変動要因

主に海外の債券に投資した結果、為替市場で円高が進んだものの、債券の利息収入を獲得したことや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。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

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)

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 率	債 券 先 物 率
	騰 落 率	率		
(期首) 2019年12月 2 日	円 10,673	% -	% 97.9	% -
12月末	10,775	1.0	97.7	-
2020年 1 月末	10,816	1.3	97.7	-
2 月末	10,873	1.9	97.6	-
3 月末	10,592	△0.8	97.9	-
4 月末	10,472	△1.9	97.3	-
5 月末	10,722	0.5	97.2	-
6 月末	10,882	2.0	97.5	-
7 月末	10,968	2.8	97.3	-
8 月末	10,959	2.7	97.7	-
9 月末	10,946	2.6	97.6	-
10月末	10,808	1.3	97.6	-
(期末) 2020年11月30日	11,005	3.1	98.0	-

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2019.12.3~2020.11.30)

■海外債券市況

海外債券の金利は、当作成期を通して見ると低下しました。

当作成期首より、新型コロナウイルスによる世界経済の減速懸念の高まりから、金利は大きく低下しました。その後は、各国で段階的に経済活動が再開されたことやワクチン開発への期待から金利は一時的に上昇しましたが、感染再拡大への懸念が高まると金利は再び低下しました。2020年8月には、株価が上昇するなどリスクに対する市場心理が改善し、金利は上昇しました。10月には、米国大統領および連邦議会選挙を控えて、バイデン候補が大統領に当選し、民主党が上下院を制した場合の拡張的な財政政策を懸念する動きなどから、米国の金利を中心に上昇しました。

新興国の債券市場でも、経済の減速懸念の高まりから各国で利下げが行われたことなどを受け、多くの国で金利は低下しました。

■為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると円高が進みました。

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

新興国の対円為替相場は、感染拡大を受けてリスク回避姿勢が強まり、多くの通貨が下落しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を純資産総額の80%程度、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」を純資産総額の20%程度組み入れます。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

ファンドの通貨の比率をベンチマーク（J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケッツ グローバル ダイバーシファイド（円換算））に極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

ポートフォリオについて

(2019.12.3～2020.11.30)

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を純資産総額の80%程度、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」を純資産総額の20%程度組み入れました。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

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

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2019年12月3日 ～2020年11月30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）	1,005

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を純資産総額の80%程度、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」を純資産総額の20%程度組み入れます。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2019.12.3~2020.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	30円	0.273%	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10,799円です。
(投 信 会 社)	(21)	(0.197)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(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	5	0.044	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(4)	(0.034)	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	34	0.317	

(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。

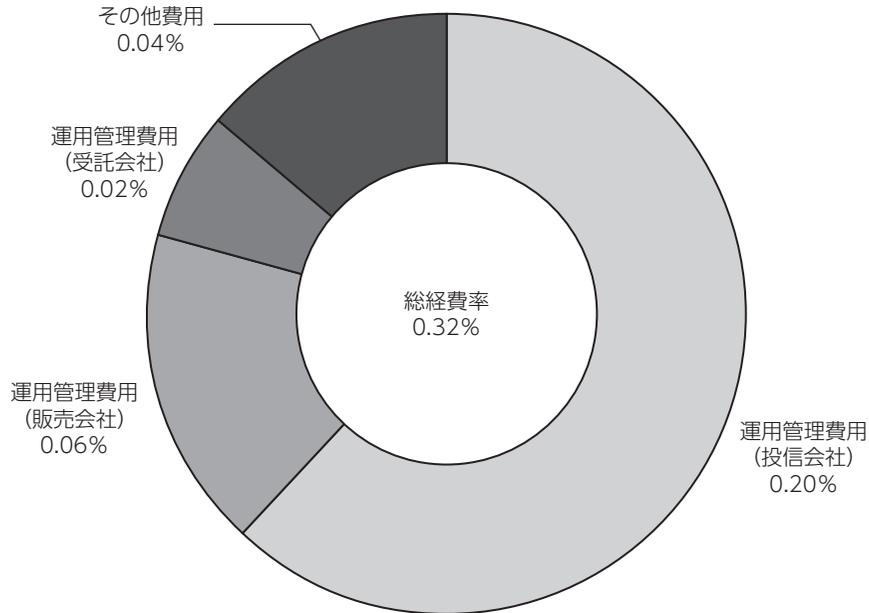
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.32%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12月3日から2020年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	74,996	102,604	118,098	150,247
外国債券インデックス・マザーファンド	113,817	335,640	247,087	720,502

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	□ 数	評 価 額	□ 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	399,927	356,825	491,598	491,598
外国債券インデックス・マザーファンド	787,285	654,015	1,968,979	1,968,979

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	491,598	19.9
外国債券インデックス・マザーファンド	1,968,979	79.8
コール・ローン等、その他	8,090	0.3
投資信託財産総額	2,468,669	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=103.89円、1カナダ・ドル=79.95円、1オーストラリア・ドル=76.91円、1シンガポール・ドル=77.69円、1イギリス・ポンド=138.55円、1イスラエル・シケル=31.34円、1トルコ・リラ=13.25円、1デンマーク・クローネ=16.71円、1ノルウェー・クローネ=11.76円、1スウェーデン・クローネ=12.22円、1メキシコ・ペソ=5.19円、1フィリピン・ペソ=2.16円、1アルゼンチン・ペソ=1.28円、100チリ・ペソ=13.54円、100コロンビア・ペソ=2.88円、100インドネシア・ルピア=0.74円、1ブラジル・リアル=19.46円、1チェコ・コルナ=4.74円、1ルーマニア・レイ=25.50円、1オフショア人民元=15.81円、1ロシア・ルーブル=1.37円、1マレーシア・リンギット=25.53円、1南アフリカ・ランド=6.82円、1タイ・バーツ=3.43円、1ペルー・ソル=28.83円、1ポーランド・ズロチ=27.71円、100ハンガリー・フォリント=34.39円、1ウルグアイ・ペソ=2.44円、1ドミニカ・ペソ=1.78円、1ユーロ=124.38円です。

(注3) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(17,267,923千円)の投資信託財産総額(17,444,832千円)に対する比率は、99.0%です。外国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(217,489,673千円)の投資信託財産総額(218,909,428千円)に対する比率は、99.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,468,669,338円
コール・ローン等	6,624,049
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	491,598,524
外国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	1,968,979,991
未収入金	1,466,774
(B) 負債	5,756,906
未払解約金	2,362,093
未払信託報酬	3,296,013
その他未払費用	98,800
(C) 純資産総額(A-B)	2,462,912,432
元本	2,237,982,504
次期繰越損益金	224,929,928
(D) 受益権総口数	2,237,982,504口
1万口当り基準価額(C/D)	11,005円

* 期首における元本額は2,655,013,152円、当作成期間中における追加設定元本額は695,143,661円、同解約元本額は1,112,174,309円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,005円です。

■損益の状況

当 期 自2019年12月3日 至2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,020円
受取利息	411
支払利息	△ 2,431
(B) 有価証券売買損益	73,109,050
売買益	104,323,117
売買損	△ 31,214,067
(C) 信託報酬等	△ 7,174,004
(D) 当期損益金(A+B+C)	65,933,026
(E) 前期繰越損益金	68,500,676
(F) 追加信託差損益金	90,496,226
(配当等相当額)	(66,621,261)
(売買損益相当額)	(23,874,965)
(G) 合計(D+E+F)	224,929,928
次期繰越損益金(G)	224,929,928
追加信託差損益金	90,496,226
(配当等相当額)	(66,621,261)
(売買損益相当額)	(23,874,965)
分派準備積立金	134,435,722
繰越損益金	△ 2,020

(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	65,932,283
(c) 収益調整金	90,496,226
(d) 分配準備積立金	68,503,439
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	224,931,948
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	224,931,948
(h) 受益権総口数	2,237,982,504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。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（ダイワ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））が投資対象としている「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の決算日（2020年7月6日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2020年11月30日）現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄 公 社 債

（2019年12月3日から2020年11月30日まで）

買			付			売			付		
銘	柄	金額	銘	柄	金額	銘	柄	金額	銘	柄	金額
		千円			千円			千円			千円
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル)	2024/1/1	248,686	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル)	10% 2021/1/1	135,600	Poland Government Bond (ポーランド)	1.75% 2021/7/25	121,128	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル)	2021/7/1	119,473
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル)	10% 2023/1/1	165,800	Poland Government Bond (ポーランド)	2.75% 2028/4/25	91,668	Mexican Bonos (メキシコ)	6.5% 2021/6/10	103,640	Mexican Bonos (メキシコ)	8.5% 2029/5/31	127,068
China Government Bond (中国)	3.29% 2029/5/23	128,114	Indonesia Treasury Bond (インドネシア)	8.25% 2021/7/15	68,573	China Government Bond (中国)	1.99% 2025/4/9	117,797	Poland Government Bond (ポーランド)	2.5% 2026/7/25	67,713
Mexican Bonos (メキシコ)	8.5% 2029/5/31	127,068	Poland Government Bond (ポーランド)	2.5% 2026/7/25	67,713	China Government Bond (中国)	2.85% 2027/6/4	115,851	Poland Government Bond (ポーランド)	2% 2021/4/25	58,527
China Government Bond (中国)	1.99% 2025/4/9	117,797	BONOS TESORERIA PESOS (チリ)	4.5% 2021/3/1	55,623	China Government Bond (中国)	2.36% 2023/7/2	112,916	Poland Government Bond (ポーランド)	5.75% 2021/10/25	50,962
China Government Bond (中国)	2.85% 2027/6/4	115,851	Poland Government Bond (ポーランド)	5.75% 2021/10/25	50,962	China Government Bond (中国)	3.13% 2029/11/21	109,757			
Poland Government Bond (ポーランド)	2.75% 2028/4/25	91,668				China Government Bond (中国)	3.12% 2026/12/5	109,394			
Poland Government Bond (ポーランド)	2.5% 2026/7/25	67,713									
Poland Government Bond (ポーランド)	2% 2021/4/25	58,527									
BONOS TESORERIA PESOS (チリ)	4.5% 2021/3/1	55,623									
Poland Government Bond (ポーランド)	5.75% 2021/10/25	50,962									

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2020年11月30日現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（12,662,214千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	2020年11月30日現在							
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
トルコ	千トルコ・リラ 28,580	千トルコ・リラ 27,113	千円 359,257	% 2.1	% 2.1	% 0.7	% 0.7	% 0.6
メキシコ	千メキシコ・ペソ 276,200	千メキシコ・ペソ 310,567	1,611,845	9.2	—	5.6	2.3	1.3
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 12,893	27,850	0.2	—	0.2	—	—
チリ	千チリ・ペソ 2,790,000	千チリ・ペソ 3,244,368	439,287	2.5	—	1.8	0.7	—
コロンビア	千コロンビア・ペソ 29,570,000	千コロンビア・ペソ 32,971,197	949,570	5.4	—	3.5	1.2	0.8
インドネシア	千インドネシア・ルピア 203,089,000	千インドネシア・ルピア 222,659,035	1,647,676	9.4	—	6.6	2.3	0.5
ブラジル	千ブラジル・レアル 77,450	千ブラジル・レアル 76,559	1,489,847	8.5	—	1.5	5.6	1.4
チェコ	千チェコ・コルナ 139,800	千チェコ・コルナ 147,858	700,849	4.0	—	2.7	1.0	0.3

2020年11月30日現在									
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 16,370	千ルーマニア・レイ 17,603	千円 448,898	% 2.6	% -	% 1.3	% 1.0	% 0.3	
中国	千オフショア人民元 84,200	千オフショア人民元 83,155	1,314,684	7.5	-	4.8	2.8	-	
ロシア	千ロシア・ルーブル 921,830	千ロシア・ルーブル 1,008,720	1,381,947	7.9	-	4.7	2.6	0.7	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 42,330	千マレーシア・リンギット 45,533	1,162,460	6.7	-	3.6	2.4	0.7	
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 213,790	千南アフリカ・ランド 189,906	1,295,159	7.4	-	6.8	0.6	-	
タイ	千タイ・バーツ 383,560	千タイ・バーツ 431,670	1,480,631	8.5	-	5.6	2.0	0.9	
ペルー	千ペルー・ソル 14,250	千ペルー・ソル 17,182	495,379	2.8	-	2.7	0.1	-	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 44,170	千ポーランド・ズロチ 48,507	1,344,147	7.7	-	3.8	2.8	1.2	
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 1,662,800	千ハンガリー・フォリント 1,824,744	627,529	3.6	-	1.5	1.5	0.6	
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 8,100	千ウルグアイ・ペソ 8,457	20,636	0.1	-	0.0	-	0.1	
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 11,717	20,856	0.1	0.1	0.1	-	-	
合 計	-	-	16,818,517	96.4	2.2	57.5	29.8	9.1	

(注1) 邦貨換算金額は、2020年11月30日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

2020年11月30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		
トルコ	Turkey Government Bond	国 債 証 券	%	千トルコ・リラ	千トルコ・リラ	千円	20,971	2022/01/12
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	9.5000	1,660	1,582	20,971	9,694	2022/09/14
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	8.5000	790	731	32,675	8,514	2023/03/08
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	7.1000	2,780	2,466	19,623	30,829	2024/03/20
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	10.4000	680	642	32,545	25,584	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	9.0000	1,630	1,481	32,545	2021/09/22	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	8.0000	2,690	2,326	30,753	37,719	2026/02/11
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	10.6000	2,570	2,456	24,044	21,086	2022/08/17
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	9.2000	2,010	1,930	27,108	18,265	2027/02/24
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	11.0000	2,400	2,321	27,108	19,839	2027/02/24
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	11.0000	2,970	2,846	27,108	2022/08/17	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	10.7000	1,900	1,814	27,108	2023/01/18	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	10.5000	1,700	1,591	27,108	2028/03/08	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	12.2000	1,400	1,378	27,108	2023/06/14	
	Turkey Government Bond	国 債 証 券	12.4000	2,000	2,045	27,108	2023/06/14	
Turkey Government Bond	国 債 証 券	16.2000	1,400	1,497	27,108	2023/06/14		
通貨小計	銘 柄 数 金 額	15銘柄		28,580	27,113	359,257		

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2020年11月30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		
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 18,900	千メキシコ・ペソ 19,480	千円 101,102	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	14,500	16,264	84,412	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国債証券	7.2500	10,000	10,286	53,387	2021/12/09	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	22,000	24,460	126,952	2024/09/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	22,750	24,949	129,486	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	24,150	28,728	149,098	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	30,230	33,801	175,429	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	9,992	51,858	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	30,730	36,801	190,998	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	17,900	21,292	110,507	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	17,950	20,613	106,985	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	31,450	32,425	168,287	2022/06/09	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	17,820	19,563	101,534	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,430	11,908	61,804	2034/11/23	
	通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄		276,200	310,567	1,611,845	
フィリピン	Philippine Government International Bond	国債証券	6.2500	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 12,893	27,850	2036/01/14	
通貨小計	銘柄数 金 額	1銘柄		10,000	12,893	27,850		
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ 500,000	千チリ・ペソ 573,905	77,706	2026/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	570,000	677,621	91,749	2035/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	410,000	560,187	75,849	2043/01/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	410,000	479,376	64,907	2030/09/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.0000	250,000	269,452	36,483	2023/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	650,000	683,826	92,590	2025/03/01	
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		2,790,000	3,244,368	439,287		
コロンビア	Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	千コロンビア・ペソ 90,000	千コロンビア・ペソ 117,247	3,376	2027/06/28	
	Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	45,828	1,319	2023/03/21	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	4,335,000	4,609,448	132,752	2022/05/04	
	Colombian TES	国債証券	10.0000	3,650,000	4,443,583	127,975	2024/07/24	
	Colombian TES	国債証券	6.0000	5,090,000	5,424,311	156,220	2028/04/28	
	Colombian TES	国債証券	7.5000	4,310,000	4,993,910	143,824	2026/08/26	
	Colombian TES	国債証券	7.7500	2,700,000	3,148,092	90,665	2030/09/18	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	3,000,000	3,264,300	94,011	2032/06/30	
	Colombian TES	国債証券	6.2500	2,700,000	2,965,788	85,414	2025/11/26	
	Colombian TES	国債証券	7.2500	2,200,000	2,427,700	69,917	2034/10/18	
	Colombian TES	国債証券	5.7500	1,050,000	1,107,571	31,898	2027/11/03	
Colombian TES	国債証券	7.2500	400,000	423,416	12,194	2050/10/26		
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄		29,570,000	32,971,197	949,570		
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	千インドネシア・ルピア 8,250,000	千インドネシア・ルピア 9,188,107	67,991	2036/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	6,000,000	7,053,120	52,193	2031/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	5,873,230	43,461	2032/08/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,640,618	56,540	2038/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	11,039,500	81,692	2024/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	7,200,000	8,209,440	60,749	2039/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	12,000,000	13,650,120	101,010	2029/05/15	

2020年11月30日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円	
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	7.0000	14,300,000	15,158,429	112,172	2030/09/15
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	6.5000	12,500,000	13,220,250	97,829	2025/06/15
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	7.5000	6,100,000	6,570,432	48,621	2035/06/15
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	11.0000	3,600,000	4,445,712	32,898	2025/09/15
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	10.5000	2,180,000	2,809,780	20,792	2030/08/15
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	9.5000	2,970,000	3,625,063	26,825	2031/07/15
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	8.3750	12,824,000	14,556,137	107,715	2026/09/15
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	8.2500	4,750,000	5,355,482	39,630	2032/06/15
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	7.0000	10,330,000	11,000,726	81,405	2027/05/15
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	7.0000	11,060,000	11,568,317	85,605	2022/05/15
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	5.6250	10,910,000	11,244,064	83,206	2023/05/15
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	6.1250	11,450,000	11,521,906	85,262	2028/05/15
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	6.6250	7,075,000	7,072,028	52,333	2033/05/15
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	8.3750	12,520,000	14,256,148	105,495	2034/03/15
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	8.3750	13,150,000	14,535,089	107,559	2024/03/15
	Indonesia Treasury Bond		国債証券	9.0000	11,120,000	13,065,332	96,683	2029/03/15
通貨小計	銘 柄 数 金 額	23銘柄			203,089,000	222,659,035	1,647,676	
ブラジル					千ブラジル・リアル	千ブラジル・リアル		
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F		国債証券	10.0000	13,310	14,548	283,108	2023/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F		国債証券	10.0000	10,690	11,969	232,926	2025/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F		国債証券	10.0000	7,250	8,185	159,299	2027/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F		国債証券	10.0000	4,300	4,915	95,657	2029/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F		国債証券	10.0000	500	568	11,068	2031/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional		国債証券	-	7,200	6,948	135,213	2022/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional		国債証券	-	6,100	5,702	110,967	2022/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional		国債証券	-	12,700	10,970	213,486	2023/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional		国債証券	-	15,400	12,750	248,120	2024/01/01
通貨小計	銘 柄 数 金 額	9銘柄			77,450	76,559	1,489,847	
チェコ					千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ		
	Czech Republic Government Bond		国債証券	2.5000	12,600	14,008	66,398	2028/08/25
	Czech Republic Government Bond		国債証券	5.7000	8,600	10,241	48,545	2024/05/25
	Czech Republic Government Bond		国債証券	4.7000	10,200	11,074	52,491	2022/09/12
	Czech Republic Government Bond		国債証券	2.4000	16,100	17,352	82,251	2025/09/17
	Czech Republic Government Bond		国債証券	1.0000	17,900	18,036	85,494	2026/06/26
	Czech Republic Government Bond		国債証券	0.9500	12,000	11,696	55,442	2030/05/15
	Czech Republic Government Bond		国債証券	0.4500	9,900	9,935	47,096	2023/10/25
	Czech Republic Government Bond		国債証券	0.2500	10,500	10,056	47,666	2027/02/10
	Czech Republic Government Bond		国債証券	2.7500	12,000	13,664	64,770	2029/07/23
	Czech Republic Government Bond		国債証券	2.0000	20,000	21,831	103,478	2033/10/13
	Czech Republic Government Bond		国債証券	1.2000	10,000	9,960	47,212	2031/03/13
通貨小計	銘 柄 数 金 額	11銘柄			139,800	147,858	700,849	
ルーマニア					千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ		
	Romania Government Bond		国債証券	5.8500	1,430	1,537	39,199	2023/04/26
	Romania Government Bond		国債証券	4.7500	1,150	1,243	31,707	2025/02/24
	Romania Government Bond		国債証券	5.8000	2,100	2,460	62,738	2027/07/26
	Romania Government Bond		国債証券	3.5000	1,090	1,109	28,304	2022/12/19
	Romania Government Bond		国債証券	3.2500	1,600	1,631	41,596	2024/04/29
	Romania Government Bond		国債証券	3.4000	1,700	1,719	43,853	2022/03/08
	Romania Government Bond		国債証券	4.2500	1,500	1,562	39,834	2023/06/28
	Romania Government Bond		国債証券	5.0000	2,600	2,952	75,290	2029/02/12

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2020年11月30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		
	Romania Government Bond		国 債 証 券	4.8500	1,000	千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ	千円	2026/04/22
	Romania Government Bond		国 債 証 券	3.6500	1,400				2031/09/24
	Romania Government Bond		国 債 証 券	4.1500	800				2028/01/26
通貨小計	銘 柄 数	額	11銘柄		16,370		17,603	448,898	
中国	China Government Bond		国 債 証 券	3.2900	4,300	千オフショア人民元	千オフショア人民元		2023/10/18
	China Government Bond		国 債 証 券	3.2200	5,700				2025/12/06
	China Government Bond		国 債 証 券	3.2500	4,800				2028/11/22
	China Government Bond		国 債 証 券	3.1900	6,700				2024/04/11
	China Government Bond		国 債 証 券	3.2900	8,200				2029/05/23
	China Government Bond		国 債 証 券	3.2500	6,800				2026/06/06
	China Government Bond		国 債 証 券	3.1200	7,000				2026/12/05
	China Government Bond		国 債 証 券	3.1300	7,000				2029/11/21
	China Government Bond		国 債 証 券	2.9400	4,500				2024/10/17
	China Government Bond		国 債 証 券	2.8500	7,600				2027/06/04
	China Government Bond		国 債 証 券	2.6800	6,300				2030/05/21
	China Government Bond		国 債 証 券	1.9900	8,000				2025/04/09
	China Government Bond		国 債 証 券	2.3600	7,300				2023/07/02
通貨小計	銘 柄 数	額	13銘柄		84,200		83,155	1,314,684	
ロシア	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	8.1500	46,760	千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル		2027/02/03
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.6000	32,910				2022/07/20
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.0000	14,400				2023/01/25
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.0500	46,160				2028/01/19
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.0000	33,800				2023/08/16
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	8.5000	31,000				2031/09/17
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.7500	54,100				2026/09/16
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.4000	59,000				2022/12/07
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.7000	46,100				2023/03/23
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.1000	48,600				2024/10/16
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.0000	49,000				2021/12/15
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	6.5000	38,000				2024/02/28
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.2500	45,000				2034/05/10
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	6.9000	51,000				2029/05/23
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.9500	51,000				2026/10/07
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.4000	55,000				2024/07/17
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.1500	59,000				2025/11/12
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.6500	65,000				2030/04/10
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	7.7000	38,000				2039/03/16
	Russian Federal Bond - OFZ		国 債 証 券	6.0000	58,000				2027/10/06
通貨小計	銘 柄 数	額	20銘柄		921,830		1,008,720	1,381,947	
マレーシア	Malaysia Government Investment Issue		国 債 証 券	3.9480	3,400	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		2022/04/14
	Malaysia Government Investment Issue		国 債 証 券	4.2580	1,800				2027/07/26
	Malaysia Government Investment Issue		国 債 証 券	4.0940	2,000				2023/11/30
	Malaysia Government Investment Issue		国 債 証 券	4.3690	1,700				2028/10/31
	Malaysia Government Investment Issue		国 債 証 券	4.1300	1,600				2029/07/09
	Malaysia Government Investment Issue		国 債 証 券	3.6550	1,700				2024/10/15
	Malaysia Government Investment Issue		国 債 証 券	3.7260	1,400				2026/03/31
	Malaysia Government Investment Issue		国 債 証 券	3.4650	1,500				2030/10/15

2020年11月30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	3.7330	2,350	2,519	64,322	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.1810	1,740	1,868	47,709	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.9550	2,950	3,188	81,395	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8000	1,400	1,466	37,447	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.9000	2,000	2,162	55,209	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.6200	1,200	1,223	31,239	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.0590	3,020	3,238	82,671	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8990	2,520	2,735	69,836	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	4.7620	2,600	3,044	77,737	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.7570	1,400	1,462	37,332	2023/04/20
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.9060	2,000	2,156	55,052	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8850	2,150	2,325	59,372	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.4780	1,100	1,154	29,463	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT		国債証券	3.8280	800	833	21,278	2034/07/05
通貨小計	銘 柄 数	22銘柄			42,330	45,533	1,162,460	
	金 額							
南アフリカ					千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	10.5000	30,050	34,997	238,682	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	6.2500	11,220	7,704	52,542	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	6.5000	12,580	8,129	55,441	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	7.0000	15,940	13,421	91,534	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	7.7500	13,880	14,889	101,543	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.7500	29,520	23,716	161,745	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.5000	17,900	14,677	100,100	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.0000	22,900	21,555	147,008	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.7500	16,600	13,331	90,920	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.2500	15,300	13,567	92,528	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.8750	16,600	14,438	98,470	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	9.0000	11,300	9,478	64,640	2040/01/31
通貨小計	銘 柄 数	12銘柄			213,790	189,906	1,295,159	
	金 額							
タイ					千タイ・パーツ	千タイ・パーツ		
	Thailand Government Bond		国債証券	4.8750	26,050	33,635	115,368	2029/06/22
	Thailand Government Bond		国債証券	3.6250	23,300	25,082	86,032	2023/06/16
	Thailand Government Bond		国債証券	3.8500	22,610	25,950	89,009	2025/12/12
	Thailand Government Bond		国債証券	3.6500	26,100	26,956	92,462	2021/12/17
	Thailand Government Bond		国債証券	3.6500	22,700	27,573	94,576	2031/06/20
	Thailand Government Bond		国債証券	1.8750	17,200	17,558	60,227	2022/06/17
	Thailand Government Bond		国債証券	3.4000	20,100	24,734	84,839	2036/06/17
	Thailand Government Bond		国債証券	2.1250	26,600	28,417	97,473	2026/12/17
	Thailand Government Bond		国債証券	2.0000	24,000	24,711	84,760	2022/12/17
	Thailand Government Bond		国債証券	3.7750	29,000	35,899	123,134	2032/06/25
	Thailand Government Bond		国債証券	2.8750	24,900	29,169	100,051	2046/06/17
	Thailand Government Bond		国債証券	2.4000	22,000	23,184	79,523	2023/12/17
	Thailand Government Bond		国債証券	2.8750	20,000	22,518	77,236	2028/12/17
	Thailand Government Bond		国債証券	3.3000	28,000	34,210	117,340	2038/06/17
	Thailand Government Bond		国債証券	1.4500	30,000	30,873	105,897	2024/12/17
	Thailand Government Bond		国債証券	1.6000	9,000	9,216	31,614	2029/12/17
	Thailand Government Bond		国債証券	1.6000	12,000	11,977	41,081	2035/06/17
通貨小計	銘 柄 数	17銘柄			383,560	431,670	1,480,631	
	金 額							
ペルー	Peru Government Bond		国債証券	5.7000	千ペルー・ソル 730	千ペルー・ソル 858	24,740	2024/08/12

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2020年11月30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		
	Peru Government Bond		国 債 証 券	6.3500	1,970	千ペルー・ソル	千ペルー・ソル	千円	2028/08/12
	Peru Government Bond		国 債 証 券	6.1500	1,850		2,448	70,599	2032/08/12
	Peru Government Bond		国 債 証 券	5.9400	1,900		2,184	62,974	2029/02/12
	Peru Government Bond		国 債 証 券	5.4000	1,250		2,308	66,555	2034/08/12
	Peru Government Bond		国 債 証 券	5.3500	1,000		1,349	38,902	2040/08/12
	Peru Government Bond		国 債 証 券	8.2000	1,565		1,008	29,072	2026/08/12
	Peru Government Bond		国 債 証 券	6.9000	2,065		2,113	60,933	2037/08/12
	Peru Government Bond		国 債 証 券	6.9500	1,920		2,488	71,739	2031/08/12
	Peru Government Bond		国 債 証 券				2,423	69,861	2031/08/12
通貨小計	銘 柄 数	9銘柄			14,250		17,182	495,379	
						千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド	Poland Government Bond		国 債 証 券	5.7500	3,610		3,983	110,370	2022/09/23
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.5000	5,990		6,617	183,366	2026/07/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.5000	4,140		4,597	127,389	2027/07/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.2500	3,200		3,300	91,465	2022/04/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.5000	4,500		4,735	131,221	2023/01/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.5000	5,500		5,942	164,676	2024/04/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.7500	5,450		6,213	172,162	2029/10/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	1.2500	1,200		1,202	33,325	2030/10/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	4.0000	2,530		2,818	78,097	2023/10/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.7500	4,500		5,086	140,942	2028/04/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	3.2500	3,550		4,010	111,130	2025/07/25
通貨小計	銘 柄 数	11銘柄			44,170		48,507	1,344,147	
						千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント		
ハンガリー	Hungary Government Bond		国 債 証 券	3.0000	98,500		105,109	36,147	2024/06/26
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	3.0000	170,000		185,376	63,750	2027/10/27
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	1.7500	140,000		142,980	49,171	2022/10/26
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	2.7500	130,000		139,300	47,905	2026/12/22
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	6.7500	88,000		120,458	41,425	2028/10/22
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	3.0000	145,000		156,803	53,924	2030/08/21
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	2.5000	160,000		168,424	57,921	2024/10/24
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	3.2500	162,000		178,677	61,447	2031/10/22
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	1.5000	40,000		40,630	13,972	2023/08/23
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	1.0000	130,000		128,271	44,112	2025/11/26
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	6.0000	131,800		151,385	52,061	2023/11/24
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	7.0000	125,000		137,568	47,309	2022/06/24
	Hungary Government Bond		国 債 証 券	5.5000	142,500		169,758	58,380	2025/06/24
通貨小計	銘 柄 数	13銘柄			1,662,800		1,824,744	627,529	
						千ウルグアイ・ペソ	千ウルグアイ・ペソ		
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond		国 債 証 券	9.8750	5,300		5,495	13,408	2022/06/20
	Uruguay Government International Bond		国 債 証 券	8.5000	2,800		2,962	7,227	2028/03/15
通貨小計	銘 柄 数	2銘柄			8,100		8,457	20,636	
						千ドミニカ・ペソ	千ドミニカ・ペソ		
ドミニカ共和国	Dominican Republic International Bond		国 債 証 券	9.7500	11,000		11,717	20,856	2026/06/05
通貨小計	銘 柄 数	1銘柄			11,000		11,717	20,856	
合 計	銘 柄 数	222銘柄						16,818,517	

(注1) 邦貨換算金額は、2020年11月30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、評価額の単位未满是切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第21期 (決算日 2020年11月30日)

(作成対象期間 2019年12月3日～2020年11月30日)

外国債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

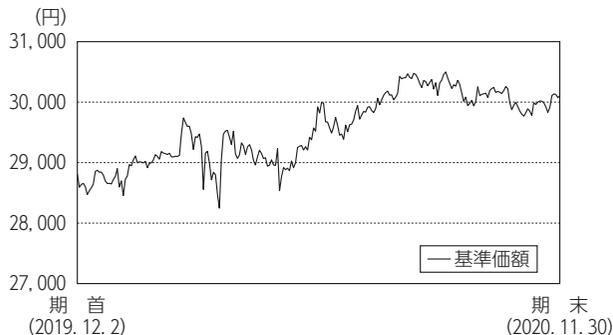
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：28,807円 期末：30,106円 騰落率：4.5%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆ 投資環境について

○ 海外債券市況

主要国の国債金利は、当作成期を通して見ると低下しました。

当作成期首より、新型コロナウイルスによる世界経済の減速懸念の高まりから、金利は大きく低下しました。その後は、各国で段階的に経済活動が再開されたことやワクチン開発への期待から金利は一時的に上昇しましたが、感染再拡大への懸念が高まると金利は再び低下しました。2020年8月には、株価が上昇するなどリスクに対する市場心理が改善し、金利は上昇しました。10月には、米国大統領および連邦議会選挙を控えて、バイデン候補が大統領に当選し民主党政権が成立したものの、米国の財政政策の懸念などから、米国の金利を中心に上昇しました。

○ 為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると米ドルなどが下落しました。

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

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ ポートフォリオについて

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

◆ ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は4.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.5%となりました。

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

《今後の運用方針》

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

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

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	5 (5)
(その他)	(0)
合 計	5

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

■ 売買および取引の状況
公 社 債

(2019年12月 3 日から2020年11月30日まで)

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカ・ドル 244, 186	千アメリカ・ドル 221, 904 (—)
	カナダ	千カナダ・ドル 18, 392	千カナダ・ドル 9, 377 (—)
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 31, 353	千オーストラリア・ドル 5, 400 (—)
	シンガポール	千シンガポール・ドル 3, 085	千シンガポール・ドル 1, 151 (—)
	イギリス	千イギリス・ポンド 26, 395	千イギリス・ポンド 11, 406 (—)
	イスラエル	千イスラエル・シケル 30, 447	千イスラエル・シケル 544 (—)
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 16, 467	千デンマーク・クローネ 2, 271 (—)
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 10, 993	千ノルウェー・クローネ 7, 241 (—)
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 14, 305	千スウェーデン・クローネ 11, 290 (—)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 81, 550	千メキシコ・ペソ 32, 935 (—)
マレーシア	千マレーシア・リンギット 13, 203	千マレーシア・リンギット 5, 100 (—)	

		買付額	売付額
外	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 7, 914	千南アフリカ・ランド 137, 657 (—)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 18, 643	千ポーランド・ズロチ 8, 566 (—)
	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 4, 308	千ユーロ 849 (—)
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 7, 400	千ユーロ 2, 393 (—)
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 10, 174	千ユーロ 3, 003 (—)
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 50, 275	千ユーロ 21, 351 (—)
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 49, 813	千ユーロ 15, 873 (—)
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 29, 263	千ユーロ 10, 586 (—)
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 43, 888	千ユーロ 22, 171 (—)
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 2, 826	千ユーロ 626 (—)
国	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 6, 786	千ユーロ 2, 319 (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 204, 737	千ユーロ 79, 175 (—)

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

■主要な売買銘柄
公 社 債

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2023/4/15	1,400,722	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2021/4/30	869,839
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.625% 2030/8/15	1,039,310	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2024/5/31	573,867
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.625% 2030/5/15	831,431	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2021/6/15	542,018
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.375% 2050/8/15	786,370	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2021/9/30	536,388
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2025/6/30	783,138	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 3.25% 2021/10/25	535,670
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2025/9/30	679,021	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2021/6/30	505,631
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2050/2/15	664,353	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2021/7/31	504,550
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.5% 2027/4/30	608,726	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.625% 2021/2/15	454,267
GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 2023/4/14	608,569	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3% 2045/11/15	445,066
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2040/8/15	601,899	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2020/12/31	441,566

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国(外貨建)公社債(通貨別)

作 成 期	当 期			未				
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
区 分			千円	%	%	%	%	%
アメリカ	千アメリカ・ドル 820,457	千アメリカ・ドル 897,323	93,222,970	42.6	—	18.7	16.0	7.9
カナダ	千カナダ・ドル 48,203	千カナダ・ドル 54,207	4,333,924	2.0	—	0.9	0.7	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 67,164	千オーストラリア・ドル 75,437	5,801,880	2.7	—	1.8	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 10,378	千シンガポール・ドル 11,857	921,200	0.4	—	0.3	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 78,966	千イギリス・ポンド 104,078	14,420,010	6.6	—	5.1	1.1	0.4
イスラエル	千イスラエル・シェケル 25,400	千イスラエル・シェケル 29,484	924,033	0.4	—	0.2	0.2	0.0
デンマーク	千デンマーク・クローネ 56,061	千デンマーク・クローネ 71,697	1,198,067	0.5	—	0.4	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 36,634	千ノルウェー・クローネ 38,933	457,858	0.2	—	0.1	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 50,870	千スウェーデン・クローネ 56,926	695,644	0.3	—	0.2	0.1	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 307,034	千メキシコ・ペソ 342,802	1,779,145	0.8	—	0.4	0.2	0.1
マレーシア	千マレーシア・リンギット 39,094	千マレーシア・リンギット 42,024	1,072,884	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 45,329	千ポーランド・ズロチ 49,569	1,373,582	0.6	—	0.3	0.3	0.1

作成期		当 期				末			
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
ユ ー ロ	アイルランド	千ユーロ 11,943	千ユーロ 13,978	千円 1,738,620	% 0.8	% —	% 0.6	% 0.2	% 0.1
	オランダ	千ユーロ 27,805	千ユーロ 34,178	4,251,147	1.9	—	1.3	0.5	0.2
	ベルギー	千ユーロ 35,009	千ユーロ 44,357	5,517,247	2.5	—	2.0	0.4	0.1
	フランス	千ユーロ 148,837	千ユーロ 183,176	22,783,533	10.4	—	7.0	2.6	0.7
	ドイツ	千ユーロ 107,345	千ユーロ 130,943	16,286,782	7.4	—	4.8	2.1	0.6
	スペイン	千ユーロ 86,979	千ユーロ 106,965	13,304,319	6.1	—	4.1	1.6	0.4
	イタリア	千ユーロ 139,894	千ユーロ 167,518	20,835,981	9.5	—	6.0	2.5	1.1
	フィンランド	千ユーロ 9,664	千ユーロ 10,842	1,348,586	0.6	—	0.4	0.1	0.1
	オーストリア	千ユーロ 21,268	千ユーロ 26,576	3,305,593	1.5	—	1.0	0.4	0.1
	小計	588,744	718,538	89,371,812	40.8	—	27.2	10.3	3.4
合 計	—	—	215,573,016	98.5	—	56.0	29.8	12.7	

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ア メ リ カ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	千アメリカ・ドル 2,153	千アメリカ・ドル 2,191	千円 227,701	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,224	3,297	342,567	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,459	2,516	261,402	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,543	2,606	270,826	2022/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,668	6,858	712,571	2022/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,526	470,206	2023/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,865	505,468	2023/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,568	4,854	504,377	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,398	560,874	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,654	587,417	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	5,296	550,254	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	8.0000	2,106	2,265	235,372	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	761	79,098	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,102	114,494	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	977	101,589	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	955	99,317	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	1,000	103,960	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	473	645	67,091	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	1,072	111,398	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	3,466	360,101	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,748	181,685	2036/02/15

外国債券インデックスマザーファンド

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

区 分	銘 柄	種 類	当 期		未			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,648	4,419	459,139	2046/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,962	3,050	316,904	2023/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,623	3,735	388,125	2023/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,729	3,969	412,405	2026/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,142	222,594	2023/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,423	4,148	430,959	2046/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,590	269,119	2023/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	3,092	321,309	2023/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	5,716	593,875	2026/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,480	4,028	418,533	2046/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,859	297,071	2023/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,478	257,456	2023/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,589	268,986	2023/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,767	599,225	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	3,031	314,955	2021/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,604	270,599	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,500	4,536	471,248	2046/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,632	273,539	2023/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,400	3,454	358,937	2021/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,000	4,080	423,933	2021/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,657	276,077	2023/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	6,140	6,790	705,455	2027/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,070	319,035	2022/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,639	274,252	2024/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,545	4,701	488,415	2047/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,010	3,074	319,450	2022/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,441	253,656	2024/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,550	4,837	502,611	2024/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,966	308,222	2022/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	7,149	742,755	2027/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	2,656	275,990	2047/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	3,000	3,072	319,240	2022/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	3,181	330,491	2024/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,072	319,168	2022/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,626	584,557	2024/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,000	3,075	319,558	2022/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,550	265,016	2024/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	6,556	681,141	2027/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,900	2,984	310,060	2022/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,205	333,022	2024/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,450	4,390	456,090	2047/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,200	3,282	341,018	2022/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	2,120	220,327	2024/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,579	267,942	2022/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,500	2,677	278,126	2024/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,588	268,916	2022/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	6,122	636,076	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,500	4,460	463,380	2047/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,769	391,649	2024/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,433	356,756	2024/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	3,022	314,003	2024/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,667	380,999	2023/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,650	6,500	675,342	2028/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,481	361,717	2023/02/28	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,838	294,867	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,979	309,560	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,800	5,060	525,735	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,900	3,057	317,613	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	3,189	331,312	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,200	5,721	594,405	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	7,558	785,282	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,655	275,853	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	2,112	219,504	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,953	410,761	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,660	276,383	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,657	276,098	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	3,329	345,928	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,850	4,114	427,410	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	7,812	811,616	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,220	5,635	585,456	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,794	290,302	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,853	400,356	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	4,006	416,225	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,817	292,676	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,227	335,288	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,821	293,081	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,312	447,990	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,106	426,597	2021/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	6,900	8,200	851,972	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,520	6,447	669,812	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,371	350,260	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	2,160	224,450	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,800	2,872	298,446	2021/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,500	3,895	404,747	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,686	279,082	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,079	319,910	2022/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	7,610	790,664	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,085	320,543	2022/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	4,289	445,654	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,786	289,450	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	6,295	654,069	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,774	288,232	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,531	366,859	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,600	374,054	2022/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,743	285,027	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,700	3,806	395,486	2022/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,400	3,497	363,367	2022/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	6,094	633,145	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	4,425	459,804	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,741	388,726	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	3,093	321,389	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,585	372,461	2022/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,276	340,399	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,688	383,213	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	3,021	313,933	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,000	4,102	426,256	2022/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,500	5,802	602,861	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,699	280,419	2026/07/31

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

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	10,000	9,810	1,019,171	2030/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,936	512,832	2027/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	7,700	7,333	761,827	2050/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,800	5,570	578,736	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,481	361,680	2027/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,997	311,461	2022/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,996	207,430	2023/09/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	6,468	672,009	2025/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,998	311,486	2022/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,942	409,551	2027/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,484	361,993	2025/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,200	4,191	435,500	2023/10/15	
通貨小計	銘柄数	249銘柄						
	金 額			820,457	897,323	93,222,970		
				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル			
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	405	622	49,753	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	586	866	69,298	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,401	112,035	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,771	141,659	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,645	131,567	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,363	2,111	168,839	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,751	1,818	145,382	2022/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	1,461	2,219	177,428	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,292	103,307	2023/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,512	120,956	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,846	147,611	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,252	100,136	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	1,023	81,864	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,279	102,324	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,440	1,445	115,606	2022/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,750	1,774	141,837	2022/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,200	1,328	106,242	2028/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,300	4,445	355,439	2023/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,300	1,362	108,908	2023/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,110	2,559	204,616	2051/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,386	110,858	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,276	102,058	2024/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,462	116,889	2024/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	3,630	290,256	2030/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	800	808	64,621	2021/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,600	1,660	132,756	2025/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,100	1,117	89,333	2022/02/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5	5	407	2022/05/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,902	232,079	2025/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,301	184,015	2022/08/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	700	55,987	2022/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	880	70,392	2030/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	500	494	39,573	2026/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	500	499	39,927	2024/04/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,500	119,948	2023/02/01	
通貨小計	銘柄数	35銘柄						
	金 額			48,203	54,207	4,333,924		

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

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	当 期		末			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,621	1,776	246,129	2025/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,682	2,785	385,874	2065/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,586	219,863	2026/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	2,320	2,341	324,351	2022/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,940	2,247	311,454	2047/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,750	3,212	445,098	2037/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,510	1,969	272,931	2057/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	2,010	2,163	299,692	2027/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	2,000	2,042	282,985	2023/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	2,500	2,787	386,201	2028/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,060	1,491	206,643	2071/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	2,600	2,692	372,992	2024/04/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,110	1,366	189,388	2049/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	1,051	145,731	2054/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	1,800	1,899	263,116	2029/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	2,600	2,674	370,532	2025/06/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	940	1,021	141,593	2041/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	2,300	2,306	319,550	2023/01/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	2,300	2,313	320,468	2030/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	650	590	81,783	2061/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,505	208,577	2026/01/30	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,000	997	138,175	2028/01/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	1,038	143,852	2050/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	900	898	124,524	2035/07/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,300	1,304	180,786	2024/01/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,386	192,137	2028/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,840	2,635	365,215	2032/06/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,788	247,797	2025/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,662	2,547	353,006	2036/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,257	2,127	294,792	2038/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,908	3,915	542,535	2055/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,666	3,001	415,799	2046/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,589	220,228	2027/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,416	4,231	586,291	2042/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,830	2,635	365,086	2030/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	2,530	350,607	2049/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	2,345	325,034	2039/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,382	1,453	201,314	2022/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,260	1,926	266,915	2034/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,574	3,287	455,481	2060/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,604	360,841	2040/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	2,824	391,308	2052/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,242	2,313	320,522	2022/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,166	3,278	454,284	2044/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,582	1,682	233,130	2023/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,586	3,330	461,456	2068/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,092	1,206	167,187	2024/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	2,124	3,368	466,731	2045/01/22	
通貨小計	銘柄数 金 額	48銘柄		78,966	104,078	14,420,010		

区 分		当 期				末		
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
イスラエル		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	千イスラエル・シケル 2,000	千イスラエル・シケル 2,681	千円 84,053	2026/10/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	2,000	2,127	66,679	2022/01/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	4.2500	1,800	1,971	61,788	2023/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,900	3,254	101,990	2042/01/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,000	2,232	69,962	2024/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,450	76,788	2025/08/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,970	61,752	2027/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.2500	1,000	1,022	32,041	2022/11/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,100	2,940	92,144	2047/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,800	2,020	63,324	2028/09/28
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,500	1,557	48,802	2023/11/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.7500	1,000	1,010	31,667	2022/07/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	1,900	1,936	60,676	2030/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.5000	600	603	18,928	2025/04/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	700	706	22,146	2037/05/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.1500	1,000	998	31,286	2023/07/31
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄			25,400	29,484	924,033	
デンマーク		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 13,662	千デンマーク・クローネ 26,252	438,685	2039/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	7,550	7,812	130,545	2021/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,162	86,266	2023/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	6,735	112,544	2025/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	7,900	8,490	141,883	2027/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	9,590	10,450	174,628	2029/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,300	4,377	73,141	2022/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,416	40,372	2052/11/15
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄			56,061	71,697	1,198,067	
ノルウェー		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	千ノルウェー・クローネ 8,204	千ノルウェー・クローネ 8,555	100,617	2023/05/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,448	52,310	2024/03/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	5,395	5,693	66,950	2025/03/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,340	3,508	41,258	2026/02/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,450	3,687	43,368	2027/02/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,828	45,026	2028/04/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	4,166	48,997	2029/09/06
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	4,800	5,045	59,329	2030/08/19
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄			36,634	38,933	457,858	
スウェーデン		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	千スウェーデン・クローネ 4,655	千スウェーデン・クローネ 7,308	89,314	2039/03/30
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	8,465	8,962	109,521	2022/06/01
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	8,025	8,471	103,526	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,595	8,570	104,735	2025/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	7,723	94,377	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,550	4,869	59,510	2028/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	7,400	7,977	97,484	2029/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	3,000	3,041	37,172	2031/05/12
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄			50,870	56,926	695,644	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期				未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額			
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
				%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円		
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	20,290	20,912	108,537	2026/03/05		
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	18,300	20,526	106,533	2047/11/07		
	Mexican Bonos	国債証券	7.2500	29,000	29,831	154,825	2021/12/09		
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	23,800	26,462	137,339	2024/09/05		
	Mexican Bonos	国債証券	6.7500	7,200	7,556	39,216	2023/03/09		
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	30,033	32,936	170,939	2023/12/07		
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	23,919	28,453	147,672	2024/12/05		
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	27,968	31,272	162,302	2027/06/03		
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	11,998	62,272	2036/11/20		
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,544	35,381	183,627	2029/05/31		
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	16,894	20,095	104,296	2038/11/18		
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	15,015	17,243	89,492	2031/05/29		
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	28,599	29,485	153,031	2022/06/09		
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	19,654	21,576	111,984	2042/11/13		
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,944	9,069	47,073	2034/11/23		
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		307,034	342,802	1,779,145			
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,511	64,109	2027/05/31		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,336	34,124	2030/04/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,668	42,584	2026/04/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,449	37,002	2031/06/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4180	875	900	22,998	2022/08/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	791	20,215	2027/03/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	1,001	1,036	26,472	2023/03/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,520	38,828	2033/04/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,186	1,271	32,462	2028/06/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	600	691	17,648	2043/09/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,135	28,982	2024/07/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,877	47,926	2025/09/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7950	1,161	1,203	30,731	2022/09/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,349	34,454	2035/05/31		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,302	1,364	34,825	2023/08/17		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	1,030	26,304	2046/03/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	650	702	17,942	2026/11/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	352	358	9,163	2021/11/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,600	1,645	41,999	2022/03/10		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	750	804	20,530	2024/09/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,291	32,978	2027/11/16		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,050	1,229	31,393	2037/04/07		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,284	32,782	2025/03/14		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	2,500	2,611	66,665	2023/04/20		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,372	35,039	2033/11/07		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	600	710	18,126	2038/06/08		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	700	17,892	2026/07/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,910	2,065	52,744	2029/08/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,351	34,493	2048/07/06		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400	419	10,713	2024/06/14		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,354	34,577	2034/07/05		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,786	45,621	2040/05/22		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	700	699	17,870	2050/06/15		
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	500	496	12,675	2031/04/15			
通貨小計	銘柄数 金 額	34銘柄		39,094	42,024	1,072,884			

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	2,309	2,547	70,594	2022/09/23
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,377	4,835	133,989	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	3,520	97,541	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,320	3,424	94,895	2022/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,850	4,051	112,267	2023/01/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,870	3,101	85,931	2024/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840	5,517	152,892	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,400	3,666	101,594	2024/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	—	3,200	3,198	88,629	2022/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.7500	1,000	1,013	28,097	2025/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.2500	1,300	1,302	36,102	2030/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	1,154	31,978	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,625	2,924	81,030	2023/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,650	4,125	114,320	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,591	5,186	143,717	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金額			45,329	49,569	1,373,582		
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (アイルランド)		IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,031	1,300	161,763	2025/03/13
		IRISH TREASURY	国債証券	3.9000	624	690	85,861	2023/03/20
		IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	689	85,701	2024/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	961	1,213	150,888	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.8000	516	525	65,409	2022/03/15
		IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	881	1,260	156,765	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,166	145,065	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	703	87,541	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	—	350	354	44,095	2022/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	881	109,582	2028/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	750	888	110,469	2033/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	450	526	65,474	2031/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	1,200	1,352	168,245	2029/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	600	798	99,341	2050/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	250	266	33,184	2035/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	836	104,018	2027/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	500	524	65,211	2030/10/18
国小計	銘柄数	17銘柄						
	金額			11,943	13,978	1,738,620		
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (オランダ)		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	548	645	80,247	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,139	1,648	204,993	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,685	2,897	360,335	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	867	107,864	2023/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,779	3,332	414,497	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,438	1,508	187,604	2022/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,593	198,247	2033/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,477	183,713	2023/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,579	2,830	352,104	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,666	207,246	2024/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,872	232,958	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,638	1,749	217,606	2026/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,209	150,476	2022/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,407	299,459	2027/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,432	178,227	2024/01/15

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			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		
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,150	1,272	158,233	2028/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,286	160,030	2029/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	1,033	128,512	2040/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,994	248,022	2030/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	832	103,540	2027/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	600	620	77,223	2052/01/15
国 小 計	銘柄数 金 額	21銘柄			27,805	34,178	4,251,147	
ユーロ (ベルギー)		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,699	1,815	225,803	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	2,026	252,110	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	1,412	175,646	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	2,283	2,493	310,129	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	1,667	207,454	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	640	1,098	136,642	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	1,490	1,529	190,279	2023/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,400	1,529	190,207	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,099	136,799	2024/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	780	1,281	159,385	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	400	498	62,057	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,340	1,477	183,749	2028/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	850	1,012	125,900	2033/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,678	208,741	2029/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	600	835	103,921	2050/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,278	159,010	2030/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	660	698	86,924	2040/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,246	155,060	2027/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,478	308,236	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	2,104	3,686	458,506	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	877	932	115,934	2022/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	2,937	365,392	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,280	159,208	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,316	1,436	178,729	2022/09/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	1,167	145,273	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,441	179,263	2023/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	843	1,556	193,604	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,684	209,578	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	1,074	133,693	2034/06/22
国 小 計	銘柄数 金 額	29銘柄			35,009	44,357	5,517,247	
ユーロ (フランス)		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	1,985	2,428	302,072	2023/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	4,033	501,630	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	5,031	625,824	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,927	5,073	631,083	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	4,574	569,001	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,764	3,853	479,249	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	4,104	510,503	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	4,097	4,696	584,188	2023/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,564	6,786	844,064	2041/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,717	3,983	495,413	2060/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,146	3,861	480,355	2026/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	3,630	3,819	475,094	2022/04/25

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	5,199	6,415	797,916	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,694	3,905	485,731	2022/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,588	4,495	559,096	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,347	3,554	442,114	2023/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	5,086	5,617	698,734	2024/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,887	7,540	937,943	2030/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,899	5,385	669,832	2024/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,679	457,615	2025/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	5,528	687,681	2025/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,920	5,882	731,677	2031/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,787	4,025	500,649	2026/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,869	4,674	581,470	2036/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,287	1,993	247,903	2066/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,800	3,996	497,122	2026/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	4,042	502,838	2022/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	3,408	423,979	2039/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,753	466,915	2027/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,000	4,401	547,515	2048/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,440	303,524	2023/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,400	4,827	600,439	2028/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	4,717	586,819	2034/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	5,453	678,326	2028/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,481	433,037	2024/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,412	175,629	2022/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,750	3,690	459,079	2050/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,250	5,685	707,213	2029/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,130	3,221	400,700	2025/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,800	2,907	361,626	2029/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,438	303,324	2023/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,870	2,098	261,022	2052/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,098	385,356	2026/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	1,083	134,730	2040/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,070	257,481	2030/11/25
国 小 計	銘柄数 金 額	45銘柄			148,837	183,176	22,783,533	
ユーロ (ドイツ)				千ユーロ	千ユーロ			
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,189	147,999	2024/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,741	216,650	2027/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	3,167	393,998	2028/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,357	168,895	2028/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	3,219	400,477	2030/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,448	5,647	702,454	2031/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,405	2,446	304,271	2034/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,571	6,208	772,249	2037/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	2,510	312,279	2039/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,439	2,939	365,649	2040/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,874	5,185	644,983	2042/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,807	1,862	231,598	2022/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,222	2,311	287,535	2022/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	4,728	588,082	2044/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,644	1,710	212,721	2022/09/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,481	184,319	2023/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,920	238,837	2023/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,721	214,134	2023/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,690	210,281	2024/02/15

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千ユーロ	千円	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,979	5,158	641,558	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,722	214,213	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,042	4,315	536,764	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,315	287,985	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,134	3,402	423,197	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,368	2,528	314,527	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,527	314,421	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	6,200	6,595	820,409	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,496	310,473	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,370	3,358	417,721	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	2,071	257,628	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,400	4,730	588,350	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,371	295,012	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,174	394,849	2029/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,846	229,701	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,852	230,435	2030/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,328	289,591	2035/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,101	261,329	2027/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	741	92,168	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,273	158,369	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	806	100,250	2021/12/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	302	37,664	2022/03/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	12,579	2022/06/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	12,606	2022/09/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,160	1,171	145,733	2022/04/08
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	2,129	264,927	2022/10/07
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,730	5,838	726,145	2023/04/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,943	241,792	2023/10/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,971	245,204	2024/04/05
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,752	217,956	2024/10/18
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,482	308,789	2025/04/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,387	296,999	2025/10/10
国 小 計	銘柄数 金 額	51銘柄		107,345	130,943	16,286,782	
ユーロ (スペイン)				千ユーロ	千ユーロ		
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	3,984	495,598	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	2,234	277,974	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	2,435	302,957	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,474	307,789	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	3,083	383,485	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	2,927	364,165	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	2,827	351,712	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	3,030	3,329	414,181	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	2,080	2,109	262,391	2022/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	2,123	264,070	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	2,200	2,777	345,405	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	2,290	284,877	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,600	1,632	203,051	2022/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	2,124	264,243	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,300	1,910	237,669	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	2,400	2,458	305,804	2023/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,900	2,130	264,957	2028/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	1,700	1,709	212,655	2021/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,600	2,938	365,528	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,050	2,482	308,733	2035/07/30

区 分		当 期				未		償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,367	294,410	2024/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,962	368,501	2029/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,360	1,424	177,171	2030/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,460	2,494	310,224	2023/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,529	190,279	2025/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,200	1,242	154,572	2050/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,569	319,554	2027/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,900	3,241	403,239	2030/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	900	996	123,938	2040/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,979	3,261	405,679	2032/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,854	2,954	367,519	2037/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	2,158	3,906	485,844	2040/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	1,969	245,000	2024/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	2,473	4,434	551,558	2041/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,189	2,717	338,058	2025/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,671	332,261	2026/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.8500	1,978	2,126	264,536	2022/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	1,958	2,214	275,402	2023/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	2,179	271,029	2023/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,515	312,852	2028/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	2,566	319,167	2044/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,265	281,746	2024/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,367	294,515	2024/10/31	
国 小 計	銘柄数	43銘柄						
	金 額			86,979	106,965	13,304,319		
				千ユーロ	千ユーロ			
ユーロ (イタリア)	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	1,906	2,428	302,008	2023/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,577	196,257	2026/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,414	424,642	2027/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	2,007	249,735	2024/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	2,126	264,508	2046/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,629	1,669	207,658	2022/04/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,666	331,635	2025/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	2,284	284,131	2032/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,891	2,083	259,169	2025/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,504	1,555	193,448	2022/09/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	2,077	258,454	2047/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,359	1,400	174,209	2023/03/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	1,786	1,938	241,155	2026/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	2,754	342,572	2036/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	1,141	141,922	2026/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	1,550	1,593	198,260	2023/10/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,358	1,368	170,230	2021/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	1,288	160,307	2067/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,798	223,716	2033/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,705	212,148	2027/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,394	173,441	2024/05/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	2,050	2,095	260,682	2022/04/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,850	2,710	337,117	2048/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,700	3,028	376,712	2027/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,700	1,738	216,264	2022/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,703	211,883	2024/11/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,686	209,823	2038/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	2,358	293,296	2028/02/01	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,957	243,499	2023/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,389	172,850	2025/05/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,050	3,638	452,586	2028/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	2,200	2,374	295,384	2023/10/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,744	217,032	2025/11/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,684	209,461	2035/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,250	1,967	244,680	2049/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,550	1,587	197,423	2022/07/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	2,318	288,388	2029/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,200	2,354	292,897	2024/07/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	2,100	2,339	290,930	2026/07/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	1,250	1,660	206,574	2040/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	2,050	255,003	2030/04/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	740	747	92,959	2023/01/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,300	1,327	165,063	2025/02/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,449	304,709	2027/01/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,800	2,235	278,108	2050/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,603	199,504	2036/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,000	2,049	254,946	2023/06/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,300	2,502	311,268	2025/07/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	2,081	258,946	2030/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,400	2,654	330,199	2030/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3000	1,300	1,322	164,499	2023/08/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,700	1,780	221,508	2027/09/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	819	101,984	2026/02/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,400	1,539	191,438	2041/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,300	1,339	166,638	2031/04/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	12,538	2024/01/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	800	845	105,110	2051/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	2,754	3,912	486,684	2029/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,399	547,211	2031/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,852	354,786	2033/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	3,522	438,127	2034/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	3,943	490,515	2037/02/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	3,375	419,857	2039/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,560	318,493	2023/08/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,581	321,103	2025/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	3,740	465,267	2040/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,555	317,906	2026/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,012	2,150	267,514	2022/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	2,657	2,934	364,943	2022/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,960	2,183	271,612	2022/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	3,222	400,773	2028/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,119	263,590	2023/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	3,079	383,056	2044/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,535	315,324	2024/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,526	314,304	2024/09/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,838	3,615	449,727	2030/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.1500	1,593	1,637	203,641	2021/12/15	
国 小 計	銘柄数	77銘柄						
	金 額			139,894	167,518	20,835,981		
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	614	688	85,676	2031/04/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	300	37,354	2025/09/15	
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	1,111	1,181	147,010	2026/04/15	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千ユーロ	千円	
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	204	25,396	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	496	61,731	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	770	777	96,759	2022/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	860	107,019	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	370	439	54,677	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	541	67,346	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	544	67,708	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	205	25,556	2024/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	324	40,409	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	427	53,167	2040/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	500	520	64,777	2030/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	813	101,216	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	489	60,843	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.6250	312	325	40,480	2022/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	470	58,472	2023/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	651	81,044	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	578	71,937	2024/04/15
国 小 計	銘柄数	20銘柄					
	金 額			9,664	10,842	1,348,586	
ユーロ (オーストリア)	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	1,373	1,502	186,894	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,220	151,765	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	1,090	135,652	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	409	50,950	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	—	900	917	114,077	2023/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,780	1,910	237,664	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	1,225	152,459	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	405	50,414	2022/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	900	987	122,878	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	980	1,063	132,311	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	800	820	102,093	2024/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	—	680	708	88,063	2030/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,000	1,017	126,528	2023/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	842	104,810	2051/03/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	404	50,317	2040/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,209	150,419	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,673	2,878	358,056	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,137	141,423	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.6500	797	845	105,156	2022/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	943	117,371	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	831	103,397	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	1,102	137,079	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,028	127,899	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	1,054	131,133	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	1,019	126,773	2024/10/21
国 小 計	銘柄数	25銘柄					
	金 額			21,268	26,576	3,305,593	
通貨小計	銘柄数	328銘柄					
	金 額			588,744	718,538	89,371,812	
合 計	銘柄数	810銘柄					
	金 額					215,573,016	

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	215,573,016	98.5
コール・ローン等、その他	3,336,412	1.5
投資信託財産総額	218,909,428	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=103.89円、1カナダ・ドル=79.95円、1オーストラリア・ドル=76.91円、1シンガポール・ドル=77.69円、1イギリス・ポンド=138.55円、1イスラエル・シェケル=31.34円、1デンマーク・クローネ=16.71円、1ノルウェー・クローネ=11.76円、1スウェーデン・クローネ=12.22円、1メキシコ・ペソ=5.19円、1マレーシア・リンギット=25.53円、1ポーランド・ズロチ=27.71円、1ユーロ=124.38円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(217,489,673千円)の投資信託財産総額(218,909,428千円)に対する比率は、99.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

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

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

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ外国債券インデックスV A601,675,980円、ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)12,401,222円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)102,686,952円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)29,631,947円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)339,511,943円、外国債券インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)90,339,707円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)462,489,583円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス(為替ヘッジなし)1,814,096,236円、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし)654,015,808円、D-1's 外国債券インデックス1,055,376円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 957,155円、iFree 外国債券インデックス691,990,376円、iFree 8資産バランス989,492,660円、iFree 年金バランス49,115,601円、DCダイワ外国債券インデックス48,408,053,236円、ダイワ・ライフ・バランス30 819,754,500円、ダイワ・ライフ・バランス50

459,770,424円、ダイワ・ライフ・バランス70 279,428,323円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)459,816,979円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)336,784,366円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)108,589,082円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 8,547,742円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 19,902,336円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 4,844,467円、ダイワつみたてインデックス外国債券163,786,187円、ダイワつみたてインデックスバランス30 3,047,233円、ダイワつみたてインデックスバランス50 977,653円、ダイワつみたてインデックスバランス70 951,206円、ダイワ世界バランスファンド40VA174,483,363円、ダイワ世界バランスファンド60VA131,594,279円、ダイワ・バランスファンド35VA4,234,846,474円、ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)250,419,145円、ダイワ・インデックスセレクト 外国債券142,610,494円、ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド34,513,413円、ダイワ外国債券インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)4,864,458,623円、ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス5,832,536,410円、ダイワライフスタイル25 33,396,711円、ダイワライフスタイル50 59,767,812円、ダイワライフスタイル75 16,157,426円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は30,106円です。

■損益の状況

当期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

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

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

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

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

運用報告書 第10期（決算日 2020年7月6日）

（作成対象期間 2019年7月6日～2020年7月6日）

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

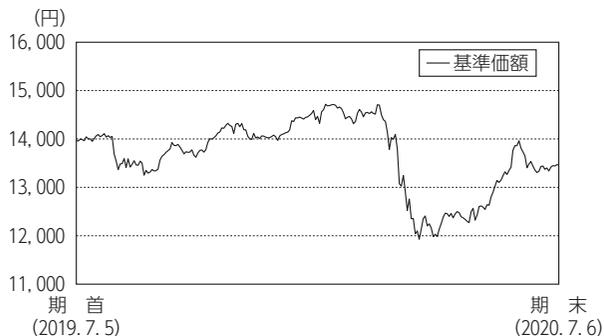
運用方針	投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ない ます。
主要投資対象	新興国通貨建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		JPMorgan ガバメント・ボンド・インデックス-エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) (ベンチマーク)		公社債 組 入 率 比
	円	%	円	%	
(期首) 2019年 7月 5日	13,964	—	14,926	—	96.8
7月 末	14,031	0.5	14,981	0.4	96.3
8月 末	13,369	△ 4.3	14,277	△ 4.3	96.1
9月 末	13,729	△ 1.7	14,700	△ 1.5	96.4
10月 末	14,259	2.1	15,209	1.9	96.9
11月 末	14,052	0.6	15,006	0.5	95.9
12月 末	14,591	4.5	15,590	4.5	95.9
2020年 1月 末	14,416	3.2	15,416	3.3	95.9
2月 末	14,137	1.2	15,142	1.4	95.8
3月 末	12,246	△ 12.3	13,096	△ 12.3	96.5
4月 末	12,495	△ 10.5	13,352	△ 10.5	94.4
5月 末	13,268	△ 5.0	14,228	△ 4.7	94.9
6月 末	13,419	△ 3.9	14,372	△ 3.7	95.3
(期末) 2020年 7月 6日	13,460	△ 3.6	14,417	△ 3.4	95.5

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) は、J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (米ドルベース) は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

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

(注5) 公社債組入率は新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。

【運用経過】

【基準価額・騰落率】

期首：13,964円 期末：13,460円 騰落率：△3.6%

【基準価額の主な変動要因】

投資対象国の債券価格の多くが上昇 (金利は低下) したことや投資している債券からの利息収入はプラス要因となったものの、投資対象通貨のほぼすべての対円為替レートが下落 (円高) したことがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○新興国債券市況

新興国債券の価格は、多くの国で上昇しました。

新興国債券の価格は、2019年8月には米中貿易摩擦への懸念の高まりにより一時下落する局面もありましたが、9月以降は、米中貿易摩擦などへの懸念が和らいだことなどから上昇しました。しかし2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染が世界的に拡大したことから経済の減速懸念が高まり、2月後半には金融市場が急激にリスク回避的な動きとなりました。先進国の金利が低下する一方で、現金化ニーズや新興国からの資金流出懸念などから、新興国の債券価格は下落しました。その後、欧米主要国の金融当局が相次いで金融緩和や流動性供給策を実施し、多くの新興国も追従したことから、金融市場は落ち着きを見せ、金利は低下しました。個別国では、従来より構造問題を抱え新型コロナウイルスによる打撃からの経済回復が相対的に遅いとみられる南アフリカや、債務再編を宣言したアルゼンチンなどの債券価格が下落しました。

○為替相場

新興国為替市場は、多くの通貨が対円で下落しました。

新興国通貨の対円為替相場は、2019年8月には米中の貿易摩擦への懸念や世界的な景気減速懸念などから一時下落しました。9月以降は、米中通商交渉や英国のEU (欧州連合) 離脱交渉の進展期待が高まる中で新興国通貨は上昇しました。2020年に入ると、新型コロナウイルスの感染が世界的に拡大したことから経済の減速懸念が高まり、2月後半には金融市場がリスク回避的な動きとなりました。それを受けて3月には現金化ニーズや新興国からの資金流出懸念などから、新興国通貨は大きく売られました。その後は、各国の金融緩和や流動性供給策を受けて、下落幅を縮小させました。個別国では、新型コロナウイルスの感染拡大が止まらないブラジル・レアル、原油価格下落の影響を受けたロシア・ルーブル、ロシアからのミサイル防衛システム購入をめぐって対米関係が悪化し、新型コロナウイルスの影響で経常赤字拡大が懸念されるトルコ・リラ、感染拡大が止まらない米国への経済依存度が高く、利下げ続きのメキシコ・ペソ、構造問題を抱え新型コロナウイルスによる打撃からの経済回復が遅いとみられる南アフリカ・ランドなどが相対的に大きく下落しました。

◆前作成期における「今後の運用方針」

今後も、新興国通貨建ての債券に投資し、ファンドの通貨比率をベンチマーク (J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)) に極力近づけ、かつ、ファンドとベンチマークの金利変動に対する価格感応度を近づけることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△3.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△3.6%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、税金、売買に伴う費用などが主な要因です。

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	17 (16)
(その他)	(1)
合 計	17

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2019年7月6日から2020年7月6日まで)

		買 付 額	売 付 額
外	トルコ	千トルコ・リラ 1,730	千トルコ・リラ 3,361 (—)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 92,403	千メキシコ・ペソ 27,655 (—)
	フィリピン	千フィリピン・ペソ 12,265	千フィリピン・ペソ 15,103 (—)
	アルゼンチン	千アルゼンチン・ペソ —	千アルゼンチン・ペソ 4,771 (—)
	チリ	千チリ・ペソ 510,255	千チリ・ペソ 712,114 (—)
国	コロンビア	千コロンビア・ペソ 6,185,347	千コロンビア・ペソ 1,571,030 (—)
	インドネシア	千インドネシア・ルピア 52,116,249	千インドネシア・ルピア 29,824,871 (—)
	ブラジル	千ブラジル・レアル 35,832	千ブラジル・レアル 14,958 (—)

		買 付 額	売 付 額
外	チェコ	千チェコ・コルナ 52,476	千チェコ・コルナ 6,668 (—)
	ルーマニア	千ルーマニア・レイ 6,942	千ルーマニア・レイ 2,100 (—)
	中国	千オフショア・人民元 41,697	千オフショア・人民元 — (—)
	ロシア	千ロシア・ルーブル 333,692	千ロシア・ルーブル 86,479 (—)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 15,446	千マレーシア・リンギット 4,599 (—)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 65,095	千南アフリカ・ランド 12,380 (—)
国	タイ	千タイ・バーツ 130,705	千タイ・バーツ 49,563 (—)
	ペルー	千ペルー・ソル 5,002	千ペルー・ソル 1,468 (—)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 17,138	千ポーランド・ズロチ 12,617 (—)
	ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 333,526	千ハンガリー・フォリント 167,397 (—)
	ドミニカ	千ドミニカ・ペソ 11,415	千ドミニカ・ペソ — (—)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2019年7月6日から2020年7月6日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2023/7/1	212,045	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2021/1/1	135,600
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	165,800	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2021/7/1	119,296
Poland Government Bond (ポーランド) 2.75% 2029/10/25	149,071	Poland Government Bond (ポーランド) 1.75% 2021/7/25	117,035
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8% 2030/1/31	131,069	Mexican Bonos (メキシコ) 6.5% 2021/6/10	103,640
Mexican Bonos (メキシコ) 8.5% 2029/5/31	127,068	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.25% 2021/7/15	70,478
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2025/1/1	119,234	Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2026/7/25	67,713
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2029/1/1	113,201	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	65,576
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	107,487	Poland Government Bond (ポーランド) 2% 2021/4/25	58,527
Czech Republic Government Bond (チェコ) 2% 2033/10/13	101,786	BONOS TESORERIA PESOS (チリ) 4.5% 2021/3/1	55,623
Russian Federal Bond - OFZ (ロシア) 7.65% 2030/4/10	94,252	Poland Government Bond (ポーランド) 5.25% 2020/10/25	51,162

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国(外貨建)公社債(通貨別)

作 成 期	当 期				末				
	区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下組入率	残存期間別組入比率		
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
		千トルコ・リラ	千トルコ・リラ	千円	%	%	%	%	%
トルコ		28,580	28,123	441,257	2.8	2.8	0.9	1.3	0.6
		千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ						
メキシコ		275,400	311,333	1,497,514	9.4	—	5.7	2.4	1.3
		千フィリピン・ペソ	千フィリピン・ペソ						
フィリピン		10,000	12,342	26,782	0.2	—	0.2	—	—
		千チリ・ペソ	千チリ・ペソ						
チリ		2,190,000	2,719,102	364,631	2.3	—	2.1	0.2	—
		千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ						
コロンビア		27,720,000	30,534,012	900,753	5.7	—	4.0	0.8	0.9
		千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア						
インドネシア		185,839,000	192,457,049	1,424,182	8.9	—	6.4	2.1	0.5
		千ブラジル・リアル	千ブラジル・リアル						
ブラジル		68,150	71,034	1,438,452	9.0	—	2.0	5.5	1.6
		千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ						
チェコ		150,500	162,413	737,355	4.6	—	3.5	0.9	0.2
		千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ						
ルーマニア		16,570	17,200	431,213	2.7	—	1.2	1.1	0.4
		千オフショア・人民元	千オフショア・人民元						
中国		40,700	41,219	627,778	3.9	—	2.7	1.3	—
		千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル						
ロシア		821,630	896,691	1,362,970	8.6	—	5.1	2.6	0.8
		千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット						
マレーシア		38,580	41,407	1,040,981	6.5	—	4.2	1.6	0.7
		千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド						
南アフリカ		205,190	177,883	1,124,223	7.1	—	6.5	0.6	—
		千タイ・バーツ	千タイ・バーツ						
タイ		363,860	411,245	1,422,911	8.9	—	5.9	2.0	1.1

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
ペルー	千ペルー・ソル 15,050	千ペルー・ソル 17,558	千円 533,778	3.4 %	— %	3.2 %	0.2 %	— %
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 41,440	千ポーランド・ズロチ 45,533	1,236,688	7.8	—	4.1	2.7	0.9
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 1,459,800	千ハンガリー・フォリント 1,621,001	555,030	3.5	—	1.4	1.6	0.5
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 8,100	千ウルグアイ・ペソ 7,851	19,786	0.1	—	0.0	—	0.1
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 9,927	18,167	0.1	0.1	0.1	—	—
合計	—	—	15,204,460	95.5	2.9	59.0	26.8	9.6

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	未		償 還 年 月 日
					評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	9.5000	千トルコ・リラ 1,660	千トルコ・リラ 1,657	千円 26,002	2022/01/12
	Turkey Government Bond	国債証券	8.5000	790	770	12,083	2022/09/14
	Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	2,780	2,575	40,401	2023/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	683	10,717	2024/03/20
	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	1,630	1,552	24,365	2024/07/24
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	2,690	2,430	38,128	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	2,570	2,487	39,024	2026/02/11
	Turkey Government Bond	国債証券	9.2000	2,010	2,000	31,382	2021/09/22
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,400	2,460	38,597	2022/03/02
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,859	44,866	2027/02/24
	Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	1,900	1,930	30,284	2022/08/17
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	1,700	1,608	25,241	2027/08/11
	Turkey Government Bond	国債証券	12.2000	1,400	1,455	22,836	2023/01/18
	Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	2,000	2,057	32,282	2028/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	16.2000	1,400	1,596	25,043	2023/06/14
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		28,580	28,123	441,257	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 18,900	千メキシコ・ペソ 19,522	93,905	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	17,500	19,907	95,754	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	7.2500	10,000	10,355	49,808	2021/12/09
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	22,000	24,724	118,923	2024/09/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	22,750	25,148	120,962	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	24,150	29,159	140,258	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	30,230	33,925	163,182	2027/06/03

ダイワ新興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	
			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円		
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	10,066	48,420	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	30,730	36,703	176,545	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	14,100	16,997	81,758	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	17,950	20,514	98,676	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	31,450	32,523	156,439	2022/06/09	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	17,820	19,841	95,437	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,430	11,942	57,442	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金 額			275,400	311,333	1,497,514		
フィリピン	Philippine Government International Bond	国債証券	6.2500	千フィリピン・ペソ	千フィリピン・ペソ			
				10,000	12,342	26,782	2036/01/14	
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金 額			10,000	12,342	26,782		
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ	千チリ・ペソ			
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	550,000	643,791	86,332	2026/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	570,000	706,537	94,746	2035/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	410,000	601,412	80,649	2043/01/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	410,000	493,422	66,167	2030/09/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.0000	250,000	273,937	36,735	2023/03/01	
通貨小計	銘柄数	5銘柄						
	金 額			2,190,000	2,719,102	364,631		
コロンビア	Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ			
	Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	90,000	114,263	3,370	2027/06/28	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	45,000	45,253	1,334	2023/03/21	
	Colombian TES	国債証券	10.0000	4,335,000	4,640,270	136,887	2022/05/04	
	Colombian TES	国債証券	10.0000	3,650,000	4,519,466	133,324	2024/07/24	
	Colombian TES	国債証券	6.0000	5,090,000	5,244,430	154,710	2028/04/28	
	Colombian TES	国債証券	7.5000	4,310,000	4,985,075	147,059	2026/08/26	
	Colombian TES	国債証券	7.7500	2,700,000	2,995,785	88,375	2030/09/18	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	3,000,000	3,139,380	92,611	2032/06/30	
	Colombian TES	国債証券	6.2500	2,300,000	2,519,650	74,329	2025/11/26	
	Colombian TES	国債証券	7.2500	2,200,000	2,330,438	68,747	2034/10/18	
通貨小計	銘柄数	10銘柄						
	金 額			27,720,000	30,534,012	900,753		
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア			
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	8,250,000	8,638,162	63,922	2036/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	6,000,000	6,508,440	48,162	2031/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	5,441,315	40,265	2032/08/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,202,618	53,299	2038/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	10,571,200	78,226	2024/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	5,000,000	5,283,150	39,095	2039/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	12,000,000	12,793,920	94,675	2029/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	8,100,000	7,987,167	59,105	2030/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	9,000,000	8,995,770	66,568	2025/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	6,100,000	6,041,562	44,707	2035/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	3,600,000	4,268,628	31,587	2025/09/15	

		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	
			%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	2,180,000	2,665,050	19,721	2030/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,386,542	25,060	2031/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	10,224,000	11,039,261	81,690	2026/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	4,972,300	36,795	2032/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	10,330,000	10,368,737	76,728	2027/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	11,060,000	11,385,053	84,249	2022/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	10,910,000	10,789,771	79,844	2023/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	8,700,000	8,153,988	60,339	2028/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	7,075,000	6,480,417	47,955	2033/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,520,000	13,190,446	97,609	2034/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	13,150,000	13,965,694	103,346	2024/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	11,120,000	12,327,854	91,226	2029/03/15
通貨小計	銘柄数 金 額	23銘柄		185,839,000	192,457,049	1,424,182	
				千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル		
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	13,310	15,134	306,482	2023/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	9,490	11,171	226,225	2025/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	7,250	8,689	175,960	2027/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	5,100	6,221	125,987	2029/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	500	620	12,562	2031/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	7,200	6,897	139,679	2022/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	6,100	5,695	115,340	2022/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	12,700	11,121	225,205	2023/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	6,500	5,481	111,008	2024/01/01
通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄		68,150	71,034	1,438,452	
				千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ		
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	3.8500	8,200	8,588	38,990	2021/09/29
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	12,600	14,381	65,289	2028/08/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	8,600	10,407	47,248	2024/05/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	10,200	11,240	51,031	2022/09/12
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	16,100	17,591	79,866	2025/09/17
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	17,900	18,313	83,144	2026/06/26
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	12,000	12,160	55,207	2030/05/15
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	9,900	9,947	45,162	2023/10/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	13,000	12,668	57,516	2027/02/10
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	12,000	14,105	64,037	2029/07/23
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	20,000	22,640	102,785	2033/10/13
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	10,000	10,368	47,074	2031/03/13
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄		150,500	162,413	737,355	
				千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ		
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	5.8500	1,430	1,520	38,125	2023/04/26
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,204	30,204	2025/02/24
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,100	2,365	59,301	2027/07/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.5000	1,090	1,092	27,385	2022/12/19

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

		当 期			末			
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ	千円		
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,600	1,584	39,728	2024/04/29	
	Romania Government Bond	国債証券	3.4000	1,700	1,702	42,674	2022/03/08	
	Romania Government Bond	国債証券	4.2500	1,500	1,532	38,420	2023/06/28	
	Romania Government Bond	国債証券	4.0000	1,000	1,010	25,328	2021/10/27	
	Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,798	70,158	2029/02/12	
	Romania Government Bond	国債証券	4.8500	1,000	1,057	26,518	2026/04/22	
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,400	1,330	33,366	2031/09/24	
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金 額			16,570	17,200	431,213		
中国				千オフショア・人民元	千オフショア・人民元			
	China Government Bond	国債証券	3.2900	1,800	1,846	28,123	2023/10/18	
	China Government Bond	国債証券	3.2200	2,100	2,148	32,722	2025/12/06	
	China Government Bond	国債証券	3.2500	1,800	1,836	27,968	2028/11/22	
	China Government Bond	国債証券	3.1900	2,700	2,769	42,173	2024/04/11	
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,400	5,540	84,377	2029/05/23	
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,914	74,851	2026/06/06	
	China Government Bond	国債証券	3.1200	4,500	4,570	69,607	2026/12/05	
	China Government Bond	国債証券	3.1300	4,500	4,577	69,719	2029/11/21	
	China Government Bond	国債証券	2.9400	4,500	4,577	69,710	2024/10/17	
	China Government Bond	国債証券	2.8500	1,600	1,598	24,349	2027/06/04	
	China Government Bond	国債証券	2.6800	3,000	2,945	44,852	2030/05/21	
	China Government Bond	国債証券	1.9900	4,000	3,894	59,320	2025/04/09	
通貨小計	銘柄数	12銘柄						
	金 額			40,700	41,219	627,778		
ロシア				千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル			
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	31,760	36,394	55,319	2027/02/03	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	32,910	34,905	53,056	2022/07/20	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	14,400	15,196	23,098	2023/01/25	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	46,160	50,137	76,209	2028/01/19	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	24,300	25,896	39,362	2023/08/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.5000	29,300	30,285	46,034	2021/08/18	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	31,000	37,266	56,645	2031/09/17	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	43,100	48,358	73,505	2026/09/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	59,000	62,730	95,350	2022/12/07	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	45,100	51,187	77,804	2033/03/23	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	35,600	38,290	58,201	2024/10/16	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	49,000	50,732	77,112	2021/12/15	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	38,000	39,936	60,702	2024/02/28	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.2500	45,000	49,457	75,175	2034/05/10	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.9000	51,000	54,728	83,187	2029/05/23	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.9500	51,000	57,751	87,782	2026/10/07	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	55,000	59,688	90,726	2024/07/17	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1500	35,000	37,899	57,607	2025/11/12	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6500	40,000	44,970	68,354	2030/04/10	

区 分		当 期			未			償還年月日	
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額			
				%	千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル	千円		
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	33,000	38,182	58,037	2039/03/16	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.0000	32,000	32,693	49,694	2027/10/06	
通貨小計	銘柄数	21銘柄							
	金 額				821,630	896,691	1,362,970		
マレーシア	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.9480	3,400	3,507	88,174	2022/04/14		
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,978	49,750	2027/07/26		
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0940	2,000	2,117	53,226	2023/11/30		
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	1,700	1,888	47,478	2028/10/31		
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	2,600	2,847	71,586	2029/07/09		
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.6550	1,700	1,788	44,973	2024/10/15		
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	1,400	1,488	37,427	2026/03/31		
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	1,500	1,584	39,844	2030/10/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	2,350	2,505	62,977	2028/06/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,869	46,991	2024/07/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,850	1,991	50,053	2025/09/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,400	1,463	36,782	2023/08/17		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	3,000	3,232	81,255	2026/11/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	1,200	1,226	30,838	2021/11/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,420	1,520	38,230	2024/09/30		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	2,120	2,285	57,460	2027/11/16		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	2,600	2,984	75,026	2037/04/07		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,457	36,648	2023/04/20		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	2,000	2,149	54,034	2026/07/15		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,400	1,520	38,217	2029/08/15		
	通貨小計	銘柄数	20銘柄						
	金 額				38,580	41,407	1,040,981		
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	30,050	34,216	216,247	2026/12/21		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	11,220	7,329	46,322	2036/03/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	9,880	6,201	39,194	2041/02/28		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	15,940	12,980	82,038	2031/02/28		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	13,880	14,822	93,676	2023/02/28		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	29,520	22,875	144,574	2048/02/28		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	14,500	11,471	72,500	2037/01/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	22,900	20,912	132,169	2030/01/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	16,600	12,856	81,254	2044/01/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	15,300	13,114	82,884	2032/03/31		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	14,100	11,941	75,471	2035/02/28		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	11,300	9,159	57,889	2040/01/31		
	通貨小計	銘柄数	12銘柄						
		金 額				205,190	177,883	1,124,223	
タイ	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	26,050	33,848	117,115	2029/06/22		
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	23,300	25,380	87,817	2023/06/16		
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	22,610	26,100	90,307	2025/12/12		

ダイワ新興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	
			%	千タイ・パーツ	千タイ・パーツ	千円		
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	30,600	32,020	110,791	2021/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	22,700	27,530	95,254	2031/06/20	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.8750	17,200	17,668	61,131	2022/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	16,600	20,467	70,817	2036/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	24,900	26,602	92,044	2026/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	20,000	20,720	71,691	2022/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	29,000	36,011	124,599	2032/06/25	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	24,900	29,262	101,247	2046/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.4000	22,000	23,341	80,761	2023/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	20,000	22,572	78,099	2028/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	21,000	25,837	89,398	2038/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.4500	22,000	22,623	78,278	2024/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	9,000	9,267	32,065	2029/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	12,000	11,991	41,489	2035/06/17	
通貨小計	銘柄数	17銘柄						
	金 額			363,860	411,245	1,422,911		
				千ペルー・ソル	千ペルー・ソル			
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	5.7000	730	848	25,790	2024/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	1,970	2,331	70,879	2028/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.1500	1,850	2,113	64,255	2032/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.9400	1,900	2,191	66,635	2029/02/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.4000	1,250	1,314	39,955	2034/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.3500	1,400	1,407	42,790	2040/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	1,965	2,539	77,213	2026/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	2,065	2,476	75,280	2037/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	1,920	2,334	70,977	2031/08/12	
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金 額			15,050	17,558	533,778		
				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ			
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	3,610	4,060	110,282	2022/09/23	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,740	4,086	110,980	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,640	3,982	108,175	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,200	3,325	90,313	2022/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,000	3,176	86,279	2023/01/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,500	5,940	161,346	2024/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	5,450	6,157	167,250	2029/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	1,820	1,955	53,122	2021/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,530	2,835	77,023	2023/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	5,400	6,015	163,391	2028/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	3,550	3,995	108,523	2025/07/25	
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金 額			41,440	45,533	1,236,688		
				千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント			
ハンガリー	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	98,500	105,946	36,276	2024/06/26	
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	170,000	185,087	63,373	2027/10/27	
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	89,000	91,519	31,336	2021/10/27	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額			償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額	
					千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント		
	Hungary Government Bond	国債証券	1.7500	140,000	143,182	49,025	2022/10/26	
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000	139,685	47,828	2026/12/22	
	Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	88,000	120,718	41,333	2028/10/22	
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	120,000	128,558	44,018	2030/08/21	
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	160,000	169,182	57,928	2024/10/24	
	Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	65,000	71,194	24,376	2031/10/22	
	Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	131,800	153,673	52,617	2023/11/24	
	Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	125,000	140,668	48,164	2022/06/24	
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	142,500	171,584	58,750	2025/06/24	
通貨小計	銘柄数	12銘柄						
	金 額			1,459,800	1,621,001	555,030		
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond	国債証券	9.8750	5,300	5,289	13,329	2022/06/20	
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	2,800	2,562	6,457	2028/03/15	
通貨小計	銘柄数	2銘柄						
	金 額			8,100	7,851	19,786		
ドミニカ共和国	Dominican Republic International Bond	国債証券	9.7500	11,000	9,927	18,167	2026/06/05	
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金 額			11,000	9,927	18,167		
合 計	銘柄数	217銘柄						
	金 額					15,204,460		

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年7月6日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	15,204,460	95.0
コール・ローン等、その他	794,810	5.0
投資信託財産総額	15,999,270	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月6日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=107.65円、1トルコ・リラ=15.69円、1メキシコ・ペソ=4.81円、1フィリピン・ペソ=2.17円、1アルゼンチン・ペソ=1.52円、100チリ・ペソ=13.41円、100コロンビア・ペソ=2.95円、100インドネシア・ルピア=0.74円、1ブラジル・レアル=20.25円、1チェコ・コルナ=4.54円、1ルーマニア・レイ=25.07円、1オフショア・人民元=15.23円、1ロシア・ルーブル=1.52円、1マレーシア・リンギット=25.14円、1南アフリカ・ランド=6.32円、1タイ・バーツ=3.46円、1ペルー・ソル=30.40円、1ポーランド・ズロチ=27.16円、100ハンガリー・フォリント=34.24円、1ウルグアイ・ペソ=2.52円、1ドミニカ・ペソ=1.83円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(15,718,458千円)の投資信託財産総額(15,999,270千円)に対する比率は、98.2%です。

ダイワ新興国債券インデックス・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7月6日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	16,234,609,781円
コール・ローン等	576,230,846
公社債（評価額）	15,204,460,582
未収入金	243,168,944
未収利息	193,911,880
前払費用	16,837,529
(B) 負債	309,390,371
未払金	288,857,058
未払解約金	20,526,161
その他未払費用	7,152
(C) 純資産総額（A－B）	15,925,219,410
元本	11,831,677,635
次期繰越損益金	4,093,541,775
(D) 受益権総口数	11,831,677,635口
1万口当り基準価額（C／D）	13,460円

*期首における元本額は9,423,800,647円、当作成期間中における追加設定元本額は3,467,075,255円、同解約元本額は1,059,198,267円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、新興国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）55,786,582円、ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）255,895,312円、ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）353,072,397円、D-1's 新興国債券インデックス54,311,180円、iFree 新興国債券インデックス2,854,911,762円、iFree 8資産バランス1,912,727,809円、DCダイワ新興国債券インデックスファンド6,133,418,719円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券173,893,569円、ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド37,660,305円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は13,460円です。

■損益の状況

当期 自 2019年7月6日 至 2020年7月6日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	757,470,572円
受取利息	757,573,046
支払利息	△ 102,474
(B) 有価証券売買損益	△ 1,322,317,061
売買益	594,453,788
売買損	△ 1,916,770,849
(C) その他費用	△ 18,122,115
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 582,968,604
(E) 前期繰越損益金	3,735,990,237
(F) 解約差損益金	△ 328,483,412
(G) 追加信託差損益金	1,269,003,554
(H) 合計（D＋E＋F＋G）	4,093,541,775
次期繰越損益金（H）	4,093,541,775

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

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

ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス

運用報告書（全体版） 第4期

（決算日 2020年11月30日）

（作成対象期間 2019年12月3日～2020年11月30日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果を東証REIT指数（配当込み）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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行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 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 中 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 中 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2017年11月30日)	9,372	0	△ 6.3	3,189.89	△ 6.1	98.0	1.6	564
2 期末 (2018年11月30日)	10,585	0	12.9	3,610.49	13.2	98.2	1.5	1,027
3 期末 (2019年12月 2 日)	13,333	0	26.0	4,562.74	26.4	98.1	1.8	1,183
4 期末 (2020年11月30日)	10,596	0	△20.5	3,635.82	△20.3	97.5	2.4	1,177

(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。

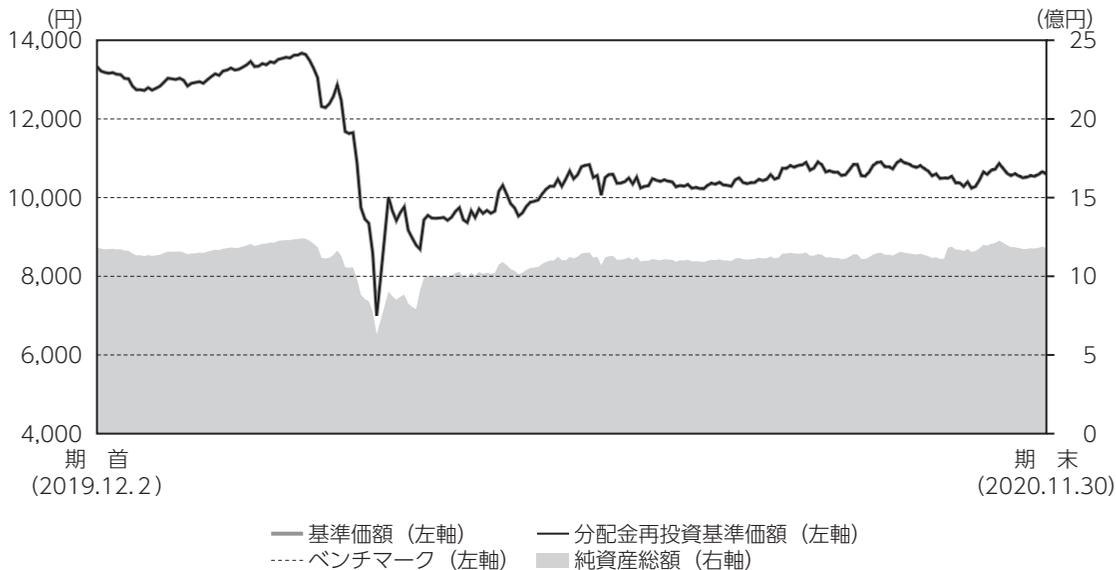
(注3) 投資信託証券および不動産投信指数先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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：13,333円

期末：10,596円（分配金0円）

騰落率：△20.5%（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、世界的な新型コロナウイルスの感染拡大による景気減速懸念などを背景に、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス

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
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2019年12月2日	13,333	% -	4,562.74	% -	% 98.1	% 1.8
12月末	13,002	△ 2.5	4,450.34	△ 2.5	98.2	1.7
2020年1月末	13,461	1.0	4,608.85	1.0	98.0	1.7
2月末	12,317	△ 7.6	4,218.40	△ 7.5	98.1	1.8
3月末	9,764	△26.8	3,343.59	△26.7	97.1	2.8
4月末	9,674	△27.4	3,313.25	△27.4	97.2	2.8
5月末	10,467	△21.5	3,586.37	△21.4	97.2	2.8
6月末	10,285	△22.9	3,525.99	△22.7	97.4	2.6
7月末	10,311	△22.7	3,535.10	△22.5	97.4	2.5
8月末	10,892	△18.3	3,735.15	△18.1	97.3	2.5
9月末	10,784	△19.1	3,698.94	△18.9	97.5	2.5
10月末	10,239	△23.2	3,512.43	△23.0	97.5	2.4
(期末) 2020年11月30日	10,596	△20.5	3,635.82	△20.3	97.5	2.4

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2019.12.3～2020.11.30)

■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、長期金利の上昇の落ち着いたきとともに相対的に高い配当利回りに注目が集まり、上昇しました。しかし2020年2月以降は、世界的な新型コロナウイルスの感染拡大による景気減速懸念により、投資家がリスク回避姿勢を強める中で、国内リート市場は下落に転じました。3月には、金融機関による3月末の決算対策や減損回避などの目的でロスカット（強制損切り）の売りが膨らんだことから、急落しました。5月は、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、経済活動正常化への期待もあり、上昇しました。その後、10月に過去最大規模の公募増資が発表されると需給悪化懸念から下落に転じましたが、11月には米国大統領選挙および連邦議会選挙の結果や、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展によるリスク選好の中で、上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「ダイワJ-R E I T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-R E I T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R E I T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

(2019.12.3～2020.11.30)

■当ファンド

国内リートへの投資は、「ダイワJ-R E I Tマザーファンド」の受益証券を組み入れることによつて行いました。

■ダイワJ-R E I Tマザーファンド

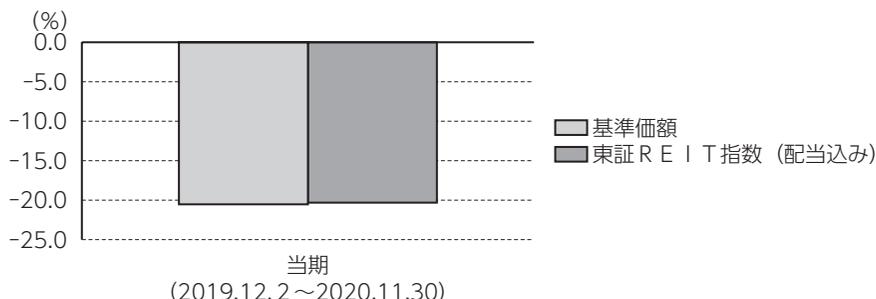
ベンチマークの動きを反映した投資成果をめざして、おおむね時価総額構成比に基づいたポートフォリオを構築しました。リート実質組入比率（不動産投信指数先物を含む。）については、当作成期を通じて99～100%程度としました。

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△20.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△20.5%となりました。

ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との違い、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

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

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2019年12月3日 ～2020年11月30日	
当期分配金 (税込み) (円)	—	
対基準価額比率 (%)	—	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	3,425	

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

■ダイワJ-REITマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2019.12.3~2020.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	25円	0.230%	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11,010円です。
(投 信 会 社)	(17)	(0.153)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(6)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.003	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(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	0.005	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	26	0.238	

(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。

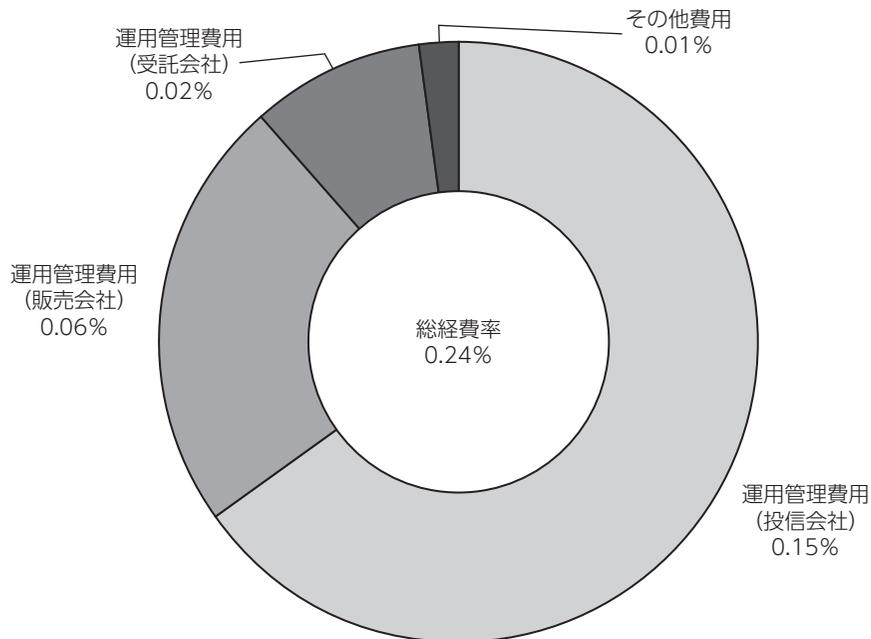
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.24%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12月3日から2020年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワJ-REIT マザーファンド	140,035	356,342	53,193	145,633

(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12月3日から2020年11月30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
投資信託証券	百万円 139,212	百万円 2,673	% 1.9	百万円 61,123	百万円 8,799	% 14.4
不動産投信指数 先物取引	56,955	8,958	15.7	53,447	8,815	16.5
コール・ローン	1,462,516	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合0.3%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2019年12月3日から2020年11月30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	3,331	1,985	10,307

(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つて発行される有価証券

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

種 類	当 期
	ダイワJ-REITマザーファンド 買 付 額
投資信託証券	百万円 5,356

(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12月3日から2020年11月30日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	30千円
うち利害関係人への支払額 (B)	11千円
(B) / (A)	39.4%

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

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

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワJ-REITマザーファンド	349,695	436,537	1,176,557

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワJ-REITマザーファンド	1,176,557	99.3
コール・ローン等、その他	8,573	0.7
投資信託財産総額	1,185,130	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,185,130,028円
コール・ローン等	2,943,024
ダイワJ-REITマザーファンド(評価額)	1,176,557,004
未収入金	5,630,000
(B) 負債	7,976,583
未払解約金	6,651,910
未払信託報酬	1,293,951
その他未払費用	30,722
(C) 純資産総額(A - B)	1,177,153,445
元本	1,110,904,033
次期繰越損益金	66,249,412
(D) 受益権総口数	1,110,904,033口
1万口当り基準価額(C / D)	10,596円

*期首における元本額は887,949,644円、当作成期間中における追加設定元本額は494,302,320円、同解約元本額は271,347,931円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,596円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月3日 至2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 916円
受取利息	129
支払利息	△ 1,045
(B) 有価証券売買損益	△171,954,225
売買益	42,844,158
売買損	△214,798,383
(C) 信託報酬等	△ 2,598,931
(D) 当期繰越損益金(A + B + C)	△174,554,072
(E) 前期繰越損益金	215,393,410
(F) 追加信託差損益金	25,410,074
(配当等相当額)	(165,112,341)
(売買損益相当額)	(△139,702,267)
(G) 合計(D + E + F)	66,249,412
次期繰越損益金(G)	66,249,412
追加信託差損益金	25,410,074
(配当等相当額)	(165,112,341)
(売買損益相当額)	(△139,702,267)
分配準備積立金	215,394,846
繰越損益金	△174,555,508

(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	165,112,341
(d) 分配準備積立金	215,394,846
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	380,507,187
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	380,507,187
(h) 受益権総口数	1,110,904,033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。

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップオンライン Ｊ－ＲＥＩＴインデックス）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の決算日（2020年9月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2020年11月30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12月3日から2020年11月30日まで）

買				付				売				付			
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	柄	口数	金額	平均単価	
		千口	千円	円			千口	千円	円			千口	千円	円	
日本ビルファンド		18.553	12,043,892	649,161	日本ビルファンド		6.167	4,156,450	673,982	日本ビルファンド		6.167	4,156,450	673,982	
ジャパンリアルエステイト		13.007	8,171,364	628,228	ジャパンリアルエステイト		6.619	4,048,669	611,673	ジャパンリアルエステイト		6.619	4,048,669	611,673	
ＧＬＰ投資法人		48.052	7,357,368	153,112	野村不動産マスターＦ		21.14	2,989,064	141,393	野村不動産マスターＦ		21.14	2,989,064	141,393	
野村不動産マスターＦ		45.607	6,871,641	150,670	日本プロロジスリート		9.706	2,980,829	307,112	日本プロロジスリート		9.706	2,980,829	307,112	
日本プロロジスリート		21.898	6,796,521	310,371	ＧＬＰ投資法人		16.956	2,422,494	142,869	ＧＬＰ投資法人		16.956	2,422,494	142,869	
大和ハウスリート投資法人		20.513	5,523,680	269,277	ユナイテッド・アーバン投資法人		18.709	2,342,903	125,228	ユナイテッド・アーバン投資法人		18.709	2,342,903	125,228	
オリックス不動産投資		25.916	4,486,304	173,109	大和ハウスリート投資法人		8.798	2,285,538	259,779	大和ハウスリート投資法人		8.798	2,285,538	259,779	
産業ファンド		23.718	4,087,568	172,340	オリックス不動産投資		13.189	2,165,440	164,185	オリックス不動産投資		13.189	2,165,440	164,185	
日本リテールファンド		24.128	4,077,712	169,003	日本リテールファンド		12.497	2,010,125	160,848	日本リテールファンド		12.497	2,010,125	160,848	
ユナイテッド・アーバン投資法人		28.84	4,010,592	139,063	アドバンス・レジデンス		6.228	1,929,500	309,810	アドバンス・レジデンス		6.228	1,929,500	309,810	

(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11月30日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（134,869,045千口）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11月30日現在		
	口数	評価額	比率
不動産投信	千口	千円	%
エスコンジャパンリート	6.451	728,963	0.2
サンケイリアルエステート	9.659	943,684	0.3
ＳＯＳＩＬＡ物流リート投	8.794	1,095,732	0.3
日本アコモデーションファンド投資法人	13.117	7,568,509	2.1
MCUBS MidCity投資法人	48.3	3,984,750	1.1
森ヒルズリート	46.369	6,394,285	1.8
産業ファンド	55.798	9,820,448	2.7
アドバンス・レジデンス	37.495	11,304,742	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	25.752	4,586,431	1.3
ＡＰＩ投資法人	19.78	7,714,200	2.1
ＧＬＰ投資法人	113.502	17,921,965	4.9
コンフォリア・レジデンシャル	17.225	4,983,192	1.4
日本プロロジスリート	59.729	19,561,247	5.4
星野リゾート・リート	6.006	3,003,000	0.8
Oneリート投資法人	6.153	1,509,330	0.4

ファンド名	2020年11月30日現在		
	口数	評価額	比率
イオンリート投資	40.038	4,888,639	1.3
ヒューリックリート投資法	31.78	4,506,404	1.2
日本リート投資法人	12.822	4,494,111	1.2
インバスコ・オフィス・Jリート	253.601	3,489,549	1.0
積水ハウス・リート投資	116.103	8,661,283	2.4
トーセイ・リート投資法人	8.733	937,924	0.3
ケネディクス商業リート	14.515	3,357,319	0.9
ヘルスケア&メディカル投資	8.419	1,077,632	0.3
サムティ・レジデンシャル	7.599	803,214	0.2
野村不動産マスターＦ	127.65	17,360,400	4.8
いちごホテルリート投資	6.903	484,590	0.1
ラサールロジポート投資	43.989	6,871,081	1.9
スターアジア不動産投	40.558	1,950,839	0.5
マリモ地方創生リート	3.698	421,572	0.1
三井不ロジパーク	13.777	6,833,392	1.9

ファンド名	2020年11月30日現在		
	口数	評価額	比率
	千口	千円	%
大江戸温泉リート	6.371	436,413	0.1
投資法人みらい	42.632	1,639,200	0.5
森トラスト・ホテルリート投	8.549	986,554	0.3
三菱地所物流ＲＥＩＴ	8.882	3,539,477	1.0
ＣＲＥロジスティクスファンド	10.772	1,683,663	0.5
ザイマックス・リート	6.048	552,182	0.2
タカラレーベン不動産投	11.862	1,062,835	0.3
伊藤忠アドバンスロジ	15.311	1,965,932	0.5
日本ビルファンド	44.426	25,633,802	7.1
ジャパンリアルエステイト	39.474	21,394,908	5.9
日本リテールファンド	74.163	12,348,139	3.4
オリックス不動産投資	78.651	12,269,556	3.4
日本プライムリアルティ	24.576	7,532,544	2.1
プレミア投資法人	35.654	4,264,218	1.2
東急リアル・エステート	26.466	4,020,185	1.1
グローバル・ワン不動産投資法人	27.411	2,752,064	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人	84.42	9,961,560	2.7
森トラスト総合リート	28.212	3,549,069	1.0
インヴィンシブル投資法人	165.054	5,108,421	1.4
フロンティア不動産投資	13.1	4,912,500	1.4
平和不動産リート	24.221	2,829,012	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	25.792	7,608,640	2.1
福岡リート投資法人	20.415	2,835,643	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人	12.211	8,083,682	2.2
いちごオフィスリート投資法人	32.749	2,298,979	0.6
大和証券オフィス投資法人	8.41	5,037,590	1.4
阪急阪神リート投資法人	17.83	2,148,515	0.6
スタートアップロード投資法人	6.147	1,200,509	0.3
大和ハウスリート投資法人	56.321	14,153,467	3.9
ジャパン・ホテル・リート投資法人	127.163	6,536,178	1.8
大和証券リビング投資法人	49.8	4,467,060	1.2
ジャパンエクセレント投資法人	36.628	4,549,197	1.3
合計	口数、金額 銘柄数<比率>	2,374,036 354,620,139 62銘柄	<97.6%>

(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11月30日現在	
		買建額	売建額
国内		百万円	百万円
	東証ＲＥＩＴ	8,846	-

(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33期（決算日 2020年9月15日）

（作成対象期間 2020年3月17日～2020年9月15日）

ダイワ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。

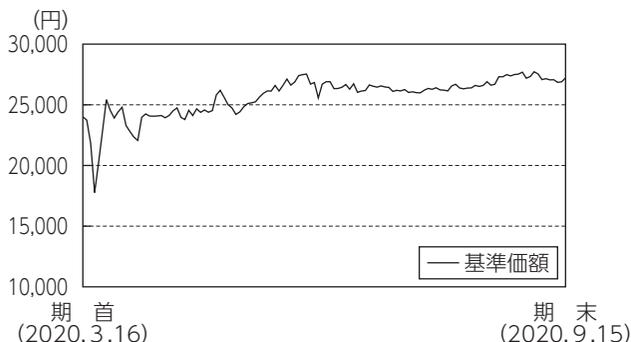
運用方針	東京証券取引所が算出・公表する「東証ＲＥＩＴ指数」（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

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	騰落率	ベンチマーク	騰落率	証券先物	指数先物
	円	%		%	%	%
(期首)2020年3月16日	24,011	-	3,237.59	-	95.0	2.8
3月末	24,796	3.3	3,343.59	3.3	97.2	2.8
4月末	24,571	2.3	3,313.25	2.3	97.2	2.8
5月末	26,591	10.7	3,586.37	10.8	97.2	2.8
6月末	26,134	8.8	3,525.99	8.9	97.4	2.6
7月末	26,206	9.1	3,535.10	9.2	97.4	2.5
8月末	27,688	15.3	3,735.15	15.4	97.4	2.5
(期末)2020年9月15日	27,210	13.3	3,670.48	13.4	96.9	2.5

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：24,011円 期末：27,210円 騰落率：13.3%

【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、経済活動正常化への期待や底堅い決算・業績予想などを背景に国内リート市況が上昇し、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内リート市況

国内リート市況は上昇しました。

国内リート市況は、当作成期首より、金融機関による2020年3月末の決算対策や、減損回避などの目的でロスカット（強制損切り）の売りが膨らんだことから、急落しました。しかし5月には、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、経済活動正常化への期待もあり、国内リート市場は上昇しました。当作成期末にかけては、底堅い内容となった決算・業績予想などを好感し、緩やかに上昇しました。

◆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13.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は13.3%となりました。ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率の違い、先物取引の影響、売買等のコストが控除されたことが差異の要因となりました。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (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。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2020年3月17日から2020年9月15日まで)

	買 付		売 付	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内	471.28295	65,863,154	(194.21705)	(26,746,048)

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2020年3月17日から2020年9月15日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	百万円	百万円	百万円	百万円
不動産投信指数先物取引	25,045	25,266	-	-

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

投資信託証券

(2020年3月17日から2020年9月15日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘	柄	□ 数	金 額	平均単価	銘	柄	□ 数	金 額	平均単価
		千□	千円	円			千□	千円	円
GLP投資法人		31.899	4,961,970	155,552	日本ビルファンド		2.791	1,738,833	623,014
日本ビルファンド		6.655	4,351,829	653,918	ジャパンリアルエステイト		2.882	1,639,430	568,851
ジャパンリアルエステイト		6.872	4,027,176	586,026	日本プロロジスリート		4.1	1,288,087	314,167
日本プロロジスリート		10.425	3,211,357	308,043	野村不動産マスターF		9.095	1,209,076	132,938
野村不動産マスターF		22.186	2,908,309	131,087	ユナイテッド・アーバン投資法人		10.447	1,135,841	108,724
大和ハウスリート投資法人		9.803	2,578,482	263,029	大和ハウスリート投資法人		4.111	1,087,345	264,496
産業ファンド		13.643	2,371,339	173,813	GLP投資法人		7.169	1,075,521	150,023
ラサールロジポート投資		13.304	2,294,002	172,429	日本プライムリアルティ		3.183	941,135	295,675
アドバンス・レジデンス		6.518	2,076,018	318,505	アドバンス・レジデンス		2.68	856,562	319,612
オリックス不動産投資		13.69	1,995,920	145,794	オリックス不動産投資		5.74	821,730	143,158

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

ファンド名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
不動産投信	千口	千円	%
エスコンジャパンリート	6.284	632,798	0.2
サンケイリアルエステート	9.408	868,358	0.2
S O S I L A 物流リート投	8.566	1,159,836	0.3
日本アコモデーションファンド投資法人	12.776	7,857,240	2.2
MCUBS MidCity投資法人	47.045	3,580,124	1.0
森ビルリート	45.166	6,070,310	1.7
産業ファンド	54.347	9,983,543	2.8
アドバンス・レジデンス	36.521	11,376,291	3.2
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	25.084	4,718,300	1.3
A P I 投資法人	19.266	7,629,336	2.1
G L P 投資法人	110.555	18,385,296	5.1
コンフォリア・レジデンシャル	16.778	5,243,125	1.5
日本プロロジスリート	58.177	20,420,127	5.7
星野リゾート・リート	5.85	2,995,200	0.8
Oneリート投資法人	5.993	1,468,884	0.4
イオンリート投資	38.998	4,586,164	1.3
ヒューリックリート投資法	30.954	4,181,885	1.2
日本リート投資法人	12.489	4,283,727	1.2
インベスコ・オフィス・Jリート	247.014	3,433,494	1.0
積水ハウス・リート投資	113.087	8,164,888	2.3
トーセイ・リート投資法人	8.506	909,291	0.3
ケネディクス商業リート	14.138	3,049,566	0.9
ヘルスケア&メディカル投資	8.201	1,021,844	0.3
サムティ・レジデンシャル	7.401	721,597	0.2
野村不動産マスターF	124.335	16,163,550	4.5
いちごホテルリート投資	6.723	465,903	0.1
ラサールロジポート投資	42.847	7,528,217	2.1
スターアジア不動産投	39.5039	1,682,866	0.5
マリモ地方創生リート	3.602	369,565	0.1
三井不ロジパーク	11.017	5,861,044	1.6
大江戸温泉リート	6.206	402,769	0.1
投資法人みらい	41.525	1,561,340	0.4
森トラスト・ホテルリート投	8.327	905,144	0.3
三菱地所物流 R E I T	8.651	3,706,953	1.0
C R E ロジスティクスファンド	10.492	1,546,520	0.4
ザイマックス・リート	5.891	510,160	0.1
タカラレーベン不動産投	11.554	962,448	0.3
伊藤忠アドバンスロジ	12.141	1,657,246	0.5
日本ビルファンド	37.233	23,717,421	6.6
ジャパンリアルエステイト	38.449	22,646,461	6.3
日本リテールファンド	72.668	11,256,273	3.1
オリックス不動産投資	76.609	11,859,073	3.3
日本プライムリアルティ	23.938	7,516,532	2.1

ファンド名	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
プレミアム投資法人	34.728	4,042,339	1.1
東急リアル・エステート	25.778	3,637,275	1.0
グローバル・ワン不動産投資法人	26.699	2,707,278	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人	82.227	9,234,092	2.6
森トラスト総合リート	27.479	3,712,412	1.0
インヴィンシブル投資法人	160.767	4,967,700	1.4
フロンティア不動産投資	12.76	4,459,620	1.2
平和不動産リート	23.944	2,700,883	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	25.122	7,330,599	2.0
福岡リート投資法人	19.885	2,636,751	0.7
ケネディクス・オフィス投資法人	11.894	7,243,446	2.0
いちごオフィスリート投資法人	31.898	2,370,021	0.7
大和証券オフィス投資法人	8.192	4,767,744	1.3
阪急阪神リート投資法人	17.367	2,033,675	0.6
スタートアップロシード投資法人	5.987	1,207,577	0.3
大和ハウスリート投資法人	54.858	14,784,231	4.1
ジャパン・ホテル・リート投資法人	123.86	5,982,438	1.7
大和証券リビング投資法人	48.506	5,301,705	1.5
ジャパンエクセレント投資法人	35.677	4,306,213	1.2
合 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	2,301,9439 346,486,724 62銘柄	<96.9%>

※エスコンジャパンリート、サンケイリアルエステート、S O S I L A 物流リート投、森ビルズリート、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、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、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 R E I T、C R E ロジスティクスファンド、伊藤忠アドバンスロジ、日本プライムリアルティ、フロンティア不動産投資、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、大和証券リビング投資法人につきましては、各ファンドで開示されている直近の有価証券報告書または有価証券届出書において、当社の利害関係人等（投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される法人等を含みます。）である大和証券、大和リアル・エステート・アセット・マネジメントが当該ファンドの運用会社または一般事務受託会社となっています。
 (注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。
 (注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内	百万円	百万円
東証 R E I T	8,951	-

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年9月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託証券	346,486,724	96.7
コール・ローン等、その他	11,763,038	3.3
投資信託財産総額	358,249,763	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年9月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	362,885,875,254円
コール・ローン等	5,846,447,737
投資信託証券(評価額)	346,486,724,240
未収入金	1,548,434,485
未収配当金	4,191,499,792
差入委託証拠金	4,812,769,000
(B) 負債	5,186,966,340
未払金	4,194,000
未払解約金	534,570,000
差入委託証拠金代用有価証券	4,648,175,000
その他未払費用	27,340
(C) 純資産総額(A - B)	357,698,908,914
元本	131,456,354,868
次期繰越損益金	226,242,554,046
(D) 受益権総口数	131,456,354,868口
1万口当り基準価額(C/D)	27,210円

* 期首における元本額は120,918,340,404円、当作成期間中における追加設定元本額は24,751,188,470円、同解約元本額は14,213,174,006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5,730,916,634円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（毎月分配型）115,264,671,031円、ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン（年1回決算型）339,888,168円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 1,229,972円、i F r e e J - R E I T インデックス140,025,135円、i F r e e 8 資産バランス1,029,528,802円、DC・ダイワＪ－ＲＥＩＴオープン5,317,882,980円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 2,477,304円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 4,603,626円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 2,696,936円、ダイワ・ノーロード J - R E I T ファンド101,960,258円、ダイワファンドラップ J - R E I T インデックス1,707,972,273円、ダイワ J - R E I T インデックス（ダイワ S M A 専用）262,363,036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413,120,791円、ダイワ・インデックスセレクト J - R E I T 1,137,017,922円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は27,210円です。

■損益の状況

当期 自2020年3月17日 至2020年9月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	7,129,533,078円
受取配当金	7,104,215,882
受取利息	23,396
その他収益金	26,737,941
支払利息	△ 1,444,141
(B) 有価証券売買損益	31,604,814,900
売買益	36,880,930,687
売買損	△ 5,276,115,787
(C) 先物取引等損益	976,920,130
取引益	1,171,384,050
取引損	△ 194,463,920
(D) その他費用	△ 57,308
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	39,711,210,800
(F) 前期繰越損益金	169,420,427,710
(G) 解約差損益金	△ 21,354,047,994
(H) 追加信託差損益金	38,464,963,530
(I) 合計(E + F + G + H)	226,242,554,046
次期繰越損益金(I)	226,242,554,046

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

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

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス (為替ヘッジあり)

運用報告書 (全体版) 第4期

(決算日 2020年11月30日)

(作成対象期間 2019年12月3日~2020年11月30日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券に投資し、海外リート市場の動きを反映した投資成果をめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

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/不動産投信（リート）	
信託期間	無期限	
運用方針	海外のリート市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行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			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (現地通貨ベース)		投資信託 組入比率	投信証 組入比率	不動産 投信比率	純資産額
	(分配落)	税金 分配	み 金 騰 落 率	(参考指数)	期 騰 落 率				
1期末(2017年11月30日)	円 10,301	円 0	% 3.0	10,550	% 5.5	% 0.3	% 97.6	% 0.5	百万円 451
2期末(2018年11月30日)	10,317	0	0.2	10,866	3.0	0.8	98.9	1.0	767
3期末(2019年12月2日)	11,735	0	13.7	12,751	17.3	2.1	96.5	3.0	839
4期末(2020年11月30日)	10,306	0	△12.2	11,362	△10.9	0.5	97.0	2.5	822

(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。

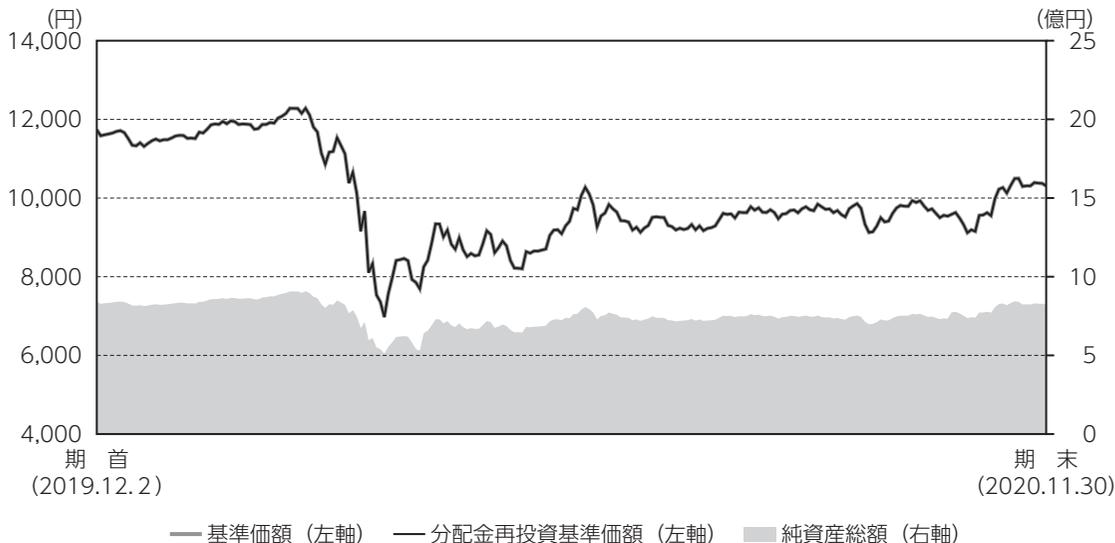
(注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：11,735円

期末：10,306円（分配金0円）

騰落率：△12.2%（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、海外リート市場の下落が主な要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

ダイワ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)

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) (参考指数)		投 資 信 託 組 入 証 比 率	投 信 託 証 組 入 証 比 率	不 動 産 投 信 物 指 数 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期首) 2019年12月2日	円 11,735	% -	12,751	% -	% 2.1	% 96.5	% 3.0
12月末	11,577	△ 1.3	12,608	△ 1.1	1.2	97.4	1.9
2020年1月末	11,867	1.1	12,955	1.6	1.7	96.6	2.1
2月末	11,146	△ 5.0	12,189	△ 4.4	1.6	96.1	2.7
3月末	8,463	△27.9	9,261	△27.4	1.5	95.8	2.9
4月末	9,168	△21.9	10,038	△21.3	0.8	95.5	3.2
5月末	9,194	△21.7	10,062	△21.1	2.1	95.0	3.2
6月末	9,238	△21.3	10,129	△20.6	0.9	96.7	2.5
7月末	9,585	△18.3	10,521	△17.5	0.6	94.7	2.5
8月末	9,777	△16.7	10,736	△15.8	0.5	96.6	2.8
9月末	9,393	△20.0	10,312	△19.1	1.2	95.2	2.9
10月末	9,192	△21.7	10,100	△20.8	0.9	95.2	2.8
(期末) 2020年11月30日	10,306	△12.2	11,362	△10.9	0.5	97.0	2.5

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2019.12.3～2020.11.30)

■海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、長期金利の上昇を背景として米国を中心に上値が重い展開となりました。2020年に入ると、米国の対中追加関税回避や長期金利の低下などが支援材料となり、堅調な推移となりました。しかし2月以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて大幅に下落しました。3月下旬からは、各国の財政金融政策や新型コロナウイルスワクチン開発への期待などから上昇しました。5月以降は、世界的な経済活動の再開期待から堅調な展開となりました。その後9月以降は、感染再拡大やそれに伴うロックダウン（都市封鎖）への懸念などから下落する局面があったものの、11月に入ると、ワクチン開発で高い効果を示す結果が報告され、経済活動再開への期待が高まったことなどから上昇して当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

引き続き「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。また、マザーファンドの保有外貨建資産の当ファンド相当分については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

(2019.12.3～2020.11.30)

■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資を90～110%の範囲で行いました。また、マザーファンド保有外貨建資産の当ファンド相当分については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行いました。なお、マザーファンドの組入比率が100%程度にならないのは、為替の売りヘッジ予約による評価損益が発生する影響が主要因です。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

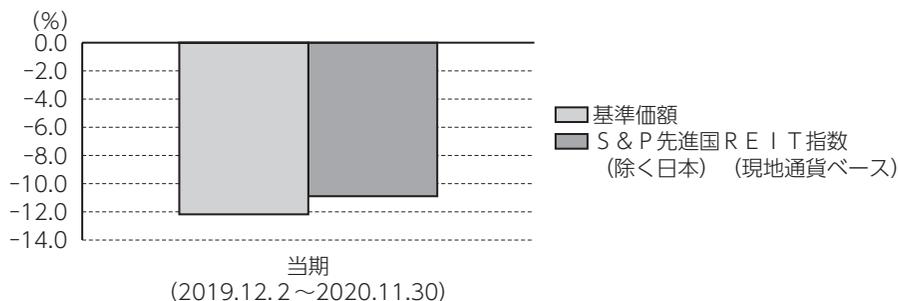
また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物を組み入れました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

マザーファンドについては、配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のズレも、かい離要因としてあげられます。また、為替ヘッジを行う時に、通貨間の金利差等による損益（為替ヘッジコスト）が発生します。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

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

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2019年12月3日 ～2020年11月30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）	1,618

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

引き続き「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

また、マザーファンドの保有外貨建資産の当ファンド相当分については、為替変動リスクを低減するため、為替ヘッジを行います。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2019.12.3~2020.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	32円	0.323%	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9,951円です。
(投 信 会 社)	(24)	(0.246)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(5)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(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	0.021	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)	(0.005)	
(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	2	0.016	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(2)	(0.015)	
そ の 他 費 用	7	0.072	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(4)	(0.039)	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)	(3)	(0.027)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	43	0.431	

(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。

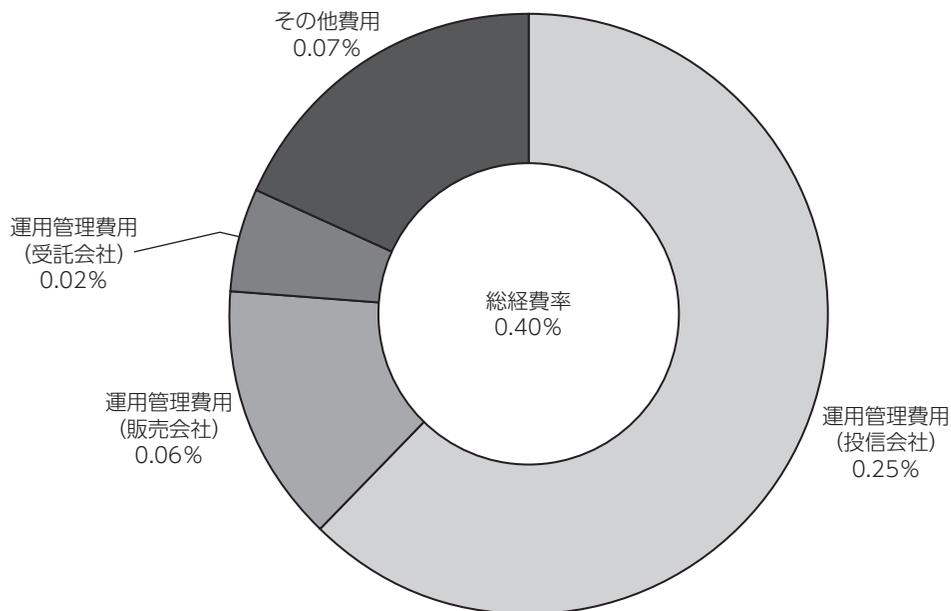
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.40%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12月3日から2020年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	122,314	243,260	78,504	158,760

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	329,451	373,261	822,816

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	822,816	99.2
コール・ローン等、その他	6,802	0.8
投資信託財産総額	829,619	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=103.89円、1カナダ・ドル=79.95円、1オーストラリア・ドル=76.91円、1香港ドル=13.40円、1シンガポール・ドル=77.69円、1ニュージーランド・ドル=73.11円、1イギリス・ポンド=138.55円、1イスラエル・シケル=31.34円、100韓国ウォン=9.42円、1ユーロ=124.38円です。

(注3) 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(28,578,706千円)の投資信託財産総額(28,965,833千円)に対する比率は、98.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,553,640,776円
コール・ローン等	1,744,262
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)	822,816,971
未収入金	729,079,543
(B) 負債	731,231,171
未払金	729,194,994
未払解約金	808,080
未払信託報酬	1,207,720
その他未払費用	20,377
(C) 純資産総額(A-B)	822,409,605
元本	797,988,165
次期繰越損益金	24,421,440
(D) 受益権総口数	797,988,165□
1万口当り基準価額(C/D)	10,306円

* 期首における元本額は715,401,824円、当作成期間中における追加設定元本額は336,517,235円、同解約元本額は253,930,894円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,306円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月3日 至2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 690円
受取利息	134
支払利息	△ 824
(B) 有価証券売買損益	△ 43,885,368
売買益	98,228,415
売買損	△142,113,783
(C) 信託報酬等	△ 2,488,419
(D) 当期繰越損益金(A + B + C)	△ 46,374,477
(E) 前期繰越損益金	73,575,145
(F) 追加信託差損益金	△ 2,779,228
(配当等相当額)	(55,582,892)
(売買損益相当額)	(△ 58,362,120)
(G) 合計(D + E + F)	24,421,440
次期繰越損益金(G)	24,421,440
追加信託差損益金	△ 2,779,228
(配当等相当額)	(55,582,892)
(売買損益相当額)	(△ 58,362,120)
分配準備積立金	73,575,145
繰越損益金	△ 46,374,477

(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	55,582,892
(d) 分配準備積立金	73,575,145
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	129,158,037
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	129,158,037
(h) 受益権総口数	797,988,165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。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

運用報告書 第16期（決算日 2020年11月30日）

（作成対象期間 2019年12月3日～2020年11月30日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

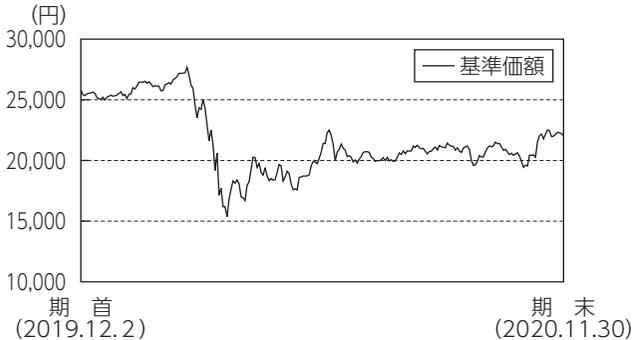
運用方針	S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託先物 比率		不動産 比率	
	円	騰落率 (ベンチマーク)	円	騰落率	投資 比率	先物 比率	不動産 比率	先物 比率
(期首)2019年12月2日	25,842	0	29,879	-	2.0	95.1	2.9	
12月末	25,654	△ 0.7	29,698	△ 0.6	1.2	97.1	1.9	
2020年1月末	26,120	1.1	30,141	0.9	1.7	96.2	2.1	
2月末	24,572	△ 4.9	28,596	△ 4.3	1.6	95.7	2.7	
3月末	18,399	△28.8	21,171	△29.1	1.5	95.7	2.9	
4月末	19,668	△23.9	22,705	△24.0	0.8	96.0	3.2	
5月末	19,882	△23.1	23,018	△23.0	2.1	94.8	3.2	
6月末	20,105	△22.2	23,265	△22.1	0.9	96.6	2.5	
7月末	20,495	△20.7	23,781	△20.4	0.6	96.9	2.5	
8月末	21,131	△18.2	24,446	△18.2	0.5	96.8	2.8	
9月末	20,278	△21.5	23,428	△21.6	1.2	95.9	2.9	
10月末	19,615	△24.1	22,704	△24.0	0.9	96.3	2.8	
(期末)2020年11月30日	22,044	△14.7	25,605	△14.3	0.5	97.0	2.5	

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) S & P 先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) は、S & P 先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。
- (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
- (注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (注5) 不動産投資信託先物比率は買建比率・売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：25,842円 期末：22,044円 騰落率：△14.7%

【基準価額の主な変動要因】

海外リート市場の下落が主な要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、長期金利の上昇を背景として米国を中心に上値が重い展開となりました。2020年に入ると、米国の対中追加関税回避や長期金利の低下などが支援材料となり、堅調な推移となりました。しかし2月以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて大幅に下落しました。3月下旬からは、各国の財政金融政策や新型コロナウイルス治療薬開発への期待などから上昇しました。5月以降は、世界的な経済活動の再開期待から堅調な展開となりました。その後9月以降は、新型コロナウイルスの感染再拡大やそれに伴うロックダウン (都市封鎖) への懸念などから下落する局面があったものの、11月に入ると、ワクチン開発で高い効果を示す結果が報告され、経済活動再開への期待が高まったことなどから上昇して当作成期末を迎えました。

○為替相場

為替相場は、まちまちな動きとなりました。

対円為替相場は、当作成期首より、米中貿易摩擦への懸念が後退したことなどから円安傾向となりました。2020年に入ると、新型コロナウイルスに関する懸念が拡大し、特に2月下旬から3月中旬にかけて大きく円高が進行しました。その後は、大幅な下落に対する反発などから円安となりました。さらにその後も、経済活動の再開期待や世界的な金融緩和の長期化観測から円安傾向が続きました。7月以降は、米中関係の悪化などが材料となって米ドルなどが円高に転じる一方、他の通貨はリスク選好の動きからおおむね円安傾向となりました。9月以降は、新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念などから円高が進行しましたが、当作成期末にかけては、ワクチンに対する期待感から円安となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△14.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△14.7%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。

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

《今後の運用方針》

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

また、運用の効率化を図るため、E T F（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）（「当インデックス」）は S & P Dow Jones Indices LLC（「S P D J I」）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 S P D J I 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、S P D J I、Dow Jones、S & P またはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行なわず、S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	5円
（株式）	（ 0 ）
（先物・オプション）	（ 1 ）
（投資信託受益証券）	（ 1 ）
（投資信託証券）	（ 3 ）
有価証券取引税	3
（株式）	（ 0 ）
（投資信託受益証券）	（ 0 ）
（投資信託証券）	（ 3 ）
その他費用	14
（保管費用）	（ 8 ）
（その他）	（ 6 ）
合 計	22

（注1）費用の項目および算出法については前掲の「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12月3日から2020年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 — (27.78)	千アメリカ・ドル — (8)	百株 — 27.78	千アメリカ・ドル — 9

（注1）金額は受渡し代金。

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

（注3）金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託受益証券

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 510 (-)	千アメリカ・ドル 41,340 (-)	千口 547 (-)	千アメリカ・ドル 44,723 (-)

（注1）金額は受渡し代金。

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

（注3）売付()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

（注4）金額の単位未満は切捨て。

(3) 投資信託証券

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

	買		付		売		付		
	口	数	金	額	口	数	金	額	
外	アメリカ	千口 1,743.4 (△ 17.686)	千アメリカ・ドル 59,233 (32)	千口 388.388 (-)	千アメリカ・ドル 10,376 (-)	千口 388.388 (-)	千アメリカ・ドル 10,376 (-)	千口 388.388 (-)	千アメリカ・ドル 10,376 (-)
	カナダ	千口 149.9 (△ 7.4)	千カナダ・ドル 2,666 (△ 225)	千口 33.9 (-)	千カナダ・ドル 626 (-)	千口 33.9 (-)	千カナダ・ドル 626 (-)	千口 33.9 (-)	千カナダ・ドル 626 (-)
	オーストラリア	千口 2,620.44 (22.073)	千オーストラリア・ドル 9,234 (24)	千口 492.59 (-)	千オーストラリア・ドル 1,812 (-)	千口 492.59 (-)	千オーストラリア・ドル 1,812 (-)	千口 492.59 (-)	千オーストラリア・ドル 1,812 (-)
	香港	千口 435.3 (-)	千香港ドル 11,372 (-)	千口 56.9 (-)	千香港ドル 3,970 (-)	千口 56.9 (-)	千香港ドル 3,970 (-)	千口 56.9 (-)	千香港ドル 3,970 (-)
	シンガポール	千口 3,198.5 (△ 51.578)	千シンガポール・ドル 4,551 (△ 95)	千口 860.7 (-)	千シンガポール・ドル 1,571 (-)	千口 860.7 (-)	千シンガポール・ドル 1,571 (-)	千口 860.7 (-)	千シンガポール・ドル 1,571 (-)
	ニュージーランド	千口 271 (-)	千ニュージーランド・ドル 506 (-)	千口 51.45 (-)	千ニュージーランド・ドル 96 (-)	千口 51.45 (-)	千ニュージーランド・ドル 96 (-)	千口 51.45 (-)	千ニュージーランド・ドル 96 (-)
	イギリス	千口 2,809.82 (273.95)	千イギリス・ポンド 4,643 (△ 189)	千口 1,020.166 (-)	千イギリス・ポンド 860 (-)	千口 1,020.166 (-)	千イギリス・ポンド 860 (-)	千口 1,020.166 (-)	千イギリス・ポンド 860 (-)
	韓国	千口 35.92 (0.546)	千韓国ウォン 176,097 (-)	千口 0.546 (-)	千韓国ウォン 154 (-)	千口 0.546 (-)	千韓国ウォン 154 (-)	千口 0.546 (-)	千韓国ウォン 154 (-)
	ユーロ (アイルランド)	千口 24 (-)	千ユーロ 44 (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)
	ユーロ (オランダ)	千口 1.7 (-)	千ユーロ 34 (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)
国	ユーロ (ベルギー)	千口 19.84 (20.066)	千ユーロ 906 (87)	千口 3.504 (-)	千ユーロ 157 (-)	千口 3.504 (-)	千ユーロ 157 (-)	千口 3.504 (-)	千ユーロ 157 (-)

	買		付		売		付		
	口	数	金	額	口	数	金	額	
外	ユーロ (フランス)	千口 35.65 (-)	千ユーロ 1,566 (△ 30)	千口 13.09 (-)	千ユーロ 595 (-)	千口 13.09 (-)	千ユーロ 595 (-)	千口 13.09 (-)	千ユーロ 595 (-)
	ユーロ (ドイツ)	千口 11.42 (-)	千ユーロ 149 (△ 17)	千口 3.2 (-)	千ユーロ 45 (-)	千口 3.2 (-)	千ユーロ 45 (-)	千口 3.2 (-)	千ユーロ 45 (-)
	ユーロ (スペイン)	千口 27.31 (-)	千ユーロ 250 (△ 1)	千口 12.5 (-)	千ユーロ 101 (-)	千口 12.5 (-)	千ユーロ 101 (-)	千口 12.5 (-)	千ユーロ 101 (-)
	ユーロ (その他)	千口 294.6 (-)	千ユーロ 140 (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)
国	ユーロ (ユーロ 通貨計)	千口 414.52 (20.066)	千ユーロ 3,092 (37)	千口 32.294 (-)	千ユーロ 899 (-)	千口 32.294 (-)	千ユーロ 899 (-)	千口 32.294 (-)	千ユーロ 899 (-)

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

種 類 別	買		建		売		建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	百万円							
不動産投信指数先物取引	4,449	4,476	-	-	-	-	-	-

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

当				期					
買		付		売		付			
銘	柄	口 数	金 額	平均単価	銘	柄	口 数	金 額	平均単価
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)		千口 510	千円 4,437,202	円 8,700	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)		千口 547	千円 4,798,191	円 8,771

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘柄	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)		5.8	412,135	71,057	PROLOGIS INC (アメリカ)		8.6	82,563	9,600
PROLOGIS INC (アメリカ)		41.6	409,870	9,852	EQUINIX INC (アメリカ)		1	73,269	73,269
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		27	398,225	14,749	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT (アメリカ)		4	65,962	16,490
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		23.4	230,370	9,844	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		3.7	57,752	15,608
PUBLIC STORAGE (アメリカ)		9.6	213,646	22,254	LINK REIT (香港)		56.9	54,999	966
WELLTOWER INC (アメリカ)		29.5	196,740	6,669	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)		7.6	51,925	6,832
REALTY INCOME CORP (アメリカ)		26.6	183,110	6,883	PUBLIC STORAGE (アメリカ)		2	41,797	20,898
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT (アメリカ)		10.4	178,357	17,149	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		2.2	39,300	17,863
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)		9.2	173,319	18,839	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES (アメリカ)		5.6	37,182	6,639
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)		23.2	166,803	7,189	WELLTOWER INC (アメリカ)		7.1	37,046	5,217

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

(i) 外国投資信託受益証券

ファンド名	当		期		未
	口数	評価額	評価額	比率	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円		%
VANGUARD REAL ESTATE ETF	17.5	1,485	154,336		0.5

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

(注2) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(ii) 外国投資信託証券

ファンド名	当		期		未
	口数	評価額	評価額	比率	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
不動産ファンド					
(シンガポール)	千口	千アメリカ・ドル	千円		%
MANULIFE US REAL ESTATE INV	320.562	238	24,810		0.1
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	151.4	106	11,088		0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90	12	1,280		0.0
PRIME US REIT	99	76	7,970		0.0
(アメリカ)					
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	29.5	572	59,517		0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13.7	76	7,970		0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	21.982	301	31,309		0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	25.4	374	38,948		0.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC	31.4	5,271	547,616		1.9
SIMON PROPERTY GROUP INC	71.847	6,146	638,561		2.2
BOSTON PROPERTIES INC	31.4	3,216	334,141		1.2
APARTMENT INV & MGMT CO-A	32.467	999	103,820		0.4
VORNADO REALTY TRUST	35.064	1,414	146,914		0.5
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	18	395	41,103		0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13.9	468	48,679		0.2
NEXPOINT RESIDENTIAL	4.8	208	21,662		0.1
QTS REALTY TRUST INC-CL A	13.6	816	84,774		0.3
EQUITY RESIDENTIAL	76.5	4,528	470,497		1.6
APPLE HOSPITALITY REIT INC	43.8	585	60,838		0.2
EPR PROPERTIES	16.1	611	63,559		0.2

ファンド名	当		期		未
	口数	評価額	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		%
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.5	32	3,410		0.0
CITY OFFICE REIT INC	9.3	84	8,772		0.0
GLOBAL NET LEASE INC	19.833	336	34,986		0.1
EQUINIX INC	19.6	13,730	1,426,429		4.9
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	15.529	438	45,511		0.2
CHATHAM LODGING TRUST	7.4	82	8,610		0.0
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	7.1	128	13,299		0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	12.3	799	83,060		0.3
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	25.7	349	36,258		0.1
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4.9	225	23,376		0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	157.6	2,304	239,374		0.8
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	59.008	1,683	174,898		0.6
CORESITE REALTY CORP	9.5	1,188	123,517		0.4
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	34.1	916	95,190		0.3
RLJ LODGING TRUST	35.871	451	46,918		0.2
FARMLAND PARTNERS INC	2.9	23	2,464		0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	46.1	809	84,052		0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1.4	152	15,839		0.1
CYRUSONE INC	25.9	1,812	188,271		0.7
KIMCO REALTY CORP	94.4	1,422	147,794		0.5
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9.8	133	13,887		0.0
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	48.85	1,289	133,929		0.5

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	
WHITESTONE REIT	千口	千アメリカ・ドル	千円	%
GAMING AND LEISURE PROPRTIE	46,349	67	7,029	0.0
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	27.2	443	46,060	0.7
PARK HOTELS & RESORTS INC	51.68	864	89,770	0.2
COLONY CAPITAL INC	105,011	457	47,565	0.2
INVITATION HOMES INC	125,297	3,603	374,371	1.3
JBG SMITH PROPERTIES	25,132	805	83,733	0.3
ALEXANDER & BALDWIN INC	16.5	268	27,855	0.1
CLIPPER REALTY INC	1.4	8	907	0.0
GLADSTONE LAND CORP	4.5	67	6,984	0.0
AMERICOLD REALTY TRUST	45.1	1,533	159,304	0.6
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	14.3	312	32,460	0.1
VICI PROPERTIES INC	118.2	3,035	315,345	1.1
RETAIL VALUE INC	2,815	43	4,494	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	12.5	206	21,414	0.1
BRT APARTMENTS CORP	1.3	17	1,832	0.0
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10.1	165	17,145	0.1
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4.9	768	79,815	0.3
SAFEHOLD INC	3.2	213	22,197	0.1
WASHINGTON PRIME GROUP INC	29.96	31	3,299	0.0
AMERICAN FINANCE TRUST INC	22.4	181	18,849	0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	22.9	478	49,675	0.2
CORECIVIC INC	25.224	193	20,125	0.1
COREPOINT LODGING INC	6.7	45	4,705	0.0
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3.4	45	4,683	0.0
STORE CAPITAL CORP	50.5	1,683	174,864	0.6
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2.4	25	2,690	0.0
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	22.4	203	21,176	0.1
LIFE STORAGE INC	10.4	1,128	117,197	0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	10.1	304	31,667	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	20,082	258	26,830	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	9.2	73	7,684	0.0
PARAMOUNT GROUP INC	36.4	359	37,324	0.1
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29.2	283	29,425	0.1
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	27.4	1,331	138,372	0.5
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	23.7	342	35,603	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	32.5	977	101,529	0.4
VENTAS INC	83,379	3,993	414,921	1.4
CARETRUST REIT INC	21,503	424	44,075	0.2
GEO GROUP INC/THE	27.4	266	27,640	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	64.3	1,037	107,817	0.4
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	10.6	252	26,275	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	44,987	769	79,966	0.3
UMH PROPERTIES INC	8.6	122	12,740	0.0
IRON MOUNTAIN INC	63.8	1,698	176,442	0.6
TERRENO REALTY CORP	15.2	886	92,110	0.3
VEREIT INC	240,908	1,768	183,705	0.6
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22.32	842	87,558	0.3
SUN COMMUNITIES INC	21.8	3,021	313,924	1.1
ACADIA REALTY TRUST	17,011	251	26,084	0.1
ALEXANDER'S INC	0.4	113	11,742	0.0
PROLOGIS INC	163,619	16,460	1,710,036	5.9
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26.2	4,248	441,331	1.5
BRANDYWINE REALTY TRUST	38.3	440	45,718	0.2
SAUL CENTERS INC	2.4	76	7,958	0.0
MACK-CALI REALTY CORP	20.2	283	29,422	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	21.8	2,130	221,361	0.8
COUSINS PROPERTIES INC	32,906	1,128	117,258	0.4
SITE CENTERS CORP	31,878	340	35,403	0.1
DUKE REALTY CORP	82.1	3,151	327,442	1.1

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		
EASTGROUP PROPERTIES INC	千口	千アメリカ・ドル	千円	%	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,467	8.7	1,223	127,071	0.4
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	27.8	1,180	122,688	0.4	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	15.4	1,360	141,383	0.5	
GETTY REALTY CORP	7,703	220	22,951	0.1	
WELLTOWER INC	93.2	6,015	624,911	2.2	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	120.3	3,594	373,439	1.3	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23.1	897	93,282	0.3	
SERVICE PROPERTIES TRUST	36.5	449	46,679	0.2	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30.1	910	94,594	0.3	
EQUITY COMMONWEALTH	27,375	726	75,479	0.3	
KILROY REALTY CORP	23.2	1,463	152,086	0.5	
LTC PROPERTIES INC	8.4	318	33,118	0.1	
LEXINGTON REALTY TRUST	60	622	64,640	0.2	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	25,328	3,140	326,284	1.1	
MACERICH CO/THE	21,979	238	24,774	0.1	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	37.5	2,201	228,726	0.8	
NATL HEALTH INVESTORS INC	9.6	630	65,525	0.2	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	38.4	1,474	153,152	0.5	
REALTY INCOME CORP	77,117	4,753	493,840	1.7	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	24	653	67,919	0.2	
PUBLIC STORAGE	33.8	7,437	772,631	2.7	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4.3	570	59,280	0.2	
REGENCY CENTERS CORP	34.92	1,637	170,109	0.6	
RPT REALTY	17.8	137	14,313	0.0	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17.6	174	18,156	0.1	
SL GREEN REALTY CORP	16.4	993	103,164	0.4	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	49	242	25,198	0.1	
TAUBMAN CENTERS INC	13.3	568	59,096	0.2	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6	85	8,932	0.0	
UDR INC	65.3	2,561	266,069	0.9	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2.6	162	16,930	0.1	
WP CAREY INC	38.5	2,690	279,543	1.0	
WASHINGTON REIT	17.8	427	44,437	0.2	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	25.9	571	59,357	0.2	
AGREE REALTY CORP	11.7	770	80,077	0.3	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50,748	1,819	189,008	0.7	
CUBESMART	43.3	1,379	143,365	0.5	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45,526	493	51,317	0.2	
DIGITAL REALTY TRUST INC	59,778	8,173	849,139	2.9	
EXTRA SPACE STORAGE INC	28.6	3,146	326,837	1.1	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,875	67	7,003	0.0	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2.96	175	18,216	0.1	
KITE REALTY GROUP TRUST	18.95	281	29,294	0.1	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	21	310	32,289	0.1	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,233	39	4,110	0.0	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	30.5	1,234	128,298	0.4	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6.3	114	11,872	0.0	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	42,342	336	34,927	0.1	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	117.1	2,291	238,079	0.8	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21	102	10,646	0.0	
DOUGLAS EMMETT INC	36.5	1,165	121,078	0.4	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	46.7	394	40,948	0.1	
アメリカ・ドル 通貨 計	5,540,075 155銘柄	197,536	20,522,019	<71.0%>	
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	%	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13.1	141	11,332	0.0	
SLATE GROCERY REIT	8.1	100	8,049	0.0	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10.2	179	14,344	0.0	
SLATE OFFICE REIT	5.1	21	1,724	0.0	

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			比率
	口数	評価額	金額	
	千口	千カナダ・ドル	千円	%
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4.2	80	6,457	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	19.7	240	19,262	0.1
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	17.6	233	18,658	0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11.2	74	5,927	0.0
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	8.5	151	12,137	0.0
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4.1	45	3,599	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6.2	474	37,945	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	18.3	236	18,873	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	16.2	229	18,352	0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	24.7	385	30,806	0.1
CHOICE PROPERTIES REIT	36.8	489	39,130	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4.2	68	5,496	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11.9	178	14,252	0.0
PLAZA RETAIL REIT	11.1	40	3,274	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	16.3	395	31,602	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	19.5	1,001	80,040	0.3
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21.79	199	15,975	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	32,566	467	37,362	0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	34.3	623	49,827	0.2
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5.4	116	9,282	0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4.7	164	13,144	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9.5	139	11,165	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13.3	545	43,575	0.2
カナダ・ドル 通貨計	388,556 27銘柄	7,024	561,600	< 1.9% >
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円	%
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	78.38	235	18,084	0.1
CROMWELL PROPERTY GROUP	435.284	396	30,464	0.1
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	95.11	299	23,041	0.1
AVENTUS GROUP	88	237	18,273	0.1
RURAL FUNDS GROUP	78.595	204	15,716	0.1
WAYPOINT REIT	177.83	489	37,611	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	98.668	483	37,183	0.1
CENTURIA OFFICE REIT	84.95	192	14,831	0.1
CENTURIA CAPITAL GROUP	97.59	247	19,064	0.1
INVESTEC AUSTRALIA PROPERTY	119.63	155	11,960	0.0
HOME CONSORTIUM	35	132	10,202	0.0
HOMECO DAILY NEEDS REIT	17.5	23	1,810	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	241.86	623	47,991	0.2
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	70.547	263	20,238	0.1
NATIONAL STORAGE REIT	206.195	391	30,131	0.1
APN INDUSTRIA REIT	29.76	89	6,912	0.0
GDI PROPERTY GROUP	123.31	149	11,475	0.0
SCENTRE GROUP	1,194.91	3,441	264,673	0.9
ARENA REIT	79.89	223	17,204	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38.3	121	9,367	0.0
BWP TRUST	105.55	458	35,231	0.1
DEXUS	251.73	2,471	190,120	0.7
GPT GROUP	444	2,104	161,861	0.6
CHARTER HALL RETAIL REIT	120.4	463	35,650	0.1
MIRVAC GROUP	908.06	2,370	182,279	0.6
STOCKLAND	550.01	2,541	195,431	0.7
ABACUS PROPERTY GROUP	81.12	257	19,777	0.1
GOODMAN GROUP	381.71	7,103	546,339	1.9
VICINITY CENTRES	878.9	1,467	112,885	0.4
CHARTER HALL GROUP	105.06	1,399	107,627	0.4
INGENIA COMMUNITIES GROUP	68.66	318	24,502	0.1
オーストラリア・ドル 通貨計	7,286,509 31銘柄	29,358	2,257,947	< 7.8% >
(香港)	千口	千香港ドル	千円	%
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	349	1,333	17,864	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193	717	9,620	0.0

ファンド名	当期			比率
	口数	評価額	金額	
	千口	千香港ドル	千円	%
FORTUNE REIT	311	2,183	29,255	0.1
PROSPERITY REIT	300	714	9,567	0.0
LINK REIT	476.9	32,667	437,746	1.5
CHAMPION REIT	431	1,973	26,451	0.1
香港・ドル 通貨計	2,060.9 6銘柄	39,589	530,505	< 1.8% >
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円	%
KEPPEL DC REIT	293.783	837	65,048	0.2
FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	126.2	59	4,657	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	455	423	32,874	0.1
AIMS APAC REIT	89	108	8,435	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST	121.8	63	4,967	0.0
FRASERS LOGISTICS & COMMERC	591.19	821	63,842	0.2
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86	69	5,411	0.0
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	208.9	141	10,954	0.0
EC WORLD REIT	57	41	3,188	0.0
IREIT GLOBAL	105.124	67	5,267	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	722.377	2,181	169,486	0.6
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,029.422	2,048	159,151	0.6
SUNTEC REIT	473.4	724	56,271	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	608.2	1,192	92,612	0.3
KEPPEL REIT	375.4	401	31,206	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST	417.456	429	33,405	0.1
ESR-REIT	559.902	226	17,617	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS	161.6	202	15,693	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	211.776	497	38,664	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	308.8	149	11,635	0.0
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	179.396	222	17,282	0.1
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	86.3	341	26,550	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	467.2	42	3,266	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	384.78	1,135	88,185	0.3
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	244.5	152	11,872	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	498.484	1,031	80,165	0.3
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182.1	117	9,125	0.0
SPH REIT	220.6	183	14,224	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	202.1	101	7,850	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	219.4	76	5,965	0.0
OLUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	541.063	208	16,183	0.1
(非上場)				
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	10.046	0	34	0.0
シンガポール・ドル 通貨計	10,238,299 32銘柄	14,301	1,111,099	< 3.8% >
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランド・ドル	千円	%
ARGOSY PROPERTY LTD	158.52	237	17,384	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	357.92	440	32,186	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	76.8	228	16,732	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST	248.22	598	43,735	0.2
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	245.82	427	31,271	0.1
ニュージーランド・ドル 通貨計	1,087.28 5銘柄	1,932	141,308	< 0.5% >
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円	%
ASSURA PLC	594.52	433	60,130	0.2
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	129.57	94	13,051	0.0
STANDARD LIFE INV PROP INC	100	55	7,647	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	177.71	124	17,259	0.1
PICTON PROPERTY INCOME LTD	121.11	86	11,963	0.0
REGIONAL REIT LTD	81.31	60	8,449	0.0
NEWRIVER REIT PLC	69.33	52	7,242	0.0
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	183.29	249	34,536	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	135.49	138	19,147	0.1
CUSTODIAN REIT PLC	89.42	76	10,642	0.0

ファンド名	当 期 末			
	口 数	外貨建金額	邦貨換算金額	比 率
GCP STUDENT LIVING PLC	千口	千円	千円	%
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	96.86	136	18,922	0.1
LXI REIT PLC	67.9	73	10,160	0.0
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	118,038	136	18,970	0.1
AEVW UK REIT PLC	75.2	78	10,939	0.0
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	25.61	19	2,710	0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	180	129	17,906	0.1
RDI REIT PLC	150	160	22,185	0.1
LAND SECURITIES GROUP PLC	41,036	38	5,372	0.0
SEGRO PLC	166,381	1,106	153,319	0.5
HAMMERSON PLC	263.74	2,377	329,382	1.1
UNITE GROUP PLC/THE	811,984	181	25,143	0.1
BRITISH LAND CO PLC	87.26	862	119,508	0.4
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	208.52	980	135,813	0.5
DERWENT LONDON PLC	53,581	346	48,075	0.2
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	24.39	753	104,350	0.4
WORKSPACE GROUP PLC	283.37	394	54,651	0.2
SAFESTORE HOLDINGS PLC	26.46	185	25,662	0.1
SHAFTESBURY PLC	46.35	353	48,934	0.2
BIG YELLOW GROUP PLC	53.85	286	39,729	0.1
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	36.96	418	57,967	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	203.15	448	62,147	0.2
TRITAX BIG BOX REIT PLC	121.6	43	5,980	0.0
イギリス・ポンド通貨計	5,194.25	11,479	1,590,499	< 5.5% >
(イスラエル) REIT 1 LTD	千口	千円	千円	%
イスラエル・シケル通貨計	28.84	455	14,289	< 0.0% >
(韓国) SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	千口	千円	千円	%
LOTTE REIT CO LTD	6	44,460	4,188	0.0
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	17.96	96,984	9,135	0.0
韓国ウォン通貨計	41.92	214,900	20,243	< 0.1% >
ユーロ (アイルランド) IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	千口	千ユーロ	千円	%
HIBERNIA REIT PLC	82.05	115	14,389	0.0
国 小 計	116.24	134	16,771	0.1
ユーロ (オランダ) WERELDHAVE NV	千口	千ユーロ	千円	%
EUROCOMMERCIAL PROPRIET-CV	6.47	75	9,343	0.0
NSI NV	8.23	126	15,702	0.1
VASTNED RETAIL NV	3.231	108	13,543	0.0
国 小 計	3.75	87	10,844	0.0
ユーロ (ベルギー) AEDIFICA	千口	千ユーロ	千円	%
COFINIMMO	6.256	606	75,477	0.3
BEFIMMO	5.3	661	82,269	0.3
INTEREST OFFICES & WAREHOUS	5.07	192	23,899	0.1
RETAIL ESTATES	4.61	104	13,044	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA	1.94	116	14,477	0.1
CARE PROPERTY INVEST	25.48	718	89,308	0.3
XIOR STUDENT HOUSING NV	4.9	133	16,638	0.1
MONTEA	2.7	136	16,959	0.1
国 小 計	2.15	208	25,912	0.1
国 小 計	58.406	2,878	357,988	< 1.2% >

ファンド名	当 期 末			
	口 数	外貨建金額	邦貨換算金額	比 率
ユーロ (フランス) UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	千口	千ユーロ	千円	%
ICADE	26.77	1,690	210,300	0.7
CARMILA	5.94	355	44,255	0.2
ALTAREA	10	123	15,373	0.1
GECINA SA	0.74	102	12,701	0.0
KLEPIERRE	10,521	1,337	166,323	0.6
COVIVIO	39.94	774	96,274	0.3
MERCIALYS	8,992	647	80,526	0.3
国 小 計	4.03	28	3,543	0.0
国 小 計	106.933	5,059	629,299	< 2.2% >
ユーロ (ドイツ) ALSTRIA OFFICE REIT-AG	千口	千ユーロ	千円	%
HAMBORNER REIT AG	34.82	478	59,506	0.2
国 小 計	11.98	107	13,340	0.0
ユーロ (スペイン) LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	千口	千ユーロ	千円	%
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	10.53	51	6,417	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	50.033	406	50,500	0.2
国 小 計	66.1	524	65,237	0.2
ユーロ (イタリア) IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	千口	千ユーロ	千円	%
国 小 計	6.24	22	2,782	0.0
ユーロ (その他) CROMWELL EUROPEAN REIT	千口	千ユーロ	千円	%
国 小 計	294.6	142	17,771	0.1
ユーロ通貨計	294.6	142	17,771	< 0.1% >
合 計	859,613	10,318	1,283,439	< 4.4% >
合 計	32,726.242	-	28,032,952	< 97.0% >

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

(注2) 比率欄は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	451	-
STOXX 600 REAL (ドイツ)	271	-

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	率
	千円	%
投資信託受益証券	154,336	0.5
投資信託証券	28,032,952	96.8
コール・ローン等、その他	778,544	2.7
投資信託財産総額	28,965,833	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=103.89円、1カナダ・ドル=79.95円、1オーストラリア・ドル=76.91円、1香港ドル=13.40円、1シンガポール・ドル=77.69円、1ニュージーランド・ドル=73.11円、1イギリス・ポンド=138.55円、1イスラエル・シェケル=31.34円、100韓国ウォン=9.42円、1ユーロ=124.38円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(28,578,706千円)の投資信託財産総額(28,965,833千円)に対する比率は、98.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	29,286,393,421円
コール・ローン等	427,298,478
投資信託受益証券(評価額)	154,336,387
投資信託証券(評価額)	28,032,952,855
未収入金	357,873,678
未収配当金	67,602,662
差入委託証拠金	246,329,361
(B) 負債	386,546,524
未払金	373,445,599
未払株式払込金	5,533,125
未払解約金	7,567,800
(C) 純資産総額(A-B)	28,899,846,897
元本	13,110,290,968
次期繰越損益金	15,789,555,929
(D) 受益権総口数	13,110,290,968口
1万口当り基準価額(C/D)	22,044円

* 期首における元本額は10,530,038,419円、当作成期間中における追加設定元本額は5,074,786,065円、同解約元本額は2,494,533,516円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワファンドラップ 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジあり) 6,132,754,799円、ダイワファンドラップ 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし) 1,093,059,962円、ダイワファンドラップオンライン 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジあり) 373,261,192円、ダイワファンドラップオンライン 外国 R E I T インデックス (為替ヘッジなし) 273,443,934円、D-1's グローバル R E I T インデックス 1,889,346円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 1,550,762円、i F r e e 外国 R E I T インデックス 123,942,403円、i F r e e 8 資産バランス 1,373,085,035円、グローバル・リート・インデックスファンド (資産形成型) 58,109,678円、グローバル・リート・インデックスファンド (毎月決算型) 22,959,674円、DCダイワ・グローバル R E I T インデックス ファンド 2,665,764,298円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 3,110,210円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 6,033,482円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 3,580,507円、ダイワバランスファンド2020-07 (適格機関投資家専用) 249,211,041円、ダイワ・インデックスセレクト グローバル R E I T 253,711,264円、ダイワ・ノーロード グローバル R E I T ファンド 52,204,021円、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 S M A 専用) 217,637,598円、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 S M A 専用) 204,981,762円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は22,044円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月3日 至2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	906,938,843円
受取配当金	906,808,298
受取利息	16,322
その他収益金	276,441
支払利息	△ 162,218
(B) 有価証券売買損益	△ 5,029,277,719
売買益	1,259,234,903
売買損	△ 6,288,512,622
(C) 先物取引等損益	△ 27,500,056
取引益	227,997,158
取引損	△ 255,497,214
(D) その他費用	△ 17,338,657
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 4,167,177,589
(F) 前期繰越損益金	16,681,310,374
(G) 解約差損益金	△ 2,568,409,291
(H) 追加信託差損益金	5,843,832,435
(I) 合計(E+F+G+H)	15,789,555,929
次期繰越損益金(I)	15,789,555,929

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

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

ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス (為替ヘッジなし)

運用報告書 (全体版) 第4期

(決算日 2020年11月30日)

(作成対象期間 2019年12月3日~2020年11月30日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券に投資し、投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）／インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行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			S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 組入比率	投信証 組入比率	不動産 指数比率	純資産額
	(分配落)	税金 分配	み み騰 騰落 率	(ベンチマーク)	期 騰 騰落 率				
1期末(2017年11月30日)	円 10,273	円 0	% 2.7	10,407	% 4.1	% 0.3	% 98.9	% 0.5	百万円 312
2期末(2018年11月30日)	10,501	0	2.2	10,745	3.2	0.8	97.9	0.9	561
3期末(2019年12月2日)	11,725	0	11.7	12,100	12.6	2.0	95.1	2.9	595
4期末(2020年11月30日)	9,969	0	△15.0	10,369	△14.3	0.5	97.0	2.5	602

(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。

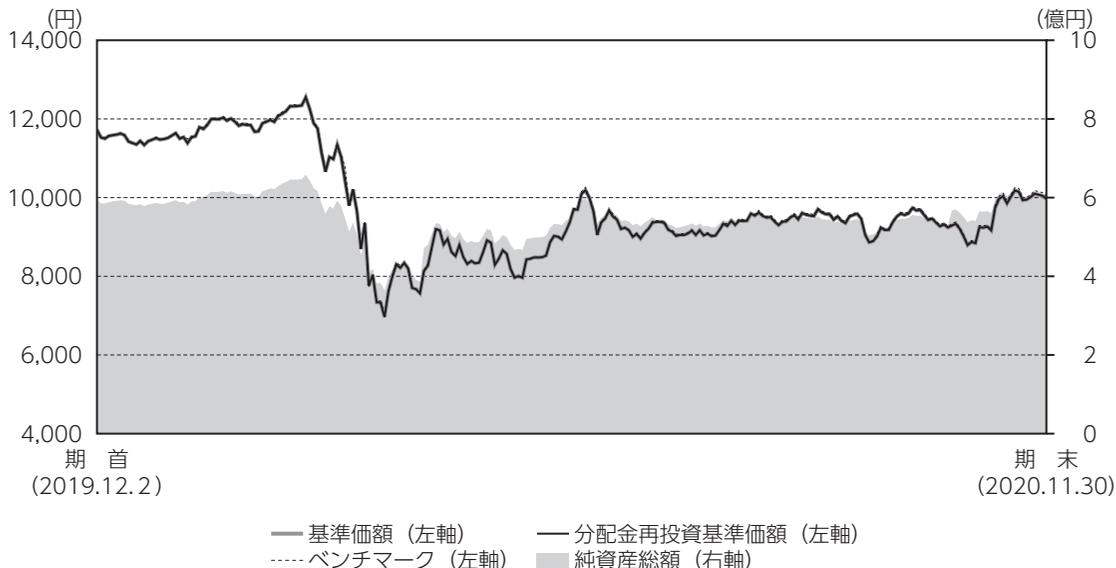
(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。

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



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

■基準価額・騰落率

期首：11,725円

期末：9,969円(分配金0円)

騰落率：△15.0%(分配金込み)

■基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、海外リート市場の下落が主な要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

ダイワ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)

年 月 日	基準価額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資 組入	信託 証比率	投資 組入	資 券率	不 動 産	指 数 率
	騰	落	騰	落						
(期首) 2019年12月2日	円 11,725	% -	12,100	% -		% 2.0		% 95.1		% 2.9
12月末	11,637	△ 0.8	12,026	△ 0.6		1.2		97.1		1.9
2020年1月末	11,844	1.0	12,206	0.9		1.7		96.2		2.1
2月末	11,140	△ 5.0	11,580	△ 4.3		1.6		95.7		2.7
3月末	8,339	△28.9	8,574	△29.1		1.5		95.7		2.9
4月末	8,912	△24.0	9,194	△24.0		0.8		96.0		3.2
5月末	9,006	△23.2	9,322	△23.0		2.1		94.8		3.2
6月末	9,105	△22.3	9,421	△22.1		0.9		96.6		2.5
7月末	9,279	△20.9	9,630	△20.4		0.6		96.9		2.5
8月末	9,564	△18.4	9,900	△18.2		0.5		96.8		2.8
9月末	9,176	△21.7	9,487	△21.6		1.2		95.9		2.9
10月末	8,873	△24.3	9,194	△24.0		0.9		96.2		2.8
(期末) 2020年11月30日	9,969	△15.0	10,369	△14.3		0.5		97.0		2.5

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2019.12.3～2020.11.30)

■ 海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、長期金利の上昇を背景として米国を中心に上値が重い展開となりました。2020年に入ると、米国の対中追加関税回避や長期金利の低下などが支援材料となり、堅調な推移となりました。しかし2月以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて大幅に下落しました。3月下旬からは、各国の財政金融政策や新型コロナウイルスワクチン開発への期待などから上昇しました。5月以降は、世界的な経済活動の再開期待から堅調な展開となりました。その後9月以降は、感染再拡大やそれに伴うロックダウン（都市封鎖）への懸念などから下落する局面があったものの、11月に入ると、ワクチン開発で高い効果を示す結果が報告され、経済活動再開への期待が高まったことなどから上昇して当作成期末を迎えました。

■ 為替相場

為替相場は、まちまちな動きとなりました。

対円為替相場は、当作成期首より、米中貿易摩擦への懸念が後退したことなどから円安傾向となりました。2020年に入ると、新型コロナウイルスに関する懸念が拡大し、特に2月下旬から3月中旬にかけて大きく円高が進行しました。その後は、大幅な下落に対する反発などから円安となりました。さらにその後も、経済活動の再開期待や世界的な金融緩和の長期化観測から円安傾向が続きました。7月以降は、米中関係の悪化などが材料となって米ドルなどが円高に転じる一方、他の通貨はリスク選好の動きからおおむね円安傾向となりました。9月以降は、感染再拡大への懸念などから円高が進行しましたが、当作成期末にかけては、新型コロナウイルスのワクチンに対する期待感から円安となりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■ 当ファンド

主として「ダイワ・グローバル R E I T インデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■ ダイワ・グローバル R E I T 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 R E I T 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、E T F（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

ポートフォリオについて

(2019.12.3～2020.11.30)

■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ100%行いました。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

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

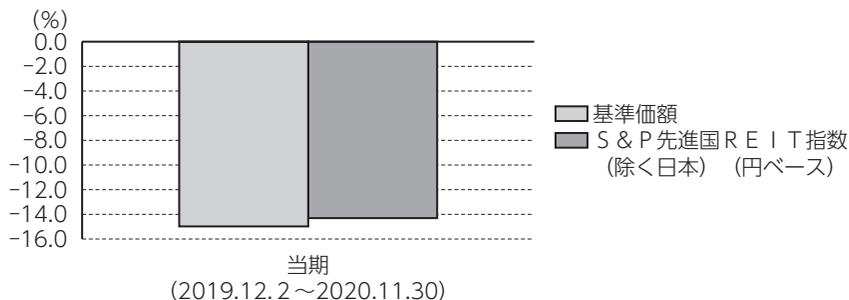
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマーク（S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース））の騰落率は△14.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△15.0%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、マザーファンドにおいて組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

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

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2019年12月3日 ～2020年11月30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）	1,894

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

主として「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。

また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2019.12.3~2020.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	32円	0.323%	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9,795円です。
(投 信 会 社)	(24)	(0.246)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(5)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(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	0.021	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)	(0.005)	
(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	2	0.016	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(2)	(0.015)	
そ の 他 費 用	7	0.071	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(4)	(0.039)	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)	(3)	(0.027)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	42	0.431	

(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。

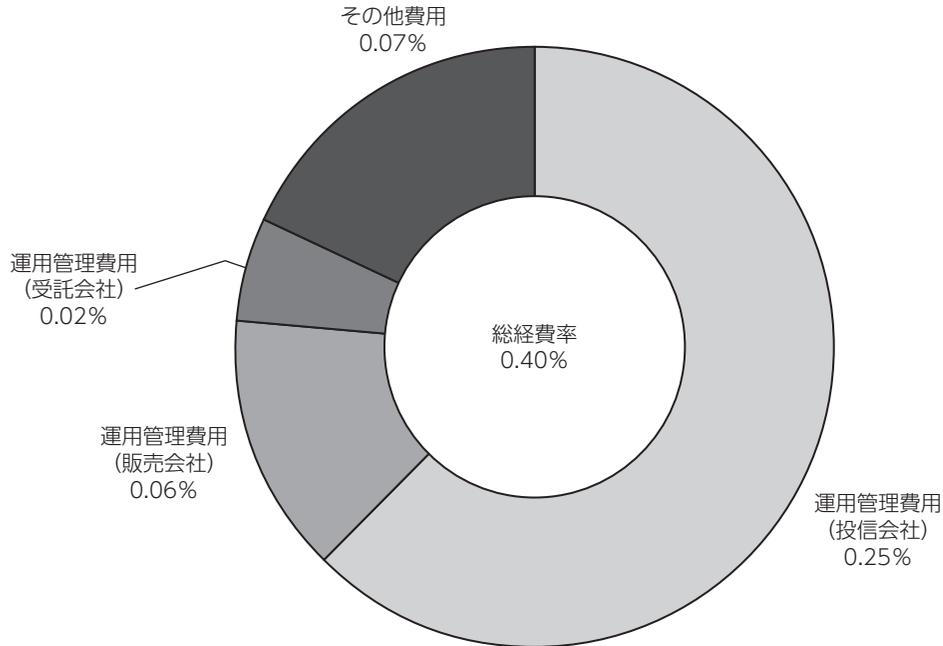
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.40%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12月3日から2020年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	83,809	164,768	40,884	84,195

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	230,518	273,443	602,779

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバルREIT インデックス・マザーファンド	602,779	99.7
コール・ローン等、その他	1,516	0.3
投資信託財産総額	604,296	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=103.89円、1カナダ・ドル=79.95円、1オーストラリア・ドル=76.91円、1香港ドル=13.40円、1シンガポール・ドル=77.69円、1ニュージーランド・ドル=73.11円、1イギリス・ポンド=138.55円、1イスラエル・シェケル=31.34円、100韓国ウォン=9.42円、1ユーロ=124.38円です。

(注3) 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(28,578,706千円)の投資信託財産総額(28,965,833千円)に対する比率は、98.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	604,296,439円
コール・ローン等	1,122,631
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)	602,779,808
未収入金	394,000
(B) 負債	1,472,798
未払解約金	575,308
未払信託報酬	882,612
その他未払費用	14,878
(C) 純資産総額(A-B)	602,823,641
元本	604,694,831
次期繰越損益金	△ 1,871,190
(D) 受益権総口数	604,694,831□
1万口当り基準価額(C/D)	9,969円

* 期首における元本額は508,116,057円、当作成期間中における追加設定元本額は262,282,042円、同解約元本額は165,703,268円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,969円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1,871,190円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月3日 至2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 261円
受取利息	24
支払利息	△ 285
(B) 有価証券売買損益	△46,991,621
売買益	24,546,461
売買損	△71,538,082
(C) 信託報酬等	△ 1,796,522
(D) 当期繰越損益金(A + B + C)	△48,788,404
(E) 前期繰越損益金	59,405,112
(F) 追加信託差損益金	△12,487,898
(配当等相当額)	(55,160,709)
(売買損益相当額)	(△67,648,607)
(G) 合計(D + E + F)	△ 1,871,190
次期繰越損益金(G)	△ 1,871,190
追加信託差損益金	△12,487,898
(配当等相当額)	(55,160,709)
(売買損益相当額)	(△67,648,607)
分配準備積立金	59,405,112
繰越損益金	△48,788,404

- (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	55,160,709
(d) 分配準備積立金	59,405,112
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	114,565,821
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	114,565,821
(h) 受益権総口数	604,694,831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。

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の第16期にかかる運用状況については、299～307ページをご参照ください。