

ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ

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

運用報告書 (全体版)

第7期

(決算日 2023年6月15日)

(作成対象期間 2022年6月16日~2023年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ」は、このたび、
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/>

ダイワファンドラップ TOP I Xインデックス

運用報告書(全体版)

第7期

(決算日 2023年6月15日)

(作成対象期間 2022年6月16日～2023年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）		
運用方針	投資成果を東証株価指数（TOP I X）（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、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、わが国の株式に投資し、東証株価指数（TOP I X）（配当込み）に連動する投資成果をあげることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<4641>

最近5期の運用実績

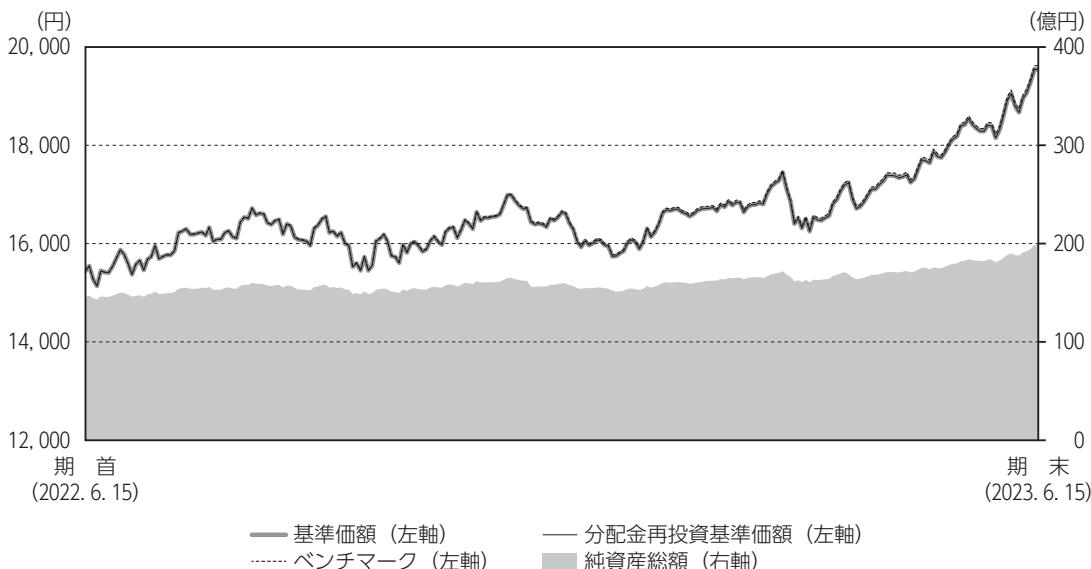
決算期	基準価額			TOPIX (配当込み)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
3期末(2019年6月17日)	円 12,045	円 0	% △ 12.2	2,318.32	% △ 11.9	% 98.5	% 1.5	百万円 8,839
4期末(2020年6月15日)	円 12,246	円 0	% 1.7	2,364.73	% 2.0	% 98.2	% 1.6	11,171
5期末(2021年6月15日)	円 16,103	円 0	% 31.5	3,117.60	% 31.8	% 97.4	% 2.6	13,378
6期末(2022年6月15日)	円 15,446	円 0	% △ 4.1	2,999.04	% △ 3.8	% 98.2	% 1.8	14,582
7期末(2023年6月15日)	円 19,542	円 0	% 26.5	3,809.16	% 27.0	% 97.6	% 2.4	19,886

(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。
 ※ベンチマークを「TOPIX」から「TOPIX (配当込み)」に変更しました。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：15,446円
 期末：19,542円 (分配金0円)
 騰落率：26.5% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		TOPIX (配当込み)		株 式 組入比率	株 式 先物比率
	円	騰 落 率 %	(ベンチマーク)	騰 落 率 %		
(期首)2022年 6月15日	15,446	—	2,999.04	—	98.2	1.8
6月末	15,590	0.9	3,027.34	0.9	97.5	2.5
7月末	16,166	4.7	3,140.07	4.7	97.2	2.8
8月末	16,356	5.9	3,177.98	6.0	96.9	3.1
9月末	15,455	0.1	3,003.39	0.1	96.1	3.9
10月末	16,236	5.1	3,156.44	5.2	96.7	3.2
11月末	16,710	8.2	3,249.61	8.4	97.1	2.8
12月末	15,943	3.2	3,101.25	3.4	97.3	2.7
2023年 1月末	16,641	7.7	3,238.48	8.0	96.8	3.2
2月末	16,793	8.7	3,269.12	9.0	98.2	1.9
3月末	17,074	10.5	3,324.74	10.9	97.2	2.7
4月末	17,529	13.5	3,414.45	13.9	97.5	2.5
5月末	18,151	17.5	3,537.93	18.0	97.2	2.8
(期末)2023年 6月15日	19,542	26.5	3,809.16	27.0	97.6	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

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、米国のインフレ率がピークアウトするとの期待感などから、2022年8月中旬にかけて上昇が続き、その後は、英国の財政悪化や欧米の金利上昇などが嫌気されて9月末にかけて下落しましたが、欧米の金利上昇が一服したことや国内で経済活動正常化への期待が高まったことなどから、11月下旬にかけて上昇しました。12月には、世界的な景況感の悪化や日銀の政策変更による急速な円高などで下落しましたが、2023年1月以降は、中国のゼロコロナ政策見直しにより景気回復期待が高まったことや、日銀総裁人事への不透明感が解消し円安が進んだことなどが好感され、3月上旬にかけて上昇しました。その後は、米国地方銀行の経営破綻や欧州金融機関の破綻懸念などで金融不安が高まり、3月半ばにかけて下落しましたが、欧州金融機関の破綻回避などを受けて金融不安が一定程度後退したことにより、上昇に転じました。さらに、日銀新総裁就任後初の金融政策決定会合で金融緩和継続の方針が示されたことや、海外に比べて遅れていた経済正常化の動きが本格化したこと、海外投資家による日本株見直しの動きが強まったことなどにより、当作成期末にかけて大幅に上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

て行いました。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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

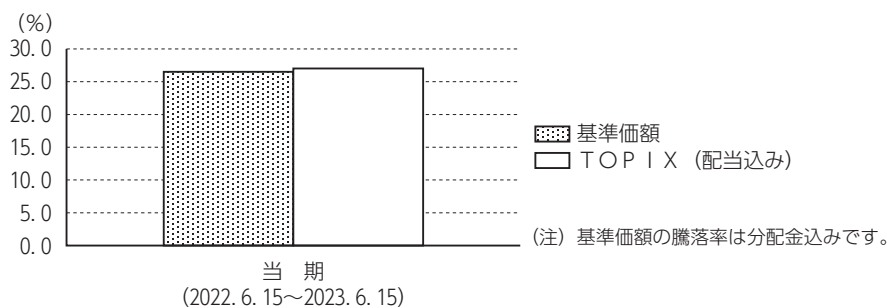
組入ファンド	ベンチマーク
トピックス・インデックス・マザーファンド	TOPIX（配当込み）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は27.0%となりました。一方、当ファンドの騰落率は26.5%とな

りました。マザーファンドで組み入れている現物株式ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差

異、先物取引の影響、運用管理費用等のコストがかい離の要因として挙げられます。



* ベンチマークはTOPIX（配当込み）です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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	
	2022年6月16日 ～2023年6月15日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	9,542

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
- (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。
- (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2022. 6. 16~2023. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	57円	0.341%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は16,616円です。
(投信会社)	(35)	(0.209)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(18)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(4)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	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)	(0.007)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合計	59	0.355	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

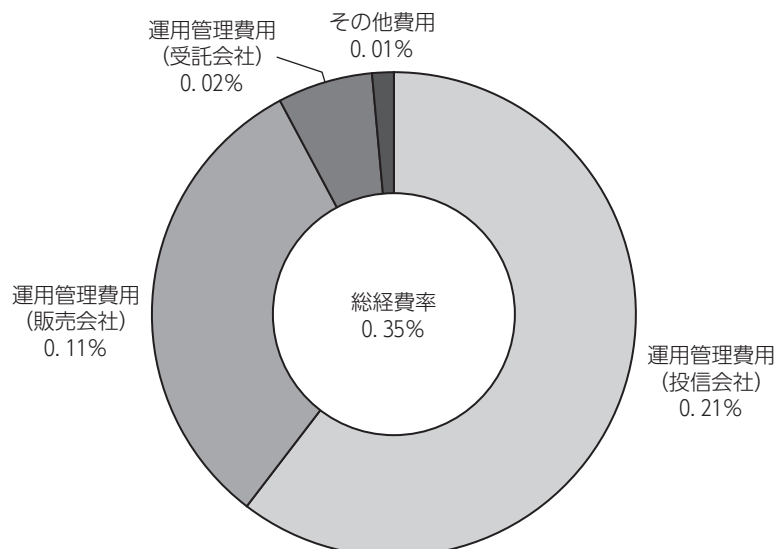
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

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



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	2,232,923	3,124,800	1,389,171	1,910,200

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

項 目	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	40,806,626千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	199,686,760千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.20

(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

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A		B/A	売付額等 C		D/C
区 分	百万円	うち利害関係人との取引状況 B 百万円		百万円	うち利害関係人との取引状況 D 百万円	
株式	30,166	6,162	20.4	10,640	43	0.4
株式先物取引	42,630	28,057	65.8	41,525	29,510	71.1
コール・ローン	2,781,341	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合7.8%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

種 類	当 期		
	トピックス・インデックス・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	40	33	414

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

種 類	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
	買 付 額
	百万円
株式	12

(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

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	1,343千円
うち利害関係人への支払額 (B)	125千円
(B) / (A)	9.4%

(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、大和証券株式会社、株式会社大和証券グループ本社、株式会社マネーパートナーズグループ、サムティ株式会社です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	11,370,096	12,213,848	19,885,366

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	19,885,366	99.8
コール・ローン等、その他	33,512	0.2
投資信託財産総額	19,918,878	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	19,918,878,545円
コール・ローン等	33,512,392
トピックス・インデックス・マザーファンド (評価額)	19,885,366,153
(B) 負債	32,113,996
未払解約金	3,205,465
未払信託報酬	28,449,738
その他未払費用	458,793
(C) 純資産総額 (A - B)	19,886,764,549
元本	10,176,374,027
次期繰越損益金	9,710,390,522
(D) 受益権総口数	10,176,374,027口
1万口当り基準価額 (C / D)	19,542円

* 期首における元本額は9,440,492,072円、当作成期間中における追加設定元本額は2,583,526,613円、同解約元本額は1,847,644,658円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は19,542円です。

■損益の状況

当期 自 2022年 6月16日 至 2023年 6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 10,363円
受取利息	787
支払利息	△ 11,150
(B) 有価証券売買損益	3,885,763,141
売買益	4,087,731,506
売買損	△ 201,968,365
(C) 信託報酬等	△ 55,762,316
(D) 当期損益金 (A + B + C)	3,829,990,462
(E) 前期繰越損益金	1,234,168,184
(F) 追加信託差損益金	4,646,231,876
(配当等相当額)	(2,763,930,090)
(売買損益相当額)	(1,882,301,786)
(G) 合計 (D + E + F)	9,710,390,522
次期繰越損益金 (G)	9,710,390,522
追加信託差損益金	4,646,231,876
(配当等相当額)	(2,763,930,090)
(売買損益相当額)	(1,882,301,786)
分配準備積立金	5,064,169,009
繰越損益金	△ 10,363

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

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	3,334,144,496
(c) 収益調整金	4,646,231,876
(d) 分配準備積立金	1,730,024,513
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	9,710,400,885
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	9,710,400,885
(h) 受益権総口数	10,176,374,027口

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

《お知らせ》

■ベンチマークの変更について

- 当ファンドのベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。
変更前：東証株価指数 (TOPIX)
変更後：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
- マザーファンドのベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。
変更前：東証株価指数
変更後：東証株価指数 (配当込み)

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ TOPIXインデックス）が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（2022年9月20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（2023年6月15日）現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■トピックス・インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
トヨタ自動車	669.3	1,311,451	1,959	ソフトバンクグループ	115.3	634,454	5,502
ソニーグループ	70.1	789,541	11,263	三菱商事	57	233,705	4,100
日本電信電話	166.9	661,065	3,960	日立	31.4	205,035	6,529
キーエンス	8.5	484,729	57,026	三菱UFJフィナンシャルG	219.5	188,266	857
第一三共	106.5	478,945	4,497	日立金属	71.5	155,941	2,181
三菱UFJフィナンシャルG	457.2	381,190	833	スズキ	30.9	146,658	4,746
武田薬品	88.1	360,199	4,088	中外製薬	39	145,399	3,728
東京海上HD	110.2	320,894	2,911	丸紅	106.5	139,193	1,306
任天堂	39.7	312,751	7,877	日本郵政	141.6	138,048	974
みずほフィナンシャルG	174	307,431	1,766	トヨタ自動車	59.5	124,446	2,091

(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、2023年6月15日現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンド（155,385,420千円）の内容です。

(1)国内株式

銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
水産・農林業 (0.1%)			大木建設	2.1	2,700	住友電設	7	20,965	寿スピリッツ	7.9	85,399
極洋	4	14,600	鉄建建設	5.3	10,589	日本電設工業	12.1	22,554	カルビー	33.9	94,699
ニッスイ	105.6	68,217	西松建設	12.4	43,412	エクシオグループ	34.2	96,324	森永乳業	13.4	66,598
マルハニチロ	15.7	39,077	三井住友建設	59.4	21,740	新日本空調	4	8,908	六甲バター	5.6	7,459
雪国まいたけ	9	8,559	大豊建設	3	11,475	九電工	17.9	73,211	ヤクルト	53	481,240
カネコ種苗	3.3	4,860	佐田建設	3.6	1,612	三機工業	16.2	24,413	明治ホールディングス	90.8	292,376
サカタのタネ	12	48,720	ナカノフドー建設	4	1,488	日揮ホールディングス	73.1	136,733	雪印メグミルク	17.8	34,460
ホクト	9.6	17,865	奥村組	12	48,720	中外炉工業	2.4	4,898	プリマハム	9.9	21,572
ホクリヨウ	1.2	997	東鉄工業	10.1	25,744	ヤマト	4.7	4,309	日本ハム	28.9	115,802
鉱業 (0.3%)			イチケン	1.3	2,475	太平電業	4.6	20,194	林兼産業	1.7	816
住石ホールディングス	12.6	4,636	富士ビー・エス	2.5	1,105	高砂熱学	17.8	43,147	丸大食品	7.6	11,339
日鉄鉱業	4.3	17,737	浅沼組	5.8	18,647	三晃金属	0.7	2,989	S Foods	8.1	26,325
三井松島 HLDGS	4.8	12,153	戸田建設	90.7	73,639	朝日工業社	3	6,831	柿安本店	2.9	6,675
INPEX	390.8	624,107	熊谷組	12.3	38,806	明星工業	12.6	12,335	伊藤ハム米久 HLDGS	56	40,544
石油資源開発	12.2	52,338	北野建設	1.1	3,268	大気社	8.6	34,357	サッポロホールディングス	24.3	91,125
K&O エナジーグループ	4.8	11,563	植木組	1.6	2,145	ダイダン	4.9	13,156	アサヒグループホールディング	171.3	985,317
建設業 (2.0%)			矢作建設	9.9	11,375	日比谷総合設備	6.4	13,977	キリンHD	334.4	717,455
ショーボンドHD	14.4	83,880	ピーエス三菱	9.2	6,808	フィル・カンパニー	1.3	1,173	宝ホールディングス	50.7	54,502
ミライト・ワン	34.9	62,872	日本ハウス HLDGS	14.5	5,481	テスホールディングス	8	8,272	オエノホールディングス	22.1	8,066
タマホーム	6.6	21,252	新日本建設	10.5	11,865	インフロンニアHD	77.4	102,709	養命酒	2.4	4,420
サンヨーホームズ	1	715	東亜道路	2.9	12,774	東洋エンジニア	9.7	5,975	コカ・コーラボトラーズHD	58.3	92,143
日本アーク	3.4	2,934	日本道路	1.5	13,350	レイズネクス	10.6	14,765	サントリー食品インター	52.2	283,550
ファーストコーポレーション	2.3	1,750	東亜建設	6.3	19,089	食料品 (3.4%)			ダイドールグループHD	4.2	21,378
ベステラ	1.7	2,145	日本国土開発	21.8	12,927	ニッポン	19.8	36,392	伊藤園	25.1	103,888
キャンディル	1.5	855	若菜建設	3.2	9,920	日清製粉G本社	68.5	126,896	キーコーヒー	8.3	17,156
ダイセキ環境ソリューション	1.7	1,776	東洋建設	23.6	24,378	日東富士製粉	1.3	6,188	ユニカフェ	1.9	1,723
第一カッター興業	2.7	3,742	五洋建設	104.7	80,964	昭和産業	6.4	17,312	ジャパンフーズ	0.9	985
安藤・間	61.2	66,646	世紀東急	9.4	12,173	鳥越製粉	4.9	3,033	日清オйлオグループ	10.4	35,828
東急建設	30	22,020	福田組	2.8	13,412	中部飼料	10.6	11,543	不二製油グループ	17.4	35,269
コムシスホールディングス	36	101,268	住友林業	56.7	193,290	フィード・ワン	10.7	7,811	かどや製油	0.7	2,415
ビーアールホールディングス	16.7	6,479	日本基礎技術	3.4	1,747	東洋精糖	1.1	1,564	J-オイルミルズ	7.6	12,129
高松コンストラクショング	6.8	16,639	巴コーポレーション	6.4	2,950	日本甜菜糖	4.3	7,890	キッコーマン	49.1	413,225
東建コーポレーション	3.1	22,320	大和ハウス	206.3	776,306	DM三井製糖ホールディ	7.3	19,483	味の素	179.1	1,026,386
ソネット	0.9	882	ライト工業	13.6	26,384	塩水港精糖	6.8	1,387	ブルドックソース	3.9	7,780
ヤマウラ	5.5	6,473	積水ハウス	224	615,328	ウェルネオシュガー	3.8	7,383	キューピー	39.7	92,977
オリエンタル白石	37.8	11,529	日特建設	7.1	7,213	森永製菓	13.5	62,262	ハウス食品G本社	22.5	72,697
大成建設	69.1	327,464	北陸電気工事	5.1	4,549	中村屋	1.9	5,823	カゴメ	34.4	116,684
大林組	264	312,180	エアテック	16.2	13,753	江崎グリコ	21.2	81,365	焼津水産化工	2.2	1,797
清水建設	221.9	196,758	日本リーテック	6.4	8,729	名糖産業	2.9	4,700	アリアケジャパン	6.4	33,529
飛島建設	8.2	10,414	四電工	3.1	6,733	井村屋グループ	4.1	9,315	ビエトロ	0.8	1,448
長谷工コーポレーション	76.2	130,606	中電工	11.3	25,425	不二家	5	12,475	エバラ食品工業	2	5,912
松井建設	7.1	4,856	関電工	40.3	44,733	山崎製パン	49.5	99,866	やまみ	0.6	816
銭高組	0.7	2,145	きんでん	51.8	101,217	第一屋製パン	1.4	541	ニチレイ	33.9	105,700
鹿島建設	163.7	343,851	東京エネシス	7.4	7,370	モロゾフ	2.4	8,688	東洋水産	37.4	238,499
不動テトラ	5.3	9,577	トーエネック	2.4	8,808	亀田製菓	4.7	19,787	イートアンド HLDGS	3.2	7,049

銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
大冷	0.7	1,355	日本曹達	8.1	41,310	高砂香料	5.1	13,402	あすか製薬HD	7.8	10,202
ヨシムラ・フード・HLDGS	4.6	4,029	東ソー	100.7	176,073	マンダム	16.5	23,826	サワイグループHD	17.3	58,802
日清食品HD	26.1	315,288	トクヤマ	24.3	59,085	ミルボン	11.2	57,433	石油・石炭製品 (0.4%)		
永谷園ホールディングス	3.6	7,570	セントラル硝子	12.1	39,446	ファンケル	33	78,622	日本コークス工業	68.7	7,419
一正蒲鉾	2.5	1,982	東亜合成	37.7	48,840	コーサー	15.4	216,370	ニチレキ	9	15,894
フジッコ	7.6	14,561	大阪ソーダ	4.5	23,670	コタ	7	11,487	ユシロ化学	3.9	4,095
ロックフィールド	8.4	12,566	関東電化	14.7	13,230	シーボン	0.8	1,244	ビービー・カストロール	2.2	1,955
日本たばこ産業	488	1,568,432	デンカ	27.4	71,952	ポーラ・オルビスHD	38.7	82,256	富士石油	15.6	4,102
ケンコーマヨネーズ	5.3	6,874	信越化学	626.9	3,019,777	ノビアホールディングス	6.7	36,314	MORESCO	1.9	2,198
わらべや日洋HD	5.4	12,079	日本カーバイド	2.3	3,059	アジュバホールディング	1.4	1,299	出光興産	83.9	243,519
なとり	4.6	9,052	堺化学	5.9	11,056	新日本製薬	4.3	6,050	ENEOSホールディングス	1,277.6	617,975
イフジ産業	1	1,047	第一稀元素化学工	6.9	6,762	アクシーアジア	3.8	5,240	コスモエネルギーHLDGS	29.8	122,776
ファーマフーズ	10.6	19,694	エア・ウォーター	70.9	134,213	エステー	5.8	8,833	ゴム製品 (0.8%)		
ユーグレナ	48.1	42,760	日本酸素HLDGS	73.1	229,680	アグロカネショウ	3	5,046	横浜ゴム	42.9	137,451
紀文食品	5.7	5,506	日本化学工業	2.6	4,830	コニシ	12.6	28,047	TOYO TIRE	43.4	84,282
ビッパルスホールディングス	4.3	5,495	東邦アセチレン	1.2	1,644	長谷川香料	14.4	47,232	ブリヂストン	241.1	1,454,556
ミヨシ油脂	2	2,028	日本パーカライズン	37.3	40,321	星光PMC	3	1,725	住友ゴム	74.1	99,479
理研ビタミン	6.4	13,484	高圧ガス	10.8	7,927	小林製薬	22	177,958	藤倉コンポジット	4.1	3,706
繊維製品 (0.4%)			チタン工業	0.7	987	荒川化学工業	6.3	6,381	オカモト	4.1	16,133
片倉工業	6.9	11,523	四国化成ホールディング	8.9	13,287	メック	6.2	21,049	フコク	4	5,240
グンゼ	5.3	23,876	戸田工業	1.7	4,039	日本高純度化学	1.9	5,014	ニッタ	7.6	23,636
東洋紡	32.9	33,607	ステラケミファ	4.5	13,545	タカラバイオ	20.4	33,558	住友理工	14.5	12,499
ユニチカ	23.1	5,590	保土谷化学	2.1	6,835	JCU	8.4	30,408	三ツ星ベルト	11	47,190
富士紡ホールディングス	3	9,450	日本触媒	11.5	63,215	新田ゼラチン	3.6	2,649	パンドラ・土石製品	11.8	16,602
倉敷紡績	5.6	12,488	大日精化	5.3	10,430	OA T アグリオ	2.4	4,538	ガラス・土石製品 (0.7%)		
シキボウ	3.3	3,290	カネカ	17.3	68,231	デクセリアルズ	21.8	68,430	日東紡績	8.5	22,618
日本毛織	20.3	20,827	三菱瓦斯化学	56.4	119,427	アース製薬	6.9	35,535	AGC	76.8	405,043
ダイトウボウ	9.4	874	三井化学	62.3	248,639	北興化学	7.6	7,455	日本板硝子	38.3	24,090
トーア紡コーポレーション	2.2	888	JSR	70.4	237,811	大成ラミック	2.4	7,046	石塚硝子	0.9	1,413
ダイドーリミテッド	8.3	2,166	東京応化工業	13.2	112,569	クミアイ化学	30.2	33,038	日本山村硝子	2.2	2,455
帝国繊維	8.5	14,033	大阪有機化学	5.7	14,523	日本農業	13.9	9,132	日本電気硝子	30.7	80,403
帝人	72.5	100,448	三菱ケミカルグループ	509	420,535	アキレス	4.8	6,993	オハラ	3.6	5,806
東レ	505.2	397,845	KHネオケム	12.6	30,479	有沢製作所	12.1	13,406	住友大阪セメント	10.6	39,230
住江織物	1.2	2,655	ダイセル	110.6	142,784	日東電工	54.8	594,032	太平洋セメント	48.1	136,748
日本フェルト	3.3	1,359	住友ベークライト	11.2	63,772	リック	10.7	8,720	日本ヒューム	6.5	5,037
イチカワ	0.7	947	積水化学	154.3	317,626	三光合成	9.4	5,376	日本コンクリート	15.1	5,134
日東製網	0.7	953	日本ゼオン	45.2	62,828	きもと	8.8	1,689	三谷セキサン	3.2	16,384
アツギ	3.7	1,576	アイカ工業	19.1	58,808	藤森工業	6	20,490	アジアバイラルHD	11.7	7,137
ダイニック	1.7	1,232	UBE	38.7	94,931	前澤化成工業	5	8,155	東海カーボン	63.4	79,123
セーレン	14.5	34,597	積水樹脂	11.1	25,341	未来工業	2.7	7,136	日本カーボン	4.3	19,113
ソト	1.8	1,438	タキロンシーアイ	16.3	8,704	ウェーブロックHLDGS	1.7	974	東洋炭素	4.7	23,923
東海染工	0.6	676	旭有機材	5	21,875	ジェイ エス ピー	5.4	9,784	ノリタケ	3.7	19,277
小松マテリアル	11.1	7,559	ニチバン	4.6	8,698	エフビコ	14.2	41,748	OTO	49.8	222,008
ワコールホールディングス	14.5	43,036	リケンテクノス	16.1	10,062	天馬	6.5	17,706	日本硝子	87.8	156,898
ホギメディカル	10.1	32,421	大倉工業	3.5	7,301	信越ポリマー	14	20,146	日本特殊陶業	57.5	159,361
クラウドディアHLDGS	1.3	867	積水化成成品	10.4	4,430	東リ	13.2	4,144	ダントーホールディングス	4.1	2,915
T S Iホールディングス	25.2	17,262	群栄化学	1.8	4,507	ニフコ	27.2	111,438	MA R UWA	2.8	56,644
マツオカコーポレーション	1.6	1,788	タイガース ポリマー	2.6	1,471	バルカー	6.3	24,507	品川リフラクトリーズ	2.1	10,773
ワールド	9.8	15,082	ミライアル	2	3,134	ユニ・チャーム	157.2	846,993	黒崎播磨	1.5	11,970
三陽商会	2.3	3,558	ダイキアクシス	2.3	1,646	ショーエイコーポ	1.7	950	ヨータイ	4	5,860
ナイガイ	1.9	533	ダイキョーニシカワ	16.4	13,070	医薬品 (5.3%)			東京薬業	5.3	1,759
オンワードホールディングス	49.3	18,586	竹本容器	2	1,648	協和キリン	91.1	246,197	ニッカト	2.6	1,674
ルックホールディングス	1.7	4,018	森六ホールディングス	3.8	7,663	武田薬品	668.3	3,032,077	フジインコーポレートッド	6	57,120
ゴールドウイン	13.4	181,168	恵和	4.8	5,332	アステラス製薬	713.4	1,611,213	クニミネ工業	1.7	1,638
デサント	13	53,950	日本化薬	57.8	72,943	住友ファーマ	56	35,386	エアードエマテリアル	1.1	1,172
キング	2.5	1,495	カーリットホールディングス	6.7	5,373	塩野義製薬	95.2	583,671	ニチアス	19.2	55,180
ヤマトインターナショナル	4.6	1,274	日本精化	4.2	11,928	わかもと製薬	5.6	1,288	ニチハ	9.5	29,925
パルプ・紙 (0.2%)			扶桑化学工業	7	28,350	日本新薬	17.8	113,528	鉄鋼 (0.9%)		
特種東海製紙	3.5	11,515	トリケミカル	10.1	27,148	中外製薬	236.4	980,114	日本製鉄	346.5	1,035,688
王子ホールディングス	313.7	172,503	ADEKA	26.4	68,191	科研製薬	12.9	46,452	神戸製鋼所	155	200,570
日本製紙	38.9	48,197	日油	23.3	146,254	エーザイ	91.8	874,578	中山製鋼所	15.8	13,129
三菱製紙	7	3,885	新日本理化	8	2,016	ロート製薬	73.1	232,823	合同製鐵	3.8	13,015
北越コーポレーション	47.4	41,759	ハリマ化成グループ	4.1	3,567	小野薬品	145.7	389,747	JFEホールディングス	206.6	419,294
中越パルプ	2.4	3,295	花王	183.7	940,176	久光製薬	16.8	59,488	東京製鐵	21.5	31,755
巴川製紙	1.8	1,193	第一工業製薬	2.8	5,003	持田製薬	8.7	28,057	共英製鋼	8.7	18,087
大王製紙	33.2	37,350	石原ケミカル	3.4	5,834	参天製薬	137.7	165,171	大和工業	12.6	75,184
阿波製紙	1.4	798	日華化学	2.3	1,966	扶桑薬品	2.4	4,821	東京製鋼	3.6	10,216
レーンゴ	68.6	59,284	ニイタカ	1.1	2,282	日本ケミファ	0.6	1,090	大阪製鐵	3.5	4,879
トーモク	4.3	8,582	三洋化成	4.6	19,619	ツムラ	23.8	64,890	淀川製鋼所	8.7	27,666
ザ・パックス	5.7	17,812	有機合成薬品	4.2	1,297	キッセイ薬品工業	11.6	34,080	中部鋼鉄	6.3	11,925
化学 (6.0%)			大日本塗料	9.1	8,271	生化学工業	14.6	11,081	丸一鋼管	23.3	76,959
北の達人コーポ	31.8	9,412	日本ペイントHOLD	333.5	411,539	栄研化学	12.4	18,823	モリ工業	1.4	4,697
クラレ	119.9	166,601	関西ペイント	69.1	151,985	鳥居薬品	4	14,440	大同特殊鋼	9.7	54,727
旭化成	471.5	458,722	神東塗料	4.8	624	JCRファーマ	25.5	33,634	日本高周波	2	674
共栄レザー	3.3	1,801	中国塗料	12.3	13,800	東和薬品	11.7	20,627	日本冶金工	5.6	22,764
レナック・ホールディング	72.9	165,555	日本特殊塗料	3.7	3,799	富士製薬工業	5.5	6,121	山陽特殊製鋼	7.6	21,888
住友化学	559.2	241,406	藤倉化成	10	4,390	ゼリア新薬工業	10.4	25,823	愛知製鋼	4.4	12,738
住友精化	3.1	13,221	太陽ホールディングス	11.6	30,009	そーせいグループ	25.9	73,556	日本金属	1.3	1,153
日産化学	35.8	230,731	DIC	29.5	77,319	第一三共	657.8	3,157,440	大太平洋金属	5.4	8,634
ラサ工業	3	6,627	サカタインクス	16.8	20,748	杏林製薬	16.2	28,204	新日本電工	45.7	13,070
クレハ	6.5	55,120	東洋インSCホールディン	14.6	32,470	大幸薬品	14.7	5,541	栗本鉄工所	3.6	7,282
多木化学	2.9	12,774	T&K TOKA	6.6	8,256	ダイト	5.3	12,688	虹技	0.7	839
テイカ	5	6,380	富士フィルムHLDGS	144.9	1,277,003	大塚ホールディングス	172.8	957,139	日本製鋼所	0.6	617
石原産業	13.7	17,851	資生堂	157.7	1,065,421	大正製薬HD	16.7	87,758	三菱製鋼	4.8	6,297
片倉コープアグリ	1.2	1,500	ライオン	90.6	124,846	ベプチドリーム	36.6	81,050	日亜鋼業	6	1,884

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在	
	株数	評価額 千円		株数	評価額 千円		株数	評価額 千円		株数	評価額 千円
日本精線	1	4,640	ダイジェット	0.6	519	平和	25.2	60,001	ダイヤモンドエレクトロニクスHD	2.5	1,920
エンビプロHD	4.2	2,385	旭ダイヤモンド	21.2	17,426	理想科学工業	6.8	15,667	日本電気	107.6	756,320
シンニッタン	6.4	1,580	DMG森精機	46.1	118,661	SANKYO	14.9	86,703	富士通	75.8	1,446,643
新家工業	1.3	2,930	ソディック	21.2	15,030	日本金銭機械	8.3	8,980	沖電気	34.4	30,547
非鉄金属 (0.7%)			ディスコ	36.6	829,356	マースグループHLDGS	4.4	11,404	岩崎通信機	2.5	2,065
大紀アルミニウム	10.9	14,758	日東工器	3.6	7,099	フクシマガリレイ	5.6	31,696	電気興業	3.1	7,061
日本軽金属HD	20.7	29,580	日進工具	6.3	7,320	オーイズミ	2.2	1,067	サンケン電気	7.1	91,093
三井金属	22.3	80,034	パンチ工業	5.3	2,936	ダイコク電機	4.1	12,041	ナカヨ	0.9	1,040
東邦亜鉛	4.5	7,659	富士ダイス	2.7	1,846	竹内製作所	13.8	61,410	アイホン	4.6	10,888
三菱マテリアル	51.2	133,196	豊和工業	3.2	2,540	アマノ	21.6	64,605	ルネサスエレクトロニクス	496.1	1,325,827
住友鉱山	89.7	441,951	石川製作所	1.5	2,040	JUKI	11.8	6,950	セイコーエプソン	97.7	215,623
DOWAホールディングス	17.2	78,930	東洋機械金属	4	2,620	サンデン	8.7	1,722	ワコム	57.9	35,666
古河機金	11.2	17,382	津田駒工業	1.1	477	ジャンメ	7.8	4,711	アルバック	18	107,352
エス・サイエンス	35.5	887	エンシュウ	1.2	841	マックス	9.4	23,490	アクセル	2.2	3,487
大阪チタニウム	11.3	34,013	島精機製作所	12.1	23,014	グローリー	18.3	51,962	EIZO	5.5	26,180
東邦チタニウム	13.9	24,464	オプトロン	11.2	27,384	新晃工業	7.6	16,005	ジャパンディスプレイ	61.7	2,406
UACJ	10.7	29,178	NCホールディングス	1.2	2,562	大和冷機工業	11.6	16,182	日本信号	17.1	18,365
CKサンエツ	1.8	7,632	フウキポンプ	5	7,170	セガサミーホールディングス	61.1	178,778	京三製作所	15.7	7,033
古河電工	25.9	64,814	フリュー	8	8,376	日本ビストンリング	2	2,906	能美防災	10.2	18,788
住友電工	268.4	474,262	ヤマシンフィルタ	18.2	5,678	リケン	3	8,577	ホーチキ	5.6	9,800
フジクラ	83.3	98,127	日阪製作所	7.3	6,409	T P R	8.9	13,714	星和電機	2.3	1,106
SWCC	8.7	16,277	やまびこ	12.5	19,525	ツバキ・ナカシマ	18.5	16,428	エレコム	18.2	28,064
タツタ電線	15.6	11,154	野村マイクロ・サイエンス	2.6	17,056	ホシザキ	48.9	257,018	パナソニックホールディング	898.2	1,507,628
カナレ電気	0.9	1,242	平田機工	3.6	29,844	大豊工業	6.5	5,544	シャープ	91.3	71,670
平河ヒューテック	4.4	6,481	PEGASUS	8.4	4,737	日本精工	139.7	125,422	アンリツ	53.7	65,514
リョービ	8.3	15,828	マルマエ	3.4	6,004	NTN	150.4	44,789	富士通ゼネラル	21.5	69,853
アールステイ	6.6	4,527	タツモ	4.1	10,701	ジェイテクト	67.8	88,411	ソニーグループ	532.6	7,429,770
アサヒHD	31	60,016	ナプテスコ	47.8	161,659	不二越	5.6	22,652	TDK	120.5	686,006
金属製品 (0.5%)			三井海洋開発	9.5	13,471	日本トムソン	18.7	10,920	帝国通信工業	3.6	5,846
稲葉製作所	4.1	6,703	レオン自動機	8	11,640	THK	43.9	136,660	タムラ製作所	32.6	22,428
宮地エンジニアリング	2.1	8,169	SMC	24.7	2,024,165	ユースイン精機	5.9	4,165	アルプスアルパイン	68	86,598
トーカロ	21.4	30,495	ホソカワミクロン	5.4	15,903	前澤給装工業	5.3	5,941	池上通信機	1.8	1,132
アルファCO	2.2	2,534	ユニオンツール	3.4	11,577	イーグル工業	8.3	14,076	日本電波工業	9.1	11,820
SUMCO	148.1	305,308	オイレス工業	10.5	20,758	前澤工業	3.3	2,488	鈴木	4	3,960
川田テクノロジー	1.8	9,540	日精工エスピー	3	12,210	メイビラー工業	7.1	32,837	メイコー	8.4	22,965
RS TECHNOLOGIES	5.2	17,472	サトールディングス	10.9	21,080	キッツ	27.9	30,829	日本トリム	1.7	4,926
ジェイテックコーポレーション	0.8	1,914	技研製作所	7.2	14,587	マキタ	94.6	378,021	ローランドディー・ジー	4.1	14,083
信和	3.3	2,435	日本エアーテック	3.8	4,392	三井E&S	21.7	10,524	フオスター電機	6.9	6,361
東洋製罐グループHD	46.3	99,012	カワタ	1.7	2,125	日立造船	62.4	57,283	SMK	1.8	4,177
ホッカンホールディングス	4.1	5,649	日精樹脂工業	5.6	5,532	三菱重工業	133	912,513	ヨコオ	6.1	10,626
コロン	4.4	3,924	オカダアイヨン	1.8	4,051	IHI	47.9	188,055	ティアック	10.3	1,236
横河ブリッジHLDGS	9.8	23,735	ワイエイシホールディングス	2.5	8,012	サナヤホールディングス	7.7	1,008	ホシデン	17.7	32,001
駒井ハルテック	1	1,851	小松製作所	356.3	1,377,099	スター精密	14.4	26,409	ヒロセ電機	12.6	247,968
高田機工	0.5	1,377	住友重機械	45.1	157,895	電気機器 (18.7%)			日本航空電子	15.6	44,070
三和ホールディングス	71.6	131,493	日立建機	30.3	122,018	日清紡ホールディングス	62.2	70,503	TOA	8.6	7,550
文化シャッター	22.3	24,842	日工	11.1	7,126	イビデン	43.6	351,808	マグセル	15.2	23,894
三協立山	8.9	6,007	巴工業	3.2	9,078	コニカミノルタ	169.7	79,538	古野電気	9.8	10,456
アルインコ	6	5,958	井関農機	7.3	9,460	ブラザー工業	101.7	223,740	スマグコーポレーション	6.9	9,108
東洋シャッター	1.4	869	TOWA	7.8	19,780	ミネベアミツミ	132.4	371,448	アイコム	2.9	8,642
LEXIL	113.2	213,778	丸山製作所	1	1,818	日立	369.8	294,178	リオン	3.2	5,894
日本フィルコン	3.9	1,813	北川鉄工所	3	3,552	東芝	146.3	661,422	横河電機	83.2	228,425
ノーリツ	11.5	20,861	ローツェ	4	47,680	三菱電機	785.9	1,605,986	新電元工業	2.9	9,729
長府製作所	8	19,872	タカキタ	1.6	705	富士電機	46.3	295,903	アズビル	52.6	243,906
リンナイ	42.3	125,694	クボタ	402.6	887,330	東洋電機製造	1.9	1,805	東亜ディーケーケー	2.7	2,241
ダイニチ工業	3	2,178	荏原実業	3.6	11,502	安川電機	90.1	606,553	日本光電工業	34.7	136,613
日東精工	11.4	6,760	三菱化工機	2.5	6,860	シンフォニアテクノロジー	8.3	14,126	チノー	3.1	7,126
三洋工業	0.7	1,328	月島ホールディングス	10.4	12,552	明電舎	11.7	22,698	共和電業	5.4	1,900
岡部	12.3	9,704	帝国電機製作所	5.3	13,191	オリジン	1.3	1,615	日本電子材料	5.1	8,710
ジーテクト	8.7	12,815	東京機械	1.4	677	山洋電気	3.3	25,443	堀場製作所	16.8	138,700
東プレ	13.8	20,989	新東工業	15.2	16,051	デンヨー	5.9	11,847	アドバンテスト	59.3	1,159,315
高周波熱練	12.1	11,870	渋谷工業	7.2	19,648	PHCホールディングス	10.6	15,582	小野測器	2.1	932
東京製綱	4.6	5,115	アイチコーポレーション	10.5	8,872	ソシオネクスト	10.4	264,264	エスペック	6.1	14,304
サンコー	5.3	2,750	小森コーポレーション	17.6	16,720	東芝テック	11.3	47,912	キーエンス	75.3	5,344,041
モリテックスチル	4.4	1,236	鶴見製作所	5.8	15,033	芝浦メカトロニクス	1.5	31,665	日置電機	3.9	35,529
パイオラックス	10.6	22,270	日本ギア工業	1.9	704	マブチモーター	18.8	74,372	シスメックス	64.9	641,276
エイチワン	7.9	5,609	酒井重工業	0.9	4,473	ニデック	185.1	1,435,080	日本マイクロナクス	12.4	23,126
日本発条	68.7	69,936	荏原製作所	31.1	225,599	ユーエムシエレクトロニクス	5.5	3,377	メガチップス	6.2	23,839
中央発条	5.7	4,064	石井鉄工所	0.7	1,729	トレッサ・セミコンダクター	3.6	8,240	OBARA GROUP	4.1	16,994
アドパネクス	0.7	681	西島製作所	6.5	11,141	東光高岳	4.5	9,567	澤藤電機	0.7	900
立川ブラインド	3.5	4,490	北越工業	7.6	10,206	ダブル・スコープ	24.9	31,324	原田工業	2.5	2,012
三益半導体	6.1	19,093	ダイキン工業	90.8	2,685,410	ダイヘン	6.8	38,624	コーセル	8.9	11,071
機械 (5.6%)			オルガン	10.4	42,016	ヤーマン	13.1	13,715	イリソ電子工業	6.9	29,359
日本ドライケミカル	1.4	2,326	トーヨーカネツ	2.9	10,106	JVCケンウッド	69.2	35,568	オプテックスグループ	13.8	28,317
日本製鋼所	20.9	63,494	栗田工業	42.5	247,562	ミマキエンジニアリング	7.2	5,781	千代田インテグレ	2.6	6,240
三浦工業	31.7	122,203	椿本チエイン	10.8	39,906	イーPEX	4.3	6,110	レーザータック	34.5	756,412
タクマ	23.5	35,931	大同工業	2.4	1,747	大崎電気	18	10,062	スタンレー電気	53.6	162,086
ツガミ	17	23,715	木村化工機	5.9	4,354	オムロン	69.7	642,494	ウシオ電機	38.1	72,332
オークマ	7.7	57,626	アネスト岩田	13	14,716	日東工業	10.2	35,343	岡谷電機	4.5	1,215
芝浦機械	7.6	37,468	ダイフク	117.7	359,220	IDEC	11.2	36,344	ヘリオステクノH	5.3	3,233
アマダ	121.6	171,516	サムコ	2	12,880	正興電機製作所	2.2	2,226	エノモト	1.5	2,521
アイダエンジニア	15.4	14,245	加藤製作所	2.7	3,453	不二電機工業	1.2	1,387	日本セラミック	7.7	20,073
TAKISAWA	1.5	1,825	油研工業	0.9	1,809	ジーエス・エアサコーポ	25	71,012	遠藤照明	2.6	3,075
FUJI	33.2	85,440	タダノ	40.2	45,627	サクサホールディングス	1.2	2,167	古河電池	5.5	5,830
牧野フライス	8.4	46,620	フジテック	26.6	97,888	メルコホールディングス	1.9	6,070	双信電機	2.3	821
オーエスジー	36.4	73,400	CKD	21.1	50,344	テクノメディカ	1.8	3,420	山一電機	6.6	15,067

銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
図研	6.6	23,925	テイ・エス テック	34.4	66,478	オカムラ	22.5	44,325	三井倉庫 HOLD	7	24,745
日本電子	18.9	100,340	ジャムコ	3.1	4,259	美津濃	7.5	28,650	住友倉庫	20.2	47,934
カシオ	56.3	68,010	精密機器 (2.6%)			電気・ガス業 (1.3%)			渋谷倉庫	3	7,917
ファナック	369.6	1,924,507	テルモ	231.6	1,062,117	東京電力HD	678.7	334,531	東陽倉庫	8.1	2,178
日本シイエムケイ	16.1	8,484	クリエートメディック	1.9	1,710	中部電力	277.3	476,817	日本トランスシティ	15.4	9,748
エンプラス	2.2	13,068	日機装	17.5	15,907	関西電力	290.5	515,056	ケイヒン	1	1,736
大真空	9.3	6,026	日本エム・ディ・エム	4.6	4,508	中国電力	119.7	110,626	中央倉庫	3.6	3,801
ローム	34.8	468,060	島津製作所	91.7	418,610	北陸電力	70.6	54,065	川西倉庫	1	1,017
浜松ホトニクス	60.4	435,061	JMS	7	3,962	東北電力	183.7	161,711	安田倉庫	5.1	4,998
三井ハイテック	7.8	72,696	クボテック	1.3	291	四国電力	64.1	62,946	ファイブホールディングス	1.1	1,353
新光電気工業	26.7	152,617	長野計器	5.4	10,465	九州電力	173	157,637	東洋埠頭	1.7	2,269
京セラ	117	932,724	プイ・テクノロジー	3.6	9,007	北海道電力	72.3	43,669	上組	36	119,016
太陽誘電	36.7	157,846	東京計器	5.7	7,404	沖縄電力	17.5	20,370	サンリツ	1.4	1,024
村田製作所	228.4	1,945,968	愛知時計	2.9	4,773	電源開発	56.9	117,498	キムラユニティ	2.7	3,240
双葉電子工業	14.3	7,192	インターアクション	3.6	5,176	エフオン	4.9	2,709	キューソー流通システム	3.5	3,353
北陸電気工業	2.2	2,686	オーバル	5.1	2,096	イーレックス	13.4	15,155	東海運	3.3	930
ニチコン	15.4	22,499	東京精密	16.5	115,665	レノバ	20.1	31,054	エーアイティ	4.8	8,808
日本ケミコン	7.4	9,420	マニー	30.2	49,543	東京瓦斯	159.3	512,627	内外トランスライン	2.7	6,612
KOA	11.4	20,349	ニコン	108.9	190,629	大阪瓦斯	152.6	342,129	日本コンセプト	2.4	4,106
市光工業	10.8	6,112	トプコン	39.6	82,981	東邦瓦斯	29.7	74,428	情報・通信業 (8.2%)		
小糸製作所	90.6	258,028	オリンパス	463.5	1,042,875	北海道瓦斯	4.6	10,391	NEC ネットエスアイ	25.2	50,122
ミツバ	13.9	11,161	理研計器	4.7	25,427	広島ガス	16.4	6,051	クロスキャット	4.3	4,910
SCREENホールディングス	12.9	209,560	タムロン	5.6	21,028	西部ガス HLDGS	7.2	15,364	システナ	127.4	40,003
キャノン電子	8.2	15,752	HOYA	160.8	2,885,556	静岡ガス	17.3	21,521	デジタルアーツ	4.8	29,760
キャノン	413.1	1,491,291	シード	2.9	1,592	メタウォーター	9.5	17,727	日鉄ソリューションズ	12.9	53,470
リコー	188.8	238,171	ノーリツ鋼機	7.2	16,473	陸運業 (2.9%)			キューブシステム	4.4	5,469
象印マホービン	22.6	39,866	A&D ホロンホールディングス	10.9	18,922	SBSホールディングス	6.7	21,842	コア	3.4	5,827
MUTOHホールディングス	0.8	1,372	朝日インテック	84.2	237,444	東武鉄道	82.7	310,042	手間いらず	1.3	4,953
東京エレクトロン	159.4	3,235,820	シチズン時計	82.7	71,204	相鉄ホールディングス	24.8	64,852	ラクーンホールディングス	6.4	4,793
イノテック	5.1	8,170	リズム	1.8	2,896	東急	211.1	377,024	ソリトンシステムズ	3.9	4,578
輸送用機器 (8.0%)			大研医器	4.3	2,210	京浜急行	85.3	111,060	ソフトクリエイトHD	6.2	10,608
トヨタ紡織	31.7	82,261	メニコン	25.9	65,203	小田急電鉄	114.1	228,085	T I S	82.6	298,929
芦森工業	1.1	2,077	シンシア	0.5	278	京王電鉄	39.8	185,507	JNSホールディングス	2.6	1,515
ユニプレス	13.6	14,837	松風	3.4	7,653	京成電鉄	48.6	281,539	グリー	20.3	13,438
豊田自動織機	55	541,035	セイコーグループ	11.7	30,162	富士急行	9.2	46,552	GMOペパボ	1.1	1,923
モリタホールディングス	13.2	20,367	ニプロ	62.7	64,424	東日本旅客鉄道	127.7	998,103	コーエーテックモHD	47.3	112,313
三菱工業	11.6	9,941	その他製品 (2.3%)			西日本旅客鉄道	96.3	575,103	三菱総合研究所	3.7	19,610
デンソー	155.3	1,500,198	KYORITSU	9	1,251	東海旅客鉄道	58	1,027,470	ボルテージ	1.6	494
東海理化電機	21.2	45,156	中本パックス	1.8	2,919	西武ホールディングス	91	137,410	電算	0.7	1,136
川崎重工業	56.7	201,455	スノーピーク	12.9	23,994	鴻池運輸	12.7	20,091	AGS	2.1	1,754
名村造船所	14.9	8,746	パラマウントベッドHD	17.4	42,664	西日本鉄道	20.1	48,561	ファインデックス	6.4	3,708
日本車輛	2.9	5,968	トランザクション	4.9	8,374	ハマキョウレックス	5.9	22,007	ブレインパッド	5.8	5,289
三菱ロジスネクスト	11.9	14,744	粧美堂	1.6	609	サイイ引越センター	3.5	17,150	K L a b	15.1	5,194
近畿車輛	0.8	1,169	ニホンフラッシュ	7	6,846	近鉄グループHLDGS	75	367,650	ホルトウインホールディン	13	10,530
日産自動車	1,069.8	580,580	前田工織	6.3	19,656	阪急阪神 HLDGS	100.3	472,814	ネクソン	195.6	571,836
いすゞ自動車	219	396,171	永大産業	6.1	1,274	南海電鉄	35.9	115,777	アイスタイル	21.9	15,636
トヨタ自動車	4,134.2	593,411	アートネイチャー	7.7	5,898	京阪ホールディングス	41.4	154,049	エムアップホールディングス	9.3	11,429
日野自動車	96.9	60,494	パンダイナムコHLDGS	206.3	720,605	神戸電鉄	2.1	6,436	エイチーム	4.6	3,155
三菱自動車工業	293.7	143,854	アイフジスジャパン	1.6	992	名古屋鉄道	83.2	197,308	エニグモ	9.7	3,880
エフテック	4.1	3,927	S H O E I	17	44,285	山陽電鉄	5.7	12,568	テクノスジャパン	4.8	2,942
レシップホールディングス	2.3	1,156	フランスベッドHLDGS	9.7	10,873	アルプス物流	5.9	8,389	e n i s h	4.4	3,410
GMB	1.1	2,343	パイロットコーポレーション	11.8	52,958	ヤマトホールディングス	96.2	245,646	コロブラ	29.2	19,710
ファルテック	0.9	553	萩原工業	5.1	7,267	山丸	19.1	93,399	オルトプラス	4.6	998
武蔵精密工業	18.5	33,503	フジールインターナショナル	15.3	23,424	丸連	2.8	663	ブロードリーフ	44.4	19,447
日産車体	13.1	11,410	タカラトミー	34.6	61,138	丸全昭和運輸	4.6	17,802	クロス・マーケティングG	3.5	2,600
新明和工業	23.3	31,222	広済堂ホールディングス	3.9	8,291	センコーグループHLDGS	39.6	38,808	デジタルハーツHLDGS	4.7	6,124
極東開発工業	12.4	21,687	エステールホールディングス	1.3	798	トナミホールディングス	1.6	7,192	システム情報	6.1	4,556
トピー工業	6	13,008	タカノ	2.1	1,524	ニッコンホールディングス	24.1	68,612	メディアドゥ	3.1	4,612
ティラド	1.9	3,412	プロネクサス	6.4	6,259	日石輸送	0.6	1,607	じげん	21.9	16,249
タチエス	11.9	17,885	ホクシン	5	665	福山通運	5.7	21,090	ブイキューブ	9.2	4,452
NOK	29.2	59,991	ウッドワン	1.9	2,179	セイノーホールディングス	46.6	92,920	エンカレッジ・テクノロジー	1.3	674
フタバ産業	20.3	10,129	大建工業	4.6	10,672	エスライン	1.6	1,288	サイバーリンクス	1.9	1,297
K Y B	7.3	34,894	凸版印刷	98.5	304,857	神奈川中央交通	2.2	6,930	ディー・エル・イー	4.3	1,427
大同メタル工業	14.8	7,311	大日本印刷	82.2	332,745	AZ-COM丸和ホールディ	18.1	35,982	フィックスターズ	8.5	11,313
プレス工業	33.7	20,085	共同印刷	2.1	6,363	C&Fロジホールディングス	7.4	8,954	CARTA HOLDINGS	3.5	4,609
ミクニ	6.6	2,725	N I S S H A	14.2	22,294	九州旅客鉄道	53.2	161,674	オブティム	6.3	6,678
太平洋工業	17.5	22,907	光村印刷	0.5	597	SGホールディングス	144.2	305,343	セレス	3.1	2,920
河西工業	7.7	1,170	TAKARA & COMPANY	4.9	11,181	NIPPON EXPRESS	28.1	234,410	S H I F T	5	134,975
アイシン	58	255,432	アシックス	69.5	301,908	海運業 (0.5%)			ティーガイア	7.8	13,798
マツダ	249.1	345,003	ツツミ	1.3	2,805	日本郵船	201.1	617,175	セック	0.8	2,644
今仙電機製作所	3.7	2,349	ローランド	5.5	23,650	商船三井	132.5	439,370	テクマトリックス	13.8	25,019
本田技研	612.1	2,761,183	小松ウオール工業	2.7	6,963	川崎汽船	56.5	183,738	プロシッパ	3.3	4,814
スズキ	138.3	705,330	ヤマハ	47.5	277,115	NS ユナイテッド海運	4	13,700	ガホー・オンライン・インター	22.1	64,244
SUBARU	238.3	641,503	河合楽器	2	6,500	明治海運	5.7	3,169	GMOペイメントゲートウェイ	15.1	174,707
安永	2.5	2,307	クリナップ	8.9	6,167	飯野海運	27.5	22,440	ザッパラス	1.6	556
ヤマハ発動機	118.4	472,416	ピジヨン	48	98,664	共栄タンカー	1.1	927	システムリサーチ	2.3	5,993
T B K	6.3	2,274	キングジム	6.6	6,045	乾汽船	9.6	12,470	インターネットイニシアティブ	42.1	115,838
エクセディ	12.4	28,392	リンテック	15.1	33,982	空運業 (0.5%)			さくらインターネット	8.5	6,001
豊田合成	22	56,848	イトーキ	15.4	14,660	日本航空	184.7	527,780	ヴァインクス	1.7	2,478
愛三工業	12.3	13,849	任天堂	475.4	2,959,365	ANAホールディングス	204.6	653,492	GMOグローバルサインHD	2.3	7,751
盟和産業	0.8	782	三菱鉛筆	10.6	18,221	パスコ	1.1	1,948	SRAホールディングス	3.8	12,369
日本プラス	4.6	2,014	タカラスタンダード	13.8	24,619	倉庫・運輸関連業 (0.1%)			システムインテグレータ	1.7	761
ヨロズ	7.3	6,540	コクヨ	36.1	69,312	トランコム	2.2	14,564	朝日ネット	8.2	4,961
エフ・シー・シー	13.4	24,428	ナカバヤシ	8	3,880	日新	5.6	14,089	e B A S E	10.7	8,399
シマノ	30.8	715,638	グローブライド	6.1	13,645	三菱倉庫	16.2	58,303	アバントグループ	9.5	13,870

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在	
	株数	評価額 千円		株数	評価額 千円		株数	評価額 千円		株数	評価額 千円
アドソル日進	3.3	5,841	Zホールディングス	1,074.2	388,860	卸売業 (6.8%)			伊藤忠	490.9	2,755,421
ODKソリューションズ	1.3	725	トレンドマイクロ	43.6	321,855	高千穂交易	2.2	6,688	丸紅	621.6	1,493,704
フリービット	3.9	6,388	IDホールディングス	5.1	6,186	オルパルスカアHLDGS	0.9	1,780	高島	1	3,535
コムチュア	10	21,450	日本オラクル	14.4	162,648	伊藤忠食品	1.8	9,252	長瀬産業	36.4	87,997
サイバーコム	0.9	1,377	アルファシステムズ	2.3	8,303	エレマテック	7.1	12,602	蝶理	4.2	11,655
アステリア	5.8	4,379	フューチャー	18.8	34,234	あらた	6.1	28,243	豊田通商	69.8	505,212
アイル	3.5	9,691	CAC HOLDINGS	4.6	7,990	トーメンデバイス	1.1	6,391	三共生興	11.4	6,418
マークライNZ	4.2	10,680	S Bテクノロジー	3.2	7,891	東京エレグロンデバイス	2.9	31,871	兼松	30.8	61,107
メディカル・データ・ビジ	11.5	8,349	オービックビジネスC	14.8	81,696	円谷フィールズホールディ	13.7	39,072	ツカモトコーポレーション	0.9	1,214
gumi	11.1	7,259	伊藤忠テクノソリューションズ	40.5	147,703	双日	79.4	250,745	三井物産	565.4	3,079,168
ショーケース	1.3	505	アイティフォー	9.8	10,907	アルフレッサホールディングス	80	172,080	日本紙パルプ	4.2	21,210
モバイルファクトリー	1.3	1,171	神栄	1	6,410	横浜冷凍	21.4	24,973	カメイ	8.5	12,121
テラスカイ	3.3	9,164	エックスネット	0.8	821	ラサ商事	0.8	878	東都水産	0.3	1,941
デジタル・インフォメーション	4.3	6,755	大塚商会	42.8	243,532	アルコックス	10.3	14,152	OUGホールディングス	0.9	2,196
PCIホールディングス	2.4	2,486	サイボウズ	10.4	24,533	神戸物産	61.6	228,905	スターゼン	6.2	14,607
アイビーシー	0.9	557	電通国際情報S	9.1	48,139	ハイパー	1.1	481	山善	21.3	23,749
ネオジャパン	2.7	2,772	ACCESS	8.8	8,703	あいホールディングス	12.7	30,035	椿本興業	1.3	5,161
P R T I M E S	1.9	2,673	デジタルガレージ	13.4	51,523	ディーブイエックス	1.7	1,574	住友商事	493.3	1,504,071
ラクス	35.7	88,893	イーエムシステムズ	12.6	10,684	ダイワボウHD	32.4	93,247	内田洋行	3.2	18,240
ランドコンピュータ	1.4	1,853	ウェザーニューズ	2.3	15,364	マクニカホールディングス	18.8	118,628	三菱商事	492.7	3,346,418
ダブルスタンダード	3.1	7,604	C I J	12.8	8,140	ラクト・ジャパン	3	6,036	第一実業	2.8	16,240
オーブントリア	5.3	6,365	ビジネスエンジニアリング	1.2	4,116	グリムス	3.3	9,385	キャノンマーケティングJPN	18.4	66,497
マイネット	1.9	642	日本エンタープライズ	6.9	931	パイタルK S K HD	11.6	10,532	西華産業	3.1	6,255
アカツキ	3.6	7,383	WOWOW	6	6,696	八洲電機	6.4	8,761	佐藤商事	5.5	7,920
ベネフィットジャパン	0.3	358	スカラ	7	5,565	メデアホールディングス	5.1	4,707	菱洋エレフトロ	6.8	24,038
UBICOMホールディングス	2.3	3,979	インテリジェントウェブ	3.1	2,442	レスターホールディングス	7.7	19,534	東京産業	7.2	6,386
カナミックネットワーク	8	3,488	IMAGICA GROUP	6.4	3,852	ジュエテックHD	1.4	1,604	ユアサ商事	7.2	32,184
ナムシステムコーポレーション	5.4	637	ネットワンシステムズ	28.1	95,680	大光	2.6	1,497	神鋼商事	2	11,360
チェンジホールディングス	18.5	37,906	システムソフト	27	2,052	OCHIホールディングス	1.4	1,727	トルク	3.2	854
シンクロ・フード	3.7	2,604	アルゴグラフィックス	6.9	27,945	TOKAIホールディングス	39.6	35,085	阪和興業	14.3	66,280
オークネット	3.8	6,368	マーベラス	12.1	8,070	黒谷	1.7	1,016	正栄食品	5.3	22,551
キャピタル・アセット・プラン	1.1	811	エイベックス	12.7	19,138	Cominix	1.2	942	カナデン	5.2	6,775
セグエグループ	1.6	1,670	B I P R O G Y	27.8	99,079	三洋貿易	8.9	12,406	R Y O D E N	6.3	13,236
エイトレッド	1	1,375	都築電気	3.9	7,269	ビューティガレージ	1.3	5,531	岩谷産業	18.1	135,876
マクロミル	14.9	12,769	TBSホールディングス	38.6	93,354	ウイン・パートナーズ	5.7	5,814	ナイス	2.5	3,712
ビーグリー	1.1	1,270	日本テレビHD	67	88,373	ミタチ産業	1.5	2,119	ニチモウ	0.8	2,900
ユー	2.2	4,802	朝日放送グループHD	7	4,522	シッパルスケアHD	28.6	67,681	極東貿易	4.7	7,896
オーザローカル	2.7	8,221	テレビ朝日HD	18.2	28,519	明治電機工業	2.9	3,984	アスタナホールディングス	13.6	6,160
テモナ	1.3	367	スカパーJSATHD	67.2	38,572	デリカフーズHLDGS	2.4	1,399	三菱オプリア	21.1	31,797
ニーズウェル	3.2	2,425	テレビ東京HD	5.4	16,011	スターティアホールディングス	1.2	1,404	稲畑産業	16	51,760
マネーフォワード	18.2	114,951	日本BS放送	2.1	1,913	コメダホールディングス	19.4	51,351	G S I クレオス	4.6	8,781
サインポスト	2.2	1,100	ビジョン	9.9	18,503	ピーバントットコム	0.9	421	明和産業	10.5	7,119
SUN ASTERISK	5.3	6,211	スマートバリュー	1.4	555	アセンテック	2.8	1,867	クワザワホールディングス	1.9	860
電算システムHD	3.7	12,783	USEN-NEXT HLDGS	8.4	28,896	富士興産	1.4	1,965	ワキタ	14.5	18,966
APPIER GROUP	28.7	51,373	ワイヤレスゲート	2.5	562	協栄産業	0.6	1,287	東邦ホールディングス	19.8	50,925
ソルクシーズ	4.8	2,097	日本通信	69.8	18,497	フルサト・マルカHD	7.9	19,449	サンゲツ	19.9	48,018
フェイス	1.6	804	クロップス	0.9	955	ヤマエグループHD	4.5	13,104	ミツウロコグループ	10.2	13,933
プロトコーポレーション	9.4	10,396	日本電信電話	967.5	3,948,367	小野建	7.7	12,320	シナネンホールディングス	2.6	9,945
ハイマックス	2.3	3,337	KDDI	583.5	2,639,170	南陽	1.2	2,618	伊藤忠エネクス	19.8	24,334
野村総合研究所	150.4	569,414	ソフトバンク	1,213.1	1,848,764	佐島電機	3.8	6,581	サンリオ	22.5	131,310
サイバネットシステム	6.3	5,569	光通信	8.9	192,462	エコートレーディング	1.2	946	サンワテクノス	4	9,640
CEホールディングス	3.3	1,914	エムティーアイ	5.1	3,381	伯東	4.5	23,265	リョーサン	8.4	34,020
日本システム技術	2.4	6,156	GMOインターネットグループ	27.9	75,302	コドーテック	6.3	7,093	新光商事	10.6	13,038
インテージホールディングス	8.6	14,241	ファイバーゲート	4.1	6,154	中山福	3.2	1,094	トーホー	3.4	10,009
東邦システムサイエンス	1.6	1,937	アイドマーケティングコム	1.3	354	ナガイレーベン	9.9	22,651	三信電気	3.2	6,870
ソースネクスト	38.3	7,660	K A D O K A W A	39.9	138,213	三菱食品	7.3	26,280	東陽テクニカ	8.1	11,518
インフォコム	9.8	23,088	学研ホールディングス	12.6	11,138	松田産業	6.1	13,481	モスフードサービス	11.8	37,701
シンプレクスHD	12.9	32,430	ゼンリン	13.3	12,302	第一興商	30.8	79,125	加賀電子	6.5	39,650
HEROZ	2.5	5,407	密友社ホールディングス	2.5	747	メディアパルHD	76.2	179,717	ソーダニツカ	4.5	3,582
ラクスル	18.1	22,806	インプレスホールディングス	5	1,035	S P K	3.5	6,163	立花エレテック	5.8	16,918
メルカリ	45.5	149,422	アイネット	4.5	6,808	萩原電気HLDGS	3	9,375	フオーバル	3.1	3,289
I P S	2.5	5,575	松竹	4.3	49,643	アズワン	11.3	66,590	P A L T A C	12.5	64,812
F I G	6.7	1,855	東宝	47.3	269,751	スズデン	2.7	6,093	三谷産業	13.7	4,329
システムサポート	2.9	6,165	東映	2.1	38,409	尾家産業	1.4	1,730	太平洋興発	2.2	1,603
イーソル	4.8	4,752	N T T データ	237	499,596	シモジマ	5.5	6,187	西本WISMETTAC HD	2	9,040
アルテリア・ネットワークス	6.9	13,579	ビー・シー・エー	4.3	5,964	ドウシシャ	8.3	18,733	ヤマシタヘルスケアHLDGS	0.5	1,014
東海ソフト	0.9	922	ビジネスB太田昭和	3.2	7,977	小津産業	1.4	2,233	コア商事HLDGS	4.4	3,066
ウイングアーク1ST	7.8	19,539	D T S	16.1	57,074	高速	4.2	8,752	KPPグループホールディン	18.5	11,488
ビット・コミュニケーションズHD	2	3,074	スクウェア・エニックス・HD	38	260,832	たけびし	3	5,121	ヤマタネ	3.5	5,747
サーバーワークス	1.5	5,010	シーイーシー	10.6	19,281	リック	1.3	3,827	丸紅建材リース	0.5	1,091
東名	0.4	1,006	カブコム	75	414,900	丸文	7	9,149	泉州電業	4	14,300
ヴィッツ	0.6	897	アイ・エス・ビー	3.8	6,026	ハピネット	6.7	14,076	トラスコ中山	16.8	38,623
トピックスシステムズ	1.4	1,450	ジャズステック	4.6	6,067	橋本総業HLDGS	3.1	3,766	オートバックスセブン	28	42,840
Sansan	24.7	44,842	S C S K	61.7	141,786	日本ライフライン	23.5	25,356	モリト	5.6	5,868
Link-U	1.4	1,719	NSW	2.9	7,293	タカショー	6.9	4,588	加藤産業	9.9	39,501
ギフティ	8.2	14,350	アイネス	5.4	7,954	I D O M	24	21,240	北恵	1.4	1,041
モデル	10.1	55,146	T K C	12.1	46,948	進和	4.8	10,680	イエローハット	14.2	26,170
ベース	2.6	14,222	富士ソフト	8.5	78,200	エスケイジャパン	1.5	820	JKホールディングス	6.1	5,898
JMDC	12.4	74,214	NSD	27	76,059	ダイトロン	3.1	9,579	日伝	4.7	10,669
フォーカスシステムズ	5.5	5,967	コナミグループ	32.3	250,066	シークス	11.4	17,989	北沢産業	3.2	1,286
クレスコ	5.9	12,030	福井コンピュータHLDS	5.3	15,868	田中商事	1.7	1,077	杉本商事	3.5	7,224
フジ・メディア・HD	72.2	98,083	JBCCホールディングス	5.5	13,057	オーハシテクニカ	3.8	6,049	因幡電機産業	20.7	69,138
オービック	25.2	596,106	ミロク情報サービス	6.9	10,812	白銅	2.8	6,664	東テック	2.6	10,998
ジャストシステム	10.9	48,941	ソフトバンクグループ	372.5	2,418,270	アルコー通産	0.6	670	ミスミグループ本社	120.3	373,170
TDCソフト	6.3	10,798						アルテック	3.4	935	

銘柄			2023年6月15日現在			銘柄			2023年6月15日現在			
		千株	千円						千株		千円	
タキヒヨー		1.5		1,396	申カツ田中 HLDGS	2.2		3,735	シルバーライフ	1.5		1,890
蔵王産業		1		2,234	パロックジャパン	5.1		4,324	GENKY DRUGSTORES	3.5		14,385
ズケン		23.4		85,831	グスリのアオキ HLDGS	7.1		55,742	ナルミヤ・インターナショナル	1		953
ジェコス		4.7		4,079	力の源 HD	3.5		4,840	ブックオフ GHD	4.1		5,129
グローセル		7.4		3,048	FOOD&LIFE COMPAN	42.5		129,582	ギフトホールディングス	1.7		8,721
小売業 (4.3%)					メディカルシステムネットワーク	6.8		2,468	アインホールディングス	11		55,264
ローソン		19.8		123,631	一家ホールディングス	1.4		875	元気寿司	2.2		7,117
サンエー		6		27,360	ジャパンクラフトホールディ	1.8		1,004	ヤマダホールディングス	326.5		140,754
カワチ薬品		6.2		13,491	はるやま HLDGS	2.6		1,237	アークラフズ	11.6		18,293
エービーシー・マート		11.6		92,405	ノジマ	26		36,140	ニトリホールディングス	32.2		550,781
ハードオフコーポレーション		2.4		3,259	カップ・クリエイト	12.4		18,786	グ鲁班軒	6.4		6,777
アスクル		16.5		31,416	ライトオン	4.6		2,612	愛眼	4.9		940
ゲオホールディングス		7.8		12,862	良品計画	87.1		121,504	ケユーホールディングス	4.6		5,869
アダストリア		9.6		28,608	パリティホールディングス	7.8		2,550	吉野家ホールディングス	31.2		80,652
ジーフット		4.1		1,111	アドヴァングループ	7.5		7,132	松屋フーズ HLDGS	3.7		15,299
シー・ヴィー・エス・ベイエリア		0.8		395	アルビス	2.6		6,198	サガミホールディングス	12.8		16,089
くら寿司		9.3		28,365	コナカ	7.3		2,649	関西フードマーケット	7.2		11,642
キャンドゥ		2.8		6,804	ハウス ローゼ	0.8		1,280	王将フードサービス	5.2		33,488
IKホールディングス		1.9		703	G7ホールディングス	10		12,720	ミニストップ	5.7		8,293
バルグループ HLDGS		7.8		28,899	イオン北海道	11.8		10,112	アークス	14.7		35,970
エディオン		31.5		43,848	コジマ	13.2		7,497	パロホールディングス	15.5		30,240
サーラコーポレーション		17		13,056	ヒマラヤ	1.9		1,786	ベルク	4		24,840
ウツ		3		2,109	コーナン商事	10.8		37,854	大庄	3.3		3,679
ハローズ		3.7		12,765	エコス	2.9		5,425	ファーストリテイリング	35.8		1,309,206
フジオフード G 本社		8.7		13,154	ワタミ	9.5		8,512	サンドラッグ	30.2		129,618
あみやき亭		1.9		6,650	マルシェ	2		518	サックスパーホールディング	7.5		7,162
ひらまつ		13.1		3,471	パンパシフィック HD	160.9		405,146	ヤマザワ	1.1		1,379
大黒天物産		2.4		12,192	西松屋チェーン	17.5		28,770	やまや	1.3		3,445
ハニースホールディングス		6.4		9,491	ゼンショーホールディングス	43.5		268,786	ペルルーナ	19.1		13,522
ファーマライズ HD		1.3		800	幸楽苑ホールディングス	5.1		5,100	銀行業 (5.8%)			
アルペン		6.6		13,127	ハルクスレイ	2.1		1,291	いざぎホールディング	87.7		65,494
ハブ		2		1,584	サイゼリヤ	11.7		42,237	しずおかフィナンシャル	167.1		169,439
クオールホールディングス		10.9		19,816	V Tホールディングス	30.2		15,734	ちゅうぎんフィナンシャ	62.2		53,504
ジンスホールディングス		4.7		14,687	魚力	2.5		5,437	楽天銀行	25.6		46,950
ビックカメラ		42.5		45,475	ポブラ	1.7		317	島根銀行	2.5		1,200
DCMホールディングス		46.2		57,103	フジ・コーポレーション	4.8		7,252	じもとホールディングス	5.5		2,106
ペッパーフードサービス		19.1		2,483	ユナイテッドアローズ	8.5		20,493	めぐろフィナンシャル G	367.8		125,383
MonotaRO		112.9		212,308	ハイデイド高	11.8		27,765	東京きらぼし FG	9.5		29,735
東京一番フーズ		1.4		693	YU-WA CREATION H	3.6		702	九州フィナンシャル G	130.2		71,102
DDグループ		3.9		5,140	コロワイド	36.7		73,069	ゆうちょ銀行	207.3		225,646
きちりホールディングス		1.4		1,247	ピーシーデポコーポ	8.7		4,167	富山第一銀行	24.5		16,660
アークランドサービス HD		6.4		18,745	香番屋	6.2		33,322	コソルデア・フィナンシャル	397.7		217,343
J. フロント リテイリング		99.1		140,920	トップカルチャー	2		376	西日本フィナンシャル HD	46		55,108
ドール・日レスHD		14.1		28,721	P L A N T	1.4		971	33 F G	6.5		10,003
マツコヨコカ&カンパニー		48.3		390,795	スギホールディングス	16		96,064	第四北越フィナンシャル G	11.5		35,305
プロコンピリー		4.3		12,538	兼売堂ホールディングス	4.5		11,601	ひろぎん HLDGS	96.6		76,400
Z O Z O		52.7		155,465	ヴァイ・ホールディングス	9.5		788	おきなわ F G	7.1		14,902
トレジャー・ファクトリー		3.8		5,969	スクロール	11.8		10,808	十六 F G	9.6		28,992
物語コーポレーション		13.3		45,685	ヨドンホールディングス	6.9		12,300	北国 F HD	8.3		34,984
三越伊勢丹 HD		134.1		196,523	木曾路	12.1		28,822	プロクシアホールディングス	9		18,450
Hamee		2.9		3,352	SRSホールディングス	13		12,998	あいちフィナンシャル	10.3		22,443
マーケットエンタープライズ		0.6		820	千趣会	14.5		6,061	S B I 新生銀行	17.1		48,136
ウエルシアHD		41.3		120,265	タカキヨー	4.2		310	あおぞら銀行	46.8		123,107
クリエイティ HD		13.2		46,266	リテールパートナーズ	11.7		19,656	三菱UFJフィナンシャル G	4,644.1		4,597,194
丸善 CHI HD		7.2		2,527	ケーヨー	13		10,699	リそなホールディングス	937.5		621,562
ミサワ		1.1		668	上新電機	7.2		13,968	三井住友トラスト HD	134.7		679,561
ティアーライフ		0.9		1,275	日本瓦斯	42.7		84,524	三井住友フィナンシャル G	541.8		3,177,657
イー・ピーホールディングス		1.3		956	ロイヤルホールディングス	15.3		41,141	千葉銀行	206.6		178,316
テムニー		1.9		2,394	東天紅	0.5		385	群馬銀行	143.4		73,707
シュッピン		6		6,198	いなげや	7.6		11,742	武蔵野銀行	9.6		20,217
オイシックス・ラ・大地		10.7		24,898	チヨダ	7.5		6,457	千葉興業銀行	13.4		7,396
ネクスティー		18.2		52,288	ライフコーポレーション	7		21,140	筑波銀行	33.3		6,626
ジョイフル本田		23.7		41,498	リンガーハット	10.2		24,918	七十七銀行	23.6		56,663
鳥貴族ホールディングス		2.9		7,780	Mr Ma x HD	11.1		6,893	秋田銀行	4.9		8,143
ホットランド		6		10,332	テンアライド	6.9		1,752	山形銀行	8.2		8,774
すかいらーく HD		108.9		200,484	AOKIホールディングス	14.8		12,343	岩手銀行	5.2		10,483
SFPホールディングス		4.3		8,651	オークワ	13		11,193	東邦銀行	57.9		13,143
縮半ホールディングス		6.1		8,357	コメリ	12.1		35,803	東北銀行	2.9		2,900
ヨシックスホールディングス		1.2		2,724	青山商事	17		21,437	ふくおかフィナンシャル G	59.2		162,356
ユニテック・スーパーマケ		25.6		28,288	しまむら	9.4		125,349	スルガ銀行	63		31,941
ゴルフダイジェスト・オン		3.6		3,024	はせがわ	2.9		977	八十二銀行	159.1		98,053
B E E N O S		3.4		6,113	高島屋	60		113,100	山梨中央銀行	7.6		8,747
あさひ		7.1		9,073	松屋	13.5		15,808	大垣共立銀行	14.2		25,801
日本調剤		5.4		6,183	エイチ・ツウ・オリテイリング	38.7		56,811	福井銀行	6.7		9,520
コスモス薬品		7.9		109,257	近鉄百貨店	3.4		8,639	清水銀行	3		4,260
トーエル		2.9		2,157	丸井グループ	58.7		143,433	富山銀行	0.9		1,467
セブン&アイ・HLDGS		274.6		1,690,986	アクシアルリテイリング	5.4		19,197	滋賀銀行	12.2		32,988
クワイエントラスト・ホル		59.8		59,919	井筒屋	2.9		1,041	南都銀行	11.1		26,295
ツルハホールディングス		16.7		174,014	イオン	270		754,020	百五銀行	69.1		28,123
サンマルクホールディングス		6.5		12,369	イズミ	12.1		41,127	京都銀行	23.5		167,790
フェリシモ		1.4		1,414	平和堂	13.3		28,209	紀陽銀行	26.5		38,610
トリドールホールディングス		19.8		58,429	フジ	12.2		22,252	ほくほくフィナンシャル G	46.9		53,935
TOKYO BASE		8.1		3,078	ヤオコー	9		64,431	山陰合同銀行	46.4		36,980
JWLプラス HLDGS		1		1,175	ゼビオホールディングス	10.9		12,153	鳥取銀行	1.9		2,152
JMホールディングス		6.1		11,773	ケーズホールディングス	56.4		69,992	百十四銀行	6.8		11,927
サツドラホールディングス		2.8		2,251	OLYMPIC グループ	2.3		1,248	四国銀行	11.9		9,996
アレンガホールディングス		5.9		5,846	日産東京販売HD	7.8		2,698	阿波銀行	10.5		20,569
大分銀行		4.4		9,222								
宮崎銀行		4.9		11,142								
佐賀銀行		4.3		6,918								
琉球銀行		17.3		15,587								
セブン銀行		265		76,081								
みずほフィナンシャルG		1,072.3		2,283,462								
高知銀行		2		1,340								
山口フィナンシャルG		81.3		73,739								
名古屋銀行		4.9		16,023								
北洋銀行		111.9		30,213								
大光銀行		1.9		1,998								
愛媛銀行		10		7,960								
トマト銀行		1.9		1,919								
京葉銀行		34.3		18,247								
栃木銀行		34.1		8,388								
北日本銀行		2.6		5,124								
東和銀行		14.3		7,507								
福島銀行		6.7		1,393								
大東銀行		2.3		1,430								
トモニホールディングス		60.2		21,611								
フィデアホール		7.8		10,202								
池田泉州HD		96.3		22,726								
証券・商品先物取引業 (0.7%)												
F P G		25.1		29,994								
ジャパンベストメントA		6		6,696								
マセキアホールディングス		3.3		2,465								
SBIホールディングス		107.5		304,762								
日本アジア投資		4.5		1,026								
ジャフコグループ		24.9		45,903								
大和証券G 本社		530.5		387,158								
野村ホールディングス		1,365.2		751,133								
岡三証券グループ		64.3		31,056								
丸三証券		25.5		11,500								
東洋証券		24.3		7,508								
東海東京HD		80.6		31,272								
光世証券		1.3		604								
水戸証券		19.6		6,213								
いちよし証券		14		8,526								
松井証券		44.1		35,941								
マネックスG		80		42,160								
極東証券		9.2		6,026								
岩												

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
スター・マイカ・HLDGS	6.7	4,321	クックパッド	20.9	3,782	ファーストロジック	0.7	672	スバル興業	0.4	3,836
SREホールディングス	3.6	15,030	エスクリ	2.4	864	三機サービス	0.9	965	東京テアトル	2.2	2,486
ADワークスグループ	14.3	2,974	アイ・ケイ・ケイホールディング	2.9	1,740	Gunosy	6.2	3,782	タナベコンサルティング	2.3	2,095
ヒューリック	173.4	214,495	学情	3.5	6,216	デザインフン・ジャパン	1.5	262	ナガワ	2.1	14,091
三栄建築設計	3.5	5,365	スタジオアリス	3.9	8,482	イー・ガーディアン	3	6,030	東京都競馬	6.5	26,552
野村不動産HLDGS	46.3	162,374	シミックホールディングス	3.8	7,516	リブセンス	2.8	725	常磐興産	2.1	2,570
三重交通グループHD	15.7	8,980	エプコ	1.3	989	ジャパンマテリアル	23.6	56,592	カナモト	14.2	31,012
サムティ	11.7	25,529	N J S	1.7	4,593	ベクトル	12.2	16,409	ニシオホールディングス	7.2	23,796
地主	5.7	11,189	総合警備保障	28.7	114,771	ウチヤマホールディングス	2.5	787	アゴラホスピタリティーG	32.6	880
プレサンスコーポレーション	11.7	22,779	カカゴコム	56.8	115,673	ライブオンエアソリューション	6.5	8,417	トランス・コスモス	9.6	34,272
ハウスコム	0.9	838	アイロムグループ	2.8	5,292	キャリアリンク	2.8	8,184	乃村工藝社	33.6	32,592
JPMC	3.7	4,144	セントケア・ホールディング	4.9	3,699	IBJ	4.7	3,055	藤田観光	3.4	12,172
サンセイイランドック	1.7	1,482	サイネックス	1	619	アサンテ	3.8	6,304	KNT-CTホールディングス	4.6	6,306
エストラスト	0.7	446	ルネサンス	5.3	4,775	パリュウH R	6.7	9,393	トーカイ	6.9	12,882
フージャースHD	11.5	11,454	ディップ	13.6	47,464	M&Aキャピタルパートナー	6.3	21,105	白洋舎	0.8	2,186
オープンハウスグループ	27.2	148,267	デジタルホールディングス	6	6,354	デジタルエクスプレスHD	2.7	2,775	セコム	78.8	757,425
東急不動産HD	223	188,524	新日本科学	8.2	17,589	ERIホールディングス	1.5	2,007	セントラル警備保障	4.2	12,146
飯田GHD	65	156,650	キャリアデザインセンター	1.2	1,776	アピスト	0.9	2,799	丹青社	15	11,745
イーグランド	0.9	1,350	ベネフィット・ワン	35.8	58,228	シグマタスク・ホールディング	11.7	14,543	メイテック	30.3	75,447
ビーロット	3.9	2,507	エムスリー	153	497,709	ウィルグループ	6.5	7,130	応用地質	7.2	14,227
ファーストブラザーズ	1.1	1,018	ツカダ・グローバルHOLD	3.8	1,854	エスコローA J	7.6	1,086	船井総研ホールディン	16.2	42,427
AND DOホールディングス	4.5	5,197	プラス	0.7	732	メドピア	6.9	6,851	進学会ホールディングス	1.9	552
シーアールイー	4.1	6,027	アウトソーシング	46.1	63,548	レアジョブ	1.1	1,057	オオバ	3.7	2,793
プロパティエージェント	0.7	804	ウェルネット	4.5	2,772	リクルートホールディングス	573.1	2,799,593	いであ	1.3	2,180
ケイアイスター不動産	3.6	17,298	ワールドホールディングス	3.5	9,730	エラン	10.2	8,364	学究社	3.1	6,674
アグリ都市デザイン	1	1,538	ディー・エヌ・エー	31	58,869	土木管理総合試験	2.5	837	ベネッセホールディングス	29	53,200
ジェイ・エス・ピー	1.8	8,793	博報堂DY HLDGS	98.7	150,369	日本郵政	931	943,103	イオンデライト	8.5	25,466
ロードスターキャピタル	4.3	6,837	ぐるなび	14.4	5,356	ベルシステム24HLDGS	10.4	14,487	ナック	3.4	3,240
テンポイノベーション	1.7	1,812	タカミヤ	10.4	5,252	鎌倉新書	8.8	6,362	ダイセキ	15.8	60,988
グローバルリンクマネジメント	1.1	1,516	ジャパバストレスキューS	3.8	2,663	SMN	1.4	637	ステッピング	2.8	5,079
フェイスネットワーク	1.6	2,248	ファンコミュニケーションズ	15	6,000	一蔵	0.8	448			
パーク24	57.8	123,345	ライク	2.8	4,527	グローバルキッズCOMP	1.1	746	合計	株数、金額	88,640 246,890,055
パララ	2.7	5,170	ビジネス・ブリークスルー	2.2	959	エアトリ	5.6	15,243			
宮越ホールディングス	3.3	2,828	エスピーール	22.3	11,863	アトラエ	4.7	3,492			
三井不動産	320.5	922,719	WDBホールディングス	4	8,824	ストライク	3.3	10,989			
三菱地所	447.6	785,314	ティア	3.8	1,664	ソラスト	21.7	14,821			
平和不動産	12	44,640	CDG	0.6	840	セラク	2.3	3,443			
東京建物	70.8	135,511	アドウェイズ	10.6	7,208	インソース	16.8	21,184			
京阪神ビルディング	12.6	14,817	パリュウコマース	5.7	8,213	ベカレントコンサルティング	61.3	338,130			
住友不動産	134	495,532	インフォマート	80.8	23,836	ORCHESTRA HLDGS	1.6	2,064			
テーオーシー	13.6	8,418	JPホールディングス	22.1	7,491	アイモバイル	3.4	3,933			
東京楽天地	1.2	5,022	エコナックホールディングス	10.2	948	キャリアインデックス	2.3	676			
スターコポレーション	10.7	30,794	CLホールディングス	2.2	1,955	MS-Japan	1.9	1,939			
フジ住宅	10.2	6,946	プラスステージ・インター	32.9	21,714	船場	1	736			
空港施設	9.1	4,968	アミュージ	4.2	7,707	ジャパンエレベーターSHD	27.6	51,667			
明和地所	2.7	2,502	ドリームインキュベータ	2.3	6,656	フルテック	0.8	876			
ゴールドクレスト	7	12,502	クワック	5.9	12,378	グリーンズ	2	2,356			
エスリード	3.4	8,833	TAC	2.9	580	ツナググループHLDGS	1.7	1,028			
日神グループHLDGS	11.7	6,247	電通グループ	76.1	359,953	GAMEWITH	1.9	729			
日本エスコ	16.4	13,284	テイクアンドザゴーズ	2.3	2,727	MS&CONSULTING	0.7	426			
MIRARTHホールディング	37.1	16,138	びあ	2.6	8,697	ウェルビー	5.7	2,667			
AVANTIA	3.3	2,752	イオンファンタジー	3.3	11,187	エル・ティー・エス	1	3,240			
イオンモール	38.5	69,107	シーティーエス	8.5	6,273	ミダックホールディングス	4.7	7,435			
毎日コムネット	2.2	1,623	ネクシイズグループ	1.8	1,188	日総工産	6	5,478			
ファースト住建	2.3	2,509	HUグループHD	22.8	62,494	キュービーネットHLDGS	3.7	5,209			
ランド	442.4	3,981	アルプス技研	6.7	19,838	RPAホールディングス	10.3	4,295			
カチタス	19.9	45,471	サニックス	12.3	4,391	スプリックス	1.9	1,480			
トーセイ	12.3	22,164	日本空調サービス	8.2	6,281	マネジメントソリューションズ	4.3	16,082			
穴吹興産	1.1	2,519	オリエンタルランド	409.6	2,231,091	プロレド・パートナーズ	2	1,052			
サンフロントリア不動産	12.4	17,298	ダスキン	17.4	54,844	AND FACTORY	1.7	673			
インテリックス	1.4	770	明光ネットワークジャパン	9.7	6,256	テノ・ホールディングス	0.7	474			
ランドビジネス	2.1	508	ファルコホールディングス	3.5	6,520	フロンティア・マネジメント	2.6	3,127			
サンネクスタグループ	1.8	1,827	秀英予備校	1.3	526	ピアラ	1	503			
グランディハウス	4.8	2,740	田谷	1	461	コプロ・ホールディングス	1	2,225			
日本空港ビルディング	26.2	167,942	ラウンドワン	64.7	38,108	ギークス	0.8	610			
サーピス業 (4.9%)			リゾートトラスト	30.7	67,079	アンピスホールディングス	8.2	25,256			
明豊ファシリティアワークス	3	2,220	ビー・エム・エル	9.6	29,568	カープスホールディングス	21.1	15,276			
日本工営	4.6	17,480	らいいあコミュニケーション	12.5	18,300	フォーラムエンジニアリング	4.5	5,256			
LIFULL	26.2	7,205	リソー教育	35.3	10,095	FAST FITNESS JAP	2.6	3,205			
MIXI	17.6	48,646	早稲田アカデミー	4.3	5,912	ダイヤルマケティングクス	9.3	8,230			
ジェイエイリクルートメント	7	17,500	ユー・エス・エス	79.6	191,477	ポピンズ	1.1	1,720			
日本M&Aセンターホールデ	132.9	144,329	東京個別指導学院	9.1	4,823	LITALICO	6	15,042			
メンバーズ	2.3	3,645	サイバーエージェント	171.2	179,160	アドバンテッジリスクマネ	2.9	1,769			
中広	0.8	322	楽天グループ	464.4	240,791	リログループ	43.1	90,057			
UTグループ	11.4	34,120	グリーク・アンド・リバー社	4.6	9,098	東祥	5.3	6,095			
アイティメディア	3	3,960	SBIグローバルアセット	12.5	6,287	ピーウィズ	1.9	3,929			
E・Jホールディングス	4.6	7,203	テー・オー・ダブリュー	15.8	5,103	TREホールディングス	16.3	19,331			
オープンアップグループ	23.2	50,251	山田コンサルティングGP	3.9	6,622	人・夢・技術グループ	2.9	4,341			
コシダホールディングス	23.1	27,304	セントラルスポーツ	2.9	7,038	大栄環境	19.6	47,863			
アルトナー	1.4	2,405	フィールドホールディングス	7.4	17,530	日本管財ホールディング	8.1	20,817			
パソナグループ	9.5	16,321	エン・ジャパン	14.1	36,702	エイチ・アイ・エス	20.2	41,672			
CD S	1.5	2,695	リソルホールディングス	0.5	2,337	ラックランド	3.2	10,720			
リンクアンドモチベーション	22.1	9,679	テクノプロ・ホールディング	45.8	154,804	共立メンテナンス	13.3	72,019			
エス・エム・エス	29.5	88,795	アトラグループ	1.4	249	イチナンホールディングス	8.6	11,584			
サンセイアパックスG	1.8	1,189	インテックワークス	1.5	499	建設技術研究所	4	14,100			
パーソルホールディングス	85.4	235,960	アイ・アールジャパンHD	4	6,444	スペース	5.5	5,758			
リニカル	3.4	2,856	Keepert 技研	4.8	24,384	燦ホールディングス	3.3	7,266			

(2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2023年6月15日現在	
	買建額	売建額
国内 TOPIX	百万円 6,005	百万円 -

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入状況

区分	2023年6月15日現在	
	貸付	借入
株式	株 3,383,300 (18,000)	株 (-) (-)

(注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

(注2) 当ファンドに係る当作成期中の利害関係人のうち、大和証券株式会社へ18,000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34期 (決算日 2022年9月20日)

(作成対象期間 2021年9月22日～2022年9月20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。

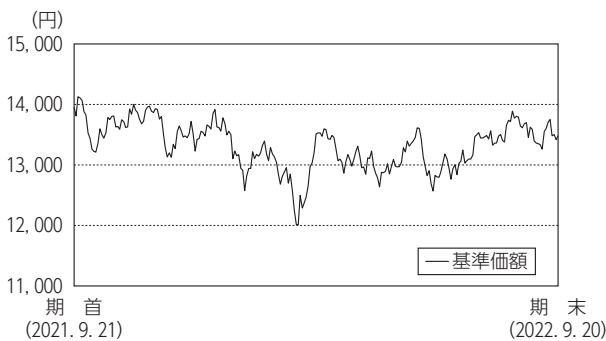
運用方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	東京証券取引所上場株式 (上場予定を含みます。)
株式組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		TOPIX (※配当なし)		株式組入比率	株式先物比率
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首)2021年9月21日	13,951	—	2,064.55	—	98.7	0.9
9月末	13,825	△ 0.9	2,030.16	△ 1.7	98.1	1.8
10月末	13,629	△ 2.3	2,001.18	△ 3.1	97.5	2.5
11月末	13,132	△ 5.9	1,928.35	△ 6.6	97.2	3.0
12月末	13,593	△ 2.6	1,992.33	△ 3.5	98.2	1.8
2022年1月末	12,941	△ 7.2	1,895.93	△ 8.2	97.7	2.4
2月末	12,885	△ 7.6	1,886.93	△ 8.6	97.5	2.7
3月末	13,437	△ 3.7	1,946.40	△ 5.7	97.3	2.6
4月末	13,116	△ 6.0	1,899.62	△ 8.0	96.8	3.3
5月末	13,215	△ 5.3	1,912.67	△ 7.4	96.0	4.0
6月末	12,945	△ 7.2	1,870.82	△ 9.4	97.5	2.5
7月末	13,427	△ 3.8	1,940.31	△ 6.0	97.2	2.8
8月末	13,589	△ 2.6	1,963.16	△ 4.9	96.9	3.1
(期末)2022年9月20日	13,480	△ 3.4	1,947.27	△ 5.7	96.6	3.4

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。
上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注3) 株式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：13,951円 期末：13,480円 騰落率：△3.4%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、当作成期前半に下落しましたが、後半は持ち直しました。

国内株式市況は、当作成期首より、新政権への期待の後退や中国の大手不動産会社の信用不安などで下落しましたが、衆議院議員選挙で自民党が過半数を大きく上回ったことなどが好感され、2021年11月中旬にかけて底堅く推移しました。年末にかけては、新型コロナウイルスの新変異株への警戒感から再び上値の重い展開になり、さらに2022年に入ると、F R B (米国連邦準備制度理事会) の金融引き締め加速懸念による金利上昇を受けて世界的に株価が下落する中で、日本株も下落しました。2月下旬からは、ロシアによるウクライナ侵攻で下落が加速しましたが、F R B の利上げ決定で悪材料出尽くし観測が強まったことや為替相場で円安が進行したことなどから、3月末にかけて反発しました。その後は、経済活動の正常化による内需の回復が鮮明となり反発する局面があった一方、F R B の利上げペースの加速や景気の先行きに対する懸念などから調整する局面もあり、一進一退の展開となりました。6月半ば以降は、資源価格の上昇が一服してインフレ懸念が後退したことや、F R B の利上げペースの期待などから、株価は反発しましたが、米国の8月C P I (消費者物価指数) が市場を上回ったことにより再びF R B の利上げペース加速が意識され、当作成期末にかけて株価は下落しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△5.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△3.4%となりました。

・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。

*ベンチマークはTOPIX (※配当なし) です。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株 式

(2021年9月22日から2022年9月20日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 9,645.1 (2,849.511)	千円 22,261,652 (—)	千株 5,379.511	千円 11,300,641

(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

(2021年9月22日から2022年9月20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 41,019	百万円 35,992	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2021年9月22日から2022年9月20日まで)

銘 柄	買 付			売 付			
	株 数	金 額	平均単価	株 数	金 額	平均単価	
ソフトバンク	千株 536.6	千円 823,240	円 1,534	ソフトバンクグループ	千株 126.8	千円 774,874	円 6,111
ソニーグループ	58.3	697,170	11,958	トヨタ自動車	160.7	342,481	2,131
日本電信電話	155.5	584,266	3,757	キーエンス	4.9	319,597	65,224
トヨタ自動車	245.3	507,419	2,068	日本電信電話	85.1	265,837	3,123
東京エレクトロン	9.2	501,396	54,499	三菱UFJフィナンシャルG	412.8	262,963	637
三菱商事	127.8	471,109	3,686	信越化学	10.8	213,069	19,728
リクルートホールディングス	71.3	455,835	6,393	東京海上HD	23.8	173,047	7,270
キーエンス	8.3	451,491	54,396	ダイキン工業	8.2	170,385	20,778
日本郵政	412.5	369,177	894	KDDI	46.8	168,246	3,595
任天堂	5.2	302,767	58,224	伊藤忠	43.6	162,978	3,738

(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							
水産・農林業 (0.1%)	千株	千株	千円	千株	千株	千円	キャンディール	千株	千株	千円	三井住友建設	千株	千株	千円	極洋	3.1	3.3	12,111	キャンディール	1.7	1.5	894	三井住友建設	51.7	53.5	24,342	
日本水産	84.3	96.7	52,798	スペースパリュウHD	11.5	—	大豊建設	5	3.5	15,155	マルハニチロ	14	13.8	33,340	ダイセキ環境ソリューション	1.8	2	1,822	前田建設	53.4	—	—	大豊建設	5	3.5	15,155	
雪国まいたけ	—	7.5	7,470	第一カッター興業	2.3	2.2	2,802	佐田建設	5.1	4.9	2,072	カナコ種苗	2.7	3	4,647	安藤・間	58.4	47.2	42,149	ナカノフドー建設	5	5.4	1,625	前田建設	5.1	4.9	2,072
サカタのタネ	10.8	11.3	54,748	東急建設	29	28	18,928	奥村組	11.5	11.8	35,211	ホクト	7.9	7.9	15,128	コムシスホールディングス	32.6	33.4	85,804	東鉄工業	8.5	9.5	22,676	伊藤忠	43.6	43.6	162,978
ホクリヨウ	2.3	1.3	791	ビーアールホールディングス	12.5	12.8	4,492	飛鳥建設	5.7	6.2	6,652	富士ピー・エス	2.4	3.5	1,641	高松コンストラクションGP	5.7	6.9	13,248	イチケン	1.5	1.7	3,085	伊藤忠	43.6	43.6	162,978
鉱業 (0.3%)				東建コーポレーション	2.8	2.9	23,780	ソネック	1	1.1	1,125	浅沼組	2.6	5.2	14,190	住石ホールディングス	21.6	18.6	4,352	戸田建設	86.1	91.8	70,594	浅沼組	2.6	5.2	14,190
住石ホールディングス	21.6	18.6	4,352	ソネック	1	1.1	1,125	ヤマウラ	4.1	4.8	4,656	日鉄鉱業	2.1	2	11,680	熊谷組	9.9	11.8	30,727	熊谷組	9.9	11.8	30,727	日鉄鉱業	2.1	2	11,680
三井松島 HLDGS	3.6	4.4	14,674	オリエンタル白石	32.3	35	8,855	大成建設	65.4	66.6	286,713	三井松島 HLDGS	3.6	4.4	14,674	北野建設	1.2	1.4	3,298	大成建設	65.4	66.6	286,713	三井松島 HLDGS	3.6	4.4	14,674
I N P E X	367.2	329.6	496,707	大林組	209	222.6	219,038	飛鳥建設	5.7	6.2	6,652	I N P E X	367.2	329.6	496,707	植木組	1.8	2.1	2,627	飛鳥建設	5.7	6.2	6,652	I N P E X	367.2	329.6	496,707
石油資源開発	12.4	12.3	46,063	清水建設	197.8	205.9	157,101	長谷工コーポレーション	68.6	64.3	106,352	石油資源開発	12.4	12.3	46,063	松井建設	7.8	8	4,648	長谷工コーポレーション	68.6	64.3	106,352	石油資源開発	12.4	12.3	46,063
K&O エナジーグループ	4.3	4	6,652	飛鳥建設	5.7	6.2	6,652	松井建設	7.8	8	4,648	K&O エナジーグループ	4.3	4	6,652	鎌高組	0.9	0.9	2,853	松井建設	7.8	8	4,648	K&O エナジーグループ	4.3	4	6,652
建設業 (2.2%)				鹿島建設	153.9	163.1	243,182	不動テトラ	5.1	5	7,720	建設業 (2.2%)				不動テトラ	5.1	5	7,720	鹿島建設	153.9	163.1	243,182	建設業 (2.2%)			
ヒノキヤグループ	2.3	—	—	大末建設	2.5	2.6	4,035	大末建設	2.5	2.6	4,035	ヒノキヤグループ	2.3	—	—	大末建設	2.5	2.6	4,035	大末建設	2.5	2.6	4,035	ヒノキヤグループ	2.3	—	—
ショーボンドHD	13.2	12.1	76,109	鉄建建設	3.9	4.7	8,460	鉄建建設	3.9	4.7	8,460	ショーボンドHD	13.2	12.1	76,109	西松建設	15.5	14.5	60,610	鉄建建設	3.9	4.7	8,460	ショーボンドHD	13.2	12.1	76,109
ミライト・ワン	31.9	33.5	51,389	西松建設	15.5	14.5	60,610	西松建設	15.5	14.5	60,610	ミライト・ワン	31.9	33.5	51,389	西松建設	15.5	14.5	60,610	西松建設	15.5	14.5	60,610	ミライト・ワン	31.9	33.5	51,389
タマホーム	5.9	6.3	14,956	西松建設	15.5	14.5	60,610	西松建設	15.5	14.5	60,610	タマホーム	5.9	6.3	14,956	西松建設	15.5	14.5	60,610	西松建設	15.5	14.5	60,610	タマホーム	5.9	6.3	14,956
サンヨーホームズ	1.5	1.8	1,245	西松建設	15.5	14.5	60,610	西松建設	15.5	14.5	60,610	サンヨーホームズ	1.5	1.8	1,245	西松建設	15.5	14.5	60,610	西松建設	15.5	14.5	60,610	サンヨーホームズ	1.5	1.8	1,245
日本アクア	4.4	4.2	2,805	西松建設	15.5	14.5	60,610	西松建設	15.5	14.5	60,610	日本アクア	4.4	4.2	2,805	西松建設	15.5	14.5	60,610	西松建設	15.5	14.5	60,610	日本アクア	4.4	4.2	2,805
ファーストコーポレーション	3.2	2.6	1,908	西松建設	15.5	14.5	60,610	西松建設	15.5	14.5	60,610	ファーストコーポレーション	3.2	2.6	1,908	西松建設	15.5	14.5	60,610	西松建設	15.5	14.5	60,610	ファーストコーポレーション	3.2	2.6	1,908
ベステラ	1.9	2.1	2,114	西松建設	15.5	14.5	60,610	西松建設	15.5	14.5	60,610	ベステラ	1.9	2.1	2,114	西松建設	15.5	14.5	60,610	西松建設	15.5	14.5	60,610	ベステラ	1.9	2.1	2,114

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
				千円					千円					千円
若築建設	3.6	3.8	8,246		アサヒグループホールディングス	158.6	144.4	685,900		ナイガイ	3.2	2.3	586	
東洋建設	24.2	27.1	23,360		キリンHD	247.6	282.1	643,329		オンワードホールディングス	41.8	41.6	12,438	
五洋建設	90.1	88.2	64,738		宝ホールディングス	50.2	42.7	46,116		ルックホールディングス	2.3	2.1	4,592	
世紀東急	10.2	10.8	8,208		オエノンホールディングス	19.9	17.5	4,900		ゴールドウイン	11	12.4	101,184	
福田組	2.4	2.4	11,868		養命酒	2.3	2	3,636		デサント	11.4	12.8	46,208	
住友林業	54.4	47.8	112,377		ココ・コーポラトラスJHD	47.2	48.9	70,024		キング	3.4	3.7	1,531	
日本基礎技術	6.3	5.9	2,861		サントリー食品インター	45.2	44	226,600		ヤマトインターナショナル	5.8	5.5	1,435	
バコーボレーション	8.4	9.6	3,907		ダイドールグループHD	3.8	3.9	18,817		パルプ・紙 (0.2%)				
大和ハウス	194.3	189.7	590,915		伊藤園	20.5	23.3	138,402		特種東海製紙	3.9	3.9	11,895	
ライト工業	12.2	13.2	25,713		キーコーヒー	6.9	7	14,763		王子ホールディングス	297.6	289.1	159,294	
積水ハウス	227.9	227.6	572,414		ユニカフェ	2.5	2	1,836		日本製紙	29.5	30	26,220	
日特建設	5.3	5.1	4,941		ジャパンフーズ	1	1.1	1,211		三菱製紙	7.8	9.6	2,841	
北陸電気工事	3.4	4.1	3,013		日清オイリオグループ	8.5	8.7	27,709		北越コーポレーション	48.7	44.6	33,806	
ユアテック	12.1	13.9	10,313		不二製油グループ	16.5	16.6	40,089		中越パルプ	2.3	2.3	2,166	
日本リーテック	4.4	4.6	3,758		かどや製油	0.7	0.7	2,509		巴川製紙	2.1	2.3	1,835	
四電工	1.2	2.3	4,303		J-オイルミルズ	6.2	6.8	10,567		大王製紙	31.8	31.9	37,992	
中電工	10.1	9.2	19,872		キッコーマン	48.5	46	380,420		阿波製紙	1.6	1.4	421	
関電工	34.9	39.1	33,547		味の素	160.3	152.9	608,083		レンゴー	68.3	58.3	49,846	
きんでん	42.2	48.8	75,249		ブルドックソース	—	2.8	5,163		トーモク	4.1	3.6	5,486	
東京エネシス	6.7	7	7,014		キューピー	37.8	33.6	76,003		ザ・バック	4.8	4.8	11,198	
トーエネック	2	2.4	8,448		ハウス食品G本社	25.1	24	69,792		化学 (6.1%)				
住友電設	5.9	5.9	15,788		カゴメ	25.4	29.2	86,811		北の達人コーポ	24	27.1	6,856	
日本電設工業	11.1	10.2	18,584		焼津水産化工	3.1	3.1	2,700		クラレ	96.3	101.2	108,992	
エクシオグループ	32.3	33	71,841		アリアケジャパン	6.2	7	33,425		旭化成	435.4	463	468,787	
新日本空調	5.4	5.2	9,573		ビエトロ	0.9	0.9	1,602		共和レザー	3.3	4.1	2,197	
九電工	14.8	15.2	43,639		エバラ食品工業	1.7	1.7	5,261		昭和電工	47	61.4	133,176	
三機工業	15.5	15.6	26,208		やまみ	0.8	0.7	993		住友化学	518.1	510.7	275,267	
日揮ホールディングス	70.1	67.9	133,355		ニチレイ	32.1	28.6	67,839		住友精化	3.2	3	9,810	
中外炉工業	2.4	2.2	3,506		東洋水産	34.7	34.3	202,370		日産化学	36	33.7	228,486	
ヤマト	6.8	5.9	4,631		イートアンドHLDGS	2.3	3	6,663		ラサ工業	2.2	2.6	6,198	
太平電業	4.9	4.3	14,663		大冷	1.1	0.6	1,143		クレハ	5.6	5.4	50,220	
高砂熱学	18.7	18.2	30,612		ヨシムラ・フード・HLDGS	4	3.8	1,843		多木化学	2.6	2.5	12,675	
三晃金属	0.9	1	2,716		日清食品HD	26.4	24.8	244,528		テイカ	4.6	4.3	5,461	
朝日工業社	1.4	2.9	5,240		永谷園ホールディングス	3.5	3.3	6,507		石原産業	12.1	13.4	14,257	
明星工業	13.1	12	8,724		一正蒲鉾	2.8	3	2,295		片倉コープアグリ	1.6	1.7	2,068	
大気社	10.1	10	33,150		フジッコ	7.5	7.1	13,546		日本曹達	9.1	8.2	37,146	
ダイダ	4.6	4.4	9,878		ロックフィールド	7.5	7.7	11,611		東ソー	101.6	92.7	159,536	
日比谷総合設備	6.7	6.4	11,993		日本たばこ産業	360.4	411.2	992,431		トクヤマ	19.3	22.3	41,054	
フィル・カンパニー	1.3	1.1	1,328		ケンコーマヨネーズ	4	3.9	6,068		セントラル硝子	12	11.3	38,759	
テスホールディングス	—	6.7	7,048		わらべや日洋HD	4.6	4.7	10,495		東亜合成	39	32.6	36,153	
インフロンニアHD	—	83.6	85,188		なとり	4.1	4.3	8,703		大阪ソーダ	6.4	5.8	22,417	
東洋エンジニア	9.1	10.1	6,413		イフジ産業	1.5	1.2	1,082		関東電化	15	13.7	13,590	
レイズネクスト	11.1	10.3	12,040		ビックルスコーポレーション	3.4	—	—		デンカ	24	25.2	83,664	
食品 (3.4%)					ファーマフーズ	—	9.7	12,241		信越化学	121.6	118.7	1,884,362	
ニッポン	19.5	18.6	28,885		ユーグレナ	35.3	40.2	35,818		日本カーバイド	2.2	2.9	3,738	
日清製粉G本社	76.2	72.3	104,545		紀文食品	—	5.9	5,787		堺化学	4.4	4.8	9,312	
日東富士製粉	0.5	1.1	5,010		ビックルスホールディングス	—	3.7	3,922		第一稀元素化学工	7.3	6.3	8,656	
昭和産業	5.9	6	15,024		ミヨシ油脂	2.3	2.3	2,281		エア・ウォーター	67.3	59.9	105,064	
鳥越製粉	6.4	5.4	3,564		理研ピタミン	6.4	5.3	9,110		日本酸素HLDGS	54.3	61.6	151,228	
中部飼料	8.4	7.8	8,447		繊維製品 (0.5%)					日本化学工業	1.9	2.1	4,166	
フィード・ワン	9.3	8.9	6,203		片倉工業	8.8	6	12,096		東邦アセチレン	1.2	1.5	1,714	
東洋精糖	1.5	1	873		グンゼ	4.8	4.4	17,182		日本パーカラライジング	32	31.5	30,649	
日本甜菜糖	3.5	3.9	6,279		東洋紡	25.6	29.4	32,604		高圧ガス	9.8	10.6	6,996	
DM三井製糖ホールディ	5.1	6.1	11,547		ユニチカ	18.5	20.9	6,123		チタン工業	0.9	0.9	1,452	
塩水港精糖	10.3	7.9	1,595		富士紡ホールディングス	3.2	3	10,245		四国化成	8	8.5	10,820	
日新製糖	3.1	3.5	6,086		倉敷紡績	5.6	5.3	11,490		戸田工業	1.5	1.6	4,808	
森永製菓	15.7	15.5	59,597		シキボウ	3.7	4.2	3,742		ステラケミファ	3.5	3.8	10,282	
中村屋	1.6	1.6	5,040		日本毛織	20.2	18.6	20,385		保土谷化学	1.9	2	6,410	
江崎グリコ	18.4	17.9	62,023		ダイトウボウ	12.1	16.5	1,419		日本触媒	11.7	10.7	60,241	
名糖産業	3.2	2.8	4,617		トリア紡コーポレーション	2.3	2.3	791		大日精化	5	5.4	9,520	
井村屋グループ	3.8	3.8	8,546		ダイドーリミテッド	7.6	12.6	1,839		カネカ	17	16.1	62,790	
不二家	4.1	4.4	10,692		帝国繊維	7.6	7.2	11,649		三菱瓦斯化学	65.8	58.9	121,687	
山崎製パン	50.7	42	68,334		帝人	61.6	66.1	97,629		三井化学	57	58.2	178,092	
第一屋製パン	1.8	0.6	269		東レ	476.3	464.9	358,298		J S R	66.3	69.7	210,145	
モロゾフ	1.1	2.3	8,429		住江織物	1.4	1.3	2,278		東京応化工業	11.4	11.1	71,928	
電田製菓	3.8	4	17,960		日本フェルト	3	4.1	1,685		大阪有機化学	6.1	4.8	10,785	
寿スブリッツ	6.6	6.7	55,409		イチカフ	0.8	0.9	1,224		三菱ケミカルグループ	439.1	464.6	330,562	
カルビー	30.6	35	103,775		日東製網	0.9	0.7	919		K Hネオケム	11.1	10.6	27,602	
森永乳業	12.6	13	53,560		アツギ	5.2	5.3	2,077		ダイセル	88.5	100.3	90,270	
六甲バター	4.5	4.5	6,462		ダイニツク	2.5	2.1	1,266		住友ベークライト	10.4	10.6	44,679	
ヤクルト	46.4	48.8	401,136		セイレン	16.4	13.8	28,952		積水化学	137.3	143	270,127	
明治ホールディングス	44.2	42.3	272,412		ソトー	1.8	2.8	2,004		日本ゼオン	59.3	56.3	76,849	
雪印メグミルク	16	16.9	28,239		東海染工	0.8	0.8	892		アイカ工業	18.2	17.6	56,232	
アリマハム	9.6	9.6	20,265		小松マテーレ	10.5	11.3	9,299		UBE	33.1	35.1	71,779	
日本ハム	25.7	26.9	104,910		ワコールホールディングス	16.3	15.3	34,914		積水樹脂	10.2	10.4	17,784	
林兼産業	2.8	1.7	782		ホギメディカル	8.7	9.3	31,573		タキロンシーアイ	13.8	16.4	8,741	
丸大食品	6.4	6.8	10,050		クラウドディアHLDGS	2.1	2	578		旭有機材	3.6	4.3	9,872	
S Foods	6	6.9	20,368		T S Iホールディングス	19.7	22.8	9,576		ニチパン	3.2	4	6,484	
柿安本店	2.2	2.7	6,183		マツオカコーポレーション	2	2.1	2,058		リケンテクノス	16.2	15.2	7,995	
伊藤ハム米久HLDGS	42.8	48.5	32,446		ワールド	8.5	9.9	14,137		大倉工業	3.5	3	5,304	
サッポロホールディングス	22.8	20.7	66,136		三陽商会	4	3.4	3,216		積水化成	7.9	7.7	3,172	

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	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円
群栄化学	1.4	1.5	3,681	天馬	5.2	5.9	12,283	東海カーボン	56.9	53.3	56,124	日本カーボン	3.7	3.7	15,114	東洋炭素	4.6	4.1	14,329	
タイガースポリマー	2.2	4.1	1,730	信越ポリマー	9.9	13.8	17,512	ノリタケ	3.7	3.9	15,892	TOTO	47.9	46.2	228,228	日本硝子	73.3	75.3	151,127	
ミライアル	1.9	2.4	4,192	東リ	14.7	17.2	3,457	バルカー	5.3	6.2	16,510	日本特殊陶業	51.5	53.4	157,156	ダントーホールディングス	6.2	5.1	1,647	
ダイキアクシス	2.6	2.3	1,541	ニフコ	25	25.5	80,197	ユニ・チャーム	129.4	132.6	625,341	MA R U W A	2.4	2.6	46,800	品川リフラクトリーズ	1.5	1.8	7,182	
ダイキョーニシカワ	13.7	15.7	9,058	パルカー	5.3	6.2	16,510	ショーエコーポ	2.2	2	1,154	黒崎播磨	1.1	1.3	6,454	ヨータイ	5	4.9	6,904	
竹本容器	2.9	2.5	1,890	協和キリン	79	76.9	245,311	協和キリン	79	76.9	245,311	イソライト	3	—	—	東京窯業	7.7	8	2,168	
森六ホールディングス	3.5	3.7	6,645	武田薬品	558.4	600.8	2,308,273	武田薬品	558.4	600.8	2,308,273	ニッカトー	2.9	3.5	1,561	フジインコーポレートッド	5.5	6.1	38,003	
恵和	—	2.1	8,274	アステラス製薬	581.9	653.6	1,293,474	アステラス製薬	581.9	653.6	1,293,474	クニミネ工業	2.2	2.4	1,968	エーアンドエーマテリアル	0.9	1.2	1,041	
日本化薬	39.9	52.5	63,525	住友ファーマ	50.2	47.3	48,577	住友ファーマ	50.2	47.3	48,577	ニチアス	16.9	16.1	38,285	ニチハ	9.2	9.8	27,900	
カーリットホールディングス	6.3	6.4	4,345	塩野義製薬	84.3	88.8	618,936	塩野義製薬	84.3	88.8	618,936	鉄鋼 (0.8%)				日本製鉄	317	315.7	710,640	
日本精化	4.8	4.8	9,283	わかもと製薬	8.5	7.6	1,793	わかもと製薬	8.5	7.6	1,793	神戸製鋼所	122.5	131.9	85,207	中山製鋼所	8.4	10.9	6,888	
扶桑化学工業	5.3	5.9	20,414	日本新薬	19.1	16.7	124,582	日本新薬	19.1	16.7	124,582	合同製鐵	3.5	3.6	6,566	JFEホールディングス	192.4	175	257,250	
トリケミカル	6.4	7.7	16,578	中外製薬	210.1	199.2	696,602	中外製薬	210.1	199.2	696,602	東京製鐵	26.2	22.2	28,904	共英製鋼	7.4	7.4	11,433	
ADEKA	30.2	29.5	67,525	科研製薬	11.3	11	42,405	科研製薬	11.3	11	42,405	大和工業	14.1	12.4	56,420	東京製鐵	2.7	2.9	3,894	
日油	24.9	21.6	111,888	エーザイ	74.4	84.5	509,535	エーザイ	74.4	84.5	509,535	大阪製鐵	3.3	4.1	4,940	淀川製鋼所	8.4	8.2	20,393	
新日本理化学	13	10.7	2,568	ロート製薬	31.8	36.5	159,505	ロート製薬	31.8	36.5	159,505	丸一鋼管	21.4	21.9	65,634	丸一鋼管	21.4	21.9	65,634	
ハリマ化成グループ	4.7	5	4,640	小野薬品	153.7	147.4	501,454	小野薬品	153.7	147.4	501,454	モリ工業	1.9	1.9	5,074	大同特殊鋼	11	10.3	39,500	
花王	148.3	157.9	959,558	久光製薬	19.4	16.2	54,918	久光製薬	19.4	16.2	54,918	日本高周波	2.3	2.9	930	日本冶金工	5.1	5.2	15,106	
第一工業製薬	2.3	2.5	5,262	持田製薬	9.2	8.6	29,197	持田製薬	9.2	8.6	29,197	山陽特殊製鋼	7.8	6.5	13,149	愛知製鐵	3.8	4.2	9,147	
石原ケミカル	1.7	3.5	4,518	参天製薬	117	133.2	130,402	参天製薬	117	133.2	130,402	日立金属	63.1	71.5	155,441	日立金属	63.1	71.5	155,441	
日華化学	2.7	2.9	2,505	扶桑薬品	2.1	2.5	4,982	扶桑薬品	2.1	2.5	4,982	日本金属	1.7	2	1,992	大平洋金属	4.5	4.7	11,515	
ニイタカ	1.5	1.4	3,353	日本ケミファ	0.8	0.8	1,463	日本ケミファ	0.8	0.8	1,463	新日本電工	44.3	42	14,784	栗本鉄工所	2.9	3	4,872	
三洋化成	3.9	4.5	20,475	ツムラ	22.5	21.8	67,907	ツムラ	22.5	21.8	67,907	虹技	0.8	1	937	日本鑄鉄管	0.7	0.8	776	
有機合成薬品	5.7	5	1,560	日医工	19	22	9,526	日医工	19	22	9,526	三菱製鋼	5	4.8	4,752	日亜鋼業	8.8	8.7	2,114	
大日本塗料	7	8.4	6,048	キッセイ薬品工業	11.5	11.1	27,838	キッセイ薬品工業	11.5	11.1	27,838	日本精線	1	1.2	5,580	エンビプロHD	3.2	5	4,410	
日本ペイント HOLD	247.6	281.3	301,834	生化学工業	11.5	13.7	11,987	生化学工業	11.5	13.7	11,987	シンニッタン	8.5	8.7	1,905	新家工業	1.6	1.5	2,550	
関西ペイント	74	64.7	138,263	栄研化学	12	11.4	20,269	栄研化学	12	11.4	20,269	非鉄金属 (0.8%)				大紀アルミニウム	10.1	9.3	12,192	
神東塗料	5.8	4.7	648	白水製薬	2.5	—	—	白水製薬	2.5	—	—	日本軽金属HD	17.7	19.2	31,084	三井金属	18	20.4	64,770	
中国塗料	16.4	15.9	14,039	鳥居薬品	4.2	3.4	9,557	鳥居薬品	4.2	3.4	9,557	東邦亜鉛	3.6	3.9	9,410	三菱マテリアル	43.6	43.6	89,336	
日本特殊塗料	4.9	4.6	4,457	JCRファーマ	19.3	21.5	45,558	JCRファーマ	19.3	21.5	45,558	住友鉱山	85	82.9	363,931	DOWAホールディングス	17	17.6	96,096	
藤倉化成	8.2	9.3	4,129	東和薬品	9.8	11	23,936	東和薬品	9.8	11	23,936	古河機金	10.3	11.1	13,863	古河機金	10.3	11.1	13,863	
太陽ホールディングス	4.9	10.9	28,743	富士製薬工業	4.5	4	4,148	富士製薬工業	4.5	4	4,148	エス・サイエンス	35.4	37.2	930	大阪チタニウム	6.7	8.8	28,028	
DIC	27.2	24.8	62,322	ゼリア新薬工業	12.1	11.3	23,052	ゼリア新薬工業	12.1	11.3	23,052	東邦チタニウム	12.5	13.6	33,632	UACJ	10	10.3	24,720	
サカタインクス	13.7	14	13,944	第一三共	527.7	554.6	2,329,874	第一三共	527.7	554.6	2,329,874	CKサンエツ	1.4	1.4	5,628	古河電工	20.6	21.8	54,173	
東洋インキSCホールディン	13.3	12.3	23,542	キョーリン製薬HD	14.8	13.8	24,274	キョーリン製薬HD	14.8	13.8	24,274	住友電工	230.9	263.8	428,411	フジクラ	80.7	84.5	81,880	
T & K TOKA	4.6	6.1	5,953	大幸薬品	10.5	11.6	7,134	大幸薬品	10.5	11.6	7,134	昭和電線 HLDGS	6.7	6.6	12,315	昭和電線 HLDGS	6.7	6.6	12,315	
富士フイルム HLDGS	118.1	134.3	919,552	ダイト	4.3	4.8	12,408	ダイト	4.3	4.8	12,408	東京特殊電線	0.7	1	2,222	タツタ電線	12.5	13.6	6,201	
資生堂	125.3	132.9	687,225	大塚ホールディングス	139	145.6	661,897	大塚ホールディングス	139	145.6	661,897	カナレ電気	0.9	1.1	1,587	カナレ電気	0.9	1.1	1,587	
ライオン	81.1	76.5	124,083	大正製薬HD	16.8	14.2	73,840	大正製薬HD	16.8	14.2	73,840	平河ヒューテック	3.7	4.3	4,695	平河ヒューテック	3.7	4.3	4,695	
高砂香料	4.2	4.3	11,665	ペプチドリーム	35.4	30.9	50,397	ペプチドリーム	35.4	30.9	50,397	リョービ	7.8	7.1	9,322	リョービ	7.8	7.1	9,322	
マンダム	14.5	14.9	22,960	あすか製薬HD	7.8	7.2	8,100	あすか製薬HD	7.8	7.2	8,100	アーレスティ	8.1	8	3,224	アーレスティ	8.1	8	3,224	
ミルボン	8.5	9.4	60,160	サワイグループHD	14.8	14.6	59,276	サワイグループHD	14.8	14.6	59,276	アサヒHD	25.6	30.2	64,144	アサヒHD	25.6	30.2	64,144	
ファンケル	24.7	30.9	88,374	石油・石炭製品 (0.5%)				石油・石炭製品 (0.5%)				金属製品 (0.6%)				稲葉製作所	4.9	3.9	5,331	
コーセー	12.8	12.9	187,308	日本コークス工業	58.3	64.7	6,146	日本コークス工業	58.3	64.7	6,146	宮地エンジニアリングG	2.3	2.2	7,161	宮地エンジニアリングG	2.3	2.2	7,161	
コタ	4.7	5.3	8,140	ニチレキ	7.7	8.5	11,160	ニチレキ	7.7	8.5	11,160	トーカロ	16.7	19.3	24,298	トーカロ	16.7	19.3	24,298	
シーボン	0.8	1	1,660	ユシロ化学	3.4	3.2	2,777	ユシロ化学	3.4	3.2	2,777									
ポーラ・オルビス HD	28.9	32.7	53,137	ピービー・カストロール	2.4	2.6	2,836	ピービー・カストロール	2.4	2.6	2,836									
ノエビアホールディングス	5.6	5.6	32,704	富士石油	18.9	16.7	5,377	富士石油	18.9	16.7	5,377									
アジュバンホールディング	1.9	1.7	1,625	MORESCO	2.1	2.7	2,967	MORESCO	2.1	2.7	2,967									
新日本製薬	—	3.7	6,049	出光興産	73.9	77.8	267,243	出光興産	73.9	77.8	267,243									
エステー	4.2	4.8	7,444	ENEOSホールディングス	1,004.4	1,149.6	581,007	ENEOSホールディングス	1,004.4	1,149.6	581,007									
アグロカネショウ	2.5	2.6	3,523	コスモエネルギーHLDGS	21.3	30.2	120,800	コスモエネルギーHLDGS	21.3	30.2	120,800									
シーニシ	10.9	11.6	18,618	ゴム製品 (0.7%)				ゴム製品 (0.7%)												
長谷川香料	11.5	13.2	41,646	横浜ゴム	39.2	36.3	84,942	横浜ゴム	39.2	36.3	84,942									
星光PMC	3.8	3.5	1,918	TOYO TIRE	35.7	36.7	62,353	TOYO TIRE	35.7	36.7	62,353									
小林製薬	18.8	19.5	162,630	ブリヂストン	193.5	203.3	1,035,813	ブリヂストン	193.5	203.3	1,035,813									
荒川化学工業	5	5.4	5,589	住友ゴム	60.9	62.5	76,625	住友ゴム	60.9	62.5	76,625									
メック	5.2	5.2	12,188	藤倉コンビジット	6.2	6.3	5,865	藤倉コンビジット	6.2	6.3	5,865									
日本高純度化学	2	1.7	4,046	オカモト	3.9	3.5	13,527	オカモト	3.9	3.5	13,527									
タカラバイオ	17.7	20	35,760	フコク	3.1	3.5	3,444	フコク	3.1	3.5	3,444									
JCU	7.5	7.8	24,492	フタ	6.8	7.2	21,103	フタ	6.8	7.2	21,103									
新田ゼラチン	4	4.4	3,907	住友理工	13.3	14.9</														

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
アルファCO	2.2	2.7	2,546		ナブテスコ	39	40.3	126,542		ツバキ・ナカシマ	15	15.8	19,228	
SUMCO	84.6	124.7	231,069		三井海洋開発	7.3	8	11,736		ホシザキ	19.6	41.2	160,886	
川田テクノロジーズ	1.3	1.5	5,595		レオン自動車	6.3	8.1	9,525		大豊工業	6	6.2	4,377	
RS TECHNOLOGIES	2.2	2.1	13,986		S MC	19.6	22.4	1,415,680		日本精工	138	130.8	101,631	
ジェイテックコーポレーション	—	1	1,582		ホンカワミクロン	2.3	4.9	12,563		NTN	154.3	139.7	40,093	
信和	3.5	4.7	3,802		ユニオンツール	2.6	2.8	9,884		ジェイテクト	64.7	65.2	67,025	
東洋製罐グループHD	42.4	38.5	69,569		オイレス工業	8.9	9.7	14,608		不二越	6	4.7	17,390	
ホクサンホールディングス	3.1	3.3	4,372		日精工エスビー	2.2	2.9	11,701		日本トムソン	18.6	17.5	10,080	
コロナ	3.7	3.4	2,869		サトーホールディングス	8.6	9.9	18,899		THK	39	37	98,272	
横河ブリッジHLDGS	11.6	10.8	21,060		技研製作所	5.9	6.7	22,478		ユーション精機	4.3	5.7	4,098	
駒井ハルテック	1.4	1.2	2,006		日本エアーテック	3.2	3.2	3,401		前澤給装工業	4.7	4.9	4,444	
高田機工	0.6	0.6	1,440		カワタ	1.8	2.4	2,119		イーグル工業	8.1	8.4	10,088	
三和ホールディングス	62.7	71.2	96,262		日精樹脂工業	5.5	4.6	4,411		前澤工業	4.9	4.6	2,824	
文化シャッター	20.2	22.4	23,542		オカダアイオン	2.1	2.4	3,470		日本ピラー工業	7.3	6.5	16,354	
三協立山	8.7	9.1	5,605		ワイエイシイホールディングス	2.8	3	4,131		キッツ	22.6	23.4	19,445	
アルインコ	4.4	5.5	4,900		小松製作所	304	346.5	975,051		マキタ	87.6	86.4	261,792	
東洋シャッター	1.7	1.6	868		住友重機械	38.5	40.9	118,691		三井 E&SHD	21.7	21.7	8,897	
L I X I L	91.3	119	277,151		日立建機	31.6	30.6	89,596		日立造船	54.6	60.7	52,930	
日本フィルコン	4.2	4.8	2,246		日工	10.1	9.3	5,924		三菱重工業	105.7	112.2	582,430	
ノーリツ	13.6	9.7	15,102		巴工業	2.6	2.7	6,712		I H I	45.3	47.8	166,105	
長府製作所	6.5	6.7	13,688		井関農機	6.3	6	7,422		サノヤスホールディングス	9.8	9.7	1,193	
リンナイ	12.9	13.1	138,729		TOWA	6.3	6.6	11,794		スター精密	10.4	12.4	21,811	
ダイニチ工業	3.8	3.8	2,416		丸山製作所	1.3	1.2	1,854		電気機器 (17.0%)				
日東精工	8.6	9.6	5,126		北川鉄工所	2.7	3	3,897		日清紡ホールディングス	40.4	52.2	56,323	
三洋工業	0.7	0.8	1,360		ローテック	3.1	3.8	31,198		イビデン	32.6	36.8	165,784	
岡部	12.2	10.7	7,179		タカキタ	2.2	2.5	1,325		コニカミノルタ	137.2	155.2	76,358	
ジーテクト	7.9	8.4	11,617		クボタ	327.4	341.8	738,458		ブラザー工業	81.6	87.2	227,330	
東プレ	12.3	11.6	14,314		荏原実業	3.4	3.2	7,062		ミネベアミツミ	115.7	121.6	295,609	
高周波熱錬	11.8	11.4	7,854		三菱化工機	2.3	2.2	4,769		日立	322.9	367.7	2,473,885	
東京製鋼	2.9	4.7	4,441		月島機械	11.8	11.9	10,936		東芝	133	133.6	681,493	
サンコール	5.4	6.6	4,930		帝国電機製作所	4.5	4.9	9,662		三菱電機	670.3	713.3	989,703	
モリテックスチル	5.4	5.9	1,569		東京機械	3.4	3.1	2,077		富士電機	40.6	42.5	248,200	
パイオラックス	9.3	10	19,550		新東工業	15.3	14.2	10,039		東洋電機製造	2.4	2.3	2,030	
エイチワン	6.4	6.8	4,100		渋谷工業	5.9	6	14,562		安川電機	72.2	75.9	341,170	
日本発条	66.5	63.9	60,129		アイチ コーポレーション	11.2	10.7	8,656		シンフォニアテクノロジー	8.6	7.7	11,026	
中央発條	4.4	3.6	2,509		小森コーポレーション	16.8	17.4	12,789		明電舎	11.3	10.9	21,919	
アドバネクス	1.1	1	1,218		鶴見製作所	5	5.4	12,555		オリジン	1.6	1.9	2,631	
立川ブラインド	3.1	2.9	3,024		住友精密	0.9	1.2	3,178		山洋電気	3.3	2.8	14,392	
三益半導体	5	5.9	12,077		日本ギア工業	2.4	3.4	1,298		デンヨー	5.6	5.3	7,976	
機械 (5.3%)					酒井重工業	1.1	1.2	3,642		PHC ホールディングス	—	11.8	18,585	
日本ドライケミカル	1.6	1.7	2,563		荏原製作所	28	26.2	133,882		東芝テック	7.2	8.2	32,964	
日本製鋼所	20.3	19.4	59,073		石井鉄工所	0.9	1	2,789		芝浦メカトロニクス	1.3	1.4	14,952	
三浦工業	28.8	29.7	84,942		西島製作所	6.6	6.3	8,568		マップモーター	15.7	15.9	64,713	
タクマ	22.9	21.7	28,210		北越工業	6.8	6.5	6,500		日本電産	161.6	169.8	1,559,443	
ツガミ	14.3	15.4	18,295		ダイキン工業	85.5	83.5	2,011,932		ユーエムシーエレクトロニクス	3.9	2.6	1,258	
オークマ	7.6	7.2	37,008		セルガノ	2.3	2.2	19,954		トックス・セミコンダクター	3.8	3.3	9,177	
芝浦機械	6.8	8.6	24,905		トーヨーカネツ	2.6	2.6	6,526		東光高岳	3.4	4.3	8,161	
アマダ	97.1	119.3	128,366		栗田工業	36.7	38.6	211,142		ダブル・スコープ	19.3	21	41,559	
アイダエンジニア	16.9	16.5	13,695		椿本チエイン	9.6	10	32,850		ダイヘン	7.4	7	28,385	
滝澤鉄工所	1.8	2.3	2,640		大同工業	3.3	3	2,139		ヤーマン	11.5	12.5	15,675	
F U J I	26.4	30.1	59,628		木村化工機	6.3	5.9	4,236		J V C ケンウッド	60.1	62.6	12,645	
牧野フライス	7.7	7.7	34,342		アネスト岩田	10.9	11.8	10,561		ミマキエンジニアリング	6.2	6.8	4,753	
オーエスジー	30.3	30.7	58,115		ダイフク	37	36.1	263,891		I - P E X	3.2	3.7	4,917	
ダイジェット	0.7	0.9	778		サムコ	1.7	2.1	6,877		日新電機	15.8	17.8	24,831	
旭ダイヤモンド	16.3	18.9	14,080		加藤製作所	3.4	3.5	2,618		大崎電気	13.2	12.5	6,762	
DMG 森精機	39.7	38.9	68,386		油研工業	0.9	1.2	2,138		オムロン	55.8	63.6	445,200	
ソディック	16.1	17.8	13,901		タダノ	32.7	36.9	33,283		日東工業	9.8	9.7	25,239	
ディスコ	9	11.1	379,620		フジテック	23.3	23.5	68,338		I D E C	9.2	9.5	28,737	
日東工器	3.2	3.7	5,957		C K D	15.7	19.3	36,052		正興電機製作所	2.5	2.6	2,649	
日進工具	5.1	6	6,786		キトー	5.6	5.8	15,660		不二電機工業	1	1.5	1,663	
パンチ工業	5.8	6.4	2,758		平和	18.3	21.3	46,306		ジーエス・ユアサコーポ	24.4	23	57,178	
富士ダイス	2.8	3.9	2,351		理想科学工業	5	6.4	15,379		サクサホールディングス	1.5	1.7	2,145	
豊和工業	3.8	4	3,280		S A N K Y O	16	15.8	65,096		メルコホールディングス	2.4	2.1	6,720	
ニテックオーケーケー	2.9	2.9	3,384		日本金銭機械	6.6	7.9	5,174		テクノメディカ	1.4	1.7	2,743	
石川製作所	1.8	2.1	2,885		マースグループ HLDGS	3.8	4.9	8,158		ダイヤモンドエレクトリックHD	2	2.1	2,595	
東洋機械金属	3.9	5	2,915		フクシマガリレイ	4.7	4.7	17,437		日本電気	85.5	90.7	441,709	
津田駒工業	1.3	1.2	583		オーイズミ	2.3	2.8	1,103		富士通	60.5	68.8	1,103,208	
エンシュウ	1.4	1.9	1,463		ダイコク電機	2.6	3.5	4,623		沖電気	27.1	29.1	21,097	
島精機製作所	9.4	11.1	23,731		竹内製作所	11.6	11.7	31,356		岩崎通信機	2.9	2.9	2,163	
オプトラン	8.3	9.5	22,382		アマノ	17.6	20.1	50,049		電気興業	3.1	3.7	8,672	
NC ホールディングス	2.7	2.1	3,840		J U K I	9.2	10	6,980		サンケン電気	7.5	6.6	32,076	
イワキポンプ	4	4.9	6,468		サンデン	9.2	11.1	2,886		ナカヨ	1.1	1.2	1,273	
フリュー	6.8	6.8	7,126		ジャノメ	6.5	6.6	4,554		アイホン	4.3	3.4	6,871	
ヤマシンフィルタ	13.8	11.8	3,964		マックス	8.8	9	17,937		ルネサスエレクトロニクス	362.2	417.2	557,379	
日阪製作所	8.1	7.5	6,262		グロリー	16.9	18.1	41,847		セイコーエプソン	83.4	85.4	183,097	
やまびこ	12.6	10.5	12,054		新晃工業	6.3	7.1	11,111		ワコム	49.2	58.6	44,653	
野村マイクロ・サイエンス	—	2.4	8,796		大和冷機工業	10.9	9.8	10,819		アルバック	12.5	15.2	86,336	
平田機工	3	3.3	14,899		セガサミーホールディングス	60.8	68.7	135,545		アクセル	2.8	3	2,832	
ペガサスミシン製造	6.6	7.7	7,161		日本ピストンリング	2.7	2.9	3,677		E I Z O	5.8	5.2	19,942	
マルマエ	2.9	3.1	6,156		リケン	2.9	2.9	7,015		ジャパンディスプレイ	61.7	61.7	2,961	
タツモ	3.1	3.5	4,907		T P R	8.6	8.6	11,094		日本信号	15.5	16.3	15,468	

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	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円
京三製作所	13.4	15.1	6,432	三井ハイテック	6.7	6.6	52,602	日本エム・ディ・エム	4	4.4	5,654									
能美防災	8.8	8.7	13,902	新光電気工業	22.9	22.5	82,237	島津製作所	86.5	91.3	352,874									
ホーチキ	4.6	4.8	6,432	京セラ	102	107.5	869,997	JMS	5.9	5.9	3,268									
星和電機	3.4	3.1	1,373	太陽誘電	30	34	140,930	クボテック	1.8	2	472									
エレコム	15.6	17.5	27,860	村田製作所	197.2	208.5	1,541,440	長野計器	5.1	5.1	5,457									
パナソニックホールディング	715.6	815.4	908,763	双葉電子工業	10.8	12.7	8,166	ブイ・テクノロジ	3.1	3.3	9,352									
シャープ	89.6	72.6	68,607	北陸電気工業	2.2	2.8	3,052	東京計器	4.1	4.9	6,041									
アンリツ	40.9	48.4	78,988	ニチコン	21.8	20.3	29,861	愛知時計	0.7	2.8	4,020									
富士通ゼネラル	20.8	20.7	61,272	日本ケミコン	7	7.2	14,176	インターアクション	3.5	3.8	6,410									
ソニーグループ	420.6	478.9	4,959,009	KOA	9.6	10.6	25,577	オーバル	6.6	7.4	3,315									
TDK	32.5	110.7	564,570	市光工業	9.8	9.6	3,868	東京精密	11.4	11.9	55,632									
帝国通信工業	2.7	3.3	4,725	小糸製作所	40.1	38.2	178,203	マニー	26.7	28	51,100									
タムラ製作所	25.2	27.6	18,878	ミツバ	12.7	11.7	4,925	ニコン	102.7	107.9	160,123									
アルプスアルパイン	54.7	62.6	77,185	SCREENホールディングス	11.7	12.1	109,021	トプコン	34	36	65,016									
池上通信機	2.4	2.3	1,350	キャノン電子	6.2	7	11,319	オリンパス	352.1	366.2	1,089,261									
日本電波工業	7.1	7.7	11,349	キャノン	333.6	348.3	1,157,052	理研計器	5.9	5.1	21,853									
鈴木	3.1	3.8	3,359	リコー	171.6	181.9	207,184	タムロン	5.6	4.8	14,904									
メイコー	—	8.3	24,260	象印マホービン	17.9	18.9	30,580	HOYA	131	147.6	2,137,986									
日本トリム	1.6	1.5	3,549	MUTOHホールディングス	0.9	1	1,930	シード	2.4	3.6	1,990									
ローランドディー・ジー	4	3.6	11,520	東京エレクトロン	39.3	48.5	1,990,440	ノーリツ鋼機	6.2	6	14,946									
フォスター電機	6.6	7.2	5,637	輸送用機器 (7.9%)				A&Dホロンホールディングス	5.8	8.7	7,838									
S MK	1.6	1.7	4,148	トヨタ紡織	19.8	26.8	52,662	朝日インテック	72.2	83.9	202,366									
ヨコオ	5.5	5.2	11,076	芦森工業	1.2	1.6	1,635	シチズン時計	85.2	74.9	46,438									
ティアック	5.2	12.6	1,423	ユニプレス	10.6	12.7	12,496	リズム	1.9	2.5	3,652									
ホシデン	18	17	27,574	豊田自動織機	54.3	54.1	398,176	大研医器	4.8	6.1	2,891									
ヒロセ電機	10.4	10.6	213,802	モリタホールディングス	10.2	12.3	16,063	メニコン	10.5	23.6	71,036									
日本航空電子	15.8	15.4	36,790	三桜工業	9.5	10.7	7,811	シンシア	1.4	0.7	315									
TOA	7.4	8.3	6,706	デンソー	147.8	149.6	1,110,780	松風	3.2	2.6	5,816									
マクセル	13.1	14	20,874	東海理化電機	17.5	20.3	30,896	セイコーHD	9.7	10.9	32,918									
古野電気	8.5	9.2	10,460	川崎重工業	52.7	51.9	128,037	ニプロ	49.8	53	58,459									
ユニデンホールディングス	1.8	—	—	名村造船所	21.9	20	13,000	その他製品 (2.5%)												
スミダコーポレーション	6.2	5.8	6,177	日本車輛	2.2	2.4	5,044	中本パックス	1.6	2.2	3,451									
アイコム	2.8	2.4	6,295	三菱ロジスネクスト	9.1	10.1	7,928	スノーピーク	4.5	10.9	24,132									
リオン	2.9	2.7	5,516	近畿車輛	1	1.2	1,184	パラマウントベッドHD	12.5	14.7	38,058									
本多通信工業	4.4	2.8	1,974	日産自動車	790.6	901.8	484,897	トランザクション	4.5	4.8	5,097									
横河電機	66.6	70.2	163,987	いすゞ自動車	178.9	221.4	396,084	粧美堂	2.3	1.5	639									
新電元工業	2.7	2.7	10,530	トヨタ自動車	680.1	3,485.1	7,139,227	ニホンフラッシュ	5.7	6	5,790									
アズビル	45.6	44.3	175,649	日野自動車	84.6	95.4	62,868	前田工業	7.6	6.8	22,406									
東亜ディーケーケー	2.8	3.9	3,287	三菱自動車工業	250.8	283.5	173,502	永大産業	8.6	7.5	1,830									
日本光電工業	27.8	29.4	87,994	エフテック	5.3	4.7	2,486	アートネイチャー	6.3	6.4	4,742									
チノー	1.8	2.4	3,950	レシップホールディングス	2.9	2.9	1,493	パングイナムコHLDGS	55.5	63.2	627,449									
共和電業	6.6	7	2,380	GMB	1.6	1.4	984	アイフィスジャパン	1.8	2.2	1,313									
日本電子材料	2.9	3.6	5,364	ファルテック	1.4	1.6	950	共立印刷	8.2	10.1	1,343									
堀場製作所	12.3	14.1	85,164	武蔵精密工業	15.4	17	29,070	S H O E I	6.5	6.7	35,912									
アドバンテス	50	56.8	420,888	日産車体	9.3	11.4	9,120	フランスベッドHLDGS	9.8	10	9,130									
小野測器	2.5	2.7	1,096	新明和工業	19.5	20	20,780	パイロットコーポレーション	11.1	10	53,900									
エスベック	5.8	5.7	10,163	極東開発工業	11.6	12.4	17,136	萩原工業	3.8	4.1	4,305									
キーエンス	65.9	69.3	3,547,467	トビー工業	5.4	5.9	8,260	トッパン・フォームズ	11.9	—	—									
日置電機	3.3	3.3	21,846	ティラド	2.2	2.1	5,709	フジールインターナショナル	13.7	15.8	24,110									
シスメックス	52.4	54.7	449,141	タチエス	10.5	12.6	15,561	タカラトミー	30.3	31.6	41,585									
日本マイクロニクス	11.5	10.5	14,290	NOK	32.4	28.9	36,442	広済堂ホールディングス	5.2	4.8	6,019									
メガチップス	6.7	6.8	17,829	フタバ産業	16.1	17.1	5,899	エステールホールディングス	4	1.4	877									
OBARA GROUP	3.7	3	9,885	K Y B	7.7	6.7	22,880	タカノ	2.1	2.8	2,100									
澤藤電機	0.8	1	1,142	大同メタル工業	13	14.7	7,599	プロネクス	5.3	5.8	5,631									
原田工業	2.7	3.6	2,808	プレス工業	32.6	34.7	14,955	ホクシン	6.9	5.6	817									
コーセル	8.2	8.5	7,225	ミクニ	7.9	9.3	3,041	ウッドワン	2.5	2.3	2,684									
イリソ電子工業	5.7	6.4	26,784	太平洋工業	14.1	14.7	16,067	大建工業	4.5	3.8	7,296									
オプテックスグループ	11.1	11.7	24,593	河西工業	9.4	9.2	1,950	凸版印刷	101.3	99.6	224,996									
千代田インテグレ	2.7	2.6	5,751	アイシン	49.2	56	228,480	大日本印刷	79	82.8	250,470									
アイ・オー・データ	2.4	—	—	マツダ	211.9	225.1	271,470	共同印刷	2	1.9	4,805									
レーザーテック	29.6	31.3	547,280	今仙電機製作所	5.6	5.2	2,953	N I S S H A	13.8	12.1	22,518									
スタンレー電気	46.9	49.3	126,355	本田技研	528.2	558.9	1,981,300	光村印刷	0.6	0.4	491									
岩崎電気	2.4	2.5	6,297	スズキ	133.1	151.5	755,833	TAKARA & COMPANY	3.3	4.4	9,279									
ウソコ電機	35	36.3	58,697	SUBARU	192	201	512,349	アシックス	59.7	58.6	153,942									
岡谷電機	4.6	5.3	1,303	安永	3.2	3.1	2,250	ツツミ	2.1	1.9	3,784									
ヘリオステクノH	6.2	7.2	2,728	ヤマハ発動機	87.8	99.7	292,121	ローランド	—	4.6	19,205									
エノモト	2.1	2.1	3,126	T B K	7.4	7.3	2,219	小松ウオール工業	2.2	2.3	4,370									
日本セラミック	6.7	6.4	16,844	エクセディ	9.1	11.6	21,054	ヤマハ	39.9	44.4	229,992									
遠藤照明	3.3	3.5	2,698	豊田合成	22	21.7	52,080	河合楽器	2	1.9	5,168									
古河電池	4.9	5.4	6,312	愛三工業	10.6	12.2	8,991	クリナップ	6	7.3	4,409									
双信電機	3.3	3.8	1,584	盟和産業	1.1	1.1	1,084	ピジョン	40.8	40.5	85,779									
山一電機	4.5	5	10,095	日本プラスト	5.1	5.4	2,484	兼松サステック	0.6	0.4	644									
図研	4.6	5	18,050	ヨロズ	5.5	5.9	5,174	キングジム	5.6	5.6	5,129									
日本電子	12.4	14.7	79,527	エフ・シー・シー	10.5	12.8	18,764	リンテック	14	14.6	33,915									
カシオ	54	47.3	63,571	シマノ	27.1	26	638,300	イトーキ	12.9	12.7	5,524									
ファナック	58.9	67.1	1,463,115	テイ・エス テック	30.8	32.5	50,472	任天堂	38.5	43.2	2,671,056									
日本シイエムケイ	13.9	13.6	6,460	ジャムコ	4.3	4.6	6,371	三菱鉛筆	10.6	9.3	13,122									
エンプラス	3.1	1.9	8,474	精密機器 (2.8%)				タカラスタンダード	13.2	12.3	16,260									
大真空	2.5	9.5	9,091	テルモ	205.8	216.3	933,983	コクヨ	32.5	30.6	55,967									
ローム	27.9	31.8	338,352	クリエートメディック	1.8	2.5	2,262	ナカバヤシ	5.8	5.5	2,805									
浜松ホトニクス	48.3	50.9	322,706	日機装	21.5	15.8	15,942	グローブライド	3.4	5.7	14,512									

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
オカムラ	23.6	21.5	29.4	29.4	ANAホールディングス	172	172.3	480.4	480.4	ガンホー・オンライン・エンター	17.8	19.5	43.7	43.7
美津濃	6.8	6.3	17.3	17.3	パスコ	1.3	1.4	1,827	1,827	GMOペイメントゲートウェイ	12.9	14.5	152.5	152.5
電気・ガス業 (1.3%)					倉庫・運輸関連業 (0.2%)					ザッパラス	4.1	2.4	756	756
東京電力HD	573.4	572.5	277.0	277.0	トランコム	2	2	16,620	16,620	システムリサーチ	2.1	2.1	3,948	3,948
中部電力	204.9	215.8	304.9	304.9	日新	4.9	5.3	9,905	9,905	インターネットニアティブ	18	20	95,500	95,500
関西電力	253.5	267.2	348.9	348.9	三菱倉庫	22	17.5	62,562	62,562	さくらインターネット	7.8	7.8	4,282	4,282
中国電力	97.7	110.2	85.1	85.1	三井倉庫 HOLD	6.9	7.1	23,749	23,749	ヴィンクス	1.9	2.2	3,330	3,330
北陸電力	62.4	64.6	32.1	32.1	住友倉庫	22.5	21.3	45,603	45,603	GMOグローバルサインHD	1.6	2	9,630	9,630
東北電力	156.4	167.1	115.8	115.8	渋沢倉庫	3.4	3.5	7,248	7,248	SRAホールディングス	3.6	3.6	11,088	11,088
四国電力	55.1	63.7	50.1	50.1	東陽倉庫	9.6	10.1	2,747	2,747	システムインテグレート	1.8	2.4	1,036	1,036
九州電力	148.5	146.6	117.7	117.7	日本トランスシティ	13.5	12.8	6,464	6,464	朝日ネット	6	6.6	4,065	4,065
北海道電力	64.3	66.1	33.8	33.8	ケイヒン	1.1	1.2	1,726	1,726	e B A S E	8.6	8.9	4,859	4,859
沖縄電力	13	16.1	17.7	17.7	中央倉庫	3.5	3.6	3,391	3,391	アパント	7.7	8	10,744	10,744
電源開発	53.3	56.5	120.0	120.0	川西倉庫	1.1	1.3	1,345	1,345	アドソル日進	2.7	2.6	3,837	3,837
エフオン	4.5	4.6	2,957	2,957	安田倉庫	5	4.9	4,508	4,508	ODKソリューションズ	—	1.5	946	946
イーレックス	10.2	9.9	28,353	28,353	ファイズホールディングス	1.4	1.6	1,606	1,606	フリービット	4.7	3.8	3,351	3,351
レノバ	11.7	15	53,775	53,775	東洋埠頭	1.8	1.8	2,192	2,192	コムチュア	6.2	8.4	19,378	19,378
東京瓦斯	128.7	136.1	352,771	352,771	宇徳	5.4	—	—	—	サイバーコム	1.1	1.2	1,647	1,647
大阪瓦斯	120.9	128.6	296,551	296,551	上組	34.9	34.4	95,563	95,563	アステリア	5.2	5.5	4,559	4,559
東邦瓦斯	33.1	30	90,900	90,900	サンリツ	1.9	1.6	1,075	1,075	アイル	3.9	3.6	6,696	6,696
北海道瓦斯	3.5	3.7	6,153	6,153	キムラユニティー	1.4	3.8	3,055	3,055	マークラインズ	3.6	3.4	8,262	8,262
広島ガス	11.7	12.7	4,216	4,216	キューソー流通システム	1.5	4.2	5,825	5,825	メディカル・データ・ビジ	8.9	9.5	9,462	9,462
西部ガス HLDGS	7.4	7.4	13,253	13,253	近鉄エクスプレス	12	—	—	—	g u m i	9.5	10.5	9,429	9,429
静岡ガス	19.3	14.5	15,210	15,210	東海運	4	4.1	1,098	1,098	ショーケース	1.9	1.6	620	620
メタウォーター	7.9	7.8	15,670	15,670	エアティイー	4.1	4.5	6,907	6,907	モバイルファクトリー	2.1	1.6	1,454	1,454
陸運業 (3.2%)					内外トランスライン	2.7	2.3	5,152	5,152	テラスカイ	2.5	2.7	5,332	5,332
SBSホールディングス	5.4	5.6	16,626	16,626	日本コンセプト	2.2	2	3,450	3,450	デジタル・インフォメーション	3.4	3.3	5,016	5,016
東武鉄道	69.5	69.8	238,367	238,367	情報・通信業 (9.1%)					PCIホールディングス	3.6	2.8	2,646	2,646
相鉄ホールディングス	22.6	22.9	55,509	55,509	NEC ネットズエスアイ	22.3	24.8	39,928	39,928	パイプドHD	1.6	—	—	—
東急	168.3	178	304,380	304,380	クロスキャット	1.8	4.1	5,391	5,391	アイビージー	1.4	1.2	541	541
京浜急行	86	85.3	127,864	127,864	システナ	24	107	44,940	44,940	ネオジャパン	1.7	2.1	2,093	2,093
小田急電鉄	107.3	96.2	183,838	183,838	デジタルアーツ	3.9	4	26,520	26,520	P R T I M E S	1.8	1.6	3,904	3,904
京王電鉄	37.4	33.6	183,456	183,456	日鉄ソリューションズ	9.7	13	46,280	46,280	ラクス	20.4	34.4	51,909	51,909
京成電鉄	50.5	46.5	189,720	189,720	キューブシステム	3.8	3.9	3,974	3,974	ランドコンピュータ	1	1.7	1,431	1,431
富士急行	9.2	7.8	35,412	35,412	WOW WORLD	1.7	1	866	866	ダブルスタンダード	1	2.3	5,352	5,352
新京成電鉄	1.9	—	—	—	コア	2.6	3.1	4,324	4,324	オープンドア	4.3	4.5	10,080	10,080
東日本旅客鉄道	118.2	116.6	888,958	888,958	手間いらざ	1	1.1	5,786	5,786	マイネット	2.6	2.3	1,117	1,117
西日本旅客鉄道	75	81.1	463,486	463,486	ラクーンホールディングス	5	6.4	7,532	7,532	アカツキ	2.9	3.4	7,622	7,622
東海旅客鉄道	55.8	53.8	919,980	919,980	ソリトシステムズ	3.6	3.3	3,636	3,636	ベネフィットジャパン	0.7	0.6	941	941
西武ホールディングス	81.3	92.4	143,404	143,404	ソフトクリエイトHD	2.7	3.3	11,253	11,253	UBICOMホールディングス	2	2	4,626	4,626
鴻池運輸	10.4	10.7	15,429	15,429	T I S	66.3	65.6	268,632	268,632	カナミックネットワーク	7.5	9.3	4,836	4,836
西日本鉄道	18.4	18.3	53,838	53,838	JNSホールディングス	4.3	3.6	1,404	1,404	ノムラシステムコーポレーション	3.9	7	896	896
ハマキョウレックス	5	5	16,225	16,225	グリー	42.6	34.3	29,498	29,498	チェンジ	12.6	15.6	29,000	29,000
スカイ引越センター	3.2	3.5	17,202	17,202	GMOペパボ	—	0.9	1,622	1,622	シンクロ・フード	5.2	4.1	1,914	1,914
近鉄グループHLDGS	63.4	68	331,840	331,840	コーエーテックモHD	17.9	23.9	110,896	110,896	オークネット	3.9	3.3	7,240	7,240
阪急阪神HLDGS	84	84.4	367,984	367,984	三菱総合研究所	2.8	3.1	13,531	13,531	キャピタル・アセット・プラン	—	1.4	998	998
南海電鉄	29.8	30.3	87,839	87,839	ボルテージ	3.1	2.1	644	644	セグエグループ	2	1.6	1,073	1,073
京阪ホールディングス	28.3	28.3	105,276	105,276	電算	0.8	0.7	1,302	1,302	エイトレッド	1.6	1	1,802	1,802
神戸電鉄	1.5	1.7	5,788	5,788	A G S	3.1	3	2,019	2,019	マクロミル	13.5	14.4	15,696	15,696
名古屋鉄道	52.3	70	159,530	159,530	ファインデックス	6.1	5.1	2,978	2,978	ビーグリー	1.7	1.2	1,638	1,638
山陽電鉄	4.4	5.2	11,481	11,481	ブレインパッド	1.9	6.4	6,124	6,124	オロ	2.3	1.9	3,041	3,041
アルプス物流	—	5.1	5,727	5,727	K L a b	12	12	5,244	5,244	ユーザローカル	2.7	2.2	3,500	3,500
日本通運	22	—	—	—	ポルトゥウィンホールディン	8.9	10.9	10,267	10,267	テモナ	2	1.3	414	414
ヤマトホールディングス	89.1	99.1	214,551	214,551	イーブックイニシアティブ	1.3	—	—	—	ニーズウェル	1.8	2.3	1,501	1,501
山九	16.2	17.6	74,712	74,712	ネクソン	148.6	171.3	440,926	440,926	マネーフォワード	—	15.3	51,561	51,561
丸運	4.3	3	660	660	アイススタイル	21.6	19.4	10,088	10,088	サインポスト	1.8	2.5	2,105	2,105
丸全昭和運輸	5.2	4.9	15,239	15,239	エムアップホールディングス	2	8.7	14,233	14,233	電算システムHD	2.9	3.1	6,999	6,999
センコーグループHLDGS	36.2	33.4	33,233	33,233	イーチーム	5.1	4.7	3,783	3,783	ソルクシーズ	3	6	2,184	2,184
トナミホールディングス	1.5	1.4	5,236	5,236	エニグモ	6.5	8.1	4,195	4,195	フェイス	2.5	1.9	1,054	1,054
ニッコンホールディングス	21.3	21.8	52,886	52,886	テクノスジャパン	5.3	5.8	2,592	2,592	プロトコーポレーション	8.1	8.1	8,764	8,764
日石輸送	0.6	0.8	1,902	1,902	e n i s h	3.9	5.6	2,380	2,380	ハイマックス	2.2	2	2,660	2,660
福山通運	8.1	9.3	31,294	31,294	コプロ	21.3	24.8	17,112	17,112	野村総合研究所	114.8	130.4	466,832	466,832
セイノーホールディングス	47.6	39.5	45,938	45,938	オルトプラス	5.1	5.6	1,680	1,680	サイバネットシステム	5.3	5.3	5,135	5,135
エスライン	1.3	2	1,602	1,602	ブロードリーフ	33.8	37.2	19,232	19,232	C Eホールディングス	3.8	3.7	1,831	1,831
神奈川中央交通	1.5	1.8	6,327	6,327	クロス・マーケティングG	3.3	2.9	2,508	2,508	日本システム技術	1.2	1.4	3,490	3,490
日立物流	13.4	13.3	116,774	116,774	デジタルハーツHLDGS	3.4	3.4	6,572	6,572	インテージホールディングス	8.8	8.6	13,940	13,940
丸和運輸機関	13.8	12.2	18,702	18,702	システム情報	5.4	5.6	5,398	5,398	東邦システムサイエンス	1.4	1.9	1,939	1,939
C&Fロジホールディングス	6.3	6.1	7,277	7,277	メディアアドゥ	2.8	2.5	4,785	4,785	ソースネクスト	33.4	32.7	8,829	8,829
九州旅客鉄道	49.5	48.7	153,161	153,161	じげん	17	21.4	7,340	7,340	インフォコム	6.6	8.1	15,681	15,681
SGホールディングス	120.5	121.5	251,505	251,505	バイクューブ	7	7.6	7,850	7,850	シンプレクスHD	—	11.9	23,681	23,681
NIPPON EXPRESS	—	23.6	170,864	170,864	エンカレッジ・テクノロジー	1.1	1.7	868	868	H E R O Z	2	2.2	2,457	2,457
海運業 (0.6%)					サイバーリンクス	2.6	2.3	2,628	2,628	ラクスル	7.4	8.9	24,457	24,457
日本郵船	53.4	60.6	581,760	581,760	ディー・エル・イー	4.3	4.3	1,419	1,419	メルカリ	—	28.5	61,332	61,332
商船三井	37.9	111.7	366,376	366,376	フィックスターズ	7.1	7.3	7,891	7,891	I P S	—	2.1	6,279	6,279
川崎汽船	19.8	22.3	164,574	164,574	CARTA HOLDINGS	3	3.1	5,359	5,359	F I G	6.8	8.3	3,311	3,311
NSユニテッド海運	3.2	3.4	14,739	14,739	オプティム	5	5.2	4,466	4,466	システムサポート	1.9	2.6	3,723	3,723
明治海運	7	6.9	5,078	5,078	セレス	2.6	2.5	2,527	2,527	イール	4	4.1	2,	

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	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円
東名	—	0.6	651	NTTデータ	175.8	199.7	389,015	メディアパルHD	66.2	69.7	130,339									
ヴィッツ	—	0.7	732	ピー・シー・イー	1.1	4.4	4,760	S P K	2.9	2.9	4,022									
トピックスシステムズ	1.6	1.9	1,852	ビジネスB太田昭和	2.6	2.5	3,677	萩原電気HLDGS	2.4	2.4	5,337									
Sansan	6	23.7	32,540	D T S	14	13.9	48,997	アズワン	4.8	10.8	64,692									
Link-U	—	1.3	916	スクウェア・エニックス・HD	28.1	34.9	217,427	スズデン	2.2	2.3	4,620									
ギフト	—	6.8	15,708	シーイーシー	7.2	8.1	11,680	尾家産業	2	1.7	1,456									
ベース	—	1.1	7,667	カプコン	56.8	70.7	261,943	シモジマ	4.2	4.4	4,884									
JMDC	—	9.4	50,760	アイ・エス・ビー	4.1	3.2	4,012	ドウシシャ	6.2	7.2	10,720									
フォーカスシステムズ	5.6	4.5	4,396	ジャステック	4.1	3.8	4,639	小津産業	1.7	1.7	2,998									
グレスコ	4.7	5.5	9,702	S C S K	15.3	51.8	116,394	高速	3.5	3.8	5,836									
フジ・メディア・HD	68.5	66.2	73,614	NSW	2.1	2.9	6,394	たけびし	2.2	2.6	3,900									
オービック	20.8	23.6	468,932	アイネス	6.8	6.4	9,708	リックス	1.3	1.6	3,420									
ジャストシステム	9.5	10.7	35,577	T K C	11.5	11.4	39,843	丸文	5.6	5.9	4,926									
TDCソフト	5.9	5.9	7,133	富士ソフト	7.2	7.2	58,176	ハビネット	6	5.5	8,910									
Zホールディングス	869.7	1,081.4	439,048	NSD	21.6	23.3	57,690	橋本総業HLDGS	1.6	1.3	2,624									
トレンドマイクロ	35.3	36.8	299,552	コナミグループ	24	27.3	184,002	日本ライフライン	21.3	22.4	22,288									
IDホールディングス	3.6	4.5	3,951	福井コンピュータHLDGS	3.3	3.4	12,036	タカショー	5.1	5.9	3,982									
日本オラクル	13.5	12.2	97,966	JBCCホールディングス	4.2	5	9,200	マルカ	2.3	—	—									
アルファシステムズ	1.9	2	8,680	ミロク情報サービス	6.6	6.7	10,110	I DOM	22.7	22.9	20,884									
フューチャー	7.9	15.9	25,710	ソフトバンクグループ	522.9	449.8	2,481,546	進和	3.8	4.5	9,868									
CAC HOLDINGS	4.1	4.1	5,899	卸売業 (5.7%)	—	—	—	エスケイジャパン	2.6	1.9	1,026									
S B テクノロジー	2.8	3.2	7,708	ハウスイ	0.5	—	—	ダイトロン	2.8	2.6	5,478									
トーセ	1.7	2	1,528	高千穂交易	2.5	2.7	5,880	シークス	9.4	9.6	10,992									
オービックビジネス	6.5	7.2	33,588	オルパヘルスケアHLDGS	1.1	1.2	1,705	田中商事	1.7	1.9	1,077									
伊藤忠テクノソリューションズ	30.5	34.1	116,451	伊藤忠食品	1.6	1.5	7,455	オーハシテクノカ	3.4	3.6	5,115									
アイティフォー	8.8	9.2	7,065	エレマテック	5.8	5.9	8,035	白銅	2.3	2.4	6,182									
東計電算	0.9	0.9	5,490	J A L U X	1.7	—	—	ダイコー通産	0.9	0.9	988									
エクスネット	1.6	1.1	1,103	あらた	5.1	5.5	23,210	伊藤忠	462.5	451.3	1,716,745									
大塚商会	35.9	36.1	161,186	トーマンデバイス	0.9	1.1	6,292	丸紅	652.2	652.2	922,536									
サイボウズ	9.2	8.7	12,223	東京エレクトロデバイス	2.2	2.2	12,232	高島	1	1	2,615									
電通国際情報	9.8	7.7	34,380	フィールズ	5.9	6.6	10,282	長瀬産業	35.8	34.2	70,281									
ACCES	8.4	8.6	6,355	双日	367.4	77.2	181,342	蝶理	4.3	4.2	8,530									
デジタルガレージ	10.9	12.4	45,880	アルフレッサホールディングス	68.6	78.1	134,253	豊田通商	66.2	67.1	331,138									
イーエムシステムズ	11.7	10.7	9,030	横浜冷凍	17.4	18.7	17,129	三共生興	9.2	10.1	4,787									
ウェザーニューズ	2.1	2.3	18,170	神栄	1.2	1.1	918	兼松	26.1	26	38,974									
C I J	4	5.6	4,267	ラサ商事	3.3	3	2,952	ツカモトコーポレーション	1.4	1.1	1,158									
ビジネスエンジニアリング	0.8	1.7	3,607	アルコニックス	7.2	9.7	13,318	三井物産	527.9	545.6	1,809,755									
日本エンタープライズ	8.4	7.3	1,124	神戸物産	51.6	51.9	185,283	日本紙パルプ	3.3	3.6	16,164									
WOWOW	3.3	2.8	3,808	ハイパー	1.6	1.5	661	カメイ	8.1	8	8,912									
スカラ	6.5	6.2	4,414	あいホールディングス	9.3	10.7	23,368	東都水産	0.4	0.4	1,980									
インテリジェントウェイブ	3.7	4	2,880	ディーブイエックス	2.1	2.4	2,112	OUGホールディングス	1	1	2,876									
IMAGICA GROUP	5.4	5.4	5,054	ダイワボウHD	30.3	32	62,528	スターゼン	5	5	10,540									
ネットワンシステムズ	27.1	27.7	81,271	マクニカホールディングス	16	17.8	50,285	山善	25	27.2	25,105									
システムソフト	18.4	22.6	2,327	ラクト・ジャパン	3	2.6	5,688	椿本興業	1.2	1.2	4,440									
アルゴグラフィックス	5.3	5.8	22,852	グリムス	—	3.3	5,583	住友商事	416.2	445.5	878,971									
マーベラス	10.4	11.8	7,976	バイタルK S K HD	11.3	11.8	7,788	内田洋行	2.9	3	13,035									
エイベックス	11.7	13	20,644	八洲電機	4.6	5.5	5,527	三菱商事	402.7	493.7	2,156,975									
B I P R O G Y	23.1	23.4	74,529	メディアスホールディングス	3.9	4.1	2,870	第一実業	3.2	2.9	11,150									
兼松エレクトロニクス	3.6	4.1	16,646	レスターホールディングス	6.5	7.1	14,249	キャンマーケティングJPN	16.3	15.5	49,522									
都築電気	—	3.4	4,471	ジュテックHD	1.4	1.6	1,745	西華産業	3.3	3.1	5,099									
TBSホールディングス	43.6	36.6	60,024	大光	3	3.3	2,313	佐藤商事	5.1	5	5,810									
日本テレビHLDGS	55.1	62.8	74,983	OCHIホールディングス	1.9	1.5	1,864	菱洋エレクトロ	5.1	4.4	9,869									
朝日放送グループHD	5.3	6.1	3,928	TOKAIホールディングス	31.5	36.3	32,161	東京産業	6.6	6.3	4,995									
テレビ朝日HD	20.6	18	25,956	黒谷	2.4	2.1	1,184	ユアサ商事	6.6	6	21,690									
スカパーJSATHD	42.6	63.5	34,544	Cominix	1.3	0.8	577	神鋼商事	1.5	1.7	7,021									
テレビ東京HD	4.5	4.6	8,951	三洋貿易	6.9	7	7,525	トルク	3.9	1.9	419									
日本BS放送	2	2.4	2,246	ビューティガレージ	1.2	1.2	3,423	阪和興業	13.3	13	47,645									
ビジョン	11.9	8.4	11,928	ウイン・パートナーズ	4.6	5.3	5,040	正栄食品	4.2	4.5	19,350									
スマートバリュー	2.1	1.7	790	ミタチ産業	1.1	2.1	1,738	カナデン	5.3	6.1	6,581									
USEN-NEXT HLDGS	6.8	5.7	11,844	シップヘルスケアHD	23.5	21.6	56,829	菱電商事	4.7	5.8	9,436									
ワイヤレスゲート	3.1	3.2	905	明治電機工業	2.1	2.2	2,323	フルサト工業	3.4	—	—									
コネクシオ	4.2	5.3	6,593	デリカフーズHLDGS	3.5	2.8	1,450	岩谷産業	16.1	16.7	91,850									
日本通信	60.9	62.6	13,772	スターティアホールディングス	1.6	1.7	1,694	ナイス	2.5	2.5	3,910									
クロップス	1.2	1.6	1,440	コメダホールディングス	14.6	16.3	38,891	ニチモウ	1	0.9	2,407									
日本電信電話	770.5	840.9	3,292,123	ピーバンドットコム	1.2	1.1	561	極東貿易	2.1	4.4	5,838									
KDDI	528.4	546.9	2,391,046	アセンテック	2	2.5	1,467	アステナホールディングス	10.8	11.6	5,080									
ソフトバンク	599.1	1,135.7	1,706,957	富士興産	2.1	1.9	2,287	三菱オプティ	16.2	16.8	18,933									
光通信	7.8	8.6	153,682	協栄産業	0.7	0.9	1,322	稲畑産業	16	15.1	38,384									
エムティーアイ	7.6	5.9	2,973	フルサト・マルカHD	—	6.7	22,076	G S Iクレオス	3.6	3.6	5,367									
GMOインターネットグループ	23.7	23.6	62,280	ヤマエグループHD	—	4.3	6,888	明和産業	5.9	7	5,565									
ファイバーゲート	2.9	3.4	3,155	小野建	5.5	6.9	10,239	クワザホールディングス	2.5	2.6	1,099									
アйдマーケティングコミュ	1.7	1.7	496	南陽	1.2	1.4	2,639	ヤマエ久野	4.6	—	—									
KADOKAWA	17.3	40.4	112,675	佐島電機	4	4.8	5,942	ワキタ	13	13.7	15,467									
学研ホールディングス	9.6	10.6	10,154	エコートレーディング	1.9	1	537	東邦ホールディングス	20.8	20.4	39,086									
ゼンリン	11.7	12.5	11,500	伯東	4.4	4.4	15,290	サンゲツ	17.5	18.1	29,665									
昭文社ホールディングス	3.4	3.3	1,029	コンドートック	4.8	5.5	5,604	ミツウロコグループ	9.9	8.4	8,635									
インプレスホールディングス	8.9	6.2	1,289	中山福	4.3	3.3	1,029	シナネンホールディングス	2.5	2.5	9,362									
アイネット	3	3.5	4,655	ナガイレーベン	8.4	9.1	17,826	伊藤忠エネクス	14.9	16.5	17,671									
松竹	4.3	4.3	51,901	三菱食品	7	7.3	24,345	サンリオ	19.1	21.2	78,864									
東宝	38.9	44.3	232,132	松田産業	5.2	5.5	12,391	サンワテクノス	4.4	3.8	5,149									
東映	2.2	2.1	37,737	第一興商	12.9	14.3	59,345	リョーサン	6.8	7.7	18,010									

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
新光商事	9.1	9.8	9.349	千円	ZOZO	39.2	51.8	158,767	千円	YU-WA CREATION H	4.3	3.9	807	千円
トーヨー	3	2.9	4,405		トレジャー・ファクトリー	2.1	2.2	4,197		コロナイド	22	31	59,427	
三信電気	4.1	2.8	4,930		物語コーポレーション	3.7	3.7	26,159		ピーシーデポコーポ	7.4	8.4	2,301	
東陽テクニカ	6.9	7.3	9,497		ココカラファイン	5.9	—	—		番番屋	4.4	5.3	23,956	
モスフード サービス	9	9.9	31,234		三越伊勢丹HD	116.5	113.2	139,122		トップカルチャー	2.5	1.5	313	
加賀電子	6.2	6.1	25,132		Hamee	1.9	2.7	2,589		P L A N T	1.6	1.8	1,164	
ソーダニツカ	6.3	5.8	3,567		マーケットエンタープライズ	—	0.8	734		スギホールディングス	13.3	15	90,150	
立花エレテック	4.6	4.8	7,814		ウエルシアHD	35.2	39.8	120,992		葉王堂ホールディングス	2.8	3.8	9,192	
フオーバル	2.2	2.7	2,713		クリエイトSDH	9.7	11	34,375		ヴィア・ホールディングス	7.6	9.5	1,320	
P A L T A C	10.7	10.6	45,686		丸善 CHD	5.1	8.2	2,796		スクロール	9.9	11.6	8,595	
三谷産業	9.4	11.5	3,542		ミサワ	1.9	1.4	824		ヨンドシーホールディングス	6.2	6.4	11,411	
太平洋興発	2.6	2.6	1,770		ティーライフ	1.4	1	1,235		木曾路	8.3	10.2	22,021	
西本 WISMETTAC HD	1.5	1.7	6,825		イー・ピーホールディングス	1.7	1.3	590		SRS ホールディングス	8.2	10.9	9,592	
ヤマシタヘルスケアHLDGS	0.9	0.7	1,050		チムニー	2.1	2.4	2,964		千趣会	11.8	12.2	4,794	
コア商事 HLDGS	—	4.8	3,115		シュッピン	4.8	6.2	7,874		タカキユウ	7.3	3.9	319	
国際紙パルプ商事	13.6	14.1	9,729		オイシックス・ラ・大地	9	10.8	18,900		リテールパートナーズ	7.9	10	10,880	
ヤマタネ	2.9	3.1	4,966		ネクステージ	13.7	15.3	50,184		ケーヨー	11.9	13.7	12,975	
丸紅建材リース	0.5	0.6	1,081		ジョイフル本田	18.6	21.5	37,861		上新電機	7.4	7.2	13,917	
日鉄物産	4.6	4.5	24,255		鳥貴族ホールディングス	2.6	2.5	6,115		日本瓦斯	32.6	36	81,180	
泉州電業	2	1.7	9,690		ホットランド	4.6	5	6,690		ロイヤルホールディングス	11.6	12.8	28,044	
トラスコ中山	13.8	14.1	27,903		すかいらーく HD	92.6	91.9	141,434		東天紅	0.5	0.5	412	
オートボックスセブン	23.4	23.4	33,766		SFP ホールディングス	2.9	3.8	6,532		いなげや	7.3	7.3	8,789	
モリト	4.5	5	3,600		綿半ホールディングス	4.9	5.2	7,280		チヨダ	6.4	6.6	5,280	
加藤産業	9.3	8.1	27,864		ヨシックスホールディングス	1.3	1.5	3,403		ライフコーポレーション	6.2	5.9	15,882	
北恵	1.8	1.5	1,095		ユナイテッド・スーパーマーケット	19	22	23,320		リンガーハット	7.9	8.7	19,192	
イノテック	3.7	4.4	5,953		ゴルフダイジェスト・オン	3.9	3	5,955		MrMaxHD	8.8	9.3	5,812	
イエローハット	12	12	22,032		B E E N O S	3.6	3.8	9,591		テンアライド	5.3	7.2	2,080	
JK ホールディングス	5.8	5.2	5,246		あさひ	5	6.2	8,258		AOKIホールディングス	13.3	14.9	10,891	
日伝	5.3	5	8,885		日本調剤	4.2	4.7	6,030		オークワ	10	10.5	9,912	
北沢産業	4.3	3.6	774		コスモス薬品	6.7	7.6	107,312		コメリ	10	11.6	30,635	
杉本商事	3.2	3.5	6,520		トーエル	3.1	3.4	2,492		青山商事	15.3	14.6	13,884	
因幡電機産業	17.5	18.5	50,597		オンリー	1.1	—	—		しまむら	7.7	8.8	108,328	
東テック	2.3	2.2	7,634		セブン&アイ・HLDGS	258.8	252.4	1,511,876		はせがわ	3.3	3.4	1,244	
ミスミグループ本社	82.9	94.5	318,465		クリエイト・レストランツ・ホール	36.2	50.6	47,513		高島屋	49.2	50.6	86,121	
アルテック	6.3	4.2	1,373		ツルハホールディングス	14.5	16.4	133,332		松屋	14.4	12.7	13,500	
タキヨー	2.1	1.8	1,474		サンマルクホールディングス	5.1	6	9,768		イチ・ツー・オーリテイリング	32.5	32.8	37,457	
蔵王産業	1	1.3	2,338		フェリシモ	1.7	1.6	1,636		近鉄百貨店	2.5	2.1	4,956	
スズケン	28	26.9	90,249		トリドールホールディングス	16.6	18.7	57,970		丸井グループ	56.4	54.4	136,489	
ジェコス	4.5	5.1	4,105		TOKYO BASE	6.9	7	2,485		アクシナルリテイリング	5.3	5	16,700	
グローセル	6.4	8.1	3,377		ウイルプラス HLDGS	1.2	1.5	1,660		井筒屋	3.7	3.7	1,369	
小売業 (4.5%)					JM ホールディングス	4.9	5.6	9,486		イオン	254.2	248.2	669,023	
ローソン	16.6	16.7	78,824		サツドラホールディングス	0.9	3.1	2,018		イズミ	13.5	11.9	36,652	
サンエー	4.8	5.1	21,981		アレンザホールディングス	4.9	4.8	4,713		平和堂	12	11.1	22,344	
カワチ薬品	4.6	5.8	12,209		串カツ田中 HLDGS	1.9	1.8	3,229		フジ	7.9	16.5	31,053	
イービーシー・マート	10.3	11.8	75,520		パロックジャパン	4.9	5.2	4,113		ヤオコー	7.5	8.5	55,760	
ハードオフコーポレーション	2.5	3.2	4,182		クスリのアオキ HLDGS	6.6	6.7	44,488		ゼビオホールディングス	7.4	10.3	10,300	
アスクル	11.2	16.2	26,892		力の源 HD	2.3	4.4	3,502		ケーズホールディングス	56.6	64	78,464	
グオホールディングス	8.9	9.1	15,542		FOOD&LIFE COMPAN	38.9	38.5	92,015		OLYMPIC グループ	3.6	3.5	2,023	
アダストリア	9.4	8.2	18,007		メディカルシステムネットワーク	6.2	6.5	2,665		日産東京販売HD	8.9	12.5	3,575	
ジーフット	3	4.9	1,484		一家ホールディングス	—	1.8	1,398		シルバーライフ	1.5	1.6	2,014	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	1	0.8	315		藤久ホールディングス	—	2.4	1,632		一家ダイニングプロジ	1.3	—	—	
くら寿司	7.1	7.9	24,332		はるやま HLDGS	2.3	3.1	1,264		GENKY DRUGSTORES	2.9	3.3	12,078	
キャンドウ	3.6	2.4	5,342		ノジマ	11.7	12.2	33,062		ナルミヤ・インターナショナル	1.6	1.7	1,456	
アイケイ	—	2.3	959		カッパ・クリエイト	9.1	10.6	15,348		ブックオフGHD	3.7	4.5	4,689	
パルグループHLDGS	5.9	6.7	16,113		ライトオン	4.6	5.7	3,955		ギフトホールディングス	—	1.4	5,264	
エディオン	27.5	34.4	41,039		良品計画	76.2	86.7	111,322		アインホールディングス	9.6	9.3	60,264	
サーラコーポレーション	13.6	14.4	10,843		パリキホールディングス	7.9	9.1	2,293		元気寿司	1.8	2.1	6,562	
ワッツ	3.4	3.6	2,484		アドヴァングループ	6.6	6.3	5,399		ヤマダホールディングス	221	267.2	129,324	
ハローズ	2.7	3.4	10,019		アルビス	1.9	2.1	4,953		アークランズ	10.3	11.9	17,671	
フジオフード G 本社	5.6	5.7	7,660		コナカ	7.8	7.9	2,749		ニトリホールディングス	26.2	29.9	382,570	
あみやき亭	1.3	1.8	5,261		ハウス ローゼ	0.6	0.8	1,295		グルメ軒屋	4.1	6.1	6,240	
ひらまつ	12.7	15.5	2,914		G-7ホールディングス	3.9	8.3	12,217		愛眼	4.4	6.9	1,235	
大黒天物産	2.2	2.4	13,824		イオン北海道	8.9	9.8	11,446		ケーユーホールディングス	3.4	4	4,780	
ハニースホールディングス	5	6.1	7,545		ゴジマ	12.3	12.9	8,230		吉野家ホールディングス	21.7	26.3	62,068	
ファーマライズHD	1.5	1.3	839		ヒマラヤ	2.2	2.4	2,332		松屋フーズ HLDGS	2.9	3.6	13,824	
アルペン	5.3	5.5	11,715		コーナン商事	9.6	10.7	35,791		サガミホールディングス	8.7	11	13,651	
ハブ	2.1	2.4	1,425		エコス	2.5	2.5	4,527		関西フードマーケット	4.8	6.1	6,954	
クオールホールディングス	8.8	9.3	11,569		ワタミ	8.9	9	8,280		王将フードサービス	4.1	5	32,550	
ジンスホールディングス	4.6	4	17,980		マルシェ	1.5	2.1	955		プレナス	7.5	8.4	16,178	
ビックカメラ	38.5	44.5	52,866		バンパシフィック HD	132.5	150.5	404,845		ミニストップ	5.4	5.5	7,881	
DCMホールディングス	40.7	44.5	46,680		西松屋チェーン	14.9	14.9	22,633		アークス	12.7	13.3	27,265	
ベッパーフードサービス	9.2	14.1	3,285		ゼンショーホールディングス	35.4	36.8	133,768		パローホールディングス	13.3	15.3	27,769	
MonotaRO	84.2	95.1	214,450		幸楽苑ホールディングス	4.1	4.4	4,664		藤久	1.7	—	—	
東京一番フーズ	1.6	1.1	654		ハーグスレイ	1	3.1	1,546		ベルク	3.2	3.3	18,315	
DD ホールディングス	3.4	4.1	2,529		サイゼリヤ	10.2	11.2	30,038		大庄	3.1	3.8	4,396	
きちりホールディングス	1.4	1.8	610		V T ホールディングス	25.2	28.8	14,486		ファーストリテイリング	8.9	10.1	828,099	
アークランドサービスHD	5.5	5.5	11,605		魚力	1.9	2	4,380		サンドラッグ	25	28.3	99,191	
J. フロントリテイリング	79.4	83.6	100,570		ポプラ	3.1	1.8	261		サックスパーホールディング	5	7.4	5,032	
ドトール・日レスHD	10.4	11.9	20,337		フジ・コーポレーション	3.4	4.1	5,133		ヤマザワ	1.1	1.2	1,537	
マツキヨココカラ&カンパニー	27.5	44.1	264,159		ユナイテッドアローズ	7.7	8	15,664		やまや	1.2	1.7	4,409	
ブロンコビリー	3.6	3.5	8,592		ハイデイ日高	9.5	11	23,243		ペルーナ	14.9	16.2	11,728	

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	
銀行業 (5.4%)																				
島根銀行	3	2.1	974	福島銀行	7.7	8.2	1,746	サンセイランディック	2	3.2	2,640	エストラスト	1.1	2.8	1,528					
じもとホールディングス	4.3	4.9	2,518	大東銀行	3	3.2	2,028	オーブジャズHD	10.4	10	8,130	オープンハウスグループ	21.2	24	126,480					
めびきフィナンシャルG	344.1	311.1	88,974	トモニホールディングス	48.2	55.5	17,704	東急不動産HD	180.4	205.3	163,213	飯田GHHD	55.3	61.8	133,920					
東京きらぼしFG	8.8	8.8	20,116	池田泉州HD	66.2	6.8	9,064	イーグランド	1.3	1.3	2,174	ビーロッド	4.7	6	3,342					
九州フィナンシャルG	134.9	132.1	50,858	証券、商品先物取引業 (0.7%)				ファーストブラザーズ	1.2	1.5	1,279	AND DOホールディングス	3.3	4.2	3,717					
ゆうちょ銀行	187.2	177.8	186,156	FPG	22.7	25.5	34,170	シーアールイー	1.9	3	4,473	プロパティエージェン	1.4	0.9	1,412					
富山第一銀行	14.7	17.2	7,602	ジャパンインベストメントA	—	5.1	7,053	ケイアイスター不動産	2.3	3.4	16,405	アグレ都市デザイン	1.7	1.3	1,968					
コンコルディア・フィナンシャル	402.8	373.2	174,284	マキアホールディングス	3.2	4.5	2,866	ジェイ・エス・ビー	1.4	1.7	6,358	ロードスターキャピタル	—	2.8	4,939					
西日本フィナンシャルHD	43.3	39.7	30,688	SBIホールディングス	81.8	93.1	249,880	テンポイノベーション	2.2	2.6	2,438	グローバルリンクマネジ	1.3	1.6	1,491					
33FG	5.6	5.9	8,767	日本アジア投資	6.1	6.6	1,524	フェイスネットワーク	—	1.2	1,665	パーク24	35.8	48.7	100,760					
第四北越フィナンシャルG	10.7	10.6	28,906	ジャフコグループ	8.7	26.1	56,793	バラカ	1.6	2	3,850	宮越ホールディングス	2.7	3.1	2,858					
ひろぎんHLDGS	98.7	96.5	60,602	大和証券G本社	495.5	483.6	298,042	三井不動産	301.5	294.6	863,178	三井不動産	301.5	294.6	863,178					
おきなわFG	—	6.3	13,815	野村ホールディングス	1,013	1,151.1	581,881	三菱地所	433.9	429.9	841,314	平和不動産	11.5	12.1	49,005					
十六FG	—	8.8	21,850	岡三証券グループ	53.9	53.9	18,056	東京建物	65.4	60	127,980	ダイビル	16.9	—	—					
北國FHD	—	6.3	30,681	丸三証券	19.6	22.2	10,189	京阪神ビルディング	10.5	10.2	13,280	住友不動産	148.9	135.8	479,102					
プロクリアホールディングス	—	7.9	17,380	東洋証券	21.5	23	6,118	テアオーシー	12.1	12.2	9,101	東京栄天地	1	1.3	5,278					
新生銀行	54.7	49.2	96,432	東海東京HD	68.8	73.5	27,709	スターツコーポレーション	7.7	10.5	28,707	フジ住宅	7.7	9.6	6,268					
あおぞら銀行	39.5	42	115,626	光世証券	1.8	1.6	665	空港施設	7.2	8.7	4,811	明和地所	3.4	4.1	2,542					
三菱UFJフィナンシャルG	4,527.4	4,412.5	3,237,892	水戸証券	17.8	17.5	4,357	ゴールドクレスト	5.8	6.6	11,754	エスリード	2.5	3.4	5,919					
りそねホールディングス	768.7	797.9	441,637	いちよし証券	13.3	12.6	8,064	日神グループHLDGS	9.3	13.5	5,899	日本エスコ	13.1	14.7	11,921					
三井住友トラストHD	125.2	124.7	540,075	松井証券	32.2	36.9	29,667	タカラレーベン	29.3	32.8	12,923	AVANTIA	3.6	4.2	3,372					
三井住友フィナンシャルG	457.6	489.1	2,130,519	マネックスG	60.4	63.5	30,289	イオンモール	33.1	38.6	65,041	毎日コムネット	2.7	3.4	2,135					
千葉銀行	221.2	213	168,483	極東証券	8.5	8.5	5,831	ファースト住建	2.9	3.4	3,750	ランド	371.2	437.9	4,379					
群馬銀行	136.6	121.2	49,692	岩井コスモホールディング	7.7	7	8,750	カチタス	16.4	18.8	63,544	トーセイ	9.3	10.8	15,627					
武蔵野銀行	9.7	9.5	16,625	アイザワ証券グループ	11.9	10	6,510	穴吹興産	1.8	1.8	3,724	サンフロンティア不動産	8.1	11.3	13,345					
千葉興業銀行	16.6	16.1	4,572	マネーパートナーズGP	9.1	8.5	2,278	インテリックス	2	2.5	1,415	ランドビジネス	2.9	3.7	854					
筑波銀行	29.1	29.8	5,781	スパークス・グループ	31.6	35.7	10,888	サンネクスタグループ	2.3	3	2,823	グランディハウス	5.2	5.8	3,248					
七七七銀行	20.5	20.1	37,486	小林洋行	4.1	2.4	516	日本空港ビルデング	23.1	24.4	148,840	サービス業 (5.4%)								
青森銀行	5.1	—	—	保険業 (2.3%)				明豊ファシリティアークス	3.3	3.4	2,291	日本工営	3.8	4.6	16,905					
秋田銀行	4	4.4	7,444	かんぽ生命保険	82.4	75.8	173,354	LIFULL	22.5	22.5	3,757	ミクシィ	16.5	16.7	40,029					
山形銀行	7	7	6,923	SOMPOホールディングス	116.6	107.3	655,603	ジェイエイシールクートメント	5.5	6	12,540	日本M&Aセンターホールデ	105.5	119.8	208,212					
岩手銀行	4.2	4.7	8,883	アニコムホールディングス	19.5	23.2	14,708	MEMBERS	2.4	1.9	4,858	メンバーズ	2.4	1.9	4,858					
東邦銀行	56.7	55.1	11,460	MS&A	160.3	155.1	650,799	中広	1.1	1.1	441	UTグループ	9.4	10.5	27,961					
東北銀行	3.3	3.3	3,210	第一生命HLDGS	326.2	367.2	900,558	アイティメディア	2.5	3.4	5,542	タケエイ	7.5	—	—					
みちのく銀行	4.5	—	—	東京海上HD	218.1	209.8	1,657,210	E・Jホールディングス	3.5	4.2	5,451	夢真ビーネックスグループ	17.6	23.9	40,104					
ふくおかフィナンシャルG	60.1	54.4	145,084	T&Dホールディングス	198.3	167.7	255,407	コシダカホールディングス	18.6	19.5	17,472	アルトナー	1.6	1.9	1,875					
静岡銀行	161.8	155.4	137,995	アドバンスクリエイト	3.4	3.7	4,018	パソナグループ	7.3	7.9	15,768	CDS	1.5	1.9	3,212					
十六銀行	8.3	—	—	その他金融業 (1.2%)				リックアンドモチベーション	14.5	18.9	13,475	GCA	8.2	—	—					
スルガ銀行	63	63	24,318	全国保証	17.2	18	85,050	エス・エム・エス	22.2	24.9	74,949	サニーサイドアップG	2	2.5	1,495					
八十二銀行	148.5	139.4	70,257	あんしん保証	—	3.4	890	パーソルホールディングス	64.2	73.1	203,437	リニカル	3.7	4.2	3,045					
大塚中央銀行	7.4	7.6	8,854	ジェイリース	2.5	2.6	6,669	クックパッド	21.7	17.7	3,717	エスクリ	3	3.5	2,291					
大垣共立銀行	12.9	12.9	22,781	イントラスト	2.7	3.3	2,059	アイ・ケイ・ケイホールディン	3.1	3.7	2,342									
福井銀行	5.9	5.7	8,253	日本モーゲージサービス	3.7	4.2	3,809													
北國銀行	6.2	—	—	Casa	2.1	2.7	2,241													
清水銀行	2.5	2.5	3,700	アルヒ	10.1	11.1	15,540													
富山銀行	1.3	1.2	2,101	プレミアグループ	3.4	11.4	22,184													
滋賀銀行	13.2	12.3	32,718	ネットプロHD	—	22.9	10,534													
南都銀行	9.3	10.2	21,593	クレディセゾン	38.9	44.2	78,587													
百五銀行	59.3	63	20,790	芙蓉総合リース	6.8	6.5	53,755													
京都銀行	23.9	23.4	128,466	みずほリース	10.5	9.2	30,176													
紀陽銀行	23	22.3	33,717	東京センチュリー	15.3	11.7	57,388													
ほくほくフィナンシャルG	44.2	42.8	37,535	日本証券金融	29	29.6	24,272													
山陰合同銀行	41	41.7	29,648	アイフル	113.8	126.7	49,793													
中国銀行	56	53.1	50,710	リコーリース	5.2	6.7	24,220													
鳥取銀行	2.2	2.4	2,700	イオンフィナンシャルサービス	40.4	41.1	62,143													
伊予銀行	88.2	84.8	62,497	アコム	129.8	149.5	49,036													
百十四銀行	6.5	7	11,851	ジャックス	7.7	7.5	28,650													
四国銀行	9.3	9.5	8,293	オリコ	179.6	204.1	24,083													
阿波銀行	9.9	10	19,300	オリックス	401.5	447.8	1,012,923													
大分銀行	3.7	4	7,604	三菱HCキャピタル	227	243.2	165,619													
宮崎銀行	4.1	4.1	9,216	九州リースサービス	3	3.3	2,006													
佐賀銀行	3.8	3.7	5,735	日本取引所グループ	178.7	175.5	359,073													
沖縄銀行	5.8	—	—	イー・ギャランティ	8	11.2	26,913													
琉球銀行	13.6	15.9	12,576	アサックス	3.9	3.5	2,089													
セブン銀行	221.9	225	59,625	NECキャピタルソリューション	2.8	3.1	6,516													
みずほフィナンシャルG	898.7	903.8	1,509,346	不動産業 (2.0%)																
高知銀行	2.5	2.4	1,584	いちご	74.3	84.4	25,742													
山口フィナンシャルG	82.6	75.5	60,551	日本駐車場開発	73.5	75.8	14,856													
長野銀行	2.4	2.3	2,833	スター・マイカ・HLDGS	3.5	3.4	5,355													
名古屋銀行	5.2	4.6	14,352	SREホールディングス	—	1.9	5,650													
北洋銀行	101.2	95.3	22,300	ADワークスグループ	13.1	21.2	3,307													
愛知銀行	2.3	2.4	13,656	ビューリック	139.7	147	161,700													
中京銀行	2.6	2.4	4,538	三栄建築設計	3	3.3	5,471													
大光銀行	2.2	2.2	3,014	野村不動産HLDGS	38.3	39.3	141,676													
愛媛銀行	8.9	9.9	8,692	三重交通グループHD	12.8	15.8	7,757													
トマト銀行	2.3	2	2,070																	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末			
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株	株数	千株
学情	2.8	3	4	1,167	アトラグループ	1.9	1.9	359	ビーウィズ	—	2	2,770	TREホールディングス	—	13.7	23,509
スタジオアリス	3.4	3.3	7	2,203	インターワークス	1.6	2.5	947	人・夢・技術グループ	—	2.9	7,786	エイチ・アイ・エス	14.5	17.1	38,286
シミックホールディングス	3.6	3.7	5	875	アイ・アールジャパンHD	2.7	3.4	7,146	ラックランド	1.9	2.1	6,014	共立メンテナンス	10.7	13	78,390
エブコ	1.5	1.6	1	1,014	Ke e P e r 技研	4.4	4.7	18,259	イチネンホールディングス	6.2	7.4	9,405	建設技術研究所	4.1	3.3	9,814
N J S	1.6	1.3	2	567	ファーストロジック	2.2	1.1	962	スペース	3.9	4.7	4,140	長大	2.6	—	—
総合警備保障	25.4	26.7	96	921	三機サービス	1.5	1.2	1,100	燦ホールディングス	2.7	3.2	5,987	スバル興業	0.4	0.4	3,660
カカコム	47.8	53.6	140	803	G u n o s y	4.8	4.1	3,136	東京テアトル	2.3	3	3,645	タナベ経営	1	2.6	1,684
アイロムグループ	2.4	2.7	6	534	デザインワン・ジャパン	3.5	2.3	397	ナガワ	2	2.1	15,750	東京競馬	5	5.5	23,182
セントケア・ホールディング	5.2	4.8	3	988	イー・ガーディアン	3.2	2.5	7,295	常盤興産	2.6	2.5	3,145	カナモト	11	11.9	24,716
サイネックス	1.8	1.2	715	リブセンス	6.6	3.7	954	西尾レントオール	5.8	6.1	17,751	アゴラホスピタリティG	52.2	42.7	982	
ルネサンス	4.2	5.1	5	869	ジャパンマテリアル	19.1	22.5	43,740	トランス・コスモス	6.4	9.2	34,500	乃村工藝社	27.7	31.3	29,766
ディップ	10.4	12.9	50	310	ベフトル	8.3	10.2	11,220	藤田観光	2.7	2.9	8,375	KNT-CTホールディングス	3.8	4.5	8,806
デジタルホールディングス	4.9	5.1	6	568	ウチヤマホールディングス	3	3.7	1,102	日本管財	6.7	7.7	20,097	トーカイ	6.1	5.8	10,909
新日本科学	8.1	9	23	157	チャームケアコーポレーション	5.4	5.5	6,088	白洋舎	0.7	0.6	858	セコム	63.1	72	609,264
キャリアデザインセンター	1.6	1.6	2	328	キャリアリンク	2.5	2.7	6,002	セントラル警備保障	3	3.6	8,586	丹青社	11.9	13.7	10,905
ベネフィット・ワン	23.5	26.4	55	466	I B J	5.9	3.9	3,673	メイテック	7.8	26	61,880	応用地質	7.1	6.3	11,724
エムスリー	113.6	128.9	557	879	アサンテ	2.6	3.1	4,991	船井総研ホールディン	13.1	13.7	33,606	進学会ホールディングス	2.6	2.1	661
ツカダ・グローバルHOLD	4.9	4.6	1,692	バリユーHR	2.7	5.7	8,396	オオバ	4.2	4.5	3,159	いであ	1.5	1.6	2,676	
プラス	1.4	1	910	M&Aキャピタルパートナー	5.5	6	23,160	学究社	1.9	2.2	3,638	学究社	1.9	2.2	3,638	
アウトソーシング	37.4	38.9	49	597	ライドオンエクスプレスHD	2.6	2.9	3,210	ベネッセホールディングス	23.6	24.3	52,731	イオンディライト	7.8	8.3	23,655
ウェルネット	6.3	6.7	3,966	ERIホールディングス	1.8	2.1	2,310	ナック	2.7	4.1	3,817	ダイセキ	12.9	13.3	59,783	
ワールドホールディングス	2.6	2.9	7,972	アビスト	1.1	1.1	3,250	ステップ	2.3	2.7	4,930					
ディー・エヌ・エー	27.8	27.9	54	842	シグマクシス・ホールディンク	3.8	8.8	10,507								
博報堂DY HLDGS	89.1	92.4	104	412	ウィルグループ	4.7	5.4	7,614								
ぐるなび	11.1	10.6	4,876	エスコローA J	10.3	8.1	1,368									
タカミヤ	7.5	8.8	3,625	メドピア	—	5.1	7,160									
ジャパンバスターズセキュ	5	4.1	2,988	レアジョブ	—	1.4	1,044									
ファンコミュニケーションズ	16.4	12.8	5,363	リクルートホールディングス	459.6	523.3	2,304,089									
ライク	1.9	2.4	5,258	エラン	9.7	8.6	9,511									
ビジネス・ブレークスルー	3	2.5	1,007	土木管理総合試験	3.4	3.2	985									
エスピーール	19.1	18.8	19	232	日本郵政	484.9	797.5	796,383								
WDBホールディングス	3	3.4	8,918	ネットマーケティング	4.6	3.6	3,232									
ティア	3.6	4.1	1,791	ベルシステム24HLDGS	10.9	10.5	14,637									
C D G	0.5	0.6	754	鎌倉新書	6.9	8.4	7,291									
アドウェイズ	—	9	6,660	S M N	2.1	1.7	902									
バリユーコマース	5.3	4.9	11,260	一蔵	0.9	1	465									
インフォマート	71.5	67.8	29	357	グローバルキッズCOMP	1.7	1.1	739								
JPホールディングス	18.8	17.9	4,976	エアトリ	4.6	4.2	12,684									
エコナックホールディングス	13.5	13.9	1,237	アトラエ	4.9	5.1	7,680									
CLホールディングス	1.7	1.8	1,596	ストライク	2.6	3.2	13,120									
プレスステージ・インター	23.6	27.5	18	397	ソラスト	16.2	18	16,308								
アミューズ	3.5	4	7,304	セラク	2.6	2.3	2,502									
ドリームインキュベータ	2.1	2.3	4,482	インソース	6.7	8.1	23,020									
クイック	3.9	4.6	8,454	ペイカレントコンサルティング	4.2	5.2	210,340									
T A C	4	3.9	803	ORCHESTRA HLDGS	1.6	1.4	3,591									
電通グループ	66.2	68.4	291	384	アイモバイル	2.6	3.6	4,546								
ティクアンドギヴニーズ	3.4	3.5	5,596	キャリアインデックス	3.2	2.5	990									
ぴあ	1.9	2.2	7,557	MS - J a p a n	3	3	2,691									
イオンファンタジー	2.5	2.9	10,904	船場	0.9	0.9	653									
シーティーエス	7.3	8.3	6,067	グレイステクノロジー	7.2	—	—									
ネクシイズグループ	2.3	2.2	1,553	ジャパンエレベーターSHD	19.1	23.1	44,860									
H U グループHD	18.1	19.1	51	741	フルテック	0.9	1.1	1,284								
アルプス技研	5.5	5.7	10,413	グリーンズ	2.8	2.7	2,278									
サニックス	10.8	12.8	3,276	ツナググループHLDGS	2.1	2.3	786									
ダイオーズ	0.8	1.6	2,398	GAMEWITH	2.4	2.2	814									
日本空調サービス	6.3	7.2	5,414	ソウルドアウト	1.6	—	—									
オリエンタルランド	68.1	77.7	1,578	864	MS&CONSULTING	1.3	1.2	745								
ダスキン	14.5	15.7	44	650	ウェルビー	—	4.8	3,595								
明光ネットワークジャパン	8.1	8.5	5,159	エル・ティール・エス	—	0.8	2,560									
ファルコホールディングス	2.9	3.3	5,768	ミダックホールディングス	2.9	3.3	11,319									
秀英予備校	2	1.6	713	日総工産	5.3	5.7	3,317									
田谷	1.5	1.3	713	キュービーネットHLDGS	3	3.4	4,919									
ラウンドワン	22.7	20.5	42	394	RPAホールディングス	8.8	10.2	3,019								
リゾートトラスト	29.8	31	74	586	スプリックス	2.1	2.5	2,450								
ビー・エム・エル	8.4	9.3	31,387	マネジメントソリューションズ	3.4	3.6	9,727									
りらいあコミュニケーション	9.9	10.7	10,582	プロレド・パートナーズ	1.7	1.6	905									
リソー教育	34.2	33.8	11,018	AND FACTORY	1.9	1.7	618									
早稲田アカデミー	2.8	4.1	4,391	テノ・ホールディングス	—	0.8	435									
ユー・エス・エス	71.5	81.8	198	365	フロンティア・マネジメント	—	2.2	2,787								
東京個別指導学院	5.7	6.6	3,715	ピアラ	—	1.2	854									
サイバーエージェント	159.1	155.9	201	422	コプロ・ホールディングス	—	1.5	1,345								
楽天グループ	330.2	301.2	193	972	ギークス	1.5	1.3	1,115								
クリーク・アンド・リバー社	3.5	3.9	9,652	カープスホールディングス	18.2	20	16,640									
モーニングスター	—	12.5	5,887	フォーラムエンジニアリング	4.7	4.5	4,117									
テー・オー・ダブリュー	10.8	13.1	4,087	FAST FITNESS JAP	—	1.3	2,034									
山田コンサルティングGP	3.6	3.9	4,882	ダイレクトマーケティング	—	7.4	11,773									
セントラルスポーツ	2.4	2.7	6,863	ポピンズ	—	0.9	1,572									
フルキャストホールディングス	5.7	6.3	16,474	LITALICO	2.8	5.9	16,779									
エン・ジャパン	11.5	13	31,005	アドバンテッジリスクマネ	3.6	3.9	1,856									
リソルホールディングス	0.7	0.8	3,668	リロググループ	35.2	40.1	91,267									
テクノプロ・ホールディング	38.6	43.8	130	786	東祥	4.3	5.5	6,858								

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国 内	6,702	—
ト P I X	—	—

(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	4,316,900 (46,600)	株 一 (一)

(注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
(注2) 当ファンドに係る当作成期中の利害関係人のうち、大和証券株式会社へ46,600株を貸付しています。

■投資信託財産の構成

2022年9月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	190,358,800 千円	92.8 %
コール・ローン等、その他	14,760,160	7.2
投資信託財産総額	205,118,961	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年9月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	205,855,265,093円
コール・ローン等	14,544,002,321
株式(評価額)	190,358,800,810
未収入金	57,668,600
未収配当金	85,377,722
未収利息	402,872
その他未収収益	5,697,768
差入委託証拠金	803,315,000
(B) 負債	8,836,048,504
未払解約金	37,544,320
差入委託証拠金代用有価証券	767,800,000
受入担保金	8,030,704,184
(C) 純資産総額 (A - B)	197,019,216,589
元本	146,161,636,928
次期繰越損益金	50,857,579,661
(D) 受益権総口数	146,161,636,928口
1万口当り基準価額 (C / D)	13,480円

* 期首における元本額は137,972,449,571円、当作成期間中における追加設定元本額は21,891,192,489円、同解約元本額は13,702,005,132円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：
トピックス・インデックスファンド 2,913,315,600円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA 5,057,552,549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 919,050円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA (一般投資家私募) 22,914,284円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA (一般投資家私募) 306,153,651円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA (一般投資家私募) 20,861,610円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA (一般投資家私募) 620,077,228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) 424,026,190円
D-I's TOPIXインデックス 31,216,024円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050 209,861,004円
iFree TOPIXインデックス 6,024,963,119円
iFree 8資産バランス 4,243,393,048円
iFree 年金バランス 754,549,149円

DCダイワ日本株式インデックス	68,855,675,811円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,261,884,393円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,664,787,412円
ダイワ・ライフ・バランス70	4,626,300,873円
年金ダイワ日本株式インデックス	6,602,474,346円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	59,540,051円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	69,149,114円
ダイワつみたてインデックス日本株式	2,398,708,347円
ダイワつみたてインデックスバランス30	12,198,543円
ダイワつみたてインデックスバランス50	10,134,564円
ダイワつみたてインデックスバランス70	25,524,777円
ダイワ国内株式インデックス(ラップ専用)	964,722,382円
ダイワ世界バランスファンド40VA	80,584,476円
ダイワ世界バランスファンド60VA	44,620,861円
ダイワ・バランスファンド35VA	5,365,977,076円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	495,127,448円
ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	70,111,584円
ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)	105,903,266円
ダイワ・ノーロードTOPIXファンド	221,137,687円
ダイワファンドラップTOPIXインデックス	11,537,778,484円
ダイワTOPIXインデックス(ダイワSMA専用)	1,659,502,574円
ダイワファンドラップオンラインTOPIXインデックス	3,228,157,904円
ダイワ・インデックスセレクトTOPIX	1,206,704,313円
ダイワライフスタイル25	134,931,541円
ダイワライフスタイル50	556,481,026円
ダイワライフスタイル75	423,712,951円
DC・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド)	8,850,002,618円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,480円です。

■損益の状況

当期自2021年9月22日至2022年9月20日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	4,534,850,132円
受取配当金	4,392,780,992
受取利息	7,085,379
その他収益金	137,155,020
支払利息	△ 2,171,259
(B) 有価証券売買損益	△ 10,575,678,342
売買益	12,741,452,615
売買損	△ 23,317,130,957
(C) 先物取引等損益	△ 113,613,450
取引益	537,753,550
取引損	△ 651,367,000
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 6,154,441,660
(E) 前期繰越損益金	54,510,271,140
(F) 解約差損益金	△ 4,614,203,610
(G) 追加信託差損益金	7,115,953,791
(H) 合計 (D + E + F + G)	50,857,579,661
次期繰越損益金 (H)	50,857,579,661

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

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

《お知らせ》

■主要投資対象の変更について

東京証券取引所の市場改革を見据え、主要投資対象を以下の通り変更しました。

変更前：東京証券取引所第一部上場株式

変更後：東京証券取引所上場株式

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

ダイワファンドラップ 日経225インデックス

運用報告書(全体版)

第7期

(決算日 2023年6月15日)

(作成対象期間 2022年6月16日～2023年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）		
運用方針	投資成果を日経平均トータルリターン・インデックスの動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券	
	ストックインデックス225・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均トータルリターン・インデックスに採用された銘柄	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、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、わが国の株式に投資し、日経平均トータルリターン・インデックスに連動する投資成果をあげることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<4642>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			日経平均トータルリターン・インデックス		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
3期末(2019年6月17日)	円	円	%		%	%	%	百万円
3期末(2019年6月17日)	13,227	0	△ 5.9	33,830.22	△ 5.6	97.7	2.3	8,152
4期末(2020年6月15日)	13,749	0	3.9	35,258.98	4.2	98.1	1.9	11,210
5期末(2021年6月15日)	19,054	0	38.6	48,974.74	38.9	97.9	2.1	14,516
6期末(2022年6月15日)	17,300	0	△ 9.2	44,639.75	△ 8.9	97.6	2.4	14,452
7期末(2023年6月15日)	22,421	0	29.6	58,102.64	30.2	98.8	1.2	19,299

(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。

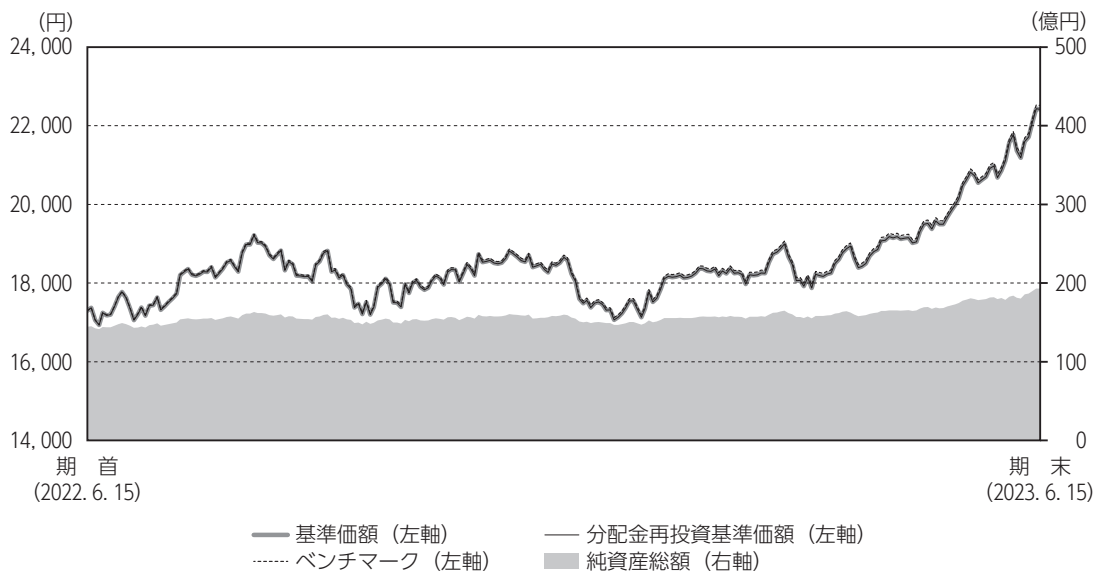
(注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

※ベンチマークを「日経平均株価」から「日経平均トータルリターン・インデックス」に変更しました。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

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

*ベンチマークは日経平均トータルリターン・インデックスです。

※ベンチマークを「日経平均株価」から「日経平均トータルリターン・インデックス」に変更しました。

■基準価額・騰落率

期首：17,300円

期末：22,421円(分配金0円)

騰落率：29.6%(分配金込み)

■基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		日経平均トータルリターン・インデックス		株 式 組入比率	株 式 先物比率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
		%		%	%	%
(期首)2022年6月15日	17,300	—	44,639.75	—	97.6	2.4
6月末	17,361	0.4	44,843.60	0.5	97.2	2.7
7月末	18,281	5.7	47,240.59	5.8	98.8	1.2
8月末	18,474	6.8	47,760.69	7.0	98.3	1.7
9月末	17,199	△ 0.6	44,470.99	△ 0.4	93.1	6.9
10月末	18,285	5.7	47,302.96	6.0	96.5	3.5
11月末	18,536	7.1	47,968.16	7.5	98.1	1.8
12月末	17,316	0.1	44,827.29	0.4	97.3	2.7
2023年1月末	18,128	4.8	46,947.81	5.2	98.4	1.6
2月末	18,212	5.3	47,178.76	5.7	98.1	1.9
3月末	18,774	8.5	48,651.96	9.0	96.4	3.5
4月末	19,317	11.7	50,068.10	12.2	97.2	2.8
5月末	20,683	19.6	53,593.44	20.1	97.4	2.5
(期末)2023年6月15日	22,421	29.6	58,102.64	30.2	98.8	1.2

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、米国のインフレ率がピークアウトするとの期待感などから、2022年8月中旬にかけて上昇が続き、その後、英国の財政悪化や欧米の金利上昇などが嫌気されて9月末にかけて下落しましたが、欧米の金利上昇が一服したことや国内で経済活動正常化への期待が高まったことなどから、11月下旬にかけて上昇しました。12月には、世界的な景況感の悪化や日銀の政策変更による急速な円高などで下落しましたが、2023年1月以降は、中国のゼロコロナ政策見直しにより景気回復期待が高まったことや、日銀総裁人事への不透明感が解消し円安が進んだことなどが好感され、3月上旬にかけて上昇しました。その後、米国地方銀行の経営破綻や欧州金融機関の破綻懸念などで金融不安が高まり、3月半ばにかけて下落しましたが、欧州金融機関の破綻回避などを受けて金融不安が一定程度後退したことにより、上昇に転じました。さらに、日銀新総裁就任後初の金融政策決定会合で金融緩和継続の方針が示されたことや、海外に比べて遅れていた経済正常化の動きが本格化したこと、海外投資家による日本株見直しの動きが強まったことなどにより、当作成期末にかけて大幅に上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■ストックインデックス225・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■当ファンド

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

■ストックインデックス225・マザーファンド

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

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

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

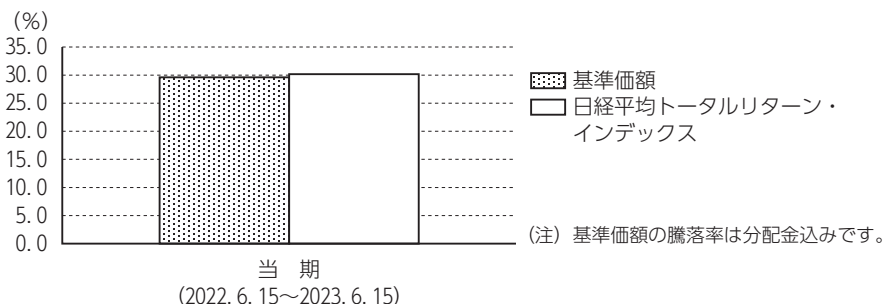
組入ファンド	ベンチマーク
ストックインデックス225・マザーファンド	日経平均トータルリターン・インデックス

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は30.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は29.6%となりました。

先物取引の影響、運用管理費用、売買等のコストなどが差異の要因となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークは日経平均トータルリターン・インデックスです。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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	
	2022年6月16日 ～2023年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	12,421

- （注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- （注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
- （注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。
- （注4）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■ストックインデックス225・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

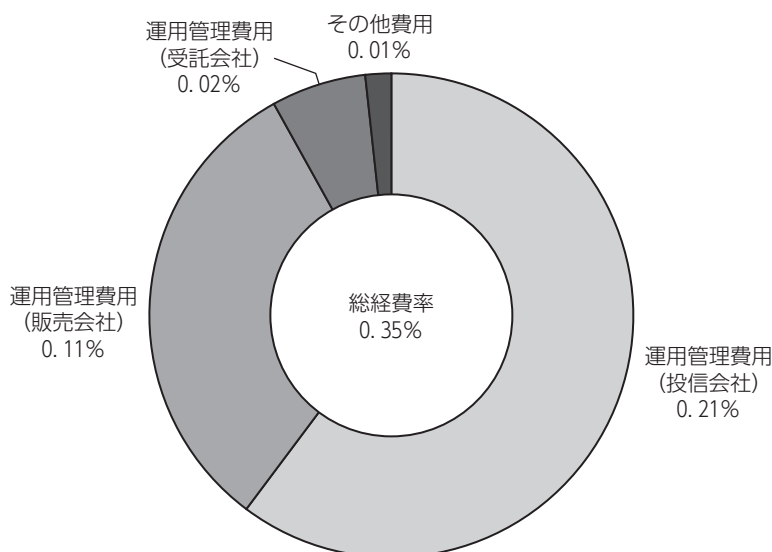
項目	当期 (2022. 6. 16~2023. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	63円	0.341%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は18,489円です。
(投信会社)	(39)	(0.209)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(20)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(4)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0.002	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合計	64	0.349	

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

参考情報

■総経費率

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



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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ストックインデックス225・マザーファンド	675,345	2,540,800	564,498	2,143,900

(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

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

項 目	当 期	
	口 数	金 額
	千口	千円
(a) 期中の株式売買金額	81,314,760	千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	223,230,689	千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.36	

(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

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況 B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況 D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	35,543	16,811	47.3	45,771	20,008	43.7
株式先物取引	127,575	90,711	71.1	131,538	95,529	72.6
コール・ローン	2,180,347	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合6.9%

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

(3)利害関係人の発行する有価証券等

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	21	33	186

(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

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	355千円
うち利害関係人への支払額 (B)	254千円
(B) / (A)	71.6%

(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まず。

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

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	口 数	金 額	口 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
ストックインデックス225・マザーファンド	4,144,976	4,255,823	19,295,903	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ストックインデックス225・マザーファンド	19,295,903	99.6
コール・ローン等、その他	86,054	0.4
投資信託財産総額	19,381,957	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	19,381,957,642円
コール・ローン等	85,454,116
ストックインデックス225・マザーファンド (評価額)	19,295,903,526
未収入金	600,000
(B) 負債	82,815,200
未払解約金	54,836,971
未払信託報酬	27,534,226
その他未払費用	444,003
(C) 純資産総額 (A - B)	19,299,142,442
元本	8,607,441,935
次期繰越損益金	10,691,700,507
(D) 受益権総口数	8,607,441,935口
1万口当り基準価額 (C / D)	22,421円

* 期首における元本額は8,353,925,182円、当作成期間中における追加設定元本額は1,947,250,912円、同解約元本額は1,693,734,159円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は22,421円です。

■損益の状況

当期 自 2022年6月16日 至 2023年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 11,870円
受取利息	1,362
支払利息	△ 13,232
(B) 有価証券売買損益	4,223,685,918
売買益	4,452,070,257
売買損	△ 228,384,339
(C) 信託報酬等	△ 54,704,891
(D) 当期損益金 (A + B + C)	4,168,969,157
(E) 前期繰越損益金	1,464,430,165
(F) 追加信託差損益金	5,058,301,185
(配当等相当額)	(3,150,336,610)
(売買損益相当額)	(1,907,964,575)
(G) 合計 (D + E + F)	10,691,700,507
次期繰越損益金 (G)	10,691,700,507
追加信託差損益金	5,058,301,185
(配当等相当額)	(3,150,336,610)
(売買損益相当額)	(1,907,964,575)
分配準備積立金	5,633,411,192
繰越損益金	△ 11,870

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	3,127,927,727
(c) 収益調整金	5,058,301,185
(d) 分配準備積立金	2,505,483,465
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	10,691,712,377
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	10,691,712,377
(h) 受益権総口数	8,607,441,935口

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

《お知らせ》

■ベンチマークの変更について

- ・当ファンドのベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。
変更前：日経平均株価（日経225）
変更後：日経平均トータルリターン・インデックス
- ・マザーファンドのベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。
変更前：日経平均株価
変更後：日経平均トータルリターン・インデックス

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 日経 225インデックス）が投資対象としている「ストックインデックス 225・マザーファンド」の決算日（2022年9月20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（2023年6月15日）現在におけるストックインデックス 225・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

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

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ファーストリテイリング	36	2,755,200	76,533	ファーストリテイリング	122	4,908,550	40,234
ニデック	234.4	2,040,470	8,705	東京エレクトロン	110	2,652,760	24,116
HOYA	146.5	2,031,697	13,868	ソフトバンクグループ	324	1,756,284	5,420
S M C	29.3	1,711,159	58,401	K D D I	324	1,377,264	4,250
東京エレクトロン	36	1,477,820	41,050	ダイキン工業	54	1,337,210	24,763
オリエンタルランド	283	1,281,654	4,528	ファナック	166	1,250,010	7,530
ソフトバンクグループ	216	1,196,568	5,539	アドバンテスト	108	1,230,400	11,392
K D D I	216	899,568	4,164	信越化学	166	1,044,840	6,294
ダイキン工業	36	785,970	21,832	テルモ	216	886,824	4,105
ファナック	36	744,600	20,683	T D K	162	793,110	4,895

(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、2023年6月15日現在におけるストックインデックス 2 2 5 ・ マザーファンド（56,240,375千口）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			日産化学	255	1,643,475	日本碍子	255	455,685
ニッスイ	255	164,730	東ソー	127.5	222,933	鉄鋼 (0.1%)		
鉱業 (0.1%)			トクヤマ	51	124,006	日本製鉄	25.5	76,219
I N P E X	102	162,894	デンカ	51	133,926	神戸製鋼所	25.5	32,997
建設業 (1.6%)			信越化学	1,275	6,141,675	J F E ホールディングス	25.5	51,752
コムシスホールディングス	255	717,315	三井化学	51	203,541	大平洋金属	25.5	40,774
大成建設	51	241,689	三菱ケミカルグループ	127.5	105,340	非鉄金属 (0.7%)		
大林組	255	301,537	U B E	25.5	62,551	三井金属	25.5	91,519
清水建設	255	226,108	花王	255	1,305,090	三菱マテリアル	25.5	66,338
長谷工コーポレーション	51	87,414	D I C	25.5	66,835	住友鉱山	127.5	628,192
鹿島建設	127.5	267,813	富士フイルム HLDGS	255	2,247,315	DOWA ホールディングス	51	234,039
大和ハウス	255	959,565	資生堂	255	1,722,780	古河電工	25.5	63,813
積水ハウス	255	700,485	日東電工	255	2,764,200	住友電工	255	450,585
日揮ホールディングス	255	476,977	医薬品 (6.8%)			フジクラ	255	300,390
食料品 (3.4%)			協和キリン	255	689,137	金属製品 (0.0%)		
日清製粉G本社	255	472,387	武田薬品	255	1,156,935	S U M C O	25.5	52,568
明治ホールディングス	102	328,440	アステラス製薬	1,275	2,879,587	機械 (5.8%)		
日本ハム	127.5	510,892	住友ファーマ	255	161,134	日本製鋼所	51	154,938
サッポロホールディングス	51	191,250	塩野義製薬	255	1,563,405	オークマ	51	381,684
アサヒグループホールディン	255	1,466,760	中外製薬	765	3,171,690	アマダ	255	359,677
キリンHD	255	547,102	エーザイ	255	2,429,385	S M C	25.5	2,089,725
宝ホールディングス	255	274,125	第一三共	765	3,672,000	小松製作所	255	985,575
キッコーマン	255	2,146,080	大塚ホールディングス	255	1,412,445	住友重機械	51	178,551
味の素	255	1,462,170	石油・石炭製品 (0.2%)			日立建機	255	1,026,885
ニチレイ	127.5	397,545	出光興産	102	296,055	クボタ	255	562,020
日本たばこ産業	255	819,570	ENEOS ホールディングス	255	123,343	荏原製作所	51	369,954
繊維製品 (0.1%)			ゴム製品 (0.8%)			ダイキン工業	255	7,541,625
帝人	51	70,660	横浜ゴム	127.5	408,510	日本精工	255	228,939
東レ	255	200,812	ブリヂストン	255	1,538,415	N T N	255	75,939
パルプ・紙 (0.1%)			ガラス・土石製品 (0.8%)			ジェイテクト	255	332,520
王子ホールディングス	255	140,224	A G C	51	268,974	三井 E & S	25.5	12,367
日本製紙	25.5	31,594	日本板硝子	25.5	16,039	日立造船	51	46,818
化学 (7.0%)			日本電気硝子	76.5	200,353	三菱重工業	25.5	174,955
クラレ	255	354,322	住友大阪セメント	25.5	94,375	I H I	25.5	100,113
旭化成	255	248,089	太平洋セメント	25.5	72,496	電気機器 (25.3%)		
レゾナック・ホールディング	25.5	57,910	東海カーボン	255	318,240	コニカミノルタ	255	119,518
住友化学	255	110,083	T O T O	127.5	568,395	ミネアミツミ	255	715,402

銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
日立	51	454,308	東海旅客鉄道	25.5	451,732	三菱地所	255	447,397
三菱電機	255	521,092	ヤマトホールディングス	255	651,142	東京建物	127.5	244,035
富士電機	51	325,941	NIPPON EXPRESS	25.5	212,721	住友不動産	255	942,990
安川電機	255	1,716,660	海運業 (0.3%)			サービス業 (4.6%)		
ニデック	204	1,581,612	日本郵船	76.5	234,778	エムスリー	612	1,990,836
オムロン	255	2,350,590	商船三井	76.5	253,674	ディー・エヌ・エー	76.5	145,273
ジーエス・ユアサコーポ	51	144,865	川崎汽船	76.5	248,778	電通グループ	255	1,206,150
日本電気	25.5	179,239	空運業 (0.3%)			オリエンタルランド	255	1,388,985
富士通	25.5	486,667	日本航空	255	728,662	サイバーエージェント	204	213,486
ルネサスエレクトロニクス	255	681,487	ANA ホールディングス	25.5	81,447	楽天グループ	255	132,217
セイコーエプソン	510	1,125,570	倉庫・運輸関連業 (0.2%)			リクルートホールディングス	765	3,737,025
パナソニックホールディング	255	428,017	三菱倉庫	127.5	458,872	日本郵政	255	258,315
シャープ	255	200,175	情報・通信業 (10.3%)			セコム	255	2,451,060
ソニーグループ	255	3,557,250	ネクソン	510	1,490,985			
TDK	765	4,355,145	Zホールディングス	102	36,924			
アルプスアルパイン	255	324,742	トレンドマイクロ	255	1,882,410			
横河電機	255	700,102	日本電信電話	102	416,262			
アドバンテスト	510	9,970,500	KDDI	1,530	6,920,190			
キーエンス	25.5	1,809,735	ソフトバンク	255	388,620			
カシオ	255	308,040	東宝	25.5	145,426			
ファナック	1,275	6,638,925	NTTデータ	1,275	2,687,700			
京セラ	510	4,065,720	コナミグループ	255	1,974,210			
太陽誘電	255	1,096,755	ソフトバンクグループ	1,530	9,932,760			
村田製作所	204	1,738,080	卸売業 (3.1%)					
SCREENホールディングス	51	828,495	双日	25.5	80,529			
キャノン	382.5	1,380,825	伊藤忠	255	1,431,315			
リコー	255	321,682	丸紅	255	612,765			
東京エレクトロン	765	15,529,500	豊田通商	255	1,845,690			
輸送用機器 (4.5%)			三井物産	255	1,388,730			
デンソー	255	2,463,300	住友商事	255	777,495			
川崎重工業	25.5	90,601	三菱商事	255	1,731,960			
日産自動車	255	138,388	小売業 (12.6%)					
いすゞ自動車	127.5	230,647	J.フロントリテイリング	127.5	181,305			
トヨタ自動車	1,275	2,958,637	三越伊勢丹HD	255	373,702			
日野自動車	255	159,196	セブン&アイ・HLDGS	255	1,570,290			
三菱自動車工業	25.5	12,489	高島屋	127.5	240,337			
マツダ	51	70,635	丸井グループ	255	623,092			
本田技研	510	2,300,610	イオン	255	712,980			
スズキ	255	1,300,500	ファーストリテイリング	765	27,976,050			
SUBARU	255	686,460	銀行業 (0.6%)					
ヤマハ発動機	255	1,017,450	しずおかフィナンシャル	255	258,570			
精密機器 (3.9%)			コンコルディア・フィナンシャル	255	139,357			
テルモ	1,020	4,677,720	あおぞら銀行	25.5	67,077			
ニコン	255	446,377	三菱UFJフィナンシャルG	255	252,424			
オリンパス	1,020	2,295,000	りそなホールディングス	25.5	16,906			
HOYA	127.5	2,287,987	三井住友トラストHD	25.5	128,647			
シチズン時計	255	219,555	三井住友フィナンシャルG	25.5	149,557			
その他製品 (2.6%)			千葉銀行	255	220,090			
パンダイナミコHLDGS	765	2,672,145	ふくおかフィナンシャルG	51	139,867			
凸版印刷	127.5	394,612	みずほフィナンシャルG	25.5	54,302			
大日本印刷	127.5	516,120	証券・商品先物取引業 (0.2%)					
ヤマハ	255	1,487,670	大和証券G本社	255	186,099			
任天堂	255	1,587,375	野村ホールディングス	255	140,301			
電気・ガス業 (0.2%)			松井証券	255	207,825			
東京電力HD	25.5	12,568	保険業 (0.9%)					
中部電力	25.5	43,847	SOMPOホールディングス	51	330,837			
関西電力	25.5	45,211	MS&AD	76.5	399,559			
東京瓦斯	51	164,118	第一生命HLDGS	25.5	67,192			
大阪瓦斯	51	114,342	東京海上HD	382.5	1,285,582			
陸運業 (1.3%)			T&Dホールディングス	51	102,765			
東武鉄道	51	191,199	その他金融業 (0.7%)					
東急	127.5	227,715	クレディセゾン	255	532,185			
小田急電鉄	127.5	254,872	オリックス	255	645,022			
京王電鉄	51	237,711	日本取引所グループ	255	653,182			
京成電鉄	127.5	738,607	不動産業 (1.0%)					
東日本旅客鉄道	25.5	199,308	東急不動産HD	255	215,577			
西日本旅客鉄道	25.5	152,286	三井不動産	255	734,145			

銘柄	2023年6月15日現在	
	株数	評価額
合計	53,116.5	251,968,590
銘柄数<比率>	225銘柄	<98.8%>

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

(2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2023年6月15日現在	
	買建額	売建額
国内	2,973	—
日経平均	2,973	—

(注) 単位未満は切捨て。

■ 有価証券の貸付及び借入状況

区分	2023年6月15日現在	
	貸付	借入
株式	452,800	—

(注) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

ストックインデックス225・マザーファンド

運用報告書 第21期 (決算日 2022年9月20日)

(作成対象期間 2021年9月22日～2022年9月20日)

ストックインデックス225・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

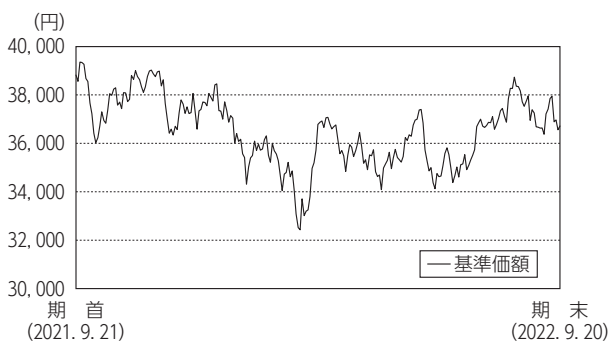
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		日経平均株価 (※配当なし)		株式 組入 比率	株式 先物 比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首)2021年9月21日	38,825	—	29,839.71	—	97.8	1.5
9月末	38,558	△ 0.7	29,452.66	△ 1.3	96.5	3.6
10月末	37,819	△ 2.6	28,892.69	△ 3.2	97.6	2.4
11月末	36,420	△ 6.2	27,821.76	△ 6.8	97.1	2.9
12月末	37,751	△ 2.8	28,791.71	△ 3.5	98.6	1.4
2022年1月末	35,400	△ 8.8	27,001.98	△ 9.5	97.7	2.3
2月末	34,798	△ 10.4	26,526.82	△ 11.1	97.6	2.4
3月末	36,805	△ 5.2	27,821.43	△ 6.8	98.1	1.9
4月末	35,523	△ 8.5	26,847.90	△ 10.0	96.6	3.4
5月末	36,120	△ 7.0	27,279.80	△ 8.6	98.4	1.6
6月末	34,988	△ 9.9	26,393.04	△ 11.6	97.2	2.8
7月末	36,853	△ 5.1	27,801.64	△ 6.8	98.8	1.2
8月末	37,255	△ 4.0	28,091.53	△ 5.9	98.3	1.7
(期末)2022年9月20日	36,718	△ 5.4	27,688.42	△ 7.2	97.1	2.9

(注1) 基準価額の騰落率は期首比。
(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注3) 株式先物比率は買建比率－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：38,825円 期末：36,718円 騰落率：△5.4%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、当作成期前半に下落しましたが、後半は持ち直しました。

国内株式市況は、当作成期首より、新政権への期待の後退や中国の大手不動産会社の信用不安などで下落しましたが、衆議院議員選挙で自民党が過半数を大きく上回ったことなどが好感され、2021年11月中旬にかけて底堅く推移しました。年末にかけては、新型コロナウイルスの新変異株への警戒感から再び上値の重い展開になり、さらに2022年に入ると、FRB(米連邦準備制度理事会)の金融引き締め加速懸念による金利上昇を受けて世界的に株価が下落する中で、日本株も下落しました。2月下旬からは、ロシアによるウクライナ侵攻で下落が加速しましたが、FRBの利上げ決定で悪材料出尽くし観測が強まったことや為替相場で円安が進行したことなどから、3月末にかけて反発しました。その後は、経済活動の正常化による内需の回復が鮮明となり反発する局面があった一方、FRBの利上げペースの加速や景気の先行きに対する懸念などから調整する局面もあり、一進一退の展開となりました。6月半ば以降は、資源価格の上昇が一服してインフレ懸念が後退したことや、FRBの利上げ幅縮小への期待などから、株価は反発しましたが、米国の8月CPI(消費者物価指数)が市場を上回ったことにより再びFRBの利上げペース加速が意識され、当作成期末にかけて株価は下落しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△7.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△5.4%となりました。

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

・資金の流出入に伴う現物株式および株式先物の売買等によるコスト負担等が、マイナス要因となりました。

*ベンチマークは日経平均株価(※配当なし)です。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

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

■売買および取引の状況

(1) 株 式 (2021年9月22日から2022年9月20日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 10,626.6 (1,415.2)	千円 46,938,580 (—)	千株 3,693.5	千円 14,466,534

(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

(2021年9月22日から2022年9月20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 97,731	百万円 94,280	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式 (2021年9月22日から2022年9月20日まで)

銘 柄	当 期 買 付			当 期 売 付		
	株 数	金 額	平均単価	株 数	金 額	平均単価
ファーストリテイリング	千株 54	千円 3,597,380	円 66,618	千株 17	千円 1,360,020	円 80,001
東京エレクトロン	54	2,869,620	53,141	17	866,500	50,970
村田製作所	227.2	2,186,597	9,624	102	605,544	5,936
キーエンス	28.4	1,854,616	65,303	102	425,886	4,175
ソフトバンクグループ	324	1,755,828	5,419	17	411,595	24,211
任天堂	28.4	1,548,146	54,512	17	403,490	23,734
KDDI	324	1,245,264	3,843	68	317,492	4,669
ダイキン工業	54	1,212,860	22,460	234	308,884	1,320
ファナック	54	1,178,050	21,815	17	307,995	18,117
信越化学	54	975,430	18,063	34	306,920	9,027

(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	株 数	評 価 額		株 数	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	株 数	評 価 額
水産・農林業 (0.1%)	千株	千株	千株	千円	キッコーマン	千株	千株	千株	千円	三菱ケミカルグループ	千株	千株	千株	千円
日本水産	234	271	147,966		味の素	234	271	2,241,170		UBE	23.4	27.1	55,419	
マルハニチロ	23.4	27.1	65,473		ニチレイ	117	135.5	321,406		花王	234	271	1,646,867	
鉱業 (0.1%)					日本たばこ産業	234	271	654,058		DI C	23.4	27.1	68,102	
INPEX	93.6	108.4	163,358		繊維製品 (0.2%)					富士フイルムHLDGS	234	271	1,855,537	
建設業 (1.8%)					東洋紡	23.4	27.1	30,053		資生堂	234	271	1,401,341	
コムシスホールディングス	234	271	696,199		ユニチカ	23.4	27.1	7,940		日東電工	234	271	2,341,440	
大成建設	46.8	54.2	233,331		帝人	46.8	54.2	80,053		医薬品 (7.4%)				
大林組	234	271	266,664		東レ	234	271	208,859		協和キリン	234	271	864,490	
清水建設	234	271	206,773		バルブ・紙 (0.1%)					武田薬品	234	271	1,041,182	
長谷工コーポレーション	46.8	54.2	89,646		王子ホールディングス	234	271	149,321		アステラス製薬	1,170	1,355	2,681,545	
鹿島建設	117	135.5	202,030		日本製紙	23.4	27.1	23,685		住友ファーマ	234	271	278,317	
大和ハウス	234	271	844,165		化学 (7.1%)					塩野義製薬	234	271	1,888,870	
積水ハウス	234	271	681,565		クラレ	234	271	291,867		中外製薬	702	813	2,843,061	
日揮ホールディングス	234	271	532,244		旭化成	234	271	274,387		エーザイ	234	271	1,634,130	
食料品 (3.7%)					昭和電工	23.4	27.1	58,779		第一三共	702	813	3,415,413	
日清製粉G本社	234	271	391,866		住友化学	234	271	146,069		大塚ホールディングス	234	271	1,231,966	
明治ホールディングス	46.8	54.2	349,048		日産化学	234	271	1,837,380		石油・石炭製品 (0.2%)				
日本ハム	117	135.5	528,450		東ソー	117	135.5	233,195		出光興産	93.6	108.4	372,354	
サッポロホールディングス	46.8	54.2	173,169		トクヤマ	46.8	54.2	99,782		ENEOSホールディングス	234	271	136,963	
アサヒグループホールディングス	234	271	1,287,250		デンカ	46.8	54.2	179,944		ゴム製品 (0.8%)				
キリンHD	234	271	618,015		信越化学	234	271	4,302,125		横浜ゴム	117	135.5	317,070	
宝ホールディングス	234	271	292,680		三井化学	46.8	54.2	165,852		ブリヂストン	234	271	1,380,745	

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
ガラス・土石製品 (1.0%)	千株	千株	千株	千円	キヤノン	351	406.5	1,350,393		三菱商事	234	271	1,183,999	
AGC	46.8	54.2	258,263		リコー	234	271	308,669		小売業 (12.2%)				
日本板硝子	23.4	27.1	15,636		東京エレクトロン	234	271	11,121,840		J.フロントリテイリング	117	135.5	163,006	
日本電気硝子	70.2	81.3	213,168		輸送用機器 (4.8%)					三越伊勢丹HD	234	271	333,059	
住友大阪セメント	23.4	27.1	94,714		デンソー	234	271	2,012,175		セブン&アイ・HLDS	234	271	1,623,290	
太平洋セメント	23.4	27.1	58,210		川崎重工業	23.4	27.1	66,855		高島屋	117	135.5	230,621	
東海カーボン	234	271	285,363		日産自動車	234	271	145,716		丸井グループ	234	271	679,939	
ＴＯＴＯ	117	135.5	669,370		いすゞ自動車	117	135.5	242,409		イオン	234	271	730,480	
日本碍子	234	271	543,897		トヨタ自動車	234	1,355	2,775,717		ファーストリテイリング	234	271	22,219,290	
鉄鋼 (0.1%)					日野自動車	234	271	178,589		銀行業 (0.6%)				
日本製鉄	23.4	27.1	61,002		三菱自動車工業	23.4	27.1	16,585		コンソルディア・フィナンシャル	234	271	126,557	
神戸製鋼所	23.4	27.1	17,506		マツダ	46.8	54.2	65,365		新生銀行	23.4	—	—	
JFEホールディングス	23.4	27.1	39,837		本田技研	468	542	1,921,390		あおぞら銀行	23.4	27.1	74,606	
大平洋金属	23.4	27.1	66,395		スズキ	234	271	1,352,019		三菱UFJフィナンシャルG	234	271	198,859	
非鉄金属 (0.9%)					SUBARU	234	271	690,779		りそなホールディングス	23.4	27.1	14,999	
日本軽金属HD	23.4	27.1	43,874		ヤマハ発動機	234	271	794,030		三井住友トラストHD	23.4	27.1	117,370	
三井金属	23.4	27.1	86,042		精密機器 (4.0%)					三井住友フィナンシャルG	23.4	27.1	118,047	
東邦亜鉛	23.4	27.1	65,392		テルモ	936	1,084	4,680,712		千葉銀行	234	271	214,361	
三菱マテリアル	23.4	27.1	55,527		ニコン	234	271	402,164		ふくおかフィナンシャルG	46.8	54.2	144,551	
住友鉱山	117	135.5	594,845		オリンパス	936	1,084	3,224,358		静岡銀行	234	271	240,648	
DOWAホールディングス	46.8	54.2	295,932		シチズン時計	234	271	168,020		みずほフィナンシャルG	23.4	27.1	45,257	
古河電工	23.4	27.1	67,343		その他製品 (3.0%)					証券・商品先物取引業 (0.2%)				
住友電工	234	271	440,104		バンダイナムコHLDS	234	271	2,690,488		大和証券G本社	234	271	167,017	
フジクラ	234	271	262,599		凸版印刷	117	135.5	306,094		野村ホールディングス	234	271	136,990	
金属製品 (0.0%)					大日本印刷	117	135.5	409,887		松井証券	234	271	217,884	
SUMCO	23.4	27.1	50,216		ヤマハ	234	271	1,403,780		保険業 (0.9%)				
東洋製罐グループHD	234	—	—		任天堂	—	27.1	1,675,593		SOMPOホールディングス	58.5	54.2	331,162	
機械 (5.0%)					電気・ガス業 (0.2%)					MS&AD	70.2	81.3	341,134	
日本製鋼所	46.8	54.2	165,039		東京電力HD	23.4	27.1	13,116		第一生命HLDS	23.4	27.1	66,462	
オークマ	46.8	54.2	278,588		中部電力	23.4	27.1	38,292		東京海上HD	117	135.5	1,070,314	
アマダ	234	271	291,596		関西電力	23.4	27.1	35,392		T&Dホールディングス	46.8	54.2	82,546	
小松製作所	234	271	762,594		東京瓦斯	46.8	54.2	140,486		その他金融業 (0.8%)				
住友重機械	46.8	54.2	157,288		大阪瓦斯	46.8	54.2	124,985		クレディセゾン	234	271	481,838	
日立建機	234	271	793,488		陸運業 (1.5%)					オリックス	—	271	613,002	
クボタ	234	271	585,495		東武鉄道	46.8	54.2	185,093		日本取引所グループ	234	271	554,466	
荏原製作所	46.8	54.2	276,962		東急	117	135.5	231,705		不動産業 (1.3%)				
ダイキン工業	234	271	6,529,745		小田急電鉄	117	135.5	258,940		東急不動産HD	234	271	215,445	
日本精工	234	271	210,567		京王電鉄	46.8	54.2	295,932		三井不動産	234	271	794,030	
NTN	234	271	77,777		京成電鉄	117	135.5	552,840		三菱地所	234	271	530,347	
ジェイテクト	234	271	278,588		東日本旅客鉄道	23.4	27.1	206,610		東京建物	117	135.5	289,021	
三井E&SHD	23.4	27.1	11,111		西日本旅客鉄道	23.4	27.1	154,876		住友不動産	234	271	956,088	
日立造船	46.8	54.2	47,262		東海旅客鉄道	23.4	27.1	463,410		サービス業 (5.0%)				
三菱重工業	23.4	27.1	140,676		日本通運	23.4	—	—		エムスリー	561.6	650.4	2,814,931	
IHI	23.4	27.1	94,172		ヤマトホールディングス	234	271	586,715		ディー・エヌ・エー	70.2	81.3	157,478	
電気機器 (22.2%)					NIPPON EXPRESS	—	27.1	196,204		電通グループ	234	271	1,154,460	
日清紡ホールディングス	234	—	—		海運業 (0.3%)					サイバーエージェント	187.2	216.8	280,105	
コニカミノルタ	234	271	133,332		日本郵船	23.4	27.1	260,160		楽天グループ	234	271	174,524	
ミネベアミツミ	234	271	658,801		商船三井	23.4	81.3	266,664		リクルートホールディングス	702	813	3,579,639	
日立	46.8	54.2	364,657		川崎汽船	23.4	27.1	199,998		日本郵政	234	271	270,620	
三菱電機	234	271	376,012		空運業 (0.0%)					セコム	234	271	2,293,202	
富士電機	46.8	54.2	316,528		ANAホールディングス	23.4	27.1	75,568						
安川電機	234	271	1,218,145		倉庫・運輸関連業 (0.2%)					合計	株数、金額	42,599.7	50,948	213,513,854
オムロン	234	271	1,897,000		三菱倉庫	117	135.5	484,412			銘柄数<比率>	225銘柄	225銘柄	<97.1%>
ジーエス・ユアサコーポ	46.8	54.2	134,741		情報・通信業 (11.8%)						千株	千株	千円	
日本電気	23.4	27.1	131,977		ネクソン	468	542	1,395,108						
富士通	23.4	27.1	434,548		Zホールディングス	93.6	108.4	44,010						
沖電気	23.4	27.1	19,647		トレンドマイクロ	234	271	2,205,940						
セイコーエプソン	468	542	1,162,048		スカパーJSATHD	23.4	—	—						
パナソニックホールディング	234	271	302,029		日本電信電話	93.6	108.4	424,386						
シャープ	234	271	256,095		KDDI	1,404	1,626	7,108,872						
ソニーグループ	234	271	2,806,205		ソフトバンク	234	271	407,313						
TDK	234	813	4,146,300		東宝	23.4	27.1	142,004						
アルプスアルパイン	234	271	334,143		NTTデータ	1,170	1,355	2,639,540						
横河電機	234	271	633,056		コナミグループ	234	271	1,826,540						
アドバンテスト	468	542	4,016,220		ソフトバンクグループ	1,404	1,626	8,970,642						
キーエンス	—	27.1	1,387,249		卸売業 (2.5%)									
カシオ	234	271	364,224		双日	23.4	27.1	63,657						
ファナック	234	271	5,909,155		伊藤忠	234	271	1,030,884						
京セラ	468	542	4,386,406		丸紅	234	271	383,329						
太陽誘電	234	271	1,123,295		豊田通商	234	271	1,337,385						
村田製作所	—	216.8	1,602,802		三井物産	234	271	898,907						
SCREENホールディングス	46.8	54.2	488,342		住友商事	234	271	534,683						

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
日経平均	6,340	—

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

区 分	当 期 末	
	貸 付	借 入
株式	1,844,700 (株 2,000)	(株 —)

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

■投資信託財産の構成

2022年9月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	213,513,854 千円	94.7 %
コール・ローン等、その他	11,876,737	5.3
投資信託財産総額	225,390,591	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年9月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	227,711,782,708円
コール・ローン等	11,682,627,104
株式 (評価額)	213,513,854,000
未収配当金	150,042,000
未収利息	258,073
その他未収収益	381,531
差入委託証拠金	2,364,620,000
(B) 負債	7,885,461,465
未払金	24,387,050
未払解約金	18,614,000
差入委託証拠金代用有価証券	2,322,860,000
受入担保金	5,519,600,415
(C) 純資産総額 (A - B)	219,826,321,243
元本	59,868,190,359
次期繰越損益金	159,958,130,884
(D) 受益権総口数	59,868,190,359口
1万口当り基準価額 (C/D)	36,718円

* 期首における元本額は51,056,738,772円、当作成期間中における追加設定元本額は21,637,949,096円、同解約元本額は12,826,497,509円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：
 ストック インデックス ファンド 225 24,848,663,794円
 適格機関投資家専用・ダイワ・ストックインデックスファンド 225 VA 263,464,032円
 大和 ストック インデックス 225 ファンド 7,935,056,488円
 D-1's 日経 225 インデックス 78,793,586円
 iFree 日経 225 インデックス 9,666,626,791円
 DC・ダイワ・ストックインデックス 225 (確定拠出年金専用ファンド) 5,555,795,016円
 ダイワ・ノーロード 日経 225 ファンド 468,492,474円
 ダイワファンドラップ 日経 225 インデックス 4,244,605,798円
 ダイワ日経 225 インデックス (ダイワ SMA 専用) 541,069,757円
 ダイワ・インデックスセレクト 日経 225 6,265,622,623円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は36,718円です。

■損益の状況

当期 自 2021年9月22日 至 2022年9月20日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	4,026,868,557円
受取配当金	3,924,755,922
受取利息	6,771,023
その他収益金	98,973,489
支払利息	3,631,877
(B) 有価証券売買損益	△ 12,855,023,186
売買益	13,388,910,010
売買損	△ 26,243,933,196
(C) 先物取引等損益	3,789,770
取引益	1,468,050,180
取引損	△ 1,464,260,410
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 8,824,364,859
(E) 前期繰越損益金	147,172,267,330
(F) 解約差損益金	△ 34,801,906,491
(G) 追加信託差損益金	56,412,134,904
(H) 合計 (D + E + F + G)	159,958,130,884
次期繰越損益金 (H)	159,958,130,884

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

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

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

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)

運用報告書(全体版)

第7期

(決算日 2023年6月15日)

(作成対象期間 2022年6月16日～2023年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/株式/インデックス型		
信託期間	無期限(設定日:2016年9月26日)		
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数(配当込み、円ヘッジ・ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの受益証券	
	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式(上場予定および店頭登録予定を含みます。)	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、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、外国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCIコクサイ指数(配当込み、円ヘッジ・ベース)に連動する投資成果をあげることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2731>

最近5期の運用実績

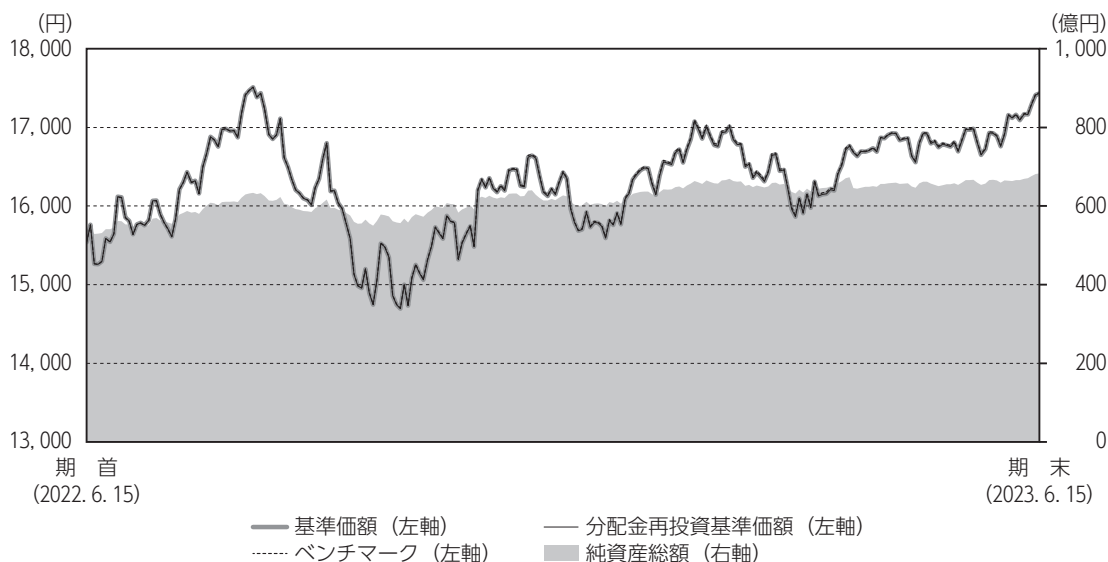
決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円ヘッジ・ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率	純資産 総額
	(分配前)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率					
3期末(2019年6月17日)	円 12,648	円 0	% 2.0	12,737	% 2.1	% 91.6	% 6.0	% —	% 2.8	百万円 36,065
4期末(2020年6月15日)	円 12,825	円 0	% 1.4	12,944	% 1.6	% 95.0	% 1.9	% —	% 2.7	42,369
5期末(2021年6月15日)	円 17,819	円 0	% 38.9	18,034	% 39.3	% 94.2	% 3.7	% —	% 2.4	56,165
6期末(2022年6月15日)	円 15,540	円 0	% △12.8	15,769	% △12.6	% 95.9	% 6.0	% —	% 2.5	53,716
7期末(2023年6月15日)	円 17,433	円 0	% 12.2	17,696	% 12.2	% 94.2	% 4.7	% —	% 2.1	68,296

- (注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
 - (注2) MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円ヘッジ・ベース) は、MSCI Inc. (「MSCI」) の承諾を得て、MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、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 (税引後配当込み、円ヘッジ・ベース) は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html]
 - (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
 - (注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
 - (注5) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。
 - (注6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。
 - (注7) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。
- ※ベンチマークを「MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)」から「MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円ヘッジ・ベース)」に変更しました。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

■基準価額・騰落率

期首：15,540円
 期末：17,433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

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

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、 円ヘッジ・ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首) 2022年 6月15日	15,540	—	15,769	—	95.9	6.0	—	2.5
6月末	15,812	1.8	16,037	1.7	92.2	11.5	—	2.5
7月末	16,669	7.3	16,910	7.2	87.9	8.8	—	2.4
8月末	16,336	5.1	16,578	5.1	93.5	7.4	—	2.5
9月末	14,891	△ 4.2	15,118	△ 4.1	91.8	10.1	—	2.3
10月末	15,876	2.2	16,115	2.2	91.3	9.2	—	2.2
11月末	16,244	4.5	16,495	4.6	87.7	4.8	—	2.2
12月末	15,815	1.8	16,058	1.8	88.4	5.3	—	2.2
2023年 1月末	16,551	6.5	16,811	6.6	89.6	7.8	—	2.3
2月末	16,428	5.7	16,689	5.8	95.1	7.3	—	2.3
3月末	16,520	6.3	16,782	6.4	93.2	3.5	—	2.2
4月末	16,801	8.1	17,056	8.2	92.9	6.4	—	2.1
5月末	16,887	8.7	17,146	8.7	92.8	7.7	—	2.0
(期末) 2023年 6月15日	17,433	12.2	17,696	12.2	94.2	4.7	—	2.1

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より横ばいで推移し、2022年7月中旬に米国の利上げペース鈍化の可能性が意識されて上昇しましたが、8月以降はF R B (米国連邦準備制度理事会) 議長講演において利上げ継続姿勢が強調されたことへの懸念から下落しました。10月以降は、英国政府が市場の懸念材料になっていた減税策の一部撤回を表明したことや、F R Bが今後利上げ幅を縮小させるのではないかと期待を背景に上昇しました。その後2023年2月には、米国の利上げ長期化への懸念から軟調な展開となり、3月には、米国の地方銀行の経営破綻やスイスの金融大手の株価急落により信用不安が高まり、続落しました。破綻した米国の地方銀行の預金保護や、F R Bによる金融機関への流動性供給、スイスの金融会社の救済合併の決定などにより、3月下旬には信用不安が後退したことから上昇しました。4月以降は、横ばいでの推移となりましたが、5月下旬以降は、AI (人工知能) 関連で使用される半導体メーカーの強気見通しや、米国の債務上限問題の解決などが好感されて上昇し、当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

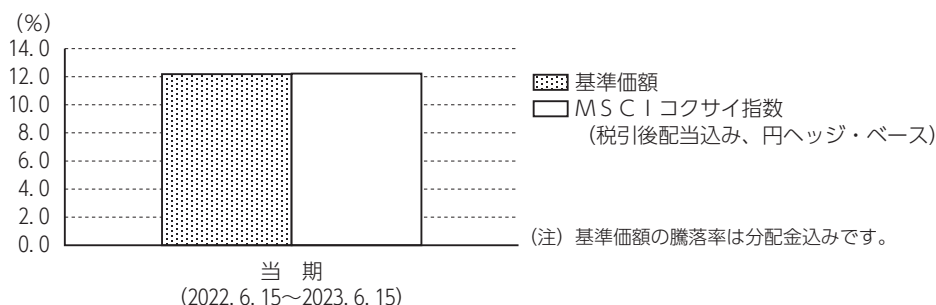
組入ファンド	ベンチマーク
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	M S C I コクサイ指数（税引後配当込み、円ヘッジ・ベース）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は12.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は12.2%となりました。

マザーファンドで組み入れているポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率との差異、為替ヘッジにかかるコスト、運用管理費用・売買委託手数料や保管費用等のコスト負担がかい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークはM S C I コクサイ指数（税引後配当込み、円ヘッジ・ベース）です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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	
	2022年6月16日 ～2023年6月15日	
当期分配金（税込み） (円)		—
対基準価額比率 (%)		—
当期の収益 (円)		—
当期の収益以外 (円)		—
翌期繰越分配対象額 (円)		7,448

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
 (注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
 (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。
 (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

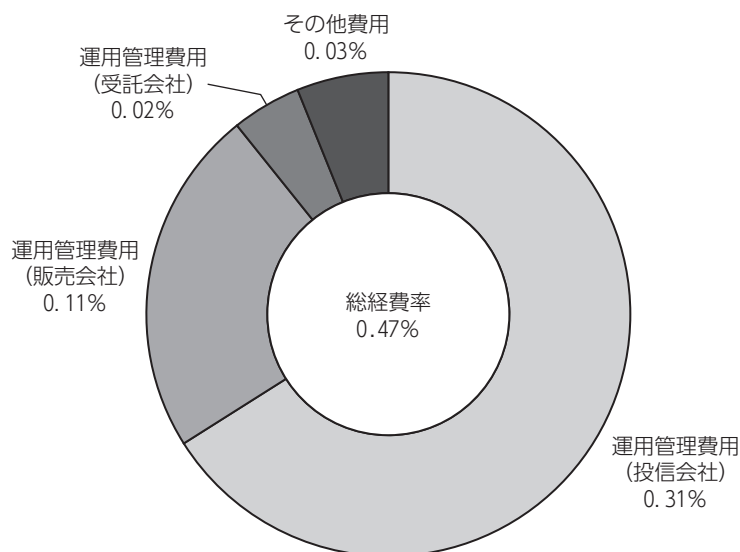
項目	当期 (2022. 6. 16~2023. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	73円	0.445%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は16,305円です。
（投信会社）	(51)	(0.313)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販売会社）	(18)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(4)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	2	0.010	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(1)	(0.007)	
（先物・オプション）	(1)	(0.003)	
（投資証券）	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	2	0.009	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(2)	(0.009)	
（投資証券）	(0)	(0.000)	
その他費用	5	0.029	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)	(0.024)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(1)	(0.003)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（その他）	(0)	(0.002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	81	0.494	

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.47%です。



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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	5,647,920	14,266,049	2,795,178	7,213,540

(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

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

項 目	当 期	
	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	34,420,727千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	74,072,335千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.46	

(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
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	22,230,689	25,083,432	68,287,135			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	68,287,135	99.6
コール・ローン等、その他	243,647	0.4
投資信託財産総額	68,530,783	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=140.39円、1カナダ・ドル=105.30円、1オーストラリア・ドル=95.37円、1香港・ドル=17.93円、1シンガポール・ドル=104.58円、1ニュージーランド・ドル=86.93円、1イギリス・ポンド=177.72円、1イスラエル・シェケル=39.178円、1スイス・フラン=155.82円、1デンマーク・クローネ=20.42円、1ノルウェー・クローネ=13.16円、1スウェーデン・クローネ=13.09円、1ユーロ=152.15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(91,483,138千円)の投資信託財産総額(94,180,706千円)に対する比率は、97.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	68,530,783,089円
コール・ローン等	243,647,598
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)	68,287,135,491
(B) 負債	233,901,298
未払解約金	89,089,199
未払信託報酬	143,714,942
その他未払費用	1,097,157
(C) 純資産総額 (A - B)	68,296,881,791
元本	39,176,810,504
次期繰越損益金	29,120,071,287
(D) 受益権総口数	39,176,810,504口
1万口当り基準価額 (C / D)	17,433円

* 期首における元本額は34,566,355,532円、当作成期間中における追加設定元本額は12,181,359,226円、同解約元本額は7,570,904,254円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は17,433円です。

■損益の状況

当期 自 2022年6月16日 至 2023年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 44,738円
受取利息	4,799
支払利息	△ 49,537
(B) 有価証券売買損益	6,925,532,578
売買益	7,554,622,719
売買損	△ 629,090,141
(C) 信託報酬等	△ 277,731,164
(D) 当期損益金 (A + B + C)	6,647,756,676
(E) 前期繰越損益金	3,804,551,046
(F) 追加信託差損益金 (配当等相当額)	(14,664,336,200)
(売買損益相当額)	(4,003,427,365)
(G) 合計 (D + E + F)	29,120,071,287
次期繰越損益金 (G)	29,120,071,287
追加信託差損益金 (配当等相当額)	(14,664,336,200)
(売買損益相当額)	(4,003,427,365)
分配準備積立金	10,511,929,128
繰越損益金	△ 59,621,406

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

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

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

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	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	18,667,763,565
(d) 分配準備積立金	10,511,929,128
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	29,179,692,693
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	29,179,692,693
(h) 受益権総口数	39,176,810,504口

《お知らせ》

■ベンチマークの変更について

当ファンドおよびマザーファンドのベンチマークとしていた株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。

変更前：MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)

変更後：MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ヘッジ・ベース)

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の決算日（2023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（2023年6月15日）現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLEINC (アメリカ)	44.463	899,836	20,237	APPLEINC (アメリカ)	41.301	857,432	20,760
MICROSOFTCORP (アメリカ)	20.2	708,736	35,085	MICROSOFTCORP (アメリカ)	16.9	616,659	36,488
AMAZON.COMINC (アメリカ)	28.271	393,559	13,920	AMAZON.COMINC (アメリカ)	22.342	329,506	14,748
TESLAINC (アメリカ)	9.459	282,172	29,831	ALPHABETINC-CLC (アメリカ)	10.197	223,327	21,901
ALPHABETINC-CLA (アメリカ)	17.462	233,557	13,375	ALPHABETINC-CLA (アメリカ)	8.977	215,732	24,031
ALPHABETINC-CLC (アメリカ)	14.718	198,763	13,504	TESLAINC (アメリカ)	4.576	183,365	40,071
NVIDIACORP (アメリカ)	6.945	193,704	27,891	NVIDIACORP (アメリカ)	5.908	162,682	27,535
UNITEDHEALTHGROUPOINC (アメリカ)	2.605	177,271	68,050	METAPLATFORMSINCLASSA (アメリカ)	6.245	159,755	25,581
JOHNSON&JOHNSON (アメリカ)	7.301	162,878	22,309	UNITEDHEALTHGROUPOINC (アメリカ)	2.141	142,687	66,645
BERKSHIREHATHAWAYINC-CLB (アメリカ)	3.9	159,328	40,853	JOHNSON&JOHNSON (アメリカ)	5.831	132,908	22,793

(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、2023年6月15日現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（34,080,983千円）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	株数	2023年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	15.71	247	34,721	資本財・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	37.84	902	126,731	情報技術
FIRST SOLAR INC	11	212	29,809	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	22.16	363	51,077	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	15.94	168	23,664	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7.46	94	13,253	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	56.06	188	26,396	金融
ABBOTT LABORATORIES	209.75	2,165	304,038	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	39.5	180	25,342	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	19.87	437	61,448	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	39.68	237	33,329	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	67.23	543	76,234	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5.85	314	44,120	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	72.42	396	55,613	金融
QORVO INC	11.47	118	16,682	情報技術
AFLAC INC	73.86	507	71,298	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	15.7	263	36,949	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	24.8	215	30,318	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	56	2,685	376,998	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	27.24	184	25,928	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	15.51	585	82,135	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	15.43	164	23,081	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	26.03	751	105,552	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	80.37	1,611	226,249	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	23.12	130	18,351	金融
AUTOZONE INC	2.32	556	78,150	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	27.8	383	53,777	生活必需品
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	145.65	108	15,254	ヘルスケア
CELANESE CORP	12.11	140	19,780	素材
DR HORTON INC	37.76	428	60,220	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	93	13,090	ヘルスケア
AUTODESK INC	24.92	532	74,710	情報技術
MOODY'S CORP	20.3	691	97,099	金融
DEVON ENERGY CORP	75.99	371	52,221	エネルギー
ALBEMARLE CORP	14.89	337	47,410	素材
ATMOS ENERGY CORP	13.49	157	22,171	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	33.69	178	25,129	公益事業
CITIGROUP INC	229.53	1,107	155,447	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	49.4	1,067	149,864	資本財・サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	62.88	525	73,808	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	4.07	124	17,468	一般消費財・サービス

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
HESS CORP	33.73	452	63,467	エネルギー
DAVITA INC	6.09	59	8,334	ヘルスケア
DANAHER CORP	83.49	1,990	279,491	ヘルスケア
FORTIVE CORP	35.36	245	34,501	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	64.93	718	100,881	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	67.06	490	68,867	生活必需品
BUNGE LTD	16.53	157	22,120	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	38.99	513	72,106	情報技術
APPLE INC	1,913.86	35,205	4,942,493	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	35.15	411	57,805	金融
BOEING CO/THE	68.37	1,482	208,190	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	19.13	191	26,848	金融
BECTON DICKINSON AND CO	35.01	886	124,513	ヘルスケア
LEIDOS HOLDINGS INC	14	116	16,319	資本財・サービス
NISOURCE INC	41.11	111	15,675	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14.04	132	18,648	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	95.21	420	59,039	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	505.38	1,805	253,505	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	156.59	5,259	738,431	金融
ANSYS INC	9.74	325	45,713	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	164.78	522	73,379	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	92.43	834	117,162	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	255.56	1,639	230,193	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	352	4,980	699,205	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	28.55	317	44,546	金融
LKQ CORP	29.16	158	22,298	一般消費財・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	41.71	270	38,038	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	32.12	758	106,447	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13.37	426	59,863	金融
DOLLAR GENERAL CORP	26.08	422	59,358	生活必需品
SERVICENOW INC	24.2	1,372	192,740	情報技術
CATERPILLAR INC	62.57	1,522	213,737	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	26.69	172	24,205	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	24.56	101	14,209	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	5.74	119	16,714	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	30.93	186	26,235	公益事業
MOSAIC CO/THE	38.41	134	18,867	素材
DELTA AIR LINES INC	20.19	85	11,958	資本財・サービス
CORNING INC	101.7	338	47,458	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	494.61	2,520	353,857	情報技術
MORGAN STANLEY	152.02	1,337	187,767	金融
DECKERS OUTDOOR CORP	3	152	21,341	一般消費財・サービス
MSCI INC	9.69	471	66,141	金融
FAIR ISAAC CORP	2.99	237	33,381	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	4.7	144	20,233	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	29.98	177	24,874	資本財・サービス
BROADCOM INC	50.12	4,441	623,546	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	6	135	19,060	ヘルスケア
DICK'S SPORTING GOODS INC	8	108	15,162	一般消費財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	16.05	318	44,724	ヘルスケア
ARAMARK	28.58	114	16,113	一般消費財・サービス
DTE ENERGY COMPANY	24.9	281	39,484	公益事業
CENTENE CORP	71.87	464	65,230	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	11.82	164	23,034	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	65.65	177	24,976	金融
DARLING INGREDIENTS INC	19	122	17,228	生活必需品
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24.19	507	71,245	金融
GARTNER INC	10.2	359	50,458	情報技術
SPLUNK INC	22.66	236	33,135	情報技術
DOMINION ENERGY INC	96.76	508	71,398	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	95.44	558	78,356	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	14	97	13,685	資本財・サービス
DEERE & CO	34.64	1,382	194,062	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC	15.77	291	40,978	資本財・サービス
POOL CORP	4.38	151	21,238	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	30.08	304	42,719	金融
VMWARE INC-CLASS A	28.61	402	56,565	情報技術
BURLINGTON STORES INC	7.66	113	15,959	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	45.41	232	32,615	金融
VAIL RESORTS INC	4.48	111	15,699	一般消費財・サービス
TARGA RESOURCES CORP	24.31	172	24,221	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	99	14,036	金融
WESTLAKE CORP	4.24	48	6,767	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	43.19	399	56,020	公益事業
COGNEX CORP	19.94	111	15,648	情報技術
WEBSTER FINANCIAL CORP	22	85	12,002	金融
TELEFLEX INC	6.45	157	22,142	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	11.28	196	27,616	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	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8.45	299	42,076	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	2.41	89	12,548	ヘルスケア
CATALENT INC	18.63	78	11,008	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17.36	337	47,376	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	7.83	215	30,283	ヘルスケア
CARLISLE COS INC	6	141	19,887	資本財・サービス
IDEX CORP	9.6	199	28,014	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	97.5	735	103,235	生活必需品
ROLLINS INC	23.37	95	13,415	資本財・サービス
AECOM	17	146	20,572	資本財・サービス
WATSCO INC	4	144	20,300	資本財・サービス
GRACO INC	21	176	24,806	資本財・サービス
AMETEK INC	24.89	382	53,672	資本財・サービス
TORO CO	13	125	17,655	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	27.48	262	36,792	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	16.64	93	13,082	資本財・サービス
HEICO CORP	5.35	88	12,380	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	6.84	81	11,479	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5.21	214	30,061	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	33.06	298	41,924	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	4.67	183	25,706	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	53.07	2,797	392,790	生活必需品
EPAM SYSTEMS INC	7.63	169	23,836	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	14.57	122	17,145	素材
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	7	178	25,044	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3.22	663	93,176	一般消費財・サービス
UGI CORP	29.07	80	11,304	公益事業
CUMMINS INC	17.27	404	56,809	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	97.31	790	110,971	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	16.87	297	41,820	情報技術
COSTAR GROUP INC	49.57	410	57,621	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	11.4	365	51,329	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	5.94	719	101,057	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	9.9	159	22,361	金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	33.86	486	68,238	一般消費財・サービス
DEXCOM INC	45.07	572	80,395	ヘルスケア
NORDSON CORP	4.88	114	16,017	資本財・サービス
COPART INC	52.7	455	63,879	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	21.5	272	38,267	エネルギー
SEAGEN INC	17.45	342	48,067	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	8.62	277	39,022	ヘルスケア
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	10.38	213	29,962	金融
TRANSDIGM GROUP INC	6.44	522	73,310	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	21.64	162	22,745	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	10.79	101	14,272	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	29.45	296	41,601	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	253.43	428	60,128	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	25.65	728	102,340	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4.2	115	16,282	金融
COTERRA ENERGY INC	86.46	209	29,447	エネルギー
T-MOBILE US INC	73.94	946	132,921	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	17.86	82	11,563	不動産
COCA-COLA CO/THE	493.9	3,005	421,994	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	25.75	168	23,664	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.25	226	31,792	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	33.73	90	12,747	金融
CSX CORP	246.44	815	114,483	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10.01	227	31,897	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	19.96	217	30,524	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	1,116.69	14,117	1,981,913	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	72.67	657	92,359	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	496.15	5,217	732,486	エネルギー
AES CORP	90.21	187	26,266	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	4.48	152	21,454	金融
EOG RESOURCES INC	70.11	775	108,929	エネルギー
EQT CORP	38.28	147	20,663	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	22.68	208	29,290	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1.34	171	24,092	金融
AMERISOURCEBERGEN CORP	19.76	353	49,670	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	35.92	428	60,211	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	481.59	683	96,006	一般消費財・サービス
EXACT SCIENCES CORP	19.24	179	25,136	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	41	5,840	コミュニケーション・サービス
ENTEGRIS INC	18.93	214	30,091	情報技術
AERCAP HOLDINGS NV	17	103	14,477	資本財・サービス
FORTINET INC	83.51	596	83,802	情報技術
MARKEL CORP	1.7	226	31,758	金融
NEXTERA ENERGY INC	237.26	1,741	244,487	公益事業

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
MASIMO CORP	6.23	100	14,112	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	177.14	709	99,623	素材
INSULET CORP	8.09	229	32,208	ヘルスケア
US BANCORP	175.49	563	79,084	金融
UNITED RENTALS INC	8.49	344	48,389	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	6.59	98	13,851	情報技術
FASTENAL CO	71.58	396	55,712	資本財・サービス
FISERV INC	70.76	849	119,207	金融
GENERAL ELECTRIC CO	130.89	1,370	192,393	資本財・サービス
AXON ENTERPRISE INC	9	178	24,993	資本財・サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP	5	93	13,134	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	175.33	655	91,960	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	29.34	622	87,381	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	40.54	1,371	192,608	金融
FIRST HORIZON CORP	64	73	10,287	金融
ALPHABET INC-CL A	721.42	8,921	1,252,531	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	648.23	8,062	1,131,920	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	10.83	131	18,451	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	69.78	562	79,008	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	72.24	280	39,370	公益事業
GENUINE PARTS CO	18.47	293	41,156	一般消費財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	86.2	223	31,403	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	23.3	444	62,454	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	114.26	366	51,411	エネルギー
REPLIGEN CORP	6	96	13,597	ヘルスケア
HOME DEPOT INC	122.66	3,676	516,107	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	5.32	68	9,642	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	187.48	203	28,504	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4.31	92	13,028	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	18.15	472	66,400	生活必需品
HUMANA INC	15.69	713	100,223	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	32.76	641	90,001	情報技術
HENRY SCHEIN INC	14.91	111	15,659	ヘルスケア
HP INC	128.71	398	55,925	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	173.22	291	40,879	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6.81	20	2,912	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22.62	177	24,852	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	46.63	326	45,877	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	90.63	332	46,657	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	17.38	311	43,724	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	108.61	1,490	209,199	情報技術
HUBBELL INC	7.39	233	32,727	資本財・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	47.24	150	21,089	素材
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	15	99	13,904	資本財・サービス
ZOETIS INC	56.04	928	130,324	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	28.49	516	72,546	資本財・サービス
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	17	156	21,973	情報技術
CHENIERE ENERGY INC	28.18	414	58,155	エネルギー
HYATT HOTELS CORP - CL A	6	70	9,846	一般消費財・サービス
ALLEGION PLC	9.42	109	15,442	資本財・サービス
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	18	217	30,576	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	29.12	53	7,452	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	30.46	416	58,512	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	35.3	111	15,699	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	12.25	186	26,219	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	314.44	5,080	713,194	ヘルスケア
ABBVIE INC	213.19	2,904	407,732	ヘルスケア
HOLOGIC INC	32.36	253	35,535	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	42.1	568	79,861	生活必需品
KROGER CO	85.32	402	56,548	生活必需品
KLA CORP	16.64	799	112,258	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	28.55	1,292	181,388	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8.4	201	28,277	金融
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	28.72	114	16,007	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	72.99	1,568	220,168	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	97.56	4,367	613,217	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	17.01	1,071	150,453	情報技術
LOEWS CORP	22.28	129	18,179	金融
MCDONALD'S CORP	88.23	2,544	357,279	一般消費財・サービス
3M CO	64.15	654	91,816	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	266.96	7,297	1,024,475	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	39.88	1,567	220,081	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7.55	321	45,133	素材
SOLAREDDGE TECHNOLOGIES INC	7.36	199	28,047	情報技術
ALCOA CORP	20.93	75	10,616	素材
PHILLIPS 66	53.5	511	71,878	エネルギー
ATLISSIAN CORP PLC-CLASS A	19	344	48,341	情報技術
MGM RESORTS INTERNATIONAL	38.67	169	23,800	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	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	27.85	253	35,571	生活必需品
METLIFE INC	83.3	449	63,080	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	113.18	712	100,039	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	30.3	512	71,923	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	19.69	547	76,932	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.82	370	52,083	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	125.17	374	52,612	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	12.97	406	57,014	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	305.45	3,319	465,957	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	62.67	438	61,534	素材
MASCO CORP	25.41	140	19,723	資本財・サービス
M & T BANK CORP	18.06	220	30,907	金融
MARSH & MCLENNAN COS	58.96	1,050	147,420	金融
BLACK KNIGHT INC	24.98	142	19,989	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	11.47	150	21,141	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	33.13	601	84,399	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	27.24	591	83,104	情報技術
BLOCK INC CLASS A	72.49	461	64,816	金融
TRANSUNION	25.57	193	27,106	資本財・サービス
VISTRA CORP	40.57	100	14,130	公益事業
NOVOCURE LTD	10.54	47	6,658	ヘルスケア
NETAPP INC	23.7	173	24,388	情報技術
NIKE INC -CL B	151.56	1,710	240,137	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	29.13	644	90,542	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	68.88	596	83,781	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	24.96	245	34,431	金融
ALLY FINANCIAL INC	37.09	105	14,772	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	17.09	765	107,463	資本財・サービス
APTIV PLC	34.76	351	49,292	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	96.04	404	56,763	素材
MCKESSON CORP	17.07	667	93,761	ヘルスケア
XYLEM INC	23.43	261	36,768	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	186.38	1,734	243,499	生活必需品
NUCOR CORP	31.83	479	67,315	素材
GODADDY INC - CLASS A	19.3	143	20,167	情報技術
EVERGY INC	29.23	172	24,178	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	88.24	515	72,432	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	58	8,199	金融
OKTA INC	19.95	148	20,843	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	14.45	108	15,255	コミュニケーション・サービス
WIX.COM LTD	7.85	66	9,398	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	42.93	114	16,134	金融
KKR & CO INC	68.86	392	55,132	金融
PAYCHEX INC	39.74	443	62,229	資本財・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7.46	678	95,267	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	214.58	943	132,398	生活必需品
P G & E CORP	184.79	318	44,725	公益事業
PFIZER INC	675.3	2,657	373,153	ヘルスケア
CIGNA CORP	35.89	946	132,903	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	32.76	161	22,710	情報技術
XCEL ENERGY INC	62.56	390	54,883	公益事業
STERIS PLC	12.93	275	38,686	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	41	260	36,631	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	15.3	47	6,699	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	34.95	116	16,334	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	40.35	1,184	166,299	ヘルスケア
DOW INC	87.6	462	64,946	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	11.3	80	11,358	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	27.51	188	26,416	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	15.55	571	80,238	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	220.15	908	127,552	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	26.11	525	73,780	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	284.36	4,163	584,527	生活必需品
EXELON CORP	123.53	495	69,577	公益事業
INGERSOLL-RAND INC	42.91	275	38,626	資本財・サービス
NVR INC	0.39	229	32,230	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	151.14	1,551	217,850	エネルギー
TWILIO INC - A	20.53	136	19,106	情報技術
DOCUSIGN INC	23.33	126	17,719	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	7	223	31,438	資本財・サービス
CERIDIAN HCM HOLDING INC	14.7	97	13,633	資本財・サービス
PEPSICO INC	165.23	3,026	424,892	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4.09	62	8,722	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	29.5	74	10,395	情報技術
MONGODB INC	8.21	307	43,175	情報技術
SNAP INC - A	129.1	132	18,577	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	89.92	512	71,993	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	45.96	393	55,193	金融

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
AMCOR PLC	195.45	198	27,878	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	26.41	406	57,083	情報技術
ROKU INC	14.17	103	14,595	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	22.9	334	46,973	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	75.6	2,381	334,377	情報技術
PENTAIR PLC	22.22	134	18,900	資本財・サービス
QUALCOMM INC	134.4	1,658	232,836	情報技術
INVESCO LTD	37	61	8,601	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	6.64	46	6,543	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	28.95	209	29,405	金融
DATADOG INC - CLASS A	34.87	335	47,132	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	78.96	192	27,070	コミュニケーション・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	12.67	976	137,160	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	27.89	400	56,210	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	4.6	1,200	168,538	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	42.54	451	63,448	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	9.98	131	18,404	素材
RESMED INC	17.97	389	54,654	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	13.27	180	25,383	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	12.09	86	12,113	資本財・サービス
MODERNA INC	41.17	518	72,855	ヘルスケア
HUBSPOT INC	6.51	328	46,057	情報技術
REVVITY INC	13.45	155	21,790	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	103.3	476	66,942	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	52.62	460	64,646	資本財・サービス
BILL HOLDINGS INC	11.59	132	18,588	情報技術
AVANTOR INC	97.8	191	26,856	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	27.73	84	11,924	金融
DYNATRACE INC	23.39	121	17,016	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	61.14	469	65,929	コミュニケーション・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	121.13	218	30,626	金融
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	29.96	82	11,629	コミュニケーション・サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	41.76	134	18,848	ヘルスケア
MATCH GROUP INC	30.49	134	18,881	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	221.66	3,482	488,845	エネルギー
ZSCALER INC	9.85	155	21,786	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	44.6	304	42,683	公益事業
ETSY INC	14.09	133	18,803	一般消費財・サービス
TESLA INC	346.01	8,885	1,247,391	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	29.65	536	75,371	情報技術
GEN DIGITAL INC	85.05	156	21,910	情報技術
UNITY SOFTWARE INC	35.42	145	20,407	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	17.45	155	21,825	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	17.94	800	112,342	情報技術
CHEWY INC - CLASS A	8.56	33	4,772	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	35.52	244	34,343	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	12.66	424	59,585	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	112.72	110	15,444	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	34.38	245	34,510	一般消費財・サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	52.7	210	29,527	コミュニケーション・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	50.23	628	88,246	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	39.73	311	43,723	不動産
SOUTHERN CO/THE	132.11	931	130,718	公益事業
SYSCO CORP	63.45	462	64,875	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	28.26	490	68,854	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6	25	3,531	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	16	93	13,185	金融
STEEL DYNAMICS INC	21.56	225	31,687	素材
SCHLUMBERGER LTD	166.49	786	110,486	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	17.49	77	10,938	資本財・サービス
AT&T INC	859.91	1,362	191,224	コミュニケーション・サービス
APA CORP	36.32	122	17,158	エネルギー
SOUTHWEST AIRLINES CO	10.08	33	4,750	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	49.47	458	64,408	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	23.88	117	16,491	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	30.66	753	105,822	素材
SEMPRA ENERGY	37.08	546	76,674	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	22.64	120	16,979	情報技術
CLARIVATE PLC	33.77	30	4,219	資本財・サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	244.48	388	54,607	情報技術
UIPATH INC - CLASS A	45	80	11,365	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	22.4	146	20,531	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	13.35	71	10,101	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC	108.49	1,921	269,769	情報技術
SALESFORCE.COM INC	120.23	2,517	353,448	情報技術
WESTROCK CO	38.4	112	15,757	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	50.86	387	54,372	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	82.84	534	75,012	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	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
TERADYNE INC	20.46	225	31,699	情報技術
UNION PACIFIC CORP	74.17	1,503	211,107	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	76.22	173	24,407	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	58.23	650	91,264	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	175.65	1,701	238,851	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	87.82	1,535	215,610	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	22.88	486	68,328	ヘルスケア
AMEREN CORPORATION	27.27	225	31,714	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	112.36	5,166	725,393	ヘルスケア
TOAST INC CLASS A	29	67	9,478	金融
VERISIGN INC	10.8	238	33,476	情報技術
LUCID GROUP INC	51	32	4,582	一般消費財・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	45.41	66	9,396	一般消費財・サービス
VALERO ENERGY CORP	47.23	528	74,150	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	6.68	296	41,599	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	104	14,632	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7.67	112	15,741	ヘルスケア
ELEVANCE HEALTH INC	28.52	1,244	174,703	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	218.67	2,021	283,813	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	455.52	1,916	269,103	金融
WASTE MANAGEMENT INC	48.99	795	111,707	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	146.97	443	62,312	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	14.18	309	43,405	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	6.36	92	13,032	一般消費財・サービス
WALMART INC	179.67	2,818	395,686	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	26.39	374	52,613	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	11.45	118	16,637	一般消費財・サービス
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	139	47	6,634	資本財・サービス
WABTEC CORP	17.29	175	24,676	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	138.64	1,107	155,514	一般消費財・サービス
WATERS CORP	7.59	198	27,926	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	6.97	195	27,435	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	92.98	292	41,131	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13.91	317	44,602	金融
WESTERN DIGITAL CORP	44.44	179	25,242	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	39.2	354	49,821	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	61.97	383	53,878	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	195.55	4,369	613,415	金融
PPL CORP	96.77	259	36,490	公益事業
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	41.2	383	53,907	公益事業
PULTEGROUP INC	25.92	189	26,655	一般消費財・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	288.48	394	55,363	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC	29.29	412	57,856	素材
NORTHERN TRUST CORP	26.67	198	27,800	金融
FERGUSON PLC	28.54	428	60,112	資本財・サービス
NVIDIA CORP	299	12,856	1,804,868	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	48.58	614	86,288	金融
ASPEN TECHNOLOGY CORP	3	49	6,930	情報技術
TYSON FOODS INC-CL A	38.33	190	26,776	生活必需品
NETFLIX INC	53.58	2,362	331,619	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	47.16	2,452	344,360	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	24.11	82	11,623	公益事業
GLOBE LIFE INC	10.11	108	15,186	金融
TEXTRON INC	23.88	155	21,888	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	37.49	72	10,136	コミュニケーション・サービス
TEXAS PACIFIC LAND CORP	0.7	93	13,073	エネルギー
OMNICOM GROUP	23.11	218	30,698	コミュニケーション・サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	13.37	154	21,640	資本財・サービス
ORACLE CORP	195.74	2,393	335,997	情報技術
MASTERCARD INC - A	103.28	3,870	543,382	金融
ONEOK INC	55.66	336	47,220	エネルギー
ROPER TECHNOLOGIES INC	12.25	559	78,497	情報技術
U HAUL NON VOTING SERIES N	8.82	42	6,033	資本財・サービス
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	18	169	23,796	金融
CHESAPEAKE ENERGY CORP	12	95	13,437	エネルギー
HF SINCLAIR CORP	19	84	11,896	エネルギー
OVINTIV INC	30	110	15,532	エネルギー
YUM! BRANDS INC	34.86	475	66,729	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	21.74	297	41,700	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	19.61	132	18,569	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	865.51	2,520	353,834	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5.1	203	28,547	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	25.86	244	34,275	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	76	1,325	186,153	金融
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	46.32	363	51,066	ヘルスケア
LINDE PLC	59.27	2,218	311,460	素材
ANALOG DEVICES INC	59.8	1,147	161,097	情報技術
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	36	75	10,583	生活必需品

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
MONDAYCOM LTD	2	36	5,135	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	193.72	2,466	346,291	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	82.68	461	64,815	金融
SKYWORX SOLUTIONS INC	20.29	222	31,302	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	26.09	247	34,693	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	10.7	178	25,099	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	65.37	416	58,468	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	73.82	633	88,961	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	24.32	785	110,271	金融
AMGEN INC	64.36	1,430	200,841	ヘルスケア
EATON CORP PLC	46.09	889	124,927	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	21	518	72,823	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	101.97	1,439	202,092	情報技術
CME GROUP INC	41.88	760	106,719	金融
ECOLAB INC	31.35	563	79,138	素材
EQUIFAX INC	15.76	362	50,824	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	147.52	1,149	161,437	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	100.21	318	44,681	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	38.8	160	22,469	生活必需品
STATE STREET CORP	46.67	341	47,960	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	171.23	930	130,651	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	65.28	283	39,820	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	27.16	124	17,505	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	13.92	118	16,673	素材
CARDINAL HEALTH INC	29.73	258	36,299	ヘルスケア
FEDEX CORP	28.77	660	92,764	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46.93	527	74,008	金融
FMC CORP	13.6	142	19,959	素材
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	27.72	217	30,471	素材
INTEL CORP	495.92	1,764	247,715	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	43.18	173	24,333	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	40.37	285	40,035	金融
WOLFSPEED INC	15	84	11,895	情報技術
ILLINOIS TOOL WORKS	35.98	879	123,482	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	102.27	38	5,412	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	19.93	408	57,313	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	14.5	56	7,965	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	42.42	1,370	192,399	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	12.39	159	22,416	情報技術
SNAP-ON INC	6.23	169	23,770	資本財・サービス
CARMAX INC	17.49	139	19,569	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP	89.39	812	114,011	公益事業
TARGET CORP	54.73	729	102,367	生活必需品
DOVER CORP	17.84	259	36,361	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	5.41	393	55,221	資本財・サービス
CINTAS CORP	10.59	514	72,268	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	51.09	178	25,067	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	17	195	27,446	生活必需品
CLOROX COMPANY	13.87	213	29,975	生活必需品
ENTERGY CORP	26.23	265	37,303	公益事業
MICROSOFT CORP	854.66	28,831	4,047,598	情報技術
INCYTE CORP	18.56	114	16,009	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	157.35	1,048	147,232	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	159.57	1,402	196,936	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	128.91	891	125,091	情報技術
BLACKROCK INC	17.71	1,226	172,164	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	66.79	193	27,220	公益事業
HASBRO INC	13.26	82	11,524	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	30.95	204	28,738	生活必需品
KEYCORP	125.65	124	17,481	金融
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	162.01	1,184	166,331	生活必需品
COOPER COS INC/THE	5.51	199	28,059	ヘルスケア
CHUBB LTD	48.63	918	128,924	金融
ARROW ELECTRONICS INC	7.37	101	14,271	情報技術
ALLSTATE CORP	33.64	374	52,611	金融
EBAY INC	60.77	273	38,451	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	129.16	821	115,324	金融
EASTMAN CHEMICAL CO	13.92	114	16,018	素材
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	28.49	547	76,858	生活必需品
TRIMBLE INC	34.89	181	25,431	情報技術
LENNAR CORP-A	32.47	372	52,308	一般消費財・サービス
LEAR CORP	8.28	119	16,815	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	68.54	869	122,136	金融
PACCAR INC	63.96	499	70,092	資本財・サービス
BIOGEN INC	17.87	536	75,260	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	10.36	483	67,918	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	138.29	1,392	195,426	一般消費財・サービス
PTC INC	12	169	23,818	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	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
EVERSOURCE ENERGY	43.18	301	42,373	公益事業
INTUIT INC	33.94	1,514	212,616	情報技術
BORGWARNER INC	27.41	131	18,393	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	23.16	177	24,918	一般消費財・サービス
BALL CORP	42.23	229	32,287	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	175.22	934	131,137	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	33.8	432	60,690	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	14.88	308	43,323	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	30.03	1,023	143,745	ヘルスケア
VF CORP	54.42	104	14,722	一般消費財・サービス
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	82.61	137	19,252	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	5.64	55	7,834	一般消費財・サービス
CARNIVAL CORP	143.58	223	31,445	一般消費財・サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC	76.74	128	18,013	素材
COMCAST CORP-CLASS A	520.31	2,124	298,321	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	19	94	13,275	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	131	53	7,540	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	41,037.97 604銘柄	458,317 <69.3%>	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
(カナダ)				
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	103.76	674	71,062	生活必需品
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	41.76	186	19,656	金融
IMPERIAL OIL LTD	30.68	203	21,383	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2.53	697	73,486	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	33.05	336	35,386	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	50.69	301	31,721	素材
INTACT FINANCIAL CORP	19.51	386	40,650	金融
BCE INC	6.68	40	4,246	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	24.14	465	49,046	素材
SUNCOR ENERGY INC	152.97	607	63,996	エネルギー
METRO INC/CN	23.77	169	17,796	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	38.95	384	40,522	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	146.37	970	102,202	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	112.45	648	68,251	金融
TORONTO-DOMINION BANK	216.5	1,730	182,197	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	33.35	128	13,509	金融
ROYAL BANK OF CANADA	162.09	2,029	213,658	金融
TOURMALINE OIL CORP	36.56	217	22,933	エネルギー
TC ENERGY CORP	117.92	641	67,598	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	64.94	267	28,132	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	207.61	464	48,903	素材
CAE INC	37.52	104	10,951	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	19.68	332	35,026	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	18	62	6,575	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	6.31	67	7,055	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	15.6	97	10,309	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	47	95	10,066	金融
HYDRO ONE LTD	48.66	181	19,107	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	18.61	217	22,931	生活必需品
NORTHLAND POWER INC	26.32	72	7,665	公益事業
WSP GLOBAL INC	14.57	256	26,968	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9.74	104	11,052	資本財・サービス
PARKLAND CORP	16.21	54	5,771	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	19.49	64	6,823	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	35.24	193	20,335	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC	9.24	130	13,754	資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A	21.93	76	8,029	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	50.43	294	31,017	コミュニケーション・サービス
BRP INC/CA- SUB VOTING	4.03	43	4,561	一般消費財・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	74.02	87	9,244	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	59.83	400	42,128	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	69.97	77	8,200	公益事業
AIR CANADA	17	40	4,213	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	147.57	95	10,069	素材
BANK OF MONTREAL	82.04	970	102,171	金融
POWER CORP OF CANADA	69.72	244	25,754	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	142.31	1,250	131,645	情報技術
NUTRIEN LTD	61.74	481	50,735	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	15.32	67	7,114	公益事業
CAMECO CORP	43.9	182	19,244	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	4.22	82	8,727	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	18.65	93	9,821	資本財・サービス
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	7.72	30	3,223	金融
TELUS CORP	6	15	1,609	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	53.74	310	32,696	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	6.23	106	11,233	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	138.7	1,025	107,975	エネルギー

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2.74	268	28,298	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	39.47	295	31,158	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	8	122	12,909	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	26.15	52	5,531	素材
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	10	103	10,849	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	77.51	522	54,977	金融
ENBRIDGE INC	243.58	1,197	126,090	エネルギー
BROOKFIELD CORP	163.87	722	76,096	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	210.41	540	56,874	金融
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	109.62	1,135	119,596	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	16.09	146	15,438	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	23.64	95	10,014	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	68.38	1,063	111,959	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	29.56	413	43,530	情報技術
ONEX CORPORATION	11.04	77	8,155	金融
IGM FINANCIAL INC	13.18	54	5,691	金融
TMX GROUP LTD	34.9	104	10,969	金融
OPEN TEXT CORP	32.1	179	18,928	情報技術
SAPUTO INC	29	90	9,548	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	77.81	240	25,366	素材
FORTIS INC	59.38	335	35,321	公益事業
RB GLOBAL INC	20.46	155	16,347	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	66	70	7,457	素材
CENOVUS ENERGY INC	182.31	403	42,541	エネルギー
DOLLARAMA INC	30.74	263	27,795	一般消費財・サービス
ALTAGAS LTD	32.01	78	8,271	公益事業
KEYERA CORP	22	67	7,070	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	77.34	131	13,795	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,780.83 85銘柄	28,497 3,000,740	<3.2%>
(オーストラリア)	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
THE LOTTERY CORPORATION LTD	237.27	120	11,449	一般消費財・サービス
TELSTRA GROUP LTD	423.51	184	17,569	コミュニケーション・サービス
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	382.83	877	83,682	金融
MEDIBANK PRIVATE LTD	301.36	108	10,375	金融
BHP GROUP LTD	625.31	2,870	273,728	素材
SOUTH32 LTD	645	251	23,990	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	241.85	838	79,921	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	217.22	471	44,954	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	397.07	1,012	96,602	金融
WESTPAC BANKING CORP	440.52	905	86,377	金融
SANTOS LTD	344.14	250	23,926	エネルギー
RIO TINTO LTD	47.51	551	52,627	素材
ORIGIN ENERGY LTD	182.8	155	14,801	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD	196.19	70	6,679	資本財・サービス
PILBARA MINERALS LTD	300.83	146	14,000	素材
XERO LTD	14.26	158	15,141	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	27.48	87	8,331	金融
COLES GROUP LTD	163.86	293	27,957	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	16.45	128	12,283	情報技術
IDP EDUCATION LTD	20.88	49	4,715	一般消費財・サービス
IGO LTD	80.81	122	11,668	素材
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	163.2	212	20,295	素材
REECE LTD	23.22	43	4,161	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	139.06	82	7,864	生活必需品
SEEK LTD	48.13	103	9,914	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	86.16	98	9,383	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	108.78	283	27,056	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	216.92	2,112	201,435	金融
AMPOL LTD	46.05	140	13,408	エネルギー
ORICA LTD	47.83	72	6,915	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	209.61	316	30,225	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD	160.85	617	58,860	生活必需品
QANTAS AIRWAYS LTD	63.73	40	3,883	資本財・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	47.96	187	17,879	素材
MACQUARIE GROUP LTD	45.72	814	77,635	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	77.93	296	28,301	一般消費財・サービス
CSL LTD	61.13	1,755	167,465	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	140.07	675	64,387	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	10.39	246	23,530	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	50.24	103	9,836	素材
SUNCORP GROUP LTD	145.04	190	18,175	金融
ASX LTD	22.6	137	13,108	金融
COMPUTERSHARE LTD	60.54	138	13,175	資本財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	141	13,515	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	52.23	182	17,439	ヘルスケア
BRAMBLES LTD	212.01	291	27,842	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	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
MINERAL RESOURCES LTD	18.81	134	12,794	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20.64	118	11,318	ヘルスケア
REA GROUP LTD	6.08	80	7,683	コミュニケーション・サービス
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	7,863.05 49銘柄	19,275 <2.0%>	
	百株	千香港・ドル	千円	
(香港)				
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	175	720	12,911	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	270	1,386	24,859	一般消費財・サービス
MTR CORP	235	864	15,505	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	180	1,821	32,661	不動産
SINO LAND CO	540	523	9,391	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	335.52	1,639	29,387	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	50	267	4,800	不動産
CLP HOLDINGS LTD	230	1,300	23,320	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	185.65	437	7,839	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,380.27	945	16,952	公益事業
HANG SENG BANK LTD	90	1,015	18,202	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT	155	309	5,547	不動産
WH GROUP LTD	895	371	6,659	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	159	4,948	88,719	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	270	352	6,312	不動産
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	220	272	4,891	資本財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	320	632	11,337	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	235.52	1,049	18,812	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	229	4,117	公益事業
AIA GROUP LTD	1,544	12,683	227,423	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120	168	3,016	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	200	821	14,720	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	192	408	7,315	生活必需品
ESR CAYMAN LTD	220	307	5,514	不動産
SANDS CHINA LTD	290	826	14,819	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	170	1,387	24,872	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	430	1,036	18,580	金融
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,146.96 27銘柄	36,725 658,493 <0.7%>	
	百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)				
CAPITALAND INVESTMENT LTD	304	102	10,682	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD	149	418	43,739	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	243	757	79,186	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	137.5	104	10,928	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	173	115	12,103	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	30	20	2,102	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	36	3,779	不動産
SEATRUM	3,301.71	42	4,419	資本財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	12	40	4,202	資本財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	447	555	58,106	金融
GENTING SINGAPORE LTD	1,300	123	12,915	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	32	48	5,083	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,124	279	29,269	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	52	5,470	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	118	114	11,970	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD	278	111	11,687	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 >	7,842.21 16銘柄	2,922 305,649 <0.3%>	
	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
(ニュージーランド)				
MERIDIAN ENERGY LTD	150	81	7,067	公益事業
MERCURY NZ LTD	123.8	78	6,849	公益事業
EBOS GROUP LTD	20.56	73	6,369	ヘルスケア
SPARK NEW ZEALAND LTD	236.35	121	10,519	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	132.89	110	9,576	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	72.38	172	14,968	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 >	735.98 6銘柄	636 55,352 <0.1%>	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)				
SHELL PLC	853.07	1,965	349,379	エネルギー
HALEON PLC	679.98	216	38,537	生活必需品
WISE PLC CLASS A	78.05	48	8,600	金融
BP PLC	2,202.57	1,015	180,512	エネルギー
UNILEVER PLC	305.07	1,210	215,106	生活必需品
BARCLAYS PLC	1,774.8	279	49,659	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,104.96	166	29,603	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	339.07	385	68,454	金融
NATWEST GROUP PLC	698.35	185	32,938	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	30.8	54	9,636	素材

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
BAE SYSTEMS PLC	398.54	378	67,315	資本財・サービス
AVIVA PLC	319.64	128	22,768	金融
GSK	507.45	691	122,956	ヘルスケア
INFORMA PLC	162	114	20,280	コミュニケーション・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	105.87	67	12,056	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	16.37	76	13,571	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	51.49	21	3,743	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7.4	84	14,953	資本財・サービス
HALMA PLC	39.78	96	17,172	情報技術
ENTAIN PLC	58.23	70	12,485	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	453.96	67	11,960	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	68.57	37	6,741	金融
M&G PLC	259.64	52	9,325	金融
ENDEAVOUR MINING PLC	23.57	48	8,595	素材
RELX PLC	239.73	618	109,920	資本財・サービス
DIAGEO PLC	274.59	926	164,724	生活必需品
RIO TINTO PLC	132.68	708	125,869	素材
STANDARD CHARTERED PLC	274.61	183	32,698	金融
TESCO PLC	872.12	230	40,918	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	92.37	115	20,503	ヘルスケア
GLENCORE PLC	1,182.88	556	98,877	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	27	4,802	金融
SMITHS GROUP PLC	40.8	69	12,341	資本財・サービス
PEARSON PLC	82.71	68	12,091	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	176.31	48	8,538	生活必需品
NEXT PLC	14.56	93	16,695	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	578.08	63	11,336	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	24.65	83	14,894	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	37.03	115	20,440	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	3,386.29	246	43,835	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	14.08	77	13,827	素材
KINGFISHER PLC	247.03	58	10,457	一般消費財・サービス
WPP PLC	130.21	113	20,243	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	85	15,222	公益事業
SEVERN TRENT PLC	26.81	72	12,883	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	303.37	194	34,613	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	89.36	527	93,793	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	88.44	101	18,051	金融
SCHRODERS PLC	72.17	33	5,871	金融
SSE PLC	136.72	251	44,623	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	55	9,928	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	188.89	2,174	386,385	ヘルスケア
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	807.41	192	34,151	金融
3I GROUP PLC	103.64	210	37,408	金融
ASHTREAD GROUP PLC	56.56	309	55,063	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	115.48	100	17,949	情報技術
NATIONAL GRID PLC	458.51	472	84,053	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,515.44	385	68,532	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	119.26	207	36,932	生活必需品
CENTRICA PLC	721.84	84	15,028	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	11.55	45	8,091	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	264.3	679	120,716	生活必需品
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34.83	65	11,634	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	2,416.75	1,476	262,341	金融
ANGLO AMERICAN PLC	145.24	375	66,659	素材
MONDI PLC	52.48	66	11,770	素材
COMPASS GROUP PLC	206.69	450	80,077	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	39.69	46	8,242	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	755.78	103	18,374	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	25.74	60	10,695	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	45.08	101	18,114	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	20.78	115	20,459	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	17.13	75	13,376	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	45.64	395	70,226	金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	20.39	38	6,885	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	35	6,280	金融
ANTOFAGASTA PLC	60.56	94	16,789	素材
ABRDN PLC	277.75	60	10,696	金融
EXPERIAN PLC	114.6	340	60,570	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 >	34,952.66 79銘柄	21,955 <4.2%>	3,901,871
(イスラエル)		百株	千イスラエル・シェケル	千円
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	143.35	270	10,580	金融
AZRIELI GROUP LTD	5.3	114	4,476	不動産
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	12.79	188	7,366	情報技術
ICL GROUP LTD	82.94	170	6,697	素材

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2023年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イスラエル・シケル	千円	
ELBIT SYSTEMS LTD	3	221	8,685	資本財・サービス
BANK HAPOLIM BM	151.6	470	18,442	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	240.49	651	25,543	金融
NICE LTD	7.42	607	23,785	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	18.83	242	9,516	金融
イスラエル・シケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	665.72 9銘柄	2,937 <0.1%>	115,094
	百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)				
DUFREY AG-REG	12.51	50	7,867	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	396.77	733	114,282	金融
ROCHE HOLDING AG-BR	3.24	95	14,933	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.89	63	9,832	素材
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	49	7,781	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	84.41	2,317	361,109	ヘルスケア
SIKA AG-REG	16.7	433	67,578	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	226	35,339	生活必需品
ABB LTD-REG	195.16	691	107,681	資本財・サービス
SWISS RE AG	37.23	329	51,317	金融
NESTLE SA-REG	336.21	3,581	558,039	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2.56	227	35,390	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4.94	98	15,333	資本財・サービス
JULIUS BAER GROUP LTD	26.84	156	24,315	金融
SGS SA-REG	23	195	30,498	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	4.67	89	13,978	資本財・サービス
TEMENOS AG - REG	7.93	60	9,388	情報技術
HELVETIA HOLDING AG-REG	4.71	59	9,217	金融
VAT GROUP AG	3.39	133	20,738	資本財・サービス
BKW AG	2.5	37	5,777	公益事業
ALCON INC	62.3	447	69,700	ヘルスケア
SIG GROUP N AG	34	87	13,573	素材
SWATCH GROUP AG/THE-BR	3.77	99	15,567	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	17.79	758	118,199	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	5.5	77	12,118	金融
CLARIANT AG-REG	25.52	33	5,225	素材
NOVARTIS AG-REG	249.92	2,240	349,158	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.41	71	11,109	生活必需品
BACHEM HOLDING AG-REG B	3.9	33	5,286	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	61.82	909	141,650	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	3.24	178	27,878	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	3.57	34	5,315	金融
GEBERIT AG-REG	4.69	230	35,896	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	1.07	308	48,084	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	16.25	222	34,689	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	6.13	145	22,694	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	17.97	91	14,207	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	8.6	489	76,248	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	22	3,519	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD	67.54	404	62,997	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3.29	177	27,713	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	6.4	166	25,928	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	73	11,519	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.08	89	14,011	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,798.94 44銘柄	17,024 <2.9%>	2,652,697
	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
(デンマーク)				
NOVO NORDISK A/S-B	213.72	23,321	476,217	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	80.02	1,296	26,470	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0.39	485	9,922	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	133.4	2,607	53,243	資本財・サービス
CARLSBERG AS-B	12.06	1,285	26,251	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	24.64	833	17,011	素材
COLOPLAST-B	14	1,185	24,208	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	26.12	3,539	72,271	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	0.98	174	3,570	資本財・サービス
DEMANT A/S	6.14	178	3,646	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.58	731	14,946	資本財・サービス
TRYG A/S	40.74	629	12,861	金融
PANDORA A/S	11.28	659	13,474	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	12.62	642	13,116	素材
GENMAB A/S	8.77	2,337	47,725	ヘルスケア
ORSTED A/S	27.46	1,805	36,862	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	612.92 16銘柄	41,714 <0.9%>	851,802

銘柄	株数	2023年6月15日現在		業種等	
		評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
		百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
(ノルウェー)					
DNB BANK	110.49	2,131	28,048	金融	
NORSK HYDRO ASA	208.13	1,528	20,109	素材	
ORKLA ASA	116.18	893	11,763	生活必需品	
TELENOR ASA	87.46	956	12,585	コミュニケーション・サービス	
EQUINOR ASA	131.75	4,206	55,352	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	21.12	774	10,194	素材	
MOWI ASA	46.77	872	11,478	生活必需品	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	354	4,661	金融	
AKER BP ASA	36.55	951	12,520	エネルギー	
KONGSBERG GRUPPEN ASA	12.03	563	7,415	資本財・サービス	
SALMAR ASA	7.28	340	4,481	生活必需品	
ADEVINTA ASA	33.82	262	3,453	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 >	831.58 12銘柄	13,834	182,066 <0.2%>	
(スウェーデン)		百株	キスウェーデン・クローネ	千円	
SAGAX CLASS B	20.2	466	6,102	不動産	
INVESTOR CLASS A	62.56	1,340	17,541	金融	
VOLVO CAR CLASS B	71.77	320	4,195	一般消費財・サービス	
ERICSSON LM-B SHS	376.89	2,146	28,091	情報技術	
VOLVO AB-B SHS	183.33	4,015	52,567	資本財・サービス	
SKF AB-B SHARES	40	796	10,427	資本財・サービス	
TELE2 AB-B SHS	70.26	649	8,499	コミュニケーション・サービス	
GETINGE AB-B SHS	28.69	710	9,294	ヘルスケア	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	215.49	2,554	33,440	金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	196.35	1,762	23,070	金融	
SWEDBANK AB - A SHARES	108.21	1,897	24,837	金融	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	84.85	1,235	16,171	一般消費財・サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	73.2	1,083	14,185	素材	
SKANSKA AB-B SHS	37.09	556	7,287	資本財・サービス	
SANDVIK AB	154.4	3,299	43,190	資本財・サービス	
INVESTOR AB-B SHS	237.64	5,096	66,709	金融	
ATLAS COPCO AB-A SHS	361.15	5,881	76,986	資本財・サービス	
VOLVO AB-A SHS	43.59	985	12,895	資本財・サービス	
HOLMEN AB-B SHARES	11.14	459	6,013	素材	
SECURITAS AB-B SHS	49.05	414	5,430	資本財・サービス	
TELIA CO AB	290.88	697	9,130	コミュニケーション・サービス	
ALFA LAVAL AB	38.03	1,487	19,474	資本財・サービス	
ATLAS COPCO AB-B SHS	203.29	2,861	37,454	資本財・サービス	
ASSA ABLOY AB-B	134.77	3,505	45,885	資本財・サービス	
SAAB AB-B	8	460	6,033	資本財・サービス	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	26.38	768	10,062	金融	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	64.2	272	3,566	不動産	
INDUTRADE AB	36	950	12,445	資本財・サービス	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	19.11	428	5,613	ヘルスケア	
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	434	5,684	金融	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	20.48	458	6,007	資本財・サービス	
LIFCO AB-B SHS	29.24	683	8,952	資本財・サービス	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	212.51	2,339	30,627	資本財・サービス	
BEIJER REF AB	35	564	7,389	資本財・サービス	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	85.03	2,378	31,131	生活必需品	
EMBRACER GROUP AB	70.9	187	2,458	コミュニケーション・サービス	
BOLIDEN AB	31.71	1,028	13,457	素材	
EPIROC AB-A	99.3	2,016	26,399	資本財・サービス	
EPIROC AB-B	40.15	697	9,123	資本財・サービス	
HUSQVARNA AB-B SHS	54	483	6,332	資本財・サービス	
NORDEA BANK ABP	360.6	4,054	53,074	金融	
EQT AB	33.65	748	9,791	金融	
EVOLUTION AB	24.81	3,494	45,739	一般消費財・サービス	
KINNEVIK AB - B	30.03	459	6,014	金融	
HEXAGON AB-B SHS	277.67	3,647	47,741	情報技術	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12.16	353	4,624	金融	
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,673.24 46銘柄	71,135	931,157 <1.0%>	
ユーロ (アイルランド)		百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	26.93	92	14,054	素材	
AIB GROUP PLC	126.8	49	7,481	金融	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	126.91	119	18,170	金融	
KINGSPAN GROUP PLC	22.72	144	22,040	資本財・サービス	
KERRY GROUP PLC-A	23.68	213	32,469	生活必需品	
CRH PLC	79.19	374	56,954	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	17.53	317	48,342	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	423.76 7銘柄	1,311	199,513 <0.2%>	

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	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オランダ)				
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	100.23	201	30,606	コミュニケーション・サービス
EXOR NV	13	105	16,112	金融
QIAGEN N. V.	25.21	106	16,240	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	134.99	251	38,288	ヘルスケア
NN GROUP NV	38.6	128	19,510	金融
HEINEKEN NV	35.44	332	50,654	生活必需品
AEGON NV	261.33	118	18,091	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	124.07	368	56,027	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.	21.68	157	24,020	素材
WOLTERS KLUWER	35.82	408	62,102	資本財・サービス
ING GROEP NV	406.74	500	76,193	金融
KONINKLIJKE KPN NV	376.07	115	17,646	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV	44.65	3,043	463,112	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA	40.3	56	8,611	金融
IMCD NV	7.15	96	14,724	資本財・サービス
ADYEN NV	2.26	367	55,877	金融
JUST EAT TAKEAWAY	23.81	31	4,758	一般消費財・サービス
PROSUS NV	90.55	613	93,285	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV	14.76	40	6,162	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV	5.55	228	34,718	情報技術
RANDSTAD NV	14.9	71	10,947	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	15.57	123	18,833	生活必需品
OCI NV	11.97	25	3,855	素材
EURONEXT NV	9.29	61	9,300	金融
STMICROELECTRONICS NV	85.7	395	60,189	情報技術
AIRBUS SE	66.36	859	130,772	資本財・サービス
ARGENX SE	7.68	279	42,557	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55.46	71	10,843	生活必需品
CNH INDUSTRIAL NV	141.78	190	28,917	資本財・サービス
STELLANTIS NV	244.3	385	58,602	一般消費財・サービス
FERRARI NV	15.99	449	68,436	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,471.21 31銘柄	10,187 <1.7%>	1,550,000
ユーロ (ベルギー)				
UCB SA	15.5	130	19,795	ヘルスケア
KBC GROUP NV	30.11	191	29,154	金融
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	15.79	115	17,629	金融
SOLVAY SA	11.54	124	18,989	素材
UMICORE	22.7	63	9,646	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	94.78	495	75,449	生活必需品
AGEAS	18.87	72	10,956	金融
D'ETEREN GROUP	2.96	51	7,791	一般消費財・サービス
ELIA GROUP SA/NV	5.02	57	8,768	公益事業
SOFINA	1.46	29	4,558	金融
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	218.73 10銘柄	1,332 <0.2%>	202,738
ユーロ (ルクセンブルグ)				
ARCELORMITTAL	69.75	182	27,788	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	14.8	89	13,560	ヘルスケア
TENARIS SA	39.92	51	7,853	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	124.47 3銘柄	323 <0.1%>	49,202
ユーロ (フランス)				
TOTALENERGIES SE	266.38	1,436	218,495	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	85.84	240	36,530	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	58.07	926	140,994	素材
KERING	8.27	432	65,808	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	59.69	992	150,994	資本財・サービス
BOUYGUES SA	27.21	81	12,469	資本財・サービス
BNP PARIBAS	122.31	703	107,041	金融
THALES SA	12.35	162	24,775	資本財・サービス
DANONE	69.44	374	56,989	生活必需品
CARREFOUR SA	85.63	141	21,490	生活必需品
VIVENDI	89.3	73	11,198	コミュニケーション・サービス
L'OREAL	26.76	1,103	167,828	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	59.11	335	51,029	資本財・サービス
LEGRAND SA	36.29	335	51,107	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA	22.62	460	70,106	生活必需品
EURAZEO SE	4	26	4,041	金融
SOCIETE GENERALE SA	114.36	268	40,915	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	31.03	2,637	401,303	一般消費財・サービス
ACCOR SA	18.5	61	9,432	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	22.23	394	59,951	情報技術
VALEO SA	22.45	47	7,220	一般消費財・サービス

銘柄	2023年6月15日現在			業種等	
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千ユーロ	千円		
PUBLICIS GROUPE	29.18	217	33,093	コミュニケーション・サービス	
BUREAU VERITAS SA	32.27	80	12,279	資本財・サービス	
EFFAGE	9.45	94	14,414	資本財・サービス	
SODEXO SA	10.85	110	16,772	一般消費財・サービス	
IPSEN	6.4	70	10,779	ヘルスケア	
AMUNDI SA	10.05	54	8,364	金融	
TELEPERFORMANCE	7.45	119	18,158	資本財・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3.14	85	13,056	ヘルスケア	
SEB SA	2.16	19	2,905	一般消費財・サービス	
ESSILORLUXOTTICA	32.41	542	82,547	ヘルスケア	
DASSAULT AVIATION SA	2.2	37	5,677	資本財・サービス	
WORLDLINE SA	25.21	89	13,693	金融	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	17	62	9,559	一般消費財・サービス	
AXA SA	205.77	548	83,451	金融	
EDENRED	30.07	185	28,201	金融	
RENAULT SA	28.61	101	15,485	一般消費財・サービス	
HERMES INTERNATIONAL	3.49	688	104,766	一般消費財・サービス	
REMY COINTREAU	2.53	36	5,600	生活必需品	
DASSAULT SYSTEMES SE	92.7	378	57,651	情報技術	
WENDEL	3.31	33	5,021	金融	
ORANGE	269.43	277	42,256	コミュニケーション・サービス	
ALSTOM	36.68	99	15,174	資本財・サービス	
SANOFI	126.78	1,191	181,283	ヘルスケア	
VINCI SA	59.34	645	98,194	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	79.89	232	35,432	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA	146.09	160	24,361	金融	
BIOMERIEUX	4.57	41	6,384	ヘルスケア	
ENGIE	246.86	352	53,695	公益事業	
SAFRAN SA	37.77	522	79,557	資本財・サービス	
ARKEMA	6.5	55	8,406	素材	
ADP	3.5	48	7,359	資本財・サービス	
GETLINK SE	49.73	78	11,867	資本財・サービス	
BOLLORE	143.02	80	12,218	コミュニケーション・サービス	
小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,006.25 54銘柄	18,582	2,827,398 <3.0%>	
ユーロ (ドイツ)		百株	千ユーロ	千円	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	65.57	212	32,383	資本財・サービス	
DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	13.2	154	23,548	一般消費財・サービス	
BAYER AG-REG	109.47	567	86,277	ヘルスケア	
EVONIK INDUSTRIES AG	24.31	44	6,765	素材	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	276.77	274	41,815	金融	
COMMERZBANK AG	148.3	151	22,981	金融	
VOLKSWAGEN AG	3.41	54	8,337	一般消費財・サービス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	19.18	252	38,444	一般消費財・サービス	
SIEMENS AG-REG	85.45	1,404	213,662	資本財・サービス	
E. ON SE	288.8	325	49,543	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	39.13	441	67,216	一般消費財・サービス	
GEA GROUP AG	19.08	75	11,524	資本財・サービス	
CONTINENTAL AG	12.72	91	13,915	一般消費財・サービス	
BASF SE	102.78	481	73,240	素材	
ALLIANZ SE-REG	44.83	940	143,068	金融	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24.37	180	27,512	生活必需品	
RHEINMETALL AG	5.02	123	18,735	資本財・サービス	
RWE AG	86.49	345	52,572	公益事業	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	66.13	62	9,534	資本財・サービス	
BRENNTAG SE	22.59	167	25,482	資本財・サービス	
FRESENIUS SE & CO KGAA	48.35	123	18,810	ヘルスケア	
SAP SE	116.36	1,460	222,151	情報技術	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	15.35	502	76,464	金融	
ZALANDO SE	25.14	66	10,105	一般消費財・サービス	
HEIDELBERG MATERIALS AG	16.41	120	18,361	素材	
COVESTRO AG	30.46	124	18,917	素材	
RATIONAL AG	0.74	47	7,222	資本財・サービス	
SARTORIUS AG-VORZUG	2.79	94	14,441	ヘルスケア	
TALANX AG	8.04	43	6,581	金融	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	17.4	100	15,339	一般消費財・サービス	
DELIVERY HERO SE	26.66	97	14,799	一般消費財・サービス	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	5.6	62	9,491	ヘルスケア	
BECHTLE AG	8.19	31	4,811	情報技術	
NEMETSCHKE SE	7.89	57	8,703	情報技術	
SCOUT24 AG	10.83	63	9,606	コミュニケーション・サービス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	32.3	170	25,918	ヘルスケア	
KNORR-BREMSE AG	9.26	61	9,394	資本財・サービス	
HELLOFRESH SE	18.14	32	4,972	生活必需品	
SIEMENS ENERGY AG	47.32	112	17,063	資本財・サービス	
BEIERSDORF AG	11.47	137	20,845	生活必需品	
MERCK KGAA	17.52	294	44,823	ヘルスケア	
ADIDAS AG	19.21	335	51,061	一般消費財・サービス	
PUMA SE	12.95	66	10,186	一般消費財・サービス	
HENKEL AG & CO KGAA	13.11	86	13,105	生活必需品	

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2023年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	359.05	687	104,571	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	23.41	101	15,404	ヘルスケア
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	99.52	749	114,094	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	141.56	550	83,698	情報技術
HANNOVER RUECK SE	9.39	179	27,323	金融
DEUTSCHE POST AG-REG	109.07	476	72,437	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	20.14	336	51,173	金融
MTU AERO ENGINES AG	7.63	172	26,271	資本財・サービス
WACKER CHEMIE AG	2.32	28	4,290	素材
SYMRISE AG	15.09	139	21,287	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	141.05	36	5,504	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	7.33	75	11,520	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	71.44	135	20,548	不動産
LEG IMMOBILIEN SE	8.69	47	7,290	不動産
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,994.78 58銘柄	14,361 <2.4%>	2,185,160
		百株	千ユーロ	千円
ユーロ (ポルトガル)				
JERONIMO MARTINS	29	71	10,916	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	420.61	194	29,521	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	61.35	65	10,025	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	510.96 3銘柄	331 <0.1%>	50,462
		百株	千ユーロ	千円
ユーロ (スペイン)				
CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV	7.81	24	3,745	公益事業
TELEFONICA SA	674.94	245	37,308	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA	37.6	78	11,967	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	659.05	446	67,945	金融
IBERDROLA SA	680.49	787	119,791	公益事業
REPSOL SA	192.2	260	39,609	エネルギー
GRIFOLS SA	27.95	33	5,024	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	1,850.35	601	91,497	金融
AMADEUS IT GROUP SA	55.29	385	58,583	一般消費財・サービス
NATURGY ENERGY GROUP SA	16.68	44	6,755	公益事業
CAIXABANK SA	624.69	228	34,796	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	29.53	92	14,031	資本財・サービス
AENA SME SA	8.66	128	19,540	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA	68.12	248	37,768	コミュニケーション・サービス
ACCIONA SA	2.91	47	7,177	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	115.47	395	60,102	一般消費財・サービス
ENAGAS SA	32.18	58	8,901	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	66.58	108	16,552	公益事業
FERROVIAL SA	71.27	205	31,273	資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA	30.29	58	8,954	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,252.06 20銘柄	4,478 <0.7%>	681,328
		百株	千ユーロ	千円
ユーロ (イタリア)				
PRYSMIAN SPA	29.49	110	16,803	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	156.78	296	45,155	金融
MEDIOBANCA SPA	74.65	84	12,845	金融
UNICREDIT SPA	213.13	407	62,008	金融
TELECOM ITALIA SPA	1,085.03	27	4,254	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO	1,758.41	413	62,872	金融
POSTE ITALIANE SPA	64.65	65	9,929	金融
MONCLER SPA	24.35	159	24,333	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	12.85	57	8,794	ヘルスケア
ENI SPA	288.95	375	57,091	エネルギー
DIASORIN SPA	2.77	27	4,124	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	33.08	39	5,946	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA	65.11	48	7,326	金融
AMPLIFON SPA	14.4	50	7,718	ヘルスケア
ENEL SPA	954.39	582	88,694	公益事業
SNAM SPA	243	121	18,515	公益事業
TERNA SPA	158.15	126	19,274	公益事業
FINECOBANK SPA	80.77	100	15,318	金融
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,259.96 18銘柄	3,095 <0.5%>	471,008
		百株	千ユーロ	千円
ユーロ (フィンランド)				
UPM-KYMMENE OYJ	75.36	225	34,249	素材
NOKIA OYJ	546.81	212	32,363	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	82.27	90	13,731	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	59.11	73	11,138	素材
ELISA OYJ	22.12	111	17,029	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS	58.26	248	37,814	金融
FORTUM OYJ	44	58	8,830	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	34.7	66	10,131	生活必需品
KONE OYJ-B	45.41	224	34,214	資本財・サービス
NESTE OYJ	49.41	202	30,807	エネルギー

銘柄	株数	2023年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
ORION OYJ-CLASS B METSO CORPORATION	百株 13.15 84.14	千ユーロ 51 93	千円 7,899 14,222	ヘルスケア 資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,114.74 12 銘柄	1,659 <0.3%>	
ユーロ (オーストリア) VERBUND AG OMV AG ERSTE GROUP BANK AG VOESTALPINE AG	百株 8.76 20.56 53.26 13.23	千ユーロ 65 80 171 44	千円 10,016 12,275 26,052 6,771	公益事業 エネルギー 金融 素材
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	95.81 4 銘柄	362 <0.1%>	
ユーロ (その他) DSM FIRMENICH AG	百株 23	千ユーロ 227	千円 34,644	素材
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	23 1 銘柄	227 <0.0%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	21,495.73 221 銘柄	56,253 <9.2%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	136,437.79 1,214 銘柄	— <94.2%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資証券

銘柄	□数	2023年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.805	343	48,187
SIMON PROPERTY GROUP INC	4.043	448	62,946
BOSTON PROPERTIES INC	1.658	89	12,622
SBA COMMUNICATIONS CORP	1.365	313	44,040
EQUITY RESIDENTIAL	4.626	307	43,103
EQUINIX INC	1.097	851	119,476
AMERICAN TOWER CORP	5.614	1,083	152,128
HOST HOTELS & RESORTS INC	7.895	137	19,352
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	4.367	152	21,353
KIMCO REALTY CORP	7.054	136	19,113
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	5.382	105	14,779
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	3	150	21,113
INVITATION HOMES INC	7.588	258	36,262
VICI PROPERTIES INC	10.288	333	46,767
VENTAS INC	5.394	249	35,076
WEYERHAEUSER CO	9.311	284	39,894
CROWN CASTLE INTL CORP	5.407	618	86,847
IRON MOUNTAIN INC	3.16	179	25,162
SUN COMMUNITIES INC	1.355	181	25,448
PROLOGIS INC	11.058	1,352	189,815
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.599	194	27,369
CAMDEN PROPERTY TRUST	1.049	117	16,458
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.704	164	23,066
WELLTOWER INC	5.911	481	67,665
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	7.752	160	22,527
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.236	189	26,618
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2.666	180	25,316
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	5.245	108	15,205
REALTY INCOME CORP	7.086	433	60,862
PUBLIC STORAGE	1.886	535	75,228
REGENCY CENTERS CORP	1.761	107	15,041
UDR INC	4.545	195	27,507
WP CAREY INC	2.562	179	25,148
DIGITAL REALTY TRUST INC	3.672	387	54,381
EXTRA SPACE STORAGE INC	1.486	212	29,899
アメリカ・ドル通貨計	□数、金額 銘柄数 < 比率 >	150.627 35 銘柄	11,224 <1.7%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.831	41	4,369
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.925	18	1,937
カナダ・ドル通貨計	□数、金額 銘柄数 < 比率 >	1.756 2 銘柄	59 <0.0%>

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘 柄		2023年6月15日現在		
		□ 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
		千円	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)				
DEXUS/AU		12,537	98	9,409
LENDLEASE GROUP		6,942	49	4,680
TRANSURBAN GROUP		40,11	572	54,586
APA GROUP		13,286	133	12,721
SCENTRE GROUP		64,017	165	15,812
GPT GROUP		21,774	87	8,347
MIRVAC GROUP		43,513	94	9,046
STOCKLAND		40,622	165	15,767
GOODMAN GROUP		19,586	385	36,779
VICINITY CENTRES		50,371	93	8,935
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	312,758 10 銘柄	1,846	176,088 <0.2%>
(香港)				
LINK REIT		37	1,729	31,014
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		36	324	5,822
香港・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	73 2 銘柄	2,054	36,836 <0.0%>
(シンガポール)				
CAPITALAND ASCENDAS REIT		47.5	126	13,263
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		82,826	163	17,064
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		30	49	5,208
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS		37.6	62	6,527
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	197,926 4 銘柄	402	42,062 <0.0%>
(イギリス)				
LAND SECURITIES GROUP PLC		7,946	47	8,385
SEGRO PLC		17,001	128	22,823
BRITISH LAND CO PLC		9,799	32	5,828
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	34,746 3 銘柄	208	37,037 <0.0%>
ユーロ (ベルギー)				
WAREHOUSES DE PAUW SCA		1,846	48	7,409
国 小 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,846 1 銘柄	48	7,409 <0.0%>
ユーロ (フランス)				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		1,507	70	10,746
GECINA SA		0,578	56	8,618
KLEPIERRE		2,394	53	8,126
COVIVIO		0,353	16	2,483
国 小 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	4,832 4 銘柄	197	29,975 <0.0%>
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	6,678 5 銘柄	245	37,384 <0.0%>
合 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	777,491 61 銘柄	—	1,911,507 <2.1%>

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘 柄 別		2023年6月15日現在	
		買 建 額	売 建 額
		百万円	百万円
外	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	3,194	—
	S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	203	—
	SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	50	—
	FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	162	—
国	SWISS MKT IX FUTR (ドイツ)	105	—
	EURO STOXX 50 (ドイツ)	670	—

(注1) 外貨建の評価額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

運用報告書 第15期 (決算日 2023年1月10日)

(作成対象期間 2022年1月12日~2023年1月10日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

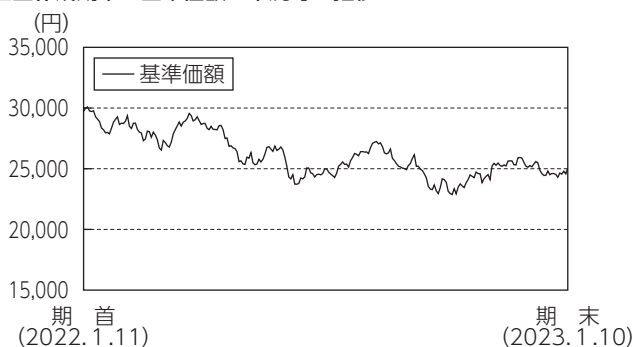
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式 (上場予定および店頭登録予定を含みます。)
株式組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース) (※配当なし)		株組比	式入率	株先比	式物率	投資証券組入比率
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率					
(期首)2022年1月11日	29,723	-	21,997	-	94.4	3.3	2.4		
1月末	28,346	△4.6	20,971	△4.7	93.0	4.4	2.3		
2月末	28,101	△5.5	20,755	△5.6	92.5	5.4	2.3		
3月末	29,379	△1.2	21,655	△1.6	96.8	6.6	2.5		
4月末	26,891	△9.5	19,803	△10.0	95.8	6.9	2.7		
5月末	26,817	△9.8	19,686	△10.5	88.9	8.1	2.3		
6月末	24,586	△17.3	18,017	△18.1	92.2	11.5	2.5		
7月末	25,929	△12.8	18,984	△13.7	87.9	8.8	2.4		
8月末	25,421	△14.5	18,579	△15.5	93.5	7.4	2.5		
9月末	23,180	△22.0	16,916	△23.1	91.8	10.1	2.3		
10月末	24,723	△16.8	18,019	△18.1	91.3	9.2	2.2		
11月末	25,306	△14.9	18,419	△16.3	87.7	4.8	2.2		
12月末	24,647	△17.1	17,912	△18.6	88.4	5.3	2.2		
(期末)2023年1月10日	25,080	△15.6	18,224	△17.2	91.2	6.9	2.2		

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：29,723円 期末：25,080円 騰落率：△15.6%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行った結果、米国の金融引き締めに対する懸念が高まり海外株式市況が下落したことから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○先進国株式市況

先進国株式市況は下落しました。

先進国株式市況は、当作成期首より、2021年12月のFOMC(米国連邦公開市場委員会)議事録を受け、米国の金融引き締めに対する懸念が高まり、下落しました。2022年2月以降は、欧米中央銀行高官の金融政策に対する発言や、ロシアのウクライナへの侵攻などから一進一退の展開となりました。4月に入るとFRB(米国連邦準備制度理事会)高官から利上げペースを加速させるとの発言が相次いだことや、米国の一部主要銘柄が市場予想を下回る決算を発表したことなどから下落しました。6月には、FOMCにおいて0.75%ポイントの大幅利上げが行われるとの観測が高まったことで、金融引き締めによる欧米景気への悪影響が懸念されて下落しました。7月中旬には米国の利上げペース鈍化の可能性が意識されて上昇しましたが、8月以降はFRB議長講演において利上げ継続姿勢が強調されたことへの懸念から下落しました。10月以降は、英国政府が減税策の一部撤回を表明したことやFRBが今後利上げ幅を縮小させるのではないかと期待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△17.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△15.6%となりました。

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

*ベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)(※配当なし)です。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式)	3円 (2)
(先物・オプション)	(1)
(投資証券)	(0)
有価証券取引税 (株式)	2 (2)
(投資証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	6 (6)
(その他)	(1)
合計	11

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株 式

(2022年1月12日から2023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 7,491.58 (2,751.3)	千アメリカ・ドル 79,026 (△ 1,183)	百株 8,857.83	千アメリカ・ドル 91,825
	カナダ	百株 959.03 (200.34)	千カナダ・ドル 5,597 ()	百株 1,087.71	千カナダ・ドル 5,938
	オーストラリア	百株 1,932.4 (326.84)	千オーストラリア・ドル 3,538 (1,026)	百株 2,124.16	千オーストラリア・ドル 3,930
	香港	百株 1,780 ()	千香港ドル 8,715 ()	百株 3,220	千香港ドル 8,939
	シンガポール	百株 2,012 ()	千シンガポール・ドル 512 (△ 0)	百株 1,330	千シンガポール・ドル 495
	ニュージーランド	百株 296.87 ()	千ニュージーランド・ドル 158 ()	百株 202.07	千ニュージーランド・ドル 158
	イギリス	百株 5,288.88 (76.49)	千イギリス・ポンド 3,842 (△ 690)	百株 7,552.74	千イギリス・ポンド 4,945
	イスラエル	百株 394.92 ()	千イスラエル・シケル 781 ()	百株 97.32	千イスラエル・シケル 390
	スイス	百株 535.08 (295.29)	千スイス・フラン 3,248 (△ 35)	百株 707	千スイス・フラン 3,802
	デンマーク	百株 130.13 ()	千デンマーク・クローネ 7,453 ()	百株 181.9	千デンマーク・クローネ 8,846
ノルウェー	百株 162.63 ()	千ノルウェー・クローネ 3,075 ()	百株 127.91	千ノルウェー・クローネ 2,167	
スウェーデン	百株 1,019.86 (763.5)	千スウェーデン・クローネ 14,887 (△ 696)	百株 1,550.2	千スウェーデン・クローネ 15,706	
ユーロ (アイルランド)	百株 285.14 ()	千ユーロ 308 ()	百株 37.93	千ユーロ 162	
ユーロ (オランダ)	百株 354.41 ()	千ユーロ 1,642 ()	百株 351.42	千ユーロ 1,769	
ユーロ (ベルギー)	百株 42.28 (4.32)	千ユーロ 281 ()	百株 70.38	千ユーロ 325	
ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 22.46 ()	千ユーロ 66 ()	百株 121.36	千ユーロ 138	
ユーロ (フランス)	百株 497.12 (142.88)	千ユーロ 3,232 (△ 6)	百株 690.9	千ユーロ 3,843	
ユーロ (ドイツ)	百株 789.94 ()	千ユーロ 2,494 (△ 30)	百株 767	千ユーロ 2,892	
ユーロ (ポルトガル)	百株 — ()	千ユーロ — ()	百株 52.4	千ユーロ 30	
ユーロ (スペイン)	百株 1,032.1 (2,086.29)	千ユーロ 898 ()	百株 3,498.19	千ユーロ 1,059	
ユーロ (イタリア)	百株 657.77 ()	千ユーロ 383 (△ 0)	百株 780.16	千ユーロ 616	
ユーロ (フィンランド)	百株 133.64 ()	千ユーロ 196 ()	百株 124.15	千ユーロ 256	
ユーロ (オーストリア)	百株 33.36 ()	千ユーロ 126 ()	百株 25.69	千ユーロ 89	
ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 3,848.22 (2,233.49)	千ユーロ 9,631 ()	百株 6,519.58	千ユーロ 11,183	

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

(2) 投資証券

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

	買 付		売 付		
	口 数	金 額	口 数	金 額	
外	アメリカ	千口 57.734 (△17.868)	千アメリカ・ドル 3,011 ()	千口 41.214 ()	千アメリカ・ドル 2,466 ()
	カナダ	千口 2.261 ()	千カナダ・ドル 46 ()	千口 3.505 ()	千カナダ・ドル 91 ()
	オーストラリア	千口 58.584 (△18.747)	千オーストラリア・ドル 427 (△ 162)	千口 63.286 ()	千オーストラリア・ドル 376 ()
	香港	千口 20 ()	千香港ドル 216 ()	千口 38 ()	千香港ドル 400 ()
	シンガポール	千口 17 (0.827)	千シンガポール・ドル 51 (△ 1)	千口 16.827 ()	千シンガポール・ドル 27 ()
	イギリス	千口 9.707 ()	千イギリス・ポンド 85 ()	千口 13.122 ()	千イギリス・ポンド 98 ()
	ユーロ (ベルギー)	千口 2.198 ()	千ユーロ 75 ()	千口 0.352 ()	千ユーロ 10 ()
	ユーロ (フランス)	千口 — ()	千ユーロ — (△ 4)	千口 0.244 ()	千ユーロ 16 ()
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千口 2.198 ()	千ユーロ 75 (△ 4)	千口 0.596 ()	千ユーロ 27 ()

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2022年1月12日から2023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 54,159	百万円 51,711	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

(2022年1月12日から2023年1月10日まで)

銘 柄	当 期			銘 柄	当 期		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
APPLE INC (アメリカ)	33,144	667,982	20,153	APPLE INC (アメリカ)	44,501	903,553	20,304
MICROSOFT CORP (アメリカ)	15.4	538,732	34,982	MICROSOFT CORP (アメリカ)	18.7	668,367	35,741
AMAZON.COM INC (アメリカ)	15,287	328,462	21,486	AMAZON.COM INC (アメリカ)	13,917	395,759	28,437
TESLA INC (アメリカ)	4,398	234,308	53,276	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	3,641	258,356	70,957
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	10,21	207,113	20,285	TESLA INC (アメリカ)	2,994	256,470	85,661
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	7,41	136,349	18,400	ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	3,213	220,895	68,750
UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)	1,858	131,123	70,572	UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)	2,43	159,770	65,749
NVIDIA CORP (アメリカ)	5,457	129,185	23,673	NVIDIA CORP (アメリカ)	6,377	159,003	24,933
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	5,142	121,072	23,545	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	3.8	154,284	40,601
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	2.9	120,966	41,712	META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)	6,257	151,510	24,214

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	12.95	12.28	170	22,450	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	12.2	35.55	480	63,315	情報技術
FIRST SOLAR INC	-	11	175	23,085	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	22.71	22.16	391	51,601	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS INC	15.94	15.94	154	20,317	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7.46	7.46	113	15,028	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	72.38	56.06	181	23,867	金融
ABBOTT LABORATORIES	212.42	203.51	2,282	300,929	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	39.5	39.5	158	20,873	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	19.43	19.87	361	47,694	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	47.29	38.8	204	27,001	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	69.05	70.88	560	73,941	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	4.43	4.74	181	23,965	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	74.82	72.42	506	66,840	情報技術
QORVO INC	12.83	11.47	109	14,398	情報技術
AFLAC INC	84.71	66.22	473	62,383	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	18.7	13.57	200	26,498	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	18.35	18.35	132	17,482	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	57.19	55.23	1,888	249,032	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	28.72	27.24	234	30,887	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	14.07	14.42	430	56,783	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	20.68	17.24	169	22,328	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	26.02	25.23	786	103,679	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	83.91	78.53	1,654	218,131	資本財・サービス
WVR BERKLEY CORP	17.71	23.12	168	22,247	金融
AUTOZONE INC	2.61	2.32	566	74,691	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	25.66	27.8	400	52,771	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	123.65	123.65	134	17,754	ヘルスケア
CELANESE CORP	12.97	12.11	141	18,649	素材
DR HORTON INC	43.97	42.53	394	52,021	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	24.5	80	10,656	ヘルスケア
AUTODESK INC	26.84	26.02	500	66,031	情報技術
MOODY'S CORP	20.35	18.7	543	71,697	金融
DEVON ENERGY CORP	77.48	75.99	472	62,319	エネルギー
ALBEMARLE CORP	14.27	14.89	333	43,976	素材
ATMOS ENERGY CORP	16.54	14.65	166	21,979	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	36.14	26.92	149	19,677	公益事業
CITIGROUP INC	248.66	224.18	1,065	140,519	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	51.05	47.45	1,136	149,844	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	59.18	62.88	615	81,207	公益事業
ALLEGHENY CORP	1.46	-	-	-	金融
DOMINO'S PIZZA INC	5.26	4.07	135	17,916	一般消費財・サービス
HESS CORP	38.07	33.73	486	64,138	エネルギー
DAVITA INC	10	6.09	47	6,320	ヘルスケア
DANAHER CORP	76.75	80.81	2,061	271,750	ヘルスケア
FORTIVE CORP	43.35	43.39	285	37,649	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	66.22	64.86	682	89,999	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	65.8	67.06	572	75,482	生活必需品
BUNGE LTD	18.38	16.93	165	21,884	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	40.02	38.99	473	62,414	情報技術
APPLE INC	1,997.15	1,883.58	24,514	3,232,275	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	37.57	35.15	365	48,143	金融
BOEING CO/THE	66.98	65.35	1,363	179,712	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20.63	16.11	175	23,086	金融
BECTON DICKINSON AND CO	34.85	32.89	830	109,476	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT ADR	20	-	-	-	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	14	14	140	18,519	資本財・サービス
NISOURCE INC	40.26	41.11	114	15,111	公益事業
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	17.08	14.04	131	17,282	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	99.78	95.21	458	60,432	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	493.71	487.47	2,016	265,897	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	159.59	150.59	4,751	626,494	金融
ANSYS INC	10.38	9.56	237	31,258	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	160.8	154.57	707	93,340	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	86.15	88.62	714	94,154	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	272.84	249.11	1,768	233,233	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	359.51	341.4	4,689	618,351	金融
T. ROWE PRICE GROUP INC	26.58	28.55	327	43,233	金融
LKQ CORP	33	29.16	162	21,365	一般消費財・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	36.65	33.84	218	28,863	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	33.59	32.99	547	72,170	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	13.48	13.37	429	56,625	金融
DOLLAR GENERAL CORP	28.25	26.86	647	85,367	一般消費財・サービス
SERVENOW INC	24.19	24.64	932	122,985	情報技術
CATERPILLAR INC	65.72	62.56	1,542	203,425	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	28.86	34.67	203	26,897	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	24.78	25.58	124	16,428	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	6.4	5.74	130	17,236	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	33.84	39.28	255	33,658	公益事業
MOSAIC CO/THE	52.09	38.41	181	23,903	素材
DELTA AIR LINES INC	16.5	20.19	74	9,788	資本財・サービス
CORNING INC	99.83	101.7	360	47,495	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	505.01	477.48	2,319	305,838	情報技術
MORGAN STANLEY	170.09	147.7	1,294	170,672	金融
ZILLOW GROUP INC - A	10.16	-	-	-	不動産
MSCI INC	10.06	9.69	465	61,395	金融
FAIR ISAAC CORP	3.98	2.99	177	23,412	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	4.5	4.7	115	15,193	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	27.8	29.98	163	21,566	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BROADCOM INC	48.79	47.15	2,720	358,636	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14.16	16.05	352	46,496	ヘルスケア
ARAMARK	31.73	28.58	124	16,463	一般消費財・サービス
DTE ENERGY COMPANY	22.81	20.31	244	32,257	公益事業
CENTENE CORP	68.44	68.47	531	70,046	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	13.58	11.19	136	18,026	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	55.32	65.65	269	35,575	金融
DARLING INGREDIENTS INC	-	19	121	15,990	生活必需品
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24.75	23.91	458	60,452	金融
GARTNER INC	10.48	8.69	286	37,713	情報技術
SPLUNK INC	20.29	19.21	167	22,035	情報技術
DOMINION ENERGY INC	97.4	99.15	610	80,516	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	47.68	47.72	482	63,642	生活必需品
SMITH (A.O.) CORP	14	14	86	11,350	資本財・サービス
DEERE & CO	36.23	34.17	1,463	192,917	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC	-	15.39	213	28,132	資本財・サービス
POOL CORP	4.38	4.38	139	18,353	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	35.67	35.12	373	49,297	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	23.35	28.61	355	46,877	情報技術
CABLE ONE INC	0.6	-	-	-	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	7.66	7.66	169	22,351	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	14.27	36.72	229	30,312	金融
VAIL RESORTS INC	5.53	4.48	113	14,899	一般消費財・サービス
AMC ENTERTAINMENT HLD-CL A	63.6	-	-	-	コミュニケーション・サービス
TARGA RESOURCES CORP	-	24.31	182	24,013	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	8.74	122	16,129	金融
WESTLAKE CORP	-	4.24	46	6,101	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	37.8	43.19	422	55,647	公益事業
COGNEX CORP	24.39	19.94	103	13,679	情報技術
WEBSTER FINANCIAL CORP	-	22	104	13,734	金融
TELEFLEX INC	5.63	5.02	129	17,020	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	9.79	8.61	152	20,166	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8.52	7.97	191	25,296	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	3	2.41	102	13,536	ヘルスケア
CATALENT INC	20	18.63	89	11,834	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17.57	17.36	279	36,869	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	8	6.1	180	23,839	ヘルスケア
CARLISLE COS INC	-	6	142	18,799	資本財・サービス
IDEX CORP	9.53	8.01	187	24,698	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	97.15	92.44	727	95,957	生活必需品
ROLLINS INC	26.85	23.37	85	11,256	資本財・サービス
AMETEK INC	25.97	28.47	405	53,491	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	30.47	32.72	269	35,483	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	16.44	25.64	143	18,918	資本財・サービス
HEICO CORP	5.35	5.35	83	10,985	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	7.16	6.84	71	9,446	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	4.8	3.99	161	21,286	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	34.22	27.6	252	33,239	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	5.09	4.67	148	19,641	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	52.6	51.38	2,459	324,326	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	11.28	-	-	-	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	7.49	6.24	202	26,737	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	17.5	14.57	126	16,715	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3.53	3.32	480	63,329	一般消費財・サービス
UGI CORP	20.85	29.07	116	15,312	公益事業
CUMMINS INC	17.63	15.22	371	49,023	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	93.22	90.49	698	92,132	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	17.92	14.26	262	34,587	情報技術
SIGNATURE BANK	8	6.92	80	10,564	金融
COSTAR GROUP INC	49.2	49.57	382	50,377	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	6.9	8.5	212	27,954	金融
U HAUL HOLDING	0.7	-	-	-	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	12.39	11.4	349	46,050	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	5.56	5.51	494	65,188	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	7.78	138	18,279	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	34.77	33.86	437	57,627	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	2.5	-	-	-	情報技術
DEXCOM INC	11.88	44.56	490	64,662	ヘルスケア
NORDSON CORP	7.5	5.47	131	17,398	資本財・サービス
COPART INC	24.95	52.7	329	43,386	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	22	21.5	304	40,109	エネルギー
SEAGEN INC	15.45	17.45	222	29,355	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	9.09	10.3	234	30,918	ヘルスケア
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	-	9.04	201	26,520	金融
TRANSIGM GROUP INC	6.37	6.44	419	55,262	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	5.07	17.2	144	19,036	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	12.03	10.79	116	15,363	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	24.57	29.45	333	43,920	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	278.51	220.51	412	54,397	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	32.61	27.8	694	91,558	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4.2	4.2	134	17,670	金融
COTERRA ENERGY INC	95	86.37	214	28,230	

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	
FRANKLIN RESOURCES INC	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	金融
CSX CORP	272.23	250.87	38.51	12,679	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11.66	10.01	33.73	106,310	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	15.63	15.63	806	32,130	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	55.05	1,073.28	146	19,324	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	73.71	74.53	9,376	1,236,248	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	515.19	484.49	5,255	75,027	エネルギー
AES CORP	83.41	70.37	692,906	25,283	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	5.71	5.86	206	27,250	金融
EOG RESOURCES INC	72.38	66.87	854	112,634	エネルギー
EQT CORP	-	38.28	132	17,498	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	19.14	16.76	145	19,198	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1	1.34	105	13,929	金融
ABIOMED INC	5.55	-	-	-	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	19.89	19.76	325	42,980	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	36.83	35.92	529	69,842	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	475.97	437.56	555	73,211	一般消費財・サービス
NOVAVAX INC	9.75	-	-	-	ヘルスケア
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	15.21	-	-	-	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	22.19	19.59	115	15,192	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	24.16	50	6,654	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	3.24	-	-	-	コミュニケーション・サービス
ENTEGRIS INC	17	18.93	140	18,502	情報技術
DISCOVERY INC-C	45.54	-	-	-	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	-	17	105	13,883	資本財・サービス
FORTINET INC	15.95	83.51	412	54,404	情報技術
MARKEL CORP	1.77	1.7	231	30,555	金融
NEXTERA ENERGY INC	233.99	228.48	1,920	253,261	公益事業
MASIMO CORP	6.93	6.23	96	12,702	ヘルスケア
FREEMONT-MCMORAN INC	182.97	177.14	758	100,033	素材
INSULET CORP	7.69	9.68	286	37,813	ヘルスケア
US BANCORP	171.43	164.78	768	101,266	金融
UNITED RENTALS INC	9.18	8.49	319	42,089	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	6.59	6.59	94	12,459	情報技術
FASTENAL CO	67.16	71.58	343	45,254	資本財・サービス
FISERV INC	72.06	72.08	735	97,004	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	132.27	130.95	951	125,470	資本財・サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP	-	5	93	12,285	情報技術
GENERAL MOTORS CO	154.98	162.65	584	77,031	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	13.05	-	-	-	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	28.75	27.76	680	89,750	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	40.78	40.03	1,413	186,311	金融
FIRST HORIZON CORP	-	64	156	20,657	金融
ALPHABET INC-CL A	36.31	703.73	6,194	816,709	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	34.69	647.04	5,745	757,572	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	17.63	10.83	97	12,864	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	78.49	68.57	580	76,558	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	58.4	72.24	306	40,385	公益事業
GENUINE PARTS CO	17.7	15.39	262	34,579	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	44.17	-	-	-	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	81	72.3	247	32,621	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	24.78	23.3	468	61,770	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	102.3	106.52	430	56,796	エネルギー
REPLIGN CORP	-	6	95	12,572	ヘルスケア
HOME DEPOT INC	128.45	119.54	3,799	500,911	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	8.4	5.32	66	8,775	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	190.88	153.52	221	29,168	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5	4.31	95	12,590	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	17.25	16.64	375	49,450	生活必需品
HUMANA INC	15.69	14.61	703	92,793	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	33.62	31.34	504	66,515	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9.17	-	-	-	情報技術
HENRY SCHEIN INC	18.7	14.91	120	15,831	ヘルスケア
HP INC	153.38	128.71	368	48,603	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	141.15	141.15	239	31,563	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	13.95	6.81	27	3,624	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	27.62	22.62	144	19,019	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20.28	20.28	82	10,829	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	50.11	42.74	267	35,316	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	83.9	90.63	382	50,427	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	15.58	15.07	343	45,291	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	107.57	106.13	1,523	200,872	情報技術
HUBBELL INC	-	6	138	18,304	資本財・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	34.57	127	16,869	素材
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	15	15	91	12,099	資本財・サービス
ZOETIS INC	56.48	54.41	800	105,500	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	29.08	28.49	507	66,894	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	29.38	28.18	404	53,314	エネルギー
ALLEGION PLC	11.1	9.42	105	13,944	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-C	51.08	29.12	62	8,251	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	34.31	30.14	398	52,531	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	49.12	35.3	112	14,814	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	13.93	12.25	196	25,895	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	317.89	305.02	5,355	706,128	ヘルスケア
PLUG POWER INC	62.51	62.51	88	11,720	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	
ABBVIE INC	211.65	205.39	3,320	437,786	ヘルスケア
HOLOGIC INC	30.42	26.13	208	27,489	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	39.87	38.06	521	68,759	生活必需品
KROGER CO	86.74	85.32	394	51,961	生活必需品
KLA CORP	18.3	17.24	703	92,817	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	29.82	28.18	1,293	170,539	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	9.76	8.4	160	21,120	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	28.72	28.72	129	17,040	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	84.7	71.24	1,420	187,333	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	97.69	94.32	3,299	435,051	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	17.56	16.03	725	95,623	情報技術
LOEWES CORP	28.73	22.28	131	17,323	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	26.43	17.41	53	7,035	金融
MCDONALD'S CORP	90.35	85.62	2,288	301,698	一般消費財・サービス
3M CO	69.54	64.79	821	108,311	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	287.43	267.54	3,463	456,707	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	29.23	39.14	1,371	180,796	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7.67	7.55	260	34,356	素材
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	5.75	5.75	163	21,541	情報技術
ALCOA CORP	-	20.93	105	13,872	素材
PHILLIPS 66	51.07	56.46	575	75,938	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	56.59	38.67	145	19,191	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	29.92	26.63	225	29,707	生活必需品
METLIFE INC	90.65	75.75	540	71,251	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	104.85	102.39	378	49,842	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	23.72	30.3	348	45,891	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	20.48	20.12	524	69,135	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.84	2.82	410	54,151	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	84.46	125.17	382	50,402	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	14.6	14.8	398	52,558	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	303.2	294.86	3,254	429,127	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	66.57	55.61	408	53,876	素材
MASCO CORP	35.43	25.41	127	16,872	資本財・サービス
M & T BANK CORP	13.71	22.56	335	44,186	金融
MARSH & MCLENNAN COS	60.48	56.9	969	127,831	金融
BLACK KNIGHT INC	16.44	16.44	100	13,252	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	10.18	7.54	91	12,047	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	33.61	33.13	505	66,628	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	23.03	24.48	398	52,588	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	8.8	-	-	-	一般消費財・サービス
BLOCK INC CLASS A	46.73	63.04	435	57,401	情報技術
TRANSUNION	22.93	25.57	160	21,179	資本財・サービス
VISTRA CORP	42.85	40.57	91	12,051	公益事業
NOVOCURE LTD	10.54	10.54	96	12,681	ヘルスケア
NETAPP INC	27.03	23.7	151	19,936	情報技術
NIKE INC -CL B	152.54	148.48	1,853	244,419	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	29.93	27.42	697	91,912	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	66.46	65.76	485	63,987	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	26.23	20.12	222	29,358	金融
ALLY FINANCIAL INC	50.94	37.09	97	12,812	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	18.35	17.05	844	111,370	資本財・サービス
APTIV PLC	32.32	31.76	311	41,029	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	92.52	96.04	501	66,125	素材
MCKESSON CORP	18.5	17.07	652	85,966	ヘルスケア
XYLEM INC	19.72	19.72	220	29,066	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	187.91	179.67	1,838	242,343	生活必需品
NUCOR CORP	36.92	31.83	449	59,204	素材
SUNRUN INC	15	-	-	-	資本財・サービス
WESTERN UNION CO	43.5	43.5	62	8,207	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	19.3	19.3	143	18,907	情報技術
NEWELL BRANDS INC	40.58	40.58	58	7,774	一般消費財・サービス
EVERGY INC	26.54	23.17	148	19,637	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	102.38	113.24	725	95,675	エネルギー
ERIC INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	2.69	68	9,037	金融
OKTA INC	16.34	19.95	137	18,155	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	8.8	-	-	-	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	18.78	20.88	174	22,993	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	48.77	48.77	62	8,192	ヘルスケア
LINDE PLC	57.29	52.85	1,701	224,322	素材
WIX.COM LTD	7.85	7.85	60	7,976	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	61.84	42.93	127	16,777	金融
KKR & CO INC	64.89	68.86	341	45,069	金融
PAYCHEX INC	36.57	39.74	466	61,519	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8.38	7.63	632	83,369	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	220.86	207.58	954	125,844	生活必需品
P G & E CORP	155.15	164.82	263	34,683	公益事業
PFIZER INC	669.99	653.42	3,161	416,896	ヘルスケア
CIGNA CORP	40.86	35.53	1,076	141,963	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	32.76	32.76	138	18,262	情報技術
XCEL ENERGY INC	65.28	65.41	470	62,077	公益事業
STERIS PLC	13.29	10.54	201	26,522	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	17	41	217	28,672	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	15.3	15.3	44	5,930	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	41.92	34.95	109	14,409	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	40.86	38.84	1,013	133,659	ヘルスケア
LYFT INC-A	36.49	-	-	-	資本財・サービス
DOW INC	87.18	87.6	484	63,848	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	15.08	11.3	77	10,167	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	27.23	27.51	192	25,41	

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	
PARKER HANNIFIN CORP	15.38	15.55	481	63,459	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	151.86	178.23	488	64,388	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	30.37	27.01	621	81,966	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	291.25	276.49	4,203	554,264	生活必需品
EXELON CORP	118.82	110.97	489	64,597	公益事業
TELEDAC HEALTH INC	19.85	-	-	-	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	49.86	51.87	289	38,148	資本財・サービス
NVR INC	0.45	0.33	157	20,724	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	167.66	149.02	1,748	230,592	エネルギー
TWILIO INC - A	20.53	20.53	103	13,664	情報技術
DOCUSIGN INC	25.65	23.33	131	17,382	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	6.01	5.5	160	21,217	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	14.7	14.7	92	12,187	情報技術
PEPSICO INC	167.68	159.1	2,853	376,186	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4.09	4.09	48	6,425	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	54.14	29.5	65	8,693	情報技術
MROGGOB INC	7.12	8.21	146	19,275	情報技術
SNAP INC - A	116.75	129.1	118	15,660	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	85.3	86.53	528	69,720	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	49.01	40.84	401	52,910	金融
AMCOR PLC	174.57	152.31	185	24,500	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	23.36	24.06	232	30,635	情報技術
ROKU INC	15.56	14.17	64	8,442	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20.92	22.9	362	47,838	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	75.59	74.3	2,033	268,177	情報技術
10X GENOMICS INC-CLASS A	8.18	-	-	-	ヘルスケア
KORNIT DIGITAL LTD	6	-	-	-	資本財・サービス
PENTAIR PLC	15.75	13.48	64	8,440	資本財・サービス
QUALCOMM INC	135.24	131.16	1,503	198,200	情報技術
INVESCO LTD	37	37	71	9,400	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	8.19	6.64	101	13,330	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31.93	28.95	251	33,158	金融
DATADOG INC - CLASS A	25.36	34.87	229	30,316	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	77.35	67.63	168	22,185	コミュニケーション・サービス
INMODE LTD	6	-	-	-	ヘルスケア
AVALARA INC	12.57	-	-	-	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	12.61	12.2	830	109,461	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	26.67	27.89	356	46,970	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	5.01	4.67	1,031	135,980	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	41.1	42.54	505	66,594	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	9.98	9.98	132	17,432	素材
RESMED INC	16.6	17.97	376	49,682	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	15.58	13.27	202	26,757	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	14.99	12.09	91	12,020	資本財・サービス
MODERNA INC	42.39	39.31	723	95,341	ヘルスケア
HUBSPOT INC	5.64	5.18	148	19,574	情報技術
PERKINELMER INC	11.63	17.35	232	30,628	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	97.33	103.3	449	59,247	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	48.66	52.62	428	56,523	資本財・サービス
BILL.COM HOLDINGS INC	9	11.59	116	15,341	情報技術
AVANTOR INC	66.86	97.8	202	26,640	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	14.76	27.73	89	11,864	金融
DYNATRACE INC	23.39	23.39	86	11,376	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	54	51.91	228	30,108	コミュニケーション・サービス
FIVERR INTERNATIONAL LTD	4	-	-	-	一般消費財・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	108.25	99.16	219	28,881	金融
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	28	29.96	77	10,262	コミュニケーション・サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	41.76	41.76	163	21,583	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	10.21	-	-	-	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	31.62	30.49	133	17,636	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	231.9	216.17	3,786	499,298	エネルギー
PELTON INTERACTIVE INC-A	31.74	-	-	-	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	10.89	9.85	103	13,604	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	49.85	44.6	302	39,863	公益事業
ETSY INC	16.62	14.09	170	22,477	一般消費財・サービス
TESLA INC	101.86	311.56	3,731	492,005	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	24.54	29.65	398	52,553	情報技術
GEN DIGITAL INC	79.44	62.72	134	17,771	情報技術
DRAFTKINGS INC - CL A	41.34	-	-	-	一般消費財・サービス
UNITY SOFTWARE INC	7.52	22.39	65	8,629	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	18.95	17.45	143	18,903	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	17.76	17.14	558	73,661	情報技術
CARVANA CO	9.64	-	-	-	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	8.56	8.56	34	4,529	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	29.34	29.25	118	15,580	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	15.9	14.13	518	68,407	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	137.45	126.23	151	19,988	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	9.49	34.38	165	21,781	一般消費財・サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	-	39.7	122	16,106	コミュニケーション・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	29.31	47.55	424	55,948	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	38.49	33.79	276	36,425	不動産
TWITTER INC	95.99	-	-	-	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	125.64	126.76	906	119,500	公益事業
SYSCO CORP	61.6	56.63	448	59,135	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	29.58	28.26	534	70,467	金融

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6	6	26	3,532	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	19.25	10.11	61	8,167	金融
STEEL DYNAMICS INC	23	21.56	218	28,819	素材
SCHLUMBERGER LTD	178.99	162.24	902	119,021	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	17.49	76	10,061	資本財・サービス
AFFIRM HOLDINGS INC	11	20.35	19	2,530	情報技術
AT&T INC	855.56	837.16	1,593	210,162	コミュニケーション・サービス
APA CORP	-	36.32	157	20,768	エネルギー
SOUTHWEST AIRLINES CO	17.58	10.08	35	4,732	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	55.54	49.63	320	42,305	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	25.95	23.88	103	13,696	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	30.57	28.51	672	88,717	素材
SEMPRA ENERGY	38.07	37.08	582	76,820	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	22.64	22.64	82	10,874	情報技術
CLARIVATE PLC	47.21	33.77	32	4,238	資本財・サービス
OAK STREET HEALTH INC	16.54	-	-	-	ヘルスケア
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	197.7	185.93	120	15,934	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	26.06	22.4	123	16,344	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	5	13.35	51	6,736	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC	109.81	106.13	1,875	247,232	情報技術
SALESFORCE.COM INC	116.24	118.93	1,749	230,666	情報技術
ASANA INC CLASS A	8	-	-	-	情報技術
WESTROCK CO	26.18	27.54	100	13,308	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	36.82	50.86	332	43,802	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	83.22	82.84	553	72,940	資本財・サービス
TERADYNE INC	20.96	17.18	160	21,113	情報技術
UNION PACIFIC CORP	80.74	73.49	1,554	204,897	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	-	76.22	206	27,164	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	81.28	57.69	667	88,051	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	182.23	173.5	1,728	227,844	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	87.73	85.64	1,555	205,157	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	24.35	22.88	477	62,895	ヘルスケア
AMEREN CORPORATION	28.61	26.9	240	31,711	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	114.28	108.56	5,320	701,454	ヘルスケア
TOAST INC CLASS A	-	29	52	6,878	情報技術
VERISIGN INC	13.65	10.8	224	29,654	情報技術
LUCID GROUP INC	51	51	34	4,559	一般消費財・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	22	45.41	75	9,950	一般消費財・サービス
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	23	-	-	-	金融
VALERO ENERGY CORP	45.84	47.23	607	80,070	エネルギー
SOFI TECHNOLOGIES INC	65	-	-	-	金融
UPSTART HOLDINGS INC	2	-	-	-	金融
ULTA BEAUTY INC	6.35	6.68	323	42,695	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	30.08	118	15,650	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9.92	7.67	113	14,977	ヘルスケア
ELEVANCE HEALTH INC	29.98	28.26	1,330	175,390	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	217.61	214.39	2,031	267,889	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	496.46	440.35	1,866	246,116	金融
WASTE MANAGEMENT INC	50.34	49.65	785	103,589	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	145.42	146.97	479	63,230	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	13.93	11.9	258	34,122	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	8.7	6.36	96	12,774	一般消費財・サービス
WALMART INC	184.85	174.41	2,528	333,326	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	24.92	22.26	280	36,995	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	11.45	11.45	108	14,240	一般消費財・サービス
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	-	139	51	6,817	資本財・サービス
WABTEC CORP	18.98	18.98	191	25,252	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	145.67	133.5	1,088	143,473	一般消費財・サービス
WATERS CORP	7.6	6.51	208	27,501	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	6.5	5.71	159	21,026	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	86.95	92.98	337	44,562	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14.52	11.84	301	39,817	金融
WESTERN DIGITAL CORP	35.31	32.64	122	16,177	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	41.89	33.66	325	42,854	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	58.55	53.5	339	44,785	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	202.64	191.15	4,178	550,940	情報技術
PPL CORP	101.94	96.77	291	38,949	公益事業
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	-	41.2	346	45,630	公益事業
PULTEGROUP INC	35.56	25.92	124	16,448	一般消費財・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	-	255.42	296	39,099	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC	28.34	29.29	377	49,768	素材
NORTHERN TRUST CORP	22.6	21.31	200	26,470	金融
FERGUSON PLC	-	25	347	45,850	資本財・サービス
NVIDIA CORP	300.67	291.47	4,555	600,589	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	51.6	48.58	798	105,225	金融
ASPEN TECHNOLOGY CORP	-	3	60	7,977	情報技術
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	-	9.4	16	2,114	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	33.22	38.33	251	33,208	生活必需品
NETFLIX INC	53.01	52.38	1,650	217,665	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	46.9	45.64	2,492	328,616	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	30	24.11	78	10,375	公益事業
GLOBE LIFE INC	12.15	10.11	121	16,033	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	21.06	20.41	254	33,490	金融
TEXTRON INC	28.31	23.88	168	22,200	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	37.49	37.49	71	9,426	コミュニケーション・サービス
TEXAS PACIFIC LAND CORP	-	0.7	144	19,051	エネルギー
OMNICOM GROUP	25.46	23.11	198	26,113	コミュニケーション・サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	-	13.61	171	22,570	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ORACLE CORP	200.74	187.81	1,623	213,999	情報技術
MASTERCARD INC - A	106.04	100.94	3,744	493,721	情報技術
ONEOK INC	55.26	47.73	323	42,598	エネルギー
LUMENTA TECHNOLOGIES INC	110.62	102.99	55	7,319	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	12.69	12.57	557	73,488	情報技術
U HAIL NON VOTING SERIES N	-	8.82	51	6,763	資本財・サービス
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	-	18	129	17,042	金融
CHESAPEAKE ENERGY CORP	-	12	107	14,111	エネルギー
HF SINCLAIR CORP	-	19	95	12,565	エネルギー
OVINTIV INC	-	30	149	19,733	エネルギー
YUM! BRANDS INC	36.01	34.86	452	59,641	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	14.13	17.15	180	23,765	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	22.06	19.61	98	12,982	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	926.34	842.88	2,856	376,632	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	6.22	6.35	259	34,193	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	28.38	21.2	227	29,936	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	81.72	73.46	1,104	145,672	金融
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	-	41.28	239	31,622	ヘルスケア
ANALOG DEVICES INC	64.8	62.02	1,036	136,643	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	146.31	191.32	1,286	169,616	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	100.84	92.94	593	78,267	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	19.4	17.34	167	22,058	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	32.66	26.09	149	19,707	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	11.31	8.69	164	21,710	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	65.6	65.37	397	52,455	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	71.75	68.07	662	87,291	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	27.11	24.75	758	99,964	金融
AMGEN INC	69.99	62.88	1,698	223,949	ヘルスケア
EATON CORP PLC	50.56	45.88	738	97,320	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	20.19	19.51	420	55,437	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	109.56	99.37	1,058	139,522	情報技術
CME GROUP INC	42.9	41.67	732	96,587	金融
ECOLAB INC	31.06	31.35	470	62,093	素材
EQUIFAX INC	14.41	15.76	322	42,523	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	148.98	149.45	1,271	167,689	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	92.36	100.21	361	47,605	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	33.15	38.8	178	23,578	生活必需品
STATE STREET CORP	41.52	46.67	377	49,787	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	173.79	170.89	1,459	192,489	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	60.96	65.28	291	38,474	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	21.66	27.16	151	20,035	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	15.97	13.92	118	15,563	素材
CARDINAL HEALTH INC	33.19	29.73	230	30,406	ヘルスケア
FEDEX CORP	29.79	29.42	558	73,600	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	54.87	46.93	457	60,299	金融
FMC CORP	13.6	13.6	175	23,126	素材
CERNER CORP	41.33	-	-	-	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	30.05	33.1	368	48,604	素材
CITRIX SYSTEMS INC	14.12	-	-	-	情報技術
INTEL CORP	483.45	483.62	1,417	186,896	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	52.31	43.18	153	20,239	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	48.66	35.56	273	36,031	金融
WOLFSPEED INC	-	15	109	14,394	情報技術
ILLINOIS TOOL WORKS	37.68	36.13	820	108,117	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	153	102.27	60	7,969	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	17.87	19.93	413	54,476	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	14.5	14.5	76	10,100	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	42.55	42.68	1,130	149,085	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	13.3	12.39	155	20,560	情報技術
SNAP-ON INC	5	6.23	149	19,747	資本財・サービス
CARMAX INC	19.9	17.49	117	15,466	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP	91.33	92.59	973	128,415	公益事業
TARGET CORP	60	54.06	845	111,443	一般消費財・サービス
DOVER CORP	17.13	15.26	211	27,949	資本財・サービス
VW GRAINGER INC	5.88	5.41	301	39,776	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17.5	-	-	-	資本財・サービス
CINTAS CORP	11.62	10.92	481	63,539	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	55.67	64.69	261	34,475	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	-	17	167	22,114	生活必需品
CLOROX COMPANY	16.28	13.13	187	24,697	生活必需品
ENTERGY CORP	22.43	26.23	284	37,510	公益事業
MICROSOFT CORP	861.66	828.66	18,820	2,481,486	情報技術
INCYTE CORP	26.89	20.06	158	20,847	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	160.17	154.46	1,413	186,324	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	161.74	158.34	1,227	161,881	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	135.86	129.03	727	95,883	情報技術
BLACKROCK INC	18.34	17.23	1,297	171,062	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	56.36	66.06	201	26,539	公益事業
HASBRO INC	14.49	13.48	85	11,321	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	36.9	30.95	220	29,128	生活必需品
KEYCORP	117.82	99.4	180	23,839	金融
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	173.19	156.02	1,049	138,320	生活必需品
COOPER COS INC/THE CHUBB LTD	6.47	6.86	236	31,137	ヘルスケア
ARROW ELECTRONICS INC	54.52	48.09	1,074	141,720	金融
ALLSTATE CORP	10	7.37	81	10,702	情報技術
EBAY INC	34.77	33.64	470	62,100	金融
EYPAL HOLDINGS INC	83.08	62.11	270	35,639	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	133.7	126.92	978	128,988	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	14.92	13.92	123	16,253	素材
XILINX INC	28.92	-	-	-	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DISH NETWORK CORP-A	29.84	29.84	47	6,224	コミュニケーション・サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	27.83	26.98	705	93,609	生活必需品
TRIMBLE INC	29.38	26.36	137	18,156	情報技術
LENNAR CORP-A	33.94	27.44	261	34,475	一般消費財・サービス
LEAR CORP	6	8.28	108	14,325	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	69.8	67.06	885	116,721	金融
PACCAR INC	41.7	42.64	425	56,102	資本財・サービス
BIOGEN INC	19.48	17.87	490	64,728	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	10.24	10.36	464	61,206	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	142.74	135.96	1,424	187,760	一般消費財・サービス
PTC INC	12	12	151	19,929	情報技術
EVERSOURCE ENERGY	42.9	43.18	370	48,797	公益事業
INTUIT INC	32.63	32.03	1,266	166,958	情報技術
BORGWARNER INC	30.81	27.41	115	15,265	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	29.87	23.16	190	25,058	一般消費財・サービス
BALL CORP	38.6	33.59	186	24,611	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	171.49	171.74	782	103,233	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	36.77	33.8	419	55,336	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	16.06	17.57	312	41,240	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	32.07	30.32	858	113,226	ヘルスケア
VF CORP	42.16	54.42	160	21,217	一般消費財・サービス
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	72.02	67.79	132	17,474	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	6.28	5.64	63	8,343	一般消費財・サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	37	-	-	-	情報技術
CARNIVAL CORP	99.86	99.86	94	12,468	一般消費財・サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC	-	76.74	139	18,394	素材
COMCAST CORP-CLASS A	548.2	518.73	1,947	256,821	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	16	19	100	13,234	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	231	131	63	8,525	不動産
アメリカ・ドル 株数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	38,364.27 606銘柄	39,749.32 601銘柄	392,935	51,808,527	<65.2%>
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	100.13	103.76	644	63,396	生活必需品
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	-	41.76	173	17,052	金融
IMPERIAL OIL LTD	23	30.68	196	19,370	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2.5	2.37	526	51,799	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	37.21	40.3	353	34,816	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	63	50.69	291	28,656	素材
INTEACT FINANCIAL CORP	23.79	22.97	454	44,730	金融
BCE INC	9	6.68	40	4,034	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	22	24.14	458	45,167	素材
SUNCOR ENERGY INC	173.48	170.98	721	70,996	エネルギー
METRO INC/CN	30	35.84	268	26,455	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	39.41	45.89	432	42,567	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	150.75	146.37	984	96,936	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	57	112.45	638	62,884	金融
TORONTO-DOMINION BANK	217.6	219.89	1,893	186,333	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	39	33.35	111	10,995	金融
ROYAL BANK OF CANADA	170.86	169.23	2,223	218,854	金融
TOURMALINE OIL CORP	39	36.56	234	23,125	エネルギー
TC ENERGY CORP	121.44	122.58	671	66,100	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	63.75	81.11	375	36,968	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	218.48	232.77	591	58,212	素材
CAE INC	23	37.52	101	9,981	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	22.84	19.68	306	30,132	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	18	18	65	6,455	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	10.34	6.31	62	6,195	素材
BALLARD POWER SYSTEMS INC	32.06	-	-	-	資本財・サービス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	15.6	15.6	91	9,020	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	-	47	87	8,576	金融
HYDRO ONE LTD	48	48.66	177	17,451	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	24.89	18.61	223	21,990	生活必需品
NORTHLAND POWER INC	30.03	26.32	99	9,789	公益事業
WSP GLOBAL INC	12	18.52	303	29,878	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9.74	9.74	98	9,717	資本財・サービス
PARKLAND CORP	28	16.21	49	4,885	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	23	19.49	61	6,051	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	27.31	35.24	183	18,069	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC	11	9.24	130	12,837	資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	21.93	80	7,931	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	43.06	39.56	252	24,856	コミュニケーション・サービス
BRP INC/CA- SUB VOTING	-	4.03	42	4,201	一般消費財・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	142.61	74.02	83	8,232	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	29	50.27	368	36,236	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	70	69.97	68	6,728	公益事業
AIR CANADA	17	17	34	3,429	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	147.57	147.57	89	8,786	素材
BANK OF MONTREAL	78.55	81.17	1,036	102,032	金融
POWER CORP OF CANADA	63	57.3	193	19,038	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	13.56	143.55	715	70,372	情報技術
NUTRIEN LTD	69.06	63.64	654	64,457	素材
CANOPY GROWTH CORP	20	-	-	-	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	31.93	-	-	-	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	15.32	15.32	59	5,836	

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	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	15.6	-	-	-	情報技術
TELUS CORP	10	7.72	28	2,841	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	6	6	16	1,592	情報技術
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	44	53.74	284	28,000	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES	7.43	6.23	94	9,295	一般消費財・サービス
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	152	137.89	1,018	100,263	エネルギー
MAGNA INTERNATIONAL INC	3	2.74	221	21,758	金融
WESTON (GEORGE) LTD	36.93	31.67	257	25,334	一般消費財・サービス
PAN AMERICAN SILVER CORP	9.01	8	138	13,658	生活必需品
BLACKBERRY LTD	12.18	26.15	61	6,055	素材
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE SUN LIFE FINANCIAL INC	64	-	-	-	情報技術
ENBRIDGE INC	-	10	94	9,334	情報技術
BROOKFIELD CORP	72.66	64.2	405	39,889	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	246.95	242.33	1,329	130,889	エネルギー
BAUSCH HEALTH COS INC	172.13	167.07	757	74,602	金融
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	221.84	210.36	518	51,034	金融
IA FINANCIAL CORP INC	43	-	-	-	ヘルスケア
GILDAN ACTIVEWEAR INC	114.36	108.6	1,129	111,191	資本財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	11	11	89	8,801	金融
CGI INC - CLASS A	28	23.64	92	9,148	一般消費財・サービス
ONEX CORPORATION	87.93	69.6	1,147	112,895	資本財・サービス
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	28	29.56	338	33,267	情報技術
IGM FINANCIAL INC	16	11.04	70	6,953	金融
TMX GROUP LTD	68	51.72	199	19,673	コミュニケーション・サービス
OPEN TEXT CORP	3	13.18	52	5,132	金融
SAPUTO INC	7.94	6.98	95	9,352	金融
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	32.1	32.1	132	13,038	情報技術
FORTIS INC	29	29	100	9,849	生活必需品
RITCHEY BROS AUCTIONEERS	63	63	195	19,215	素材
LUNDIN MINING CORP	62	59.38	327	32,183	公益事業
CENOVUS ENERGY INC	13.55	13.55	105	10,430	資本財・サービス
DOLLARAMA INC	66	66	62	6,112	素材
ALTAGAS LTD	141	153.73	391	38,521	エネルギー
KEYERA CORP	35.29	30.74	251	24,787	一般消費財・サービス
ARC RESOURCES LTD	47	32.01	76	7,520	公益事業
カナダ・ドル 株数・金額	4,736.04	4,807.7	-	28,588	2,813.645
通貨計 銘柄数<比率>	87銘柄	86銘柄	-	< 3.5%>	< 3.5%>
(オーストラリア)					
THE LOTTERY CORPORATION LTD	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	一般消費財・サービス
TELSTRA GROUP LTD	-	237.27	109	10,007	コミュニケーション・サービス
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	-	423.51	168	15,316	金融
MEDIBANK PRIVATE LTD	-	359.69	853	77,725	金融
BHP GROUP LTD	228.24	301.36	87	7,989	金融
SOUTH32 LTD	365.48	605.13	2,904	264,611	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	563.87	488.03	215	19,606	素材
FORTESCUE METALS GROUP LTD	105.76	219.27	768	69,994	エネルギー
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	205.54	183.91	397	36,239	素材
WESTPAC BANKING CORP	419.83	378.89	1,136	103,550	金融
SANTOS LTD	442.7	415.63	971	88,487	金融
AUSNET SERVICES	291.53	452.11	321	29,284	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	285	-	-	-	公益事業
RIO TINTO LTD	351.9	-	-	-	金融
ORIGIN ENERGY LTD	41.69	47.51	564	51,409	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	209.68	182.8	140	12,822	公益事業
PILBARA MINERALS LTD	290.47	196.19	72	6,612	資本財・サービス
XERO LTD	-	300.83	118	10,770	素材
WASHINGTON H. SOUL PATINSON	14.26	14.26	102	9,354	情報技術
COLES GROUP LTD	9.53	27.48	76	6,931	エネルギー
WISETECH GLOBAL LTD	166.96	163.86	270	24,660	生活必需品
IDP EDUCATION LTD	25.09	16.45	83	7,563	情報技術
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	26.19	20.88	62	5,651	一般消費財・サービス
EVOLUTION MINING LTD	-	80.81	114	10,431	素材
AFTERPAY LTD	148.32	107.16	128	11,675	素材
REECE LTD	170.17	-	-	-	情報技術
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRAL	30	-	-	-	資本財・サービス
SEEK LTD	63.58	23.22	33	3,046	生活必需品
TREASURY WINE ESTATES LTD	139.06	139.06	87	7,930	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	26	48.13	101	9,247	コミュニケーション・サービス
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	101.73	86.16	115	10,486	生活必需品
AMPOL LTD	119.81	96.62	220	20,068	生活必需品
ORICA LTD	218.56	204.9	2,117	192,861	金融
QBE INSURANCE GROUP LTD	20	46.05	125	11,465	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	58.45	47.83	70	6,422	素材
TABCORP HOLDINGS LTD	153.48	153.48	201	18,358	金融
CROWN RESORTS LTD	157.79	140.42	473	43,109	生活必需品
QANTAS AIRWAYS LTD	173.52	-	-	-	一般消費財・サービス
TELSTRA CORP LTD	30	-	-	-	一般消費財・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	63.73	63.73	40	3,715	資本財・サービス
MACQUARIE GROUP LTD	351.14	-	-	-	コミュニケーション・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	58.26	47.96	135	12,382	素材
CSL LTD	42.77	45.72	795	72,514	金融
WESFARMERS LTD	64.62	64.62	202	18,467	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	55.5	56.3	1,559	142,071	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	137.98	140.07	662	60,394	一般消費財・サービス
SUNCORP GROUP LTD	8.05	6.97	144	13,178	ヘルスケア
	70.92	50.24	88	8,073	素材
	145.04	145.04	174	15,882	金融

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
ASX LTD	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	金融
COMPUTERSHARE LTD	22.6	22.6	149	13,658	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	60.54	60.54	146	13,374	情報技術
SONIC HEALTHCARE LTD	270.97	270.97	128	11,700	金融
BRAMBLES LTD	52.23	52.23	159	14,488	ヘルスケア
MINERAL RESOURCES LTD	183.37	150.68	174	15,868	資本財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	-	18.81	161	14,718	ヘルスケア
REA GROUP LTD	20.64	20.64	136	12,426	ヘルスケア
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	6.08	6.08	67	6,163	コミュニケーション・サービス
DOMINOS PIZZA ENTERPRISES L	15.51	-	-	-	金融
オーストラリア・ドル 株数・金額	7,297.02	7,432.1	-	18,142	1,652,774
通貨計 銘柄数<比率>	52銘柄	49銘柄	-	< 2.1%>	< 2.1%>
(香港)					
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	百株	百株	千香港ドル	千円	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	235	175	744	12,576	一般消費財・サービス
MTR CORP	230	270	1,436	24,260	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	165	285	1,182	19,976	不動産
SINO LAND CO	160	220	2,402	40,576	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	340	340	349	5,903	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	375.52	335.52	1,633	27,597	資本財・サービス
CLP HOLDINGS LTD	80	50	331	5,594	不動産
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	170	190	1,086	18,356	公益事業
HONG KONG & CHINA GAS	205.65	185.65	522	8,826	不動産
HANG SENG BANK LTD	1,720.27	1,380.27	1,055	17,834	公益事業
NEW WORLD DEVELOPMENT	80	90	1,179	19,928	金融
WH GROUP LTD	175	155	358	6,047	不動産
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,695	895	426	7,210	生活必需品
HANG LUNG PROPERTIES LTD	149	149	5,623	94,976	金融
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	370	270	402	6,803	不動産
CKWIRE PROPERTIES LTD	260	220	361	6,101	資本財・サービス
CK ASSET HOLDINGS LTD	80	320	692	11,701	不動産
CI INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	285.52	235.52	1,167	19,710	不動産
AIA GROUP LTD	55	55	228	3,859	公益事業
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1,500	1,500	13,095	221,174	金融
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	220	120	226	3,830	資本財・サービス
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	200	200	923	15,589	不動産
ESR CAYMAN LTD	192	192	518	8,755	生活必需品
SANDS CHINA LTD	180	220	358	6,056	不動産
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	290	290	812	13,714	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	350	-	-	-	一般消費財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	170	170	1,592	26,889	資本財・サービス
香港ドル 株数・金額	10,382.96	8,942.96	-	39,892	673,792
通貨計 銘柄数<比率>	28銘柄	27銘柄	-	< 0.8%>	< 0.8%>
(シンガポール)					
CAPITALAND INVESTMENT LTD	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD	334	304	113	11,230	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	159	149	456	45,259	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	213	213	750	74,361	金融
KEPPEL CORP LTD	177.5	117.5	65	6,481	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	173	173	126	12,524	資本財・サービス
CITY DEVELOPMENTS LTD	30	30	20	1,984	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	52	52	40	3,991	不動産
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	47	12	33	3,320	資本財・サービス
GENTING SINGAPORE LTD	447	407	516	51,192	金融
VENTURE CORP LTD	450	1,300	126	12,488	一般消費財・サービス
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	32	32	55	5,498	情報技術
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,284	1,124	282	27,941	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	141	141	48	4,789	資本財・サービス
WILMAR INTERNATIONAL LTD	118	118	106	10,576	金融
シンガポール・ドル 株数・金額	3,768.5	4,450.5	-	2,858	283,124
通貨計 銘柄数<比率>	14銘柄	15銘柄	-	< 0.4%>	< 0.4%>
(ニュージーランド)					
MERIDIAN ENERGY LTD	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	公益事業
MERCURY NZ LTD	150	150	79	6,703	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD	32.94	123.8	69	5,875	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	168.6	236.35	125	10,562	コミュニケーション・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	132.89	132.89	106	8,974	資本財・サービス
RYMAN HEALTHCARE LTD	92	72.38	168	14,184	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル 株数・金額	620.62	715.42	-	551	46,300
通貨計 銘柄数<比率>	6銘柄	5銘柄	-	< 0.1%>	< 0.1%>
(イギリス)					
SHELL PLC	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	エネルギー
HALEON PLC	-	856.73	2,038	327,063	生活必需品
BP PLC	-	545.52	175	28,143	エネルギー
UNILEVER PLC	2,510.81	2,236.18	1,071	171,991	生活必需品
BARCLAYS PLC	314.26	303.04	1,271	203,997	生活必需品
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,037.15	2,049.26	353	56,765	金融
PRUDENTIAL PLC	1,031.03	912.45	94	15,192	資本財・サービス
NATWEST GROUP PLC	314.21	339.07	422	67,849	金融
EVRAZ PLC	823.39	560.2	155	24,972	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	74.41	-	-	-	素材
BAE SYSTEMS PLC	17.58	30.8	67	10,814	素材
AVEVA GROUP PLC	377.96	398.54	332	53,414	資本財・サービス
GSK	510.81	319.64	145	23,338	金融
INFORMA PLC	11.4	11.4	36	5,885	情報技術
MELROSE INDUSTRIES PLC	605.42	474.15	673	108,149	ヘルスケア
	162	162	104	16,705	コミュニケーション・サービス
	579.01	447.76	65	10,533	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千円	千円	
AUTO TRADER GROUP PLC	144.99	105.87	57	9,296	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	9.38	7.26	30	4,951	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	62.34	51.49	38	6,140	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7.4	7.4	81	13,109	資本財・サービス
HALMA PLC	39.78	39.78	82	13,296	情報技術
ENTAIN PLC	73.37	58.23	85	13,703	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	320.55	218.08	30	4,920	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	108.88	68.57	42	6,828	金融
M&G PLC	259.64	259.64	50	8,093	金融
RELX PLC	242.03	228.21	532	85,399	資本財・サービス
DIAGEO PLC	279.1	263	956	153,410	生活必需品
RIO TINTO PLC	136.27	129.26	787	126,341	素材
STANDARD CHARTERED PLC	319.51	274.61	188	30,203	金融
TESCO PLC	867.91	1,017.41	247	39,705	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	112.97	92.37	107	17,320	ヘルスケア
GLENCORE PLC	1,292.26	1,129.4	612	98,338	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	32	27	4,491	金融
SMITHS GROUP PLC	40.8	40.8	66	10,639	資本財・サービス
PEARSON PLC	82.71	82.71	74	12,032	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	176.31	176.31	43	6,991	生活必需品
NEXT PLC	16.85	14.56	93	15,079	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	322.36	34	5,529	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	17.85	37.22	104	16,771	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	31.59	37.03	108	17,345	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	3,635.21	3,095.88	274	44,060	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	17.49	14.09	95	15,289	素材
KINGFISHER PLC	172.29	247.03	62	10,084	一般消費財・サービス
WPP PLC	130.21	130.21	115	18,500	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	82.44	84	13,586	公益事業
SEVERN TRENT PLC	33.27	26.81	73	11,779	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	222.42	303.37	153	24,671	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	86.77	89.36	526	84,460	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	48.83	88.44	102	16,462	金融
SCHROEDERS PLC	12.27	72.17	32	5,236	金融
SSE PLC	124.6	119.27	199	31,991	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	123.68	52	8,498	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	186.18	184.98	2,170	348,368	ヘルスケア
FERGUSON PLC	27.24	-	-	-	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	682.32	682.32	178	28,577	金融
31 GROUP PLC	132.93	126.75	175	28,231	金融
ASHTED GROUP PLC	59.21	56.56	289	46,379	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	115.48	115.48	89	14,413	情報技術
NATIONAL GRID PLC	451.05	415.45	431	69,167	公益事業
LOYDYS BANKING GROUP PLC	8,652.13	8,515.44	410	65,932	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	108.06	98.22	202	32,562	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	18.12	11.55	47	7,558	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	258.15	249.79	820	131,655	生活必需品
BHP GROUP PLC	269.34	-	-	-	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	49.64	34.83	60	9,781	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	2,448.46	2,400.27	1,351	216,928	金融
ANGLO AMERICAN PLC	168.85	149.72	536	86,047	素材
MONDI PLC	59.21	52.48	78	12,590	素材
COMPASS GROUP PLC	219.92	203.36	386	62,003	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	26.88	39.69	51	8,247	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	1,027.57	755.78	96	15,529	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	25.74	25.74	50	8,143	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	51.36	45.08	99	16,001	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	22.68	20.78	107	17,199	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	18.97	17.13	72	11,613	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	37.5	40.9	297	47,819	金融
SHELL PLC	518.12	-	-	-	エネルギー
SHELL CLASS B PLC	446.23	-	-	-	エネルギー
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	20.39	20.39	33	5,449	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	15.7	34	5,562	金融
ANTOFFAGASTA PLC	34.6	60.56	104	16,778	素材
ABRDN PLC	330.46	277.75	53	8,642	金融
EXPERIAN PLC	113.47	114.6	328	52,723	資本財・サービス
イギリス・ポンド 株数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	35,651.73	33,464.36	21,831	3,503,288	< 4.4%>
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・ シケル	千円	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	120	143.35	260	9,890	金融
AZRIELI GROUP LTD	5.3	5.3	120	4,559	不動産
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	-	12.79	196	7,470	情報技術
BEZEG THE ISRAELI TELECOM CO	-	240	143	5,455	コミュニケーション・サービス
ICL GROUP LTD	110.96	82.94	218	8,309	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	3	3	178	6,774	資本財・サービス
BANK HAPOLIM BM	151.6	151.6	485	18,439	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	190.43	240.49	714	27,124	金融
NICE LTD	8	7.42	490	18,632	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	18.83	18.83	214	8,132	金融
イスラエル・シケル 株数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	608.12	905.72	3,024	114,787	< 0.1%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
UBS GROUP AG-REG	425.54	382.38	709	101,433	金融
ROCHE HOLDING AG-BR	2.8	3.24	114	16,387	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1.3	0.89	59	8,580	素材
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	17.54	59	8,555	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	83.88	81.68	2,380	340,457	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	千スイス・フラン	千円	
SIKA AG-REG	16.9	18.55	453	64,901	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	0.01	97	13,889	生活必需品
ABB LTD-REG	210.74	179.76	547	78,269	資本財・サービス
SWISS RE AG	36.66	37.23	350	50,079	金融
NESTLE SA-REG	342.92	325.69	3,635	520,000	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2.87	3.1	268	38,471	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4.89	2.61	49	7,102	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	301.22	487.04	149	21,324	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	26.84	26.84	153	21,952	金融
SGS SA-REG	0.65	0.78	177	25,326	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	4.67	4.67	83	11,943	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	6.65	-	-	-	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG	7.93	7.93	45	6,449	情報技術
VAT GROUP AG	3.39	3.39	97	13,945	資本財・サービス
BKW AG	-	2.5	33	4,723	公益事業
ALCON INC	58.53	55.5	369	52,855	ヘルスケア
SIG GROUP N AG	-	34	74	10,631	素材
SWATCH GROUP AG/THE-BR	5	3.77	110	15,789	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	17.92	17.76	798	114,266	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	6.11	5.5	82	11,737	金融
CLARIANT AG-REG	15.68	25.52	39	5,647	素材
NOVARTIS AG-REG	269.42	249.16	2,125	304,043	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.56	0.41	75	10,826	生活必需品
BACHEM HOLDING AG-REG B	0.78	3.9	32	4,588	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	60.87	63.09	850	121,603	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	2.76	3.24	171	24,581	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	-	3.57	30	4,424	金融
GEBERIT AG-REG	4.56	4.33	215	30,800	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	1.13	1.06	320	45,835	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1.11	12.71	146	20,925	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	6.72	6.13	142	20,325	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	21.65	17.3	107	15,317	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	9.13	8.77	405	57,943	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	4.5	24	3,446	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD	65.87	67.54	344	49,251	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3.81	3.29	165	23,680	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	6.4	6.4	141	20,240	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	9.46	78	11,298	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.14	0.14	135	19,364	生活必需品
スイス・フラン 株数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	2,069.51	2,192.88	16,451	2,353,225	< 3.0%>
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・ クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	213.44	206.2	19,747	375,405	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	72.36	80.02	1,158	22,026	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0.39	0.39	591	11,239	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	127.85	133.4	2,706	51,441	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S	11.59	-	-	-	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B	12.32	11.32	1,072	20,383	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	29.81	24.64	888	16,881	素材
COLOPLAST-B	15.19	14	1,197	22,760	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	25.8	23.04	2,540	48,288	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	1.43	0.98	184	3,503	資本財・サービス
DEMANT A/S	13.14	6.14	122	2,327	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.66	0.58	896	17,051	資本財・サービス
TRYG A/S	45.94	40.74	650	12,368	金融
PANDORA A/S	13.25	11.28	605	11,510	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	12.62	12.62	646	12,297	素材
GENMAB A/S	9.19	8.77	2,643	50,248	ヘルスケア
ORSTED A/S	22.46	22.46	1,417	26,950	公益事業
AMBU A/S-B	20.91	-	-	-	ヘルスケア
デンマーク・クローネ 株数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	648.35	596.58	37,069	704,683	< 0.9%>
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・ クローネ	千円	
DNB BANK	128.38	110.49	2,202	29,265	金融
NORSK HYDRO ASA	130.5	152.84	1,153	15,335	素材
ORKLA ASA	74.83	116.18	851	11,320	生活必需品
TELENOR ASA	87.46	87.46	863	11,474	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	122.6	113.82	3,553	47,225	エネルギー
SCHIBSTED ASA-CL A	9.17	-	-	-	コミュニケーション・サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	27.56	21.12	973	12,933	素材
MOWI ASA	46.77	46.77	812	10,799	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	20	376	4,999	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	17	-	-	-	コミュニケーション・サービス
AKER BP ASA	13.55	36.55	1,114	14,815	エネルギー
KONGSBERG GRUPPEN ASA	-	12.03	475	6,315	資本財・サービス
SALMAR ASA	-	7.28	287	3,821	生活必需品
ADEVINTA ASA	45.82	33.82	239	3,177	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ 株数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	723.64	758.36	12,903	171,485	< 0.2%>
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・ クローネ	千円	
SAGAX CLASS B	20.2	20.2	519	6,577	不動産
INVESTOR CLASS A	62.56	62.56	1,266	16,038	金融
VOLVO CAR CLASS B	-	71.77	362	4,586	一般消費財・サービス
ICA GRUPPEN AB	12.97	-	-	-	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	384.64	376.89	2,423	30,685	情報技術
VOLVO AB-B SHS	188.73	183.33	3,618	45,811	資本財・サービス

銘柄	期首		当		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円			
SKF AB-B SHARES	40	40	733	9,279	資本財・サービス		
ELECTROLUX AB-SER B	26	26	424	5,375	一般消費財・サービス		
SWEDISH MATCH AB	218.8	-	-	-	生活必需品		
TELE2 AB-B SHS	70.26	70.26	644	8,154	コミュニケーション・サービス		
GETINGE AB-B SHS	28.69	28.69	638	8,088	ヘルスケア		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	217.79	187.67	2,349	29,746	金融		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	154.82	165.57	1,815	22,983	金融		
SWEDBANK AB - A SHARES	108.21	108.21	2,042	25,857	金融		
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	103.52	81.12	1,046	13,252	一般消費財・サービス		
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	82.01	73.2	1,063	13,460	素材		
SKANSKA AB-B SHS	37.09	37.09	651	8,243	資本財・サービス		
SANDVIK AB	146.57	154.4	3,168	40,110	資本財・サービス		
INVESTOR AB-B SHS	219.28	214.46	4,265	54,002	金融		
ATLAS COPCO AB-A SHS	85.75	337.12	4,516	57,181	資本財・サービス		
VOLVO AB-A SHS	39.23	19.23	399	5,058	資本財・サービス		
HOLMEN AB-B SHARES	-	11.14	488	6,185	素材		
SECURITAS AB-B SHS	25	109.99	1,029	13,027	資本財・サービス		
TELIA CO AB	364.21	290.88	807	10,226	コミュニケーション・サービス		
ALFA LAVAL AB	48.4	38.03	1,227	15,536	資本財・サービス		
ATLAS COPCO AB-B SHS	48.13	203.29	2,421	30,662	資本財・サービス		
ASSA ABLOY AB-B	126.35	113.69	2,671	33,823	資本財・サービス		
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	16.38	26.38	710	9,000	金融		
FASTIGHTS AB BALDER-B SHRS	13.19	64.2	343	4,353	不動産		
INDUTRADE AB	-	36	829	10,505	資本財・サービス		
SWEDISH ORPHAN BIVOTRUM AB	-	19.11	418	5,300	ヘルスケア		
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	9.48	441	5,592	金融		
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	9.24	20.48	427	5,408	資本財・サービス		
LIFCO AB-B SHS	29.24	29.24	541	6,855	資本財・サービス		
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	167.16	167.16	1,709	21,638	資本財・サービス		
ORRON ENERGY	19	-	-	-	公益事業		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	72.6	85.03	2,448	30,991	生活必需品		
EMBRACER GROUP AB	70.9	70.9	348	4,413	コミュニケーション・サービス		
BOLIDEN AB	31.71	31.71	1,370	17,344	素材		
EPIROC AB-A	86.6	79.13	1,637	20,736	資本財・サービス		
EPIROC AB-B	40.15	40.15	712	9,019	資本財・サービス		
HUSQVARNA AB-B SHS	54	54	445	5,635	資本財・サービス		
NORDEA BANK ABP	406.44	420.96	5,025	63,621	金融		
EQT AB	29.6	33.65	817	10,343	金融		
EVOLUTION AB	20.64	20.64	2,355	29,825	一般消費財・サービス		
SINCH AB	64	-	-	-	情報技術		
KINNEVIK AB - B	36.41	30.03	467	5,919	金融		
HEXAGON AB-B SHS	270.76	277.67	3,237	40,988	情報技術		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13	12.16	326	4,136	金融		
スウェーデン・クロス 通貨計	4,319.71 45銘柄	4,552.87 45銘柄	65,212 < 1.0% >	825,590 < 0.2% >			
ユーロ (アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円			
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	30.55	26.93	103	14,627	素材		
AIB GROUP PLC	-	126.8	47	6,711	金融		
BANK OF IRELAND GROUP PLC	-	126.91	119	16,858	金融		
KINGSPAN GROUP PLC	20.88	17.44	99	14,128	資本財・サービス		
KERRY GROUP PLC-A	18.22	18.22	157	22,266	生活必需品		
CRH PLC	92	90.13	368	52,078	素材		
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	17.85	20.28	286	40,456	一般消費財・サービス		
国小計	179.5 5銘柄	426.71 7銘柄	1,182 < 0.2% >	16,718 < 0.2% >			
ユーロ (オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	89.3	84.9	200	28,327	コミュニケーション・サービス		
EXOR NV	-	13	94	13,391	金融		
QIAGEN N.V.	25.21	25.21	117	16,612	ヘルスケア		
KONINKLIJKE PHILIPS NV	114.2	129.22	198	28,072	ヘルスケア		
NN GROUP NV	31	38.6	153	21,752	ヘルスケア		
HEINEKEN NV	31.23	35.44	325	46,086	生活必需品		
AEGON NV	179.67	261.33	127	18,067	金融		
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	121.3	124.07	343	48,509	生活必需品		
AKZO NOBEL N.V.	25.04	21.68	144	20,419	素材		
KONINKLIJKE DSM NV	22.3	20.14	242	34,311	素材		
WOLTERS KLUWER	33	35.82	349	49,477	資本財・サービス		
ING GROEP NV	456.01	402.48	493	69,808	金融		
KONINKLIJKE KPN NV	376.07	376.07	112	15,966	コミュニケーション・サービス		
ASML HOLDING NV	49.16	46.19	2,709	383,069	情報技術		
ABN AMRO BANK NV-CVA	40.3	40.3	59	8,347	金融		
IMCD NV	7.15	7.15	101	14,379	資本財・サービス		
ADYEN NV	2.25	2.39	323	45,717	情報技術		
JUST EAT TAKEAWAY	23.81	23.81	54	7,644	一般消費財・サービス		
PROSUS NV	112.99	91.52	679	96,072	一般消費財・サービス		
JDE PEET'S NV	14.76	14.76	40	5,717	生活必需品		
ASM INTERNATIONAL NV	6.02	5.55	150	21,346	情報技術		
RANDSTAD NV	20.2	14.9	90	12,727	資本財・サービス		
HEINEKEN HOLDING NV	12.85	11.53	85	12,111	生活必需品		
OCI NV	-	11.97	38	5,445	素材		
EURONEXT NV	15	9.29	66	9,469	金融		
STMICROELECTRONICS NV	85.75	85.7	319	45,163	情報技術		
AIRBUS SE	69.81	65.21	766	108,327	資本財・サービス		
ARGENX SE	5.16	7.68	266	37,666	ヘルスケア		
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	85	55.46	55	7,833	生活必需品		
EXOR NV	10.88	-	-	-	金融		
CNH INDUSTRIAL NV	116.91	116.91	183	25,941	資本財・サービス		
STELLANTIS NV	248.03	256.3	373	52,737	一般消費財・サービス		

銘柄	期首		当		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円			
FERRARI NV	17.22	15.99	345	48,830	一般消費財・サービス		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,447.58 31銘柄	2,450.57 32銘柄	9,614 < 1.7% >	1,359,354 < 0.2% >		
ユーロ (ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円			
UCB SA	19.21	15.5	121	17,233	ヘルスケア		
KBC GROUP NV	30.11	30.11	191	27,031	金融		
COLRUYT SA	3.5	-	-	-	生活必需品		
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11.39	11.39	88	12,550	金融		
SOLVAY SA	8.73	8.73	89	12,681	素材		
UMICORE	22.7	22.7	81	11,559	素材		
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	89.26	93	527	74,643	生活必需品		
AGEAS	16.54	18.87	79	11,306	金融		
D'IETTEREN GROUP	-	2.96	54	7,683	一般消費財・サービス		
PROXIMUS	22.69	-	-	-	コミュニケーション・サービス		
ELIA GROUP SA/NV	7	5.02	69	9,765	公益事業		
SOFINA	2.39	1.46	32	4,532	金融		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	233.52 11銘柄	209.74 10銘柄	1,336 < 0.2% >	188,988 < 0.2% >		
ユーロ (ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
AROUNDTOWN SA	160.64	104.12	27	3,897	不動産		
ARCELORMITTAL	80.31	69.75	190	26,916	素材		
INPOST SA	31.82	-	-	-	資本財・サービス		
EUROFINS SCIENTIFIC	14.8	14.8	102	14,467	ヘルスケア		
TENARIS SA	47	47	74	10,522	エネルギー		
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	334.57 5銘柄	235.67 4銘柄	394 < 0.1% >	55,803 < 0.1% >		
ユーロ (フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円			
TOTALENERGIES SE	299.62	283.59	1,653	233,827	エネルギー		
MICHELIN (CGDE)	21.46	85.84	250	35,479	一般消費財・サービス		
AIR LIQUIDE SA	57.59	60.69	865	122,304	素材		
KERING	8.88	8.55	450	63,643	一般消費財・サービス		
SCHNEIDER ELECTRIC SE	63.38	59.11	856	121,025	資本財・サービス		
BOUYGUES SA	27.21	27.21	82	11,687	資本財・サービス		
BNP PARIBAS	134	123.98	731	103,451	金融		
THALES SA	14.04	12.35	141	20,009	資本財・サービス		
DANONE	75.51	77.15	379	53,593	生活必需品		
CARREFOUR SA	80.22	66.41	111	15,698	生活必需品		
SUEZ	29.5	-	-	-	公益事業		
VIVENDI	89.3	89.3	84	11,963	コミュニケーション・サービス		
L'OREAL	29.56	27.75	1,015	143,533	生活必需品		
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	69.75	68.26	361	51,138	資本財・サービス		
LEGRAND SA	34.59	30.52	246	34,873	資本財・サービス		
PERNOD RICARD SA	25.44	23.64	444	62,783	生活必需品		
EURAZEO SE	5.6	4	24	3,472	金融		
SOCIETE GENERALE SA	110.65	114.36	286	40,533	金融		
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	33.37	31.37	2,382	336,889	一般消費財・サービス		
ACCOR SA	18.5	18.5	47	6,742	一般消費財・サービス		
CAPEMIMINI SE	19.81	19.19	320	45,254	情報技術		
VALEO SA	37.03	22.45	43	6,128	一般消費財・サービス		
PUBLICIS GROUPE	29.18	29.18	179	25,445	コミュニケーション・サービス		
BUREAU VERITAS SA	32.27	32.27	83	11,866	資本財・サービス		
EIFFAGE	9.45	9.45	90	12,807	資本財・サービス		
SODEXO SA	12.48	10.85	95	13,551	一般消費財・サービス		
IPSEN	2.76	6.4	65	9,292	ヘルスケア		
ORPEA	5.24	-	-	-	ヘルスケア		
AMUNDI SA	4.37	10.05	58	8,248	金融		
TELEPERFORMANCE	7.01	7.45	177	25,068	資本財・サービス		
UBISOFT ENTERTAINMENT	9.77	9.77	24	3,443	コミュニケーション・サービス		
FAURECIA	10.41	-	-	-	一般消費財・サービス		
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3.99	3.14	92	13,042	ヘルスケア		
SEB SA	2.16	2.16	19	2,812	一般消費財・サービス		
ESSILORLUXOTTICA	35.06	32.58	572	80,999	ヘルスケア		
DASSAULT AVIATION SA	2.2	2.2	33	4,724	資本財・サービス		
WORLDLINE SA	31.35	26.41	103	14,692	情報技術		
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8.78	8.78	34	4,893	一般消費財・サービス		
AXA SA	243.18	210.14	575	81,419	金融		
EDENRED	30.07	30.07	146	20,754	情報技術		
RENAULT SA	25.54	20.44	72	10,284	一般消費財・サービス		
HERMES INTERNATIONAL	4.05	3.48	560	79,261	一般消費財・サービス		
REMY COINTREAU	2.53	2.53	41	5,848	生活必需品		
DASSAULT SYSTEMES SE	81.65	92.7	324	45,851	情報技術		
WENDEL	5.55	3.31	31	4,403	金融		
ORANGE	257.92	225.8	223	31,559	コミュニケーション・サービス		
ALSTOM	51.06	36.68	90	12,772	資本財・サービス		
CNP ASSURANCES	13.49	-	-	-	金融		
SANOFI	133.26	131.38	1,188	167,987	ヘルスケア		
VINCI SA	64.38	60.17	600	84,855	資本財・サービス		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	73.51	96.57	258	36,590	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	外貨建金額	邦貨換算金額	
BOLLORE	百株 73	百株 143.02	千ユーロ 76	千円 10,572	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>	3,080.85 59銘柄	2,955.44 57銘柄	17,841 1,899.925	< 2.4% >
ユーロ (ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	50.55	50.55	154	21,829	資本財・サービス
DR.ING. H.C. F. PORSCHER PRF (PROPOSED)	-	13.2	131	18,634	一般消費財・サービス
BAYER AG-REG	115.83	109.61	568	80,365	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	18	24.31	48	6,813	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	255.58	234.78	275	38,882	金融
COMMERZBANK AG	96.89	148.3	141	19,956	金融
VOLKSWAGEN AG	4.2	3.41	54	7,761	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	22.72	22.9	293	41,447	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	90.95	88.64	1,226	173,366	資本財・サービス
E.ON SE	300.06	288.8	282	39,973	公益事業
UNIPER SE	20.66	-	-	-	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	37.29	39.13	352	49,778	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	13	19.08	78	11,046	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	14.74	12.72	81	11,570	一般消費財・サービス
BASF SE	112.83	105.67	558	78,940	素材
ALLIANZ SE-REG	50.14	45.12	963	136,288	金融
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	21.41	19.95	130	18,474	生活必需品
RHEINMETALL AG	-	5.02	106	15,117	資本財・サービス
RWE AG	75.26	86.49	337	47,774	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	17	66.13	55	7,874	資本財・サービス
BRENTAG SE	21.21	17.73	116	16,523	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	48.35	48.35	136	19,345	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9.59	9.59	19	2,778	コミュニケーション・サービス
SAP SE	122.83	120.01	1,254	177,407	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	17.04	16.25	526	74,505	金融
ZALANDO SE	28.56	25.14	101	14,288	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	21.28	15.7	93	13,202	素材
KION GROUP AG	6	-	-	-	資本財・サービス
COVESTRO AG	19.45	19.45	83	11,783	素材
RATIONAL AG	0.74	0.74	44	6,355	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	3.88	2.79	107	15,150	ヘルスケア
PORSCHER AUTOMOBIL HLDG-PRF	21.02	17.4	97	13,761	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	21.48	18.32	85	12,090	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	5.6	5.6	70	9,975	ヘルスケア
BECHTLE AG	8.19	8.19	29	4,151	情報技術
NEMETSCHKE SE	11.39	7.89	40	5,751	情報技術
SCOUT24 AG	14.6	10.83	53	7,577	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	28.94	32.3	154	21,905	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	13.57	9.26	56	7,962	資本財・サービス
HELLOFRESH SE	18.14	18.14	45	6,478	生活必需品
SIEMENS ENERGY AG	47.32	47.32	86	12,162	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	12.75	11.47	125	17,708	生活必需品
FUCHS PETROLUB PREF	7	-	-	-	素材
MERCK KGAA	16.92	14.9	287	40,667	ヘルスケア
ADIDAS AG	21.88	19.21	272	38,473	一般消費財・サービス
PUMA SE	12.95	12.95	81	11,552	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	13.11	13.11	80	11,398	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	411.35	375.11	744	105,302	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & MERCEDES-BENZ GROUP N AG	25.61	23.41	75	10,647	ヘルスケア
INFINEON TECHNOLOGIES AG	101.1	95.27	641	90,675	一般消費財・サービス
HANNOVER RUECK SE	155.1	142.28	443	62,710	情報技術
DEUTSCHE POST AG-REG	6.44	9.39	177	25,104	金融
DEUTSCHE BOERSE AG	116.91	105.96	401	56,694	資本財・サービス
LANXESS AG	24.04	22.78	364	51,514	金融
MTU AERO ENGINES AG	15.29	-	-	-	素材
SYMRISE AG	6.66	6.19	134	19,008	資本財・サービス
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16.56	15.09	160	22,646	素材
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	62.4	141.05	35	5,045	コミュニケーション・サービス
VONOVIA SE	9	7.33	61	8,715	一般消費財・サービス
LEG IMMOBILIEN SE	80.41	96.44	244	34,577	不動産
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,932.5 59銘柄	2,955.44 57銘柄	13,438 1,899.925	< 2.4% >
ユーロ (ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	29	29	62	8,823	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	359.64	317.72	151	21,417	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	71.83	61.35	77	10,911	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	460.47 3銘柄	408.07 3銘柄	291 41,152	< 0.1% >
ユーロ (スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA RIGHTS SA	720.39	-	-	-	公益事業
CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV	-	7.81	27	3,915	公益事業
DERECHOS DE IBERDROLA S.A. SA	-	683.12	12	1,741	公益事業
TELEFONICA SA	644.91	674.94	239	33,875	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA	37.6	37.6	69	9,823	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	835.83	663.5	416	58,881	金融
IBERDROLA SA	720.39	683.12	740	104,692	公益事業
REPSOL SA	176.85	192.2	284	40,270	エネルギー
GRIFOLS SA	27.95	27.95	33	4,702	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	2,073.7	1,904.26	574	81,292	金融
AMADEUS IT GROUP SA	54	62.73	339	48,015	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA	39.78	16.68	41	5,874	公益事業
CAIXABANK SA	468.59	503.78	193	27,307	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	35.83	29.53	83	11,856	資本財・サービス

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
AENA SME SA	百株 8.66	百株 8.66	千ユーロ 110	千円 15,598	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA	65.12	68.12	223	31,637	コミュニケーション・サービス
ACCIONA SA	-	2.91	51	7,302	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	124.17	129.87	349	49,391	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	32.93	-	-	-	資本財・サービス
ENAGAS SA	36.75	32.18	51	7,347	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	51.47	66.58	109	15,442	公益事業
FERROVIAL SA	60.55	53.67	136	19,311	資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA	43.83	30.29	61	8,684	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	6,259.3 20銘柄	5,879.5 21銘柄	4,151 586,963	< 0.7% >
ユーロ (イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA	41.45	29.49	103	14,596	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	129.44	129.44	222	31,439	金融
MEDIORANZA SPA	99.71	74.65	69	9,874	金融
UNICREDIT SPA	294.71	238.87	349	49,346	金融
TELECOM ITALIA SPA	1,085.03	1,085.03	26	3,815	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO	1,910.98	1,956.59	436	61,645	金融
ATLANTIA SPA	60.27	-	-	-	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	77.27	64.65	61	8,763	金融
MONCLER SPA	24.35	24.35	128	18,135	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	12.85	12.85	50	7,147	ヘルスケア
ENI SPA	281.9	288.95	402	56,963	エネルギー
DIASORIN SPA	2.77	2.77	35	4,997	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	24.14	82.39	80	11,396	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA	80.78	65.11	51	7,237	情報技術
AMPLIFON SPA	17.5	14.4	40	5,667	ヘルスケア
ENEL SPA	983.37	954.39	534	75,548	公益事業
SNAM SPA	243	243	116	16,480	公益事業
TERNA SPA	199	158.15	114	16,174	公益事業
FINCOBANK SPA	59.72	80.77	134	18,995	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,628.24 19銘柄	5,505.85 18銘柄	2,958 418,226	< 0.5% >
ユーロ (フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ	65.25	61.24	214	30,338	素材
NOKIA OYJ	652.61	672.62	309	43,824	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	41.16	82.27	70	10,030	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	88.53	59.11	84	11,908	素材
ELISA OYJ	17.34	22.12	112	15,930	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS	68.09	58.26	285	40,426	金融
FORTUM OYJ	44	44	67	9,474	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	42.45	34.7	75	10,621	生活必需品
KONE OYJ-B	37.96	45.41	236	33,410	資本財・サービス
NESTE OYJ	57.78	49.41	221	31,379	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	17.63	13.15	71	10,095	ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,132.8 11銘柄	1,142.29 11銘柄	1,750 247,438	< 0.3% >
ユーロ (オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
VERBUND AG	12.16	8.76	64	9,164	公益事業
OMV AG	12.09	20.56	98	13,865	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	34.89	53.26	172	24,321	金融
VOESTALPINE AG	18	13.23	36	5,113	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	11	-	-	-	金融
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	88.14 5銘柄	95.81 4銘柄	371 52,645	< 0.1% >
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	22,777.47 229銘柄	22,339.6 223銘柄	53,330 7,539,813	< 9.5% >
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	131,967.94 1,227銘柄	130,908.37 1,210銘柄	- 72,491,038	< 91.2% >

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

(2) 外国投資証券

銘柄	期首		期末	
	口数	金額	口数	金額
(アメリカ)	千口	千円	千口	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,679	1,52	246	32,560
SIMON PROPERTY GROUP INC	4,012	4,043	478	63,072
BOSTON PROPERTIES INC	1,915	1,658	108	14,366
VORNADO REALTY TRUST	2,128	-	-	-
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,28	1,229	358	47,217
EQUITY RESIDENTIAL	4,406	3,833	224	29,615
EQUINIX INC	1,081	1,047	713	94,032
AMERICAN TOWER CORP	5,453	5,53	1,212	159,898
HOST HOTELS & RESORTS INC	6,701	7,895	127	16,863
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	-	3,155	97	12,912
KIMCO REALTY CORP	-	7,054	148	19,615
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	-	5,382	111	14,738
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	-	3	152	20,109
INVITATION HOMES INC	6,976	7,588	226	29,814
VICI PROPERTIES INC	8,607	11,867	379	50,037
VENTAS INC	4,401	4,401	210	27,742
WEYERHAEUSER CO	8,683	9,311	292	38,572
AGNC INVESTMENT CORP	7,559	-	-	-
CROWN CASTLE INTL CORP	5,102	5,062	735	97,030
IRON MOUNTAIN INC	3,474	3,16	159	21,023
SUN COMMUNITIES INC	1,214	1,461	210	27,696
PROLOGIS INC	8,863	10,966	1,272	167,807
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,648	2,02	296	39,042
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,177	1,049	118	15,630
DUKE REALTY CORP	4,971	-	-	-
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0,771	0,704	149	19,731
WELLTOWER INC	4,901	5,911	409	53,986
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6,434	5,888	154	20,394
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,452	1,236	192	25,383
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,95	1,95	127	16,830
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15,632	5,245	115	15,241
REALTY INCOME CORP	6,508	7,332	474	62,547
PUBLIC STORAGE	1,857	1,886	530	69,928
REGENCY CENTERS CORP	1,939	1,761	110	14,518
UDR INC	3,7	3,36	129	17,042
WP CAREY INC	2,702	2,131	172	22,775
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,415	3,233	326	43,113
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,797	1,825	268	35,444
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,597	6,944	85	11,334
アメリカ・ドル 口数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	152,985 35銘柄	151,637 36銘柄	11,131 <1.8%>	1,467,674 <1.8%>
(カナダ)	千口	千円	千口	千円
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	1,6	0,831	37	3,654
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,4	0,925	20	1,973
カナダ・ドル 口数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	3 2銘柄	1,756 2銘柄	57 <0.0%>	5,627 <0.0%>
(オーストラリア)	千口	千円	千口	千円
DEXUS/AU	13,949	12,537	97	8,862
LENDLEASE GROUP	14,733	6,942	54	5,008
TRANSURBAN GROUP	33,406	40,11	533	48,598
SYDNEY AIRPORT	18,747	-	-	-
APA GROUP	14,243	13,286	140	12,769
SCENTRE GROUP	64,017	64,017	186	16,970
GPT GROUP	30,647	21,774	92	8,470
MIRVAC GROUP	61,117	43,513	93	8,562
STOCKLAND	18,729	40,622	147	13,470
GOODMAN GROUP	20,198	23,536	418	38,165
VICINITY CENTRES	50,371	50,371	101	9,223
オーストラリア・ドル 口数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	340,157 11銘柄	316,708 10銘柄	1,867 <0.2%>	170,102 <0.2%>
(香港)	千口	千円	千口	千円
LINK REIT	26	25	1,480	24,997
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	52	33	167	2,831
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	34	36	351	5,934
香港ドル 口数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	112 3銘柄	94 3銘柄	1,999 <0.0%>	33,763 <0.0%>
(シンガポール)	千口	千円	千口	千円
CAPITALAND ASCENDAS REIT	30,5	47,5	131	13,031
CAPITALAND INTEGRATED COMM	56,826	56,826	114	11,368
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	46	30	48	4,843
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	37,6	37,6	63	6,330
シンガポール・ドル 口数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	170,926 4銘柄	171,926 4銘柄	359 <0.0%>	35,573 <0.0%>
(イギリス)	千口	千円	千口	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	10,295	7,946	53	8,512
SEGRO PLC	13,286	17,001	136	21,956
BRITISH LAND CO PLC	14,58	9,799	40	6,447
イギリス・ポンド 口数、金額 通貨計 銘柄数<比率>	38,161 3銘柄	34,746 3銘柄	230 <0.0%>	36,915 <0.0%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千円	千口	千円
WAREHOUSES DE PAUW SCA	-	1,846	52	7,365
国小計 口数、金額 銘柄数<比率>	- 1銘柄	1,846 1銘柄	52 <0.0%>	7,365 <0.0%>
ユーロ (フランス)	千口	千円	千口	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,751	1,507	81	11,577
GECINA SA	0,578	0,578	59	8,376
KLEPIERRE	2,394	2,394	54	7,730
COVIVIO	0,353	0,353	20	2,942
国小計 口数、金額 銘柄数<比率>	5,076 4銘柄	4,832 4銘柄	216 <0.0%>	30,626 <0.0%>
ユーロ通貨計 口数、金額 銘柄数<比率>	5,076 4銘柄	6,678 5銘柄	268 <0.0%>	37,991 <0.0%>
合計 口数、金額 銘柄数<比率>	822,305 62銘柄	777,451 63銘柄	-	1,787,648 <2.2%>

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄	別	当 期		末	
		買 建 額	売 建 額	買 建 額	売 建 額
外	S&P500 EMINI FUT(アメリカ)	4,102	百円	-	百円
	S&P/TSX 60 IX FUT(カナダ)	165		-	
	SPI 200 FUTURES(オーストラリア)	129		-	
	FTSE 100 IDX FUT(イギリス)	259		-	
国	SWISS MKT IX FUTR(ドイツ)	175		-	
	EURO STOXX 50(ドイツ)	640		-	

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

■投資信託財産の構成

2023年1月10日現在

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
株式	72,491,038	90.0%	千円	%
投資証券	1,787,648	2.2		
コール・ローン等、その他	6,268,541	7.8		
投資信託財産総額	80,547,228	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=131.85円、1カナダ・ドル=98.42円、1オーストラリア・ドル=91.10円、1香港ドル=16.89円、1シンガポール・ドル=99.04円、1ニュージーランド・ドル=84.00円、1イギリス・ポンド=160.47円、1イスラエル・シケル=37.95円、1スイス・フラン=143.04円、1デンマーク・クローネ=19.01円、1ノルウェー・クローネ=13.29円、1スウェーデン・クローネ=12.66円、1ユーロ=141.38円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産(76,103,650千円)の投資信託財産総額(80,547,228千円)に対する比率は、94.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年1月10日現在

項 目	当 期	末
(A) 資産		153,313,158,797円
コール・ローン等	1,537,741,980	
株式(評価額)	72,491,038,287	
投資証券(評価額)	1,787,648,637	
未収入金	75,966,014,329	
未収配当金	76,451,280	
差入委託証拠金	1,454,264,284	
(B) 負債		73,838,859,651
未払金	73,665,658,211	
未払解約金	173,201,440	
(C) 純資産総額(A-B)		79,474,299,146
元本	31,688,848,448	
次期繰越損益金	47,785,450,698	
(D) 受益権総口数		31,688,848,448口
1万口当り基準価額(C/D)		25,080円

* 期首における元本額は27,819,075,015円、当作成期間中における追加設定元本額は8,806,110,136円、同解約元本額は4,936,336,703円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：
ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 24,661,534,687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) 1,771,002,419円
i Free 外国株式インデックス (為替ヘッジあり) 2,824,140,925円
ダイワ先進国株式インデックス (為替ヘッジあり) (投資一任専用) 401,366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) 2,431,769,051円
* 当期末の計算口数当りの純資産額は25,080円です。

■損益の状況

当期 自2022年1月12日 至2023年1月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,403,580,422円
受取配当金	1,386,477,244
受取利息	3,520,604
その他収益金	14,630,648
支払利息	△ 1,048,074
(B) 有価証券売買損益	△14,393,329,043
売買益	24,299,224,634
売買損	△38,692,553,677
(C) 先物取引等損益	△ 456,650,679
取引益	1,239,170,574
取引損	△ 1,695,821,253
(D) その他費用	△ 19,025,809
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△13,465,425,109
(F) 前期繰越損益金	54,867,170,648
(G) 解約差損益金	△ 7,633,799,155
(H) 追加信託差損益金	14,017,504,314
(I) 合計(E+F+G+H)	47,785,450,698
次期繰越損益金(I)	47,785,450,698

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

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)

運用報告書(全体版)

第7期

(決算日 2023年6月15日)

(作成対象期間 2022年6月16日～2023年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）		
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券	
	外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式（預託証券を含みます。）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	ベビーファンドの株式実質上限組入比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2732>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
3期末(2019年6月17日)	円 14,011	円 0	% 0.6	円 14,073	% 0.5	% 95.8	% 1.3	% 2.9	百万円 4,523
4期末(2020年6月15日)	円 14,231	円 0	% 1.6	円 14,322	% 1.8	% 96.5	% 0.6	% 2.7	百万円 5,717
5期末(2021年6月15日)	円 20,848	円 0	% 46.5	円 21,033	% 46.9	% 91.8	% 5.9	% 2.3	百万円 9,292
6期末(2022年6月15日)	円 21,770	円 0	% 4.4	円 21,989	% 4.5	% 94.1	% 3.4	% 2.4	百万円 10,844
7期末(2023年6月15日)	円 26,685	円 0	% 22.6	円 27,024	% 22.9	% 93.8	% 4.3	% 2.1	百万円 17,911

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

(注6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

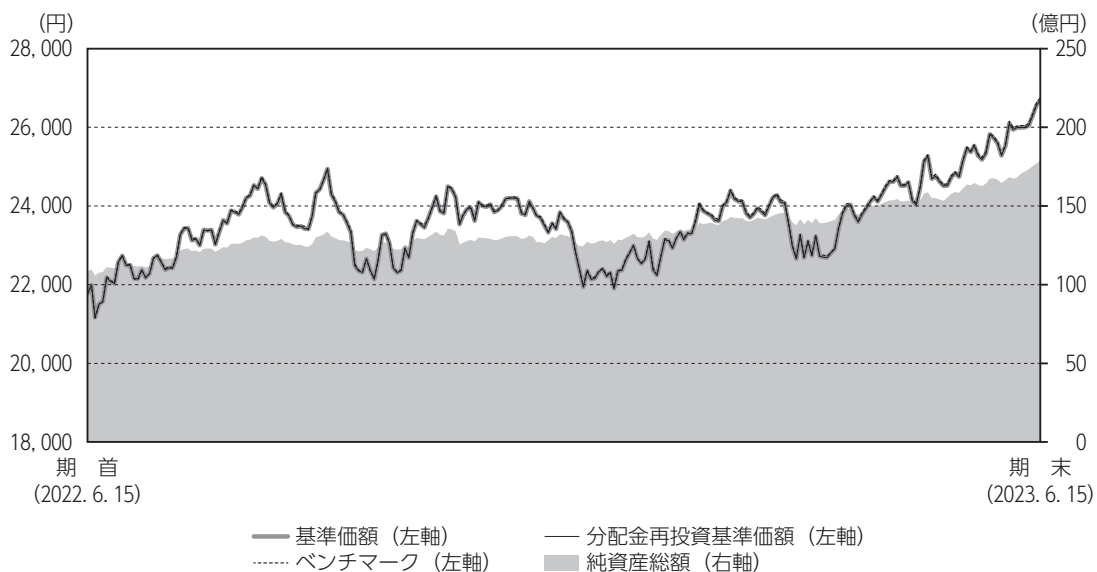
(注7) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

※ベンチマークを「MSCIコクサイ指数(円ベース)」から「MSCIコクサイ指数(税引後配当込み、円ベース)」に変更しました。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

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

*ベンチマークはMSCIコクサイ指数(税引後配当込み、円ベース)です。

※ベンチマークを「MSCIコクサイ指数(円ベース)」から「MSCIコクサイ指数(税引後配当込み、円ベース)」に変更しました。

■基準価額・騰落率

期首：21,770円

期末：26,685円(分配金0円)

騰落率：22.6%(分配金込み)

■基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資証券 組入比率
	円	騰 落 率 %	(ベンチマーク)	騰 落 率 %			
(期首)2022年 6月15日	21,770	—	21,989	—	94.1	3.4	2.4
6月末	22,496	3.3	22,743	3.4	94.6	2.9	2.5
7月末	23,374	7.4	23,600	7.3	93.8	3.8	2.5
8月末	23,526	8.1	23,764	8.1	93.0	4.5	2.5
9月末	22,365	2.7	22,571	2.6	93.3	4.3	2.3
10月末	24,498	12.5	24,762	12.6	92.2	5.7	2.2
11月末	23,772	9.2	24,042	9.3	89.7	8.1	2.2
12月末	22,305	2.5	22,554	2.6	91.3	6.4	2.2
2023年 1月末	23,138	6.3	23,418	6.5	90.1	7.6	2.3
2月末	23,944	10.0	24,213	10.1	93.0	5.0	2.2
3月末	23,817	9.4	24,087	9.5	92.4	5.6	2.1
4月末	24,461	12.4	24,730	12.5	92.1	5.7	2.1
5月末	25,591	17.6	25,891	17.7	91.8	6.4	2.0
(期末)2023年 6月15日	26,685	22.6	27,024	22.9	93.8	4.3	2.1

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■海外株式市況

海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より横ばいで推移し、2022年7月中旬に米国の利上げペース鈍化の可能性が意識されて上昇しましたが、8月以降はF R B（米国連邦準備制度理事会）議長講演において利上げ継続姿勢が強調されたことへの懸念から下落しました。10月以降は、英国政府が市場の懸念材料になっていた減税策の一部撤回を表明したことや、F R Bが今後利上げ幅を縮小させるのではないかと期待を背景に上昇しました。その後2023年2月には、米国の利上げ長期化への懸念から軟調な展開となり、3月には、米国の地方銀行の経営破綻やスイスの金融大手の株価急落により信用不安が高まり、続落しました。破綻した米国の地方銀行の預金保護や、F R Bによる金融機関への流動性供給、スイスの金融会社の救済合併の決定などにより、3月下旬には信用不安が後退したことから上昇しました。4月以降は、横ばいでの推移となりましたが、5月下旬以降は、AI（人工知能）関連で使用される半導体メーカーの強気見通しや、米国の債務上限問題の解決などが好感されて上昇し、当作成期末を迎えました。

■為替相場

為替相場は円安となりました。

対円為替相場は、当作成期首より2022年10月にかけて、世界の主要な中央銀行が政策金利見通しを大幅に引き上げたのに対し、日銀は指値オペを行い長期金利上昇の抑制を図るなど、金融政策の相違が明確となって円安が大きく進行しました。11月に入ると、米国のインフレ率の低下期待などから米国金利が低下したことで日米金利差の縮小が意識され、円高に転じました。12月には、日銀が想定外の政策修正を行ったことで金融緩和政策の転換などが意識され、日本の長期金利が大きく上昇するとともに円高が進行しました。2023年2月は、堅調な米国の経済指標を受けて米国金利が大きく上昇したことで、円安に転じて推移しました。3月は欧米の金融不安により円高に推移しましたが、当作成期末にかけては、日銀の金融緩和政策維持を受けて円安に推移しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

ポートフォリオについて

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

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

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

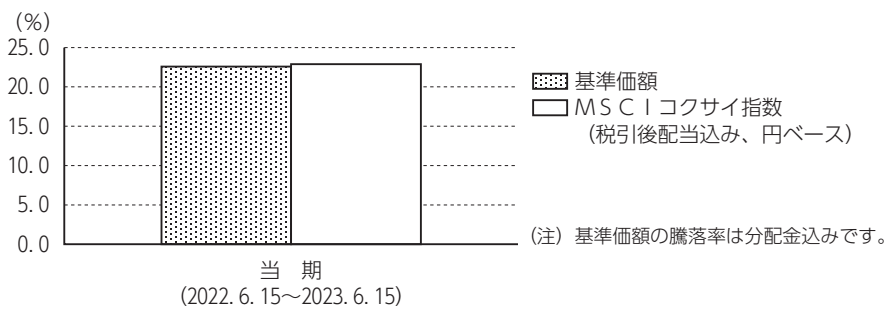
組入ファンド	ベンチマーク
外国株式インデックスマザーファンド	M S C I コクサイ指数 (税引後配当込み、円ベース)

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は22.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は22.6%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークはMSCI コクサイ指数 (税引後配当込み、円ベース) です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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	
	2022年6月16日 ～2023年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	16,685

- （注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- （注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
- （注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。
- （注4）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

1万口当りの費用の明細

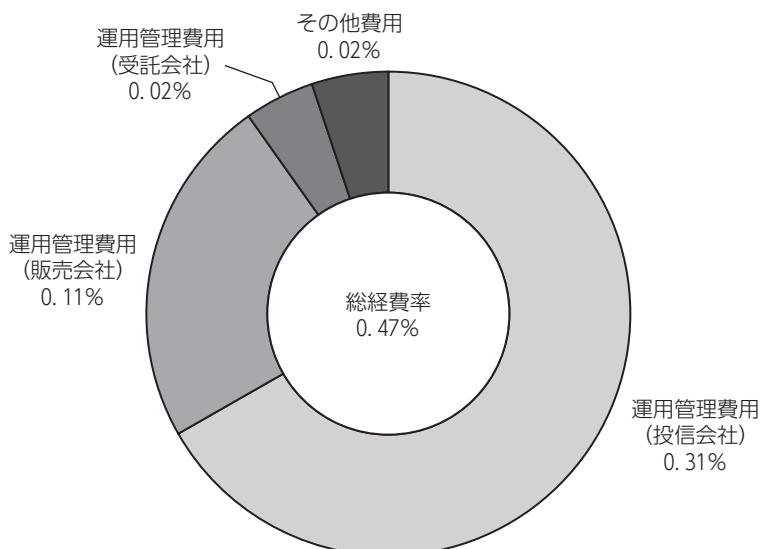
項目	当期 (2022. 6. 16~2023. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	105円	0.445%	信託報酬 = 当作成期中の平均基準価額 × 信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は23,654円です。
(投信会社)	(74)	(0.313)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(26)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(5)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0.004	売買委託手数料 = 当作成期中の売買委託手数料 / 当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(1)	(0.002)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.005	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)	(0.005)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	6	0.024	その他費用 = 当作成期中のその他費用 / 当作成期中の平均受益権口数
(保管費用)	(4)	(0.018)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	113	0.479	

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

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.47%です。



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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式 インデックス マザーファンド	1,359,311	5,872,166	421,286	1,824,725

(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

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

項 目	当 期	
	外国株式インデックスマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	41,410,049千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	274,144,565千円	
(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	評 価 額	口 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックス マザーファンド	2,749,365	3,687,390	17,909,289	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス マザーファンド	17,909,289	99.6
コール・ローン等、その他	63,447	0.4
投資信託財産総額	17,972,736	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=140.39円、1カナダ・ドル=105.30円、1オーストラリア・ドル=95.37円、1香港・ドル=17.93円、1シンガポール・ドル=104.58円、1ニュージーランド・ドル=86.93円、1イギリス・ポンド=177.72円、1イスラエル・シェケル=39.178円、1スイス・フラン=155.82円、1デンマーク・クローネ=20.42円、1ノルウェー・クローネ=13.16円、1スウェーデン・クローネ=13.09円、1ユーロ=152.15円です。

(注3) 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(350,339,836千円)の投資信託財産総額(357,217,192千円)に対する比率は、98.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	17,972,736,569円
コール・ローン等	63,214,766
外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	17,909,289,003
未収入金	232,800
(B) 負債	61,659,968
未払解約金	29,064,278
未払信託報酬	32,198,268
その他未払費用	397,422
(C) 純資産総額(A-B)	17,911,076,601
元本	6,711,991,187
次期繰越損益金	11,199,085,414
(D) 受益権総口数	6,711,991,187口
1万口当り基準価額(C/D)	26,685円

* 期首における元本額は4,981,572,692円、当作成期間中における追加設定元本額は2,849,753,966円、同解約元本額は1,119,335,471円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は26,685円です。

■損益の状況

当期 自 2022年6月16日 至 2023年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 8,552円
受取利息	699
支払利息	△ 9,251
(B) 有価証券売買損益	2,816,689,804
売買益	3,011,981,421
売買損	△ 195,291,617
(C) 信託報酬等	△ 60,766,192
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,755,915,060
(E) 前期繰越損益金	1,799,693,207
(F) 追加信託差損益金	6,643,477,147
(配当等相当額)	(3,404,483,553)
(売買損益相当額)	(3,238,993,594)
(G) 合計(D+E+F)	11,199,085,414
次期繰越損益金(G)	11,199,085,414
追加信託差損益金	6,643,477,147
(配当等相当額)	(3,404,483,553)
(売買損益相当額)	(3,238,993,594)
分配準備積立金	4,555,616,819
繰越損益金	△ 8,552

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

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

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

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	2,755,920,690
(c) 収益調整金	6,643,477,147
(d) 分配準備積立金	1,799,696,129
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	11,199,093,966
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	11,199,093,966
(h) 受益権総口数	6,711,991,187口

《お知らせ》

■ベンチマークの変更について

当ファンドおよびマザーファンドのベンチマークとして
いる株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更
しました。

変更前：MSCIコクサイ指数(円ベース)

変更後：MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「外国株式インデックスマザーファンド」の決算日（2022年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2023年6月15日）現在における外国株式インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を併せて掲載いたしました。

■外国株式インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC (アメリカ)	76.3	1,631,197	21,378	FERGUSON PLC (ジャージイ)	8.777	131,432	14,974
MICROSOFT CORP (アメリカ)	40.8	1,521,255	37,285	KONINKLIJKE DSM NV (オランダ)	7.276	127,629	17,541
AMAZON.COM INC (アメリカ)	59	861,407	14,600	ABIOMED INC (アメリカ)	2	101,117	50,558
TESLA INC (アメリカ)	26.7	768,268	28,774	SWEDISH MATCH AB (スウェーデン)	65.778	95,920	1,458
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	33.6	480,842	14,310	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP (アメリカ)	9	70,363	7,818
NVIDIA CORP (アメリカ)	13.7	446,348	32,580	ATLANTIA SPA (イタリア)	19.531	63,383	3,245
UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)	5.4	373,640	69,192	CANADIAN NATL RAILWAY CO (カナダ)	3.4	56,181	16,523
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	8.2	347,051	42,323	AVALARA INC (アメリカ)	3.65	50,471	13,827
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	14.4	325,126	22,578	ORRON ENERGY (スウェーデン)	8.05	43,607	5,417
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	16.8	313,972	18,688	MARATHON PETROLEUM CORP (アメリカ)	2.6	42,022	16,162

(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、2023年6月15日現在における外国株式インデックスマザーファンド（73,496,843千円）の内容です。

(1)外国株式

銘柄	株数	2023年6月15日現在		業種等
		評 価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	55	865	121,558	資本財・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	141	3,363	472,229	情報技術
FIRST SOLAR INC	47	907	127,367	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	83	1,362	191,308	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	62	655	92,046	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	30	379	53,299	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	211	707	99,353	金融
ABBOTT LABORATORIES	808.66	8,349	1,172,174	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	182.83	835	117,300	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	71	1,563	219,568	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	160	957	134,392	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	277	2,237	314,098	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	21	1,128	158,379	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	276	1,509	211,949	金融
QORVO INC	46.2	478	67,195	情報技術
AFLAC INC	268	1,842	258,706	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	56	938	131,795	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	79	687	96,578	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	213.2	10,223	1,435,288	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	89	603	84,714	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	54	2,036	285,965	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	71	756	106,205	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	103	2,975	417,667	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	310	6,216	872,681	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	98.42	556	78,122	金融
AUTOZONE INC	9.2	2,207	309,906	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	102.71	1,415	198,685	生活必需品
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	531	396	55,612	ヘルスケア
CELANESE CORP	49.5	575	80,855	素材
DR HORTON INC	149.16	1,694	237,884	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	96	365	51,295	ヘルスケア
AUTODESK INC	100	2,135	299,802	情報技術
MOODY'S CORP	77	2,623	368,308	金融
DEVON ENERGY CORP	306	1,497	210,285	エネルギー
ALBEMARLE CORP	55	1,247	175,122	素材
ATMOS ENERGY CORP	67	784	110,117	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	117	621	87,269	公益事業
CITIGROUP INC	906.73	4,374	614,075	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	193	4,170	585,501	資本財・サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	240	2,006	281,712	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	16.3	498	69,959	一般消費財・サービス
HESS CORP	129	1,728	242,732	エネルギー
DAVITA INC	27.5	268	37,634	ヘルスケア
DANAHER CORP	323.5	7,713	1,082,948	ヘルスケア

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
FORTIVE CORP	165	1,146	160,992	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	261	2,888	405,514	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	254	1,858	260,846	生活必需品
BUNGE LTD	70	667	93,673	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	146.95	1,935	271,763	情報技術
APPLE INC	7,374	135,644	19,043,163	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	124	1,452	203,921	金融
BOEING CO/THE	265	5,747	806,940	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	73.15	731	102,664	金融
BECTON DICKINSON AND CO	131.99	3,343	469,422	ヘルスケア
LEIDOS HOLDINGS INC	61	506	71,105	資本財・サービス
NISOURCE INC	193	524	73,590	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	55	520	73,052	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	375.71	1,659	232,978	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,956.04	6,988	981,176	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	605.5	20,338	2,855,356	金融
ANSYS INC	40	1,337	187,735	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	619.17	1,964	275,726	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	329	2,970	417,034	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	979	6,281	881,826	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	1,364.7	19,309	2,710,810	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	105	1,166	163,830	金融
LKQ CORP	125	680	95,588	一般消費財・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	144.12	936	131,433	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	127	2,997	420,883	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	49	1,562	219,395	金融
DOLLAR GENERAL CORP	102	1,653	232,152	生活必需品
SERVICENOW INC	95	5,389	756,624	情報技術
CATERPILLAR INC	240	5,839	819,832	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	113	729	102,481	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	117	482	67,690	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	24	497	69,887	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	136	821	115,360	公益事業
MOSAIC CO/THE	154	538	75,648	素材
DELTA AIR LINES INC	73	307	43,238	資本財・サービス
CORNING INC	375	1,246	174,996	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,907.5	9,720	1,364,677	情報技術
MORGAN STANLEY	583.52	5,133	720,735	金融
DECKERS OUTDOOR CORP	13	658	92,481	一般消費財・サービス
MSCI INC	37	1,798	252,553	金融
FAIR ISAAC CORP	12	954	133,974	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	15	459	64,573	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	105	620	87,119	資本財・サービス
BROADCOM INC	194.12	17,202	2,415,062	情報技術
UNITED THERAPEUTICS CORP	22	497	69,888	ヘルスケア
DICK'S SPORTING GOODS INC	31	418	58,753	一般消費財・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	58	1,151	161,622	ヘルスケア
ARAMARK	106	425	59,763	一般消費財・サービス
DTE ENERGY COMPANY	96	1,084	152,227	公益事業
CENTENE CORP	255.07	1,649	231,506	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	48	666	93,540	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	221	598	84,080	金融
DARLING INGREDIENTS INC	75	484	68,008	生活必需品
ARTHUR J GALLAGHER & CO	100	2,097	294,524	金融
GARTNER INC	37.5	1,321	185,509	情報技術
SPLUNK INC	74	770	108,210	情報技術
DOMINION ENERGY INC	389.41	2,046	287,341	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	366	2,140	300,486	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	57	396	55,719	資本財・サービス
DEERE & CO	131	5,227	733,896	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC	68	1,258	176,696	資本財・サービス
POOL CORP	18	621	87,283	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	123.84	1,252	175,875	金融
VMWARE INC-CLASS A	110	1,549	217,482	情報技術
BURLINGTON STORES INC	30	445	62,505	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	160	818	114,917	金融
VAIL RESORTS INC	19	474	66,583	一般消費財・サービス
TARGA RESOURCES CORP	98	695	97,642	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	34	388	54,606	金融
WESTLAKE CORP	18	204	28,729	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	161	1,487	208,827	公益事業
COGNEX CORP	79	441	61,997	情報技術
WEBSTER FINANCIAL CORP	79	306	43,098	金融
TELEFLEX INC	22	537	75,525	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	39	680	95,482	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	35	1,241	174,282	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	10	370	52,066	ヘルスケア
CATALENT INC	84	353	49,635	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	68	1,321	185,574	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	27	743	104,425	ヘルスケア
CARLISLE COS INC	24	566	79,550	資本財・サービス

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
IDEX CORP	35	727	102,135	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	368	2,775	389,646	生活必需品
ROLLINS INC	116.07	474	66,630	資本財・サービス
AECOM	62	534	75,030	資本財・サービス
WATSCO INC	16	578	81,201	資本財・サービス
GRACO INC	80	673	94,499	資本財・サービス
AMETEK INC	107	1,643	230,733	資本財・サービス
TORO CO	49	474	66,548	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	114	1,087	152,634	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	75.5	422	59,356	資本財・サービス
HEICO CORP	20	329	46,283	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	28	334	46,994	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	18	739	103,857	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	121	1,092	153,445	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	20	784	110,093	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	206.6	10,891	1,529,121	生活必需品
EPAM SYSTEMS INC	27	600	84,350	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	59	494	69,428	素材
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	28	713	100,179	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	13	2,679	376,177	一般消費財・サービス
UGI CORP	95	263	36,943	公益事業
CUMMINS INC	66	1,546	217,105	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	356	2,891	405,978	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	63	1,112	156,177	情報技術
COSTAR GROUP INC	189	1,564	219,699	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	46	1,475	207,119	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	20.9	2,532	355,572	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	34	547	76,796	金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	124.16	1,782	250,219	一般消費財・サービス
DEXCOM INC	181	2,299	322,866	ヘルスケア
NORDSON CORP	23.9	558	78,447	資本財・サービス
COPART INC	200	1,726	242,425	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	80	1,014	142,389	エネルギー
SEAGEN INC	65	1,275	179,048	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	34	1,096	153,918	ヘルスケア
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	37	760	106,802	金融
TRANSDIGM GROUP INC	25.9	2,100	294,836	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	73.2	548	76,940	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	46	433	60,846	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	94	945	132,784	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	941.81	1,591	223,452	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	102	2,898	406,968	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	18	497	69,783	金融
COTERRA ENERGY INC	355	861	120,908	エネルギー
T-MOBILE US INC	283.27	3,627	509,232	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	71.5	329	46,294	不動産
COCA-COLA CO/THE	1,914.5	11,651	1,635,774	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	101	661	92,818	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	73.5	864	121,388	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	140	376	52,910	金融
CSX CORP	954	3,156	443,181	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	41	930	130,649	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	68.25	743	104,372	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	4,302	54,385	7,635,234	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	281	2,543	357,137	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,889.05	19,865	2,788,882	エネルギー
AES CORP	312	647	90,844	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	20	682	95,776	金融
EOG RESOURCES INC	274	3,032	425,712	エネルギー
EQT CORP	169	649	91,226	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	73	671	94,275	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	5	640	89,898	金融
AMERISOURCEBERGEN CORP	81	1,450	203,608	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	138	1,647	231,323	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1,830.23	2,598	364,863	一般消費財・サービス
EXACT SCIENCES CORP	83	772	108,436	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	71.37	122	17,253	コミュニケーション・サービス
ENTEGRIS INC	70	792	111,274	情報技術
AERCAP HOLDINGS NV	82	497	69,831	資本財・サービス
FORTINET INC	310	2,215	311,087	情報技術
MARKEL CORP	6	798	112,090	金融
NEXTERA ENERGY INC	942.8	6,920	971,520	公益事業
MASIMO CORP	23	371	52,099	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	666.08	2,668	374,604	素材
INSULET CORP	32	907	127,402	ヘルスケア
US BANCORP	717	2,301	323,117	金融
UNITED RENTALS INC	32	1,299	182,385	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	28	419	58,853	情報技術
FASTENAL CO	266	1,474	207,033	資本財・サービス
FISERV INC	291.33	3,495	490,797	金融
GENERAL ELECTRIC CO	508.06	5,319	746,788	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	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
AXON ENTERPRISE INC	32	632	88,865	資本財・サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP	19	355	49,912	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	646	2,413	338,825	一般消費財・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	109	2,312	324,627	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	155.5	5,262	738,792	金融
FIRST HORIZON CORP	239	273	38,418	金融
ALPHABET INC-CL A	2,774	34,306	4,816,227	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	2,499.4	31,087	4,364,379	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	43	521	73,262	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	273	2,201	309,102	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	253.18	982	137,981	公益事業
GENUINE PARTS CO	66.5	1,055	148,179	一般消費財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	312	809	113,665	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	88.5	1,689	237,221	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	420	1,346	188,978	エネルギー
REPLIGEN CORP	25	403	56,657	ヘルスケア
HOME DEPOT INC	471.5	14,131	1,983,896	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	24.5	316	44,408	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	672	727	102,172	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	19.1	411	57,736	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	69	1,798	252,431	生活必需品
HUMANA INC	58	2,639	370,489	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	121	2,367	332,422	情報技術
HENRY SCHEIN INC	61	456	64,065	ヘルスケア
HP INC	473	1,463	205,521	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	604	1,015	142,541	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	73.28	223	31,336	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	92	719	101,079	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	174	1,219	171,190	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	373.03	1,367	192,039	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	64	1,146	161,010	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	423	5,803	814,761	情報技術
HUBBELL INC	25	788	110,715	資本財・サービス
INTERNATIONAL PAPER CO	153	486	68,305	素材
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	59	389	54,692	資本財・サービス
ZOETIS INC	215	3,561	499,995	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	106.99	1,940	272,438	資本財・サービス
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	68	626	87,894	情報技術
CHENIERE ENERGY INC	114	1,675	235,265	エネルギー
HYATT HOTELS CORP - CL A	23	268	37,743	一般消費財・サービス
ALLEGION PLC	40.5	472	66,393	資本財・サービス
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	68	822	115,512	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	129.73	236	33,201	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	120.37	1,647	231,225	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	150	475	66,713	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	50	762	107,019	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	1,210	19,548	2,744,450	ヘルスケア
ABBVIE INC	821.72	11,194	1,571,566	ヘルスケア
HOLOGIC INC	115	899	126,285	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	157	2,121	297,821	生活必需品
KROGER CO	318	1,501	210,764	生活必需品
KLA CORP	64	3,075	431,763	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	107	4,842	679,808	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	33	791	111,091	金融
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	105	416	58,521	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	277	5,951	835,548	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	375.85	16,827	2,362,420	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	62.8	3,956	555,465	情報技術
LOEWS CORP	91	528	74,251	金融
MCDONALD'S CORP	340.5	9,821	1,378,823	一般消費財・サービス
3M CO	256.9	2,619	367,694	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	1,031	28,182	3,956,525	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	153.39	6,029	846,496	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	29	1,234	173,360	素材
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	26.2	711	99,841	情報技術
ALCOA CORP	80	289	40,578	素材
PHILLIPS 66	214	2,047	287,515	エネルギー
ATLIASSIAN CORP PLC-CLASS A	71	1,286	180,644	情報技術
MGM RESORTS INTERNATIONAL	160.5	703	98,782	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	117	1,064	149,440	生活必需品
METLIFE INC	306	1,650	231,722	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	399	2,512	352,674	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	122	2,062	289,593	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	77.98	2,170	304,682	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	10	1,315	184,692	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	472.23	1,413	198,491	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	53	1,659	232,982	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	1,182.21	12,845	1,803,435	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	225.51	1,577	221,425	素材
MASCO CORP	103	569	79,950	資本財・サービス
M & T BANK CORP	77.99	950	133,468	金融

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
MARSH & MCLENNAN COS	230.7	4,108	576,829	金融
BLACK KNIGHT INC	73.5	418	58,816	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	34.2	449	63,036	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	123.02	2,232	313,395	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	95	2,064	289,827	情報技術
BLOCK INC CLASS A	252.12	1,605	225,431	金融
TRANSUNION	90	679	95,407	資本財・サービス
VISTRA CORP	176	436	61,302	公益事業
NOVOCURE LTD	43.5	195	27,481	ヘルスケア
NETAPP INC	98	718	100,847	情報技術
NIKE INC -CL B	572	6,455	906,300	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	106	2,346	329,472	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	255	2,209	310,166	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	96.05	943	132,498	金融
ALLY FINANCIAL INC	142	402	56,556	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	67	3,000	421,300	資本財・サービス
APTIV PLC	126	1,272	178,678	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	370.11	1,558	218,750	素材
MCKESSON CORP	64	2,504	351,536	ヘルスケア
XYLEM INC	113	1,263	177,328	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	723	6,728	944,577	生活必需品
NUCOR CORP	117	1,762	247,435	素材
GODADDY INC - CLASS A	70	521	73,144	情報技術
EVERGY INC	107.5	633	88,921	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	335.24	1,960	275,185	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	12.5	271	38,103	金融
OKTA INC	72	535	75,224	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	56	421	59,121	コミュニケーション・サービス
WIX.COM LTD	26.1	222	31,248	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	168	449	63,138	金融
KKR & CO INC	282	1,608	225,781	金融
PAYCHEX INC	151	1,684	236,452	資本財・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	29	2,637	370,342	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	832	3,656	513,355	生活必需品
P G & E CORP	845	1,456	204,517	公益事業
PFIZER INC	2,630.13	10,352	1,453,344	ヘルスケア
CIGNA CORP	139	3,666	514,726	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	118.01	582	81,809	情報技術
XCEL ENERGY INC	256	1,599	224,588	公益事業
STERIS PLC	46	980	137,631	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	180	1,145	160,819	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	65.33	203	28,606	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	136.99	456	64,023	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	158.8	4,661	654,482	ヘルスケア
DOW INC	330.18	1,743	244,795	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	51	365	51,264	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	110	752	105,629	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	60	2,205	309,602	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	853	3,520	494,219	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	109	2,193	308,008	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,098.67	16,086	2,258,415	生活必需品
EXELON CORP	463.22	1,858	260,906	公益事業
INGERSOLL-RAND INC	189.08	1,212	170,206	資本財・サービス
NVR INC	1.5	882	123,962	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	567.02	5,821	817,293	エネルギー
TWILIO INC - A	83	550	77,243	情報技術
DOCUSIGN INC	94	508	71,393	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	25	799	112,280	資本財・サービス
CERIDIAN HCM HOLDING INC	68	449	63,064	資本財・サービス
PEPSICO INC	642	11,759	1,650,918	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	20.2	306	43,076	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	121	303	42,637	情報技術
MONGODB INC	33	1,236	173,542	情報技術
SNAP INC - A	497	509	71,518	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	331.68	1,891	265,557	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	171	1,462	205,353	金融
AMCOR PLC	693	704	98,846	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	104	1,601	224,790	情報技術
ROKU INC	55	403	56,652	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	91	1,329	186,662	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	294	9,262	1,300,358	情報技術
PENTAIR PLC	74.75	452	63,584	資本財・サービス
QUALCOMM INC	519	6,404	899,122	情報技術
INVESCO LTD	152	251	35,337	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	27.5	193	27,102	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	111	803	112,745	金融
DATADOG INC - CLASS A	116	1,116	156,794	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	277	676	94,964	コミュニケーション・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	50	3,855	541,280	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	103	1,478	207,590	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	18	4,697	659,499	一般消費財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
ROSS STORES INC	158	1,678	235,657	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	42.3	555	78,008	素材
RESMED INC	68	1,473	206,815	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	52.3	712	100,040	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	49	349	49,096	資本財・サービス
MODERNA INC	153	1,928	270,751	ヘルスケア
HUBSPOT INC	21.8	1,098	154,230	情報技術
REVVITY INC	59	680	95,585	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	388.87	1,795	252,003	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	192.38	1,683	236,349	資本財・サービス
BILL HOLDINGS INC	45	514	72,171	情報技術
AVANTOR INC	315	616	86,499	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	102	312	43,861	金融
DYNATRACE INC	101	523	73,477	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	207	1,589	223,215	コミュニケーション・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	434.85	783	109,948	金融
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	132	364	51,239	コミュニケーション・サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	176	565	79,438	ヘルスケア
MATCH GROUP INC	126	555	78,026	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	837.18	13,151	1,846,305	エネルギー
ZSCALER INC	41	645	90,685	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	178	1,213	170,352	公益事業
ETSY INC	57	541	76,069	一般消費財・サービス
TESLA INC	1,333.5	34,242	4,807,367	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	122	2,209	310,129	情報技術
GEN DIGITAL INC	267	489	68,783	情報技術
UNITY SOFTWARE INC	113	463	65,106	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	71.02	632	88,827	資本財・サービス
SYNOPSYS INC	71	3,166	444,608	情報技術
CHEWY INC - CLASS A	43.5	172	24,250	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	127	874	122,791	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	50.05	1,677	235,564	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	558.21	544	76,486	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	119.5	854	119,952	一般消費財・サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	197	786	110,378	コミュニケーション・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	193	2,415	339,070	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	145	1,136	159,574	不動産
SOUTHERN CO/THE	508	3,580	502,650	公益事業
SYSCO CORP	236	1,718	241,300	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	108.03	1,874	263,211	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	29	121	17,066	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	53	311	43,676	金融
STEEL DYNAMICS INC	81.5	853	119,784	素材
SCHLUMBERGER LTD	661.52	3,127	439,000	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	70	311	43,780	資本財・サービス
AT&T INC	3,320.91	5,260	738,496	コミュニケーション・サービス
APA CORP	144	484	68,027	エネルギー
SOUTHWEST AIRLINES CO	69.5	233	32,754	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	201	1,864	261,697	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	100	491	69,057	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	114	2,802	393,469	素材
SEMPRA ENERGY	147	2,165	303,967	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	105	560	78,746	情報技術
CLARIVATE PLC	175	155	21,865	資本財・サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	841	1,338	187,846	情報技術
UIPATH INC - CLASS A	175	314	44,198	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	88.5	577	81,119	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	78	420	59,022	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC	423	7,492	1,051,826	情報技術
SALESFORCE.COM INC	465.66	9,750	1,368,931	情報技術
WESTROCK CO	119	347	48,832	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	186.09	1,417	198,943	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	320.34	2,066	290,072	資本財・サービス
TERADYNE INC	73	805	113,102	情報技術
UNION PACIFIC CORP	283.8	5,753	807,770	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	299	682	95,748	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	221.88	2,477	347,755	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	680.79	6,594	925,750	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	337	5,893	827,382	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	87.04	1,851	259,934	ヘルスケア
AMEREN CORPORATION	122	1,010	141,884	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	434.66	19,988	2,806,153	ヘルスケア
TOAST INC CLASS A	144	335	47,063	金融
VERISIGN INC	44	971	136,385	情報技術
LUCID GROUP INC	305	195	27,404	一般消費財・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	309	455	63,942	一般消費財・サービス
VALERO ENERGY CORP	176.42	1,972	276,976	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	23	1,020	143,230	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	116.88	404	56,856	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	28.3	413	58,081	ヘルスケア
ELEVANCE HEALTH INC	111	4,843	679,945	ヘルスケア

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
WALT DISNEY CO/THE	850.62	7,863	1,104,024	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,752.22	7,373	1,035,143	金融
WASTE MANAGEMENT INC	189	3,069	430,960	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	568	1,715	240,819	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	51	1,112	156,114	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	24	350	49,179	一般消費財・サービス
WALMART INC	690	10,824	1,519,585	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	98	1,391	195,380	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	48	496	69,745	一般消費財・サービス
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	920	312	43,913	資本財・サービス
WABTEC CORP	84.11	855	120,042	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	537	4,290	602,361	一般消費財・サービス
WATERS CORP	27	707	99,342	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	24	672	94,470	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	342	1,077	151,290	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	49.63	1,133	159,138	金融
WESTERN DIGITAL CORP	149	602	84,634	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	147	1,330	186,829	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	232	1,436	201,708	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	757.5	16,925	2,376,182	金融
PPL CORP	343	921	129,341	公益事業
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	153.24	1,428	200,504	公益事業
PULTEGROUP INC	103.5	758	106,434	一般消費財・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	1,077.53	1,472	206,792	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC	110	1,547	217,281	素材
NORTHERN TRUST CORP	97	720	101,112	金融
FERGUSON PLC	96	1,440	202,202	資本財・サービス
NVIDIA CORP	1,150.8	49,480	6,946,630	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	186.13	2,354	330,606	金融
ASPEN TECHNOLOGY CORP	14	230	32,341	情報技術
TYSON FOODS INC-CL A	132	656	92,212	生活必需品
NETFLIX INC	206.9	9,121	1,280,552	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	179	9,310	1,307,051	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	105.5	362	50,861	公益事業
GLOBE LIFE INC	42.55	455	63,917	金融
TEXTRON INC	94	613	86,160	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	178.87	344	48,364	コミュニケーション・サービス
TEXAS PACIFIC LAND CORP	3.5	465	65,369	エネルギー
OMNICOM GROUP	93	879	123,538	コミュニケーション・サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	59.2	682	95,818	資本財・サービス
ORACLE CORP	755.33	9,235	1,296,560	情報技術
MASTERCARD INC - A	396	14,840	2,083,457	金融
ONEOK INC	208	1,256	176,462	エネルギー
ROPER TECHNOLOGIES INC	50	2,282	320,398	情報技術
U HAUL NON VOTING SERIES N	46	224	31,469	資本財・サービス
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	74	696	97,831	金融
CHESAPEAKE ENERGY CORP	52	414	58,227	エネルギー
HF SINCLAIR CORP	73	325	45,708	エネルギー
OVINTIV INC	113	416	58,506	エネルギー
YUM! BRANDS INC	130	1,772	248,848	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	79	1,079	151,533	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	88	593	83,329	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	3,353.01	9,763	1,370,763	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	22	877	123,147	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	88	830	116,637	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	295	5,146	722,568	金融
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	169.35	1,329	186,705	ヘルスケア
LINDE PLC	228.46	8,551	1,200,543	素材
ANALOG DEVICES INC	235.91	4,526	635,528	情報技術
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	141	295	41,450	生活必需品
MONDAYCOM LTD	9	164	23,110	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	750.27	9,553	1,341,172	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	338.72	1,891	265,535	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	73	802	112,620	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	107	1,013	142,285	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	38.3	639	89,843	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	237	1,509	211,978	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	269	2,309	324,173	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	96	3,100	435,280	金融
AMGEN INC	249	5,534	777,026	ヘルスケア
EATON CORP PLC	185.36	3,578	502,420	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	77	1,901	267,018	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	393	5,547	778,881	情報技術
CME GROUP INC	168	3,049	428,100	金融
ECOLAB INC	119	2,139	300,397	素材
EQUIFAX INC	57	1,309	183,819	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	582	4,536	636,905	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	429	1,362	191,281	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	140	577	81,075	生活必需品
STATE STREET CORP	167.13	1,223	171,751	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	701.4	3,812	535,181	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2023年6月15日現在			業種等	
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千アメリカ・ドル	千円		
BAXTER INTERNATIONAL INC	236	1,025	143,958	ヘルスケア	
CAMPBELL SOUP CO	94	431	60,585	生活必需品	
CROWN HOLDINGS INC	55.8	476	66,837	素材	
CARDINAL HEALTH INC	121	1,052	147,737	ヘルスケア	
FEDEX CORP	112	2,572	361,125	資本財・サービス	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	177.54	1,994	279,980	金融	
FMC CORP	58.5	611	85,856	素材	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	119.13	932	130,954	素材	
INTEL CORP	1,944	6,916	971,042	情報技術	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	180	722	101,434	コミュニケーション・サービス	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	144.5	1,020	143,302	金融	
WOLFSPEED INC	58	327	45,997	情報技術	
ILLINOIS TOOL WORKS	142	3,471	487,340	資本財・サービス	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	386	145	20,429	コミュニケーション・サービス	
ILLUMINA INC	74	1,515	212,805	ヘルスケア	
SEALED AIR CORP	67	262	36,806	素材	
INTUITIVE SURGICAL INC	163	5,266	739,299	ヘルスケア	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	48.5	625	87,746	情報技術	
SNAP-ON INC	25	679	95,387	資本財・サービス	
CARMAX INC	74	589	82,799	一般消費財・サービス	
DUKE ENERGY CORP	359.28	3,264	458,241	公益事業	
TARGET CORP	214	2,851	400,269	生活必需品	
DOVER CORP	64	929	130,443	資本財・サービス	
WW GRAINGER INC	21	1,526	214,354	資本財・サービス	
CINTAS CORP	43	2,090	293,441	資本財・サービス	
CONAGRA BRANDS INC	222	775	108,927	生活必需品	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	68	782	109,784	生活必需品	
CLOROX COMPANY	58	892	125,347	生活必需品	
ENTERGY CORP	99	1,002	140,792	公益事業	
MICROSOFT CORP	3,294	111,119	15,600,108	情報技術	
INCYTE CORP	86	528	74,179	ヘルスケア	
CVS HEALTH CORP	596.69	3,976	558,322	ヘルスケア	
MEDTRONIC PLC	619.98	5,450	765,159	ヘルスケア	
MICRON TECHNOLOGY INC	510	3,525	494,891	情報技術	
BLACKROCK INC	70	4,847	680,491	金融	
CENTERPOINT ENERGY INC	293	850	119,412	公益事業	
HASBRO INC	60	371	52,149	一般消費財・サービス	
KELLOGG CO	128	846	118,853	生活必需品	
KEYCORP	431	427	59,963	金融	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	635.11	4,644	652,049	生活必需品	
COOPER COS INC/THE	23	834	117,127	ヘルスケア	
CHUBB LTD	192.99	3,644	511,640	金融	
ARROW ELECTRONICS INC	29	399	56,155	情報技術	
ALLSTATE CORP	123	1,370	192,365	金融	
EBAY INC	249	1,122	157,551	一般消費財・サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	496.5	3,157	443,315	金融	
EASTMAN CHEMICAL CO	55	450	63,292	素材	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	108	2,075	291,355	生活必需品	
TRIMBLE INC	115	597	83,824	情報技術	
LENNAR CORP-A	118	1,354	190,095	一般消費財・サービス	
LEAR CORP	28	405	56,864	一般消費財・サービス	
PROGRESSIVE CORP	273	3,465	486,477	金融	
PACCAR INC	242.55	1,893	265,806	資本財・サービス	
BIOGEN INC	67	2,009	282,174	ヘルスケア	
IDEXX LABORATORIES INC	39	1,821	255,675	ヘルスケア	
STARBUCKS CORP	535	5,385	756,043	一般消費財・サービス	
PTC INC	52	735	103,211	情報技術	
EVERSOURCE ENERGY	162	1,132	158,974	公益事業	
INTUIT INC	130.8	5,836	819,394	情報技術	
BORGWARNER INC	106	506	71,132	一般消費財・サービス	
BEST BUY CO INC	92.5	708	99,525	一般消費財・サービス	
BALL CORP	146.04	795	111,656	素材	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	669.97	3,571	501,418	ヘルスケア	
ELECTRONIC ARTS INC	128	1,637	229,835	コミュニケーション・サービス	
VULCAN MATERIALS CO	62	1,285	180,515	素材	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	120	4,091	574,408	ヘルスケア	
VF CORP	147	283	39,768	一般消費財・サービス	
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	271.25	450	63,214	コミュニケーション・サービス	
MOHAWK INDUSTRIES INC	25	247	34,725	一般消費財・サービス	
CARNIVAL CORP	468	730	102,495	一般消費財・サービス	
CLEVELAND-CLIFFS INC	231	386	54,223	素材	
COMCAST CORP-CLASS A	1,961.9	8,012	1,124,860	コミュニケーション・サービス	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	87	432	60,788	資本財・サービス	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	535	219	30,794	不動産	
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	158,494.49 604銘柄	1,766,559	248,007,345 <69.5%>	
(カナダ)		百株	千カナダ・ドル	千円	
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	355	2,308	243,129	生活必需品	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	151.81	678	71,455	金融	
IMPERIAL OIL LTD	95	628	66,213	エネルギー	

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千カナダ・ドル	千円		
CONSTELLATION SOFTWARE INC	9	2,482	261,413	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	131.87	1,340	141,191	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	198	1,176	123,907	素材
INTACT FINANCIAL CORP	78.5	1,553	163,560	金融
BCE INC	49.3	297	31,339	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	85	1,640	172,699	素材
SUNCOR ENERGY INC	592.3	2,353	247,792	エネルギー
METRO INC/CN	103	732	77,114	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	150	1,482	156,054	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	530	3,514	370,069	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	403	2,322	244,600	金融
TORONTO-DOMINION BANK	810	6,473	681,661	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	125	480	50,636	金融
ROYAL BANK OF CANADA	616.5	7,717	812,636	金融
TOURMALINE OIL CORP	144	857	90,327	エネルギー
TC ENERGY CORP	453.5	2,468	259,970	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	245.29	1,009	106,260	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	783	1,751	184,440	素材
CAE INC	142	393	41,448	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	75.12	1,269	133,697	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	71	246	25,935	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	35	371	39,136	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	65.5	411	43,286	素材
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	176	357	37,695	金融
HYDRO ONE LTD	144	536	56,543	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	69.6	814	85,762	生活必需品
NORTHLAND POWER INC	112	309	32,621	公益事業
WSP GLOBAL INC	55	966	101,802	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	37	398	41,984	資本財・サービス
PARKLAND CORP	66	223	23,497	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	68	226	23,808	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	118	646	68,091	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC	35	494	52,101	資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A	54	187	19,770	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	158	922	97,179	コミュニケーション・サービス
BRP INC/CA- SUB VOTING	16	172	18,111	一般消費財・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	267	316	33,344	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	221.17	1,478	155,734	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	293	326	34,339	公益事業
AIR CANADA	76	178	18,838	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	561	363	38,279	素材
BANK OF MONTREAL	317	3,749	394,786	金融
POWER CORP OF CANADA	260	912	96,042	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	533	4,682	493,057	情報技術
NUTRIEN LTD	231.19	1,804	189,982	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	58	255	26,933	公益事業
CAMECO CORP	189	786	82,850	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	18	353	37,225	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	97	485	51,080	資本財・サービス
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	26	103	10,855	金融
TELUS CORP	108	275	28,976	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	205	1,184	124,726	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	24	410	43,275	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	493	3,644	383,792	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	10	980	103,279	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	121	907	95,521	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	31.37	480	50,622	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	170	341	35,963	素材
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	38	391	41,226	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	261	1,758	185,127	金融
ENBRIDGE INC	900	4,424	465,889	エネルギー
BROOKFIELD CORP	626.25	2,761	290,813	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	818	2,099	221,109	金融
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	414.2	4,291	451,897	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	44	400	42,217	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	75	301	31,771	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	252.5	3,926	413,420	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	94	1,314	138,426	情報技術
ONEX CORPORATION	29	203	21,421	金融
IGM FINANCIAL INC	36	147	15,546	金融
TMX GROUP LTD	125	373	39,290	金融
OPEN TEXT CORP	121	677	71,351	情報技術
SAPUTO INC	108	337	35,561	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	258	798	84,110	素材
FORTIS INC	216	1,220	128,485	公益事業
RB GLOBAL INC	84	637	67,117	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	278	298	31,410	素材
CENOVUS ENERGY INC	632	1,400	147,473	エネルギー
DOLLARAMA INC	128	1,099	115,739	一般消費財・サービス
ALTAGAS LTD	121	296	31,267	公益事業
KEYERA CORP	102	311	32,780	エネルギー

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄		2023年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千カナダ・ドル	千円	
ARC RESOURCES LTD		286	484	51,016	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	17,962.97 85銘柄	106,200	11,182,931 <3.1%>	
(オーストラリア)		百株	千オーストラリア・ドル	千円	
THE LOTTERY CORPORATION LTD		955.15	483	46,092	一般消費財・サービス
TELSTRA GROUP LTD		1,767.57	768	73,329	コミュニケーション・サービス
ANZ GROUP HOLDINGS LTD		1,310.29	3,003	286,413	金融
MEDIBANK PRIVATE LTD		1,165.53	420	40,127	金融
BHP GROUP LTD		2,208.95	10,139	966,964	素材
SOUTH32 LTD		1,942.63	757	72,254	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD		827.95	2,868	273,601	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD		738.42	1,602	152,818	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		1,367.92	3,489	332,799	金融
WESTPAC BANKING CORP		1,530.58	3,146	300,117	金融
SANTOS LTD		1,449.25	1,056	100,758	エネルギー
RIO TINTO LTD		161.87	1,880	179,307	素材
ORIGIN ENERGY LTD		752.81	639	60,954	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD		751	268	25,569	資本財・サービス
PILBARA MINERALS LTD		1,131.84	552	52,676	素材
XERO LTD		63.02	701	66,917	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		103.88	330	31,494	金融
COLES GROUP LTD		585.09	1,046	99,826	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD		73.81	577	55,117	情報技術
IDP EDUCATION LTD		111.69	264	25,223	一般消費財・サービス
IGO LTD		304.05	460	43,901	素材
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		497.26	648	61,840	素材
REECE LTD		105	197	18,816	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI		606.6	359	34,305	生活必需品
SEEK LTD		142.64	308	29,383	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD		309.76	353	33,736	生活必需品
NEWCREST MINING LTD		390.92	1,019	97,231	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		735.93	7,165	683,397	金融
AMPOL LTD		104.54	319	30,438	エネルギー
ORICA LTD		194.99	295	28,191	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		650.87	984	93,855	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD		531.52	2,039	194,501	生活必需品
QANTAS AIRWAYS LTD		390.82	249	23,817	資本財・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI		188.01	734	70,090	素材
MACQUARIE GROUP LTD		160.1	2,850	271,859	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD		257.5	980	93,516	一般消費財・サービス
CSL LTD		210.34	6,042	576,227	ヘルスケア
WESFARMERS LTD		494.7	2,384	227,405	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD		28.23	670	63,933	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD		191.24	392	37,443	素材
SUNCORP GROUP LTD		542.49	712	67,982	金融
ASX LTD		83.07	505	48,183	金融
COMPUTERSHARE LTD		251.69	574	54,776	資本財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		1,039.87	543	51,867	金融
SONIC HEALTHCARE LTD		195.99	686	65,439	ヘルスケア
BRAMBLES LTD		607.6	836	79,792	資本財・サービス
MINERAL RESOURCES LTD		76.02	542	51,707	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD		78.57	451	43,086	ヘルスケア
REA GROUP LTD		22.36	296	28,255	コミュニケーション・サービス
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	28,391.93 49銘柄	67,603	6,447,349 <1.8%>	
(香港)		百株	千香港・ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		680	2,798	50,171	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		1,080	5,545	99,436	一般消費財・サービス
MTR CORP		765	2,815	50,476	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES		715	7,235	129,737	不動産
SINO LAND CO		1,820	1,765	31,653	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		1,321.69	6,456	115,764	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		240	1,285	23,043	不動産
CLP HOLDINGS LTD		805	4,552	81,622	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT		665.07	1,566	28,082	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		5,364.75	3,674	65,890	公益事業
HANG SENG BANK LTD		366	4,128	74,023	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT		725	1,447	25,946	不動産
WH GROUP LTD		3,990	1,655	29,689	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		591	18,391	329,767	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD		970	1,264	22,679	不動産
XINYI GLASS HOLDINGS LTD		870	1,078	19,342	資本財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		540	1,067	19,132	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD		956.69	4,262	76,418	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		300	1,252	22,457	公益事業
AIA GROUP LTD		5,656	46,464	833,100	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS		640	897	16,088	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		800	3,284	58,882	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		824	1,751	31,395	生活必需品

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千香港・ドル	千円	
ESR CAYMAN LTD	958	1,339	24,013	不動産
SANDS CHINA LTD	1,196	3,408	61,116	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	680	5,548	99,489	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,770	4,265	76,484	金融
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	35,289.2 27銘柄	139,202 <0.7%>	2,495,905
	(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND INVESTMENT LTD	1,281	430	45,012	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD	623	1,748	182,885	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	892	2,779	290,677	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	659.75	501	52,437	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	717	479	50,164	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	229	153	16,045	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	246	170	17,880	不動産
SEATRUM	20,160.22	258	26,986	資本財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	44	147	15,410	資本財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,667	2,072	216,698	金融
GENTING SINGAPORE LTD	2,795	265	27,768	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	128	194	20,333	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,066.5	1,012	105,893	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	722	267	28,013	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	422	409	42,808	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD	946	380	39,770	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>	35,598.47 16銘柄	11,271 <0.3%>	1,178,786
	(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	595.68	322	28,066	公益事業
MERCURY NZ LTD	341.43	217	18,891	公益事業
EBOS GROUP LTD	76.6	273	23,732	ヘルスケア
SPARK NEW ZEALAND LTD	921.47	471	41,012	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	616.44	511	44,423	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	276.26	657	57,132	ヘルスケア
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,827.88 6銘柄	2,453 <0.1%>	213,258
	(イギリス)	百株	千イギリス・ポンド	千円
SHELL PLC	3,151.29	7,262	1,290,628	エネルギー
HALEON PLC	2,313.33	737	131,107	生活必需品
WISE PLC CLASS A	302.73	187	33,356	金融
BP PLC	8,165.09	3,765	669,174	エネルギー
UNILEVER PLC	1,150.22	4,563	811,024	生活必需品
BARCLAYS PLC	7,075.53	1,113	197,975	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	3,810.6	574	102,090	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	1,254.14	1,424	253,198	金融
NATWEST GROUP PLC	2,627.37	697	123,924	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	83.88	147	26,244	素材
BAE SYSTEMS PLC	1,390.42	1,321	234,849	資本財・サービス
AVIVA PLC	1,270.14	509	90,472	金融
GSK	1,866.14	2,544	452,172	ヘルスケア
INFORMA PLC	629.95	443	78,860	コミュニケーション・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	410.19	262	46,713	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	43.01	200	35,658	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	238.27	97	17,323	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	32.7	371	66,076	資本財・サービス
HALMA PLC	168.64	409	72,798	情報技術
ENTAIN PLC	268.61	324	57,595	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	1,128.04	167	29,720	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	326.8	180	32,129	金融
M&G PLC	1,045.04	211	37,534	金融
ENDEAVOUR MINING PLC	91.41	187	33,335	素材
RELX PLC	866.25	2,234	397,190	資本財・サービス
DIAGEO PLC	1,026.28	3,464	615,659	生活必需品
RIO TINTO PLC	512.79	2,737	486,468	素材
STANDARD CHARTERED PLC	1,085.04	726	129,198	金融
TESCO PLC	3,333.84	880	156,417	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	398.59	497	88,475	ヘルスケア
GLENCORE PLC	4,873.97	2,292	407,418	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	150.95	127	22,652	金融
SMITHS GROUP PLC	153.83	261	46,530	資本財・サービス
PEARSON PLC	283.63	233	41,464	一般消費財・サービス
SAINSBURY (J) PLC	782.74	213	37,907	生活必需品
NEXT PLC	56.2	362	64,441	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	1,570.39	173	30,797	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	92.18	313	55,699	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	154.1	478	85,062	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	11,455.92	834	148,298	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	62.03	342	60,918	素材
KINGFISHER PLC	857.79	204	36,312	一般消費財・サービス
WPP PLC	489.68	428	76,130	コミュニケーション・サービス

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	311.05	323	57,435	公益事業
SEVERN TRENT PLC	114.75	310	55,143	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	1,147.75	736	130,953	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	326.21	1,926	342,394	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	241.74	277	49,341	金融
SCHRODERS PLC	398.15	182	32,393	金融
SSE PLC	496.92	912	162,186	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	432.45	195	34,715	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	705.92	8,125	1,443,999	ヘルスケア
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,720.67	647	115,077	金融
3I GROUP PLC	443.31	900	160,012	金融
ASHTREAD GROUP PLC	199.73	1,094	194,447	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	466.65	408	72,533	情報技術
NATIONAL GRID PLC	1,675.57	1,728	307,162	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	30,160.79	1,365	242,735	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	399.67	696	123,768	生活必需品
CENTRICA PLC	2,799.88	328	58,293	公益事業
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	49.18	193	34,454	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	967.41	2,486	441,855	生活必需品
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	158	296	52,775	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	9,100.1	5,558	987,828	金融
ANGLO AMERICAN PLC	578.76	1,494	265,628	素材
MONDI PLC	221.49	279	49,676	素材
COMPASS GROUP PLC	794.35	1,731	307,754	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	139.15	162	28,896	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	3,453	472	83,949	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	101.36	236	42,116	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	170.53	385	68,523	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	80.05	443	78,814	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	71.69	315	55,982	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	185.64	1,607	285,644	金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	73.61	139	24,855	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	97.79	220	39,120	金融
ANTOFAGASTA PLC	175.13	273	48,553	素材
ABRDN PLC	908.62	196	34,992	金融
EXPERIAN PLC	418.57	1,244	221,230	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 >	127,835.38 79銘柄	82,411 <4.1%>	14,646,258
(イスラエル)	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	609.11	1,147	44,959	金融
AZRIELI GROUP LTD	18.26	393	15,424	不動産
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	50.51	742	29,089	情報技術
ICL GROUP LTD	380.9	785	30,756	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	13.1	968	37,928	資本財・サービス
BANK HAPOLIM BM	625.36	1,941	76,074	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	760.17	2,060	80,739	金融
NICE LTD	31.28	2,559	100,270	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	75.98	980	38,400	金融
イスラエル・シェケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,564.67 9銘柄	11,578 <0.1%>	453,644
(スイス)	百株	千スイス・フラン	千円	
DUFREY AG-REG	48.54	195	30,526	一般消費財・サービス
UBS GROUP AG-REG	1,455.55	2,690	419,246	金融
ROCHE HOLDING AG-BR	14.47	428	66,694	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	3.07	217	33,916	素材
ADECCO GROUP AG-REG	68.23	194	30,268	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	312.65	8,583	1,337,528	ヘルスケア
SIKA AG-REG	64.99	1,687	262,991	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.05	567	88,349	生活必需品
ABB LTD-REG	699.46	2,476	385,933	資本財・サービス
SWISS RE AG	134.23	1,187	185,020	金融
NESTLE SA-REG	1,223.79	13,035	2,031,240	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	10.1	896	139,625	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	17.74	353	55,063	資本財・サービス
JULIUS BAER GROUP LTD	95.36	554	86,390	金融
SGS SA-REG	69.25	589	91,827	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	10.26	197	30,711	資本財・サービス
TEMENOS AG - REG	27.16	206	32,155	情報技術
HELVETIA HOLDING AG-REG	18.28	229	35,775	金融
VAT GROUP AG	11.76	461	71,941	資本財・サービス
BKW AG	9.42	139	21,767	公益事業
ALCON INC	222.37	1,596	248,784	ヘルスケア
SIG GROUP N AG	136.41	349	54,456	素材
SWATCH GROUP AG/THE-BR	12.9	341	53,267	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	66.96	2,855	444,893	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	19.56	276	43,096	金融
CLARIANT AG-REG	96.78	127	19,815	素材
NOVARTIS AG-REG	940.23	8,430	1,313,578	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1.59	276	43,084	生活必需品

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千スイス・フラン	千円	
BACHEM HOLDING AG-REG B	14.24	123	19,304	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	232.3	3,415	532,276	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	11.53	636	99,208	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	13.44	128	20,010	金融
GEBERIT AG-REG	15.59	765	119,323	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	4.11	1,185	184,697	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	49.67	680	106,032	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	22.79	541	84,375	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	73.75	374	58,309	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	33.14	1,885	293,824	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	22.69	113	17,748	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD	246.69	1,476	230,097	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	13.72	741	115,572	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	24.24	630	98,203	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	32.75	255	39,880	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.44	494	77,062	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,602.25 44銘柄	62,597 <2.7%>	
		百株	千デンマーク・クローネ	千円
(デンマーク)				
NOVO NORDISK A/S-B	798.58	87,141	1,779,420	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	339.63	5,502	112,350	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1.53	1,906	38,928	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	497.26	9,719	198,471	資本財・サービス
CARLSBERG AS-B	48.49	5,169	105,551	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	100.71	3,405	69,530	素材
COLOPLAST-B	58.5	4,953	101,156	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	91.66	12,419	253,614	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	4.26	759	15,518	資本財・サービス
DEMANT A/S	42.75	1,243	25,385	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2.4	3,028	61,848	資本財・サービス
TRYG A/S	177.29	2,740	55,969	金融
PANDORA A/S	43.41	2,539	51,856	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	51.94	2,643	53,985	素材
GENMAB A/S	32.49	8,658	176,808	ヘルスケア
ORSTED A/S	93.15	6,123	125,045	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,384.05 16銘柄	157,954 <0.9%>	
		百株	千ノルウェー・クローネ	千円
(ノルウェー)				
DNB BANK	458.04	8,835	116,276	金融
NORSK HYDRO ASA	643.51	4,724	62,176	素材
ORKLA ASA	369.83	2,845	37,446	生活必需品
TELENOR ASA	344.55	3,767	49,582	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	469.08	14,975	197,075	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	81.53	2,990	39,355	素材
MOWI ASA	216.43	4,036	53,119	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	92.44	1,637	21,544	金融
AKER BP ASA	155.6	4,050	53,301	エネルギー
KONGSBERG GRUPPEN ASA	40.98	1,919	25,260	資本財・サービス
SALMAR ASA	35.73	1,671	21,996	生活必需品
ADEVINTA ASA	139.44	1,082	14,239	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 >	3,047.16 12銘柄	52,536 <0.2%>	
		百株	千スウェーデン・クローネ	千円
(スウェーデン)				
SAGAX CLASS B	88.13	2,034	26,625	不動産
INVESTOR CLASS A	238.63	5,111	66,908	金融
VOLVO CAR CLASS B	285.14	1,273	16,669	一般消費財・サービス
ERICSSON LM-B SHS	1,437.21	8,183	107,121	情報技術
VOLVO AB-B SHS	743.05	16,276	213,059	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES	177.19	3,528	46,191	資本財・サービス
TELE2 AB-B SHS	263.33	2,433	31,857	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS	105.72	2,616	34,250	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	795.69	9,432	123,476	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	697.93	6,264	82,003	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	433.33	7,598	99,463	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	349.46	5,088	66,603	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	298.33	4,416	57,815	素材
SKANSKA AB-B SHS	157.24	2,360	30,894	資本財・サービス
SANDVIK AB	525.01	11,219	146,862	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	871.79	18,695	244,724	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	1,315.28	21,419	280,379	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS	92.55	2,091	27,379	資本財・サービス
HOLMEN AB-B SHARES	43.36	1,788	23,407	素材
SECURITAS AB-B SHS	227.43	1,923	25,179	資本財・サービス
TELIA CO AB	1,228.66	2,946	38,567	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	138.63	5,423	70,989	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	768.58	10,817	141,604	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	493.53	12,836	168,032	資本財・サービス
SAAB AB-B	39.43	2,271	29,739	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	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	60.27	1,756	22,989	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	301.92	1,281	16,772	不動産
INDUTRADE AB	134.54	3,553	46,511	資本財・サービス
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	78.07	1,751	22,932	ヘルスケア
LUNDBERGS AB-B SHS	35.13	1,609	21,065	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	68.43	1,533	20,073	資本財・サービス
LIFCO AB-B SHS	107.74	2,520	32,987	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	746.23	8,215	107,547	資本財・サービス
BEIJER REF AB	165.84	2,674	35,015	資本財・サービス
ESSITY AKTIEBOLAG-B	299.93	8,389	109,812	生活必需品
EMBRACER GROUP AB	300.41	795	10,416	コミュニケーション・サービス
BOLIDEN AB	130.87	4,242	55,538	素材
EPIROC AB-A	315.34	6,404	83,835	資本財・サービス
EPIROC AB-B	192.02	3,333	43,635	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS	193.95	1,737	22,742	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP	1,608.71	18,088	236,776	金融
EQT AB	175.11	3,892	50,955	金融
EVOLUTION AB	90.24	12,709	166,366	一般消費財・サービス
KINNEVIK AB - B	116.12	1,776	23,256	金融
HEXAGON AB-B SHS	1,022.32	13,428	175,774	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	71.18	2,067	27,067	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	18,029 46 銘柄	269,815 <1.0% >	3,531,882
		百株	千ユーロ	千円
ユーロ (アイルランド)				
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	117.84	404	61,497	素材
AIB GROUP PLC	612.54	237	36,142	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC	477.5	449	68,365	金融
KINGSPAN GROUP PLC	69.75	444	67,665	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A	71.89	647	98,573	生活必需品
CRH PLC	333.37	1,575	239,764	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	79.83	1,446	220,148	一般消費財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,762.72 7 銘柄	5,206 <0.2% >	792,156
		百株	千ユーロ	千円
ユーロ (オランダ)				
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	373.46	749	114,041	コミュニケーション・サービス
EXOR NV	47.86	389	59,318	金融
QIAGEN N. V.	102.72	434	66,172	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	419.97	782	119,119	ヘルスケア
NN GROUP NV	120.86	401	61,087	金融
HEINEKEN NV	116.72	1,096	166,827	生活必需品
AEGON NV	774.29	352	53,602	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	460.15	1,365	207,795	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.	78.41	570	86,874	素材
WOLTERS KLUWER	115.95	1,321	201,028	資本財・サービス
ING GROEP NV	1,638.46	2,017	306,927	金融
KONINKLIJKE KPN NV	1,431.97	441	67,192	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV	181.54	12,375	1,882,944	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA	178.28	250	38,097	金融
IMCD NV	25.14	340	51,772	資本財・サービス
ADYEN NV	9.77	1,587	241,557	金融
JUST EAT TAKEAWAY	95.3	125	19,044	一般消費財・サービス
PROSUS NV	360.49	2,440	371,379	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV	57.85	158	24,152	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV	21.15	869	132,306	情報技術
RANDSTAD NV	52.75	254	38,757	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	52.48	417	63,479	生活必需品
OCI NV	43.86	92	14,127	素材
EURONEXT NV	38.76	255	38,804	金融
STMICROELECTRONICS NV	307.76	1,420	216,147	情報技術
AIRBUS SE	267	3,458	526,162	資本財・サービス
ARGENX SE	25.09	913	139,031	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	226.54	291	44,291	生活必需品
CNH INDUSTRIAL NV	461.59	618	94,144	資本財・サービス
STELLANTIS NV	1,012.75	1,596	242,938	一般消費財・サービス
FERRARI NV	56.76	1,596	242,931	一般消費財・サービス
国 小 計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,155.68 31 銘柄	38,988 <1.7% >	5,932,058
		百株	千ユーロ	千円
ユーロ (ベルギー)				
UCB SA	55.77	468	71,226	ヘルスケア
KBC GROUP NV	112.72	717	109,144	金融
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	43.83	321	48,935	金融
SOLVAY SA	32.12	347	52,853	素材
UMICORE	92.39	258	39,261	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	391.12	2,046	311,350	生活必需品
AGEAS	71.14	271	41,304	金融
D'ETEREN GROUP	10.36	179	27,269	一般消費財・サービス
ELIA GROUP SA/NV	14.62	167	25,536	公益事業
SOFINA	6.7	137	20,918	金融
国 小 計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	830.77 10 銘柄	4,914 <0.2% >	747,800

銘柄		2023年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
計		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ルクセンブルグ)					
ARCELORMITTAL		257	672	102,390	素材
EUROFINS SCIENTIFIC		59.46	358	54,480	ヘルスケア
TENARIS SA		208.32	269	40,982	エネルギー
国小計		524.78	1,300	197,852	
		銘柄数 < 比率 >	3銘柄	< 0.1% >	
ユーロ (フランス)					
TOTALENERGIES SE		1,094.87	5,902	898,056	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		305.48	854	130,001	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		235.78	3,762	572,476	素材
KERING		33.5	1,752	266,574	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		244.3	4,061	617,992	資本財・サービス
BOUYGUES SA		95.72	288	43,866	資本財・サービス
BNP PARIBAS		500.23	2,877	437,784	金融
THALES SA		47.34	624	94,968	資本財・サービス
DANONE		289.11	1,559	237,271	生活必需品
CARREFOUR SA		267.78	441	67,205	生活必需品
VIVENDI		311.66	256	39,082	コミュニケーション・サービス
L'OREAL		108.42	4,469	679,969	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		220.86	1,253	190,668	資本財・サービス
LEGRAND SA		120.15	1,112	169,207	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA		92.92	1,892	287,986	生活必需品
EURAZEO SE		19.81	131	20,013	金融
SOCIETE GENERALE SA		355.28	835	127,112	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		124.31	10,566	1,607,670	一般消費財・サービス
ACCOR SA		83.55	279	42,598	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		74.3	1,316	200,376	情報技術
VALEO SA		91.48	193	29,424	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		103.08	768	116,905	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA		129.7	324	49,354	資本財・サービス
EIFFAGE		36.75	368	56,054	資本財・サービス
SODEXO SA		39.03	396	60,334	一般消費財・サービス
IPSEN		17.06	188	28,734	ヘルスケア
AMUNDI SA		25.69	140	21,380	金融
TELEPERFORMANCE		26.67	427	65,006	資本財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		11.94	326	49,649	ヘルスケア
SEB SA		9.97	88	13,409	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA		131.03	2,193	333,732	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA		11.08	187	28,591	資本財・サービス
WORLDLINE SA		107.9	385	58,608	金融
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		45.61	168	25,648	一般消費財・サービス
AXA SA		828.07	2,207	335,828	金融
EDENRED		112.58	693	105,583	金融
RENAULT SA		83.29	296	45,082	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL		14.26	2,813	428,073	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU		10.09	146	22,337	生活必需品
DASSAULT SYSTEMES SE		300.68	1,229	186,996	情報技術
WENDEL		11.24	112	17,050	金融
ORANGE		877.88	904	137,683	コミュニケーション・サービス
ALSTOM		141.07	383	58,360	資本財・サービス
SANOFI		510.72	4,799	730,281	ヘルスケア
VINCI SA		239.03	2,599	395,542	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		306.24	892	135,822	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		545.82	598	91,018	金融
BIOMERIEUX		18.52	170	25,873	ヘルスケア
ENGIE		822.44	1,175	178,891	公益事業
SAFRAN SA		153.91	2,130	324,190	資本財・サービス
ARKEMA		25.76	218	33,314	素材
ADP		13.43	185	28,239	資本財・サービス
GETLINK SE		194.11	304	46,323	資本財・サービス
BOLLORE		391.41	219	33,439	コミュニケーション・サービス
国小計		11,012.91	72,478	11,027,652	
		銘柄数 < 比率 >	54銘柄	< 3.1% >	
ユーロ (ドイツ)					
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		224.43	728	110,841	資本財・サービス
DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)		51.36	602	91,624	一般消費財・サービス
BAYER AG-REG		442.38	2,291	348,656	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		94.86	173	26,397	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		909.46	903	137,405	金融
COMMERZBANK AG		480.18	489	74,410	金融
VOLKSWAGEN AG		13.04	209	31,883	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		93.72	1,234	187,854	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG		342.01	5,620	855,173	資本財・サービス
E.ON SE		1,010.96	1,139	173,429	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		149.09	1,683	256,102	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		66.81	265	40,355	資本財・サービス
CONTINENTAL AG		48.53	348	53,089	一般消費財・サービス
BASF SE		404.16	1,892	288,002	素材
ALLIANZ SE-REG		181.63	3,809	579,644	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2023年6月15日現在			業種等	
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千ユーロ	千円		
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	76.95	570	86,872	生活必需品	
RHEINMETALL AG	19.65	482	73,338	資本財・サービス	
RWE AG	282.68	1,129	171,823	公益事業	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	270.29	256	38,969	資本財・サービス	
BRENNTAG SE	69.69	516	78,613	資本財・サービス	
FRESENIUS SE & CO KGAA	190.55	487	74,133	ヘルスケア	
SAP SE	470.21	5,900	897,714	情報技術	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	63.09	2,065	314,275	金融	
ZALANDO SE	96.69	255	38,867	一般消費財・サービス	
HEIDELBERG MATERIALS AG	63.89	469	71,487	素材	
COVESTRO AG	85.2	347	52,915	素材	
RATIONAL AG	2.15	137	20,984	資本財・サービス	
SARTORIUS AG-VORZUG	12.1	411	62,631	ヘルスケア	
TALANX AG	31.19	167	25,531	金融	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	67.55	391	59,549	一般消費財・サービス	
DELIVERY HERO SE	75.84	276	42,100	一般消費財・サービス	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	17.48	194	29,627	ヘルスケア	
BECHTLE AG	36.26	139	21,300	情報技術	
NEMETSCHKE SE	25.57	185	28,205	情報技術	
SCOUT24 AG	36	209	31,933	コミュニケーション・サービス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	127.21	670	102,078	ヘルスケア	
KNORR-BREMSE AG	31.58	210	32,039	資本財・サービス	
HELLOFRESH SE	71.77	129	19,672	生活必需品	
SIEMENS ENERGY AG	237.42	562	85,612	資本財・サービス	
BEIERSDORF AG	45.47	543	82,638	生活必需品	
MERCK KGAA	58.2	978	148,899	ヘルスケア	
ADIDAS AG	74.67	1,304	198,477	一般消費財・サービス	
PUMA SE	45.86	237	36,074	一般消費財・サービス	
HENKEL AG & CO KGAA	45.84	301	45,822	生活必需品	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,459.49	2,793	425,069	コミュニケーション・サービス	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	90.61	391	59,625	ヘルスケア	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	387.64	2,920	444,409	一般消費財・サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	588.05	2,285	347,687	情報技術	
HANNOVER RUECK SE	27.2	520	79,148	金融	
DEUTSCHE POST AG-REG	453.84	1,981	301,410	資本財・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	85.56	1,428	217,399	金融	
MTU AERO ENGINES AG	24.17	546	83,221	資本財・サービス	
WACKER CHEMIE AG	8.99	109	16,625	素材	
SYMRISE AG	59.9	555	84,503	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	413.12	105	16,122	コミュニケーション・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	26.86	277	42,216	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	315.18	595	90,658	不動産	
LEG IMMOBILIEN SE	31.05	171	26,049	不動産	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,215.33 58銘柄	55,610	8,461,211 <2.4%>	
百株 千ユーロ 千円					
ユーロ (ポルトガル)					
JERONIMO MARTINS	122.72	303	46,194	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,327.45	612	93,169	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	217.24	233	35,498	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,667.41 3銘柄	1,149	174,862 <0.0%>	
百株 千ユーロ 千円					
ユーロ (スペイン)					
CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV	29.38	92	14,089	公益事業	
TELEFONICA SA	2,340.49	850	129,373	コミュニケーション・サービス	
ENDESA SA	143.67	300	45,729	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,713.06	1,838	279,707	金融	
IBERDROLA SA	2,703.54	3,127	475,924	公益事業	
REPSOL SA	606	820	124,888	エネルギー	
GRIFOLS SA	129.49	152	23,277	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	7,389.96	2,401	365,424	金融	
AMADEUS IT GROUP SA	202.86	1,412	214,944	一般消費財・サービス	
NATURGY ENERGY GROUP SA	103	274	41,717	公益事業	
CAIXABANK SA	1,950.84	714	108,665	金融	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	95.44	298	45,349	資本財・サービス	
AENA SME SA	33.83	501	76,333	資本財・サービス	
CELLNEX TELECOM SA	254.43	927	141,064	コミュニケーション・サービス	
ACCIONA SA	11.17	181	27,549	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	491.19	1,680	255,666	一般消費財・サービス	
ENAGAS SA	108.03	196	29,882	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	179	292	44,501	公益事業	
FERROVIAL SA	230.57	664	101,174	資本財・サービス	
EDP RENOVAVEIS SA	124.91	242	36,926	公益事業	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	19,840.86 20銘柄	16,971	2,582,193 <0.7%>	
百株 千ユーロ 千円					
ユーロ (イタリア)					
PRYSMIAN SPA	112.38	420	64,034	資本財・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI	488.78	925	140,778	金融	

銘柄	株数	2023年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
MEDIOBANCA SPA	262.3	296	45,137	金融
UNICREDIT SPA	845.16	1,616	245,891	金融
TELECOM ITALIA SPA	4,343.74	111	17,031	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO	7,214.38	1,695	257,951	金融
POSTE ITALIANE SPA	226.39	228	34,772	金融
MONCLER SPA	92.91	610	92,846	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	46.24	207	31,645	ヘルスケア
ENI SPA	1,100.08	1,428	217,355	エネルギー
DIASORIN SPA	11.44	111	17,033	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	146.48	173	26,332	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA	250.05	184	28,138	金融
AMPLIFON SPA	56.32	198	30,188	ヘルスケア
ENEL SPA	3,662.38	2,236	340,356	公益事業
SNAM SPA	889.57	445	67,782	公益事業
TERNA SPA	634.67	508	77,348	公益事業
FINECOBANK SPA	269.08	335	51,032	金融
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	20,652.35 18銘柄	11,736 <0.5%>	
		百株	千ユーロ	千円
ユーロ (フィンランド)				
UPM-KYMMENE OYJ	240.34	717	109,227	素材
NOKIA OYJ	2,381.2	926	140,934	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	209.3	229	34,933	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	263.2	325	49,596	素材
ELISA OYJ	64.14	324	49,380	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS	211.1	900	137,019	金融
FORTUM OYJ	198	261	39,735	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	123.55	237	36,073	生活必需品
KONE OYJ-B	153.32	759	115,518	資本財・サービス
NESTE OYJ	190.5	780	118,778	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	48.46	191	29,109	ヘルスケア
METSO CORPORATION	313.51	348	52,995	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,396.62 12銘柄	6,002 <0.3%>	
		百株	千ユーロ	千円
ユーロ (オーストリア)				
VERBUND AG	29.51	221	33,741	公益事業
OMV AG	64.96	254	38,783	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	155.1	498	75,869	金融
VOESTALPINE AG	48.78	164	24,967	素材
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	298.35 4銘柄	1,139 <0.0%>	
		百株	千ユーロ	千円
ユーロ (その他)				
DSM FIRMENICH AG	78.89	781	118,830	素材
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	78.89 1銘柄	781 <0.0%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	81,436.67 221銘柄	216,279 <9.2%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	520,464.12 1,214銘柄	— <93.8%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2)外国投資証券

銘柄	数	2023年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)			
AVALONBAY COMMUNITIES INC	6.537	1,243	174,515
SIMON PROPERTY GROUP INC	15.207	1,686	236,761
BOSTON PROPERTIES INC	6.7	363	51,009
SBA COMMUNICATIONS CORP	5	1,149	161,322
EQUITY RESIDENTIAL	16.8	1,115	156,537
EQUINIX INC	4.408	3,419	480,083
AMERICAN TOWER CORP	21.7	4,188	588,028
HOST HOTELS & RESORTS INC	33.343	582	81,730
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	15.2	529	74,324
KIMCO REALTY CORP	28.9	557	78,305
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	17.3	338	47,506
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	12.2	611	85,860
INVITATION HOMES INC	28.5	970	136,197
VICI PROPERTIES INC	46.9	1,518	213,199
VENTAS INC	18.6	861	120,953
WEYERHAEUSER CO	34.214	1,044	146,596
CROWN CASTLE INTL CORP	20.2	2,311	324,452
IRON MOUNTAIN INC	13.6	771	108,295
SUN COMMUNITIES INC	5.8	775	108,931
PROLOGIS INC	42.954	5,251	737,326
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7.7	938	131,795
CAMDEN PROPERTY TRUST	5	558	78,449
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3	700	98,296
WELLTOWER INC	23.2	1,891	265,579
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	25.5	527	74,104
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5.4	828	116,293
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8.2	554	77,867
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	23.1	477	66,968
REALTY INCOME CORP	30.895	1,890	265,359
PUBLIC STORAGE	7.4	2,102	295,168
REGENCY CENTERS CORP	7.2	438	61,497
UDR INC	14.5	625	87,757
WP CAREY INC	10	699	98,160
DIGITAL REALTY TRUST INC	13.6	1,434	201,412
EXTRA SPACE STORAGE INC	6.3	902	126,760
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	585,058 35銘柄	43,859 <1.7%>
		千口	千カナダ・ドル 千円
(カナダ)			
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3.4	169	17,879
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5.8	115	12,147
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	9.2 2銘柄	285 <0.0%>
		千口	千オーストラリア・ドル 千円
(オーストラリア)			
DEXUS/AU	45.529	358	34,172
LENLEASE GROUP	28.107	198	18,951
TRANSURBAN GROUP	134.358	1,917	182,851
APA GROUP	50.633	508	48,481
SCENTRE GROUP	218.948	567	54,081
GPT GROUP	81.08	325	31,085
MIRVAC GROUP	173.08	377	35,984
STOCKLAND	104.777	426	40,669
GOODMAN GROUP	73.798	1,453	138,580
VICINITY CENTRES	163.15	303	28,940
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,073.46 10銘柄	6,435 <0.2%>
		千口	千香港・ドル 千円
(香港)			
LINK REIT	124.5	5,820	104,359
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	181	1,632	29,272
香港・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	305.5 2銘柄	7,452 <0.0%>
		千口	千シンガポール・ドル 千円
(シンガポール)			
CAPITALAND ASCENDAS REIT	165.6	442	46,240
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	261.87	515	53,951
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	170.2	282	29,547
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	112.7	187	19,565
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	710.37 4銘柄	1,427 <0.0%>

銘柄	柄	2023年6月15日現在		
		□ 数	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(イギリス)		千円	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC		30.834	183	32,539
SEGRO PLC		55.182	416	74,081
BRITISH LAND CO PLC		38.375	128	22,826
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	124.391 3 銘柄	728	129,447 <0.0%>
(ユーロ (ベルギー))		千円	千ユーロ	千円
WAREHOUSES DE PAUW SCA		7.389	194	29,657
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	7.389 1 銘柄	194	29,657 <0.0%>
(ユーロ (フランス))		千円	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		5.203	243	37,104
GECINA SA		1.995	195	29,746
KLEPIERRE		9.34	208	31,704
COVIVIO		2	92	14,070
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	18.538 4 銘柄	740	112,625 <0.0%>
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	25.927 5 銘柄	935	142,283 <0.0%>
フ ァ ン ド 合 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	2,833.906 61 銘柄	—	7,355,904 <2.1%>

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2023年6月15日現在		
	買 建 額	売 建 額	
外 国	百万円	百万円	
	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	9,490	—
	S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	992	—
	SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	764	—
	FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	867	—
国	SWISS MKT IX FUTR (ドイツ)	794	—
	EURO STOXX 50 (ドイツ)	2,313	—

(注1) 外貨建の評価額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第23期 (決算日 2022年11月30日)

(作成対象期間 2021年12月1日～2022年11月30日)

外国株式インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

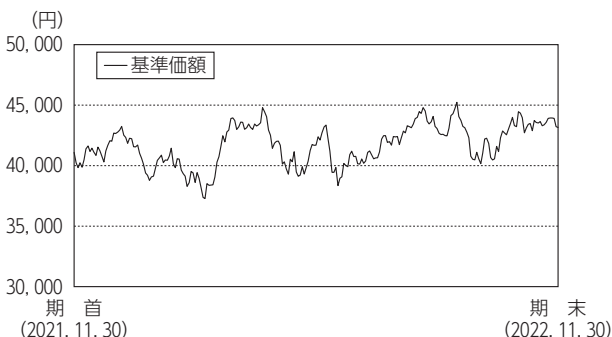
大和アセットマネジメント

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) ※配当なし		株式組入比率		投資信託証券組入比率	
	円	騰落率(ベンチマーク)	円	騰落率	%	%	%	%
(期首) 2021年11月30日	41,095	—	26,449	—	91.4	6.5	2.2	
12月末	42,776	4.1	27,515	4.0	92.8	4.8	2.4	
2022年1月1日	39,783	△ 3.2	25,570	△ 3.3	92.1	5.7	2.3	
2月末	39,516	△ 3.8	25,379	△ 4.0	91.1	6.4	2.2	
3月末	43,725	6.4	28,008	5.9	93.0	4.5	2.4	
4月末	41,854	1.8	26,749	1.1	92.3	5.2	2.6	
5月末	41,743	1.6	26,623	0.7	90.6	7.1	2.4	
6月末	40,765	△ 0.8	25,960	△ 1.9	94.6	2.9	2.5	
7月末	42,372	3.1	26,919	1.8	93.8	3.8	2.5	
8月末	42,665	3.8	27,061	2.3	93.0	4.5	2.5	
9月末	40,573	△ 1.3	25,663	△ 3.0	93.3	4.3	2.3	
10月末	44,461	8.2	28,135	6.4	92.2	5.7	2.2	
(期末) 2022年11月30日	43,159	5.0	27,278	3.1	89.7	8.1	2.2	

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) MSCIコクサイ指数(円ベース)は、MSCI Inc. (「MSCI」)の承諾を得て、MSCIコクサイ指数(米ドルベース)をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIコクサイ指数(米ドルベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html]
 (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
 (注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
 (注5) 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：41,095円 期末：43,159円 騰落率：5.0%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外株式市況

海外株式市況は下落しました。

海外株式市況は、当作成期首より、感染が急拡大していた新型コロナウイルスのオミクロン株の重症化率は低いのではないかとの見方が広がり懸念が後退したことなどから、上昇しました。2022年に入ると、2021年12月のFOMC(米国連邦公開市場委員会)議事録を受け、米国の金融引き締めに対する懸念が高まり、下落しました。2月以降は、欧米の中央銀行高官の金融政策に対する発言やロシアのウクライナへの侵攻などから、一進一退の展開となりました。4月に入ると、FRB(米国連邦準備制度理事会)高官から利上げペースを加速させるとの発言が相次いだことや、米国の一部主要銘柄が市場予想を下回る決算を発表したことなどから下落しました。6月も、FOMCにおいて0.75%ポイントの大幅利上げが行われるとの観測が高まったことで、金融引き締めによる欧米景気への悪影響が懸念されて下落しました。7月中旬には、米国の利上げペース鈍化の可能性が意識されて上昇しましたが、8月以降は、FRB議長講演において利上げ継続姿勢が強調されたことへの懸念から下落しました。10月以降は、英国政府が減税策の一部撤回を表明したことやFRBが今後利上げ幅を縮小させるのではないかと期待を背景に、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円安となりました。

対円為替相場は、当作成期首より、インフレ期待の上昇などから米国金利が上昇したため、米ドル円も上げ幅を拡大しました。また、世界的に利上げ観測が高まっている一方で、日本の金融政策が相対的に緩和的であることなどから、米ドル以外の通貨も対円で上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は3.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は5.0%となりました。

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

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

*ベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ベース) ※配当なし)です。

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション) (投資信託証券)	1円 (1) (1) (0)
有価証券取引税 (株式) (投資信託証券)	1 (1) (0)
その他費用 (保管費用) (その他)	8 (7) (1)
合 計	11

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

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
アメリカ	百株 18,307.53 (9,749.5)	千アメリカ・ドル 195,541 (△ 4,778)	百株 1,458.49	千アメリカ・ドル 5,071
カナダ	百株 2,299.5 (657.87)	千カナダ・ドル 12,730 (905)	百株 907	千カナダ・ドル 1,126
オーストラリア	百株 2,617.26 (851.24)	千オーストラリア・ドル 6,224 (1,733)	百株 1,112.63	千オーストラリア・ドル 299
香港	百株 2,753 (1)	千香港・ドル 12,780 (△ 18)	百株 1,250	千香港・ドル 767
シンガポール	百株 1,313 (1)	千シンガポール・ドル 939 (△ 2)	百株 —	千シンガポール・ドル —
ニュージーランド	百株 215.54 (1)	千ニュージーランド・ドル 145 (1)	百株 427	千ニュージーランド・ドル 324
イギリス	百株 10,671.3 (1,248.66)	千イギリス・ポンド 7,209 (△ 1,865)	百株 639.83	千イギリス・ポンド 201
イスラエル	百株 1,255.35 (1)	千イスラエル・シェケル 2,644 (1)	百株 —	千イスラエル・シェケル —
スイス	百株 789.93 (1,101.29)	千スイス・フラン 6,994 (△ 429)	百株 60.4	千スイス・フラン 437
デンマーク	百株 203.22 (1)	千デンマーク・クローネ 9,647 (1)	百株 63	千デンマーク・クローネ 597
ノルウェー	百株 424.03 (1)	千ノルウェー・クローネ 11,025 (1)	百株 64.5	千ノルウェー・クローネ 1,184
スウェーデン	百株 2,658.82 (2,558.7)	千スウェーデン・クローネ 45,330 (△ 2,067)	百株 1,402.4	千スウェーデン・クローネ 4,824
ユーロ (アイルランド)	百株 59.02 (1)	千ユーロ 369 (1)	百株 —	千ユーロ —
ユーロ (オランダ)	百株 1,013.58 (75.2)	千ユーロ 4,446 (1)	百株 140.93	千ユーロ 437
ユーロ (ベルギー)	百株 137.18 (1)	千ユーロ 839 (1)	百株 32	千ユーロ 60
ユーロ (ルクセンブルク)	百株 89.54 (1)	千ユーロ 112 (1)	百株 70	千ユーロ 44
ユーロ (フランス)	百株 1,154.37 (440.54)	千ユーロ 6,383 (△ 18)	百株 554.61	千ユーロ 838
ユーロ (ドイツ)	百株 1,331.42 (156.75)	千ユーロ 5,861 (△ 100)	百株 105	千ユーロ 252
ユーロ (ポルトガル)	百株 165.62 (1)	千ユーロ 142 (1)	百株 —	千ユーロ —
ユーロ (スペイン)	百株 1,831.51 (8,854.93)	千ユーロ 1,629 (185)	百株 8,854.93	千ユーロ 183

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ユーロ (イタリア)	百株 1,950.08 (1)	千ユーロ 1,080 (△ 1)	百株 2,039.5	千ユーロ 87
	ユーロ (フィンランド)	百株 396.63 (1)	千ユーロ 548 (1)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (オーストリア)	百株 42.06 (1)	千ユーロ 176 (1)	百株 52.5	千ユーロ 64
	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 8,171.01 (9,539.42)	千ユーロ 21,590 (64)	百株 11,849.47	千ユーロ 1,970

(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

(2021年12月1日から2022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	千口 163.98 (△ 62.048)	千アメリカ・ドル 8,569 (1)	千口 27.9 (1)	千アメリカ・ドル 471 (1)
	カナダ	千口 0.5 (1)	千カナダ・ドル 24 (1)	千口 — (1)	千カナダ・ドル — (1)
	オーストラリア	千口 98.566 (△ 45.8)	千オーストラリア・ドル 771 (△ 377)	千口 — (1)	千オーストラリア・ドル — (1)
	香港	千口 49.3 (1)	千香港・ドル 992 (1)	千口 — (1)	千香港・ドル — (1)
	シンガポール	千口 99.5 (2,559)	千シンガポール・ドル 208 (△ 5)	千口 2,559 (1)	千シンガポール・ドル 3 (1)
	イギリス	千口 15.774 (1)	千イギリス・ポンド 131 (1)	千口 — (1)	千イギリス・ポンド — (1)
国	ユーロ (ベルギー)	千口 6.192 (1)	千ユーロ 212 (1)	千口 — (1)	千ユーロ — (1)
	ユーロ (フランス)	千口 1.844 (1)	千ユーロ 71 (△ 12)	千口 — (1)	千ユーロ — (1)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千口 8.036 (1)	千ユーロ 284 (△ 12)	千口 — (1)	千ユーロ — (1)

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2021年12月1日から2022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 83,041	百万円 76,593	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

銘柄	当 期			期 末		
	株 数	金 額	平均単価	株 数	金 額	平均単価
APPLE INC (アメリカ)	64.4	1,313,713	20,399	6	62,614	10,435
MICROSOFT CORP (アメリカ)	34.5	1,285,473	37,260	3.4	56,181	16,523
AMAZON.COM INC (アメリカ)	9.69	902,160	93,102	3.65	50,471	13,827
TESLA INC (アメリカ)	8.43	768,572	91,171	8.05	43,607	5,417
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	6.29	493,688	78,487	1.75	41,510	23,720
NVIDIA CORP (アメリカ)	13.2	381,021	28,865	1.8	41,196	22,886
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	4.15	356,434	85,887	4.273	39,435	9,228
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	13.4	290,054	21,645	2.95	32,702	11,085
UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)	4.55	283,968	62,410	5.45	32,540	5,970
SEA LTD-ADR (ケイマン諸島)	12.8	251,762	19,668	1.83	32,435	17,724

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	期 首	当 期	期 末		業 種 等
	株 数	株 数	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 SOLUTIO	42.5	49	699	97,183	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	35.1	123	2,097	291,248	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	67.5	75	1,298	180,298	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	47.5	54	572	79,541	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	21.5	26	404	56,199	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	211	211	786	109,236	金融
ABBOTT LABORATORIES	643.66	723.66	7,598	1,055,193	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	141.33	155.83	579	80,544	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	56.5	65	1,150	159,706	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	126.5	139	620	86,206	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	216	247	1,911	265,488	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	16.1	18	638	88,725	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	225.62	253	1,708	237,260	情報技術
QORVO INC	40.7	44.2	415	57,685	情報技術
AFLAC INC	236	253	1,793	249,030	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	48	51	739	102,666	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	60.5	71	498	69,225	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	173.2	195.2	6,378	885,816	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	76.5	86	915	127,071	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	45.3	48	1,743	242,180	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	56.5	63	565	78,573	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	79.5	92	2,780	386,066	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	251.5	282	6,111	848,704	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	52.75	86.42	648	90,056	金融
AUTOZONE INC	8.2	8.2	2,095	291,066	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	83.21	92.71	1,358	188,613	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	419	478	414	57,551	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	41	—	—	—	公益事業
CELANESE CORP	41.5	44.5	469	65,226	素材
DR HORTON INC	125.66	138.16	1,163	161,586	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	79.5	89	268	37,337	ヘルスケア
AUTODESK INC	80.2	90	1,756	243,941	情報技術
MOODY'S CORP	61.6	69	1,997	277,428	金融
DEVON ENERGY CORP	233	259	1,748	242,779	エネルギー
ALBEMARLE CORP	43.1	48	1,296	179,988	素材
ATMOS ENERGY CORP	48.5	58	688	95,558	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	90.5	102	561	78,005	公益事業
CITIGROUP INC	748.73	804.73	3,828	531,608	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	155	174	4,472	621,143	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	183	213	2,016	279,968	公益事業
ALLEGHANY CORP	4.8	—	—	—	金融
DOMINO'S PIZZA INC	14.3	15.3	586	81,389	一般消費財・サービス
HESS CORP	102	116	1,646	228,714	エネルギー
DAVITA INC	27.5	27.5	197	27,362	ヘルスケア
DANAHER CORP	232.5	286.5	7,420	1,030,543	ヘルスケア
FORTIVE CORP	117	141	924	128,449	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	205.5	231	2,433	337,919	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	201.5	233	2,247	312,080	生活必需品
BUNGE LTD	51	63	656	91,127	生活必需品

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	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TE CONNECTIVITY LTD	119.25	131.95	1,635	227,106	情報技術
APPLE INC	6,056	6,700	94,583	13,134,866	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	110.5	116	1,259	174,862	金融
BOEING CO/THE	201.3	233	4,084	567,277	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	55.65	62.15	672	93,324	金融
BECTON DICKINSON AND CO	106.19	117.99	2,843	394,917	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	76	—	—	—	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	49	54	585	81,363	資本財・サービス
NISOURCE INC	139	165	449	62,393	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	49	53	517	71,834	資本財・サービス
BOSTON BEER COMPANY INC-A	3.2	—	—	—	生活必需品
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	300.71	317.71	1,424	197,835	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,502.04	1,737.04	6,659	924,848	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	488.5	532.5	16,780	2,330,331	金融
ANSYS INC	32	36	866	120,298	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	490.67	551.17	2,530	351,399	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	249.5	290	2,558	355,241	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	810	883	6,978	969,083	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	1,097.7	1,214.7	16,587	2,303,567	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	83	93	1,120	155,624	金融
LKQ CORP	102.5	111	587	81,589	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	18.3	—	—	—	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	114.12	128.12	911	126,536	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	100.5	114	1,864	258,871	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	42.2	45	1,460	202,772	金融
DOLLAR GENERAL CORP	88.5	94	2,376	330,064	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	71.5	83	3,293	457,417	情報技術
CATERPILLAR INC	198.5	221	5,196	721,589	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	85.5	97	556	77,266	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	83	103	484	67,298	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	18	21	502	69,844	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	106.5	120	722	100,319	公益事業
MOSAIC CO/THE	128	149	755	104,968	素材
DELTA AIR LINES INC	57.5	62	214	29,799	資本財・サービス
CORNING INC	294	332	1,109	154,036	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,529.5	1,713.5	8,272	1,148,840	情報技術
MORGAN STANLEY	506.52	541.52	4,932	684,929	金融
ZILLOW GROUP INC - A	21	—	—	—	不動産
MSCI INC	30	34	1,653	229,619	金融
FAIR ISAAC CORP	10	11	649	90,239	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	12	13	339	47,087	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	85	94	485	67,396	情報技術
BROADCOM INC	148.12	167.12	8,713	1,210,039	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	43.5	50	1,023	142,195	ヘルスケア
ARAMARK	85	96	389	54,085	一般消費財・サービス
DTE ENERGY COMPANY	71.7	79	901	125,208	公益事業
CENTENE CORP	213.87	242.07	2,043	283,788	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	39.5	44	542	75,309	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	157	202	844	117,228	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	75	87	1,702	236,414	金融
GARTNER INC	31.5	33.5	1,139	158,210	情報技術
SPLUNK INC	60.1	67	508	70,610	情報技術
DOMINION ENERGY INC	294.41	335.41	2,004	278,399	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	143	164	1,636	227,268	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	50	53	320	44,521	資本財・サービス
DEERE & CO	108	120	5,291	734,850	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC	—	60	867	120,441	資本財・サービス
POOL CORP	14.8	17	545	75,722	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	106.84	116.84	1,166	161,979	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	74.8	87	1,026	142,600	情報技術
CABLE ONE INC	2	2	143	19,996	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	24	27	519	72,173	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	42	143	945	131,264	金融
VAIL RESORTS INC	14.9	17	435	60,507	一般消費財・サービス
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	184	209	155	21,564	コミュニケーション・サービス
TARGA RESOURCES CORP	—	90	663	92,137	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	26.3	30	419	58,308	金融
WESTLAKE CORP	—	16	171	23,812	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	126	147	1,415	196,585	公益事業
COGNEX CORP	65	69	329	45,754	情報技術
WEBSTER FINANCIAL CORP	—	73	389	54,134	金融
TELEFLEX INC	17.2	19	429	59,670	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	30.5	35	629	87,405	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	27.1	31	692	96,216	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	7.9	9	359	49,936	ヘルスケア
CATALENT INC	62	69	325	45,208	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	50.5	58	1,058	146,945	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	21.2	24	774	107,558	ヘルスケア
CARLISLE COS INC	—	22	562	78,067	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
IDEX CORP	27.6	31	716	99,470	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	293.5	329	2,499	347,093	生活必需品
ROLLINS INC	80.87	92.07	366	50,925	資本財・サービス
AMETEK INC	84.45	96	1,334	185,321	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	89	100	794	110,387	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	55.5	64.5	353	49,076	資本財・サービス
HEICO CORP	16	18	281	39,137	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	23.2	26	261	36,344	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	14	16	718	99,790	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	97	108	916	127,242	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	15	17	551	76,525	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	160.6	182.6	9,658	1,341,318	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	28	32.5	184	25,689	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	20	24	825	114,631	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	46	53	538	74,830	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	10	12	1,863	258,751	一般消費財・サービス
UGI CORP	76.5	85	321	44,666	公益事業
CUMMINS INC	53.5	58	1,429	198,478	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	283.5	323	2,401	333,452	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	51	56	1,030	143,153	情報技術
SIGNATURE BANK	—	26.5	359	49,894	金融
COSTAR GROUP INC	145	164	1,283	178,211	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	20.2	24	525	73,033	金融
AMERCO	3.7	—	—	—	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	36.4	40	1,168	162,239	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	16.1	18.9	1,680	233,399	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	27.6	30	557	77,447	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	100.16	115.16	1,597	221,892	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	14.2	—	—	—	情報技術
DEXCOM INC	35.4	162	1,788	248,343	ヘルスケア
NORDSON CORP	19.1	20.9	482	66,986	資本財・サービス
COPART INC	78.3	174	1,121	155,708	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	70	1,027	142,644	エネルギー
SEAGEN INC	49.5	57	669	92,905	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	27.1	31	594	82,582	ヘルスケア
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	—	33	791	109,943	金融
TRANSDIGM GROUP INC	18.9	20.9	1,274	177,010	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	14	15.8	516	71,763	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	33.5	39	474	65,933	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	77.5	90	708	98,436	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	733.81	843.81	1,593	221,235	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	98	98	2,310	320,919	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	14	16	409	56,898	金融
COTERRA ENERGY INC	290	330	926	128,636	エネルギー
T-MOBILE US INC	226.77	259.27	3,853	535,103	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	59.5	67.5	238	33,098	不動産
COCA-COLA CO/THE	1,486.5	1,704.5	10,649	1,478,926	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	73.5	88	453	63,021	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	61.5	69.5	789	109,602	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	111.5	124	326	45,288	金融
CSX CORP	821	899	2,892	401,623	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	34.6	38	911	126,533	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	51.75	63.25	647	89,987	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	29.5	—	—	—	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	164.7	3,788	35,008	4,861,657	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	226.9	257	1,923	267,136	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,536.05	1,742.05	19,256	2,674,166	エネルギー
AES CORP	246	271	765	106,353	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	15	16	532	73,945	金融
EOG RESOURCES INC	210	242	3,419	474,826	エネルギー
EQT CORP	—	141	601	83,531	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	60	65	591	82,168	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	—	5	399	55,521	金融
ABIOMED INC	16.1	19	716	99,559	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	56.8	65	1,091	151,555	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	111.7	124	1,871	259,916	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1,433.23	1,634.23	2,247	312,050	一般消費財・サービス
NOVAVAX INC	26	—	—	—	ヘルスケア
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	62.9	—	—	—	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	62.5	71	292	40,612	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	56.37	62.37	122	17,080	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	8.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス
ENTEGRIS INC	—	62	448	62,327	情報技術
DISCOVERY INC-C	113.89	—	—	—	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	—	56	337	46,846	資本財・サービス
FORTINET INC	50.5	282	1,454	202,033	情報技術
MARKEL CORP	5.1	5.5	709	98,574	金融
NEXTERA ENERGY INC	711.8	812.8	6,704	931,093	公益事業
MASIMO CORP	19.2	22	309	42,970	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		
FREEMPORT-MCMORAN INC	536.08	599.08	2,247	312,061	素材
INSULET CORP	24.4	29	836	116,209	ヘルスケア
US BANCORP	512	584	2,604	361,625	金融
UNITED RENTALS INC	25.7	30	1,028	142,784	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	22.5	25	374	52,013	情報技術
FASTENAL CO	210.5	238	1,196	166,147	資本財・サービス
FISERV INC	219.33	254.33	2,581	358,556	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	398.56	455.06	3,898	541,321	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	476.5	573	2,277	316,300	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	43.7	—	—	—	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	87.5	98	2,461	341,891	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	123.5	142.5	5,467	759,322	金融
ALPHABET INC-CL A	109	2,488	23,683	3,288,895	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	105.57	2,333.4	22,269	3,092,630	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	39	39	349	48,542	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	220.5	249	2,062	286,449	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	197.68	224.18	892	123,904	公益事業
GENUINE PARTS CO	51	59.5	1,074	149,184	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	138.84	—	—	—	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	259	284	1,022	141,980	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	75.5	80.5	1,816	252,210	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	326	373	1,386	192,483	エネルギー
HOME DEPOT INC	385.5	425.5	13,444	1,866,981	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	22.5	22.5	284	39,491	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	529	595	910	126,420	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	15.1	17.1	389	54,147	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	53.9	60	1,382	192,048	生活必需品
HUMANA INC	47.2	52	2,772	384,993	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	101	109	1,795	249,288	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	28.2	33.2	116	16,178	情報技術
HENRY SCHEIN INC	51	56	451	62,680	ヘルスケア
HP INC	473	473	1,366	189,699	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	476	538	831	115,504	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	59.78	68.28	292	40,668	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	70	79	467	64,880	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	29.5	29.5	127	17,644	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	144	154	908	126,134	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	243.03	304.03	1,186	164,829	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	46.9	56	1,698	235,937	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	324	372	5,449	756,762	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	137.5	143	519	72,145	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	49	52	341	47,472	資本財・サービス
ZOETIS INC	173	195	2,883	400,372	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	87.79	96.99	1,697	235,694	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	88.5	95	1,640	227,771	エネルギー
ALLEGION PLC	33	36.5	404	56,146	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	129.73	129.73	265	36,859	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	94.87	106.37	1,497	208,013	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	122	134	427	59,305	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	40.5	44	666	92,582	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	955	1,089	19,176	2,662,999	ヘルスケア
PLUG POWER INC	186	211	314	43,659	資本財・サービス
ABBVIE INC	640.72	730.72	11,559	1,605,335	ヘルスケア
HOLOGIC INC	91.5	101	751	104,310	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	122	139	1,850	257,037	生活必需品
KROGER CO	264	286	1,411	196,002	生活必需品
KLA CORP	55.6	62	2,320	322,295	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	90.3	99	4,792	665,546	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	29.3	31	589	81,880	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	97	105	417	58,019	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	260	272	5,643	783,668	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	295.35	333.85	12,150	1,687,335	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	52	56.8	2,510	348,680	情報技術
LOEWS CORP	83	86	496	69,005	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	66.49	66.49	253	35,170	金融
MCDONALD'S CORP	270.5	306.5	8,318	1,155,220	一般消費財・サービス
3M CO	210.4	234.9	2,962	411,443	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	869	948	10,376	1,441,027	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	87.7	144.39	5,012	696,065	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	23.1	26	929	129,094	素材
SOLAREDDGE TECHNOLOGIES INC	19.2	23.2	674	93,705	情報技術
ALCOA CORP	—	77	367	51,005	素材
PHILLIPS 66	157.5	199	2,168	301,140	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	160.5	160.5	575	79,927	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	92	104	871	120,955	生活必需品
METLIFE INC	270	284	2,160	300,013	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	299.5	352	1,510	209,753	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	84.8	102	1,363	189,396	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	48	—	—	—	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	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	62.28	68.98	1,824	253,332	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	8.5	9	1,270	176,502	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	265.23	408.23	1,169	162,419	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	41.9	48	1,246	173,063	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	918.21	1,046.21	11,386	1,581,305	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	207.51	207.51	1,441	200,162	素材
MASCO CORP	91	98	488	67,869	資本財・サービス
M & T BANK CORP	46.89	73.99	1,264	175,620	金融
MARSH & MCLENNAN COS	185.2	207.7	3,503	486,528	金融
BLACK KNIGHT INC	56	63.5	385	53,570	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	27.2	30.2	369	51,345	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	101.72	115.02	1,854	257,577	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	69	82	1,175	163,180	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	27.1	29	91	12,754	一般消費財・サービス
BLOCK INC CLASS A	142	215.12	1,336	185,545	情報技術
TRANSUNION	69	80	483	67,168	資本財・サービス
VISTRA CORP	156.5	176	426	59,220	公益事業
NOVOCURE LTD	34.5	38.5	287	39,927	ヘルスケア
NETAPP INC	82	92	660	91,719	情報技術
NIKE INC -CL B	462	525	5,578	774,634	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	90.5	99	2,508	348,322	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	201	229	1,699	236,028	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	68.55	81.05	935	129,853	金融
ALLY FINANCIAL INC	136.5	142	376	52,276	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	57.1	61	3,222	447,568	資本財・サービス
APTIV PLC	97.5	112	1,141	158,458	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	293.11	328.11	1,501	208,503	素材
MCKESSON CORP	57.5	61	2,328	323,408	ヘルスケア
XYLEM INC	66.7	73	802	111,390	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	565	641	6,268	870,484	生活必需品
NUCOR CORP	109.5	111	1,631	226,578	素材
SUNRUN INC	61	—	—	—	資本財・サービス
WESTERN UNION CO	152.46	152.46	220	30,636	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	60	68	510	70,889	情報技術
NEWELL BRANDS INC	134.42	164.42	211	29,386	一般消費財・サービス
EVERGY INC	82.5	93.5	542	75,400	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	343.24	388.24	2,683	372,605	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	9	11.5	309	42,997	金融
OKTA INC	45.1	62	317	44,125	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	25.5	29	178	24,751	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	56	56	500	69,547	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	157.55	173.05	211	29,438	ヘルスケア
LINDE PLC	188.46	208.46	6,920	961,014	素材
WIX.COM LTD	21.3	23.1	195	27,122	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	143	158	487	67,667	金融
KKR & CO INC	188	233	1,177	163,563	金融
PAYCHEX INC	117	134	1,610	223,582	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	24.8	27	2,294	318,605	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	667	749	3,431	476,590	生活必需品
P G & E CORP	551	617	935	129,980	公益事業
PFIZER INC	2,031.13	2,321.13	11,487	1,595,237	ヘルスケア
CIGNA CORP	126.2	131	4,201	583,416	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	101.01	118.01	513	71,320	情報技術
ALTICE USA INC- A	109	—	—	—	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	197	225	1,549	215,126	公益事業
STERIS PLC	36	41	731	101,569	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	27	155	841	116,793	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	54.33	60.33	180	25,083	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	121.99	127.99	405	56,379	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	123.3	140.8	3,198	444,241	ヘルスケア
LYFT INC-A	92	125	134	18,678	資本財・サービス
DOW INC	273.68	301.18	1,525	211,842	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	38.5	45	263	36,576	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	77.4	94	663	92,120	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	46.6	53	1,559	216,600	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	445	609	1,690	234,771	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	84.5	95	2,287	317,652	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	886.67	992.67	14,441	2,005,472	生活必需品
EXELON CORP	357.72	405.22	1,620	225,091	公益事業
TELADOC HEALTH INC	51	65	176	24,489	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	147.08	168.08	887	123,288	資本財・サービス
NVR INC	1.2	1.3	592	82,284	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	492.02	535.02	6,647	923,155	エネルギー
TWILIO INC - A	59.5	70	320	44,473	情報技術
DOCUSIGN INC	71	83	369	51,360	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	18.9	21	676	93,898	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	50	57	365	50,746	情報技術
PEPSICO INC	501	572	10,444	1,450,378	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	15	18.2	274	38,136	情報技術

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	千アメリカ・ドル	千円			
DROPBOX INC-CLASS A	114	121	272	37,874	情報技術		
MONGODB INC	20.2	28	398	55,331	情報技術		
SNAP INC - A	347.5	458	449	62,457	コミュニケーション・サービス		
CORTEVA INC	269.18	298.68	1,958	271,969	素材		
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	143	155	1,652	229,433	金融		
AMCOR PLC	564	614	743	103,257	素材		
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	69	84	1,159	160,978	情報技術		
ROKU INC	42.2	48	260	36,115	コミュニケーション・サービス		
AMERICAN WATER WORKS CO INC	65.5	75	1,103	153,249	公益事業		
ACCENTURE PLC-CL A	230.5	262	7,545	1,047,784	情報技術		
10X GENOMICS INC-CLASS A	27.5	—	—	—	ヘルスケア		
PENTAIR PLC	59.25	66.75	298	41,416	資本財・サービス		
QUALCOMM INC	408.5	463	5,480	761,145	情報技術		
INVESCO LTD	141	141	265	36,889	金融		
ADVANCE AUTO PARTS INC	23.5	25.5	377	52,384	一般消費財・サービス		
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	100	106	952	132,246	金融		
DATADOG INC - CLASS A	68	100	720	100,069	情報技術		
PINTEREST INC- CLASS A	199	238	571	79,322	コミュニケーション・サービス		
AVALARA INC	30.5	—	—	—	情報技術		
REGENERON PHARMACEUTICALS	38	45	3,312	459,987	ヘルスケア		
REPUBLIC SERVICES INC	82.5	91	1,243	172,686	資本財・サービス		
BOOKING HOLDINGS INC	15	17	3,429	476,209	一般消費財・サービス		
ROSS STORES INC	131	145	1,693	235,170	一般消費財・サービス		
PACKAGING CORP OF AMERICA	34.5	38.3	508	70,574	素材		
RESMED INC	53.3	61	1,361	189,074	ヘルスケア		
QUEST DIAGNOSTICS INC	47.3	49.3	734	102,016	ヘルスケア		
ROBERT HALF INTL INC	41.5	45	342	47,624	資本財・サービス		
MODERNA INC	123.7	139	2,406	334,230	ヘルスケア		
HUBSPOT INC	15.9	18.8	531	73,800	情報技術		
PERKINELMER INC	41.3	51	681	94,655	ヘルスケア		
CARRIER GLOBAL CORP	302.37	350.87	1,526	212,052	資本財・サービス		
OTIS WORLDWIDE CORP	149.38	175.38	1,348	187,241	資本財・サービス		
BILL. COM HOLDINGS INC	—	39	447	62,104	情報技術		
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	63	—	—	—	金融		
AVANTOR INC	193.5	248	528	73,391	ヘルスケア		
CARLYLE GROUP INC/THE	57	80	239	33,195	金融		
DYNATRACE INC	67	81	294	40,933	情報技術		
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	158.2	183	891	123,736	コミュニケーション・サービス		
REGIONS FINANCIAL CORP	351.85	386.85	886	123,076	金融		
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	—	110	291	40,526	コミュニケーション・サービス		
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	65.5	144	620	86,128	ヘルスケア		
IAC/INTERACTIVECORP	28.8	32.3	156	21,795	コミュニケーション・サービス		
MATCH GROUP INC	93.7	116	543	75,518	コミュニケーション・サービス		
CHEVRON CORP	701.18	772.18	13,978	1,941,232	エネルギー		
PELTON INTERACTIVE INC-A	94	—	—	—	一般消費財・サービス		
ZSCALER INC	30	35	471	65,543	情報技術		
EDISON INTERNATIONAL	140	158	1,003	139,350	公益事業		
ETSY INC	46.5	52	633	88,012	一般消費財・サービス		
TESLA INC	296.2	1,091.5	19,737	2,740,959	一般消費財・サービス		
SNOWFLAKE INC-CLASS A	70	92	1,256	174,469	情報技術		
GEN DIGITAL INC	214	236	533	74,133	情報技術		
DRAFTKINGS INC - CL A	117	—	—	—	一般消費財・サービス		
UNITY SOFTWARE INC	21	79	284	39,516	情報技術		
STANLEY BLACK & DECKER INC	58.52	66.02	531	73,813	資本財・サービス		
SYNOPSIS INC	55.8	63	2,039	283,163	情報技術		
CARVANA CO	26.2	—	—	—	一般消費財・サービス		
CHEWY INC - CLASS A	32.5	39.5	158	22,051	一般消費財・サービス		
CLOUDFLARE INC - CLASS A	85	105	468	65,047	情報技術		
PPD INC	44	—	—	—	ヘルスケア		
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	47.85	49.05	1,889	262,436	コミュニケーション・サービス		
VIATRIS INC	433.21	490.21	548	76,108	ヘルスケア		
DOORDASH INC - A	27	78.5	418	58,147	一般消費財・サービス		
ROBLOX CORP -CLASS A	—	146	435	60,480	コミュニケーション・サービス		
AIRBNB INC-CLASS A	46	156	1,487	206,628	一般消費財・サービス		
CBRE GROUP INC - A	121.5	136	1,039	144,404	不動産		
TWITTER INC	292	—	—	—	コミュニケーション・サービス		
SOUTHERN CO/THE	386.5	440	2,892	401,628	公益事業		
SYSCO CORP	187.5	211	1,795	249,327	生活必需品		
TRAVELERS COS INC/THE	91.03	99.03	1,853	257,456	金融		
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	20	25	146	20,309	金融		
SEI INVESTMENTS COMPANY	43	46	282	39,209	金融		
STEEL DYNAMICS INC	76.5	78.5	805	111,890	素材		
SCHLUMBERGER LTD	503.52	584.52	2,983	414,384	エネルギー		
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	58.5	62	272	37,883	資本財・サービス		
AFFIRM HOLDINGS INC	—	77	98	13,697	情報技術		
AT&T INC	2,589.91	2,961.91	5,630	781,920	コミュニケーション・サービス		
APA CORP	—	144	670	93,167	エネルギー		
SOUTHWEST AIRLINES CO	55.5	60.5	237	32,976	資本財・サービス		
ON SEMICONDUCTOR CORP	155	180	1,272	176,775	情報技術		

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	75	87	425	59,043	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	91.7	102	2,464	342,177	素材
SEMPRA ENERGY	114	130	2,097	291,232	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	65	78	292	40,619	情報技術
CLARIVATE PLC	125	134	122	17,064	資本財・サービス
OAK STREET HEALTH INC	36	—	—	—	ヘルスケア
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	560	685	484	67,349	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	79.5	84.5	434	60,374	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	—	49	211	29,334	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC	335	381	6,590	915,228	情報技術
SALESFORCE.COM INC	352.16	410.66	6,228	865,006	情報技術
WESTROCK CO	98.8	107	392	54,562	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	—	166.09	1,093	151,882	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	259.34	288.34	1,885	261,873	資本財・サービス
TERADYNE INC	60.5	66	588	81,746	情報技術
UNION PACIFIC CORP	240.8	259.8	5,527	767,640	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	—	299	907	126,019	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	234.88	239.88	2,961	411,304	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	549.29	614.79	5,989	831,817	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	262	304	5,620	780,540	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	70.44	78.04	1,658	230,295	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	43.5	—	—	—	金融
AMEREN CORPORATION	92	107	933	129,630	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	342.16	387.66	20,468	2,842,453	ヘルスケア
APPLOVIN CORP CLASS A	—	49	65	9,145	情報技術
VERISIGN INC	37	41	799	111,003	情報技術
LUCID GROUP INC	—	168	163	22,770	一般消費財・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	—	132	380	52,884	一般消費財・サービス
VALERO ENERGY CORP	147.92	169.42	2,290	318,089	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	18.9	22	989	137,444	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	98.88	108.88	430	59,830	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	28.3	28.3	369	51,306	ヘルスケア
ELEVANCE HEALTH INC	89.2	100	5,153	715,680	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	658.62	752.62	7,126	989,665	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,499.22	1,567.22	7,455	1,035,312	金融
WASTE MANAGEMENT INC	152	172	2,839	394,304	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	438	504	1,729	240,207	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	42.5	46	1,007	139,904	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	23.2	24	350	48,653	一般消費財・サービス
WALMART INC	561	626	9,575	1,329,808	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	76.5	87	1,035	143,772	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	37	45	361	50,174	一般消費財・サービス
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	—	559	158	21,968	資本財・サービス
WABTEC CORP	65.11	71.11	701	97,466	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	438	484	3,879	538,780	一般消費財・サービス
WATERS CORP	22.3	25	825	114,623	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	18.9	22	587	81,517	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	265	304	1,248	173,425	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	47.43	48.63	1,159	161,064	金融
WESTERN DIGITAL CORP	112.5	127	457	63,544	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	114.3	130	1,260	175,078	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	182.5	204	1,189	165,132	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	612.5	681.5	14,247	1,978,541	情報技術
PPL CORP	279	304	882	122,512	公益事業
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	—	135.24	1,277	177,346	公益事業
PULTEGROUP INC	94.5	98.5	434	60,309	一般消費財・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	—	954.53	1,063	147,666	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC	85.3	98	1,291	179,410	素材
NORTHERN TRUST CORP	73	82	752	104,490	金融
NVIDIA CORP	903.8	1,035.8	16,198	2,249,537	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	154.63	171.13	2,812	390,622	金融
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	—	35	74	10,411	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	108.5	121	804	111,657	生活必需品
NETFLIX INC	160.7	183.9	5,166	717,521	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	142.4	162	8,743	1,214,272	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	86.5	98.5	412	57,327	公益事業
GLOBE LIFE INC	36.55	38.55	452	62,795	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	64.5	74	899	124,929	金融
TEXTRON INC	83	89	625	86,923	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	141.37	152.87	283	39,401	コミュニケーション・サービス
TEXAS PACIFIC LAND CORP	—	2.5	626	87,015	エネルギー
OMNICOM GROUP	79.5	83	653	90,780	コミュニケーション・サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	—	52.2	640	88,996	資本財・サービス
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC CLA	—	209	21	3,047	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	681.33	662.33	5,354	743,640	情報技術
MASTERCARD INC - A	320.5	359	12,318	1,710,651	情報技術
ONEOK INC	164	185	1,200	166,759	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	347.52	373.52	204	28,373	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	38	44	1,871	259,839	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
AMERCO NON VOTING SERIES N	—	36	216	30,085	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	108.5	117	1,474	204,787	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	42.5	66	668	92,891	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	69.5	74	406	56,437	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	2,794.01	2,999.01	11,096	1,540,948	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	17.2	19	776	107,857	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	67.5	77	747	103,850	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	247.5	265	4,092	568,274	金融
ANALOG DEVICES INC	193.91	214.91	3,522	489,122	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	441.5	670.27	4,919	683,117	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	311.72	329.72	2,025	281,322	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	59.5	66	595	82,736	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	84.5	93	557	77,399	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	30.3	34.3	646	89,748	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	191.5	216	1,287	178,835	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	215.5	246	2,320	322,182	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	82.4	88	2,664	369,953	金融
AMGEN INC	208.5	226	6,372	885,014	ヘルスケア
EATON CORP PLC	145.86	165.36	2,681	372,353	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	62.5	67	1,699	235,994	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	332.5	360	3,717	516,179	情報技術
CME GROUP INC	131.2	149	2,604	361,710	金融
ECOLAB INC	94	106	1,536	213,310	素材
EQUIFAX INC	44.3	51	963	133,800	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	456.5	519	4,450	618,102	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	255	323	1,230	170,897	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	105.5	124	597	82,982	生活必需品
STATE STREET CORP	124.63	152.13	1,124	156,186	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	525.4	601.4	4,834	671,388	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	182	208	1,151	159,849	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	70	86	452	62,843	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	49.8	49.8	399	55,484	素材
CARDINAL HEALTH INC	104	113	888	123,420	ヘルスケア
FEDEX CORP	92	102	1,813	251,877	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	165.04	167.54	1,710	237,502	金融
FMC CORP	46.5	51.5	657	91,335	素材
CERNER CORP	108.5	—	—	—	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	90.13	105.13	1,076	149,497	素材
CITRIX SYSTEMS INC	46	—	—	—	情報技術
INTEL CORP	1,465	1,692	4,889	679,057	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	142	160	548	76,234	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	131.5	134.5	1,019	141,635	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	115.5	129	2,894	401,941	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	386	386	247	34,360	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	53.3	65	1,355	188,266	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	54	58	301	41,907	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	128.7	149	3,856	535,499	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	43.5	43.5	569	79,153	情報技術
SNAP-ON INC	20.2	22	526	73,072	資本財・サービス
CARMAX INC	58	66	442	61,518	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP	280.28	318.28	3,117	432,890	公益事業
TARGET CORP	179.5	194	3,227	448,213	一般消費財・サービス
DOVER CORP	52	60	836	116,125	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	15.8	19	1,122	155,934	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	47.2	—	—	—	資本財・サービス
CINTAS CORP	34.2	38	1,712	237,831	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	173	199	735	102,139	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	54.5	—	—	—	生活必需品
CLOROX COMPANY	44.3	51	751	104,415	生活必需品
ENERGY CORP	74.2	84	947	131,593	公益事業
MICROSOFT CORP	2,596	2,941	70,681	9,815,477	情報技術
INCYTE CORP	69.3	76	591	82,111	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	477.69	541.69	5,464	758,864	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	488.98	549.98	4,206	584,121	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	408.5	462	2,546	353,638	情報技術
BLACKROCK INC	55.1	63	4,498	624,665	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	211	260	795	110,412	公益事業
HASBRO INC	47	54	335	46,621	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	93	104	752	104,563	生活必需品
KEYCORP	354	386	716	99,542	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	33.5	—	—	—	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	510.61	572.11	3,778	524,760	生活必需品
COOPER COS INC/THE	17.7	20	614	85,388	ヘルスケア
CHUBB LTD	162.19	175.99	3,813	529,560	金融
ARROW ELECTRONICS INC	27	27	286	39,830	情報技術
ALLSTATE CORP	109.5	114	1,520	211,156	金融
EBAY INC	249	249	1,089	151,350	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	405	455.5	3,536	491,114	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	50.5	52	443	61,561	素材

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
XILINX INC	88.5	—	—	—	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	89	96	150	20,903	コミュニケーション・サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	84.7	96	2,063	286,547	生活必需品
TRIMBLE INC	90.5	102	575	79,874	情報技術
LENNAR CORP-A	100.5	106	915	127,182	一般消費財・サービス
LEAR CORP	21.5	25	350	48,656	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	213.9	242	3,173	440,648	金融
PACCAR INC	125.37	144.37	1,505	209,027	資本財・サービス
BIOGEN INC	55.2	61	1,777	246,855	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	30.9	35	1,431	198,772	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	427.5	474	4,676	649,423	一般消費財・サービス
PTC INC	40.2	46	566	78,617	情報技術
EVERSOURCE ENERGY	124.1	143	1,153	160,158	公益事業
INTUIT INC	98.8	110.8	4,207	584,252	情報技術
BORGWARNER INC	87.5	97	406	56,481	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	82.5	88.5	744	103,432	一般消費財・サービス
BALL CORP	119.84	130.04	711	98,853	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	517.97	590.97	2,629	365,202	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	105.7	116	1,480	205,533	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	49	55	981	136,297	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	93.5	106	3,353	465,644	ヘルスケア
VF CORP	122.5	134	434	60,403	一般消費財・サービス
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	220.25	252.25	498	69,184	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	22	22	222	30,838	一般消費財・サービス
CARNIVAL CORP	300	409	398	55,377	一般消費財・サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC	—	218	330	45,834	素材
COMCAST CORP-CLASS A	1,660.9	1,847.9	6,556	910,480	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	83	87	422	58,717	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	448	486	193	26,861	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	114,614.26 598銘柄	141,212.8 597銘柄	1,414,769 <65.8%>	196,469,055
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	—	335	2,051	209,619	生活必需品
IMPERIAL OIL LTD	91	95	740	75,681	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	7	8	1,687	172,366	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	96.87	116.87	1,031	105,413	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	161	179	917	93,737	素材
INTACT FINANCIAL CORP	64.5	71.5	1,424	145,577	金融
BCE INC	49.3	49.3	315	32,238	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	69	78	1,503	153,616	素材
SUNCOR ENERGY INC	542.3	582.3	2,645	270,252	エネルギー
METRO INC/CN	86	96	747	76,350	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	120	134	1,318	134,731	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	435	482	3,358	343,062	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	159.5	366	2,349	240,010	金融
TORONTO-DOMINION BANK	652	737	6,602	674,540	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	98	114	365	37,314	金融
ROYAL BANK OF CANADA	510.5	575.5	7,698	786,475	金融
TOURMALINE OIL CORP	—	129	1,046	106,878	エネルギー
TC ENERGY CORP	352.5	397.5	2,435	248,768	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	197.29	223.29	1,078	110,224	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	633	721	1,555	158,952	素材
CAE INC	109	126	361	36,943	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	62.12	68.12	1,050	107,309	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	59	65	237	24,290	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	35	35	378	38,684	素材
BALLARD POWER SYSTEMS INC	78	—	—	—	資本財・サービス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	54.5	61.5	395	40,354	素材
HYDRO ONE LTD	113	131	479	48,995	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	59.6	67.6	819	83,742	生活必需品
NORTHLAND POWER INC	79	94	353	36,145	公益事業
WSP GLOBAL INC	43	50	800	81,804	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	28	33	335	34,323	資本財・サービス
PARKLAND CORP	51	58	162	16,590	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	60	60	173	17,732	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	90	104	536	54,801	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC	—	33	468	47,851	資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A	48	48	174	17,810	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	127	144	883	90,296	コミュニケーション・サービス
BRP INC/CA- SUB VOTING	—	16	155	15,873	一般消費財・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	225	246	281	28,800	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	87	185.17	1,254	128,181	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	215	267	264	27,031	公益事業
B2GOLD CORP	347	—	—	—	素材
AIR CANADA	65	65	122	12,563	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	432	530	289	29,617	素材
BANK OF MONTREAL	231	273	3,563	364,071	金融
POWER CORP OF CANADA	201	222	743	75,931	金融

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
SHOPIFY INC - CLASS A	41	463	2,335	238,628	情報技術
NUTRIEN LTD	203.19	223.19	2,474	252,795	素材
CANOPY GROWTH CORP	84	—	—	—	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	96	—	—	—	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	47	53	225	23,076	公益事業
CAMECO CORP	140	158	500	51,087	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	14	15	254	26,001	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	65	71	271	27,722	資本財・サービス
LIGHTSPEED COMMERCE INC	39	53	110	11,256	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	19	26	100	10,308	情報技術
TELUS CORP	108	108	308	31,511	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	170	194	931	95,151	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	22	22	327	33,465	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	420	466	3,761	384,232	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	10	10	786	80,297	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	102	113	924	94,476	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	27.37	29.37	498	50,965	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	70	78	161	16,526	素材
BLACKBERRY LTD	194	224	146	14,988	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	208.5	238	1,491	152,376	金融
ENBRIDGE INC	727	821	4,558	465,664	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	461.25	571.25	3,488	356,339	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	691	780	1,868	190,845	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	105	113	104	10,689	ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	240	377.2	4,108	419,720	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	37	44	332	33,955	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	70	75	286	29,245	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	255.5	237.5	4,037	412,446	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	79	87	1,005	102,771	情報技術
ONEX CORPORATION	26	29	199	20,394	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	160	190	697	71,274	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	31	31	120	12,290	金融
TMX GROUP LTD	19	23	317	32,472	金融
OPEN TEXT CORP	99	110	433	44,287	情報技術
SAPUTO INC	87	102	329	33,615	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	204	233	729	74,551	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	302	—	—	—	生活必需品
YAMANA GOLD INC	323	—	—	—	素材
FORTIS INC	166	193	1,031	105,386	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	38	44	318	32,530	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	221	246	202	20,708	素材
CENOVUS ENERGY INC	467	555	1,536	156,942	エネルギー
DOLLARAMA INC	107	112	912	93,182	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	29	—	—	—	公益事業
ALTAGAS LTD	103	111	248	25,423	公益事業
KEYERA CORP	74	88	267	27,338	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	—	286	553	56,594	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	14,425.79 88銘柄	16,476.16 86銘柄	98,464 10,059,105	<3.4%>
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円
THE LOTTERY CORPORATION LTD	—	849.5	387	35,944	一般消費財・サービス
TELSTRA GROUP LTD	—	1,563.94	625	58,047	コミュニケーション・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	970	1,050.94	305	28,377	金融
BHP GROUP LTD	1,034	1,973.18	8,843	820,615	素材
SOUTH32 LTD	1,601	1,770.77	720	66,874	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	335.5	740.59	2,727	253,093	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	591	660.05	1,284	119,184	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,159.5	1,250.31	3,962	367,655	金融
WESTPAC BANKING CORP	1,289.48	1,362.77	3,247	301,333	金融
SANTOS LTD	629	1,254.13	919	85,299	エネルギー
AUSNET SERVICES	650	—	—	—	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,008.5	1,168.89	2,911	270,177	金融
RIO TINTO LTD	130	144.67	1,559	144,750	素材
ORIGIN ENERGY LTD	590	688.87	549	50,944	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD	600	676	252	23,459	資本財・サービス
XERO LTD	47.5	51.35	356	33,115	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	34	79	220	20,444	エネルギー
COLES GROUP LTD	468.45	520.8	888	82,442	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	54	54	300	27,844	情報技術
IDP EDUCATION LTD	—	79	232	21,588	一般消費財・サービス
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	370	445.84	469	43,603	素材
EVOLUTION MINING LTD	595	656	175	16,252	素材
AFTERPAY LTD	76	—	—	—	情報技術
REECE LTD	105	105	162	15,101	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	473	512.6	360	33,485	生活必需品
OIL SEARCH LTD	642	—	—	—	エネルギー
SEEK LTD	117	128.45	285	26,495	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	256	275.29	376	34,893	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	千オーストラリア・ドル	千円	
NEWCREST MINING LTD	285	340.97	669	62,106	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	623.5	665.19	7,190	667,163	金融
AMPOL LTD	79.5	88	250	23,279	エネルギー
ORICA LTD	131	177.51	265	24,657	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	519.5	562.69	729	67,666	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD	441	473.31	1,656	153,670	生活必需品
TABCORP HOLDINGS LTD	782.63	—	—	—	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	134	—	—	—	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	305	354.69	219	20,372	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	1,435	—	—	—	コミュニケーション・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	156.5	174.15	512	47,508	素材
MACQUARIE GROUP LTD	119.84	141.98	2,527	234,502	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	211.3	229.09	812	75,356	一般消費財・サービス
CSL LTD	160	187.75	5,680	527,134	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	403	442.06	2,137	198,366	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	23.2	25.1	530	49,240	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	178	178	304	28,259	素材
SUNCORP GROUP LTD	436.57	480.15	576	53,463	金融
ASX LTD	67	73.65	510	47,380	金融
COMPUTERSHARE LTD	182	206.89	572	53,099	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	861.36	964.1	462	42,940	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	159.5	173.28	548	50,937	ヘルスケア
AGL ENERGY LTD	215	—	—	—	公益事業
BRAMBLES LTD	504	561.58	675	62,635	資本財・サービス
MINERAL RESOURCES LTD	—	66.66	558	51,814	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD	61.5	69.73	456	42,341	ヘルスケア
REA GROUP LTD	18	20.23	248	23,041	コミュニケーション・サービス
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	44	—	—	—	金融
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	22	22	144	13,391	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 >	22,384.83 53銘柄	24,740.7 49銘柄	60,365 <1.9%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	525	580	2,320	41,249	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	830	940	4,291	76,295	一般消費財・サービス
MTR CORP	585	665	2,477	44,043	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	510	605	5,608	99,716	不動産
SINO LAND CO	1,260	1,420	1,418	25,222	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,046.69	1,116.69	4,941	87,857	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	185	215	1,294	23,012	不動産
CLP HOLDINGS LTD	620	700	3,955	70,319	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	555.07	595.07	1,446	25,710	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	4,224.75	4,824.75	3,184	56,617	公益事業
HANG SENG BANK LTD	288	329	3,928	69,844	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT	585	635	1,176	20,909	不動産
WH GROUP LTD	3,610	3,610	1,624	28,883	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	461	511	15,330	272,567	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	780	870	1,171	20,820	不動産
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	690	780	1,121	19,942	資本財・サービス
SJM HOLDINGS LTD	710	—	—	—	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	450	450	791	14,065	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	911.69	911.69	4,298	76,429	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	235	265	1,030	18,328	公益事業
AIA GROUP LTD	4,614	5,096	38,831	690,424	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	540	540	822	14,632	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	630	720	2,595	46,149	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	679	741	1,578	28,062	生活必需品
ESR CAYMAN LTD	750	862	1,436	25,533	不動産
SANDS CHINA LTD	928	1,044	2,075	36,901	一般消費財・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	820	820	1,108	19,711	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	530	575	5,111	90,886	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,415	1,590	3,967	70,534	金融
WYNN MACAU LTD	540	—	—	—	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 >	30,508.2 30銘柄	32,011.2 28銘柄	118,935 <0.7%>	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
CAPITALAND INVESTMENT LTD	1,024	1,074	394	39,825	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD	452	508	1,564	158,091	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	699	779	2,722	275,092	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	484.75	539.75	295	29,831	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	563	627	472	47,704	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	171	200	129	13,114	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	161	161	132	13,436	不動産
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,293	1,457	1,802	182,105	金融
GENTING SINGAPORE LTD	2,090	2,380	208	21,041	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	99	112	193	19,577	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,201.5	3,553.5	970	98,019	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	565	627	218	22,109	資本財・サービス

銘柄	期首	当	期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE EXCHANGE LTD	315	357	326	32,969	金融	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	744	800	327	33,060	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 >	11,862.25 14銘柄	13,175.25 14銘柄	9,758	985,979 <0.3%>	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円		
MERIDIAN ENERGY LTD	475	525	248	21,433	公益事業	
MERCURY NZ LTD	260	300	157	13,552	公益事業	
A2 MILK CO LTD	262	—	—	—	生活必需品	
SPARK NEW ZEALAND LTD	727.89	805.3	416	35,894	コミュニケーション・サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	483	521.13	407	35,100	資本財・サービス	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	232	242	552	47,543	ヘルスケア	
RYMAN HEALTHCARE LTD	165	—	—	—	ヘルスケア	
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,604.89 7銘柄	2,393.43 5銘柄	1,782	153,524 <0.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
SHELL PLC	—	3,052.97	7,328	1,218,242	エネルギー	
HALEON PLC	—	2,041.62	582	96,841	生活必需品	
BP PLC	7,330	7,881.77	3,878	644,677	エネルギー	
UNILEVER PLC	948.6	1,041.21	4,294	713,869	生活必需品	
BARCLAYS PLC	6,223	6,832.63	1,100	182,861	金融	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	3,005	3,363.9	299	49,834	資本財・サービス	
PRUDENTIAL PLC	951	1,122.04	1,082	179,951	金融	
NATWEST GROUP PLC	2,102.91	2,183.95	568	94,571	金融	
EVRAZ PLC	174	—	—	—	素材	
JOHNSON MATTHEY PLC	70.64	70.64	150	25,093	素材	
BAE SYSTEMS PLC	1,170	1,288.2	1,043	173,537	資本財・サービス	
AVIVA PLC	1,423.66	1,156.48	518	86,239	金融	
AVEVA GROUP PLC	44	49.48	157	26,122	情報技術	
GSK	1,823	1,659.76	2,353	391,173	ヘルスケア	
INFORMA PLC	527	600.95	366	60,976	コミュニケーション・サービス	
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,595.4	1,787.92	235	39,067	資本財・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	350	380.02	214	35,678	コミュニケーション・サービス	
DCC PLC	34	39.64	177	29,487	資本財・サービス	
OCADO GROUP PLC	175	238.27	147	24,437	生活必需品	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	27.5	29	325	54,039	資本財・サービス	
HALMA PLC	137	152.6	324	53,980	情報技術	
ENTAIN PLC	212	240.59	336	55,890	一般消費財・サービス	
JD SPORTS FASHION PLC	172	997	124	20,625	一般消費財・サービス	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	235	301.68	179	29,888	金融	
M&G PLC	917	1,045.04	200	33,397	金融	
RELX PLC	703.96	785.4	1,798	298,975	資本財・サービス	
DIAGEO PLC	847	932.76	3,514	584,238	生活必需品	
RIO TINTO PLC	407	458.86	2,552	424,325	素材	
STANDARD CHARTERED PLC	970	1,046.59	637	105,950	金融	
TESCO PLC	2,806.84	3,063.36	713	118,648	生活必需品	
SMITH & NEPHEW PLC	319.5	353.11	380	63,275	ヘルスケア	
GLENCORE PLC	3,645.25	4,022.88	2,215	368,332	素材	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	124.5	132.5	112	18,734	金融	
SMITHS GROUP PLC	143.83	153.83	245	40,811	資本財・サービス	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	465.83	—	—	—	金融	
PEARSON PLC	257.63	283.63	279	46,393	コミュニケーション・サービス	
SAINSBURY (J) PLC	595.25	718.64	160	26,651	生活必需品	
NEXT PLC	48.5	53.11	304	50,675	一般消費財・サービス	
TAYLOR WIMPEY PLC	1,277	1,466.73	149	24,893	一般消費財・サービス	
WHITBREAD PLC	73.61	81.27	210	34,935	一般消費財・サービス	
BUNZL PLC	119.05	135.62	415	69,120	資本財・サービス	
VODAFONE GROUP PLC	10,141.83	10,810.03	992	165,032	コミュニケーション・サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	50.11	56.01	375	62,492	素材	
KINGFISHER PLC	737.11	787.11	189	31,506	一般消費財・サービス	
WPP PLC	429	458.47	398	66,182	コミュニケーション・サービス	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	248.27	278.81	286	47,551	公益事業	
SEVERN TRENT PLC	90.83	102.32	277	46,161	公益事業	
RENTOKIL INITIAL PLC	673	747.06	400	66,512	資本財・サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	260	291.82	1,733	288,144	生活必需品	
ST JAMES'S PLACE PLC	194.5	217.32	250	41,670	金融	
SCHROEDERS PLC	41.5	273.52	123	20,496	金融	
SSE PLC	376	435.75	730	121,400	公益事業	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	367	395	157	26,139	一般消費財・サービス	
ASTRAZENECA PLC	561	632.33	6,993	1,162,541	ヘルスケア	
FERGUSON PLC	80.87	87.77	832	138,459	資本財・サービス	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,152	2,396.89	609	101,361	金融	
3I GROUP PLC	350.91	390.73	523	87,066	金融	
ASHTREAD GROUP PLC	161.5	178.54	891	148,126	資本財・サービス	
SAGE GROUP PLC/THE	401.14	401.14	315	52,411	情報技術	
NATIONAL GRID PLC	1,296.34	1,488.17	1,500	249,481	公益事業	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	25,754.65	28,500.13	1,320	219,468	金融	
IMPERIAL BRANDS PLC	341	381.61	810	134,672	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	千イギリス・ポンド	千円	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	38.32	42.32	160	26,612	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	790.6	878.5	2,943	489,283	生活必需品
BHP GROUP PLC	768.27	—	—	—	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	128.5	138	218	36,359	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	7,416.5	8,199.21	4,184	695,515	金融
ANGLO AMERICAN PLC	465.83	518.56	1,705	283,555	素材
MONDI PLC	176	198.53	308	51,350	素材
COMPASS GROUP PLC	647.39	728	1,332	221,518	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	112	128.32	162	27,089	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	3,206	3,453	424	70,514	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	71.5	78	157	26,165	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	142.89	160.61	343	57,134	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	64.36	75.23	356	59,338	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	58.5	64.81	255	42,490	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	120.49	134.5	1,081	179,847	金融
SHELL PLC	1,489	—	—	—	エネルギー
SHELL CLASS B PLC	1,346.18	—	—	—	エネルギー
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	57	66	98	16,418	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	70.5	75	152	25,271	金融
ANTOFAGASTA PLC	141	153	208	34,690	素材
ABRDN PLC	778.62	843.62	173	28,776	金融
EXPERIAN PLC	336.54	375.75	1,078	179,200	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 >	105,587.01 82銘柄	116,867.14 79銘柄	74,742 <4.2% >	
		百株	百株	千イスラエル・シケル	千円
(イスラエル)					
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	443	514.98	1,053	42,477	金融
AZRIELI GROUP LTD	16.5	18.26	443	17,896	不動産
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	—	45.41	687	27,748	情報技術
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	—	890	556	22,453	コミュニケーション・サービス
ICL GROUP LTD	281	304.61	870	35,113	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	9.5	11	636	25,662	資本財・サービス
BANK HAPOLIM BM	441	546.45	1,802	72,711	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	562	664.26	2,091	84,342	金融
NICE LTD	24	27.31	1,777	71,698	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	54	64.07	813	32,793	金融
イスラエル・シケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,831 8銘柄	3,086.35 10銘柄	10,732 <0.1% >	
		百株	百株	千スイス・フラン	千円
(スイス)					
CS GROUP ANR RIGHTS AG	—	1,040.49	10	1,500	金融
UBS GROUP AG-REG	1,306	1,404.83	2,437	355,053	金融
ROCHE HOLDING AG-BR	11	11.8	439	64,080	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2.8	2.8	180	26,328	素材
ADECCO GROUP AG-REG	51.5	63.6	206	30,045	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	250	280.61	8,677	1,264,104	ヘルスケア
SIKA AG-REG	51	58.34	1,358	197,842	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.04	0.04	389	56,753	生活必需品
ABB LTD-REG	627	656.05	1,930	281,253	資本財・サービス
SWISS RE AG	107	120.47	1,018	148,323	金融
NESTLE SA-REG	1,027	1,124.33	12,509	1,822,229	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	8	9	817	119,093	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	15	16.01	287	41,815	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	909.2	1,040.49	301	43,985	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	80	87.08	469	68,422	金融
SGS SA-REG	2.1	2.52	550	80,208	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	6.9	9.34	159	23,238	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	17.5	—	—	—	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG	23	25	143	20,867	情報技術
VAT GROUP AG	—	10.5	270	39,431	資本財・サービス
ALCON INC	178	199.59	1,280	186,540	ヘルスケア
SIG GROUP N AG	—	130	260	37,987	素材
SWATCH GROUP AG/THE-BR	9.7	11.59	284	41,448	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	53.42	60.1	2,716	395,715	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	17	18	256	37,311	金融
CLARIANT AG-REG	77	86.78	135	19,707	素材
NOVARTIS AG-REG	791	863.2	7,190	1,047,433	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1.2	1.41	270	39,435	生活必需品
BACHEM HOLDING AG-REG B	—	12.5	109	15,969	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	186	208.49	2,500	364,297	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	9	10.36	522	76,181	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	10.1	—	—	—	金融
GEBERIT AG-REG	13	14.33	638	93,016	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	3.3	3.69	1,153	168,029	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	3.6	43.89	463	67,450	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	19.92	21.1	510	74,320	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	62	69.29	384	55,998	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	26.9	29.74	1,446	210,676	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	19	19	86	12,659	一般消費財・サービス

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
HOLCIM LTD	185.4	218.29	1,068	155,589	素材	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	11.1	12.37	622	90,637	金融	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	19.2	21.35	480	70,038	資本財・サービス	
SWISS PRIME SITE-REG	27	30.25	236	34,503	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.34	0.42	409	59,713	生活必需品	
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,218.22 40銘柄	8,049.04 42銘柄	55,188	8,039,238 <2.7%>	
	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	648	701.05	61,685	1,191,144	ヘルスケア	
DANSKE BANK A/S	260	296.78	3,773	72,867	金融	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1.2	1.31	1,924	37,159	資本財・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	386.5	430.42	7,578	146,347	資本財・サービス	
GN STORE NORD A/S	48.5	54.65	919	17,760	ヘルスケア	
CARLSBERG AS-B	39	41.8	3,777	72,950	生活必需品	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	78.5	88	3,607	69,653	素材	
COLOPLAST-B	45	51.12	4,413	85,228	ヘルスケア	
DSV PANALPINA A/S	79.1	82.8	9,161	176,914	資本財・サービス	
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	3	3.7	582	11,252	資本財・サービス	
DEMANT A/S	38.75	42.75	857	16,559	ヘルスケア	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2.3	2.3	3,469	66,997	資本財・サービス	
TRYG A/S	132	149.9	2,466	47,630	金融	
PANDORA A/S	38	40	2,015	38,913	一般消費財・サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	40.5	43	1,873	36,185	素材	
GENMAB A/S	25.2	28.29	8,996	173,717	ヘルスケア	
ORSTED A/S	70.5	81.4	4,918	94,970	公益事業	
AMBU A/S-B	63	—	—	—	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 >	1,999.05 18銘柄	2,139.27 17銘柄	122,022	2,356,253 <0.8%>	
	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円		
(ノルウェー)						
DNB BANK	367.5	400.25	7,636	106,151	金融	
NORSK HYDRO ASA	507	578.66	4,228	58,780	素材	
ORKLA ASA	290.5	323.17	2,242	31,165	生活必需品	
TELENOR ASA	278	291.31	2,852	39,649	コミュニケーション・サービス	
EQUINOR ASA	382.23	420.51	15,853	220,359	エネルギー	
SCHIBSTED ASA-CL A	28	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	66.6	71.24	3,314	46,075	素材	
MOWI ASA	166	178	2,734	38,016	生活必需品	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	73.5	80.5	1,510	20,991	金融	
SCHIBSTED ASA-B SHS	36.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
AKER BP ASA	—	135.97	4,617	64,183	エネルギー	
KONGSBERG GRUPPEN ASA	—	37.23	1,489	20,699	資本財・サービス	
SALMAR ASA	—	24.52	816	11,342	生活必需品	
ADEVINTA ASA	106	120	915	12,726	コミュニケーション・サービス	
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,301.83 11銘柄	2,661.36 12銘柄	48,211	670,144 <0.2%>	
	百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円		
(スウェーデン)						
SAGAX CLASS B	—	79.24	1,766	23,208	不動産	
INVESTOR CLASS A	—	214.58	4,260	55,982	金融	
VOLVO CAR CLASS B	—	248.08	1,233	16,212	一般消費財・サービス	
ICA GRUPPEN AB	38.7	—	—	—	生活必需品	
ERICSSON LM-B SHS	1,128.3	1,255.88	8,097	106,406	情報技術	
VOLVO AB-B SHS	556.5	649.3	12,380	162,684	資本財・サービス	
SKF AB-B SHARES	144	164.95	2,855	37,518	資本財・サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	86	86	1,251	16,451	一般消費財・サービス	
SWEDISH MATCH AB	613	657.78	7,577	99,570	生活必需品	
TELE2 AB-B SHS	188	244.23	2,277	29,928	コミュニケーション・サービス	
GETINGE AB-B SHS	—	92	2,194	28,831	ヘルスケア	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	620	700.28	8,371	110,006	金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	548.5	627.59	6,545	86,011	金融	
SWEDBANK AB - A SHARES	341	389.66	6,524	85,736	金融	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	282	314.25	3,696	48,568	一般消費財・サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	229	260.69	3,691	48,504	素材	
SKANSKA AB-B SHS	128.5	146.38	2,500	32,852	資本財・サービス	
SANDVIK AB	431	457	8,774	115,295	資本財・サービス	
INVESTOR AB-B SHS	700	783.94	15,006	197,181	金融	
ATLAS COPCO AB-A SHS	254.5	1,155.75	14,904	195,845	資本財・サービス	
VOLVO AB-A SHS	80	80	1,611	21,171	資本財・サービス	
HOLMEN AB-B SHARES	—	39.06	1,680	22,085	素材	
SECURITAS AB-B SHS	119.5	119.5	1,054	13,861	資本財・サービス	
TELIA CO AB	1,002	1,106.67	3,192	41,952	コミュニケーション・サービス	
ALFA LAVAL AB	119	127	3,752	49,312	資本財・サービス	
ATLAS COPCO AB-B SHS	149	671.61	7,817	102,722	資本財・サービス	
ASSA ABLOY AB-B	387.5	431.26	10,281	135,095	資本財・サービス	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	47.43	52.43	1,389	18,256	金融	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	40	262.68	1,231	16,184	不動産	
INDUTRADE AB	—	113.71	2,499	32,841	資本財・サービス	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円		
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	—	70.32	1,540	20,244	ヘルスケア	
LUNDBERGS AB-B SHS	30	30	1,404	18,448	金融	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	57	57	1,169	15,369	資本財・サービス	
LIFCO AB-B SHS	—	95	1,679	22,069	資本財・サービス	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	543	652.08	6,381	83,849	資本財・サービス	
ORRON ENERGY	75.5	—	—	—	公益事業	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	230	262.04	6,692	87,939	生活必需品	
EMBRACER GROUP AB	200	265.94	1,194	15,698	コミュニケーション・サービス	
BOLIDEN AB	104	113.87	4,332	56,932	素材	
EPIROC AB-A	249.5	274.36	5,417	71,182	資本財・サービス	
EPIROC AB-B	148	167.8	2,852	37,483	資本財・サービス	
HUSQVARNA AB-B SHS	158.5	170.5	1,369	17,994	資本財・サービス	
NORDEA BANK ABP	1,250	1,467.48	16,121	211,839	金融	
EQT AB	91	123.18	2,907	38,198	金融	
EVOLUTION AB	65.5	78.67	8,208	107,858	一般消費財・サービス	
SINCH AB	194	—	—	—	情報技術	
KINNEVIK AB - B	93	104.31	1,654	21,745	金融	
HEXAGON AB-B SHS	764	837.5	9,874	129,746	情報技術	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	62	62	1,634	21,483	金融	
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,548.43 41銘柄	16,363.55 46銘柄	222,858 <1.0%>	2,928,365	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (アイルランド)						
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	86	99.48	345	49,606	素材	
KINGSPAN GROUP PLC	54	60.76	328	47,144	資本財・サービス	
KERRY GROUP PLC-A	56	62.72	569	81,822	生活必需品	
CRH PLC	281	306.32	1,175	168,756	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	60.3	67.04	929	133,458	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	537.3 5銘柄	596.32 5銘柄	3,348 <0.2%>	480,788	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オランダ)						
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	278.91	291.69	649	93,184	コミュニケーション・サービス	
EXOR NV	—	45	332	47,747	金融	
QIAGEN N. V.	76.98	91.05	429	61,678	ヘルスケア	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	322.6	349	491	70,554	ヘルスケア	
NN GROUP NV	99	112.92	455	65,387	金融	
HEINEKEN NV	92	104.07	923	132,538	生活必需品	
AEGON NV	642.44	720.59	336	48,316	金融	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	373.83	419.83	1,173	168,420	生活必需品	
AKZO NOBEL N. V.	67.68	71	484	69,605	素材	
KONINKLIJKE DSM NV	62	70.17	841	120,849	素材	
WOLTERS KLUWER	96	105.4	1,099	157,840	資本財・サービス	
ING GROEP NV	1,396	1,568.62	1,829	262,654	金融	
KONINKLIJKE KPN NV	1,211.5	1,327.81	386	55,497	コミュニケーション・サービス	
ASML HOLDING NV	150.1	163.2	9,135	1,311,737	情報技術	
ABN AMRO BANK NV-CVA	151.5	167	205	29,444	金融	
IMCD NV	—	22.46	312	44,873	資本財・サービス	
ADYEN NV	7	8.7	1,241	178,253	情報技術	
JUST EAT TAKEAWAY	64.5	72.2	151	21,707	一般消費財・サービス	
PROSUS NV	333.8	354.8	2,138	307,028	一般消費財・サービス	
JDE PEET'S NV	26	37	108	15,512	生活必需品	
ASM INTERNATIONAL NV	17	18.83	482	69,253	情報技術	
VOPAK	23	—	—	—	エネルギー	
RANDSTAD NV	43	47.2	263	37,774	資本財・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	39.5	42.5	308	44,240	生活必需品	
OCI NV	—	43.86	175	25,151	素材	
EURONEXT NV	—	33	236	34,010	金融	
STMICROELECTRONICS NV	244	274.39	980	140,843	情報技術	
AIRBUS SE	211	237.36	2,591	372,087	資本財・サービス	
ARGENX SE	16.4	22.29	812	116,590	ヘルスケア	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	195	210.64	211	30,349	生活必需品	
EXOR NV	37.8	—	—	—	金融	
CNH INDUSTRIAL NV	366	402.65	612	87,874	資本財・サービス	
STELLANTIS NV	732	883.5	1,299	186,600	一般消費財・サービス	
FERRARI NV	44.95	50.61	1,055	151,508	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	7,421.49 30銘柄	8,369.34 32銘柄	31,753 <1.5%>	4,559,118	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ベルギー)						
UCB SA	45.3	49.76	383	55,112	ヘルスケア	
KBC GROUP NV	89	98.43	516	74,224	金融	
COLRUYT SA	16	—	—	—	生活必需品	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	40	42	323	46,469	金融	
SOLVAY SA	26	29.84	280	40,333	素材	
UMICORE	70	82.69	282	40,628	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	272	348.72	1,959	281,389	生活必需品	
AGEAS	62.9	62.9	237	34,146	金融	
D'IETERN GROUP	—	10.36	184	26,477	一般消費財・サービス	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
PROXIMUS	百株 49.5	百株 60.35	千ユーロ 61	千円 8,799	コミュニケーション・サービス	
ELIA GROUP SA/NV	10.5	13.33	178	25,684	公益事業	
SOFINA	6	6	126	18,177	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	687.2 11銘柄	804.38 11銘柄	4,537 <0.2%>	651,443	
ユーロ (ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
AROUNDTOWN SA	325	380	88	12,745	不動産	
ARCELORMITTAL	257	257	666	95,718	素材	
INPOST SA	70	—	—	—	資本財・サービス	
EUROFINS SCIENTIFIC	47.5	52.96	355	50,977	ヘルスケア	
TENARIS SA	157	186.08	304	43,763	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	856.5 5銘柄	876.04 4銘柄	1,415 <0.1%>	203,204	
ユーロ (フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TOTALENERGIES SE	893.5	995.42	5,867	842,384	エネルギー	
MICHELIN (CGDE)	60.5	267.4	707	101,511	一般消費財・サービス	
AIR LIQUIDE SA	169.77	209.95	2,913	418,286	素材	
KERING	27	30.04	1,660	238,344	一般消費財・サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	193.5	217.87	3,025	434,441	資本財・サービス	
BOUYGUES SA	82	90.62	269	38,669	資本財・サービス	
BNP PARIBAS	403	446.02	2,389	343,059	金融	
THALES SA	38.5	42.91	522	75,072	資本財・サービス	
DANONE	234	257.08	1,293	185,665	生活必需品	
CARREFOUR SA	212	244.54	403	57,968	生活必需品	
SUEZ	126.25	—	—	—	公益事業	
VIVENDI	278.91	295.91	253	36,326	コミュニケーション・サービス	
L'OREAL	90.4	96.88	3,366	483,373	生活必需品	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	179	199.87	883	126,784	資本財・サービス	
LEGRAND SA	94.67	107.37	838	120,338	資本財・サービス	
PERNOD RICARD SA	74.87	84.11	1,572	225,770	生活必需品	
EURAZEO SE	12.54	17.24	104	14,975	金融	
SOCIETE GENERALE SA	290	319.64	769	110,489	金融	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	99.1	111.46	7,824	1,123,440	一般消費財・サービス	
ACCOR SA	61.5	67.17	167	23,994	一般消費財・サービス	
CAPGEMINI SE	57.2	65.74	1,135	163,057	情報技術	
VALEO SA	77	84	148	21,263	一般消費財・サービス	
PUBLICIS GROUPE	80	91.79	578	83,029	コミュニケーション・サービス	
BUREAU VERITAS SA	106	116.05	292	41,939	資本財・サービス	
EIFFAGE	30.4	32.85	310	44,543	資本財・サービス	
SODEXO SA	29.5	34.91	317	45,632	一般消費財・サービス	
IPSEN	11.5	14	152	21,870	ヘルスケア	
ORPEA	18	—	—	—	ヘルスケア	
AMUNDI SA	22.5	22.5	118	16,992	金融	
TELEPERFORMANCE	21	23.15	495	71,130	資本財・サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT	30	36	94	13,542	コミュニケーション・サービス	
FAURECIA	38.57	—	—	—	一般消費財・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	10	11	347	49,861	ヘルスケア	
SEB SA	9.97	9.97	76	10,993	一般消費財・サービス	
ESSILORLUXOTTICA	101.5	115.49	2,026	291,015	ヘルスケア	
DASSAULT AVIATION SA	10	10	151	21,709	資本財・サービス	
WORLDLINE SA	85.14	96.06	430	61,803	情報技術	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	35	41.63	155	22,360	一般消費財・サービス	
AXA SA	694	762.06	2,084	299,309	金融	
EDENRED	88.5	100.44	528	75,884	情報技術	
RENAULT SA	64	77.55	261	37,612	一般消費財・サービス	
HERMES INTERNATIONAL	11.3	12.72	1,887	271,028	一般消費財・サービス	
REMY COINTREAU	7.5	9	145	20,908	生活必需品	
ATOS SE	32	—	—	—	情報技術	
DASSAULT SYSTEMES SE	234.5	267.58	929	133,525	情報技術	
WENDEL	9.3	9.3	80	11,623	金融	
ORANGE	714	800.96	788	113,207	コミュニケーション・サービス	
ALSTOM	114	125.25	307	44,167	資本財・サービス	
CNP ASSURANCES	58.5	—	—	—	金融	
SANOFI	407.25	457.21	4,032	578,933	ヘルスケア	
VINCI SA	188.5	214.23	2,069	297,102	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	197	261.79	636	91,413	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA	416	491.28	471	67,758	金融	
BIOMERIEUX	13.4	16.91	162	23,322	ヘルスケア	
ENGIE	646.23	733.28	1,052	151,188	公益事業	
EDF	202.5	221.2	265	38,111	公益事業	
SAFRAN SA	122	137.22	1,598	229,528	資本財・サービス	
ARKEMA	22.2	23.95	201	28,864	素材	
ADP	9.1	11.1	161	23,220	資本財・サービス	
SCOR SE	55.5	—	—	—	金融	
GETLINK SE	142	173.45	275	39,609	資本財・サービス	
BOLLORE	286	356.75	186	26,814	コミュニケーション・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,129.57 62銘柄	10,169.87 56銘柄	59,790 <2.9%>	8,584,781	

外国株式インデックスマザーファンド

銘	柄	期 首		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ドイツ)						
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		—	179.02	554	79,578	資本財・サービス
DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)		—	46	489	70,306	一般消費財・サービス
BAYER AG-REG		352.2	394.42	2,207	316,906	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		70	80	148	21,290	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		739	813.28	830	119,222	金融
COMMERZBANK AG		329.35	420.31	336	48,350	金融
VOLKSWAGEN AG		11.1	12	218	31,306	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		65.5	74.51	1,027	147,463	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG		273.5	307.42	4,091	587,406	資本財・サービス
E. ON SE		793	901.36	818	117,588	公益事業
UNIPER SE		66.5	66.5	31	4,571	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		117.5	132.93	1,126	161,754	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		50.5	58	225	32,394	資本財・サービス
CONTINENTAL AG		39.6	43.42	251	36,083	一般消費財・サービス
BASF SE		328.7	368.75	1,809	259,748	素材
ALLIANZ SE-REG		147.4	164.11	3,374	484,453	金融
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		64	71.68	490	70,375	生活必需品
RHEINMETALL AG		—	18.13	350	50,357	資本財・サービス
RWE AG		227	257.91	1,076	154,566	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		96.5	219.5	166	23,926	資本財・サービス
BRENTAG SE		53.5	60.9	368	52,971	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA		148	164.83	433	62,171	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		33.2	38.39	73	10,550	コミュニケーション・サービス
SAP SE		373.92	419.6	4,325	621,017	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		50.4	56.25	1,695	243,502	金融
ZALANDO SE		76.5	87.83	256	36,886	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG		53.5	57.08	299	43,010	素材
KION GROUP AG		24	27	73	10,509	資本財・サービス
COVESTRO AG		67	73	279	40,070	素材
RATIONAL AG		1.9	1.9	110	15,890	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG		12.1	12.1	427	61,396	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF		53	60.35	350	50,257	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE		58	64.43	253	36,429	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		14	15.92	202	29,006	ヘルスケア
BECHTLE AG		28.5	32.38	110	15,811	情報技術
NEMETSCHKE SE		20	22.84	104	14,970	情報技術
SCOUT24 AG		36	36	183	26,412	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		101	110.97	559	80,366	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG		25	28	151	21,709	資本財・サービス
HELLOFRESH SE		57	65.16	147	21,199	生活必需品
TEAMVIEWER AG		53.5	—	—	—	情報技術
SIEMENS ENERGY AG		143.25	172.9	270	38,900	資本財・サービス
BEIERSDORF AG		36.1	39.8	409	58,830	生活必需品
FUCHS PETROLUB PREF		23.5	—	—	—	素材
MERCK KGAA		46	51.89	893	128,220	ヘルスケア
ADIDAS AG		68.1	72	870	125,024	一般消費財・サービス
PUMA SE		38.6	41.63	199	28,601	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		37.5	41.01	264	37,978	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		1,192	1,301.22	2,532	363,644	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &		72.2	80.7	239	34,366	ヘルスケア
MERCEDES-BENZ GROUP N AG		306.5	325	2,032	291,833	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		467	524.3	1,604	230,353	情報技術
HANNOVER RUECK SE		22	23.78	430	61,867	金融
DEUTSCHE POST AG-REG		354.5	397.96	1,505	216,214	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG		67.1	76.28	1,315	188,926	金融
LANXESS AG		28	—	—	—	素材
MTU AERO ENGINES AG		17.9	21.04	415	59,633	資本財・サービス
SYMRISE AG		44	52.28	562	80,805	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		338	413.12	93	13,452	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF		19.5	22	176	25,317	一般消費財・サービス
VONOVIA SE		195	287.7	684	98,312	不動産
LEG IMMOBILIEN SE		25.5	28	172	24,748	不動産
国 小 計	株 数、金 額	8,653.62	10,036.79	44,705	6,418,828	
	銘柄数 < 比率 >	59 銘柄	59 銘柄		<2.2% >	
ユーロ (ポルトガル)						
JERONIMO MARTINS		85	114.16	243	34,978	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		992	1,094	483	69,427	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		167.5	201.96	234	33,608	エネルギー
国 小 計	株 数、金 額	1,244.5	1,410.12	961	138,014	
	銘柄数 < 比率 >	3 銘柄	3 銘柄		<0.0% >	
ユーロ (スペイン)						
TELEFONICA SA		1,867.27	2,104.78	755	108,491	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA		103.5	121	212	30,481	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		2,367	2,677	1,505	216,166	金融
IBERDROLA SA		2,119.34	2,395.38	2,552	366,455	公益事業
REPSOL SA		534	572.01	837	120,196	エネルギー

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		
GRIFOLS SA	98	118.3	117	16,890	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	6,199.5	6,823.35	1,934	277,792	金融	
AMADEUS IT GROUP SA	160.5	180.86	919	132,072	情報技術	
NATURGY ENERGY GROUP SA	103	103	270	38,776	公益事業	
CAIXABANK SA	1,605	1,749.27	620	89,111	金融	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	88.76	88.76	238	34,192	資本財・サービス	
AENA SME SA	26	29	351	50,527	資本財・サービス	
CELLNEX TELECOM SA	180.05	214.6	699	100,478	コミュニケーション・サービス	
ACCIONA SA	—	10.28	186	26,759	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	390	437.94	1,091	156,695	一般消費財・サービス	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	85	94.14	169	24,343	資本財・サービス	
ENAGAS SA	79.5	98.84	170	24,551	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	157	157	266	38,287	公益事業	
FERROVIAL SA	176.7	190.18	485	69,712	資本財・サービス	
EDP RENOVAVEIS SA	110	115.94	251	36,173	公益事業	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	16,450.12 19銘柄	18,281.63 20銘柄	13,638	1,958,157 <0.7%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (イタリア)						
PRYSMIAN SPA	88.5	100.4	338	48,608	資本財・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI	394.43	446	755	108,478	金融	
MEDIOBANCA SPA	223.65	244.07	225	32,436	金融	
UNICREDIT SPA	763.56	832.17	1,078	154,849	金融	
TELECOM ITALIA SPA	3,439.82	3,787.82	82	11,834	コミュニケーション・サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	2,039.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
INTESA SANPAOLO	5,945.37	6,630.75	1,415	203,213	金融	
ATLANTIA SPA	172.57	195.31	447	64,301	資本財・サービス	
POSTE ITALIANE SPA	177	210.74	198	28,509	金融	
MONCLER SPA	74	82.61	396	56,933	一般消費財・サービス	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	38.5	42.17	168	24,225	ヘルスケア	
ENI SPA	904	1,013.29	1,438	206,535	エネルギー	
DIASORIN SPA	8.5	10	128	18,507	ヘルスケア	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	112	128	120	17,249	コミュニケーション・サービス	
NEXI SPA	158.5	199	165	23,829	情報技術	
AMPLIFON SPA	43	47	127	18,294	ヘルスケア	
ENEL SPA	2,911.34	3,265.35	1,667	239,389	公益事業	
SNAM SPA	701	793.5	380	54,652	公益事業	
TERNA SPA	490	554.64	399	57,321	公益事業	
FINECOBANK SPA	219	232	350	50,365	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	18,904.24 20銘柄	18,814.82 19銘柄	9,886	1,419,535 <0.5%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (フィンランド)						
UPM-KYMMENE OYJ	191.5	214.28	742	106,636	素材	
NOKIA OYJ	1,913	2,172.54	993	142,584	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP	170	191.24	156	22,433	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS	197	214	300	43,139	素材	
ELISA OYJ	51	57.25	283	40,738	コミュニケーション・サービス	
SAMPO OYJ-A SHS	178	196.22	948	136,161	金融	
FORTUM OYJ	159	169	253	36,446	公益事業	
KESKO OYJ-B SHS	98	104	213	30,656	生活必需品	
KONE OYJ-B	121	133.75	648	93,138	資本財・サービス	
NESTE OYJ	151	169.85	793	113,863	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	36	40	201	28,957	ヘルスケア	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,265.5 11銘柄	3,662.13 11銘柄	5,535	794,754 <0.3%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オーストリア)						
VERBUND AG	24.3	27.4	234	33,715	公益事業	
OMV AG	53	56.5	280	40,220	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	100	135.46	398	57,219	金融	
VOESTALPINE AG	42.5	42.5	111	15,987	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	52.5	—	—	—	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	272.3 5銘柄	261.86 4銘柄	1,024	147,143 <0.0%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	67,422.34 230銘柄	73,283.3 224銘柄	176,596	25,355,769 <8.5%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	394,308.1 1,220銘柄	452,459.55 1,209銘柄	—	267,590,825 <89.7%>	

(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 □ 数	期末		
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)					
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5.087	5.837	996	138,439	
SIMON PROPERTY GROUP INC	11.857	13.607	1,598	221,952	
BOSTON PROPERTIES INC	5.47	6.2	438	60,863	
VORNADO REALTY TRUST	5.897	6.297	159	22,132	
SBA COMMUNICATIONS CORP	4.04	4.5	1,325	184,068	
EQUITY RESIDENTIAL	13.05	14.8	940	130,674	
EQUINIX INC	3.288	3.808	2,555	354,815	
AMERICAN TOWER CORP	16.45	18.9	4,105	570,124	
HOST HOTELS & RESORTS INC	24.943	29.043	541	75,259	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	—	13	422	58,690	
KIMCO REALTY CORP	—	25	568	78,878	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	—	15.5	308	42,899	
GAMING AND LEISURE PROPRTIE	—	11	567	78,776	
INVITATION HOMES INC	20.85	25.2	804	111,704	
VICI PROPERTIES INC	19.8	39.8	1,340	186,094	
VENTAS INC	13.8	16.5	749	104,027	
WEYERHAEUSER CO	27.564	30.814	978	135,905	
AGNC INVESTMENT CORP	19.6	—	—	—	
CROWN CASTLE INTL CORP	15.75	17.9	2,490	345,795	
IRON MOUNTAIN INC	10.26	11.8	635	88,258	
SUN COMMUNITIES INC	4.1	5	724	100,548	
PROLOGIS INC	26.952	38.154	4,342	603,016	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5.1	6.4	976	135,554	
CAMDEN PROPERTY TRUST	3.45	4.2	494	68,678	
DUKE REALTY CORP	13.8	—	—	—	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2.4	2.7	579	80,422	
WELLTOWER INC	15.3	18.8	1,300	180,664	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	19.8	21.9	561	77,977	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4.25	4.8	777	107,931	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6.15	7.2	471	65,421	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	50.8	17.9	379	52,723	
REALTY INCOME CORP	19.445	24.895	1,550	215,381	
PUBLIC STORAGE	5.67	6.5	1,888	262,311	
REGENCY CENTERS CORP	5.7	6.3	414	57,584	
UDR INC	10.55	12.9	525	73,000	
WP CAREY INC	6.4	8	625	86,899	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	8.3	—	—	—	
DIGITAL REALTY TRUST INC	10.3	11.8	1,283	178,204	
EXTRA SPACE STORAGE INC	4.9	5.6	859	119,388	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	21.65	24.2	314	43,621	
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額	462.723	536.755	39,595	5,498,694
	銘柄数 < 比率 >	36銘柄	37銘柄		<1.8% >
(カナダ)					
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2.9	3.4	147	15,039	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5.8	5.8	123	12,603	
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額	8.7	9.2	270	27,643
	銘柄数 < 比率 >	2銘柄	2銘柄		<0.0% >
(オーストラリア)					
DEXUS/AU	36.15	40.978	322	29,886	
LENDLEASE GROUP	23.5	25.3	192	17,888	
TRANSURBAN GROUP	95.4	119.689	1,698	157,593	
SYDNEY AIRPORT	45.8	—	—	—	
APA GROUP	41.4	45.041	505	46,934	
SCENTRE GROUP	181.922	203.007	596	55,380	
GPT GROUP	68.16	73.031	319	29,613	
MIRVAC GROUP	136.1	144.9	321	29,848	
STOCKLAND	83.8	91.123	346	32,130	
GOODMAN GROUP	58.2	65.537	1,224	113,657	
VICINITY CENTRES	137.273	151.865	308	28,605	
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額	907.705	960.471	5,836	541,538
	銘柄数 < 比率 >	11銘柄	10銘柄		<0.2% >

銘柄	柄	期首		当 期 末	
		□ 数	□ 数	評 価 額	額
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千香港・ドル	千円
(香港)					
LINK REIT		81.5	90.8	4,776	84,918
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		92	107	594	10,577
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		138	163	1,527	27,155
香港・ドル通貨計	□ 数、金額	311.5	360.8	6,898	122,651
	銘柄数 < 比率 >	3銘柄	3銘柄		<0.0% >
(シンガポール)					
CAPITALAND ASCENDAS REIT		124.5	144.5	398	40,296
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		190.87	220.07	457	46,250
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		114.3	140.8	226	22,904
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS		77.5	101.3	175	17,707
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額	507.17	606.67	1,258	127,159
	銘柄数 < 比率 >	4銘柄	4銘柄		<0.0% >
(イギリス)					
LAND SECURITIES GROUP PLC		23.562	28.317	175	29,212
SEGRO PLC		43.1	48.274	390	64,870
BRITISH LAND CO PLC		29.55	35.395	143	23,811
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金額	96.212	111.986	709	117,894
	銘柄数 < 比率 >	3銘柄	3銘柄		<0.0% >
ユーロ (ベルギー)					
WAREHOUSES DE PAUW SCA		—	6.192	159	22,866
国 小 計	□ 数、金額	—	6.192	159	22,866
	銘柄数 < 比率 >	—	1銘柄		<0.0% >
ユーロ (フランス)					
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		4.6	4.6	239	34,331
GECINA SA		1.6	1.817	172	24,718
KLEPIERRE		7.15	8.527	189	27,277
COVIVIO		1.75	2	112	16,181
国 小 計	□ 数、金額	15.1	16.944	713	102,508
	銘柄数 < 比率 >	4銘柄	4銘柄		<0.0% >
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金額	15.1	23.136	873	125,375
	銘柄数 < 比率 >	4銘柄	5銘柄		<0.0% >
合 計	□ 数、金額	2,309.11	2,609.018	—	6,560,957
	銘柄数 < 比率 >	63銘柄	64銘柄		<2.2% >

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末		
	買 建 額	売 建 額	
百万円			
外	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	16,506	—
	S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	1,181	—
	SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	976	—
	FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	1,363	—
国	SWISS MKT IX FUTR (ドイツ)	1,064	—
	EURO STOXX 50 (ドイツ)	3,061	—

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

■投資信託財産の構成

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
千円		
株式	267,590,825	89.4%
投資信託証券	6,560,957	2.2
コール・ローン等、その他	25,191,110	8.4
投資信託財産総額	299,342,893	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=138.87円、1カナダ・ドル=102.16円、1オーストラリア・ドル=92.79円、1香港・ドル=17.78円、1シンガポール・ドル=101.04円、1ニュージーランド・ドル=86.13円、1イギリス・ポンド=166.23円、1イスラエル・シケル=40.334円、1スイス・フラン=145.67円、1デンマーク・クローネ=19.31円、1ノルウェー・クローネ=13.90円、1スウェーデン・クローネ=13.14円、1ユーロ=143.58円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産 (281,426,799千円) の投資信託財産総額 (299,342,893千円) に対する比率は、94.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	316,046,707,918円
コール・ローン等	19,697,892,356
株式(評価額)	267,590,825,704
投資信託証券(評価額)	6,560,957,279
未収入金	17,359,297,553
未収配当金	373,891,289
差入委託証拠金	4,463,843,737
(B) 負債	17,673,443,530
未払金	17,579,182,430
未払解約金	94,261,100
(C) 純資産総額 (A - B)	298,373,264,388
元本	69,133,888,947
次期繰越損益金	229,239,375,441
(D) 受益権総口数	69,133,888,947口
1万口当り基準価額 (C / D)	43,159円

* 期首における元本額は61,024,141,090円、当作成期間中における追加設定元本額は13,890,679,058円、同解約元本額は5,780,931,201円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額:

ダイワ外国株式インデックスV A	308,081,421円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA (一般投資家私募)	3,459,588円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA (一般投資家私募)	38,681,400円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA (一般投資家私募)	6,474,561円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA (一般投資家私募)	180,994,510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)	67,499,826円
ダイワファンダ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)	507,554,812円
ダイワファンダラップ 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	2,997,935,211円
ダイワファンダラップオンライン 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)	637,435,268円
D-1's 外国株式インデックス	18,410,629円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	45,911,834円
iFree 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	5,903,409,265円
iFree 8資産バランス	1,346,263,819円
iFree 年金バランス	249,849,751円
DCダイワ外国株式インデックス	43,789,686,887円
ダイワ・ライフ・バランス30	521,693,855円
ダイワ・ライフ・バランス50	1,000,508,647円
ダイワ・ライフ・バランス70	822,473,467円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,893,327,736円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	12,179,865円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	12,114,090円
ダイワつみたてインデックス外国株式	1,381,872,090円
ダイワつみたてインデックスバランス30	1,875,196円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,222,293円
ダイワつみたてインデックスバランス70	4,706,722円
ダイワ先進国株式インデックス(為替ヘッジなし)(投資一任専用)	4,098,586円
ダイワ世界バランスファンド40VA	72,721,941円
ダイワ世界バランスファンド60VA	53,797,340円
ダイワ・バランスファンド35VA	1,210,030,069円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	62,518,246円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	173,081,567円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,145,121,735円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	424,216,950円
ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	1,263,595,028円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,883,082,448円
ダイワライフスタイル25	10,488,019円
ダイワライフスタイル50	43,394,568円
ダイワライフスタイル75	33,119,707円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は43,159円です。

■損益の状況

当期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	5,013,779,268円
受取配当金	4,997,566,673
受取利息	2,630,838
その他収益金	17,944,482
支払利息	△ 4,362,725
(B) 有価証券売買損益	9,907,636,349
売買益	70,488,347,988
売買損	△ 60,580,711,639
(C) 先物取引等損益	△ 1,484,431,503
取引益	1,507,074,420
取引損	△ 2,991,505,923
(D) その他費用	△ 54,725,127
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	13,382,258,987
(F) 前期繰越損益金	189,753,070,273
(G) 解約差損益金	△ 17,928,619,053
(H) 追加信託差損益金	44,032,665,234
(I) 合計 (E + F + G + H)	229,239,375,441
次期繰越損益金 (I)	229,239,375,441

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

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

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

★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（設定日：2016年9月26日）	
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	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 エマーシングインデックスとの連動をめざすETF（上場投資信託証券）
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	外国株式インデックスマザーファンドの株式組入上限比率	
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

運用報告書(全体版)

第7期

(決算日 2023年6月15日)

(作成対象期間 2022年6月16日～2023年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2730>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			株式組入比率	株式先物比率	投資証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率				
3期末(2019年6月17日)	円 13,793	円 0	% 0.1	% 93.8	% 1.3	% 4.0	百万円 1,747
4期末(2020年6月15日)	円 13,573	円 0	% △ 1.6	% 93.5	% 0.7	% 4.8	百万円 1,800
5期末(2021年6月15日)	円 19,822	円 0	% 46.0	% 90.7	% 5.1	% 3.4	百万円 2,402
6期末(2022年6月15日)	円 20,510	円 0	% 3.5	% 91.2	% 3.9	% 3.9	百万円 2,605
7期末(2023年6月15日)	円 24,679	円 0	% 20.3	% 91.0	% 4.5	% 3.5	百万円 3,957

(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。

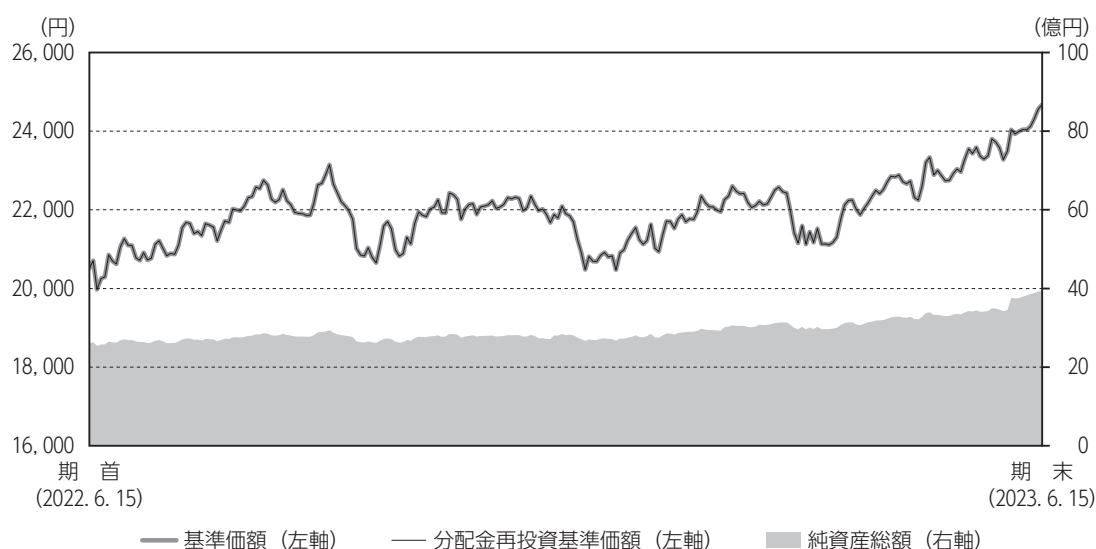
(注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(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



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：20,510円

期末：24,679円(分配金0円)

騰落率：20.3%(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	23.1%	79.0%
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	12.8%	20.2%

■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて、主に海外の株式に投資した結果、海外株式市況が上昇し、為替相場が円安となったことにより、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資証券 組入比率
	円	騰 落 率 %			
(期首)2022年 6月15日	20,510	—	91.2	3.9	3.9
6月末	21,097	2.9	91.3	3.8	4.1
7月末	21,610	5.4	91.1	4.1	4.0
8月末	21,937	7.0	89.8	5.3	3.9
9月末	20,799	1.4	90.3	5.1	3.7
10月末	22,426	9.3	89.1	6.1	3.5
11月末	22,060	7.6	87.4	8.0	3.6
12月末	20,827	1.5	88.9	6.7	3.6
2023年 1月末	21,693	5.8	87.8	7.6	3.5
2月末	22,218	8.3	90.4	5.5	3.5
3月末	22,124	7.9	90.6	5.5	3.2
4月末	22,605	10.2	90.2	5.6	3.3
5月末	23,580	15.0	89.8	6.1	3.4
(期末)2023年 6月15日	24,679	20.3	91.0	4.5	3.5

(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

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■先進国株式市況

先進国株式市況は上昇しました。

先進国株式市況は、当作成期首より横ばいで推移し、2022年7月中旬に米国の利上げペース鈍化の可能性が意識されて上昇しましたが、8月以降はF R B (米国連邦準備制度理事会) 議長講演において利上げ継続姿勢が強調されたことへの懸念から下落しました。10月以降は、英国政府が市場の懸念材料になっていた減税策の一部撤回を表明したことや、F R Bが今後利上げ幅を縮小させるのではないかと期待を背景に上昇しました。その後2023年2月には、米国の利上げ長期化への懸念から軟調な展開となり、3月には、米国の地方銀行の経営破綻やスイスの金融大手の株価急落により信用不安が高まり、続落しました。破綻した米国の地方銀行の預金保護や、F R Bによる金融機関への流動性供給、スイスの金融会社の救済合併の決定などにより、3月下旬には信用不安が後退したことから上昇しました。4月以降は、横ばいでの推移となりましたが、5月下旬以降は、A I (人工知能) 関連で使用される半導体メーカーの強気見通しや、米国の債務上限問題の解決などが好感されて上昇し、当作成期末を迎えました。

■先進国為替相場

為替相場は円安となりました。

対円為替相場は、当作成期首より2022年10月にかけて、世界の主要な中央銀行が政策金利見通しを大幅に引き上げたのに対し、日銀は指値オペを行い長期金利上昇の抑制を図るなど、金融政策の相違が明確となって円安が大きく進行しました。11月に入ると、米国のインフレ率の低下期待などから米国金利が低下したことで日米金利差の縮小が意識され、円高に転じました。12月には、日銀が想定外の政策修正を行ったことで金融緩和政策の転換などが意識され、日本の長期金利が大きく上昇するとともに円高が進行しました。2023年2月は、堅調な米国の経済指標を受けて米国金利が大きく上昇したことで、円安に転じて推移しました。3月は欧米の金融不安により円高に推移しましたが、当作成期末にかけては、日銀の金融緩和政策維持を受けて円安に推移しました。

■新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

新興国株式市況は、当作成期首より、金融引き締めによる欧米景気への悪影響が懸念され下落しました。2022年7月中旬には、米国の利上げペースの鈍化の可能性が意識されて上昇しましたが、9月に入ると、世界的なインフレ率の高止まりや主要中央銀行の積極的な利上げによる景気悪化懸念などを背景に、一段と下落しました。10月は、中国・共産党大会を受けて習近平国家主席への権力集中に対する懸念が高まったことなどを背景に、中国株を中心に大幅な下落となりました。その後は、ゼロコロナ政策の緩和が好感された中国を中心に反発して推移しました。2023年2月以降は、米国の金融引き締め長期化への警戒感から下落しました。その後は、欧米金融機関の信用不安を受けた投資家心理の悪化を背景に一時的に下落しましたが、米国当局が必要に応じて支援を拡充する構えを示したことを受けて金融システムへの警戒感が後退する中、反発して当作成期末を迎えました。

■新興国為替相場

新興国為替相場は対円で上昇しました。

新興国為替相場は、当作成期首より、F R B (米国連邦準備制度理事会) がインフレ抑制のために大幅な利上げの実施を決定したことに対し、日銀は引き続き金融緩和姿勢を維持したことで、日米の金融政策の相違が意識され大きく円安米ドル高が進行しました。新興国の為替相場についても円安が進行しました。その後も、新興国の多くがインフレ対策や通貨防衛などのために金融引き締めを行い、利上げ傾向となりました。また、堅調な米国経済指標や複数のF R B高官による金融引き締めを継続する発言から米国金利が上昇し、日米金利差の拡大を背景に円安米ドル高が進行したことから、新興国通貨も対円で上昇して推移しました。2022年11月以降は、F R Bの金融引き締め観測の後退から米国金利が低下する中、日米金利差の縮小により円高が進行したことなどから、多くの通貨が対円で下落しました。12月には、日銀がイールドカーブ・コントロール (長短金利操作) の長期金利の上限引き上げを実施したことにより円高が進行したことから、多くの通貨が対円で下落しました。2023年1月は、日銀が金融緩和政策の維持を決定したことで一時的に円安米ドル高が進行する局面もありましたが、日米金利差の縮小などにより円高米ドル安基調が継続しました。その後、新興国通貨は上昇基調で推移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

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

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

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

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

■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

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 インデックスの組入上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、DR（預託証券）等の組み入れを行いました。また、効率性の観点からETF（上場投資信託証券）および株価指数先物を利用し、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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	
	2022年6月16日 ～2023年6月15日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	14,678

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
- (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。
- (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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 (2022. 6. 16~2023. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	100円	0.456%	信託報酬＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は21,968円です。
(投信会社)	(71)	(0.324)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(24)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(5)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	4	0.016	売買委託手数料＝当期中の売買委託手数料／当期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(3)	(0.013)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.003)	
(投資証券)	(0)	(0.001)	
有価証券取引税	2	0.011	有価証券取引税＝当期中の有価証券取引税／当期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(2)	(0.011)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	13	0.061	その他費用＝当期中のその他費用／当期中の平均受益権口数
(保管費用)	(10)	(0.044)	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)	(0.011)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	120	0.545	

(注1) 当期中の費用(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。

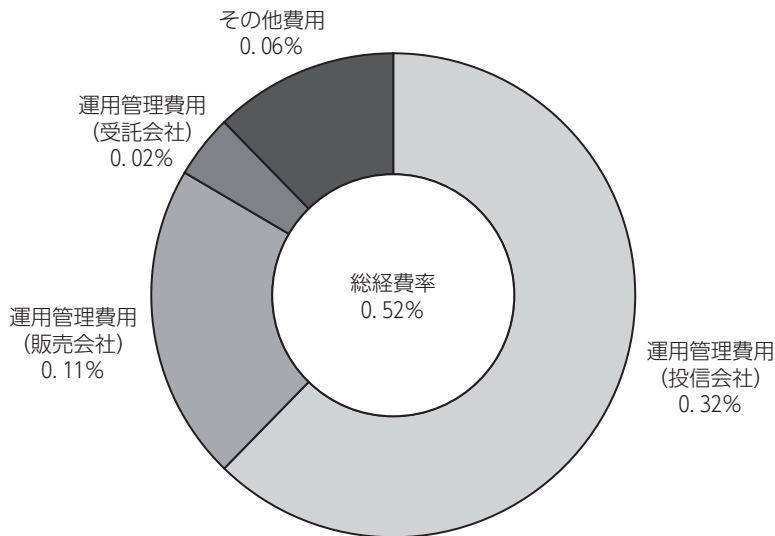
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.52%です。



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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	151,569	303,236	60,670	119,021
外国株式インデックスマザーファンド	173,807	765,793	50,250	214,725

(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

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

項 目	当 期
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	11,745,377千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	19,584,996千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.59
項 目	当 期
	外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	41,410,049千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	274,144,565千円
(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
	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	274,421	365,321	800,638
外国株式インデックスマザーファンド	519,977	643,535	3,125,585

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	800,638	20.1
外国株式インデックスマザーファンド	3,125,585	78.6
コール・ローン等、その他	48,752	1.3
投資信託財産総額	3,974,976	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
 (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=140.39円、1カナダ・ドル=105.30円、1オーストラリア・ドル=95.37円、1香港・ドル=17.93円、1シンガポール・ドル=104.58円、1ニュージーランド・ドル=86.93円、1台湾・ドル=4.563円、1イギリス・ポンド=177.72円、1イスラエル・シケル=39.178円、1スイス・フラン=155.82円、1トルコ・リラ=5.953円、1デンマーク・クローネ=20.42円、1ノルウェー・クローネ=13.16円、1スウェーデン・クローネ=13.09円、1メキシコ・ペソ=8.185円、100チリ・ペソ=17.506円、1サウジアラビア・リアル=37.52円、1インド・ルピー=1.72円、100インドネシア・ルピア=0.95円、1ブラジル・レアル=29.151円、1オフショア・人民元=19.553円、1マレーシア・リンギット=30.359円、1南アフリカ・ランド=7.66円、1タイ・バーツ=4.03円、1ユーロ=152.15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(28,533,146千円)の投資信託財産総額(28,910,568千円)に対する比率は、98.7%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(350,339,836千円)の投資信託財産総額(357,217,192千円)に対する比率は、98.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年6月15日現在

項目	当期末
(A) 資産	3,974,976,720円
コール・ローン等	47,382,942
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)	800,638,375
外国株式インデックスマザーファンド (評価額)	3,125,585,403
未収入金	1,370,000
(B) 負債	17,246,723
未払解約金	10,117,485
未払信託報酬	7,044,456
その他未払費用	84,782
(C) 純資産総額 (A - B)	3,957,729,997
元本	1,603,693,505
次期繰越損益金	2,354,036,492
(D) 受益権総口数	1,603,693,505口
1万口当り基準価額 (C / D)	24,679円

* 期首における元本額は1,270,536,081円、当作成期間中における追加設定元本額は541,659,096円、同解約元本額は208,501,672円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,679円です。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	566,328,000
(c) 収益調整金	1,201,873,445
(d) 分配準備積立金	585,845,257
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,354,046,702
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,354,046,702
(h) 受益権総口数	1,603,693,505口

《お知らせ》

■ベンチマークの変更について

「外国株式インデックスマザーファンド」のベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。

変更前：MSCI コクサイ指数 (円ベース)

変更後：MSCI コクサイ指数 (配当込み、円ベース)

■損益の状況

当期 自 2022年6月16日 至 2023年6月15日

項目	当 期
(A) 配当等収益	△ 10,210円
受取利息	652
支払利息	△ 10,862
(B) 有価証券売買損益	579,813,235
売買益	607,274,127
売買損	△ 27,460,892
(C) 信託報酬等	△ 13,480,791
(D) 当期損益金 (A + B + C)	566,322,234
(E) 前期繰越損益金	585,840,813
(F) 追加信託差損益金	1,201,873,445
(配当等相当額)	(666,821,256)
(売買損益相当額)	(535,052,189)
(G) 合計 (D + E + F)	2,354,036,492
次期繰越損益金 (G)	2,354,036,492
追加信託差損益金	1,201,873,445
(配当等相当額)	(666,821,256)
(売買損益相当額)	(535,052,189)
分配準備積立金	1,152,173,257
繰越損益金	△ 10,210

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

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

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

「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)」は、いかなる形式においてもFTSE International Limited (以下「FTSE」)、ロンドン証券取引所グループ会社 (以下「LSEG」)、または Research Affiliates LLC (以下「RA」) (以下、総称して「ライセンサ各社」) によって出資、保証、販売、または販売促進されることはございません。また、ライセンサ各社はいずれも、明示的にも黙示的にもFTSE RAFI® エマージング インデックスの使用から得られる結果や特定の日時における指数値について何ら保証や表明を行なうことはございません。当該指数はまたRAと共同しFTSEによってルールに基づき計算されます。いずれのライセンサ各社も、指数における瑕疵については (過失の有無に関わらず) 何人に対しても責任を負わず、またそれについて通知する義務も負いません。

FTSE® はLSEGの商標です。Fundamental Index® およびRAFI® はResearch Affiliates, LLCの登録商標です。

The Daiwa Fund Wrap Global Equity Index EM plus is not in any way sponsored, endorsed, sold or promoted by FTSE International Limited ("FTSE"), by the London Stock Exchange Group companies ("LSEG"), or by Research Affiliates LLC ("RA") (collectively the "Licensor Parties"), and none of the Licensor Parties make any warranty or representation whatsoever, expressly or impliedly, either as to the results to be obtained from the use of the FTSE RAFI Emerging Index (the "Index") and/or the figure at which the said Index stands at any particular time on any particular day or otherwise. The Index is compiled and calculated by FTSE in conjunction with RA. None of the Licensor Parties shall be liable (whether in negligence or otherwise) to any person for any error in the Index and none of the Licensor Parties shall be under any obligation to advise any person of any error therein.

FTSE® is a trade mark of LSEG. The trade names Fundamental Index® and RAFI® are registered trademarks of Research Affiliates, LLC.

★「外国株式インデックスマザーファンド」の第23期にかかる運用状況については105～127ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「外国株式インデックスマザーファンド」の決算日（2022年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2023年6月15日）現在における外国株式インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。86～104ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の決算日（2022年7月5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（2023年6月15日）現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

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

(1) 株式

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	161	359,981	2,235	TRIP.COM GROUP LTD-ADR (ケイマン諸島)	20.8	101,485	4,879
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル)	289.1	189,099	654	TURK HAVA YOLLARI AO (トルコ)	111.349	97,970	879
ALIBABA GROUP HOLDING LTD (ケイマン諸島)	123	186,854	1,519	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	156.5	95,485	610
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	2,478	174,063	70	TURKIYE GARANTI BANKASI (トルコ)	426.852	75,885	177
JD.COM INC - CL A (ケイマン諸島)	62.65	173,626	2,771	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE (トルコ)	17.529	67,702	3,862
PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	223.4	159,690	714	TURKIYE IS BANKASI-C (トルコ)	654.758	67,035	102
TENCENT HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)	26.3	148,435	5,643	NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC (ケイマン諸島)	136.3	65,751	482
VALE SA (ブラジル)	69.7	142,785	2,048	BANCO DO BRASIL S.A. (ブラジル)	67.4	65,718	975
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	1,442	120,843	83	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H (中国)	736	61,229	83
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO (ケイマン諸島)	3,155	119,790	37	NASPERS LTD-N SHS (南アフリカ)	2,508	56,017	22,335

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資証券

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
INVECO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	300	753,313	2,511	INVECO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	100	234,781	2,347

(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、2023年6月15日現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド（13,177,740千口）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	株数	2023年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	290	—	—	エネルギー
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	259	468	65,704	一般消費財・サービス
TAL EDUCATION GROUP- ADR	172	108	15,236	一般消費財・サービス
CANADIAN SOLAR INC	43	160	22,559	情報技術
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	156	130	18,287	コミュニケーション・サービス
NIO INC - ADR	153	138	19,439	一般消費財・サービス
PINDUODUO INC-ADR	15	118	16,566	一般消費財・サービス
KE HOLDINGS INC-ADR	118	197	27,764	不動産
LUFAX HOLDING LTD-ADR	1,215	201	28,315	金融
SBERBANK ROSSII	6,987.08	—	—	金融
JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	35	145	20,411	情報技術
BANK VTB	3,824,340	—	—	金融
NK LUKOIL	230.88	—	—	エネルギー
MOBILNYE TELESISTEMY	707	—	—	コミュニケーション・サービス
NK ROSNEFT	974.99	—	—	エネルギー
MAGNIT	46.78	—	—	生活必需品
SURGUTNEFTEGAZ	3,607.5	—	—	エネルギー
TATNEFT	576.48	—	—	エネルギー
GAZPROM	8,534.78	—	—	エネルギー
GМК NORILSKIY NIKEL	18.29	—	—	素材
NOVATEK	269.8	—	—	エネルギー
360 DIGITECH ADR INC	79	129	18,177	金融
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	72.9	—	—	素材
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	0.03	—	—	素材
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	0.04	—	—	生活必需品
SEVERSTAL - GDR REG S	134.6	—	—	素材

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TATNEFT PJSC - PREF	210.09	—	—	エネルギー
SISTEMA PJSC	3,192	—	—	コミュニケーション・サービス
INTER RAO UES PJSC	27,261	—	—	公益事業
ALROSA PJSC	1,803.1	—	—	素材
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	566.19	—	—	金融
AEROFLOT PJSC	1,649.1	—	—	資本財・サービス
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,883,717.63 32銘柄	1,798 252,462	<0.9%>
(香港)	百株	千香港・ドル	千円	
TRIP.COM GROUP LTD	137.5	3,872	69,424	一般消費財・サービス
YUM CHINA HOLDINGS INC	79.5	3,661	65,655	一般消費財・サービス
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	7,650	3,870	69,405	資本財・サービス
GEEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	2,980	2,899	51,988	一般消費財・サービス
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	180	946	16,976	生活必需品
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	1,160	1,392	24,958	生活必需品
JIANGXI COPPER CO LTD-H	1,470	1,863	33,420	素材
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,500	1,372	24,608	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	35,218	16,658	298,679	エネルギー
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	655	700	12,566	資本財・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD	877	30,309	543,442	コミュニケーション・サービス
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	5,440	1,803	32,334	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	1,580	2,717	48,726	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	28,740	16,151	289,603	エネルギー
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	375	1,128	20,238	一般消費財・サービス
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	15,931.2	1,210	21,709	不動産
HUANENG POWER INTL INC-H	3,560	1,698	30,447	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,200	2,556	45,829	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	900	733	13,151	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	55,000	27,555	494,061	金融
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	1,140	946	16,965	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	8,160	3,329	59,693	金融
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	1,075	885	15,882	不動産
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	996	963	17,268	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	375	1,290	23,129	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	9,220	4,674	83,814	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,400	6,240	111,883	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	2,111.2	1,393	24,983	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H	696	1,858	33,319	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	1,900	6,308	113,102	不動産
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	1,180	2,401	43,055	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	2,955	1,108	19,868	ヘルスケア
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	403	1,092	19,581	公益事業
BYD CO LTD-H	70	1,811	32,481	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	42,240	12,798	229,481	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	936	2,012	36,082	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	7,330	2,257	40,479	金融
CITIC LTD	1,840	1,773	31,803	資本財・サービス
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	2,415	1,502	26,933	素材
IND & COMM BK OF CHINA-H	69,560	28,867	517,592	金融
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	240	1,059	18,998	ヘルスケア
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	1,705	1,244	22,316	ヘルスケア
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	620	621	11,138	不動産
CHINA TOWER CORP LTD-H	20,480	1,843	33,048	コミュニケーション・サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	5,904	6,411	114,962	情報技術
MEITUAN-CLASS B	311.9	3,970	71,190	一般消費財・サービス
SEAZEN GROUP LTD	5,460	895	16,055	不動産
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	4,562	38,845	696,498	一般消費財・サービス
CHINA FEIHE LTD	1,870	834	14,953	生活必需品
CHINA ENERGY ENGINEERING C-H	5,180	507	9,101	資本財・サービス
GUANGDONG INVESTMENT LTD	1,340	932	16,722	公益事業
JD.COM INC - CL A	912.45	13,458	241,313	一般消費財・サービス
NETEASE INC	384	5,852	104,929	コミュニケーション・サービス
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	69.5	1,474	26,442	資本財・サービス
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	351	1,100	19,729	一般消費財・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	4,200	831	14,910	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-H	732	1,731	31,040	一般消費財・サービス
KUAISHOU TECHNOLOGY	188	1,111	19,921	コミュニケーション・サービス
BAIDU INC-CLASS A	761.5	10,661	191,151	コミュニケーション・サービス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	3,370	5,951	106,708	不動産
CRRC CORP LTD - H	2,990	1,426	25,572	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-H	7,100	1,313	23,551	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	5,415	27,778	498,076	金融
CHINA COAL ENERGY CO-H	1,630	1,017	18,236	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	2,400.5	1,697	30,429	資本財・サービス
YUJEXIU PROPERTY CO LTD	950	887	15,909	不動産
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	9,130.8	2,629	47,149	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	35,840	6,307	113,099	不動産
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	156	1,308	23,467	一般消費財・サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	2,480	2,693	48,290	不動産
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	185	1,322	23,716	一般消費財・サービス

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千香港・ドル	千円	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	790	2,413	43,273	生活必需品
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	5,000	4,750	85,167	金融
LI NING CO LTD	165	754	13,534	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	1,590	1,812	32,499	資本財・サービス
CHINA POWER INTERNATIONAL	4,180	1,162	20,835	公益事業
SUNNY OPTICAL TECH	134	1,109	19,893	情報技術
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	2,700	972	17,427	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,116	4,454	79,863	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	696	1,060	19,018	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	3,270	4,414	79,151	金融
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	252	2,520	45,183	公益事業
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	2,050	971	17,422	素材
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,360	1,607	28,822	素材
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	1,100	994	17,829	資本財・サービス
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3,180	1,545	27,710	素材
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	11,091	5,678	101,817	金融
CHINA EVERGRANDE GROUP	1,420	175	3,150	不動産
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	5,180	714	12,817	不動産
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	3,570	978	17,538	金融
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	9,170	1,448	25,978	情報技術
SINOTRUK HONG KONG LTD	700	950	17,044	資本財・サービス
CHINA MERCHANTS BANK-H	2,210	8,121	145,622	金融
BANK OF CHINA LTD-H	53,100	16,514	296,097	金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	765	1,145	20,547	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	4,990	1,212	21,741	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	2,312	1,192	21,390	金融
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	1,810	3,486	62,505	不動産
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	1,240	1,086	19,476	情報技術
香港・ドル通貨計	株数、金額	574,695.05	427,586	7,666,631
	銘柄数 < 比率 >	99銘柄		<26.5%>
(台湾)	百株	千台湾・ドル	千円	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	470	8,413	38,394	情報技術
GLOBALWAFERS CO LTD	90	4,608	21,029	情報技術
SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	270	4,320	19,715	情報技術
TAIWAN CEMENT	3,812.47	14,620	66,725	素材
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	2,390	29,755	135,795	情報技術
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	740	3,433	15,669	金融
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	1,171.12	8,947	40,833	生活必需品
FORMOSA PLASTICS CORP	1,176	11,030	50,341	素材
NAN YA PLASTICS CORP	1,311.4	10,386	47,399	素材
WALSIN LIHWA CORP	1,330	6,004	27,404	資本財・サービス
CHINA STEEL CORP	4,526.86	13,422	61,254	素材
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,176.16	11,879	54,213	情報技術
DELTA ELECTRONICS INC	550	19,415	88,604	情報技術
YAGEO CORPORATION	167.34	8,358	38,146	情報技術
WINBOND ELECTRONICS CORP	1,730	5,060	23,093	情報技術
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	740	4,432	20,229	情報技術
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	170	6,919	31,576	情報技術
QUANTA COMPUTER INC	1,100	15,400	70,280	情報技術
AUO CORP	6,516	11,956	54,567	情報技術
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	1,624	20,381	93,013	コミュニケーション・サービス
MEDIATEK INC	410.03	31,982	145,957	情報技術
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	400	7,600	34,684	情報技術
EVERGREEN MARINE CORP LTD	1,078	17,409	79,452	資本財・サービス
YANG MING MARINE TRANSPORT	1,880	12,088	55,167	資本財・サービス
CHINA AIRLINES LTD	1,710	4,240	19,353	資本財・サービス
WAN HAI LINES LTD	580	3,607	16,464	資本財・サービス
EVA AIRWAYS CORP	1,200	4,758	21,714	資本財・サービス
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	2,261.55	13,976	63,784	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	4,198.38	18,724	85,454	金融
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	5,190	6,695	30,554	金融
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	3,836.1	10,069	45,955	金融
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	2,616.82	6,385	29,139	金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,865.17	10,744	49,034	金融
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,415.83	4,614	21,057	金融
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	4,332.31	3,916	17,873	金融
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	3,841.8	6,703	30,594	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	5,790.28	14,330	65,402	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	2,166.58	6,033	27,537	金融
LARGAN PRECISION CO LTD	40	9,020	41,164	情報技術
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	260	11,973	54,641	情報技術
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	370	6,678	30,478	情報技術
TAIWAN MOBILE CO LTD	490	5,022	22,921	コミュニケーション・サービス
WISTRON CORP	2,021.1	15,501	70,745	情報技術
INNOLUX CORP	6,713.75	9,734	44,427	情報技術
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	770	6,129	27,971	コミュニケーション・サービス
PEGATRON CORP	650	5,070	23,137	情報技術
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	430	4,644	21,193	情報技術
CHAILEASE HOLDING CO LTD	340.33	7,095	32,383	金融
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,685.6	4,736	21,616	金融

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千台湾・ドル	千円	
POU CHEN	1,300	4,173	19,044	一般消費財・サービス
COMPAL ELECTRONICS	1,720	4,910	22,410	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	4,640	273,760	1,249,358	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY	5,419.02	60,963	278,221	情報技術
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	200	5,670	25,876	生活必需品
ASUSTEK COMPUTER INC	397.6	12,623	57,611	情報技術
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	1,520	4,978	22,718	資本財・サービス
UNITED MICROELECTRONICS CORP	4,740	25,359	115,730	情報技術
台湾・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	111,541.6 57銘柄	880,671 <13.9%>	
	百株	千トルコ・リラ	千円	
(トルコ)				
AKBANK T. A. S.	3,857.43	7,086	42,189	金融
TURKIYE IS BANKASI-C	3,679.78	4,872	29,007	金融
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	1,260.32	4,413	26,278	コミュニケーション・サービス
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	579.46	4,172	24,840	エネルギー
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	1,121.8	4,072	24,245	素材
HACI OMER SABANCI HOLDING	1,006.94	4,158	24,760	金融
YAPI VE KREDI BANKASI	4,529.61	5,476	32,605	金融
KOC HOLDING AS	827.1	8,213	48,899	資本財・サービス
TURK HAVA YOLLARI AO	416.97	7,626	45,406	資本財・サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	317.99	5,125	30,519	生活必需品
トルコ・リラ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	17,597.4 10銘柄	55,216 <1.1%>	
	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
(メキシコ)				
AMERICA MOVIL L	13,821	26,591	217,660	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	216.15	3,276	26,818	生活必需品
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	2,816	5,133	42,019	コミュニケーション・サービス
CEMEX SAB-CPO	12,061.19	15,076	123,405	素材
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	808	15,277	125,052	生活必需品
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	157	2,809	22,994	生活必需品
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	374	3,497	28,626	生活必需品
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	1,274	11,045	90,411	素材
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	1,536	10,516	86,084	生活必需品
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	1,093	15,664	128,221	金融
メキシコ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	34,156.34 10銘柄	108,889 <3.1%>	
	百株	千チリ・ペソ	千円	
(チリ)				
BANCO SANTANDER CHILE	43,014.81	163,413	28,607	金融
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	24.72	140,755	24,641	素材
FALABELLA SA	652.41	123,207	21,569	一般消費財・サービス
BANCO DE CHILE	23,452.13	197,021	34,491	金融
チリ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	67,144.07 4銘柄	624,397 <0.4%>	
	百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
(サウジアラビア)				
SAUDI ARABIAN MINING	184.18	783	29,403	素材
SABIC AGRI-NUTRIENTS	45.65	591	22,197	素材
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	305.37	2,705	101,513	素材
SAUDI TELECOM CO	500.96	2,156	80,916	コミュニケーション・サービス
AL RAJHI BANK	376.78	2,788	104,612	金融
RIYAD BANK	211.55	715	26,828	金融
ALINMA BANK	260.79	886	33,268	金融
THE SAUDI NATIONAL BANK	798.03	2,976	111,683	金融
SAUDI ARABIAN OIL CO	812.99	2,654	99,593	エネルギー
サウジアラビア・リアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,496.3 9銘柄	16,258 <2.1%>	
	百株	千インド・ルピー	千円	
(インド)				
BHARTI AIRTEL PARTLY PAID LTD	86.18	3,766	6,478	コミュニケーション・サービス
TATA STEEL LTD	6,648.91	75,664	130,143	素材
AXIS BANK LTD	580.79	56,783	97,668	金融
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	26.3	25,070	43,121	一般消費財・サービス
TATA POWER CO LTD	532.41	11,933	20,526	公益事業
BANK OF BARODA	802.31	15,039	25,867	金融
HINDUSTAN UNILEVER LTD	110.45	29,807	51,269	生活必需品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	632.16	17,441	29,999	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	871.1	50,223	86,384	金融
NTPC LTD	1,791.61	33,538	57,686	公益事業
POWER FINANCE CORPORATION	1,371.08	27,565	47,412	金融
JSW STEEL LTD	377.61	29,183	50,195	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,589.91	39,191	67,409	公益事業
INDIAN OIL CORP LTD	2,051.09	19,105	32,862	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	490.66	18,328	31,525	エネルギー
STEEL AUTHORITY OF INDIA	1,723.76	14,608	25,127	素材
JINDAL STEEL & POWER LTD	167.22	9,039	15,548	素材
ULTRATECH CEMENT LTD	16.94	14,158	24,353	素材
SHRIRAM FINANCE LTD	87.66	12,340	21,226	金融
TECH MAHINDRA LTD	202.08	21,776	37,454	情報技術
TATA MOTORS LTD-A-DVR	291.97	9,378	16,130	一般消費財・サービス
REC LTD	1,677	25,775	44,333	金融
COAL INDIA LTD	1,244.08	28,483	48,991	エネルギー

銘柄	2023年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千インド・ルピー	千円	
BAJAJ FINANCE LTD	20.52	14,562	25,047	金融
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	1,016.11	11,497	19,775	金融
GAIL INDIA LTD	2,125.51	22,785	39,191	公益事業
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,009.66	42,915	73,814	素材
GRASIM INDUSTRIES LTD	89.16	15,864	27,287	素材
WIPRO LTD	315.77	12,518	21,532	情報技術
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	169.75	55,186	94,920	情報技術
INFOSYS LTD	672.87	87,500	150,500	情報技術
LARSEN & TOUBRO LTD	190.69	44,908	77,242	資本財・サービス
TATA MOTORS LTD	1,506.26	85,902	147,751	一般消費財・サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	396.74	104,971	180,550	金融
ICICI BANK LTD	291.01	27,349	47,040	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD	874.77	223,228	383,952	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	2,139.69	33,775	58,093	エネルギー
ITC LTD	650.64	28,920	49,744	生活必需品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	278.1	38,340	65,945	一般消費財・サービス
HERO MOTOCORP LTD	63.97	18,753	32,255	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD	407.59	33,746	58,043	コミュニケーション・サービス
UPL LTD	198.76	13,570	23,340	素材
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	163.62	16,144	27,768	ヘルスケア
HCL TECHNOLOGIES LTD	162.58	18,466	31,762	情報技術
VEDANTA LTD	1,215.75	34,162	58,759	素材
インド・ルピー通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	37,332.8 45銘柄	1,573,276 <9.4%>	2,706,035
		百株	千インドネシア・ルピア	千円
(インドネシア)				
GOTO GOJEK TOKOPEDIA	254,670	2,954,172	28,064	一般消費財・サービス
UNITED TRACTORS TBK PT	833	1,913,817	18,181	エネルギー
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	7,610	5,250,900	49,883	資本財・サービス
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	20,746	8,298,400	78,834	コミュニケーション・サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	3,311	2,971,622	28,230	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	8,487	7,701,952	73,168	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	13,780	6,958,900	66,109	金融
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	23,682	13,143,510	124,863	金融
ADARO ENERGY TBK PT	9,498	2,137,050	20,301	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 >	342,617 9銘柄	51,330,324 <1.7%>	487,638
		百株	千ブラジル・リアル	千円
(ブラジル)				
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	310	237	6,913	公益事業
ENERGISA SA-UNITS	190	874	25,505	公益事業
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	353	1,349	39,339	金融
VIBRA ENERGIA SA	1,724	3,072	89,556	一般消費財・サービス
VIA SA	4,040	1,074	31,326	一般消費財・サービス
NATURA &CO HOLDING SA	710	1,167	34,046	生活必需品
TIM SA	567.26	861	25,118	コミュニケーション・サービス
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	358	490	14,297	生活必需品
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	6,654	20,028	583,851	エネルギー
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	787	582	16,976	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	5,699.59	9,603	279,960	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	3,683.36	10,383	302,686	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	658	860	25,070	素材
VALE SA	2,482.9	17,136	499,559	素材
GERDAU SA-PREF	873.6	2,274	66,314	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	4,725	15,918	464,040	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	914.73	1,166	33,998	公益事業
ITAUSA SA	1,523.42	1,441	42,011	金融
BRASKEM SA-PREF A	484	1,340	39,082	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	134	595	17,359	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	1,014	4,954	144,425	金融
CO SAN SA	660	1,178	34,362	エネルギー
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	710	2,802	81,691	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	1,460	1,153	33,622	公益事業
EMBRAER SA	462	942	27,474	資本財・サービス
METALURGICA GERDAU SA-PREF	1,390	1,684	49,110	素材
CCR SA	779	1,097	31,996	資本財・サービス
BRF SA	2,069	1,891	55,126	生活必需品
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	205	1,102	32,138	公益事業
LOJAS RENNEN S. A.	435.75	936	27,297	一般消費財・サービス
JBS SA	1,466	2,650	77,265	生活必需品
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	282	208	6,091	素材
SUZANO SA	249.45	1,163	33,922	素材
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	1,434	1,059	30,892	生活必需品
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,972	3,001	87,493	金融
CIELO SA	1,769.28	810	23,621	金融
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	375	1,168	34,052	公益事業
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	318.3	599	17,490	公益事業
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	450	1,360	39,655	金融
TELEFONICA BRASIL S. A.	406	1,803	52,560	コミュニケーション・サービス
KLABIN SA - UNIT	396	892	26,019	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	1,304	2,347	68,423	エネルギー
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	597	1,436	41,889	金融
COGNA EDUCACAO	3,091	992	28,923	一般消費財・サービス
BANCO BRADESCO S. A.	1,540.21	2,228	64,968	金融

銘柄		2023年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
AMBEV SA		百株 2,063	千ブラジル・レアル 3,162	千円 92,192	生活必需品
ブラジル・レアル通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	63,769.85 46銘柄	133,090 <13.4%>	
(中国)		百株	千オフショア・人民元	千円	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD		2,281	538	10,525	資本財・サービス
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A		1,676	2,832	55,382	金融
BANK OF BEIJING CO LTD -A		2,163	1,014	19,835	金融
PING AN INSURANCE GROUP CO-A		718	3,449	67,457	金融
IND & COMM BK OF CHINA-A		4,746	2,311	45,192	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A		160	356	6,967	ヘルスケア
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A		8	1,381	27,012	生活必需品
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A		318	819	16,023	素材
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A		681	913	17,856	不動産
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A		3,429	2,537	49,614	金融
CITIC SECURITIES CO-A		296	592	11,575	金融
CHINA MERCHANTS BANK-A		895	2,988	58,432	金融
PING AN BANK CO LTD-A		1,146	1,314	25,701	金融
CHINA STATE CONSTRUCTION -A		5,832	3,470	67,849	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-A		222	517	10,127	一般消費財・サービス
SAIC MOTOR CORP LTD-A		1,082	1,519	29,703	一般消費財・サービス
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A		439	170	3,339	金融
CHINA COAL ENERGY CO-A		481	399	7,815	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A		616.6	652	12,767	資本財・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A		1,557	615	12,025	資本財・サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A		622	351	6,871	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-A		178	339	6,633	素材
YANKUANG ENERGY GROUP LTD A		50	140	2,752	エネルギー
CHINA CONSTRUCTION BANK-A		306	194	3,793	金融
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A		9,186	3,270	63,942	金融
BANK OF CHINA LTD-A		2,832	1,132	22,149	金融
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A		3,493	2,298	44,940	エネルギー
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A		581	1,292	25,276	公益事業
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A		3,786	2,199	43,010	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A		421	1,264	24,720	エネルギー
CHINA VANKE CO LTD -A		989	1,424	27,846	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A		434	1,285	25,135	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A		932	572	11,189	金融
CHINA MINSHENG BANKING-A		3,547	1,393	27,256	金融
PICC HOLDING CO-A		677	412	8,074	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A		5,132	1,596	31,207	金融
CRRRC CORP LTD-A		1,541	987	19,314	資本財・サービス
CHINA UNITED NETWORK-A		2,303	1,174	22,965	コミュニケーション・サービス
CGN POWER CO LTD-A		189	57	1,123	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-A		305	420	8,223	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A		463	434	8,491	金融
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A		2,913	2,190	42,832	資本財・サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A		1,880	1,077	21,063	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A		142	547	10,700	金融
HUAXIA BANK CO LTD-A		1,943	1,128	22,073	金融
BYD CO LTD -A		20	526	10,284	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-A		335	404	7,899	資本財・サービス
ZUIJIN MINING GROUP CO LTD-A		475	564	11,033	素材
HUANENG POWER INTL INC-A		625	545	10,656	公益事業
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A		1,802	946	18,498	金融
オフショア・人民元通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	76,848.6 50銘柄	1,145,167 <4.0%>	
(マレーシア)		百株	千マレーシア・リングgit	千円	
MALAYAN BANKING BHD		1,338	1,150	34,933	金融
PUBLIC BANK BERHAD		3,096	1,182	35,904	金融
TOP GLOVE CORP BHD		8,244	915	27,781	ヘルスケア
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD		1,104	706	21,450	素材
CIMB GROUP HOLDINGS BHD		2,997	1,495	45,402	金融
マレーシア・リングgit通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	16,779 5銘柄	5,450 <0.6%>	
(南アフリカ)		百株	千南アフリカ・ランド	千円	
GOLD FIELDS LTD		321.82	9,021	69,107	素材
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD		20.41	3,071	23,524	金融
OLD MUTUAL LTD		1,817.77	2,195	16,820	金融
VODACOM GROUP LTD		262.91	3,144	24,090	コミュニケーション・サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD		234.99	5,377	41,191	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD		196.67	4,490	34,400	金融
BIDVEST GROUP LTD		116.04	3,072	23,532	資本財・サービス
BID CORP LTD		141.23	5,997	45,937	生活必需品
STANDARD BANK GROUP LTD		528.79	9,165	70,207	金融
SASOL LTD		375.33	9,685	74,192	素材
DISCOVERY LTD		207.81	3,089	23,664	金融
EXXARO RESOURCES LTD		137.92	2,461	18,857	エネルギー
KUMBA IRON ORE LTD		62	3,191	24,443	素材
SANLAM LTD		764.9	4,550	34,855	金融
FIRSTRAND LTD		1,834.84	12,575	96,332	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD		439.25	3,100	23,751	一般消費財・サービス

銘柄	株数	2023年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
THE FOSCHINI GROUP LTD	226.27	2,152	16,488	一般消費財・サービス
ABSA GROUP LTD	420.12	6,972	53,411	金融
NASPERS LTD-N SHS	21.51	6,700	51,324	一般消費財・サービス
MTN GROUP LTD	784.02	11,242	86,120	コミュニケーション・サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	333.74	5,269	40,363	素材
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	171.38	7,742	59,310	素材
SPAR GROUP LIMITED/THE	234.78	2,401	18,395	生活必需品
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	35.72	3,884	29,752	素材
SIBANYE STILLWATER LTD	2,538.4	8,617	66,012	素材
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,228.62 25銘柄	139,176 <3.7%>	
(タイ)	百株	千タイ・パーツ	千円	
SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	1,569	16,945	68,289	金融
TRUE CORPORATION NON-VOTING DR PCL	6,849	4,691	18,907	コミュニケーション・サービス
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	271	4,417	17,801	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR	605	20,267	81,678	素材
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	385	5,101	20,558	金融
KASIKORN BANK PCL-NVDR	979	12,971	52,276	金融
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	31,551	5,142	20,725	金融
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	1,327	4,644	18,717	素材
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	465	10,137	40,852	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	5,817	11,343	45,712	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	5,773	5,137	20,706	エネルギー
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,587	4,522	18,227	ヘルスケア
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	711	10,807	43,553	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	14,741	3,508	14,138	エネルギー
BANGCHAK CORP PCL-NVDR	1,200	4,230	17,046	エネルギー
PTT PCL-NVDR	15,115	47,612	191,877	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	1,127	5,212	21,005	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	2,206	14,173	57,119	生活必需品
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	711	11,589	46,704	金融
LAND & HOUSES PUB - NVDR	4,447	3,802	15,322	不動産
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	4,599	9,795	39,477	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	2,418	9,490	38,247	素材
タイ・パーツ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	104,453 22銘柄	225,544 <3.1%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,346,377.26 423銘柄	— <83.9%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資証券

銘柄	□数	2023年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	971.6	18,761	2,633,940
アメリカ・ドル通貨計	□数、金額 銘柄数 < 比率 >	971.6 1銘柄	18,761 <9.1%>
(香港)	千口	千香港・ドル	千円
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	5.89	10	179
香港・ドル通貨計	□数、金額 銘柄数 < 比率 >	5.89 1銘柄	10 <0.0%>
合計	□数、金額 銘柄数 < 比率 >	977.49 2銘柄	— <9.1%>

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2023年6月15日現在	
	買建額	売建額
外国	百万円	百万円
MSCI EMGMKT (アメリカ)	1,551	—

(注1) 外貨建の評価額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

運用報告書 第12期 (決算日 2022年7月5日)

(作成対象期間 2021年7月6日～2022年7月5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いません。
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D R (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E T F (上場投資信託証券)
株式組入制限	無制限

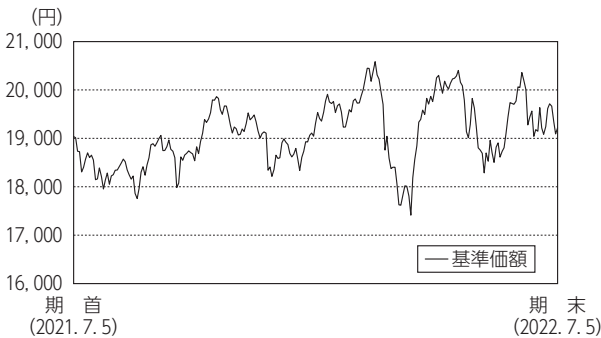
大和アセットマネジメント

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》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：19,034円 期末：19,215円 騰落率：1.0%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークへの連動をめざした運用を行いました。ロシアのウクライナ侵攻の影響で新興国株式市況は下落しました。一方で、世界的なインフレ懸念と米国の金利引き上げを背景に、新興国為替相場は対円で上昇(円安)し、基準価額は横ばいで当作成期末を迎えました。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、当作成期首より、新型コロナウイルスの影響が続く中で緩やかな下落基調で推移しました。中国のテクノロジー業界における規制強化や米国と中国の対立も、下落の要因となりました。その後、2022年2月末にはロシアのウクライナ侵攻の影響で株価は大きく下落しました。3月半ばから反発する局面もありましたが、ウクライナ情勢の混乱長期化や世界的なインフレ懸念と米国の金利引き上げが織り込まれていく形で、株価は下落して当作成期末を迎えました。

○為替相場

新興国為替相場は対円で上昇しました。

新興国為替相場は、当作成期首より対円で横ばい推移しました。2021年10月以降は、市場のリスク回避的な姿勢が後退したことなどを背景に、対円で上昇して推移しました。2022年2月末のロシアによるウクライナ侵攻でリスク回避傾向が高まり、新興国通貨は対米ドルで下落しましたが、相対的に円の下落幅が大きく、対円では上昇推移が続きました。その後は、世界的なインフレ懸念と米国の金利引き上げ観測から、米ドルが相対的に強く推移しました。この局面でも新興国通貨は対米ドルでは下落しましたが、日米の金融政策の相違がより明確となり、円安米ドル高が大きく進行したため、対円では上昇して当作成期末を迎えました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

ファンドの資産規模や資金動向、売買コストの抑制等を勘案しながら運用を行いました。

ポートフォリオ構築にあたっては、FTSE RAFI エマージング インデックスの組入比率上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、D R (預託証券) 等の組み入れを行いました。また、効率性の観点からE T F (上場投資信託証券) および株価指数先物を利用し、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1.0%となりました。

配当金に対する課税分や売買手数料・保管費用等のコスト負担が、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、株価指数先物とベンチマークとの騰落率の差異、ファンドとベンチマークの為替評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

年月日	基準価額		FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算)		株式 組入 比率	株式 先物 比率	投資信託 証券 組入比率
	円	騰落率 (%)	円換算	騰落率 (%)			
(期首)2021年7月5日	19,034	—	21,635	—	88.1	8.7	2.9
7月末	18,280	△ 4.0	20,863	△ 3.6	93.1	4.6	2.3
8月末	18,594	△ 2.3	21,270	△ 1.7	89.9	4.5	5.6
9月末	18,737	△ 1.6	21,485	△ 0.7	87.6	6.0	6.0
10月末	19,270	1.2	22,081	2.1	86.4	6.4	7.2
11月末	18,405	△ 3.3	21,066	△ 2.6	83.7	8.1	7.7
12月末	19,041	0.0	21,875	1.1	85.9	5.5	8.6
2022年1月末	19,544	2.7	22,503	4.0	84.4	6.0	9.5
2月末	19,040	0.0	21,996	1.7	85.8	3.4	10.9
3月末	19,867	4.4	22,652	4.7	90.2	5.5	4.3
4月末	19,287	1.3	21,887	1.2	87.9	5.8	6.2
5月末	19,433	2.1	22,406	3.6	84.7	6.0	9.2
6月末	19,662	3.3	22,529	4.1	82.0	7.4	10.4
(期末)2022年7月5日	19,215	1.0	22,034	1.8	81.5	7.5	10.5

(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) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

*ベンチマークは FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) です。

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	14円 (10)
(新株予約権証券)	(0)
(先物・オプション)	(2)
(投資信託証券)	(3)
有価証券取引税 (株式)	8 (8)
(新株予約権証券)	(0)
(投資信託証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	32 (20)
(その他)	(12)
合 計	55

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2021年7月6日から2022年7月5日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	アメリカ	百株 3,201 (3,826,435.14)	千アメリカ・ドル 2,368 (—)	百株 181	千アメリカ・ドル 1,426
	香港	百株 122,618.5 (765.51)	千香港・ドル 151,938 (△ 47)	百株 71,275.86	千香港・ドル 38,815
	シンガポール	百株 — (1,260)	千シンガポール・ドル — (—)	百株 167	千シンガポール・ドル 23
	台湾	百株 29,840 (758.87)	千台湾・ドル 185,838 (△ 951)	百株 18,497.2	千台湾・ドル 130,445
	トルコ	百株 12,624.58 (4,456.22)	千トルコ・リラ 15,503 (—)	百株 649.22	千トルコ・リラ 1,704
	メキシコ	百株 5,091 (—)	千メキシコ・ペソ 17,871 (△ 68)	百株 302	千メキシコ・ペソ 4,771
	チリ	百株 25,923.09 (—)	千チリ・ペソ 314,422 (—)	百株 —	千チリ・ペソ —
	サウジアラビア	百株 1,138.38 (210.42)	千サウジアラビア・リアル 7,358 (—)	百株 442.89	千サウジアラビア・リアル 2,887
	インド	百株 4,955.65 (966.68)	千インド・ルピー 267,395 (1,583)	百株 3,770.59	千インド・ルピー 96,605
	インドネシア	百株 11,515 (7,871.68)	千インドネシア・ルピア 4,561,572 (—)	百株 33,648.68	千インドネシア・ルピア 10,714,919
	ブラジル	百株 13,636 (125.5)	千ブラジル・リアル 27,273 (△ 1)	百株 10,861.71	千ブラジル・リアル 25,703
	中国	百株 18,360 (39.6)	千オフショア・人民元 13,906 (—)	百株 2,571	千オフショア・人民元 2,308
	マレーシア	百株 1,517 (—)	千マレーシア・リンギット 1,162 (—)	百株 3,092	千マレーシア・リンギット 1,685
	南アフリカ	百株 11,624.31 (17.09)	千南アフリカ・ランド 27,548 (—)	百株 812.01	千南アフリカ・ランド 10,826
タイ	百株 8,486 (1,241)	千タイ・バーツ 39,507 (534)	百株 6,192	千タイ・バーツ 25,890	

(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

(2021年7月6日から2022年7月5日まで)

	買 付		売 付	
	証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	証 券 数	千タイ・バーツ	証 券 数	千タイ・バーツ
タイ	(279,883)	(—)	(279,883)	(1,641 —)

(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

(2021年7月6日から2022年7月5日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	1,321.6 (—)	28,279 (—)	628.6 (—)	12,995 (—)

(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) 先物取引の種別別取引状況

(2021年7月6日から2022年7月5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	8,602	8,451	—	—

(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

(2021年7月6日から2022年7月5日まで)

当 期				期 末			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ALIBABA GROUP HOLDING LTD (ケイマン諸島)	238.1	435,256	1,828	HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	742	333,987	450
TENCENT HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)	39.9	240,168	6,019	PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	165.7	139,442	841
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	89	224,340	2,520	IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	1,703	123,088	72
VALE SA (ブラジル)	83.7	193,702	2,314	CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	1,159	103,490	89
PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)	210	186,286	887	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	133.5	89,376	669
BAIDU INC-CLASS A (ケイマン諸島)	64.65	151,346	2,341	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル)	116.2	89,278	768
JD. COM INC - CL A (ケイマン諸島)	27.5	112,812	4,102	JD. COM INC-ADR (ケイマン諸島)	7.8	67,812	8,693
XIAOMI CORP-CLASS B (ケイマン諸島)	332.8	70,503	211	AL RAJHI BANK (サウジアラビア)	11.509	59,544	5,173
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H (中国)	1,116	64,568	57	BAIDU INC - SPON ADR (ケイマン諸島)	3.1	56,543	18,239
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)	642	61,269	95	XP INC BDR (ケイマン諸島)	12.405	42,103	3,394

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2021年7月6日から2022年7月5日まで)

当 期				期 末			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	口 数	金 額	平均単価	銘 柄	口 数	金 額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	1,321.6	3,372,460	2,551	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	628.6	1,537,660	2,446

(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	金 額	当 期 末		業 種 等
			株 数	金 額	
	百株	百円	株 数	千円	
(アメリカ)			千アメリカ・ドル	千円	
JOYY INC-ADR	10	—	105	14,335	コミュニケーション・サービス
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	52	—	276	37,694	一般消費財・サービス
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR PREF	290	—	—	—	エネルギー
BAIDU INC - SPON ADR	28	—	—	—	コミュニケーション・サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	56	—	314	42,824	一般消費財・サービス
TAL EDUCATION GROUP- ADR	—	—	225	30,711	一般消費財・サービス
CANADIAN SOLAR INC	23	—	136	18,641	情報技術
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	34	—	—	—	資本財・サービス
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	353.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス
JD. COM INC-ADR	78	—	—	—	一般消費財・サービス
LUFAX HOLDING LTD-ADR	—	—	293	24,771	金融
SBERBANK ROSSII	—	—	6,987.08	—	金融
JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	—	—	30	27,462	情報技術
NETEASE INC-ADR	30	—	—	—	コミュニケーション・サービス
BANK VTB	—	—	3,824.340	—	金融
TRIP. COM GROUP LTD-ADR	93	—	167	63,181	一般消費財・サービス
VTB BANK JSC -GDR-REG S	1,912.17	—	—	—	金融
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	72.9	—	—	—	素材
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	96.08	—	96.08	—	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	360.75	—	360.75	—	エネルギー
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	169.93	—	182.93	—	素材
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	206.94	—	233.94	—	生活必需品
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	1,569.77	—	—	—	金融
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	24.98	—	26.98	—	エネルギー
LUKOIL PJSC-SPON ADR	202.88	—	230.88	—	エネルギー
ROSNEXT OIL CO PJSC-REGS GDR	912.99	—	974.99	—	エネルギー
GAZPROM PJSC-SPON ADR	3,923.39	—	4,267.39	—	エネルギー
SEVERSTAL - GDR REG S	134.6	—	134.6	—	素材
TATNEFT PJSC - PREF	155.09	—	210.09	—	エネルギー
SISTEMA PJSCFC	3.192	—	3.192	—	コミュニケーション・サービス
INTER RAO UES PJSC	27.261	—	27.261	—	公益事業
ALROSA PJSC	1,803.1	—	1,803.1	—	素材
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	566.19	—	566.19	—	金融
AEROFLOT PJSC	1,649.1	—	1,649.1	—	資本財・サービス
アメリカ・ドル通貨計	株 数	金 額	45,261.36	3,874,716.5	
	銘 柄 数 < 比 率 >		29 銘柄	28 銘柄	< 1.3% >
(香港)			千香港・ドル	千円	
CHINA CONCH ENVIRONMENT PROTECTION	—	—	159	2,772	資本財・サービス
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	4,600	—	2,776	48,176	資本財・サービス
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	620	—	—	—	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	千香港・ドル	千円	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	780	1,930	3,315	57,528	一般消費財・サービス
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	—	2,170	987	17,130	資本財・サービス
JIANGXI COPPER CO LTD-H	510	1,060	1,125	19,531	素材
CHINA GAS HOLDINGS LTD	492	1,368	1,597	27,722	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	20,798	31,958	11,313	196,282	エネルギー
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,460	—	—	—	一般消費財・サービス
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	3,540	—	—	—	一般消費財・サービス
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	290	385	646	11,208	資本財・サービス
FOSUN INTERNATIONAL LTD	715	—	—	—	資本財・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD	215	614	21,305	369,655	コミュニケーション・サービス
AIR CHINA LTD-H	1,100	—	—	—	資本財・サービス
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	605	5,440	2,404	41,717	不動産
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	2,580	—	—	—	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	—	1,760	2,981	51,727	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	20,520	22,280	8,265	143,413	エネルギー
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	155	200	1,099	19,067	一般消費財・サービス
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	—	2,371.2	908	15,756	不動産
HUANENG POWER INTL INC-H	6,120	4,280	1,733	30,074	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	355	695	2,432	42,203	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,050	620	951	16,501	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	47,080	41,470	21,730	377,020	金融
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	1,242	—	—	—	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	7,040	5,920	2,048	35,538	金融
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	—	755	1,280	22,216	不動産
GF SECURITIES CO LTD-H	500	500	508	8,813	金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	484	666	764	13,265	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	275	255	937	16,259	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	4,750	6,060	3,545	61,507	金融
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	760	—	—	—	資本財・サービス
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,450	2,355	5,298	91,933	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1,091.2	1,431.2	1,160	20,138	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H	1,028	520	1,004	17,430	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	1,100	1,660	6,050	104,979	不動産
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	1,820	960	2,270	39,391	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,285	1,885	993	17,235	ヘルスケア
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	220	320	1,174	20,375	公益事業
BYD CO LTD-H	50	60	1,894	32,874	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	25,230	34,450	10,231	177,519	金融
CHINA RESOURCES CEMENT	820	1,420	766	13,303	素材
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	254	—	—	—	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	358	670	1,463	25,399	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	3,900	7,110	1,706	29,606	金融
CITIC LTD	2,150	1,600	1,289	22,374	資本財・サービス
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,165	1,450	1,247	21,635	素材
IND & COMM BK OF CHINA-H	54,900	44,780	19,434	337,188	金融
CHINA TOWER CORP LTD-H	16,760	15,700	1,585	27,511	コミュニケーション・サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	—	3,328	4,605	79,913	情報技術
MEITUAN-CLASS B	52	177	3,561	61,787	一般消費財・サービス
SEAZEN GROUP LTD	1,240	—	—	—	不動産
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	951	3,332	37,718	654,411	一般消費財・サービス
GUANGDONG INVESTMENT LTD	860	—	—	—	公益事業
JD.COM INC - CL A	—	285.95	7,491	129,984	一般消費財・サービス
NETEASE INC	—	256	3,719	64,536	コミュニケーション・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	2,150	2,870	536	9,311	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-H	250	672	1,901	32,995	一般消費財・サービス
BAIDU INC-CLASS A	—	646.5	9,820	170,382	コミュニケーション・サービス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	3,180	3,000	7,515	130,385	不動産
CRRC CORP LTD - H	—	2,860	843	14,638	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-H	4,570	5,570	1,075	18,651	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,940	4,040	21,614	375,002	金融
CHINA COAL ENERGY CO-H	—	1,520	1,010	17,537	エネルギー
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	1,040	7,460	3,416	59,279	不動産
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	585	655.5	717	12,441	資本財・サービス
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	7,335.8	11,165.8	3,048	52,887	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2,440	4,290	2,012	34,908	不動産
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	60	100	960	16,656	一般消費財・サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	899	1,874	3,616	62,751	不動産
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	2,900	—	—	—	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	960	1,140	845	14,676	一般消費財・サービス
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	64	104	949	16,474	一般消費財・サービス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	330	480	1,855	32,187	生活必需品
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	3,600	2,420	2,023	35,101	金融
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	415	570	865	15,012	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	560	980	1,226	21,287	資本財・サービス
CHINA POWER INTERNATIONAL	—	3,970	1,889	32,786	公益事業
SUNNY OPTICAL TECH	37	60	717	12,439	情報技術
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	2,920	2,640	789	13,695	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	882	1,902	3,575	62,039	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	606	845	1,115	19,352	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,950	3,330	4,495	77,996	金融
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	132	199	2,579	44,746	公益事業

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		
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	660	—	—	—	素材	
KUNLUN ENERGY CO LTD	2,020	1,780	1,133	19,672	公益事業	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	620	1,040	964	16,726	素材	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	1,280	—	—	—	資本財・サービス	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,680	2,560	2,237	38,819	素材	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	8,521	9,681	4,704	81,631	金融	
CHINA EVERGRANDE GROUP	1,420	1,420	234	4,065	不動産	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	1,980	3,040	854	14,821	金融	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	3,800	—	—	—	情報技術	
CHINA MERCHANTS BANK-H	1,010	1,330	6,882	119,415	金融	
BANK OF CHINA LTD-H	33,500	45,220	14,244	247,138	金融	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	440	700	1,211	21,010	金融	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	2,400	4,240	1,068	18,538	金融	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	1,272	1,720	971	16,860	金融	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	940	940	514	8,929	一般消費財・サービス	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	580	835	3,106	53,892	不動産	
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	350,249 88銘柄	402,357.15 85銘柄	328,632 <27.9%>	5,701,770	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
YANGZIJIANG FINANCIAL HOLDING	—	1,260	52	5,097	金融	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,427	1,260	117	11,485	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 >	1,427 1銘柄	2,520 2銘柄	170 <0.1%>	16,583	
(台湾)		百株	百株	千台湾・ドル	千円	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING LTD	—	45.99	—	—	金融	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	220	260	2,639	12,069	情報技術	
SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	—	180	2,475	11,319	情報技術	
TAIWAN CEMENT	1,481.45	1,471.45	5,885	26,919	素材	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	1,160	1,630	12,062	55,166	情報技術	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	90	250	2,145	9,810	情報技術	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	881.12	651.12	4,427	20,250	生活必需品	
FORMOSA PLASTICS CORP	806	1,136	12,212	55,852	素材	
NAN YA PLASTICS CORP	621.4	921.4	7,610	34,808	素材	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	593.9	413.9	3,054	13,970	素材	
CHINA STEEL CORP	3,206.86	4,666.86	13,370	61,151	素材	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	676.16	546.16	3,020	13,813	情報技術	
DELTA ELECTRONICS INC	340	520	11,388	52,084	情報技術	
YAGEO CORPORATION	80	140	3,892	17,800	情報技術	
WINBOND ELECTRONICS CORP	750	—	—	—	情報技術	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	—	570	2,992	13,686	情報技術	
ACER INC	1,730	1,770	3,725	17,040	情報技術	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	670	630	2,879	13,167	情報技術	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	—	80	2,716	12,421	情報技術	
QUANTA COMPUTER INC	720	1,060	8,395	38,396	情報技術	
AUO CORP	6,680	6,670	9,638	44,081	情報技術	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	834	974	12,321	56,351	コミュニケーション・サービス	
MEDIATEK INC	160.03	210.03	12,832	58,692	情報技術	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	360	290	4,727	21,619	情報技術	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	—	270	2,227	10,187	資本財・サービス	
EVA AIRWAYS CORP	1,690	—	—	—	資本財・サービス	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	1,180	—	—	—	金融	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,884.11	2,194.34	12,705	58,108	金融	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,968.38	2,718.38	12,368	56,569	金融	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	4,120	5,820	8,264	37,798	金融	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,065.05	2,001.24	5,793	26,497	金融	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	2,553.81	2,133.81	4,192	19,176	金融	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,769.93	2,039.93	7,292	33,354	金融	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	—	2,340	3,755	17,177	金融	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	4,243.34	10,402.31	8,665	39,630	金融	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	—	2,180	3,618	16,550	金融	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	2,470.28	4,230.28	10,279	47,014	金融	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,467.47	1,722.14	4,460	20,399	金融	
LARGAN PRECISION CO LTD	20	40	6,940	31,740	情報技術	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	80	110	3,256	14,891	情報技術	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	—	140	2,086	9,540	情報技術	
TAIWAN MOBILE CO LTD	340	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
WISTRON CORP	1,331.1	1,381.1	3,632	16,612	情報技術	
INNOLUX CORP	6,600	7,230	8,242	37,696	情報技術	
PEGATRON CORP	1,680	640	3,564	16,303	情報技術	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	240	—	—	—	情報技術	
CHALEASE HOLDING CO LTD	264.71	260.33	4,894	22,384	金融	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	—	1,520	4,035	18,457	金融	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	324	484	4,094	18,727	情報技術	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	360	360	3,416	15,625	エネルギー	
COMPAL ELECTRONICS	1,850	1,740	3,880	17,746	情報技術	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,140	3,030	133,320	609,752	情報技術	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	9,169.02	2,889.02	28,890	132,132	情報技術	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	130	140	3,857	17,640	生活必需品	
ASUSTEK COMPUTER INC	317.6	277.6	8,369	38,279	情報技術	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	2,060	3,100	11,826	54,089	情報技術	
台湾・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	74,379.72 47銘柄	86,481.39 51銘柄	462,340 <10.3%>	2,114,560	

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	千トルコ・リラ	千円	
(トルコ)					
IS YATIRIM MENKUL DEGERLER A	324.96	—	—	—	金融
TURKIYE GARANTI BANKASI	2,418.41	4,268.52	5,783	46,872	金融
AKBANK T. A. S.	3,342.74	5,781.32	4,596	37,247	金融
TURKIYE IS BANKASI-C	2,498.56	8,102.36	3,565	28,891	金融
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	877.6	1,956.33	3,314	26,857	コミュニケーション・サービス
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	199.9	204.07	5,397	43,743	エネルギー
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	842.22	1,162.93	3,018	24,466	素材
HACI OMER SABANCI HOLDING	1,279.23	2,082.02	3,907	31,670	金融
TURKIYE HALK BANKASI	1,108.22	3,356.45	1,574	12,757	金融
YAPI VE KREDI BANKASI	2,377.87	4,210.52	1,802	14,604	金融
KOC HOLDING AS	807.81	1,226.98	4,439	35,975	資本財・サービス
TURK HAVA YOLLARI AO	1,294.89	1,219.46	5,814	47,120	資本財・サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	123.96	356.99	2,954	23,940	生活必需品
トルコ・リラ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	17,496.37 33,927.95	46,167	374,146	
		13銘柄	12銘柄	<1.8% >	
(メキシコ)					
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	88	—	—	—	資本財・サービス
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	8,965	10,736	22,094	148,516	コミュニケーション・サービス
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	758	1,113	3,688	24,793	コミュニケーション・サービス
CEMEX SAB-CPO	8,967.19	11,105.19	8,606	57,851	素材
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	756	881	12,519	84,156	生活必需品
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	—	197	2,664	17,908	生活必需品
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	574	688	5,792	38,934	素材
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	1,593	1,603	11,187	75,199	生活必需品
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	653	820	9,229	62,041	金融
メキシコ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	22,354.19 27,143.19	75,783	509,400	
		8銘柄	8銘柄	<2.5% >	
(チリ)					
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE	—	2.41	16,857	2,473	素材
CENCOSUD SA	461.15	671.12	79,796	11,709	生活必需品
BANCO SANTANDER CHILE	28,986.96	42,682.55	161,937	23,764	金融
ENEL AMERICAS SA	12,217.63	13,632.94	118,606	17,405	公益事業
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	14.72	18.72	148,442	21,783	素材
FALABELLA SA	215.93	558.41	114,948	16,868	一般消費財・サービス
BANCO DE CHILE	10,345.39	20,598.72	173,770	25,500	金融
チリ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	52,241.78 78,164.87	814,359	119,505	
		6銘柄	7銘柄	<0.6% >	
(サウジアラビア)					
SAUDI ARABIAN MINING	—	128.08	633	23,033	素材
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	131.73	233.24	2,332	84,736	素材
SAUDI TELECOM CO	54.52	164.45	1,598	58,071	コミュニケーション・サービス
AL RAJHI BANK	241.62	254.22	2,033	73,886	金融
RIYAD BANK	—	231.11	751	27,287	金融
ETIHAD ETISALAT CO	176.9	144.62	511	18,599	コミュニケーション・サービス
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	—	72.59	359	13,054	素材
ALINMA BANK	329.25	188.42	629	22,863	金融
THE SAUDI NATIONAL BANK	118.42	270.87	1,782	64,751	金融
SAUDI ARABIAN OIL CO	280.37	561.61	2,142	77,838	エネルギー
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	285.25	275.76	421	15,328	素材
SAUDI ELECTRICITY CO	366.17	365.17	872	31,707	公益事業
サウジアラビア・リアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,984.23 2,890.14	14,069	511,157	
		9銘柄	12銘柄	<2.5% >	
(インド)					
RELIANCE INDUSTRIES-PARTLY P	25.19	—	—	—	エネルギー
TATA STEEL LTD	348.72	425.77	36,384	62,944	素材
AXIS BANK LTD	431.9	526.55	34,454	59,606	金融
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	19.5	23.5	19,841	34,326	一般消費財・サービス
TATA POWER CO LTD	794.37	556.46	11,766	20,355	公益事業
BANK OF BARODA	736.29	873.29	8,597	14,873	金融
HINDUSTAN UNILEVER LTD	52.23	91.66	21,771	37,663	生活必需品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	664.96	524.85	11,908	20,602	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	782.7	751.56	35,582	61,557	金融
NTPC LTD	2,405.22	1,829.05	25,862	44,742	公益事業
JSW STEEL LTD	317.64	300.41	16,567	28,661	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	650.99	1,332.5	28,075	48,571	公益事業
INDIAN OIL CORP LTD	2,304.71	2,186.92	16,259	28,129	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	686.05	715.4	22,631	39,152	エネルギー
JINDAL STEEL & POWER LTD	220.88	260.88	8,669	14,997	素材
ULTRATECH CEMENT LTD	10.97	15.97	9,117	15,773	素材
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	—	46.17	7,758	13,422	金融
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	53.46	90.2	11,408	19,737	金融
TECH MAHINDRA LTD	92.74	117.02	11,701	20,243	情報技術
YES BANK LTD	176.4	176.4	223	386	金融
TATA MOTORS LTD-A-DVR	282.02	281.75	5,544	9,592	一般消費財・サービス
REC LTD	530.6	725.16	9,358	16,189	金融
COAL INDIA LTD	1,440.5	1,657.98	30,183	52,217	エネルギー

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	千インド・ルピー	千円	
INDUS TOWERS LTD	—	411.72	8,646	14,957	コミュニケーション・サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	622.66	787.03	7,445	12,880	金融
GAIL INDIA LTD	691.94	1,294.03	17,281	29,897	公益事業
HINDALCO INDUSTRIES LTD	640.18	659.18	22,445	38,829	素材
GRASIM INDUSTRIES LTD	136.2	137.11	18,520	32,041	素材
WIPRO LTD	160.49	155.83	6,549	11,330	情報技術
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	108.98	135.39	43,799	75,772	情報技術
INFOSYS LTD	487.24	502.75	74,809	129,419	情報技術
LARSEN & TOUBRO LTD	135.49	189.47	29,968	51,845	資本財・サービス
TATA MOTORS LTD	1,103.73	1,289.11	52,653	91,090	一般消費財・サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	218.9	350.93	77,795	134,586	金融
ICICI BANK LTD	222.99	267.64	19,272	33,341	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD	526.81	700.02	168,963	292,307	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	2,380.25	2,316.58	29,188	50,496	エネルギー
ITC LTD	804.34	909.71	26,554	45,939	生活必需品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	234.85	363.7	39,686	68,658	一般消費財・サービス
HERO MOTOCORP LTD	29.67	58.06	16,027	27,727	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD	290.16	413.67	28,208	48,800	コミュニケーション・サービス
UPL LTD	137.76	171.76	11,241	19,448	素材
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	147.6	154.16	12,786	22,119	ヘルスケア
HCL TECHNOLOGIES LTD	162.74	180.04	17,726	30,667	情報技術
VEDANTA LTD	1,329.16	794.58	17,210	29,774	素材
インド・ルピー通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	23,600.18 43銘柄	25,751.92 44銘柄	1,130,452 <9.6%>	
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	4,933	4,829	3,138,850	28,563	一般消費財・サービス
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	1,013	—	—	—	素材
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	18,061	12,563	5,012,637	45,614	コミュニケーション・サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	4,250	3,155	2,413,575	21,963	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,194	7,016	4,946,280	45,011	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	5,474	4,441	3,286,340	29,905	金融
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	8,570	—	—	—	公益事業
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	13,452	15,072	6,089,088	55,410	金融
ADARO ENERGY TBK PT	12,895	8,504	2,355,608	21,436	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 >	69,842 9銘柄	55,580 7銘柄	27,242,378 <1.2%>	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジル・レアル	千円	
ULTRAPAR PARTICIPACOES RIGHTS SA	902.93	—	—	—	エネルギー
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	164	265	166	4,256	公益事業
ENERGISA SA-UNITS	106	147	578	14,775	公益事業
RUMO SA	285	509	811	20,732	資本財・サービス
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	1,765	—	—	—	金融
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	184	—	—	—	金融
VIBRA ENERGIA SA	755	1,134	1,855	47,377	一般消費財・サービス
VIA SA	—	2,265	414	10,585	一般消費財・サービス
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	108	—	—	—	生活必需品
NATURA &CO HOLDING SA	—	412	533	13,625	生活必需品
TIM SA	485.26	526.26	684	17,470	コミュニケーション・サービス
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	—	555	335	8,560	ヘルスケア
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	4,438	3,763	10,965	280,024	エネルギー
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	—	312	265	6,780	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	4,212.18	4,701.59	8,053	205,671	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	4,857.36	4,159.36	9,412	240,371	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	185	307	458	11,704	素材
VALE SA	948.9	1,785.9	13,335	340,545	素材
GERDAU SA-PREF	570	634	1,404	35,878	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	3,673	2,491	7,933	202,607	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	1,074.87	991.73	1,026	26,212	公益事業
ITAUSA SA	1,361	1,323.2	1,091	27,877	金融
BRASKEM SA-PREF A	261	166	602	15,388	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	222	245	1,127	28,780	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	1,543	1,277	4,219	107,746	金融
COSAN SA	644	392	689	17,618	エネルギー
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	372	559	2,528	64,581	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	792	1,084	744	19,017	公益事業
EMBRAER SA	712	489	570	14,573	資本財・サービス
METALURGICA GERDAU SA-PREF	949	1,192	1,124	28,705	素材
CCR SA	886	786	958	24,467	資本財・サービス
BRF SA	571	797	1,173	29,980	生活必需品
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	260	266	1,117	28,530	公益事業
LOJAS RENNER S. A.	197.05	277.75	639	16,335	一般消費財・サービス
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	147.84	—	—	—	一般消費財・サービス
JBS SA	965	801	2,563	65,456	生活必需品
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	—	115	93	2,396	素材
SUZANO SA	122.45	158.45	798	20,381	素材
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	379	—	—	—	生活必需品
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	906	1,380	1,529	39,047	金融
CIELO SA	2,442.28	2,931.28	1,134	28,969	情報技術
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	370	411	929	23,741	公益事業

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	
SUL AMERICA SA - UNITS	188.18	343.18	742	18,973	金融
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	186.54	276.3	417	10,654	公益事業
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	332	407	1,164	29,725	金融
RAIA DROGASIL SA	235	—	—	—	生活必需品
TELEFONICA BRASIL S. A.	369	340	1,581	40,382	コミュニケーション・サービス
KLABIN SA - UNIT	—	325	656	16,756	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	732	1,106	1,312	33,525	エネルギー
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	516	393	764	19,520	金融
LOJAS AMERICANAS SA	46.93	—	—	—	一般消費財・サービス
COGNA EDUCACAO	2,643	4,014	802	20,501	一般消費財・サービス
BANCO BRADESCO S. A.	1,267.65	1,381.21	1,966	50,227	金融
AMBEV SA	1,872	1,910	2,612	66,725	生活必需品
ブラジル・リアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	47,205.42 50,105.21	93,893	2,397,764	
		48銘柄	46銘柄	<11.7% >	
	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
(中国)					
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	737	1,044	2,053	41,746	金融
BANK OF BEIJING CO LTD -A	1,495	1,860	842	17,128	金融
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	175	—	—	—	金融
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	249	518	2,406	48,924	金融
IND & COMM BK OF CHINA-A	3,796	3,012	1,436	29,207	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	93	130	238	4,844	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	94	—	—	—	金融
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	29	29	104	2,130	一般消費財・サービス
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	3	6	1,210	24,614	生活必需品
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	80	159	572	11,636	素材
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	500	564	982	19,973	不動産
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	1,733	2,719	2,164	43,998	金融
CITIC SECURITIES CO-A	148	215	460	9,370	金融
CHINA MERCHANTS BANK-A	388	512	2,101	42,726	金融
PING AN BANK CO LTD-A	464	786	1,174	23,872	金融
GF SECURITIES CO LTD-A	134	148	270	5,508	金融
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	3,940	4,804	2,598	52,834	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-A	101	101	274	5,580	一般消費財・サービス
SAIC MOTOR CORP LTD-A	630	871	1,499	30,490	一般消費財・サービス
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	337	—	—	—	素材
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	421	—	—	—	資本財・サービス
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	289	439	161	3,284	金融
CHINA COAL ENERGY CO-A	—	262	269	5,475	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	132	171.6	239	4,859	資本財・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	903	1,079	379	7,721	資本財・サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	704	704	332	6,755	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-A	68	135	239	4,863	素材
YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	81	41	159	3,233	エネルギー
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	306	306	186	3,788	金融
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	8,046	10,813	3,265	66,385	金融
BANK OF CHINA LTD-A	2,581	3,144	1,034	21,027	金融
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	2,089	2,849	1,168	23,746	エネルギー
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	3,315	3,699	1,838	37,373	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	398	344	1,148	23,357	エネルギー
CHINA VANKE CO LTD -A	344	674	1,362	27,691	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	153	333	777	15,806	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	487	487	230	4,692	金融
CHINA MINSHENG BANKING-A	3,033	4,294	1,588	32,298	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	2,530	3,928	1,178	23,955	金融
CRRC CORP LTD-A	—	1,187	613	12,475	資本財・サービス
CHINA UNITED NETWORK-A	—	2,495	863	17,549	コミュニケーション・サービス
CGN POWER CO LTD-A	189	189	54	1,106	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	154	213	300	6,101	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	229	335	325	6,619	金融
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	1,850	2,064	1,279	26,014	資本財・サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	915	1,231	759	15,440	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	52	102	322	6,558	金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	1,174	1,583	818	16,637	金融
AIR CHINA LTD-A	207	—	—	—	資本財・サービス
BYD CO LTD -A	7	10	336	6,833	一般消費財・サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	71	71	110	2,250	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-A	98	237	300	6,114	資本財・サービス
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	130	269	251	5,118	素材
HUANENG POWER INTL INC-A	665	456	342	6,971	公益事業
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	—	953	506	10,306	金融
オフショア・人民元通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	46,747 62,575.6	43,140	877,003	
		51銘柄	50銘柄	<4.3% >	
	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
(マレーシア)					
MALAYAN BANKING BHD	583	763	656	20,231	金融
GENTING BHD	878	—	—	—	一般消費財・サービス
PUBLIC BANK BERHAD	2,617	1,686	740	22,820	金融

銘柄	株数	株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	—	807	735	22,691	素材
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	1,360	1,104	555	17,121	金融
TENAGA NASIONAL BHD	497	—	—	—	公益事業
マレーシア・リンギット通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,935 4,360	2,687	82,864 <0.4%>	
(南アフリカ)	株数	株数	千南アフリカ・ランド	千円	
GOLD FIELDS LTD	241.42	237.82	3,677	30,706	素材
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	15.03	11.13	2,238	18,687	金融
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	—	9,718.7	2,410	20,125	一般消費財・サービス
NEPI ROCKCASTLE PLC	151.07	—	—	—	不動産
MULTICHOICE GROUP LTD	118.08	—	—	—	コミュニケーション・サービス
OLD MUTUAL LTD	1,295.77	1,535.77	1,707	14,259	金融
VODACOM GROUP LTD	141.5	153.79	2,088	17,434	コミュニケーション・サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD	157.17	154.54	3,136	26,186	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD	139.46	162.94	3,421	28,571	金融
BIDVEST GROUP LTD	90.87	89.12	1,884	15,738	資本財・サービス
BID CORP LTD	68.49	86.49	2,669	22,288	生活必需品
STANDARD BANK GROUP LTD	320.36	308.84	4,827	40,309	金融
SASOL LTD	273.1	306.1	11,417	95,336	素材
REMGRO LTD	—	135.67	1,776	14,835	金融
DISCOVERY LTD	130.47	130.47	1,694	14,150	金融
EXXARO RESOURCES LTD	—	101.92	1,915	15,990	エネルギー
KUMBA IRON ORE LTD	—	26.67	1,377	11,500	素材
SANLAM LTD	530.72	452.73	2,433	20,319	金融
FIRSTRAND LTD	1,215.28	1,179.95	7,463	62,317	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	278.95	454.23	2,470	20,625	一般消費財・サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	—	143.47	1,747	14,587	一般消費財・サービス
ABSA GROUP LTD	255.81	237	3,741	31,237	金融
NASPERS LTD-N SHS	26.73	35.59	9,071	75,749	一般消費財・サービス
MTN GROUP LTD	433.66	511.77	7,114	59,407	コミュニケーション・サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	64.45	112.5	2,081	17,378	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	119.7	137.42	1,908	15,933	ヘルスケア
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	122.25	139.52	3,481	29,073	素材
MR PRICE GROUP LTD	79.44	81.72	1,462	12,210	一般消費財・サービス
SIBANYE STILLWATER LTD	344.77	798.07	3,381	28,234	素材
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,614.55 24銘柄	17,443.94 27銘柄	92,598 773,197 <3.8%>	
(タイ)	株数	株数	千タイ・パーツ	千円	
SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	—	1,653	16,860	64,238	金融
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	271	271	3,604	13,732	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR	458	503	18,862	71,866	素材
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	385	385	5,755	21,929	金融
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	1,139	—	—	—	一般消費財・サービス
KASIKORN BANK PCL-NVDR	169	675	10,091	38,447	金融
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,641	—	—	—	金融
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	31,683	31,683	3,801	14,485	金融
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	917	983	4,472	17,040	素材
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	412	389	7,780	29,641	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	6,418	6,963	10,723	40,854	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	3,723	4,964	6,056	23,073	エネルギー
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,520	2,061	5,152	19,631	ヘルスケア
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	670	772	12,274	46,766	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	11,202	11,202	3,562	13,572	エネルギー
BANGCHAK CORP PCL-NVDR	1,048	—	—	—	エネルギー
PTT PCL-NVDR	10,368	9,340	31,989	121,879	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	961	1,242	6,396	24,369	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	1,447	1,718	10,565	40,255	生活必需品
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	539	—	—	—	資本財・サービス
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	187	474	6,304	24,019	金融
LAND & HOUSES PUB - NVDR	3,271	4,672	3,901	14,863	不動産
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	2,294	3,746	9,833	37,464	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,404	1,966	8,847	33,707	素材
タイ・パーツ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	82,127 23銘柄	85,662 20銘柄	186,834 711,840 <3.5%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	847,464.8 404銘柄	4,809,679.86 403銘柄	— 16,653,004 <81.5%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首 口数	当 口数	期末 評価額	
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円
(アメリカ) INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	千口 178.6	千口 871.6	15,767	2,146,552
合計	178.6	871.6	15,767	2,146,552
	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	1銘柄		< 10.5% >

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	期末	
	買建額 百万円	売建額 百万円
外国 MSCI EMGMKT (アメリカ)	1,526	—

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

■投資信託財産の構成

2022年7月5日現在

項目	期末	
	評価額 千円	比率 %
株式	16,653,004	81.3
投資信託証券	2,146,552	10.5
コール・ローン等、その他	1,687,119	8.2
投資信託財産総額	20,486,677	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5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.14円、1香港・ドル=17.35円、1シンガポール・ドル=97.49円、1台湾・ドル=4.573円、1トルコ・リラ=8.104円、1メキシコ・ペソ=6.721円、100チリ・ペソ=14.674円、1サウジアラビア・リアル=36.33円、1インド・ルピー=1.73円、100インドネシア・ルピア=0.91円、1ブラジル・レアル=25.537円、1オフショア・人民元=20.329円、1マレーシア・リンギット=30.831円、1南アフリカ・ランド=8.35円、1タイ・バーツ=3.81円です。
 (注3) 当期末における外貨建純資産 (20,150,544千円) の投資信託財産総額 (20,486,677千円) に対する比率は、98.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年7月5日現在

項目	当期末
(A) 資産	20,769,261,620円
コール・ローン等	1,078,429,674
株式 (評価額)	16,653,004,850
投資信託証券 (評価額)	2,146,552,598
未収入金	301,449,710
未収配当金	201,363,594
差入委託証拠金	388,461,194
(B) 負債	330,095,208
未払金	293,576,885
未払解約金	36,471,495
その他未払費用	46,828
(C) 純資産総額 (A - B)	20,439,166,412
元本	10,636,828,515
次期繰越損益金	9,802,337,897
(D) 受益権総口数	10,636,828,515口
1万口当り基準価額 (C / D)	19,215円

* 期首における元本額は8,472,556,221円、当作成期間中における追加設定元本額は3,341,651,046円、同解約元本額は1,177,378,752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：
 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) 53,866,340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) 268,619,744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) 331,756,132円
 D-I's 新興国株式インデックス 131,615,787円
 iFree 新興国株式インデックス 4,355,550,315円
 iFree 8資産バランス 2,693,696,590円
 ダイワ新興国株式インデックス (為替ヘッジなし) (投資一任専用) 4,956,741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) 1,038,632,015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 1,308,070,479円
 ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式 355,867,895円
 ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド 94,196,477円
 * 当期末の計算口数当りの純資産額は19,215円です。

■損益の状況

当期 自 2021年7月6日 至 2022年7月5日

項目	当期
(A) 配当等収益	993,336,144円
受取配当金	989,569,364
受取利息	516,400
その他収益金	3,334,738
支払利息	△ 84,358
(B) 有価証券売買損益	△ 559,981,162
売買益	4,497,391,875
売買損	△ 5,057,373,037
(C) 先物取引等損益	△ 244,505,869
取引益	118,901,142
取引損	△ 363,407,011
(D) その他費用	△ 29,606,072
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	159,243,041
(F) 前期繰越損益金	7,654,015,813
(G) 解約差損益金	△ 1,041,564,946
(H) 追加信託差損益金	3,030,643,989
(I) 合計 (E + F + G + H)	9,802,337,897
次期繰越損益金 (I)	9,802,337,897

(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」は、いかなる形式においても FTSE International Limited (以下「FTSE」)、ロンドン証券取引所グループ会社 (以下「LSEG」)、または Research Affiliates LLC (以下「RA」) (以下、総称して「ライセンサ各社」) によって出資、保証、販売、または販売促進されることはございません。また、ライセンサ各社はいずれも、明示的にも黙示的にも当該インデックスの使用から得られる結果や特定の日時における指数値について何ら保証や表明を行うことはございません。当該指数はまた RA と共同し FTSE によってルールに基づき計算されます。いずれのライセンサ各社も、指数における瑕疵については (過失の有無に関わらず) 何人に対しても責任を負わず、またそれについて通知する義務も負いません。

FTSE[®] は LSEG の商標です。Fundamental Index[®] および RAFI[®] は Research Affiliates, LLC の登録商標です。

The Daiwa Emerging Equity Fundamental Index Mother Fund is not in any way sponsored, endorsed, sold or promoted by FTSE International Limited ("FTSE"), by the London Stock Exchange Group companies ("LSEG"), or by Research Affiliates LLC ("RA") (collectively the "Licensor Parties"), and none of the Licensor Parties make any warranty or representation whatsoever, expressly or impliedly, either as to the results to be obtained from the use of the FTSE RAFI Emerging Index (the "Index") and/or the figure at which the said Index stands at any particular time on any particular day or otherwise. The Index is compiled and calculated by FTSE in conjunction with RA. None of the Licensor Parties shall be liable (whether in negligence or otherwise) to any person for any error in the Index and none of the Licensor Parties shall be under any obligation to advise any person of any error therein.

FTSE[®] is a trade mark of LSEG. The trade names Fundamental Index[®] and RAFI[®] are registered trademarks of Research Affiliates, LLC.

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

運用報告書(全体版)

第7期

(決算日 2023年6月15日)

(作成対象期間 2022年6月16日～2023年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）	
運用方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
	日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の30%以下
	マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、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、わが国の公社債に投資し、ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数に連動する投資成果をあげることがをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<4643>

最近5期の運用実績

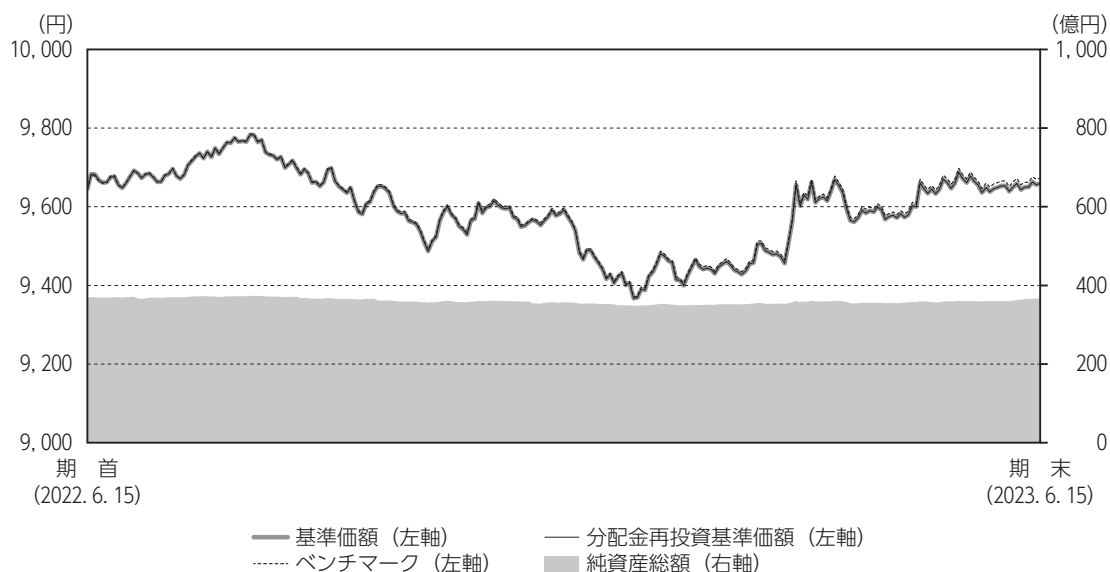
決算期	基準価額			ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公社債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
3期末(2019年6月17日)	円 10,149	円 0	% 2.4	538.684	% 2.5	% 99.4	% —	百万円 27,372
4期末(2020年6月15日)	円 10,024	円 0	△ 1.2	532.954	△ 1.1	% 99.4	% —	33,339
5期末(2021年6月15日)	円 9,987	円 0	△ 0.4	532.014	△ 0.2	% 99.3	% —	36,597
6期末(2022年6月15日)	円 9,645	円 0	△ 3.4	514.574	△ 3.3	% 99.4	% —	36,841
7期末(2023年6月15日)	円 9,659	円 0	0.1	516.013	0.3	% 99.4	% —	36,693

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



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：9,645円
 期末：9,659円 (分配金0円)
 騰落率：0.1% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

「日本債券インデックスマザーファンド」の受益証券を通じて、わが国の公社債に投資した結果、投資している債券の価格が下落したものの、債券からの利息収入がプラス要因となり、基準価額はおおむね横ばいとなりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2022年 6月15日	円	%		%	%	%
	9,645	—	514.574	—	99.4	—
6月末	9,676	0.3	516.250	0.3	99.5	—
7月末	9,740	1.0	519.643	1.0	99.4	—
8月末	9,717	0.7	518.539	0.8	99.3	—
9月末	9,612	△ 0.3	513.014	△ 0.3	99.7	—
10月末	9,600	△ 0.5	512.423	△ 0.4	99.3	—
11月末	9,552	△ 1.0	509.828	△ 0.9	99.4	—
12月末	9,427	△ 2.3	503.154	△ 2.2	99.6	—
2023年 1月末	9,400	△ 2.5	501.780	△ 2.5	99.4	—
2月末	9,504	△ 1.5	507.513	△ 1.4	99.5	—
3月末	9,636	△ 0.1	514.584	0.0	99.7	—
4月末	9,660	0.2	515.907	0.3	99.5	—
5月末	9,649	0.0	515.440	0.2	99.5	—
(期末)2023年 6月15日	9,659	0.1	516.013	0.3	99.4	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇（債券価格は下落）しました。

国内長期金利は、当作成期首から2022年12月半ばまで、米国でのインフレ・ピークアウト観測などにより低下した一時期を除き、世界的なインフレの進行や海外金利の上昇、日銀が金融政策を一部修正するのではないかとの思惑などにより、日銀がイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）で許容する上限である0.25%程度を上限とした狭いレンジでの推移が続きしました。しかし12月の金融政策決定会合において、日銀が長期金利の許容上限を0.25%程度から0.5%程度に引き上げたことを受けて長期金利は急上昇し、2023年1月には0.5%まで上昇しました。3月には、米国の地方銀行の経営破綻をきっかけとした信用不安が警戒されたことで投資家心理が悪化し、長期金利は一時0.2%台まで急低下したものの、当局の迅速な対応などが評価され、長期金利は再び0.4%台後半まで上昇しました。さらに、4月の金融政策決定会合や植田日銀総裁の記者会見を経て、日銀が早期に金融政策を修正するとの思惑が後退したことにより、5月以降は0.4%台前後での推移が続きしました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

今後も、ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行います。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流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

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

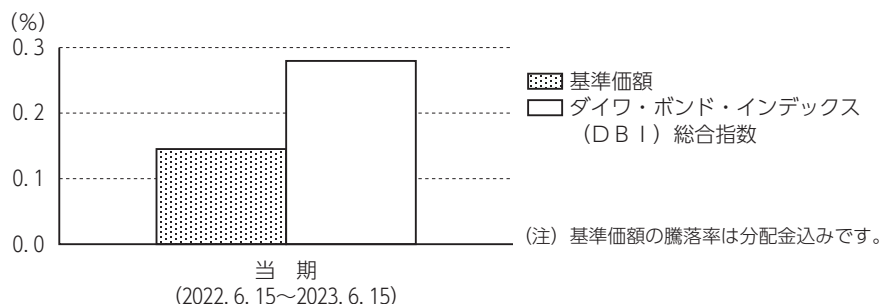
組入ファンド	ベンチマーク
日本債券インデックスマザーファンド	ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は0.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は0.1%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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	
	2022年6月16日 ～2023年6月15日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	267

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
 (注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
 (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。
 (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

今後も、ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行います。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入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 (2022. 6. 16~2023. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	14円	0.148%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,595円です。
(投信会社)	(8)	(0.082)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(5)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(1)	(0.011)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合計	15	0.154	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

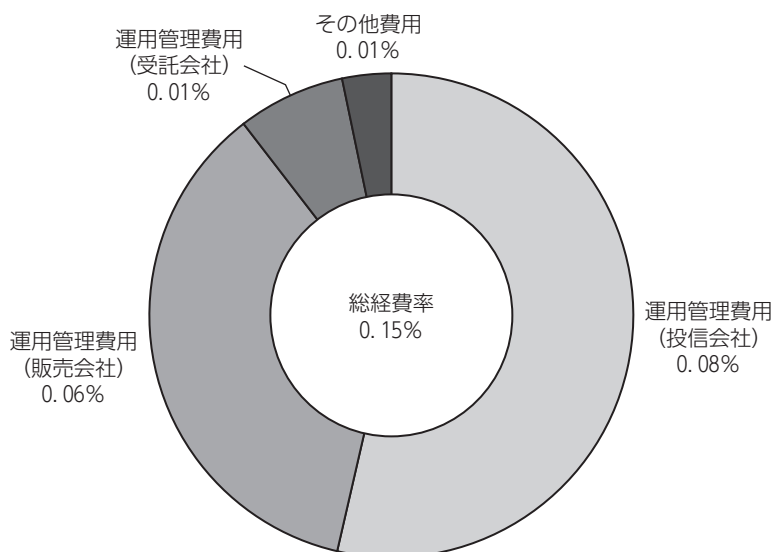
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

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



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日本債券インデックス マザーファンド	千口 3,069,614	千円 4,196,753	千口 3,257,266	千円 4,452,908

(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

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	40,354	1,397	3.5	29,358	201	0.7
コール・ローン	136,701	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合31.8%

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

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

種 類	当 期	
	日本債券インデックスマザーファンド 買 付 額	
公社債	百万円 1,900	

(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、大和証券株式会社です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額
日本債券インデックス マザーファンド	千口 26,819,810	千口 26,632,158	千円 36,656,503

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日本債券インデックス マザーファンド	千円 36,656,503	% 99.7
コール・ローン等、その他	95,598	0.3
投資信託財産総額	36,752,101	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	36,752,101,450円
コール・ローン等	95,598,155
日本債券インデックス マザーファンド (評価額)	36,656,503,295
(B) 負債	59,070,398
未払解約金	31,765,890
未払信託報酬	26,329,427
その他未払費用	975,081
(C) 純資産総額 (A - B)	36,693,031,052
元本	37,987,526,906
次期繰越損益金	△ 1,294,495,854
(D) 受益権総口数	37,987,526,906口
1万口当り基準価額 (C/D)	9,659円

* 期首における元本額は38,196,306,569円、当作成期間中における追加設定元本額は6,956,197,111円、同解約元本額は7,164,976,774円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,659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1,294,495,854円です。

■損益の状況

当期 自 2022年6月16日 至 2023年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 25,902円
受取利息	2,111
支払利息	△ 28,013
(B) 有価証券売買損益	136,945,890
売買益	170,363,640
売買損	△ 33,417,750
(C) 信託報酬等	△ 55,501,175
(D) 当期損益金 (A + B + C)	81,418,813
(E) 前期繰越損益金	△ 1,011,218,560
(F) 追加信託差損益金	△ 364,696,107
(配当等相当額)	(755,179,928)
(売買損益相当額)	(△ 1,119,876,035)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 1,294,495,854
次期繰越損益金 (G)	△ 1,294,495,854
追加信託差損益金	△ 364,696,107
(配当等相当額)	(755,179,928)
(売買損益相当額)	(△ 1,119,876,035)
分配準備積立金	260,229,141
繰越損益金	△ 1,190,028,888

(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いません。

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

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

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	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	755,179,928
(d) 分配準備積立金	260,229,141
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,015,409,069
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,015,409,069
(h) 受益権総口数	37,987,526,906口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 日本債券インデックス）が投資対象としている「日本債券インデックスマザーファンド」の決算日（2022年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2023年6月15日）現在における日本債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■日本債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
436 2年国債 0.005% 2024/5/1	1,903,496	436 2年国債 0.005% 2024/5/1	2,403,087
143 5年国債 0.1% 2025/3/20	1,707,514	138 5年国債 0.1% 2023/12/20	1,202,316
148 5年国債 0.005% 2026/6/20	1,480,809	148 5年国債 0.005% 2026/6/20	1,201,666
369 10年国債 0.5% 2032/12/20	1,455,464	140 5年国債 0.1% 2024/6/20	1,122,531
367 10年国債 0.2% 2032/6/20	1,068,864	433 2年国債 0.005% 2024/2/1	1,000,655
147 5年国債 0.005% 2026/3/20	1,011,549	351 10年国債 0.1% 2028/6/20	999,381
153 5年国債 0.005% 2027/6/20	1,000,403	139 5年国債 0.1% 2024/3/20	951,444
350 10年国債 0.1% 2028/3/20	918,282	334 10年国債 0.6% 2024/6/20	906,759
368 10年国債 0.2% 2032/9/20	915,700	431 2年国債 0.005% 2023/12/1	900,978
355 10年国債 0.1% 2029/6/20	884,318	137 5年国債 0.1% 2023/9/20	801,920

(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、2023年6月15日現在における日本債券インデックスマザーファンド（81,482,693千円）の内容です。

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

作 成 期	2023年6月15日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	う ち B B 格 以 下 組 入 率 比	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	96,969,000	98,258,745	87.6	—	56.9	22.4	8.3
地方債証券	5,000,000	5,181,131	4.6	—	3.1	1.2	0.4
特殊債券（除く金融債券）	2,500,000	2,538,615	2.3	—	1.4	0.5	0.3
金融債券	100,000	99,714	0.1	—	—	0.1	—
普通社債券	5,500,000	5,469,294	4.9	—	2.0	2.7	0.2
合 計	110,069,000	111,547,502	99.5	—	63.5	26.9	9.1

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

(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）

2023年6月15日現在						
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千円	千円		
国債証券	439 2年国債	0.0050	650,000	651,020	2024/08/01	
	440 2年国債	0.0050	180,000	180,293	2024/09/01	
	141 5年国債	0.1000	1,240,000	1,243,447	2024/09/20	
	335 10年国債	0.5000	690,000	695,409	2024/09/20	
	72 20年国債	2.1000	105,000	107,948	2024/09/20	
	441 2年国債	0.0050	80,000	80,128	2024/10/01	
	442 2年国債	0.0050	500,000	500,790	2024/11/01	
	443 2年国債	0.0050	220,000	220,352	2024/12/01	
	142 5年国債	0.1000	1,040,000	1,043,140	2024/12/20	
	336 10年国債	0.5000	275,000	277,497	2024/12/20	
	337 10年国債	0.3000	400,000	402,420	2024/12/20	
	73 20年国債	2.0000	120,000	123,816	2024/12/20	
	74 20年国債	2.1000	73,000	75,432	2024/12/20	
	445 2年国債	0.0050	100,000	100,163	2025/02/01	
	143 5年国債	0.1000	2,500,000	2,508,125	2025/03/20	
	338 10年国債	0.4000	580,000	584,953	2025/03/20	
	75 20年国債	2.1000	80,000	83,078	2025/03/20	
	76 20年国債	1.9000	51,000	52,782	2025/03/20	
	77 20年国債	2.0000	130,000	134,773	2025/03/20	
	448 2年国債	0.0050	240,000	240,381	2025/05/01	
	144 5年国債	0.1000	1,180,000	1,184,153	2025/06/20	
339 10年国債	0.4000	590,000	595,640	2025/06/20		

2023年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	78 20年国債	1.9000	61,000	63,425	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	52,089	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	55,321	2025/06/20
	145 5年国債	0.1000	1,650,000	1,656,352	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	760,000	768,094	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	91,278	2025/09/20
	146 5年国債	0.1000	1,080,000	1,084,482	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	500,000	504,590	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	98,066	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	1,630,000	1,632,917	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	710,000	713,138	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	61,462	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	85,216	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	58,434	2026/03/20
	148 5年国債	0.0050	1,380,000	1,382,277	2026/06/20
	343 10年国債	0.1000	780,000	783,525	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	107,086	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	83,291	2026/06/20
	149 5年国債	0.0050	680,000	680,999	2026/09/20
	344 10年国債	0.1000	780,000	783,564	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	20,000	21,463	2026/09/20
	150 5年国債	0.0050	1,250,000	1,251,537	2026/12/20
	345 10年国債	0.1000	950,000	954,341	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	310,000	333,215	2026/12/20
	151 5年国債	0.0050	1,240,000	1,240,930	2027/03/20
	346 10年国債	0.1000	780,000	783,369	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	107,578	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	140,340	2027/03/20
	153 5年国債	0.0050	750,000	750,000	2027/06/20
	347 10年国債	0.1000	1,100,000	1,104,180	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	54,601	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	55,000	59,620	2027/06/20
	154 5年国債	0.1000	690,000	692,201	2027/09/20
	348 10年国債	0.1000	1,050,000	1,053,349	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	43,704	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	320,000	348,275	2027/09/20
	155 5年国債	0.3000	730,000	738,380	2027/12/20
	349 10年国債	0.1000	1,250,000	1,253,087	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	100,000	109,254	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	900,000	900,846	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	155,000	170,617	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	350,000	388,587	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	97,877	2028/04/20
	11 フィリピン共和国	0.9900	100,000	99,588	2028/08/15
	352 10年国債	0.1000	700,000	699,811	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	139,192	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	166,491	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	930,000	928,977	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	90,000	99,785	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	300,000	329,331	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	680,000	678,633	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	55,000	60,564	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	260,000	289,276	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	1,380,000	1,376,287	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	200,000	224,624	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	150,000	167,574	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	500,000	498,135	2029/09/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	18,630	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	310,000	347,506	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	750,000	746,137	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	70,000	78,701	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	203,535	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	27,527	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	980,000	973,786	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	200,000	226,902	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	200,000	225,566	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	34,315	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	800,000	793,640	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	106,785	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	103,252	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	317,000	347,561	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	940,000	930,271	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	200,000	223,858	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	200,000	222,430	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	43,005	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	970,000	957,855	2030/12/20

2023年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	123 20年国債	2.1000	200,000	227,282	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	300,000	338,712	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	790,000	778,608	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	130,000	149,067	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	124,414	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	250,000	280,860	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	32,168	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	1,200,000	1,180,296	2031/06/20
	128 20年国債	1.9000	250,000	281,510	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	200,000	223,642	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	1,000,000	981,890	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	156,868	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	166,864	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	28,120	2031/11/20
	365 10年国債	0.1000	700,000	686,098	2031/12/20
	132 20年国債	1.7000	100,000	111,435	2031/12/20
	366 10年国債	0.2000	950,000	937,488	2032/03/20
	134 20年国債	1.8000	30,000	33,739	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	102,685	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	550,000	609,202	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	64,366	2032/05/20
	367 10年国債	0.2000	900,000	886,653	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	300,000	330,135	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	370,000	410,400	2032/06/20
	368 10年国債	0.2000	420,000	413,049	2032/09/20
	140 20年国債	1.7000	570,000	638,177	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	30,506	2032/11/22
	369 10年国債	0.5000	1,450,000	1,463,949	2032/12/20
	9 30年国債	1.4000	43,000	47,004	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	400,000	448,472	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	190,000	214,768	2032/12/20
	370 10年国債	0.5000	130,000	130,912	2033/03/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	47,890	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	233,448	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	390,000	429,885	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	44,897	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	340,000	381,626	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	69,780	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	420,000	471,731	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	86,581	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	400,000	445,500	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	98,207	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	270,000	298,020	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	50,000	60,562	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	532,000	587,519	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	250,000	303,635	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	530,000	579,931	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	130,000	156,716	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	480,000	514,612	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	95,726	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	500,000	535,890	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	68,353	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	680,000	736,623	2035/06/20
	154 20年国債	1.2000	630,000	674,717	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	72,165	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	440,000	460,482	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	170,000	209,023	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	500,000	486,130	2036/03/20
	157 20年国債	0.2000	560,000	529,132	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	113,474	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	350,000	342,958	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	181,531	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	350,000	346,748	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	180,000	220,478	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	460,000	460,864	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	420,000	414,376	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	186,220	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	580,000	570,627	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	480,000	471,192	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	170,000	211,498	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	300,000	289,647	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	370,000	356,076	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	246,544	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	600,000	593,046	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	400,000	382,648	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	268,246	2039/03/20

2023年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	168 20年国債	0.4000	420,000	394,279	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	320,000	294,572	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	300,000	361,479	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	420,000	385,068	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	500,000	456,540	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	285,000	347,916	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	200,000	185,032	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	510,000	470,296	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	280,000	328,720	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	600,000	551,466	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	400,000	372,972	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	270,000	325,989	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	580,000	539,110	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	530,000	482,570	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	250,000	294,055	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	450,000	416,214	2041/09/20
	179 20年国債	0.5000	380,000	350,591	2041/12/20
	36 30年国債	2.0000	350,000	412,118	2042/03/20
	180 20年国債	0.8000	490,000	476,397	2042/03/20
	181 20年国債	0.9000	500,000	493,585	2042/06/20
	37 30年国債	1.9000	450,000	522,157	2042/09/20
	182 20年国債	1.1000	340,000	346,891	2042/09/20
	183 20年国債	1.4000	240,000	257,140	2042/12/20
	38 30年国債	1.8000	600,000	684,270	2043/03/20
	184 20年国債	1.1000	240,000	243,758	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	270,000	312,865	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	180,000	205,299	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	210,000	235,622	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	205,000	230,063	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	260,000	291,852	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	300,000	336,822	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	250,000	271,167	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	210,000	227,745	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	370,000	408,206	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	280,000	297,682	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	220,000	233,807	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	310,000	291,744	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	340,000	284,821	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	385,000	337,213	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	250,000	223,515	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	310,000	289,481	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	260,000	242,192	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	340,000	315,924	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	330,000	305,863	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	88,831	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	430,000	397,547	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	300,000	269,844	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	220,000	206,802	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	178,376	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	134,285	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	430,000	363,264	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	300,000	245,844	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	220,000	179,649	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	270,000	220,349	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	183,163	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	220,000	178,389	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	300,000	256,224	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	340,000	289,469	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	350,000	305,585	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	180,000	219,999	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	300,000	261,417	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	310,000	269,867	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	320,000	278,016	2051/09/20
	73 30年国債	0.7000	240,000	208,310	2051/12/20
	5 40年国債	2.0000	185,000	218,275	2052/03/20
	74 30年国債	1.0000	320,000	300,531	2052/03/20
	75 30年国債	1.3000	330,000	333,511	2052/06/20
	76 30年国債	1.4000	480,000	497,020	2052/09/20
	77 30年国債	1.6000	20,000	21,696	2052/12/20
	6 40年国債	1.9000	285,000	330,557	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	134,289	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	237,571	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	168,509	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	230,000	206,236	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	276,723	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	380,000	294,294	2059/03/20

日本債券インデックスマザーファンド

2023年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	13 40年国債	0.5000	360,000	276,336	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	430,000	351,735	2061/03/20
	15 40年国債	1.0000	630,000	565,973	2062/03/20
	16 40年国債	1.3000	340,000	332,588	2063/03/20
種別小計	銘柄数 金 額	254銘柄	96,969,000	98,258,745	
地方債証券	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	100,702	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	100,698	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	201,848	2025/04/16
	4 東京都5年	0.0200	200,000	199,859	2025/09/19
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	103,911	2025/11/21
	27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	101,018	2025/11/27
	751 東京都公債	0.3700	100,000	100,800	2025/12/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,936	2026/06/19
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,250	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,341	2027/03/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	200,057	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,191	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	100,187	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	110,581	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	109,628	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	111,848	2029/06/20
	8 静岡県20年	2.2430	200,000	223,754	2029/08/17
	19 横浜市20年	2.2000	100,000	111,666	2029/08/31
	796 東京都公債	0.0400	100,000	98,352	2029/09/20
	1 北九州市15年	0.9360	100,000	103,908	2029/10/22
	1-1 山梨県公債	0.0500	100,000	98,318	2029/10/30
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	111,575	2029/12/14
	1-5 千葉県公債	0.0800	100,000	98,276	2030/02/25
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	112,240	2030/05/24
	808 東京都公債	0.1100	100,000	97,828	2030/09/20
	2-4 札幌市公債	0.1200	100,000	97,891	2030/09/20
	2-7 埼玉県公債	0.1250	100,000	97,864	2030/10/16
	27-12 愛知県15年	0.7590	100,000	102,435	2030/10/21
	2-2 岡山県公債	0.1200	100,000	97,492	2031/01/29
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	97,093	2031/06/30
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	111,120	2031/08/19
	7 大阪府20年	1.8400	200,000	221,232	2031/09/26
	37-2 宮城県公債	0.1350	100,000	96,920	2031/10/28
	10 京都市20年	1.8030	100,000	110,631	2031/11/21
	3-2 徳島県公債	0.1300	100,000	96,825	2031/11/26
	827 東京都公債	0.2940	100,000	97,910	2032/03/19
	12 埼玉県20年	1.7300	100,000	110,332	2032/05/24
	4-3 長崎県公債	0.3640	100,000	98,385	2032/06/18
	13 千葉県20年	1.7010	100,000	110,065	2032/10/15
	5-1 福岡県公債	0.6810	100,000	99,979	2033/05/30
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	108,222	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	108,417	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	101,984	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	116,628	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	101,913	2045/12/20
種別小計	銘柄数 金 額	45銘柄	5,000,000	5,181,131	
特殊債券 (除く金融債券)	65 地方公共団体	0.5350	100,000	100,652	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	100,553	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	100,702	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	201,854	2025/11/28
	127 都市再生	0.0750	100,000	99,766	2026/09/18
	80 住宅支援機構	1.5890	100,000	104,709	2026/09/18
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	104,787	2027/08/25
	1 地方公共団15年	1.3340	100,000	105,005	2028/01/28
	F192地方公共団体	1.1670	100,000	104,605	2028/10/24
	F226地方公共団体	1.0960	100,000	104,394	2029/02/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	110,719	2029/07/31
	47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	104,131	2029/09/20
	129 地方公共団体	0.0950	200,000	196,052	2030/02/28
	F221地方公共団体	1.1980	200,000	210,717	2030/04/26
	123 住宅支援機構	1.8010	100,000	110,612	2032/09/17
	31 地方公共団20	1.7440	100,000	110,220	2033/09/28
	223 政保道路機構	1.4270	100,000	108,129	2034/07/31
	284 政保道路機構	0.1490	200,000	185,076	2036/07/31

2023年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	298 政保道路機構 247 道路機構	0.5470 % 0.3420	100,000 200,000	97,171 178,750	2036/12/26 2040/03/19
種別小計	銘 柄 数 金 額	20銘柄			
			2,500,000	2,538,615	
金融債券	19 利付商工債	0.1000	100,000	99,714	2026/09/18
種別小計	銘 柄 数 金 額	1銘柄			
			100,000	99,714	
普通社債券	482 九州電力 5 野村不動産HD 11 日本たばこ産業 63 中日本高速道 4 ファーストリテイリング 14 セブンアンドアイ 16 NTTファイナンス 11 ヒューリック 36 芙蓉総合リース 36 三井住友F&L 1 日生2021基金 20 成田国際空港 17 パナソニック 7 三井住友海上 6 楽天カード 509 関西電力 42 リコーリース 12 アサヒグループHD 15 デンソー 78 トヨタファイナンス 11 東京電力パワー 7 日本製鉄 16 フボタ 16 JERA 1 SOMPOHD 111 住友不動産 11 サントリーホールディング 50 大阪瓦斯 82 三井不動産 22 積水ハウス 26 リソナホールディング 1 レゾナックHD 31 豊田通商 7 花王FR 81 ホンダファイナンス 34 沖縄電力 20 ZHD 15 ソフトバンク 41 東海旅客鉄道 13 NTTファイナンス 85 電源開発 7 凸版印刷 65 東京瓦斯 538 関西電力 18 楽天グループ 143 三菱地所 448 中国電力 31 トヨタ自動車 2 AGC 63 住友商事 332 北海道電力 23 森ビル 107 東日本旅客鉄	0.1700 0.9240 0.5990 0.5760 0.7490 0.1900 0.1800 0.3200 0.2700 0.2600 0.2800 0.1050 0.4700 0.1900 0.6200 0.4700 0.3900 0.3300 0.2450 0.2650 0.7900 0.5640 0.4790 0.6400 0.4790 0.5200 0.3890 0.3900 0.3600 0.3600 0.4150 0.6950 0.3550 0.3450 0.3890 0.3650 0.4600 0.4100 2.1660 1.0900 0.8720 1.1040 0.2250 0.3900 1.0500 0.9000 0.9200 0.7350 0.7900 0.8400 0.9070 0.9700 1.4150	100,000 100,000 100,000 100,000 100,000 100,000 100,000 100,000 200,000 100,000 200,000 100,000	100,093 101,344 100,941 101,104 101,229 99,840 99,830 100,028 99,985 199,976 99,767 99,756 100,286 99,635 92,062 100,527 99,984 100,124 99,542 99,623 100,348 100,689 100,455 100,798 99,986 100,516 99,993 99,995 99,996 99,996 99,996 100,003 200,007 100,000 100,000 99,999 97,385 97,057 109,408 103,471 101,901 103,489 96,915 97,458 73,535 100,652 100,098 99,979 99,980 99,990 95,510 94,100 99,892	2024/08/23 2025/05/30 2025/07/15 2025/11/13 2025/12/18 2025/12/19 2025/12/19 2026/04/13 2026/06/05 2026/06/15 2026/08/03 2026/08/21 2026/09/18 2026/11/13 2026/12/17 2027/05/25 2027/06/01 2027/06/11 2027/06/18 2027/07/23 2028/01/25 2028/03/17 2028/04/20 2028/04/25 2028/04/27 2028/04/28 2028/05/25 2028/06/02 2028/06/06 2028/06/07 2028/06/07 2028/06/15 2028/06/15 2028/06/20 2028/06/20 2028/06/23 2028/07/28 2028/10/12 2029/01/29 2029/09/20 2029/10/31 2029/12/12 2030/09/10 2031/01/24 2031/12/02 2033/05/02 2033/05/25 2033/06/01 2033/06/08 2033/06/15 2036/04/25 2038/05/17 2045/01/27
種別小計	銘 柄 数 金 額	53銘柄			
			5,500,000	5,469,294	
合 計	銘 柄 数 金 額	373銘柄			
			110,069,000	111,547,502	

(注) 単位未満は切捨て。

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第23期 (決算日 2022年11月30日)

(作成対象期間 2021年12月1日～2022年11月30日)

日本債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

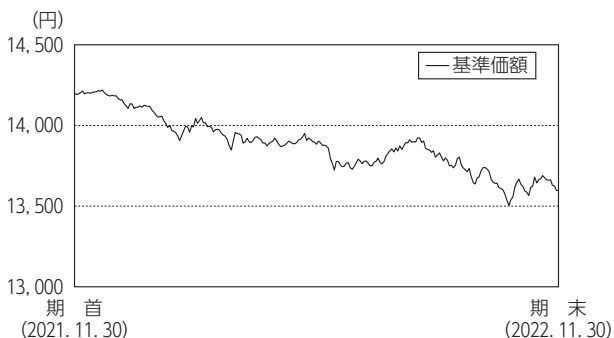
運用方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	わが国の公社債
株式組入制限	純資産総額の30%以下

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公社債	債券
	円	%	ベンチマーク	%	組入比率	先物比率
(期首) 2021年11月30日	14,199	—	532.469	—	99.2	—
12月末日	14,167	△ 0.2	531.310	△ 0.2	99.7	—
2022年1月末日	14,066	△ 0.9	527.510	△ 0.9	99.5	—
2月末日	13,995	△ 1.4	524.780	△ 1.4	99.4	—
3月末日	13,956	△ 1.7	523.357	△ 1.7	99.6	—
4月末日	13,921	△ 2.0	522.056	△ 2.0	99.6	—
5月末日	13,900	△ 2.1	521.104	△ 2.1	99.5	—
6月末日	13,768	△ 3.0	516.250	△ 3.0	99.6	—
7月末日	13,860	△ 2.4	519.643	△ 2.4	99.5	—
8月末日	13,830	△ 2.6	518.539	△ 2.6	99.4	—
9月末日	13,681	△ 3.6	513.014	△ 3.7	99.8	—
10月末日	13,667	△ 3.7	512.423	△ 3.8	99.4	—
(期末) 2022年11月30日	13,600	△ 4.2	509.828	△ 4.3	99.5	—

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注5) 債券先物比率は買建比率 - 売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：14,199円 期末：13,600円 騰落率：△4.2%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内債券市場

国内債券市場では、長期金利は上昇しました。

国内長期金利は、当作成期首より2021年末にかけて、世界的なインフレ懸念と先進各国での金融引き締めによる将来的なインフレ抑制観測とが綱引きする格好となり、0.05～0.1%程度で推移しました。2022年に入ると、世界的なインフレ圧力の高まりや各国金利の上昇を受けて日本の長期金利も上昇し、2月には0.2%台となりました。その後、ロシアによるウクライナ侵攻などで一時0.1%台半ばまで低下しましたが、ロシアに対する経済制裁が追加的なインフレ要因となり、3月下旬には0.2%台半ばまで上昇しました。4月以降も、世界的なインフレの進行と海外金利の上昇などにより日本の長期金利にも上昇圧力がかけられましたが、日銀がイールドカーブ・コントロールにおいて許容する長期金利の上限である0.25%を維持する姿勢を強く示したことで、7月にかけて0.2%台前半から半ばで推移しました。8月には、米国でのインフレ・ピークアウト観測などをを受けて一時0.1%台半ばまで低下しました。しかしその後は、米国の金融引き締めに対する警戒感から米国の長期金利が11月上旬まで上昇基調で推移したことに加え、日銀が金融政策を一部修正するのではないかとのおも感も根強く、当作成期末にかけて長期金利は0.25%付近で推移しました。

◆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△4.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△4.2%となりました。当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差はほとんどなく、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。金利や信用スプレッドの変動に対する感応度を適切にコントロールしたことから、目立った超過損益は発生しませんでした。
*ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数です。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

国	内	買 付 額		売 付 額	
		千円	千円	千円	千円
国	国債証券	41,386,966	(16,713,522	—)
	地方債証券	—	(503,611	—)
	特殊債券	—	(604,776	—)
	社債券	100,000	(201,825	—)

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債券（転換社債券）は含まれておりません。

(注4) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	千円	銘 柄	千円
436 2年国債 0.005% 2024/5/1	2,404,306	135 5年国債 0.1% 2023/3/20	1,552,681
143 5年国債 0.1% 2025/3/20	1,807,965	148 5年国債 0.005% 2026/6/20	1,101,587
365 10年国債 0.1% 2031/12/20	1,357,117	134 5年国債 0.1% 2022/12/20	952,223
150 5年国債 0.005% 2026/12/20	1,248,921	136 5年国債 0.1% 2023/6/20	951,833
151 5年国債 0.005% 2027/3/20	1,239,912	137 5年国債 0.1% 2023/9/20	801,920
148 5年国債 0.005% 2026/6/20	1,151,027	330 10年国債 0.8% 2023/9/20	617,936
367 10年国債 0.2% 2032/6/20	1,068,864	421 2年国債 0.1% 2023/2/1	601,220
433 2年国債 0.005% 2024/2/1	1,000,854	431 2年国債 0.005% 2023/12/1	600,729
153 5年国債 0.005% 2027/6/20	1,000,403	358 10年国債 0.1% 2030/3/20	547,167
366 10年国債 0.2% 2032/3/20	996,557	329 10年国債 0.8% 2023/6/20	504,650

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

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

作 成 期	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	う ち B B 格 以 下 組 入 比	残存期間別組入比率		
区 分	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
					%	%	%
国債証券	104,450,000	104,845,798	92.7	—	59.0	22.4	11.3
地方債証券	2,800,000	2,911,753	2.6	—	1.3	1.1	0.2
特殊債券（除く金融債券）	1,900,000	1,917,206	1.7	—	1.0	0.6	0.1
金融債券	100,000	99,774	0.1	—	—	0.1	—
普通社債券	2,800,000	2,780,464	2.5	—	1.0	1.3	0.2
合 計	112,050,000	112,554,997	99.5	—	62.3	25.5	11.8

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

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

区分	当 銘 柄	期		末		償還年月日
		年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	千円	
国債証券	431 2年国債	0.0050	300,000	300,255	千円	2023/12/01
	138 5年国債	0.1000	1,200,000	1,202,328	千円	2023/12/20
	332 10年国債	0.6000	250,000	251,787	千円	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	178,647	千円	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	185,000	188,661	千円	2023/12/20
	433 2年国債	0.0050	1,000,000	1,000,870	千円	2024/02/01
	434 2年国債	0.0050	100,000	100,087	千円	2024/03/01
	139 5年国債	0.1000	950,000	951,966	千円	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	700,000	705,999	千円	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	56,400	千円	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	123,524	千円	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	113,087	千円	2024/03/20
	435 2年国債	0.0050	100,000	100,093	千円	2024/04/01
	436 2年国債	0.0050	2,300,000	2,302,277	千円	2024/05/01
	140 5年国債	0.1000	1,120,000	1,122,520	千円	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	900,000	909,000	千円	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	86,149	千円	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	129,353	千円	2024/06/20
	438 2年国債	0.0050	130,000	130,102	千円	2024/07/01
	439 2年国債	0.0050	650,000	650,487	千円	2024/08/01
	440 2年国債	0.0050	180,000	180,126	千円	2024/09/01
	141 5年国債	0.1000	1,240,000	1,243,013	千円	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	690,000	696,658	千円	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	105,000	109,043	千円	2024/09/20
	142 5年国債	0.1000	1,040,000	1,042,662	千円	2024/12/20
	336 10年国債	0.5000	275,000	277,961	千円	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	400,000	402,668	千円	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	124,988	千円	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	76,184	千円	2024/12/20
	143 5年国債	0.1000	2,500,000	2,506,600	千円	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	580,000	585,533	千円	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	83,890	千円	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	53,245	千円	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	136,022	千円	2025/03/20
	144 5年国債	0.1000	1,180,000	1,183,457	千円	2025/06/20
339 10年国債	0.4000	590,000	596,242	千円	2025/06/20	
78 20年国債	1.9000	61,000	63,980	千円	2025/06/20	
79 20年国債	2.0000	50,000	52,570	千円	2025/06/20	
80 20年国債	2.1000	53,000	55,859	千円	2025/06/20	
145 5年国債	0.1000	1,250,000	1,253,850	千円	2025/09/20	
340 10年国債	0.4000	760,000	768,732	千円	2025/09/20	
82 20年国債	2.1000	87,000	92,146	千円	2025/09/20	
146 5年国債	0.1000	780,000	782,496	千円	2025/12/20	
341 10年国債	0.3000	500,000	504,655	千円	2025/12/20	
83 20年国債	2.1000	93,000	98,975	千円	2025/12/20	
147 5年国債	0.0050	1,200,000	1,200,000	千円	2026/03/20	
342 10年国債	0.1000	880,000	882,754	千円	2026/03/20	
85 20年国債	2.1000	58,000	62,007	千円	2026/03/20	
86 20年国債	2.3000	80,000	86,055	千円	2026/03/20	
87 20年国債	2.2000	55,000	58,981	千円	2026/03/20	
148 5年国債	0.0050	1,050,000	1,049,622	千円	2026/06/20	
343 10年国債	0.1000	780,000	782,347	千円	2026/06/20	
88 20年国債	2.3000	100,000	108,108	千円	2026/06/20	
89 20年国債	2.2000	78,000	84,048	千円	2026/06/20	
149 5年国債	0.0050	950,000	949,097	千円	2026/09/20	
344 10年国債	0.1000	780,000	782,067	千円	2026/09/20	
90 20年国債	2.2000	20,000	21,648	千円	2026/09/20	
150 5年国債	0.0050	1,250,000	1,247,725	千円	2026/12/20	
345 10年国債	0.1000	950,000	951,919	千円	2026/12/20	
92 20年国債	2.1000	310,000	335,695	千円	2026/12/20	
151 5年国債	0.0050	1,240,000	1,236,540	千円	2027/03/20	
346 10年国債	0.1000	780,000	780,998	千円	2027/03/20	
93 20年国債	2.0000	100,000	108,271	千円	2027/03/20	
94 20年国債	2.1000	130,000	141,310	千円	2027/03/20	
153 5年国債	0.0050	850,000	846,719	千円	2027/06/20	
347 10年国債	0.1000	1,100,000	1,100,495	千円	2027/06/20	
95 20年国債	2.3000	50,000	55,020	千円	2027/06/20	
96 20年国債	2.1000	55,000	60,023	千円	2027/06/20	
154 5年国債	0.1000	190,000	189,908	千円	2027/09/20	
348 10年国債	0.1000	1,050,000	1,049,496	千円	2027/09/20	
97 20年国債	2.2000	40,000	44,004	千円	2027/09/20	
98 20年国債	2.1000	320,000	350,505	千円	2027/09/20	
349 10年国債	0.1000	1,550,000	1,548,047	千円	2027/12/20	
99 20年国債	2.1000	100,000	109,942	千円	2027/12/20	
350 10年国債	0.1000	550,000	549,131	千円	2028/03/20	

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率 %	末		償還年月日
			額 面 金 額 千円	評 価 額 千円	
	100 20年国債	2.2000	155,000	171,929	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	350,000	391,912	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	97,237	2028/04/20
	351 10年国債	0.1000	1,000,000	997,790	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	170,000	190,275	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	10,000	11,082	2028/06/20
	11 フィリピン共和国	0.9900	100,000	100,244	2028/08/15
	352 10年国債	0.1000	1,500,000	1,496,115	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	140,214	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	167,785	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	930,000	926,931	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	90,000	100,525	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	300,000	331,485	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	680,000	677,239	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	55,000	60,986	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	260,000	291,543	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	1,580,000	1,571,815	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	200,000	226,302	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	150,000	168,754	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	710,000	705,470	2029/09/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	18,817	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	310,000	349,999	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	940,000	932,489	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	70,000	79,248	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	205,032	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	27,738	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	900,000	891,594	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	200,000	228,526	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	200,000	227,090	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	34,570	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	1,180,000	1,166,878	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	107,479	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	103,836	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	317,000	349,229	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	1,000,000	987,380	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	200,000	225,256	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	200,000	223,724	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	43,454	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	1,070,000	1,055,244	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	200,000	229,022	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	300,000	341,169	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	760,000	748,600	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	130,000	150,425	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	125,496	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	250,000	283,190	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	32,485	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	1,200,000	1,180,968	2031/06/20
	128 20年国債	1.9000	250,000	284,057	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	200,000	225,574	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	1,210,000	1,189,744	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	158,348	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	168,370	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	28,476	2031/11/20
	365 10年国債	0.1000	1,130,000	1,112,033	2031/12/20
	132 20年国債	1.7000	100,000	112,585	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	430,000	487,916	2031/12/20
	366 10年国債	0.2000	900,000	901,233	2032/03/20
	134 20年国債	1.8000	30,000	34,132	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	103,838	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	550,000	615,791	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	65,184	2032/05/20
	367 10年国債	0.2000	960,000	956,860	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	400,000	444,564	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	370,000	414,659	2032/06/20
	368 10年国債	0.2000	220,000	218,946	2032/09/20
	140 20年国債	1.7000	500,000	565,310	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	30,803	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	47,361	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	400,000	452,436	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	190,000	216,752	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	48,234	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	235,624	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	490,000	544,929	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	45,286	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	450,000	509,476	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	70,452	2033/09/20

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率 %	末		
			額 面 金 額 千円	評 価 額 千円	償還年月日
	146 20年国債	1.7000	350,000	396,294	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	87,330	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	400,000	448,664	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	99,138	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	450,000	499,725	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	50,000	61,086	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	532,000	590,413	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	250,000	305,895	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	530,000	581,860	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	130,000	157,717	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	480,000	515,260	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	96,237	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	460,000	493,304	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	68,630	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	680,000	736,841	2035/06/20
	154 20年国債	1.2000	570,000	609,934	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	72,346	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	440,000	459,078	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	170,000	209,392	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	370,000	357,146	2036/03/20
	157 20年国債	0.2000	560,000	524,367	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	113,485	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	350,000	340,116	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	181,167	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	310,000	304,280	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	180,000	219,915	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	460,000	456,145	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	420,000	409,315	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	185,344	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	580,000	563,151	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	480,000	464,294	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	170,000	210,106	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	600,000	569,640	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	300,000	283,629	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	244,208	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	600,000	582,588	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	400,000	375,188	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	265,284	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	420,000	386,034	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	320,000	287,984	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	300,000	356,661	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	420,000	376,080	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	500,000	445,765	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	285,000	343,179	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	200,000	180,704	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	510,000	459,168	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	280,000	323,780	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	600,000	538,272	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	400,000	364,124	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	270,000	321,108	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	580,000	526,187	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	530,000	470,300	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	250,000	289,107	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	420,000	378,672	2041/09/20
	179 20年国債	0.5000	380,000	341,665	2041/12/20
	36 30年国債	2.0000	350,000	404,652	2042/03/20
	180 20年国債	0.8000	490,000	464,745	2042/03/20
	181 20年国債	0.9000	500,000	482,355	2042/06/20
	37 30年国債	1.9000	450,000	511,866	2042/09/20
	182 20年国債	1.1000	140,000	139,433	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	300,000	335,400	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	230,000	261,059	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	150,000	167,349	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	210,000	230,160	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	205,000	224,481	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	260,000	284,450	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	300,000	327,903	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	250,000	263,307	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	210,000	220,886	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	370,000	395,914	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	280,000	288,218	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	220,000	226,107	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	310,000	280,773	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	340,000	272,550	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	385,000	322,849	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	250,000	213,820	2046/12/20

区 分	当 期		末		償還年月日
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	
	54 30年国債	0.8000 %	千円 310,000	千円 277,028	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	260,000	231,496	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	340,000	301,607	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	330,000	291,654	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	85,554	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	400,000	352,200	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	300,000	256,854	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	410,000	366,966	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	169,710	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	129,148	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	430,000	344,679	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	300,000	232,914	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	220,000	170,156	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	200,000	154,980	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	176,842	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	200,000	154,694	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	300,000	242,403	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	290,000	233,519	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	350,000	289,009	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	180,000	210,465	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	300,000	246,684	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	260,000	213,096	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	320,000	261,667	2051/09/20
	73 30年国債	0.7000	363,000	296,440	2051/12/20
	5 40年国債	2.0000	185,000	207,629	2052/03/20
	74 30年国債	1.0000	320,000	283,395	2052/03/20
	75 30年国債	1.3000	330,000	315,839	2052/06/20
	76 30年国債	1.4000	40,000	39,095	2052/09/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	114,945	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	126,557	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	222,812	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	155,551	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	275,000	228,822	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	255,900	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	380,000	270,358	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	360,000	254,142	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	430,000	324,237	2061/03/20
	15 40年国債	1.0000	850,000	699,924	2062/03/20
種別小計	銘柄数	265銘柄			
	金額		104,450,000	104,845,798	
地方債証券	131 共同発行地方	0.6600	100,000	100,740	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	100,820	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	100,742	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	202,041	2025/04/16
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	104,612	2025/11/21
	27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	101,064	2025/11/27
	751 東京都公債	0.3700	100,000	100,760	2025/12/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,710	2026/06/19
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	99,971	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,051	2027/03/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	199,324	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	99,928	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	99,989	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	111,451	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	110,254	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	112,696	2029/06/20
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	112,369	2029/12/14
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	112,943	2030/05/24
	2-2 岡山県公債	0.1200	100,000	97,535	2031/01/29
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	97,322	2031/06/30
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	112,341	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	109,591	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	109,576	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	102,339	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	114,919	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	98,654	2045/12/20
種別小計	銘柄数	26銘柄			
	金額		2,800,000	2,911,753	

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	
特殊債券 (除く金融債券)	65 地方公共団体		0.5350	100,000	100,669	2024/10/28
	236 政保道路機構		0.3200	100,000	100,575	2025/01/31
	71 地方公共団体		0.4650	100,000	100,630	2025/04/28
	261 政保道路機構		0.3810	200,000	201,865	2025/11/28
	127 都市再生		0.0750	100,000	99,315	2026/09/18
	80 住宅支援機構		1.5890	100,000	105,060	2026/09/18
	F143地方公共団体		1.3510	100,000	104,811	2027/08/25
	1 地方公共団15年		1.3340	100,000	105,046	2028/01/28
	86 政保道路機構		2.0000	100,000	111,428	2029/07/31
	47日本政策投資 CO		1.0270	100,000	103,878	2029/09/20
	123 住宅支援機構		1.8010	100,000	111,494	2032/09/17
	31 地方公共団20		1.7440	100,000	110,146	2033/09/28
	223 政保道路機構		1.4270	100,000	108,959	2034/07/31
	284 政保道路機構		0.1490	200,000	183,621	2036/07/31
	298 政保道路機構		0.5470	100,000	96,276	2036/12/26
	247 道路機構		0.3420	200,000	173,425	2040/03/19
	種別小計	銘柄数	16銘柄			
金額				1,900,000	1,917,206	
金融債券	19 利付商工債		0.1000	100,000	99,774	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄				
	金額			100,000	99,774	
普通社債券	1 三菱 UFJFG 劣後		0.9400	100,000	100,839	2024/06/26
	482 九州電力		0.1700	100,000	99,936	2024/08/23
	5 野村不動産 HD		0.9240	100,000	101,520	2025/05/30
	11日本たばこ産業		0.5990	100,000	101,044	2025/07/15
	63 中日本高速道		0.5760	100,000	100,946	2025/11/13
	4 ファーストリテイリング		0.7490	100,000	101,329	2025/12/18
	14 セブンアンドアイ		0.1900	100,000	99,661	2025/12/19
	16 NTT ファイナンス		0.1800	100,000	99,570	2025/12/19
	1 日生2021基金		0.2800	100,000	99,745	2026/08/03
	20 成田国際空港		0.1050	100,000	99,368	2026/08/21
	17 パナソニック		0.4700	100,000	100,154	2026/09/18
	7 三井住友海上		0.1900	100,000	99,403	2026/11/13
	6 楽天カード		0.6200	100,000	95,907	2026/12/17
	509 関西電力		0.4700	100,000	99,650	2027/05/25
	12 アサヒグループ HD		0.3300	100,000	99,622	2027/06/11
	15 デンソー		0.2450	100,000	99,480	2027/06/18
	78 トヨタファイナンス		0.2650	100,000	99,528	2027/07/23
	11 東京電力パワー		0.7900	100,000	99,077	2028/01/25
	20 ZHD		0.4600	100,000	97,181	2028/07/28
	15 ソフトバンク		0.4100	100,000	97,226	2028/10/12
	41 東海旅客鉄道		2.1660	100,000	110,291	2029/01/29
	13 NTT ファイナンス		1.0900	100,000	103,230	2029/09/20
	7 凸版印刷		1.1040	100,000	103,542	2029/12/12
65 東京瓦斯		0.2250	100,000	97,144	2030/09/10	
18 楽天グループ		1.0500	100,000	86,407	2031/12/02	
332 北海道電力		0.9070	100,000	96,030	2036/04/25	
23 森ビル		0.9700	100,000	93,675	2038/05/17	
107東日本旅客鉄		1.4150	100,000	98,947	2045/01/27	
種別小計	銘柄数	28銘柄				
	金額			2,800,000	2,780,464	
合 計	銘柄数	336銘柄				
	金額			112,050,000	112,554,997	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	112,554,997 ^{千円}	99.5 [%]
コール・ローン等、その他	620,840	0.5
投資信託財産総額	113,175,837	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	113,175,837,692円
コール・ローン等	298,172,503
公社債 (評価額)	112,554,997,510
未収入金	100,751,000
未収利息	218,481,441
前払費用	3,435,238
(B) 負債	99,099,215
未払解約金	99,099,215
(C) 純資産総額 (A - B)	113,076,738,477
元本	83,142,525,531
次期繰越損益金	29,934,212,946
(D) 受益権総口数	83,142,525,531口
1万口当り基準価額 (C/D)	13,600円

* 期首における元本額は66,960,247,306円、当作成期間中における追加設定元本額は28,030,628,143円、同解約元本額は11,848,349,918円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワ国内重視バランスファンド30V A (一般投資家私募)	52,917,204円
ダイワ国内重視バランスファンド50V A (一般投資家私募)	281,234,952円
ダイワ国際分散バランスファンド30V A (一般投資家私募)	46,312,087円
ダイワ国際分散バランスファンド50V A (一般投資家私募)	572,435,304円
DCダイワ日本債券インデックス	10,377,310,449円
ダイワ国内債券インデックス (ラップ専用)	1,548,164,674円
ダイワ・バランスファンド35V A	8,977,064,441円
ダイワ・バランスファンド25V A (適格機関投資家専用)	1,543,317,679円
ダイワ国内バランスファンド25V A (適格機関投資家専用)	189,833,127円
ダイワ国内バランスファンド30V A (適格機関投資家専用)	241,971,948円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	63,243,630円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	26,333,485,063円
ダイワ日本債券インデックス (ダイワ SMA 専用)	22,413,934,040円
ダイワファンドラップオンライン 日本債券インデックス	2,111,247,399円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	872,287,058円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,396,124,679円
ダイワライフスタイル25	432,831,898円
ダイワライフスタイル50	548,823,097円
ダイワライフスタイル75	139,986,802円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,600円です。

■損益の状況

当期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	728,453,261円
受取利息	728,645,254
支払利息	△ 191,993
(B) 有価証券売買損益	△ 5,199,368,690
売買益	7,833,710
売買損	△ 5,207,202,400
(C) 当期損益金 (A + B)	△ 4,470,915,429
(D) 前期繰越損益金	28,119,363,665
(E) 解約差損益金	△ 4,563,391,416
(F) 追加信託差損益金	10,849,156,126
(G) 合計 (C + D + E + F)	29,934,212,946
次期繰越損益金 (G)	29,934,212,946

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

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

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)

運用報告書(全体版)

第7期

(決算日 2023年6月15日)

(作成対象期間 2022年6月16日～2023年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）		
運用方針	投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの受益証券	
	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	外国の公社債	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の10%以下	
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、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、外国の公社債に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をあげることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2734>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
3 期末 (2019年 6 月17日)	円 9,905	円 0	% 4.5	10,050	% 5.1	% 97.3	% 1.4	百万円 72,847
4 期末 (2020年 6 月15日)	10,451	0	5.5	10,666	6.1	97.5	—	87,728
5 期末 (2021年 6 月15日)	10,198	0	△ 2.4	10,462	△ 1.9	98.5	—	98,409
6 期末 (2022年 6 月15日)	8,787	0	△ 13.8	9,048	△ 13.5	101.6	0.2	97,518
7 期末 (2023年 6 月15日)	8,378	0	△4.7	8,666	△4.2	98.0	1.6	98,451

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

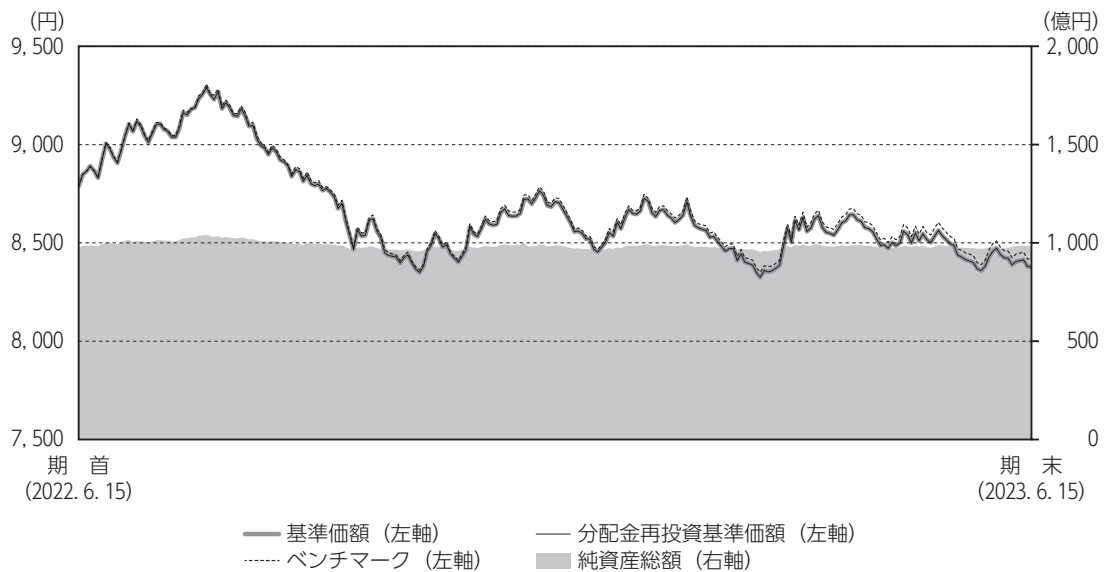
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注7) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

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

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

■基準価額・騰落率

期首：8,787円

期末：8,378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

「外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド」を通じて日本を除く先進国国債に投資した結果、各国の金利が上昇 (債券価格は下落) したため、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
	円	%		%	%	%
(期首)2022年 6月15日	8,787	—	9,048	—	101.6	0.2
6月末	8,975	2.1	9,247	2.2	98.7	2.9
7月末	9,233	5.1	9,524	5.3	95.8	0.6
8月末	8,912	1.4	9,189	1.6	99.6	1.5
9月末	8,535	△ 2.9	8,804	△ 2.7	99.5	1.6
10月末	8,521	△ 3.0	8,787	△ 2.9	100.2	1.6
11月末	8,637	△ 1.7	8,915	△ 1.5	92.1	1.6
12月末	8,476	△ 3.5	8,740	△ 3.4	93.0	1.5
2023年 1月末	8,603	△ 2.1	8,882	△ 1.8	96.9	1.5
2月末	8,395	△ 4.5	8,670	△ 4.2	100.7	1.5
3月末	8,539	△ 2.8	8,821	△ 2.5	96.9	1.5
4月末	8,500	△ 3.3	8,785	△ 2.9	98.1	1.5
5月末	8,425	△ 4.1	8,712	△ 3.7	98.2	1.6
(期末)2023年 6月15日	8,378	△ 4.7	8,666	△ 4.2	98.0	1.6

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■海外債券市況

主要国の国債金利は上昇しました。

主要国の国債金利は、当作成期首より2022年10月にかけて、世界の主要な中央銀行が政策金利見直しを大幅に引き上げたことや、商品市況の高止まりなどから期待インフレ率が上昇したことにより、上昇基調で推移しました。11月には、米国のC P I（消費者物価指数）が予想を下振れたことで長期のインフレ期待が低下したことや、世界的な景気減速懸念が高まったことなどから、金利は低下しました。その後、2023年2月は主要国の経済指標が堅調な結果となり、さらなる金融引き締め観測が織り込まれたことで、金利は上昇に転じて推移しました。3月は欧米の金融不安により低下しましたが、当作成期末にかけては、景気減速懸念や金融不安の後退により上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■当ファンド

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

■外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

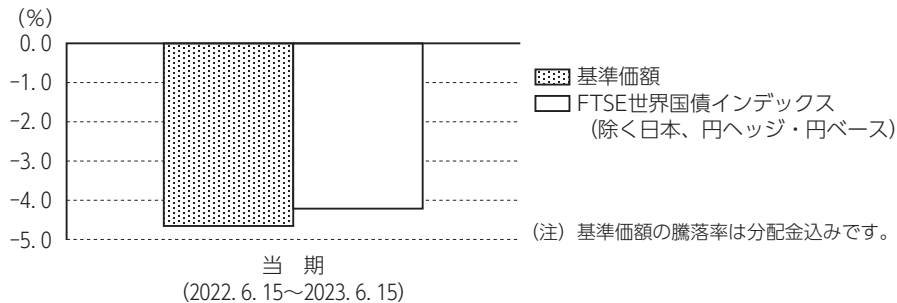
組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△4.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△4.7%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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	
	2022年 6月16日 ~2023年 6月15日	
当期分配金 (税込み) (円)	—	
対基準価額比率 (%)	—	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	858	

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金 (税込み) に合致しない場合があります。
- (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金 (税込み) の期末基準価額 (分配金込み) に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。
- (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2022. 6. 16~2023. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	36円	0.418%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は8,663円です。
（投信会社）	(25)	(0.286)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販売会社）	(10)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0.000	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0.011	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.008)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（その他）	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	37	0.429	

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

（注2）各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

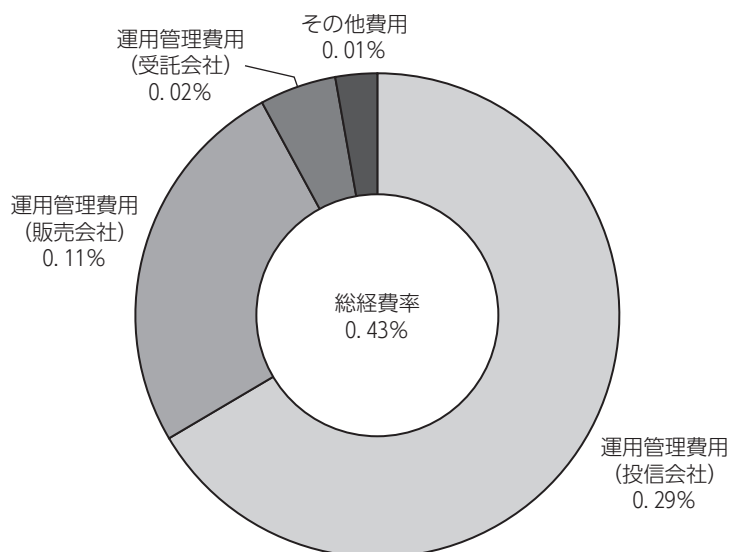
（注3）各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.43%です。



（注1）1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

（注3）各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	16,296,251	14,453,863	10,400,312	9,259,885

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	108,109,338	114,005,277	98,158,543

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	98,158,543	99.4
コール・ローン等、その他	570,911	0.6
投資信託財産総額	98,729,455	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=140.39円、1カナダ・ドル=105.30円、1オーストラリア・ドル=95.37円、1シンガポール・ドル=104.58円、1ニュージーランド・ドル=86.93円、1イギリス・ポンド=177.72円、1イスラエル・シェケル=39.178円、1デンマーク・クローネ=20.42円、1ノルウェー・クローネ=13.16円、1スウェーデン・クローネ=13.09円、1メキシコ・ペソ=8.185円、1オフショア・人民元=19.553円、1マレーシア・リングギット=30.359円、1南アフリカ・ランド=7.66円、1ポーランド・ズロチ=34.16円、1ユーロ=152.15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(122,041,041千円)の投資信託財産総額(124,457,229千円)に対する比率は、98.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	98,729,455,275円
コール・ローン等	570,911,417
外国債券インデックス(為替ヘッジあり) マザーファンド(評価額)	98,158,543,858
(B) 負債	277,629,327
未払解約金	72,544,869
未払信託報酬	203,965,592
その他未払費用	1,118,866
(C) 純資産総額(A-B)	98,451,825,948
元本	117,510,192,351
次期繰越損益金	△ 19,058,366,403
(D) 受益権総口数	117,510,192,351口
1万口当り基準価額(C/D)	8,378円

* 期首における元本額は110,985,788,072円、当作成期間中における追加設定元本額は26,147,697,038円、同解約元本額は19,623,292,759円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は8,378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19,058,366,403円です。

■損益の状況

当期自2022年6月16日至2023年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 162,125円
受取利息	13,358
支払利息	△ 175,483
(B) 有価証券売買損益	△ 4,039,765,518
売買益	376,544,338
売買損	△ 4,416,309,856
(C) 信託報酬等	△ 414,451,243
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 4,454,378,886
(E) 前期繰越損益金	△ 10,914,947,852
(F) 追加信託差損益金	△ 3,689,039,665
(配当等相当額)	(6,846,133,761)
(売買損益相当額)	(△) 10,535,173,426)
(G) 合計(D+E+F)	△ 19,058,366,403
次期繰越損益金(G)	△ 19,058,366,403
追加信託差損益金	△ 3,689,039,665
(配当等相当額)	(6,846,133,761)
(売買損益相当額)	(△) 10,535,173,426)
分配準備積立金	3,244,816,906
繰越損益金	△ 18,614,143,644

(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	6,846,133,761
(d) 分配準備積立金	3,244,816,906
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	10,090,950,667
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	10,090,950,667
(h) 受益権総口数	117,510,192,351口

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

運用報告書 第7期（決算日 2023年6月15日）

（作成対象期間 2022年6月16日～2023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いません。
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

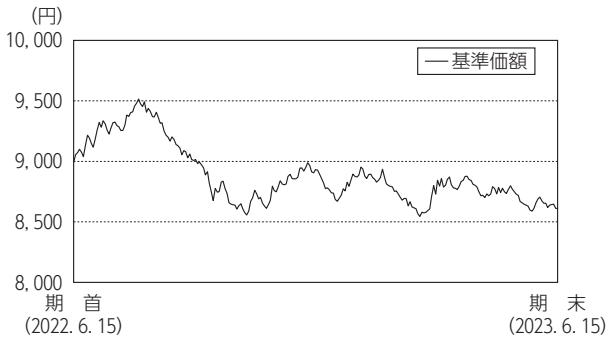
大和アセットマネジメント

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：8,993円 期末：8,610円 騰落率：△4.3%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外債券市況

主要国の国債金利は上昇しました。

主要国の国債金利は、当作成期首より2022年10月にかけて、世界の主要な中央銀行が政策金利見直しを大幅に引き上げたことや、商品市況の高止まりなどから期待インフレ率が上昇したことにより、上昇基調で推移しました。11月には、米国のCPI（消費者物価指数）が予想を下振れたことで長期のインフレ期待が低下したことや、世界的な景気減速懸念が高まったことなどから、金利は低下しました。その後、2023年2月は主要国の経済指標が堅調な結果となり、さらなる金融引き締め観測が織り込まれたことで、金利は上昇に転じて推移しました。3月は欧米の金融不安により低下しましたが、当作成期末にかけては、景気減速懸念や金融不安の後退により上昇しました。

◆前作成期末における【今後の運用方針】

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△4.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△4.3%となりました。当作成期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.1%程度でした。

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

《今後の運用方針》

外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）		公社債比率	債券先物比率
	騰落率	（ベンチマーク）	騰落率	（ベンチマーク）		
	円	%	円	%	%	%
(期首)2022年6月15日	8,993	—	9,048	—	101.9	0.2
6月末	9,188	2.2	9,247	2.2	99.0	2.9
7月末	9,456	5.1	9,524	5.3	96.1	0.6
8月末	9,130	1.5	9,189	1.6	99.8	1.5
9月末	8,746	△2.7	8,804	△2.7	99.8	1.6
10月末	8,734	△2.9	8,787	△2.9	100.5	1.6
11月末	8,857	△1.5	8,915	△1.5	92.4	1.6
12月末	8,694	△3.3	8,740	△3.4	93.3	1.5
2023年1月末	8,828	△1.8	8,882	△1.8	97.2	1.5
2月末	8,617	△4.2	8,670	△4.2	101.0	1.5
3月末	8,768	△2.5	8,821	△2.5	97.2	1.5
4月末	8,731	△2.9	8,785	△2.9	98.4	1.5
5月末	8,657	△3.7	8,712	△3.7	98.5	1.6
(期末)2023年6月15日	8,610	△4.3	8,666	△4.2	98.3	1.6

(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 （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） （その他）	1 (1) (0)
合 計	1

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 公 社 債

(2022年6月16日から2023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 131,454	千アメリカ・ドル 165,012 ()
	カナダ	千カナダ・ドル 10,651	千カナダ・ドル 10,930 ()
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 2,677	千オーストラリア・ドル 3,027 ()
	シンガポール	千シンガポール・ドル 1,982	千シンガポール・ドル 2,518 ()
	ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 2,561	千ニュージーランド・ドル — ()
	イギリス	千イギリス・ポンド 11,949	千イギリス・ポンド 10,433 ()
	イスラエル	千イスラエル・シケル 967	千イスラエル・シケル 1,640 ()
	デンマーク	千デンマーク・クローネ —	千デンマーク・クローネ 1,905 ()
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 1,802	千ノルウェー・クローネ 8,125 ()
	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 4,108 ()
	メキシコ	千メキシコ・ペソ —	千メキシコ・ペソ 6,578 ()
	中国	千オフショア・人民元 246,683	千オフショア・人民元 39,348 ()
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 1,689	千マレーシア・リンギット 1,614 ()
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 206	千ポーランド・ズロチ 5,314 ()

		買付額	売付額	
外	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 336	千ユーロ 947 ()	
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 1,855	千ユーロ 4,078 ()	
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 2,563	千ユーロ 4,515 ()	
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 23,478	千ユーロ 30,529 ()	
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 21,380	千ユーロ 24,176 ()	
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 12,084	千ユーロ 16,015 ()	
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 17,991	千ユーロ 26,193 ()	
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 303	千ユーロ 346 ()	
	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 991	千ユーロ 932 ()	
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 80,985	千ユーロ 107,736 ()	
	国	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 336	千ユーロ 947 ()
		ユーロ (オランダ)	千ユーロ 1,855	千ユーロ 4,078 ()
		ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 2,563	千ユーロ 4,515 ()
		ユーロ (フランス)	千ユーロ 23,478	千ユーロ 30,529 ()
ユーロ (ドイツ)		千ユーロ 21,380	千ユーロ 24,176 ()	
ユーロ (スペイン)		千ユーロ 12,084	千ユーロ 16,015 ()	
ユーロ (イタリア)		千ユーロ 17,991	千ユーロ 26,193 ()	
ユーロ (フィンランド)		千ユーロ 303	千ユーロ 346 ()	
ユーロ (オーストリア)		千ユーロ 991	千ユーロ 932 ()	
ユーロ (ユーロ通貨計)		千ユーロ 80,985	千ユーロ 107,736 ()	

(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

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国 債券先物取引	百万円 12,105	百万円 10,394	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2022年6月16日から2023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
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 3% 2024/6/30	千円 1,295,430	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2023/11/15	千円 3,707,914
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 0.375% 2024/7/15	993,816	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2024/5/15	2,248,984
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2029/8/15	971,562	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2024/2/15	1,958,478
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2028/2/15	881,308	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2023/8/15	1,876,815
GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 5.5% 2031/1/4	747,725	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.375% 2023/9/30	1,619,900
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.5% 2027/1/31	708,023	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2025/11/15	916,485
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2024/6/15	614,995	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 3% 2024/6/30	778,668
SPANISH GOVERNMENT BOND (スペイン) 1.3% 2026/10/31	598,138	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 5.5% 2031/1/4	681,654
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 3.5% 2033/2/15	540,522	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2040/5/15	656,857
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 4.125% 2032/11/15	538,960	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 1.75% 2024/2/15	616,370

(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	区 分	当 期		組入比率	うちBB格 以下組入 比率	残存期間別組入比率			
		額 面 金 額	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 464,457	千アメリカ・ドル 417,161	千円 58,565,315	47.9	—	21.5	17.2	9.3
	カナダ	千カナダ・ドル 26,089	千カナダ・ドル 23,970	2,524,077	2.1	—	1.1	0.5	0.5

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

作成期 区分	当期				期末			
	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
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 22,418	千オーストラリア・ドル 20,096	千円 1,916,635	% 1.6	% —	% 1.0	% 0.4	% 0.1
シンガポール	千シンガポール・ドル 5,592	千シンガポール・ドル 5,399	564,699	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 2,800	千ニュージーランド・ドル 2,519	218,977	0.2	—	0.1	0.1	—
イギリス	千イギリス・ポンド 40,587	千イギリス・ポンド 32,416	5,760,994	4.7	—	3.6	0.8	0.3
イスラエル	千イスラエル・シユケル 10,600	千イスラエル・シユケル 9,870	386,721	0.3	—	0.2	0.1	—
デンマーク	千デンマーク・クローネ 23,870	千デンマーク・クローネ 22,453	458,498	0.4	—	0.2	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 15,080	千ノルウェー・クローネ 13,581	178,726	0.1	—	0.1	0.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 21,170	千スウェーデン・クローネ 19,969	261,394	0.2	—	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 151,990	千メキシコ・ペソ 142,606	1,167,279	1.0	—	0.5	0.3	0.2
中国	千オフショア・人民元 328,800	千オフショア・人民元 338,087	6,610,627	5.4	—	2.4	2.2	0.8
マレーシア	千マレーシア・リンギット 23,280	千マレーシア・リンギット 23,757	721,259	0.6	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 17,085	千ポーランド・ズロチ 14,899	508,979	0.4	—	0.1	0.2	0.1
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 5,548	千ユーロ 4,972	756,577	0.6	—	0.4	0.2	0.1
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 12,780	千ユーロ 12,047	1,833,070	1.5	—	1.0	0.4	0.1
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 16,370	千ユーロ 14,558	2,215,138	1.8	—	1.2	0.4	0.2
ユーロ (フランス)	千ユーロ 72,521	千ユーロ 65,803	10,012,055	8.2	—	4.8	2.2	1.2
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 53,353	千ユーロ 51,574	7,846,991	6.4	—	3.8	2.0	0.6
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 43,304	千ユーロ 40,386	6,144,825	5.0	—	2.9	1.6	0.5
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 63,647	千ユーロ 60,859	9,259,724	7.6	—	4.5	2.1	1.0
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 4,970	千ユーロ 4,242	645,517	0.5	—	0.3	0.2	—
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 11,240	千ユーロ 9,983	1,519,019	1.2	—	0.6	0.4	0.2
ユーロ (小計)	283,733	264,429	40,232,921	32.9	—	19.5	9.6	3.9
合計	—	—	120,077,109	98.3	—	51.1	31.7	15.4

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

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

区分	銘柄	種類	年利率	当期			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	United States Treasury Note/Bond	国債証券	%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	8,950	9,675	1,358,278	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	3,700	3,910	549,046	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	1,400	1,595	223,999	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	630	692	97,241	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	2,000	2,156	302,720	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	300	339	47,630	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	430	411	57,725	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	2,000	2,146	301,408	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,410	1,490	209,191	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,390	1,511	212,222	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	2,270	2,498	350,808	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	600	578	81,199	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	670	586	82,338	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,500	1,231	172,917	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,000	819	115,053	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,000	1,738	244,096	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,083	292,520	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,100	1,031	144,800	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,532	1,461	205,233	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,000	935	131,280	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	2,200	1,977	277,607	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,940	2,534	355,791	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	12,810	12,320	1,729,607	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,107	295,819	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,100	847	118,948	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	15,300	14,572	2,045,766	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	期 末				償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		千円	
					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			
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	370	311	43,690	2045/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	14,820	14,027	1,969,310	2025/08/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	12,800	12,136	1,703,907	2025/11/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,400	1,175	165,075	2045/11/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	12,000	11,160	1,566,752	2026/02/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	300	229	32,280	2046/02/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,865	6,351	891,754	2026/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,070	819	115,000	2046/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	11,750	10,781	1,513,607	2026/08/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	500	363	51,068	2046/08/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	14,850	13,788	1,935,833	2026/11/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,000	820	115,223	2046/11/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,000	4,668	655,445	2027/02/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	900	754	105,985	2047/02/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	5,550	5,191	728,822	2027/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	950	797	111,900	2047/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	14,000	13,000	1,825,185	2027/08/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	12,700	12,270	1,722,600	2024/07/31		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,000	801	112,456	2047/08/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	7,000	6,727	944,472	2024/08/31		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	700	560	78,741	2047/11/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	4,000	3,774	529,893	2028/02/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	15,800	15,202	2,134,226	2025/01/31		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,000	839	117,819	2048/02/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,406	337,838	2025/03/31		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,000	858	120,554	2048/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,300	3,126	438,996	2028/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	8,000	7,564	1,061,909	2028/08/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	800	671	94,289	2048/08/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	7,300	6,979	979,825	2028/11/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	1,850	1,663	233,554	2048/11/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	15,500	14,408	2,022,786	2029/02/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,500	1,261	177,150	2049/02/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	1,644	230,840	2049/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,300	2,104	295,431	2029/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	7,000	6,520	915,393	2026/06/30		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	5,000	4,372	613,848	2029/08/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,100	1,515	212,762	2049/08/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,400	4,750	666,890	2029/11/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,300	964	135,389	2049/11/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,500	3,868	543,107	2030/02/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	6,000	5,456	766,032	2027/01/31		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	1,700	238,736	2050/02/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	3,000	2,408	338,102	2030/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,400	1,894	266,004	2050/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	4,000	2,583	362,683	2040/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,834	257,531	2025/05/31		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,300	5,027	705,796	2030/08/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,700	2,129	298,897	2050/08/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	500	320	44,933	2040/08/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	4,000	3,243	455,408	2030/11/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,800	2,337	328,171	2050/11/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	4,500	3,866	542,873	2027/11/30		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,616	507,717	2025/12/31		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	6,300	5,423	761,340	2028/01/31		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,100	2,688	377,443	2051/02/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	4,900	4,039	567,038	2031/02/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,000	1,800	252,825	2026/01/31		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	1,000	874	122,752	2028/02/29		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,400	1,736	243,837	2041/02/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,000	900	126,489	2026/02/28		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,500	4,829	677,989	2028/03/31		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,600	3,912	549,286	2031/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,629	369,206	2028/04/30		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,400	3,244	455,540	2051/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,600	1,228	172,477	2041/05/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,000	874	122,821	2028/05/31		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,903	267,179	2024/06/15		
United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	1,500	1,309	183,882	2028/06/30		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	8,000	7,592	1,065,885	2024/07/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,700	3,856	541,406	2031/08/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	3,900	2,633	369,658	2051/08/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	5,750	4,023	564,892	2041/08/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	2,400	2,147	301,456	2026/08/31		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	4,500	3,709	520,787	2031/11/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	1,500	979	137,570	2051/11/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	2,000	1,457	204,618	2041/11/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,400	4,626	649,446	2032/02/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	1,500	1,073	150,768	2052/02/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	1,000	775	108,869	2042/02/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	2,500	2,229	313,024	2029/02/28		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	2,000	1,924	270,113	2025/04/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	5,300	4,915	690,077	2032/05/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	2,300	1,889	265,334	2052/05/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	1,000	889	124,927	2042/05/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	4,000	3,908	548,644	2024/06/30		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	2,000	1,833	257,444	2032/08/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	2,000	1,686	236,801	2052/08/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	1,200	1,192	167,467	2029/09/30		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,000	2,998	420,896	2027/09/30		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	4,000	4,092	574,498	2032/11/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,000	3,060	429,593	2052/11/15		
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	4,000	3,898	547,257	2033/02/15		

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	当 期			末		
				額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
				千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円			
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	1,000	971	136,397	2043/02/15		
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	800	762	107,011	2053/02/15		
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.3750	1,000	964	135,442	2033/05/15		
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	800	763	107,143	2053/05/15		
通貨小計	銘柄数 金 額	123銘柄		464,457	417,161	58,565,315			
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	460	404	42,620	2064/12/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	907	1,014	106,819	2029/06/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,050	1,253	132,036	2033/06/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	300	352	37,155	2037/06/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	620	669	70,504	2041/06/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	140	143	15,061	2045/12/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	400	390	41,161	2024/06/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	900	813	85,645	2048/12/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,492	1,431	150,719	2025/06/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,920	1,786	188,157	2026/06/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	930	838	88,250	2027/06/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	557	58,708	2028/06/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,520	1,158	121,973	2051/12/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	300	280	29,495	2029/06/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,200	2,113	222,574	2024/09/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,700	1,468	154,670	2030/06/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	826	87,080	2025/09/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	1,210	127,492	2030/12/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,000	1,730	182,198	2031/06/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,250	885	93,216	2053/12/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,500	1,365	143,827	2027/03/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,000	858	90,376	2031/12/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	500	445	46,864	2032/06/01		
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	2,000	1,970	207,466	2025/02/01		
通貨小計	銘柄数 金 額	24銘柄		26,089	23,970	2,524,077			
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	889	916	87,374	2027/04/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	320	309	29,514	2029/04/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,800	1,773	169,137	2025/04/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	359	374	35,694	2033/04/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,398	2,419	230,707	2026/04/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	725	695	66,356	2037/04/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	800	701	66,933	2035/06/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	684	607	57,938	2039/06/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,300	1,241	118,374	2027/11/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	658	610	58,222	2028/05/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	775	625	59,659	2047/03/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,250	1,181	112,707	2028/11/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,100	1,921	183,219	2030/05/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	510	413	39,440	2041/05/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,800	1,499	142,992	2031/06/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,350	1,873	178,650	2032/05/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	900	529	50,462	2051/06/21		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	1,487	141,881	2032/11/21		
	AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.0000	1,000	916	87,369	2033/11/21		
	通貨小計	銘柄数 金 額	19銘柄		22,418	20,096	1,916,635		
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	203	205	21,463	2027/03/01		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	150	148	15,558	2024/09/01		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	600	594	62,151	2030/09/01		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	239	243	25,502	2042/04/01		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	420	435	45,513	2033/09/01		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	500	495	51,819	2029/07/01		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	400	392	40,999	2025/06/01		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	300	312	32,676	2046/03/01		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	200	193	20,236	2026/06/01		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	660	617	64,536	2036/08/01		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	350	310	32,503	2050/03/01		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	400	360	37,690	2031/07/01		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	170	153	16,057	2051/10/01		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	1,000	937	97,991	2026/11/01		
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄		5,592	5,399	564,699			
ニュージーランド	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,000	997	86,713	2027/04/15		
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	300	275	23,937	2033/04/14		
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	300	241	21,030	2037/04/15		
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	500	461	40,153	2029/04/20		
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	500	401	34,863	2051/05/15		
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	200	141	12,278	2051/05/15		
通貨小計	銘柄数 金 額	6銘柄		2,800	2,519	218,977			
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,350	1,267	225,200	2025/09/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	810	520	92,561	2065/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,775	1,612	286,500	2026/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	650	359	63,828	2047/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	820	580	103,143	2037/09/07		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	900	478	85,108	2057/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	650	569	101,164	2027/07/22		
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	800	692	123,091	2028/10/22		

区分	銘柄	種類	年 利率	期 末			償還年月日
				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	1.6250	517	240	42,716	2071/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	800	461	82,093	2049/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	441	78,413	2054/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	800	645	114,663	2029/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,000	589	104,837	2041/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	400	300	53,394	2030/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	850	248	44,200	2061/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	500	408	72,589	2028/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	370	145	25,807	2050/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,450	930	165,442	2035/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	1,700	1,225	217,755	2031/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	500	240	42,790	2046/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,200	577	102,552	2051/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.5000	2,000	1,601	284,618	2029/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.8750	500	356	63,422	2033/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	200	100	17,947	2053/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.0000	1,500	1,139	202,560	2032/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	400	145	25,786	2073/10/22
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.1250	1,100	1,070	190,213	2027/01/29
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.2500	400	364	64,714	2033/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	963	1,030	183,150	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	400	398	70,768	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,275	1,274	226,420	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	915	893	158,802	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	550	560	99,671	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	850	812	144,428	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	770	730	129,810	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	300	295	52,516	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	911	900	159,951	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	907	930	165,322	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	543	514	91,459	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,130	1,086	193,128	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	600	603	107,213	2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	527	486	86,394	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,000	959	170,600	2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	700	609	108,275	2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	875	718	127,632	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	838	696	123,791	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,000	972	172,905	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	740	628	111,629	2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金額	48銘柄		40,587	32,416	5,760,994	
イスラエル				千イスラエル・シェケル	千イスラエル・シェケル		
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,200	1,432	56,137	2042/01/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	500	474	18,582	2025/08/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	4,000	3,736	146,389	2027/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	1,200	1,136	44,541	2047/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,000	925	36,274	2028/09/28
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	1,700	1,421	55,701	2030/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,000	742	29,094	2037/05/31
通貨小計	銘柄数 金額	7銘柄		10,600	9,870	386,721	
デンマーク				千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	5,740	6,996	142,877	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,830	2,749	56,141	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,200	2,911	59,446	2027/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,700	4,106	83,863	2029/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	1,218	24,884	2052/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,602	32,723	2031/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,867	58,562	2024/11/15
通貨小計	銘柄数 金額	7銘柄		23,870	22,453	458,498	
ノルウェー				千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	150	144	1,906	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,430	1,351	17,786	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,000	2,812	37,006	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,000	1,861	24,491	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,000	1,802	23,721	2029/09/06
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	2,500	2,158	28,401	2030/08/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,000	1,671	21,996	2031/09/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1250	2,000	1,779	23,415	2032/05/18
通貨小計	銘柄数 金額	8銘柄		15,080	13,581	178,726	
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		
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,520	2,817	36,887	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,820	3,775	49,416	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,780	4,506	58,989	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,550	2,338	30,617	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	500	492	6,450	2032/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,000	2,697	35,316	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	4,000	3,339	43,716	2031/05/12
通貨小計	銘柄数 金額	7銘柄		21,170	19,969	261,394	
メキシコ				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	24,200	22,028	180,310	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	11,450	10,301	84,320	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,900	26,984	220,872	2024/09/05
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,340	6,285	51,446	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	20,800	19,669	160,997	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	2,750	2,999	24,548	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,500	6,392	52,320	2029/05/31

外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	期 末			償 還 年 月 日
				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	8.5000	5,000	4,786	39,177	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,700	21,293	174,297	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	14,050	12,373	101,278	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,300	9,493	77,708	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金 額	11銘柄		151,990	142,606	1,167,279	
中国				千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		
	China Government Bond	国債証券	3.2200	3,000	3,076	60,163	2025/12/06
	China Government Bond	国債証券	3.2500	6,500	6,784	132,657	2028/11/22
	China Government Bond	国債証券	3.2900	11,000	11,487	224,615	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3.2500	15,000	15,456	302,228	2026/06/06
	China Government Bond	国債証券	3.1200	3,000	3,081	60,255	2026/12/05
	China Government Bond	国債証券	3.1300	5,300	5,484	107,235	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2.9400	14,000	14,174	277,144	2024/10/17
	China Government Bond	国債証券	2.8500	8,000	8,140	159,170	2027/06/04
	China Government Bond	国債証券	2.6800	6,000	6,028	117,874	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	1.9900	12,000	11,969	234,040	2025/04/09
	China Government Bond	国債証券	3.0200	13,000	13,254	259,166	2025/10/22
	China Government Bond	国債証券	3.2800	14,000	14,546	284,437	2027/12/03
	China Government Bond	国債証券	3.2700	6,000	6,303	123,242	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3.8100	7,000	7,937	155,192	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	3.0100	8,000	8,216	160,649	2028/05/13
	China Government Bond	国債証券	3.7200	1,600	1,785	34,918	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.0200	8,800	9,027	176,512	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	5,000	5,058	98,899	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	7,000	7,136	139,546	2026/05/05
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7400	13,000	13,169	257,511	2026/08/04
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5900	6,500	6,853	134,007	2027/08/03
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	6,000	6,398	125,100	2028/05/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0800	4,400	5,162	100,950	2048/10/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8600	6,000	6,819	133,335	2049/07/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7700	15,000	15,497	303,026	2025/03/08
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	4,800	5,050	98,762	2050/03/16
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	3,500	3,572	69,847	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	3,300	3,571	69,839	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	5,300	5,385	105,308	2031/11/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,800	1,809	35,375	2032/02/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	4,000	4,058	79,351	2029/03/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	5,000	5,223	102,142	2052/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	9,000	9,047	176,906	2032/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,000	3,028	59,221	2029/06/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	12,000	12,038	235,391	2027/07/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	7,000	7,000	136,880	2032/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	15,000	14,994	293,189	2025/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	2,000	1,984	38,810	2032/09/01
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,000	3,004	58,753	2029/09/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	4,000	4,003	78,274	2027/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	2,000	2,033	39,757	2052/10/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	6,000	6,061	118,518	2032/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	3,000	3,032	59,291	2029/12/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2900	10,000	10,033	196,186	2024/12/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8800	4,000	4,077	79,730	2033/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	8,000	8,106	158,509	2030/03/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	3,000	3,101	60,639	2053/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	5,000	5,014	98,057	2033/05/25
通貨小計	銘柄数 金 額	48銘柄		328,800	338,087	6,610,627	
マレーシア				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,760	1,849	56,148	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,000	1,029	31,269	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	1,950	1,969	59,797	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,400	1,403	42,595	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,500	1,506	45,732	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,150	1,162	35,286	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	500	513	15,587	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	1,420	1,532	46,534	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	2,700	2,723	82,691	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	500	506	15,366	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,000	1,074	32,624	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	1,600	1,756	53,340	2038/06/08
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	1,500	1,519	46,139	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,200	1,213	36,837	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,286	39,060	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,335	40,558	2040/05/22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	1,400	1,373	41,688	2050/06/15
通貨小計	銘柄数 金 額	17銘柄		23,280	23,757	721,259	
ポーランド				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,640	2,394	81,801	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,815	1,599	54,638	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	2,300	1,936	66,136	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	2,000	1,903	65,016	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	1,800	1,315	44,948	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	900	749	25,612	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,000	716	24,462	2032/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	600	597	20,408	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	1,800	1,571	53,689	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	2,230	2,115	72,266	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	10銘柄		17,085	14,899	508,979	

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	
ユーロ（アイルランド）	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	688	716	109,000	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	680	666	101,383	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	510	405	61,689	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	520	493	75,091	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	731	111,365	2028/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	150	129	19,704	2033/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	1,100	996	151,686	2031/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	300	273	41,548	2029/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	400	272	41,432	2050/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	—	200	159	24,254	2031/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	200	127	19,420	2041/04/22
国小計	銘柄数 金額	11銘柄		5,548	4,972	756,577	
ユーロ（オランダ）	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	580	647	98,518	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,400	1,570	238,905	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,180	1,324	201,456	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	390	381	58,101	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	910	898	136,671	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	980	967	147,207	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,670	1,556	236,807	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	970	896	136,357	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	900	817	124,380	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	605	92,110	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	171	26,156	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	750	621	94,617	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	185	28,180	2052/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	564	85,961	2031/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	258	39,296	2029/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	300	246	37,562	2032/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	400	333	50,776	2054/01/15
国小計	銘柄数 金額	17銘柄		12,780	12,047	1,833,070	
ユーロ（ベルギー）	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,300	1,121	170,580	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	460	380	57,923	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	595	562	85,592	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,000	693	105,573	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	470	335	50,979	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	730	673	102,513	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	500	482	73,382	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	310	234	35,722	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	400	316	48,209	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	880	798	121,512	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	500	426	64,898	2033/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	100	89	13,624	2029/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	350	240	36,629	2050/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	900	743	113,108	2030/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	600	366	55,820	2040/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	300	265	40,408	2027/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	400	312	47,604	2031/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	270	104	15,876	2071/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	700	553	84,166	2032/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	400	245	37,338	2053/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,000	1,119	170,306	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	750	878	133,653	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	965	1,066	162,303	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	700	728	110,869	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	300	322	49,035	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	390	406	61,773	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	800	793	120,793	2024/06/22
Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	300	295	44,937	2034/06/22	
国小計	銘柄数 金額	28銘柄		16,370	14,558	2,215,138	
ユーロ（フランス）	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,715	1,829	278,399	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,600	3,192	485,689	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,210	1,402	213,362	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,232	1,369	208,317	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,265	1,376	209,459	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,143	2,478	377,166	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,000	1,122	170,811	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,500	2,536	385,996	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,410	2,401	365,379	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,340	1,313	199,907	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,186	1,163	177,021	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,000	1,960	298,259	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,400	5,138	781,811	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	800	726	110,473	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,400	3,169	482,267	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,150	1,711	260,474	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	800	522	79,444	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,070	1,892	288,006	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	500	407	61,957	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,304	198,446	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	800	615	93,603	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,000	2,716	413,260	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	1,499	228,204	2034/05/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,750	2,466	375,336	2028/11/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,150	1,445	219,885	2050/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,400	3,852	586,139	2029/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,839	432,093	2025/03/25	

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	当 期 末			償 還 年 月 日
				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	—	2,400	2,008	305,518	2029/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,100	575	87,603	2052/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	637	96,988	2040/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,435	370,600	2030/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	200	73	11,189	2072/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,100	633	96,340	2044/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,600	2,048	311,614	2031/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	450	68,515	2027/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,000	509	77,584	2053/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	600	464	70,690	2032/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,000	761	115,901	2038/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,500	1,363	207,524	2028/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,500	1,385	210,806	2032/11/25
国 小 計	銘柄数 金 額	40銘柄		72,521	65,803	10,012,055	
ユーロ（ドイツ）				千ユーロ	千ユーロ		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	455	522	79,571	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	800	907	138,035	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	800	886	134,840	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	2,096	2,577	392,162	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	2,000	2,419	368,172	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	3,270	3,977	605,171	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,390	1,612	245,292	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,020	1,232	187,491	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,810	2,328	354,313	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	656	715	108,816	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,098	1,079	164,222	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,475	1,458	221,945	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,000	1,950	296,835	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,141	173,682	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,265	496,850	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,883	1,774	269,981	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,850	3,543	539,079	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,550	1,424	216,798	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,100	2,854	434,346	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	660	504	76,809	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,050	959	145,967	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,000	893	136,019	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,800	1,594	242,539	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	431	65,649	2029/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	818	124,468	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	597	90,894	2030/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	222	33,883	2035/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	583	88,839	2031/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	143	21,895	2036/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	205	31,232	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	1,319	200,760	2031/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,500	2,850	433,762	2032/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	800	669	101,796	2053/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	1,000	979	149,003	2029/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	436	66,340	2052/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,705	259,532	2025/04/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,000	985	149,986	2028/04/13
国 小 計	銘柄数 金 額	37銘柄		53,353	51,574	7,846,991	
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	1,627	247,672	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	3,100	3,011	458,151	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	910	838	127,580	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,400	1,354	206,112	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	300	254	38,731	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,480	1,304	198,531	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	4,500	4,244	645,758	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,100	1,979	301,120	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	820	745	113,476	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,170	1,091	166,027	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,650	1,524	231,917	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,050	845	128,686	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	728	110,873	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,400	1,166	177,473	2035/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	900	769	117,067	2029/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	837	127,363	2030/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	100	51	7,889	2050/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	1,570	238,924	2030/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	950	635	96,753	2040/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	800	627	95,513	2031/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	200	93	14,156	2071/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,734	263,916	2028/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,400	1,119	170,295	2031/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	500	309	47,022	2042/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	1,000	802	122,025	2032/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	400	347	52,903	2029/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	600	561	85,392	2032/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	600	560	85,210	2043/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1500	1,500	1,467	223,206	2033/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	680	809	123,208	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	900	951	144,699	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	800	909	138,344	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	500	555	84,541	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,000	1,080	164,388	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,700	1,866	283,943	2028/10/31

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	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	790	932	141,830	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,084	1,078	164,112	2024/10/31
国 小 計	銘柄数 金 額	37銘柄		43,304	40,386	6,144,825	
ユーロ（イタリア）				千ユーロ	千ユーロ		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	2,700	3,023	459,953	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,135	1,273	193,791	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,000	1,972	300,134	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	905	760	115,643	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	920	885	134,786	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,500	1,257	191,378	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	900	869	132,260	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,300	989	150,612	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,250	1,004	152,855	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	700	485	73,915	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	200	174	26,487	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,700	1,620	246,537	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	950	818	124,521	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,050	1,937	294,755	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	700	596	90,792	2038/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,500	1,403	213,472	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	900	864	131,590	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,300	1,271	193,530	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	700	647	98,494	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	500	456	69,528	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,100	1,060	161,376	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	1,400	1,344	204,540	2026/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	500	429	65,280	2030/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	250	174	26,576	2050/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	500	366	55,702	2036/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	500	412	62,802	2030/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	600	516	78,649	2030/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	925	140,807	2026/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	700	484	73,694	2041/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,000	805	122,599	2031/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	400	233	35,589	2051/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	200	133	20,281	2037/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,600	1,242	189,053	2031/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	200	121	18,430	2045/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	450	257	39,124	2072/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	300	237	36,149	2031/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,000	780	118,684	2032/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	500	418	63,725	2029/02/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	200	127	19,434	2052/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	500	476	72,495	2029/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	700	621	94,566	2032/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	400	353	53,857	2038/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,200	1,181	179,744	2035/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,500	1,508	229,532	2029/12/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	1,840	2,007	305,434	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	1,488	1,711	260,345	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,300	1,481	225,424	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,650	1,776	270,245	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	1,270	1,240	188,706	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,140	1,225	186,501	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,900	2,972	452,336	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,714	1,846	280,886	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	3,250	3,334	507,383	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,080	2,194	333,919	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,025	1,069	162,734	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,110	2,116	322,047	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,370	1,354	206,015	2030/03/01
国 小 計	銘柄数 金 額	57銘柄		63,647	60,859	9,259,724	
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	190	161	24,524	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	800	763	116,202	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	180	168	25,617	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	270	191	29,127	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	200	181	27,584	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	150	123	18,728	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	443	67,435	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	259	39,488	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	350	237	36,112	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	150	91	13,898	2040/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	200	89	13,575	2052/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	200	158	24,183	2031/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	364	55,450	2026/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	300	263	40,163	2032/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	200	203	30,997	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	120	119	18,192	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	460	422	64,235	2042/07/04
国 小 計	銘柄数 金 額	17銘柄		4,970	4,242	645,517	
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	540	518	78,899	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	490	456	69,490	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	270	193	29,429	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	280	160	24,419	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,000	914	139,124	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	200	140	21,353	2117/09/20

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	544	82,790	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	700	611	93,087	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	450	370	56,315	2030/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	334	50,820	2051/03/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.8500	100	39	5,979	2120/06/30
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,000	796	121,219	2031/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	378	57,555	2025/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	200	135	20,683	2036/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	150	64	9,795	2071/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	200	151	23,113	2049/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	380	428	65,135	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	800	877	133,543	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	700	734	111,717	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	170	191	29,101	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	500	490	74,667	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	630	588	89,476	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	880	862	131,298	2024/10/21
国 小 計	銘柄数 金 額	23銘柄			11,240	9,983 1,519,019	
通 貨 小 計	銘柄数 金 額	267銘柄		283,733	264,429	40,232,921	
合 計	銘柄数 金 額	616銘柄				120,077,109	

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
外 US LONG BOND (CBT) (アメリカ)	35	—
US 10YR NOTE (CBT) (アメリカ)	158	—
US 5YR NOTE (CBT) (アメリカ)	226	—
US 2YR NOTE (CBT) (アメリカ)	1,147	—
国 US ULTRA BOND CBT (アメリカ)	210	—
EURO—SCHATZ FUT (ドイツ)	80	—
EURO—OAT FUTURE (ドイツ)	58	—

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

■投資信託財産の構成

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	120,077,109	96.5
コール・ローン等、その他	4,380,120	3.5
投資信託財産総額	124,457,229	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=140.39円、1カナダ・ドル=105.30円、1オーストラリア・ドル=95.37円、1シンガポール・ドル=104.58円、1ニュージーランド・ドル=86.93円、1イギリス・ポンド=177.72円、1イスラエル・シケル=39.178円、1デンマーク・クローネ=20.42円、1ノルウェー・クローネ=13.16円、1スウェーデン・クローネ=13.09円、1メキシコ・ペソ=8.185円、1オフショア・人民元=19.553円、1マレーシア・リンギット=30.359円、1南アフリカ・ランド=7.66円、1ポーランド・ズロチ=34.16円、1ユーロ=152.15円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産（122,041,041千円）の投資信託財産総額（124,457,229千円）に対する比率は、98.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	246,508,175,183円
コール・ローン等	3,219,980,203
公社債（評価額）	120,077,109,021
未収入金	122,068,233,013
未収利息	820,688,338
前払費用	43,682,720
差入委託証拠金	278,481,888
(B) 負債	124,301,596,463
未払金	124,221,611,410
未払解約金	79,985,053
(C) 純資産総額（A－B）	122,206,578,720
元本	141,933,741,025
次期繰越損益金	△ 19,727,162,305
(D) 受益権総口数	141,933,741,025口
1万口当り基準価額（C/D）	8,610円

* 期首における元本額は133,574,429,591円、当作成期間中における追加設定元本額は30,925,430,263円、同解約元本額は22,566,118,829円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：
 ダイワバランスファンド2023-01（適格機関投資家専用） 2,183,533,217円
 ダイワファンドラップ外国債券インデックス（為替ヘッジあり） 114,005,277,420円
 ダイワファンドラップオンライン外国債券インデックス（為替ヘッジあり） 4,497,197,642円
 ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用） 6,955,905円
 ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用） 3,415,999,261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） 17,824,777,580円
* 当期末の計算口数当りの純資産額は8,610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19,727,162,305円です。

■損益の状況

当期 自 2022年6月16日 至 2023年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,196,777,947円
受取利息	3,192,114,304
その他収益金	5,543,637
支払利息	△ 879,994
(B) 有価証券売買損益	△ 8,644,477,913
売買益	27,186,363,410
売買損	△ 35,830,841,323
(C) 先物取引等損益	△ 64,601,704
取引益	49,611,242
取引損	△ 114,212,946
(D) その他費用	△ 11,544,471
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 5,523,846,141
(F) 前期繰越損益金	△ 13,453,638,368
(G) 解約差損益金	2,578,170,885
(H) 追加信託差損益金	△ 3,327,848,681
(I) 合計 (E + F + G + H)	△ 19,727,162,305
次期繰越損益金 (I)	△ 19,727,162,305

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

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

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)

運用報告書(全体版)

第7期

(決算日 2023年6月15日)

(作成対象期間 2022年6月16日～2023年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型		
信託期間	無期限(設定日:2016年9月26日)		
運用方針	投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行いません。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券	
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の30%以下	
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、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、外国の公社債に投資し、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に連動する投資成果をあげることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2735>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
3 期末 (2019年 6 月17日)	円 10,978	円 0	% 2.5	11,109	% 2.7	% 98.5	% —	百万円 3,676
4 期末 (2020年 6 月15日)	11,579	0	5.5	11,801	6.2	98.3	—	4,949
5 期末 (2021年 6 月15日)	12,187	0	5.3	12,457	5.6	98.7	—	6,651
6 期末 (2022年 6 月15日)	12,025	0	△ 1.3	12,308	△ 1.2	98.4	—	7,620
7 期末 (2023年 6 月15日)	12,526	0	4.2	12,849	4.4	97.6	—	10,267

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

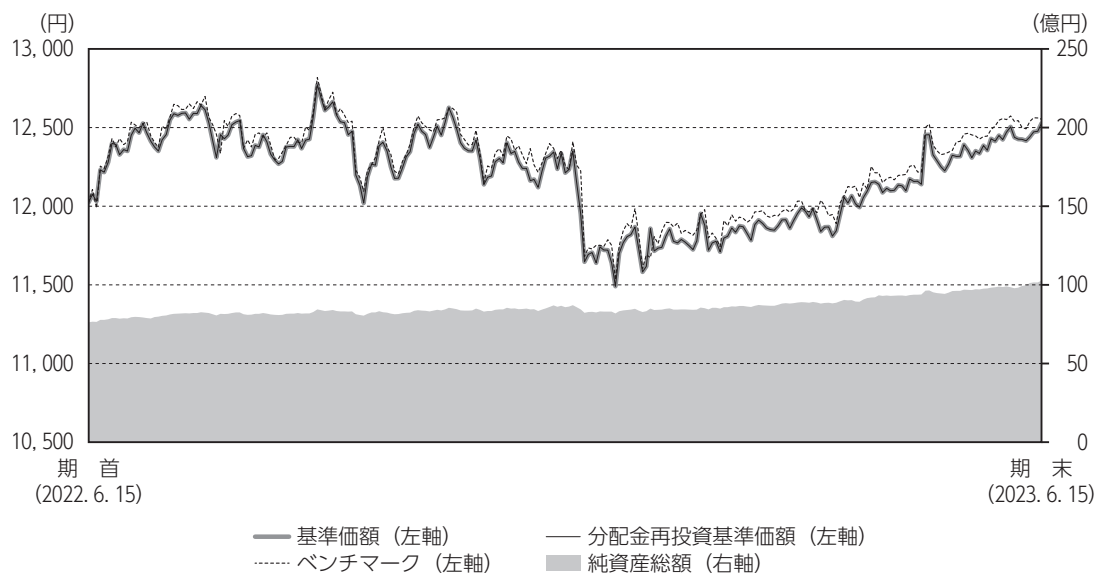
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注7) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：12,025円

期末：12,526円 (分配金 0円)

騰落率：4.2% (分配金込み)

■ 基準価額の変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
	円	%		%	%	%
(期首)2022年 6月15日	12,025	—	12,308	—	98.4	—
6月末	12,452	3.6	12,830	4.2	98.2	—
7月末	12,532	4.2	12,861	4.5	97.9	—
8月末	12,379	2.9	12,732	3.4	97.5	—
9月末	12,268	2.0	12,554	2.0	97.8	—
10月末	12,626	5.0	12,921	5.0	98.0	—
11月末	12,241	1.8	12,560	2.0	97.8	—
12月末	11,640	△ 3.2	12,028	△ 2.3	97.8	—
2023年 1月末	11,772	△ 2.1	12,125	△ 1.5	97.6	—
2月末	11,911	△ 0.9	12,247	△ 0.5	97.6	—
3月末	12,056	0.3	12,350	0.3	97.4	—
4月末	12,140	1.0	12,504	1.6	97.3	—
5月末	12,449	3.5	12,842	4.3	97.4	—
(期末)2023年 6月15日	12,526	4.2	12,849	4.4	97.6	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■ 海外債券市況

主要国の国債金利は上昇しました。

主要国の国債金利は、当作成期首より2022年10月にかけて、世界の主要な中央銀行が政策金利見通しを大幅に引き上げたことや、商品市況の高止まりなどから期待インフレ率が上昇したことにより、上昇基調で推移しました。11月には、米国のC P I（消費者物価指数）が予想を下振れたことで長期のインフレ期待が低下したことや、世界的な景気減速懸念が高まったことなどから、金利は低下しました。その後、2023年2月は主要国の経済指標が堅調な結果となり、さらなる金融引き締め観測が織り込まれたことで、金利は上昇に転じて推移しました。3月は欧米の金融不安により低下しましたが、当作成期末にかけては、景気減速懸念や金融不安の後退により上昇しました。

■ 為替相場

為替相場は円安となりました。

為替相場は、当作成期首より2022年10月にかけて、世界の主要な中央銀行が政策金利見通しを大幅に引き上げたのに対し、日銀は指値オペを行い長期金利上昇の抑制を図るなど、金融政策の相違が明確となって円安が大きく進行しました。11月に入ると、インフレ率の低下期待などから米国金利が低下したことで日米金利差の縮小が意識され、円高に転じました。12月には、日銀が想定外の政策修正を行ったことで金融緩和政策の転換などが意識され、日本の長期金利が大きく上昇するとともに円高が進行しました。2023年2月は、堅調な米国の経済指標を受けて米国金利が大きく上昇したことで、円安に転じて推移しました。3月は欧米の金融不安により円高に推移しましたが、当作成期末にかけては、日銀の金融緩和政策維持を受けて円安に推移しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れました。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

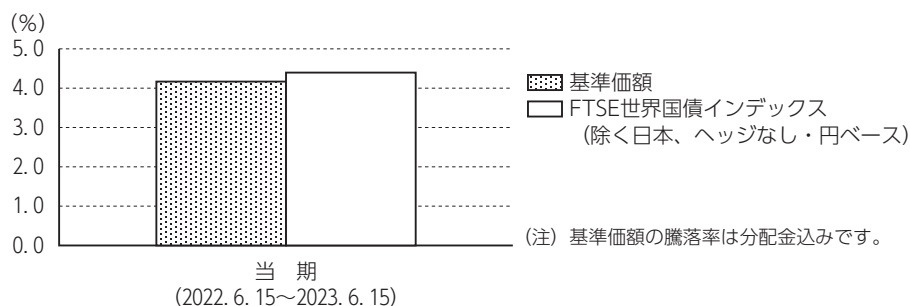
組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックスマザーファンド	FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は4.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.2%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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	
	2022年6月16日 ～2023年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	2,525

- （注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- （注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
- （注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。
- （注4）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



今後の運用方針

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

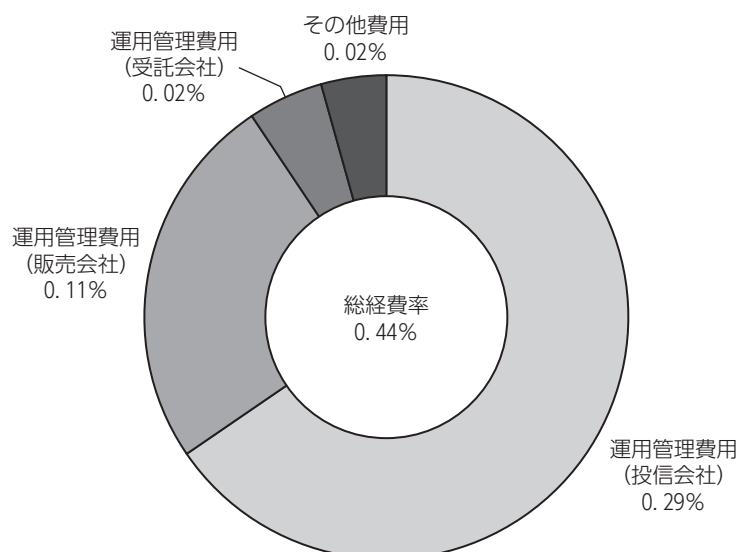
項目	当期 (2022. 6. 16~2023. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	51円	0.418%	信託報酬＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は12,202円です。
(投信会社)	(35)	(0.286)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(13)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当期中の売買委託手数料／当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＝当期中の有価証券取引税／当期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	3	0.022	その他費用＝当期中のその他費用／当期中の平均受益権口数
(保管費用)	(2)	(0.014)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	54	0.440	

- (注1) 当期中の費用(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

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



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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券 インデックス マザーファンド	925,339	2,920,848	219,589	694,132

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	2,451,240	3,156,989	10,236,855	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス マザーファンド	10,236,855	99.3
コール・ローン等、その他	72,117	0.7
投資信託財産総額	10,308,972	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=140.39円、1カナダ・ドル=105.30円、1オーストラリア・ドル=95.37円、1シンガポール・ドル=104.58円、1ニュージーランド・ドル=86.93円、1イギリス・ポンド=177.72円、1イスラエル・シェケル=39.178円、1デンマーク・クローネ=20.42円、1ノルウェー・クローネ=13.16円、1スウェーデン・クローネ=13.09円、1メキシコ・ペソ=8.185円、1オフショア・人民元=19.553円、1マレーシア・リンギット=30.359円、1ポーランド・ズロチ=34.16円、1ユーロ=152.15円です。

(注3) 外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(256,068,945千円)の投資信託財産総額(257,290,651千円)に対する比率は、99.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	10,308,972,543円
コール・ローン等	64,178,611
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	10,236,855,024
未収入金	7,938,908
(B) 負債	41,960,586
未払解約金	22,907,366
未払信託報酬	18,684,525
その他未払費用	368,695
(C) 純資産総額(A-B)	10,267,011,957
元本	8,196,839,818
次期繰越損益金	2,070,172,139
(D) 受益権総口数	8,196,839,818口
1万口当り基準価額(C/D)	12,526円

* 期首における元本額は6,337,300,973円、当作成期間中における追加設定元本額は2,866,101,938円、同解約元本額は1,006,563,093円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,526円です。

■損益の状況

当期 自 2022年6月16日 至 2023年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 13,712円
受取利息	943
支払利息	△ 14,655
(B) 有価証券売買損益	395,504,777
売買益	420,210,437
売買損	△ 24,705,660
(C) 信託報酬等	△ 36,643,297
(D) 当期損益金(A+B+C)	358,847,768
(E) 前期繰越損益金	265,385,158
(F) 追加信託差損益金	1,445,939,213
(配当等相当額)	(678,012,694)
(売買損益相当額)	(767,926,519)
(G) 合計(D+E+F)	2,070,172,139
次期繰越損益金(G)	2,070,172,139
追加信託差損益金	1,445,939,213
(配当等相当額)	(678,012,694)
(売買損益相当額)	(767,926,519)
分配準備積立金	624,246,638
繰越損益金	△ 13,712

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

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

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

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	277,543,800
(c) 収益調整金	1,445,939,213
(d) 分配準備積立金	346,702,838
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	2,070,185,851
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	2,070,185,851
(h) 受益権総口数	8,196,839,818口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（2022年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2023年6月15日）現在における外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■外国債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

（2022年6月16日から2023年6月15日まで）

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2.75% 2032/8/15	1,236,422	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2023/11/15	1,011,232
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 3.5% 2033/2/15	1,079,241	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2.25% 2024/5/25	918,364
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 4.125% 2032/11/15	911,362	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.125% 2023/8/15	771,610
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2.875% 2032/5/15	867,558	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4.25% 2023/10/25	728,066
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 3% 2052/8/15	795,757	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2023/6/15	722,087
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2.75% 2029/5/31	781,179	China Government Bond (中国) 2.88% 2023/11/5	708,723
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 3.875% 2029/12/31	687,341	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2024/5/15	683,017
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 3.5% 2030/1/31	658,473	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2024/2/15	682,725
FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2% 2032/11/25	657,549	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2024/5/15	672,052
CHINA GOVERNMENT BOND (中国) 2.6% 2032/9/1	616,899	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2023/8/15	655,479

(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、2023年6月15日現在における外国債券インデックスマザーファンド（79,274,139千円）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下組入率	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
									千円
アメリカ	千アメリカ・ドル 995,474	千アメリカ・ドル 891,230	千円 125,119,850	48.7	—	21.4	17.8	9.4	
カナダ	千カナダ・ドル 50,098	千カナダ・ドル 45,594	4,801,115	1.9	—	1.1	0.5	0.3	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 45,961	千オーストラリア・ドル 41,292	3,938,061	1.5	—	1.0	0.3	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 10,259	千シンガポール・ドル 10,034	1,049,446	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 6,530	千ニュージーランド・ドル 5,729	498,062	0.2	—	0.1	0.0	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 84,230	千イギリス・ポンド 66,940	11,896,631	4.6	—	3.4	0.9	0.4	
イスラエル	千イスラエル・シケル 18,800	千イスラエル・シケル 17,589	689,119	0.3	—	0.1	0.1	0.0	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 38,365	千デンマーク・クローネ 37,774	771,362	0.3	—	0.2	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 33,035	千ノルウェー・クローネ 30,222	397,734	0.2	—	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 40,180	千スウェーデン・クローネ 38,059	498,203	0.2	—	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 285,702	千メキシコ・ペソ 268,715	2,199,516	0.9	—	0.5	0.2	0.2	
中国	千オフショア・人民元 659,500	千オフショア・人民元 674,064	13,179,977	5.1	—	2.4	1.9	0.9	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 43,353	千マレーシア・リンギット 44,217	1,342,405	0.5	—	0.3	0.1	0.1	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 39,855	千ポーランド・ズロチ 35,386	1,208,821	0.5	—	0.2	0.2	0.1	
ユ ロ	アイルランド	千ユーロ 11,546	千ユーロ 10,112	1,538,568	0.6	—	0.4	0.1	0.1
	オランダ	千ユーロ 28,663	千ユーロ 26,311	4,003,220	1.6	—	1.0	0.5	0.1
	ベルギー	千ユーロ 34,348	千ユーロ 31,153	4,740,031	1.8	—	1.2	0.5	0.1
	フランス	千ユーロ 152,478	千ユーロ 137,677	20,947,640	8.1	—	4.9	2.4	0.8
	ドイツ	千ユーロ 117,367	千ユーロ 109,130	16,604,245	6.5	—	3.7	1.9	0.9
	スペイン	千ユーロ 89,850	千ユーロ 83,108	12,644,939	4.9	—	3.0	1.4	0.5
	イタリア	千ユーロ 135,577	千ユーロ 126,041	19,177,256	7.5	—	4.3	2.2	1.0
	フィンランド	千ユーロ 9,877	千ユーロ 8,370	1,273,636	0.5	—	0.3	0.2	0.0
	オーストリア	千ユーロ 23,170	千ユーロ 20,511	3,120,805	1.2	—	0.7	0.4	0.1
	小計	602,876	552,417	84,050,344	32.7	—	19.5	9.6	3.6
合 計	—	—	251,640,652	97.9	—	50.7	32.0	15.2	

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。
(注4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

2023年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	888	124,735	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	766	107,599	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	780	109,512	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	813	114,239	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	2,628	369,055	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,267	177,999	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	957	134,476	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	582	81,734	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	557	78,296	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	1,003	140,823	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,169	164,230	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,137	159,746	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,278	179,518	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,098	154,205	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	1,769	248,363	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,080	151,641	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,523	213,816	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,380	193,794	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,432	201,127	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,462	205,300	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,273	178,797	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,420	199,455	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,159	162,722	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,231	4,295	603,021	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	1,335	187,537	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	2,282	320,498	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	1,915	268,884	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	3,013	423,080	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	1,985	278,779	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	3,092	434,143	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	2,990	419,818	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	5,963	837,201	2024/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	1,662	233,442	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	5,694	799,453	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,746	2,314	324,927	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,478	769,091	2025/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	1,974	277,151	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,512	773,914	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,835	1,543	216,683	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,435	763,140	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,873	1,539	216,090	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,537	777,407	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	659	553	77,703	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,866	4,525	635,318	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,148	2,412	338,735	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,729	7,151	1,003,986	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,823	2,161	303,407	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	4,954	695,615	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,780	2,022	283,943	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	4,921	690,903	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,000	820	115,223	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,640	3,398	477,164	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,345	1,967	276,151	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	5,986	840,444	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	1,678	235,580	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,300	3,199	449,133	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,320	325,803	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,478	769,185	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,898	406,913	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,450	1,161	163,062	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,922	269,849	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,500	2,406	337,830	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,089	714,504	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,003	281,218	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,368	472,928	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,069	430,995	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	2,686	377,159	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,350	5,991	841,206	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,501	351,201	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,606	365,990	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,000	2,517	353,458	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	2,791	391,892	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,800	3,263	458,106	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	6,159	864,690	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	1,835	257,653	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,428	481,269	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	2,888	405,472	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	6,334	889,349	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,220	2,703	379,514	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,411	338,550	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,461	485,895	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,415	339,045	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,413	338,813	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,700	3,537	496,623	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,020	2,715	381,262	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	2,886	405,275	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	1,500	1,434	201,355	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	6,135	861,315	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,388	335,328	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	3,953	555,071	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,379	333,987	2026/02/28

2023年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,361	331,530	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	3,822	536,704	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	3,568	500,948	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,650	372,100	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,816	395,356	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,375	473,862	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	2,608	366,157	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,500	5,291	742,927	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,323	326,171	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,110	577,017	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	3,319	466,050	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,556	358,900	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,815	535,717	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,298	322,682	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,864	402,107	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	952	133,722	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	2,753	386,545	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,850	2,507	351,970	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	3,338	468,654	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	1,833	257,346	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,851	400,389	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,299	322,777	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,380	334,247	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,700	1,606	225,493	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,000	4,298	603,452	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	6,500	5,911	829,868	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	3,673	515,671	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	268	37,725	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	4,883	685,554	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,500	2,316	325,234	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,401	196,795	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,800	5,458	766,365	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,489	349,490	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,400	2,087	293,033	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	3,120	438,124	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	3,229	453,354	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,034	425,998	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,751	386,297	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	5,949	835,288	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,026	424,942	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,102	435,531	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	8,000	6,384	896,249	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,289	602,245	2027/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	6,700	3,855	541,247	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	3,200	449,339	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,012	422,908	2027/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,632	510,020	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,415	479,482	2027/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,184	447,024	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	9,800	7,947	1,115,750	2030/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,619	508,155	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,000	3,425	480,875	2027/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,800	4,183	587,254	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,100	3,396	476,855	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,100	4,617	648,192	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,296	603,192	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,287	601,880	2027/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	1,000	904	126,929	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	7,000	6,025	845,933	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,900	3,868	543,150	2051/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	10,700	8,819	1,238,226	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,502	632,063	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,371	613,764	2028/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,700	3,401	477,514	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,000	2,702	379,469	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,512	493,083	2028/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,626	509,149	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	8,700	7,399	1,038,868	2031/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,500	4,064	570,601	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,259	738,412	2028/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	4,719	662,604	2051/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,800	2,917	409,634	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,499	491,286	2028/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,400	3,963	556,450	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,903	267,179	2024/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	4,366	612,942	2028/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	5,000	4,519	634,450	2026/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	5,500	5,219	732,796	2024/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	3,000	2,836	398,182	2024/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	10,300	8,451	1,186,485	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	6,900	4,658	654,011	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	3,700	2,589	363,495	2041/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	6,000	5,360	752,521	2026/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	5,000	4,300	603,677	2028/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	5,000	4,319	606,358	2028/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	5,000	4,473	628,034	2026/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	7,500	7,067	992,234	2024/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	5,000	4,339	609,236	2028/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,500	3,141	441,005	2026/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	2,000	1,884	264,629	2024/10/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	4,500	4,236	594,721	2024/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	10,000	8,243	1,157,304	2031/11/15

外国債券インデックスマザーファンド

2023年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	6,600	4,311	605,312	2051/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	4,000	2,915	409,236	2041/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	6,000	5,235	734,966	2028/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	7,000	6,316	886,756	2026/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,617	507,858	2026/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	5,600	4,912	689,656	2028/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	2,200	2,073	291,036	2024/12/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	4,000	3,479	488,444	2028/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,613	507,273	2026/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	1,000	941	132,220	2025/01/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	10,400	8,909	1,250,786	2032/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	3,700	3,498	491,185	2025/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	4,300	3,813	535,395	2029/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	3,900	2,792	391,997	2052/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	2,500	1,938	272,174	2042/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,000	4,459	626,048	2029/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,000	4,602	646,102	2027/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	5,000	4,741	665,631	2025/03/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	3,000	2,748	385,846	2029/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	5,000	4,705	660,584	2027/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	3,000	2,886	405,169	2025/04/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	9,300	8,625	1,210,890	2032/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,890	405,818	2025/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	5,000	4,108	576,813	2052/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	1,500	1,334	187,391	2042/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	3,000	2,822	396,274	2029/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,846	399,614	2027/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	4,500	4,383	615,342	2024/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	5,605	5,605	786,888	2029/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	2,000	1,887	264,963	2027/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	2,000	1,930	271,034	2025/06/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	4,000	3,840	539,114	2029/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	3,000	2,898	406,921	2027/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	3,000	2,901	407,355	2025/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	4,070	3,854	541,120	2027/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	1,000	977	137,161	2024/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	2,500	2,423	340,273	2025/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	9,500	8,710	1,222,860	2032/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	5,200	4,385	615,683	2052/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.3750	2,000	1,810	254,105	2042/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	3,970	3,873	543,793	2024/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	3,360	3,114	437,195	2029/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	3,890	3,800	533,621	2024/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	2,500	2,402	337,216	2027/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	3,500	3,336	468,388	2029/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	2,300	2,247	315,473	2025/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,500	3,460	485,871	2024/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,485	348,890	2029/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	1,500	1,499	210,448	2027/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,400	3,376	474,032	2025/10/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	1,000	990	139,015	2024/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,000	2,999	421,077	2027/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	6,700	6,854	962,284	2032/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	1,500	1,498	210,414	2025/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,700	3,774	529,831	2052/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,000	3,003	421,725	2029/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	3,000	2,976	417,813	2024/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,486	349,114	2029/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	3,000	2,972	417,244	2027/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	2,500	2,476	347,682	2042/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,500	3,460	485,827	2025/12/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	1,500	1,478	207,560	2026/01/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	5,000	4,975	698,440	2029/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	1,500	1,486	208,639	2027/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,000	2,966	416,423	2024/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	1,000	987	138,566	2025/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	5,000	4,869	683,629	2030/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,500	3,461	485,959	2026/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	8,000	7,796	1,094,514	2033/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	1,500	1,457	204,595	2043/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	4,500	4,287	601,942	2053/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	3,700	3,610	506,810	2028/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	4,500	4,479	628,899	2025/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	1,000	1,003	140,828	2030/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,000	2,992	420,154	2028/02/29
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	2,500	2,514	353,003	2026/03/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	3,000	2,950	414,224	2025/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	1,800	1,767	248,120	2030/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	3,700	3,630	509,719	2028/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.7500	2,000	1,965	275,984	2026/04/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	3,000	2,923	410,375	2030/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	2,000	1,951	274,021	2028/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	1,000	979	137,554	2026/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.3750	3,300	3,183	446,960	2033/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	1,300	1,240	174,108	2053/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	1,500	1,458	204,777	2043/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	4,000	3,935	552,518	2025/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,600	3,569	501,097	2025/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	3,700	3,635	510,389	2028/05/31
通貨小計	銘柄数	272銘柄					
	金額			995,474	891,230	125,119,850	

2023年6月15日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	605	532	56,054	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,099	115,770	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,333	140,461	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,190	125,339	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	913	985	103,823	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	961	981	103,386	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,373	144,580	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,208	127,231	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,108	116,777	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	901	94,960	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,117	117,667	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	650	603	63,600	2028/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,710	2,827	297,712	2051/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,139	119,947	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,345	141,638	2024/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	2,980	313,889	2030/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	700	662	69,728	2025/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,655	279,624	2025/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,000	1,614	169,990	2030/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,100	1,891	199,202	2026/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	300	273	28,813	2026/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,400	2,941	309,737	2031/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,000	949	99,971	2024/10/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,650	1,876	197,619	2053/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,200	2,003	210,947	2027/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,100	1,802	189,791	2031/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	200	189	19,949	2025/04/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,500	1,335	140,592	2032/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	100	92	9,783	2029/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	383	40,425	2027/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	200	195	20,558	2024/08/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,000	970	102,185	2025/10/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	770	713	75,089	2032/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	360	351	36,991	2024/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	200	198	20,864	2028/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	300	295	31,119	2025/02/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	600	582	61,285	2026/04/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	600	566	59,702	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	300	295	31,140	2025/05/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	357	37,595	2055/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,200	1,176	123,904	2028/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	500	490	51,656	2025/08/01	
	通貨小計	銘柄数	42銘柄					
		金額			50,098	45,594	4,801,115	
	オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,989	2,049	195,485	2027/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,354	1,309	124,881	2029/04/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,798	1,771	168,949	2025/04/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.5000	2,258	2,354	224,506	2033/04/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.2500	1,748	1,763	168,172	2026/04/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.7500	1,113	1,068	101,869	2037/04/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,307	1,146	109,352	2035/06/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	792	703	67,086	2039/06/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,672	1,596	152,247	2027/11/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	1,178	1,092	104,233	2028/05/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.0000	1,252	1,010	96,378	2047/03/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,500	1,418	135,248	2028/11/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,900	1,776	169,422	2029/11/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	2,870	2,625	250,399	2030/05/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,390	1,127	107,493	2041/05/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	2,840	2,365	225,610	2031/06/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.2500	2,700	2,152	205,257	2032/05/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	2,400	2,270	216,505	2024/11/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	2,000	1,620	154,585	2030/12/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	1,400	823	78,497	2051/06/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	1,600	1,463	139,592	2025/11/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	2,500	1,973	188,207	2031/11/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	1,200	1,075	102,611	2026/09/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	1,600	1,322	126,117	2032/11/21	
AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)		国債証券	3.0000	1,300	1,190	113,580	2033/11/21	
AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)		国債証券	3.7500	1,200	1,173	111,910	2034/05/21	
AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)		国債証券	3.5000	1,100	1,047	99,856	2034/12/21	
通貨小計		銘柄数	27銘柄					
		金額			45,961	41,292	3,938,061	
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	780	81,623	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	923	915	95,735	2024/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	809	801	83,801	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	408	42,681	2042/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	588	61,551	2033/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	619	64,774	2029/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	513	53,708	2025/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	716	74,937	2046/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	435	45,531	2026/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	750	701	73,336	2036/08/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	539	56,437	2028/05/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	332	34,774	2039/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	540	479	50,148	2050/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	750	701	73,399	2025/11/01	

外国債券インデックスマザーファンド

2023年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	600	540	56,535	2031/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	200	180	18,891	2051/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	200	187	19,598	2026/11/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	240	232	24,351	2032/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	220	260	27,252	2072/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	100	99	10,374	2027/09/01
通貨小計	銘柄数	20銘柄					
	金 額			10,259	10,034	1,049,446	
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	600	598	52,028	2027/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	900	826	71,811	2033/04/14
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	490	395	34,349	2037/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	600	554	48,184	2029/04/20
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	530	425	36,955	2031/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	350	224	19,525	2041/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	400	325	28,331	2028/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	500	443	38,566	2026/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	440	359	31,214	2032/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	380	268	23,329	2051/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	640	613	53,371	2025/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	200	194	16,905	2034/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	500	500	43,488	2030/05/15
通貨小計	銘柄数	13銘柄					
	金 額			6,530	5,729	498,062	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	921	864	153,636	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,282	824	146,499	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,330	236,463	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,760	972	172,827	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,450	1,026	182,388	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,810	963	171,162	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,410	1,234	219,449	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,500	1,298	230,796	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,040	483	85,928	2071/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,210	698	124,166	2049/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	441	78,413	2054/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	1,500	1,209	214,994	2029/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,900	1,751	311,319	2025/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,190	701	124,756	2041/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	1,300	976	173,531	2030/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	1,700	497	88,401	2061/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,331	236,629	2026/01/30
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,600	1,307	232,287	2028/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	431	76,724	2050/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,700	1,091	193,966	2035/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	2,500	1,801	320,229	2031/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	2,000	963	171,162	2046/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	3,500	3,021	537,020	2026/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,800	865	153,828	2051/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.2500	1,100	1,017	180,859	2025/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	2,100	1,295	230,264	2039/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.5000	700	560	99,616	2029/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.8750	2,300	1,641	291,745	2033/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	1,300	656	116,659	2053/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.0000	3,600	2,735	486,145	2032/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	820	297	52,862	2073/10/22
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.1250	2,000	1,946	345,843	2027/01/29
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.7500	1,000	910	161,742	2038/01/29
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.2500	100	91	16,178	2033/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.5000	400	384	68,410	2025/10/22
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.7500	600	516	91,756	2053/10/22
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.0000	300	276	49,221	2063/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,015	180,487	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,240	2,229	396,301	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,470	261,405	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,362	1,330	236,380	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,357	1,383	245,917	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	1,633	290,217	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,366	1,295	230,287	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,213	215,666	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,116	2,090	371,524	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,600	1,640	291,477	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	1,272	226,207	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	1,390	247,135	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,560	1,568	278,754	2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,174	1,082	192,460	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	1,513	269,037	2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	1,350	240,061	2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,866	1,531	272,184	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,386	1,150	204,524	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,092	1,062	188,812	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,524	1,293	229,896	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	57銘柄					
	金 額			84,230	66,940	11,896,631	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	1,800	1,927	75,500	2026/10/30
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,600	1,910	74,849	2042/01/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,181	85,479	2025/08/31

2023年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千イスラエル・シケル	千円	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,681	65,875	2027/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,400	2,273	89,083	2047/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,200	1,111	43,529	2028/09/28
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	2,400	2,007	78,636	2030/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.5000	1,600	1,492	58,487	2025/04/30
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,700	1,262	49,461	2037/05/31
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.5000	200	181	7,122	2026/02/27
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.4000	900	852	33,404	2024/10/31
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	1.3000	300	245	9,602	2032/04/30
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	2.8000	600	461	18,085	2052/11/29
通貨小計	銘柄数	13銘柄					
	金 額			18,800	17,589	689,119	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	13,662	16,653	340,068	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	5,841	119,286	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,100	4,639	94,743	2027/11/31
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	8,590	7,506	153,273	2029/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,500	1,777	36,290	2052/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	400	8,180	2031/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	955	19,520	2024/11/15
通貨小計	銘柄数	7銘柄					
	金 額			38,365	37,774	771,362	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	5,395	5,211	68,582	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,340	4,101	53,982	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,450	4,171	54,892	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,256	42,859	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	3,469	45,663	2029/09/06
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	4,800	4,143	54,531	2030/08/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,500	2,925	38,494	2031/09/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1250	1,700	1,512	19,903	2032/05/18
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,500	1,430	18,824	2033/08/15
通貨小計	銘柄数	9銘柄					
	金 額			33,035	30,222	397,734	
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,655	4,087	53,501	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,595	7,505	98,250	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	6,769	88,607	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,050	4,632	60,634	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,300	3,252	42,575	2032/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	6,400	5,755	75,342	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	5,000	4,174	54,646	2031/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,000	1,882	24,646	2033/11/11
通貨小計	銘柄数	8銘柄					
	金 額			40,180	38,059	498,203	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	37,290	33,943	277,841	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	21,300	19,163	156,858	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	23,800	23,018	188,414	2024/09/05
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	7,000	6,195	50,708	2027/03/04
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	1,000	919	7,529	2025/03/06
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	14,000	12,489	102,231	2053/07/31
	MEXICAN BONOS	国債証券	7.5000	10,000	9,114	74,604	2033/05/26
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	23,919	23,712	194,094	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	27,968	26,447	216,479	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	9,677	79,215	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,544	29,053	237,809	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	18,894	18,086	148,043	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	32,515	30,501	249,660	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	21,654	19,069	156,092	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,944	7,322	59,933	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			285,702	268,715	2,199,516	
中国	China Government Bond	国債証券	3.2200	5,200	5,333	104,282	2025/12/06
	China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,218	102,044	2028/11/22
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,000	5,221	102,097	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,152	100,742	2026/06/06
	China Government Bond	国債証券	3.1200	12,000	12,326	241,022	2026/12/05
	China Government Bond	国債証券	3.1300	8,000	8,278	161,864	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2.8500	13,000	13,228	258,652	2027/06/04
	China Government Bond	国債証券	2.6800	11,500	11,554	225,925	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	3.0200	18,000	18,352	358,845	2025/10/22
	China Government Bond	国債証券	3.2800	9,000	9,351	182,852	2027/12/03
	China Government Bond	国債証券	3.2700	12,500	13,131	256,755	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3.0300	7,000	7,158	139,976	2026/03/11
	China Government Bond	国債証券	3.8100	7,300	8,277	161,843	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	3.0100	7,000	7,189	140,567	2028/05/13
	China Government Bond	国債証券	3.7200	14,000	15,626	305,537	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.0200	15,800	16,208	316,920	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,552	89,009	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7400	5,000	5,065	99,042	2026/08/04
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5700	11,000	11,195	218,905	2024/06/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5900	5,500	5,799	113,390	2027/08/03

外国債券インデックスマザーファンド

2023年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	15,000	15,362	300,386	2024/09/21
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	5,000	5,331	104,250	2028/05/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6100	17,000	17,581	343,772	2025/06/07
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5400	4,500	4,760	93,086	2028/08/16
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0800	4,500	5,280	103,244	2048/10/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8600	6,300	7,160	140,002	2049/07/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7700	11,000	11,364	222,219	2025/03/08
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	12,000	12,627	246,905	2050/03/16
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	5,500	5,613	109,760	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	11,500	12,447	243,381	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	6,000	6,097	119,217	2031/11/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	17,000	16,998	332,367	2027/01/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	7,200	7,236	141,503	2032/02/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2600	10,000	10,021	195,940	2025/02/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	15,000	15,218	297,568	2029/03/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	5,500	5,746	112,357	2052/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	5,000	5,026	98,281	2032/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	4,000	4,038	78,962	2029/06/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,000	4,000	78,217	2032/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	25,000	24,991	488,649	2025/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	32,000	31,758	620,971	2032/09/01
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9900	22,000	21,984	429,869	2024/09/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	9,500	9,515	186,052	2029/09/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	17,200	17,213	336,580	2027/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	14,000	14,233	278,302	2052/10/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	5,500	5,556	108,641	2032/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	18,000	18,031	352,576	2025/11/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	19,000	19,205	375,515	2029/12/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2900	5,000	5,016	98,093	2024/12/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6400	20,000	20,199	394,951	2028/01/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4600	18,000	18,105	354,009	2026/02/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8800	15,000	15,291	298,987	2033/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	23,000	23,098	451,639	2025/03/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	15,000	15,199	297,204	2030/03/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	25,000	25,232	493,361	2028/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	7,000	7,236	141,491	2053/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	7,000	7,016	137,202	2026/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	15,000	15,044	294,171	2033/05/25
通貨小計	銘柄数	58銘柄					
	金額			659,500	674,064	13,179,977	
				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,365	71,800	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,237	37,580	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,552	47,125	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,338	40,649	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	738	22,416	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,430	43,416	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,894	57,501	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	1,300	1,436	43,610	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,065	32,346	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,755	53,297	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,252	38,034	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	1,003	30,476	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,550	1,568	47,625	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,550	1,563	47,471	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,204	36,572	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,950	2,095	63,617	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,211	36,778	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,285	39,014	2033/11/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	2,000	2,196	66,675	2038/06/08
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	658	19,993	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,310	2,335	70,912	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,340	40,705	2048/07/06
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400	400	12,168	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,286	39,060	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,669	50,698	2040/05/22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	2,650	2,599	78,911	2050/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,800	1,655	50,273	2031/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	1,400	1,384	42,020	2032/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	400	431	13,085	2042/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5040	500	521	15,846	2029/04/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4570	700	736	22,359	2053/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5190	1,000	999	30,356	2028/04/20
通貨小計	銘柄数	32銘柄					
	金額			43,353	44,217	1,342,405	
				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,377	3,970	135,622	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	2,793	95,429	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840	4,074	139,173	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,400	3,235	110,528	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	2,000	1,823	62,301	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,193	74,913	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	2,200	1,832	62,607	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	937	32,029	2024/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	1,288	44,032	2032/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	500	464	15,861	2027/05/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	1,000	1,070	36,559	2028/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,319	45,082	2025/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,000	2,017	68,901	2033/10/25

2023年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	823	28,129	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,650	3,186	108,869	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,591	4,355	148,777	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	16銘柄					
	金額			39,855	35,386	1,208,821	
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,031	1,073	163,342	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	961	941	143,278	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	931	740	112,613	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,018	154,948	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	461	70,157	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	731	111,365	2028/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	750	647	98,524	2033/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	750	679	103,422	2031/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	950	864	131,571	2029/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	600	408	62,148	2050/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	350	261	39,714	2035/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	500	452	68,857	2027/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	665	101,202	2030/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	—	800	637	97,019	2031/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	400	255	38,840	2041/04/22
	IRISH TREASURY	国債証券	0.3500	100	80	12,185	2032/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	3.0000	200	193	29,375	2043/10/18
国小計	銘柄数	17銘柄					
	金額			11,546	10,112	1,538,568	
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,139	1,271	193,470	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,755	1,968	299,485	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,729	1,940	295,185	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,468	1,437	218,701	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,929	1,904	289,714	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,494	227,420	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,693	257,671	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,938	1,806	274,809	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,032	309,263	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,226	186,571	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,037	157,904	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	618	94,163	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,160	176,619	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	724	110,288	2027/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,250	578	88,064	2052/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,049	159,642	2031/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	591	90,010	2038/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	774	117,890	2029/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	92	14,127	2026/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	600	493	75,125	2032/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	250	38,082	2054/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	900	880	134,037	2033/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,300	1,281	194,972	2030/01/15
国小計	銘柄数	23銘柄					
	金額			28,663	26,311	4,003,220	
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,699	1,625	247,374	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	1,529	232,776	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	875	133,224	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,463	1,383	210,457	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	863	131,333	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	740	527	80,266	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,100	1,015	154,472	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,012	154,103	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	580	439	66,834	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	600	475	72,314	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,490	1,352	205,742	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	650	554	84,367	2033/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,343	204,366	2029/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	700	481	73,258	2050/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,007	153,324	2030/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	860	525	80,008	2040/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,062	161,634	2027/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	1,600	1,251	190,418	2031/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	530	204	31,164	2071/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	400	316	48,095	2032/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	800	490	74,677	2053/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	367	55,965	2039/04/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	500	494	75,308	2033/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3000	600	567	86,326	2054/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	700	693	105,573	2043/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	1,909	290,542	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,904	2,230	339,300	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	1,773	269,776	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,042	158,543	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	837	127,492	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	643	669	101,846	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,493	227,243	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	735	111,895	2034/06/22
国小計	銘柄数	33銘柄					
	金額			34,348	31,153	4,740,031	

外国債券インデックスマザーファンド

2023年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	3,227	491,053	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	3,793	577,247	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,227	3,961	602,815	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	3,081	468,868	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,764	1,960	298,272	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	2,583	393,087	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,164	3,659	556,862	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,217	1,366	207,877	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,646	3,699	562,937	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	5,899	5,878	894,346	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,088	3,027	460,682	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,087	4,990	759,281	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,899	4,801	730,587	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,322	505,571	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	4,864	740,198	2025/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,120	4,646	707,027	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,387	4,089	622,266	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	4,169	3,319	505,078	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,387	905	137,736	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,050	3,703	563,490	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	2,093	318,462	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,167	481,941	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,550	1,960	298,362	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,400	4,889	743,869	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	3,291	500,783	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	4,440	675,606	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,850	1,915	291,475	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,350	3,808	579,478	2029/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,330	4,098	623,655	2025/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	3,514	534,657	2029/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,770	1,449	220,602	2052/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,773	421,942	2026/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	1,402	213,373	2040/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	3,247	494,134	2030/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,480	544	82,801	2072/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	863	131,373	2044/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,600	3,623	551,317	2031/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,100	2,791	424,795	2027/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,600	1,325	201,719	2053/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,600	2,787	424,142	2032/05/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,992	303,095	2025/02/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,200	914	139,082	2038/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,300	2,091	318,204	2028/02/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	4,800	4,433	674,581	2032/11/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,000	871	132,586	2043/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,100	1,004	152,864	2054/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	200	197	29,992	2026/09/24	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	700	701	106,674	2033/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	600	596	90,773	2029/02/25	
国小計	銘柄数	49銘柄					
	金額			152,478	137,677	20,947,640	
ユーロ (ドイツ)				千ユーロ	千ユーロ		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,341	204,088	2027/07/04
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	2,451	373,040	2028/01/04	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,052	160,122	2028/07/04	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	2,399	365,032	2030/01/04	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,048	3,687	561,094	2031/01/04	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,305	2,803	426,580	2034/07/04	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,271	3,793	577,232	2037/01/04	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	1,600	243,555	2039/07/04	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,739	2,237	340,414	2040/07/04	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,974	2,152	327,444	2042/07/04	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	2,760	419,978	2044/07/04	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	2,649	403,113	2046/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,042	3,942	599,904	2024/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,104	320,217	2025/02/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,049	311,846	2025/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,168	3,927	597,601	2026/02/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,227	338,849	2026/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,200	3,861	587,453	2027/02/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,300	3,038	462,369	2027/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,770	2,118	322,367	2048/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,735	264,131	2028/02/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,100	3,665	557,678	2028/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,700	4,162	633,296	2029/02/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,588	393,898	2029/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,850	1,457	221,709	2050/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,493	227,236	2030/02/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,558	237,185	2035/05/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,792	272,759	2027/11/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,519	231,214	2030/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,014	154,396	2030/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	750	114,221	2031/02/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,007	153,267	2036/05/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,754	266,992	2028/11/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	564	85,888	2050/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,600	2,968	451,710	2031/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	577	87,937	2031/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,800	3,095	470,942	2032/02/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,600	1,281	194,937	2038/05/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	2,700	2,542	386,883	2032/08/15	

2023年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,200	1,003	152,695	2053/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	200	195	29,800	2029/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	100	98	15,016	2033/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	1,700	1,679	255,566	2033/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,017	154,795	2052/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2000	100	97	14,772	2024/06/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	530	512	77,954	2024/09/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,500	1,480	225,228	2024/12/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,500	1,486	226,145	2025/03/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,000	996	151,597	2025/06/12
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,630	248,094	2024/10/18
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,274	346,043	2025/04/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,153	327,712	2025/10/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	93	14,268	2025/10/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,037	310,057	2026/04/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,191	181,247	2026/10/09
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	90	13,796	2027/04/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	3,000	2,849	433,540	2027/10/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	430	409	62,314	2027/10/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	100	98	14,998	2028/04/13
国小計	銘柄数	59銘柄					
	金 額			117,367	109,130	16,604,245	
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	3,040	462,554	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	1,986	302,232	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	1,890	287,687	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,144	326,312	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	2,644	402,361	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	1,656	252,010	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	1,366	207,921	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,630	2,480	377,409	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	1,790	272,442	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,750	1,591	242,176	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	1,911	290,903	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,400	2,217	337,334	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	2,200	1,772	269,628	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,900	2,668	405,958	2028/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,457	221,747	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,250	1,874	285,225	2035/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,222	338,085	2024/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,393	364,208	2029/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,560	2,142	326,049	2030/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,374	361,352	2025/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	725	110,447	2050/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,187	332,890	2027/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,400	2,093	318,565	2030/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,300	870	132,400	2040/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	460	70,122	2026/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	2,200	1,726	262,662	2031/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	290	44,203	2024/05/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	650	302	46,008	2071/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,168	329,895	2028/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	1,900	1,306	198,850	2037/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,518	231,114	2031/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	600	370	56,427	2042/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	804	122,465	2027/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	2,100	1,684	256,254	2032/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9000	600	384	58,536	2052/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	93	14,290	2025/05/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	100	86	13,225	2029/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	1,700	1,590	241,945	2032/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,000	933	142,018	2043/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1500	1,500	1,467	223,206	2033/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	300	296	45,144	2026/05/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.9000	800	806	122,664	2039/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,179	2,594	394,811	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,754	1,853	282,002	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,858	2,111	321,305	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,973	2,192	333,600	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,789	2,871	436,928	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,123	323,024	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	1,943	295,635	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	1,532	233,212	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,086	317,476	2024/10/31
国小計	銘柄数	51銘柄					
	金 額			89,850	83,108	12,644,939	
ユーロ (イタリア)				千ユーロ	千ユーロ		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,242	189,092	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	2,684	408,412	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,789	272,221	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	1,267	192,824	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,394	364,362	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	1,731	263,463	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,891	2,792	424,848	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	1,225	186,528	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,386	2,260	343,999	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	1,867	284,189	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	991	150,915	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	671	102,214	2067/03/01

外国債券インデックスマザーファンド

2023年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,305	198,658	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,439	218,982	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,650	1,421	216,274	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,700	2,551	388,214	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,555	236,738	2024/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,108	168,614	2038/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	1,964	298,861	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,252	190,535	2025/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,550	2,450	372,839	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,516	230,747	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,174	178,697	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,650	1,508	229,444	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	1,832	278,741	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,200	2,160	328,657	2024/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	2,100	2,016	306,811	2026/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	1,250	1,067	162,374	2040/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	1,630	248,066	2030/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,300	1,236	188,105	2025/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,144	326,338	2027/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,550	1,082	164,776	2050/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,098	167,106	2036/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,500	1,452	221,047	2025/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	1,651	251,211	2030/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,100	1,809	275,271	2030/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,200	1,982	301,574	2027/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,573	239,372	2026/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,500	1,037	157,915	2041/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,900	1,530	232,938	2031/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	1,200	701	106,767	2051/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	700	466	70,985	2037/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,629	247,910	2028/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,800	1,397	212,684	2031/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,200	1,332	202,735	2045/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	998	151,974	2026/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	460	262	39,993	2072/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	686	104,499	2028/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,504	228,943	2031/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	960	146,182	2024/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,100	2,783	423,531	2026/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,700	1,326	201,763	2032/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	900	753	114,706	2029/02/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	284	43,356	2024/12/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	800	510	77,738	2052/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1000	300	274	41,809	2027/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	500	476	72,472	2025/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	800	762	115,993	2029/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,600	1,420	216,152	2032/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	300	265	40,393	2038/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6500	200	192	29,340	2027/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	500	492	74,893	2035/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	300	300	45,647	2026/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	2,800	2,894	440,334	2033/05/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	300	301	45,906	2029/12/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4000	1,500	1,489	226,620	2028/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4500	100	100	15,215	2043/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	500	499	76,048	2053/10/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4000	400	399	60,712	2025/03/28
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	500	503	76,641	2026/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	900	909	138,430	2031/10/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7000	1,200	1,192	181,466	2030/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.3500	600	614	93,533	2033/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	3,254	3,550	540,154	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	3,276	498,470	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,057	312,993	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	2,473	376,377	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	2,675	407,131	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	2,197	334,393	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,171	330,361	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	2,415	367,577	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,123	323,164	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	2,542	386,896	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	1,891	287,841	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,207	335,937	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,318	2,290	348,571	2030/03/01
国小計	銘柄数	86銘柄					
	金額			135,577	126,041	19,177,256	
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	364	308	46,983	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	266	40,525	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	758	115,421	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	255	38,836	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	725	110,339	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	470	385	58,681	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	443	67,435	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	432	65,814	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	192	29,254	2024/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	210	31,985	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	243	37,063	2040/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	500	405	61,740	2030/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	178	27,150	2052/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	476	72,551	2031/09/15

2023年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	182	27,725	2026/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	450	271	41,344	2043/04/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	300	263	40,163	2032/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	270	255	38,862	2027/04/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	375	57,145	2038/04/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	300	298	45,429	2033/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	679	103,376	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	387	58,972	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	373	56,834	2042/07/04
国小計	銘柄数	23銘柄					
	金 額			9,877	8,370	1,273,636	
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	1,373	1,318	200,608	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,049	159,686	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	561	85,455	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	137	20,931	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,170	178,079	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	378	57,655	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	1,088	165,581	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,118	170,217	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	800	773	117,631	2024/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	—	980	806	122,641	2030/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	389	59,290	2051/03/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	228	34,841	2040/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.8500	350	137	20,927	2120/06/30
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,200	956	145,463	2031/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	480	453	69,066	2025/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	407	62,051	2036/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	300	128	19,591	2071/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	257	39,148	2028/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,500	1,257	191,314	2032/02/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	227	34,670	2049/05/23
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	291	44,418	2026/07/15
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	300	295	44,917	2033/02/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,000	998	151,971	2029/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	929	141,412	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,373	1,506	229,194	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	917	139,646	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	380	57,861	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	723	709	107,969	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	719	109,501	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	913	139,057	2024/10/21
国小計	銘柄数	30銘柄					
	金 額			23,170	20,511	3,120,805	
通貨小計	銘柄数	371銘柄					
	金 額			602,876	552,417	84,050,344	
合 計	銘柄数	960銘柄					
	金 額					251,640,652	

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
 (注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第23期 (決算日 2022年11月30日)

(作成対象期間 2021年12月1日～2022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

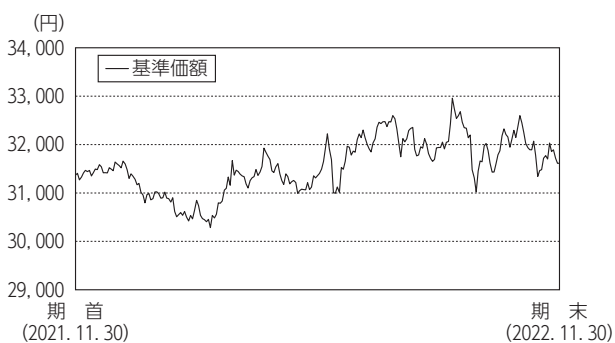
大和アセットマネジメント

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：31,370円 期末：31,615円 騰落率：0.8%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外債券市況

主要国の国債金利は、上昇しました。

当作成期首より2022年2月にかけては、物資の供給制約やインフレは金利上昇圧力となったものの、新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念が高まったことなどから、金利はおおむねレンジ内で推移しました。その後3月から当作成期末にかけては、世界の主要な中央銀行が政策金利見通しを大幅に引き上げたことや、商品市況の高止まりなどから期待インフレ率が上昇したことにより、金利は上昇基調で推移しました。

○為替相場

為替相場は、大きく円安が進みました。

対円為替相場は、当作成期首より2022年2月にかけて、主要国の金利がおおむねレンジ内で推移したこともあり、金利と同様にレンジ内での推移となりました。その後3月から当作成期末にかけては、世界の主要な中央銀行が政策金利見通しを大幅に引き上げたのに対し、日銀は指値オペを行い長期金利上昇の抑制を図るなど、金融政策の相違により明確となって、円安が大きく進行しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は0.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は0.8%となりました。

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

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

《今後の運用方針》

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

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率
	円	騰落率 %	ベンチマーク	騰落率 %		
(期首)2021年11月30日	31,370	—	31,642	—	98.6	—
12月末	31,565	0.6	31,887	0.8	98.7	—
2022年1月末	31,023	△1.1	31,315	△1.0	98.6	—
2月末	30,464	△2.9	30,877	△2.4	98.8	—
3月末	31,472	0.3	31,719	0.2	98.7	—
4月末	31,539	0.5	31,729	0.3	98.6	—
5月末	31,355	△0.0	31,595	△0.1	98.3	—
6月末	32,104	2.3	32,541	2.8	98.5	—
7月末	32,322	3.0	32,621	3.1	98.1	—
8月末	31,939	1.8	32,293	2.1	97.8	—
9月末	31,662	0.9	31,843	0.6	98.1	—
10月末	32,600	3.9	32,773	3.6	98.3	—
(期末)2022年11月30日	31,615	0.8	31,857	0.7	98.1	—

(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)	4 (4)
(その他)	(0)
合 計	4

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況
公 社 債

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

		買付額	売付額
外 国	アメリカ	千アメリカ・ドル 234,334	千アメリカ・ドル 185,257 (—)
	カナダ	千カナダ・ドル 11,048	千カナダ・ドル 10,170 (—)
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 2,053	千オーストラリア・ドル 6,914 (—)
	シンガポール	千シンガポール・ドル 1,039	千シンガポール・ドル 1,259 (—)
	ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 5,293	千ニュージーランド・ドル — (—)
	イギリス	千イギリス・ポンド 8,539	千イギリス・ポンド 10,907 (—)
	イスラエル	千イスラエル・シケル 267	千イスラエル・シケル 6,099 (—)
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 787	千デンマーク・クローネ 7,987 (—)
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 3,665	千ノルウェー・クローネ 8,215 (—)
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 965	千スウェーデン・クローネ 928 (—)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 27,642	千メキシコ・ペソ 18,952 (—)

		買付額	売付額
外 国	中国	千オフショア・人民元 374,773	千オフショア・人民元 12,067 (—)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 4,986	千マレーシア・リンギット 4,345 (—)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 3,486	千ポーランド・ズロチ 7,293 (—)
	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 98	千ユーロ 1,003 (—)
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 2,111	千ユーロ 2,818 (—)
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 2,109	千ユーロ 3,311 (—)
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 15,516	千ユーロ 19,384 (—)
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 20,093	千ユーロ 18,359 (—)
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 7,146	千ユーロ 11,081 (—)
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 13,166	千ユーロ 21,244 (—)
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 944	千ユーロ 1,317 (—)
	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 2,696	千ユーロ 4,329 (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 63,883	千ユーロ 82,850 (—)

(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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄		銘 柄	
	千円		千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2.875% 2032/5/15	1,278,650	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 2023/4/14	790,367
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.875% 2032/2/15	1,244,886	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2022/11/15	777,091
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.375% 2031/11/15	1,022,248	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.125% 2023/8/15	771,610
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2.75% 2032/8/15	980,234	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2023/11/15	756,844
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.125% 2026/10/31	830,790	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2022/11/30	736,251
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2.75% 2029/5/31	781,179	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 4.25% 2023/10/25	728,066
China Government Bond (中国) 2.88% 2023/11/5	735,284	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2023/6/15	722,087
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.875% 2051/11/15	727,265	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2023/8/15	655,479
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.375% 2028/10/31	690,613	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2023/5/15	638,124
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2.875% 2052/5/15	654,171	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 1.75% 2023/5/25	586,499

(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			末				
		評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 比	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
アメリカ	千アメリカ・ドル 973,856	千アメリカ・ドル 864,609	千円 120,068,309	% 49.7	% —	% 21.7	% 17.4	% 10.7	
カナダ	千カナダ・ドル 49,798	千カナダ・ドル 46,591	4,759,828	2.0	—	1.1	0.4	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 42,234	千オーストラリア・ドル 38,584	3,580,216	1.5	—	1.0	0.4	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 10,749	千シンガポール・ドル 10,365	1,047,303	0.4	—	0.3	0.1	0.1	
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 6,030	千ニュージーランド・ドル 5,308	457,242	0.2	—	0.1	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 72,730	千イギリス・ポンド 67,102	11,154,519	4.6	—	3.6	0.7	0.3	
イスラエル	千イスラエル・シェケル 21,700	千イスラエル・シェケル 21,202	855,180	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 43,211	千デンマーク・クローネ 45,111	871,107	0.4	—	0.2	0.1	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 37,630	千ノルウェー・クローネ 34,949	485,804	0.2	—	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 47,205	千スウェーデン・クローネ 46,624	612,648	0.3	—	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 292,735	千メキシコ・ペソ 273,185	1,972,998	0.8	—	0.4	0.3	0.2	
中国	千オフショア・人民元 381,000	千オフショア・人民元 388,062	7,534,316	3.1	—	1.5	1.1	0.5	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 39,353	千マレーシア・リンギット 38,885	1,197,267	0.5	—	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 38,225	千ポーランド・ズロチ 31,959	981,527	0.4	—	0.1	0.2	0.1	
ユ ロ	アイルランド	千ユーロ 11,953	千ユーロ 10,959	千円 1,573,613	% 0.7	% —	% 0.5	% 0.2	% 0.0
	オランダ	千ユーロ 27,863	千ユーロ 26,921	3,865,379	1.6	—	1.0	0.4	0.2
	ベルギー	千ユーロ 32,548	千ユーロ 31,167	4,474,981	1.9	—	1.3	0.4	0.2
	フランス	千ユーロ 150,364	千ユーロ 143,593	20,617,203	8.5	—	5.0	2.6	0.9
	ドイツ	千ユーロ 113,416	千ユーロ 111,332	15,985,058	6.6	—	3.8	1.8	1.0
	スペイン	千ユーロ 87,203	千ユーロ 84,565	12,141,857	5.0	—	3.0	1.5	0.6
	イタリア	千ユーロ 135,077	千ユーロ 128,493	18,449,036	7.6	—	4.3	2.4	0.9
	フィンランド	千ユーロ 9,706	千ユーロ 8,576	1,231,438	0.5	—	0.3	0.2	0.0
	オーストリア	千ユーロ 20,870	千ユーロ 19,419	2,788,191	1.2	—	0.7	0.4	0.1
	小計	589,000	565,028	81,126,760	33.6	—	20.0	9.8	3.9
合 計	—	—	236,705,030	98.1	—	50.6	31.0	16.5	

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	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	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	4,926	684,164	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,106	709,072	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	4,758	660,860	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	900	125,017	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	775	107,639	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	786	109,158	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	822	114,211	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	2,650	368,034	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,274	176,932	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	960	133,423	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	583	81,073	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	560	77,827	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	1,002	139,224	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,173	162,896	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,142	158,658	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,282	178,084	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,103	153,224	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	1,775	246,508	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,080	150,045	2040/08/15

区分	銘柄	種類	年利	期末			償還年月日
				額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円				
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,526	211,947	2040/11/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,386	192,610	2041/02/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,439	199,903	2041/05/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,466	203,587	2041/08/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,273	176,898	2041/11/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,424	197,870	2042/02/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,159	161,041	2042/05/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,231	4,281	594,560	2042/08/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	1,330	184,755	2042/11/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	2,278	316,408	2043/02/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	1,909	265,194	2043/05/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	3,012	418,325	2043/08/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	1,984	275,648	2043/11/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	3,090	429,208	2044/02/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	2,981	414,030	2044/05/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	5,933	823,986	2024/08/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	1,656	230,010	2044/08/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	5,671	787,624	2024/11/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,746	2,304	320,082	2044/11/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,451	757,087	2025/02/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	1,963	272,726	2045/02/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,488	762,175	2025/05/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,835	1,536	213,406	2045/05/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,408	751,074	2025/08/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,873	1,532	212,866	2045/08/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,518	766,395	2025/11/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	659	551	76,575	2045/11/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,866	4,490	623,526	2026/02/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,148	2,396	332,855	2046/02/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,729	7,101	986,150	2026/05/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,823	2,146	298,138	2046/05/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	4,914	682,519	2026/08/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,780	2,007	278,772	2046/08/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	4,894	679,684	2026/11/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,430	337,586	2023/10/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,000	817	113,590	2046/11/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,427	337,075	2023/11/30
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,434	338,019	2023/12/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,640	3,385	470,198	2027/02/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,409	334,668	2024/01/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,345	1,960	272,246	2047/02/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,226	309,244	2024/02/29
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,550	4,396	610,508	2024/03/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	5,969	828,980	2027/05/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	1,672	232,323	2047/05/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	2,887	400,999	2024/04/30
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,093	707,358	2024/05/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,303	319,883	2024/06/30
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,462	758,579	2027/08/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,878	399,778	2024/07/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,450	1,157	160,765	2047/08/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,907	264,913	2024/08/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,500	2,394	332,506	2024/09/30
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,072	704,469	2027/11/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	1,995	277,181	2047/11/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,355	465,956	2024/10/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,056	424,400	2024/11/30
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	2,677	371,793	2024/12/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,350	5,984	831,049	2028/02/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,495	346,576	2025/01/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,605	361,765	2025/02/28
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,000	2,513	349,085	2048/02/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	2,791	387,665	2025/03/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,800	3,266	453,558	2048/05/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	6,152	854,381	2028/05/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	1,834	254,792	2025/04/30
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,426	475,847	2025/05/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	2,888	401,116	2025/06/30
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	6,328	878,883	2028/08/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,220	2,707	376,049	2048/08/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,411	334,940	2025/07/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,457	480,184	2025/08/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,417	335,659	2025/09/30
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,415	335,416	2025/10/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	3,934	546,431	2023/10/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,700	3,537	491,318	2028/11/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,020	2,727	378,757	2048/11/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	2,887	400,920	2025/11/30
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	1,964	272,749	2023/11/30
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	1,500	1,432	198,864	2025/12/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,444	339,401	2023/12/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	6,127	850,945	2029/02/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	3,898	541,354	2024/01/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,383	330,968	2026/01/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	3,969	551,189	2049/02/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,371	329,298	2026/02/28
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,205	445,201	2024/02/29
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,352	326,736	2026/03/31
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	3,836	532,740	2049/05/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	3,560	494,496	2029/05/15
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,381	469,524	2024/04/30
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,641	366,781	2026/04/30
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,802	389,122	2026/05/31

外国債券インデックスマザーファンド

区分	銘柄	種類	年利	当 期 末			償還年月日
				額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,346	464,663	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	2,591	359,929	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,500	5,245	728,398	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,309	320,727	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,092	568,270	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	3,326	461,956	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,534	351,939	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,775	524,250	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,283	317,067	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,839	394,346	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	945	131,232	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	2,733	379,552	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,850	2,504	347,791	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	3,347	464,899	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	1,819	252,715	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,829	392,929	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,284	317,276	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,367	328,743	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,700	1,593	221,324	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,000	4,285	595,127	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	6,500	5,864	814,357	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	3,668	509,488	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	266	36,970	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	4,837	671,828	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,500	1,373	190,765	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,384	192,282	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,800	5,421	752,827	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,457	341,214	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,400	2,061	286,301	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	3,104	431,149	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	3,176	441,141	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	2,997	416,219	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,711	376,557	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,000	5,871	815,413	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	2,990	415,262	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,059	424,809	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	8,000	6,344	880,991	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,238	588,635	2027/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	6,700	3,838	533,033	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	3,151	437,614	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	2,975	413,191	2027/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,583	497,598	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,371	468,247	2027/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,136	435,632	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,915	266,044	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	9,800	7,908	1,098,253	2030/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,568	495,599	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,000	3,383	469,930	2027/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,800	4,172	579,385	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,100	3,358	466,338	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,100	4,551	632,002	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,247	589,815	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,859	397,116	2023/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,237	588,419	2027/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	1,000	890	123,726	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,000	3,797	527,422	2024/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	7,000	5,956	827,199	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,900	3,865	536,753	2051/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	10,700	8,796	1,221,625	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,000	4,729	656,806	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,436	616,110	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,334	601,897	2028/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,700	3,370	468,082	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,000	2,665	370,120	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,888	262,244	2024/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,483	483,795	2028/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,577	496,837	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	3,000	2,827	392,621	2024/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	8,700	7,378	1,024,672	2031/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,100	4,781	663,993	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,500	4,013	557,317	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,215	724,259	2028/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	4,730	656,923	2051/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,800	2,899	402,650	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,470	481,951	2028/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,400	3,913	543,478	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,868	259,523	2024/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	4,328	601,126	2028/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	5,000	4,458	619,110	2026/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	5,500	5,136	713,314	2024/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	3,000	2,792	387,826	2024/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	10,300	8,410	1,167,975	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	6,900	4,659	647,084	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	3,700	2,562	355,809	2041/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	6,000	5,287	734,300	2026/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	5,000	4,257	591,280	2028/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	5,000	4,281	594,585	2028/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	5,000	4,417	613,437	2026/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	7,500	6,964	967,149	2024/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	5,000	4,305	597,842	2028/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,500	3,100	430,582	2026/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	2,000	1,861	258,459	2024/10/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	4,500	4,184	581,145	2024/11/15

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末				償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		外 貨 換 算 金 額	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	9,000	7,384	1,025,535	2031/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	6,600	4,312	598,896	2051/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	4,000	2,892	401,656	2041/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	4,000	3,843	533,805	2023/10/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	6,000	5,193	721,285	2028/10/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	7,000	6,250	868,037	2026/10/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,583	497,648	2026/11/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.5000	5,000	4,793	665,631	2023/11/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	5,600	4,877	677,297	2028/11/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	2,200	2,052	284,974	2024/12/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	2,500	2,394	332,565	2023/12/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	4,000	3,458	480,334	2028/12/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,577	496,782	2026/12/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	1,000	932	129,539	2025/01/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,000	2,868	398,316	2024/01/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	10,400	8,885	1,233,864	2032/02/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	3,700	3,471	482,126	2025/02/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	4,300	3,791	526,463	2029/01/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	3,900	2,799	388,760	2052/02/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	2,500	1,931	268,192	2042/02/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,000	4,441	616,853	2029/02/28	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	4,000	3,843	533,777	2024/02/29	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	1,000	915	127,146	2027/02/28	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	5,000	4,714	654,695	2025/03/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	3,000	2,741	380,660	2029/03/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	5,000	4,695	652,008	2027/03/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	2,000	1,935	268,841	2024/03/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	2,000	1,920	266,716	2025/04/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	9,300	8,647	1,200,879	2032/05/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,888	401,082	2025/05/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	5,000	4,133	574,026	2052/05/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	1,500	1,337	185,716	2042/05/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	4,500	4,362	605,798	2024/04/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	3,000	2,823	392,034	2029/04/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,845	395,175	2027/04/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	4,500	4,356	605,017	2024/05/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	6,000	5,602	777,985	2029/05/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	2,000	1,887	262,067	2027/05/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	2,000	1,931	268,202	2025/06/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	4,000	3,847	534,355	2029/06/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	3,000	2,905	403,482	2027/06/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	3,000	2,902	403,116	2025/07/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	4,070	3,855	535,403	2027/07/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	1,000	974	135,321	2024/06/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	2,500	2,426	336,905	2025/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	7,500	6,888	956,567	2032/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	3,700	3,150	437,547	2052/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.3750	1,000	908	126,175	2042/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	3,970	3,867	537,139	2024/07/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	3,360	3,111	432,135	2029/07/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	3,890	3,802	528,098	2024/08/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	2,500	2,409	334,607	2027/08/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	3,500	3,342	464,187	2029/08/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	2,300	2,254	313,012	2025/09/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,000	3,481	483,517	2024/09/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,499	347,063	2029/09/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	1,500	1,509	209,646	2027/09/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,400	3,398	471,969	2025/10/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	1,000	997	138,511	2024/10/31	
通貨小計	銘柄数	264銘柄						
	金額			973,856	864,609	120,068,309		
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル			
	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	605	563	57,596	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,140	116,519	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,386	141,641	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,235	126,169	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	913	1,026	104,833	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	961	1,026	104,833	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,374	140,405	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,265	129,285	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,116	114,010	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	907	92,751	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,128	115,238	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	650	616	62,947	2028/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,710	2,968	303,214	2051/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,167	119,283	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,173	119,841	2024/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,342	137,177	2024/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	3,050	311,627	2030/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	700	661	67,548	2025/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,649	270,625	2025/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,000	1,648	168,427	2030/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,100	1,887	192,859	2026/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,141	116,605	2024/04/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	300	274	28,033	2026/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,400	3,020	308,611	2031/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,000	944	96,462	2024/10/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,450	1,079	110,273	2053/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	966	98,709	2023/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	200	183	18,764	2027/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,000	2,884	294,695	2024/02/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,100	1,852	189,293	2031/12/01	

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	期末			償還年月日
				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	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	200	189	19,373	2025/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	400	385	39,423	2024/05/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,500	1,376	140,634	2032/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	100	95	9,757	2029/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	391	40,005	2027/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	200	195	20,016	2024/08/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,000	980	100,211	2025/10/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	770	736	75,246	2032/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	360	353	36,135	2024/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	200	202	20,738	2028/03/01
通貨小計	銘柄数 金額	40銘柄		49,798	46,591	4,759,828	
オーストラリア				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,989	2,104	195,291	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	573	569	52,875	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,354	1,339	124,256	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,798	1,801	167,120	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,258	1,354	125,713	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,748	1,803	167,309	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,099	102,051	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,307	1,176	109,148	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	725	67,327	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,672	1,626	150,948	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,178	1,111	103,149	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	1,054	97,838	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,500	1,446	134,196	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,900	1,814	168,378	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,870	2,680	248,762	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,390	1,163	107,981	2041/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	2,410	223,663	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,700	1,383	128,375	2032/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,266	210,320	2024/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,000	1,645	152,669	2030/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,400	870	80,819	2051/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,465	135,991	2025/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,008	186,408	2031/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,081	100,324	2026/09/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,600	1,353	125,585	2032/11/21
	AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.0000	1,300	1,225	113,707	2033/11/21
通貨小計	銘柄数 金額	26銘柄		42,234	38,584	3,580,216	
シンガポール				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	788	79,640	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	923	921	93,142	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	809	797	80,556	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	393	39,714	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	585	59,198	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	617	62,436	2029/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	516	52,224	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	679	68,611	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	437	44,231	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	750	687	69,422	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	540	54,632	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	490	482	48,766	2024/02/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	320	32,393	2039/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	540	443	44,767	2050/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	750	699	70,649	2025/11/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	600	535	54,122	2031/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	200	165	16,717	2051/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	200	187	18,940	2026/11/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	240	231	23,440	2032/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	220	233	23,606	2072/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	100	99	10,085	2027/09/01
通貨小計	銘柄数 金額	21銘柄		10,749	10,365	1,047,303	
ニュージーランド				千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル		
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	600	603	51,974	2027/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	400	380	32,768	2033/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	490	412	35,550	2037/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	600	560	48,255	2029/04/20
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	530	430	37,117	2031/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	350	235	20,326	2041/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	700	658	56,757	2024/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	400	322	27,785	2028/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	500	436	37,631	2026/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	440	368	31,715	2032/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	380	284	24,546	2051/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	640	613	52,812	2025/04/15
通貨小計	銘柄数 金額	12銘柄		6,030	5,308	457,242	
イギリス				千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	921	893	148,512	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,282	1,116	185,532	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,382	229,794	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,760	1,200	199,520	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,450	1,170	194,550	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,810	1,272	211,591	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,410	1,292	214,782	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,500	1,378	229,182	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,040	694	115,507	2071/10/22

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	期末		償還年月日
					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	1.0000	1,800	1,745	290,207	2024/04/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,210	869	144,588	2049/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	574	95,580	2054/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	1,500	1,291	214,768	2029/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,900	1,785	296,750	2025/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,190	835	138,819	2041/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	1,300	1,051	174,817	2030/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	1,700	737	122,672	2061/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,367	227,360	2026/01/30
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,600	1,368	227,402	2028/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	564	93,829	2050/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,700	1,226	203,878	2035/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,300	1,253	208,354	2024/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	2,500	1,955	325,129	2031/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	500	297	49,387	2046/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	500	448	74,594	2026/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	800	492	81,906	2051/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.2500	100	93	15,535	2025/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	900	643	106,898	2039/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.5000	700	594	98,764	2029/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.8750	300	236	39,270	2033/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	300	195	32,529	2053/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.0000	2,100	1,738	288,908	2032/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	820	441	73,419	2073/10/22
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.1250	2,000	2,052	341,137	2027/01/29
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,088	180,943	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,240	2,454	407,985	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,528	254,071	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,362	1,491	247,952	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,357	1,574	261,740	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	2,035	338,348	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,366	1,541	256,319	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,287	213,959	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,116	2,437	405,119	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,600	1,789	297,533	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	1,536	255,412	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	1,586	263,806	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,560	1,751	291,074	2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,174	1,384	230,156	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	1,740	289,284	2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	1,666	276,987	2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,866	1,799	299,114	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,386	1,534	255,081	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,092	1,081	179,742	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,524	1,530	254,395	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	54銘柄					
	金額			72,730	67,102	11,154,519	
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	1,800	1,989	80,230	2026/10/30
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,600	2,051	82,743	2042/01/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,000	2,009	81,051	2024/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,204	88,903	2025/08/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,704	68,754	2027/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,400	2,479	100,012	2047/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,200	1,132	45,659	2028/09/28
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,500	1,475	59,528	2023/11/30
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	2,400	2,045	82,492	2030/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.5000	1,600	1,494	60,266	2025/04/30
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,700	1,330	53,681	2037/05/31
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.5000	200	182	7,358	2026/02/27
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.4000	900	850	34,313	2024/10/31
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	1.3000	300	252	10,182	2032/04/30
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金額			21,700	21,202	855,180	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	13,662	18,287	353,135	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	4,821	93,098	2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	5,954	114,984	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,100	4,729	91,335	2027/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	8,590	7,706	148,821	2029/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,500	2,239	43,246	2052/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	414	7,998	2031/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	957	18,488	2024/11/15
通貨小計	銘柄数	8銘柄					
	金額			43,211	45,111	871,107	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,072	56,608	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	5,395	5,200	72,284	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,340	4,099	56,987	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,450	4,188	58,218	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,299	45,856	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	3,530	49,068	2029/09/06
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	6,800	5,992	83,301	2030/08/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,500	3,003	41,750	2031/09/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1250	1,700	1,563	21,728	2032/05/18
通貨小計	銘柄数	9銘柄					
	金額			37,630	34,949	485,804	
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,655	5,812	76,369	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	8,025	7,951	104,478	2023/11/13

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	当 期 末			償還年月日
				額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ	千円	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,595	7,612	100,025	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	6,867	90,242	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,050	4,728	62,130	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,300	3,421	44,952	2032/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	6,400	5,906	77,616	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	5,000	4,325	56,832	2031/05/12
通貨小計	銘柄数	8銘柄					
	金額			47,205	46,624	612,648	
				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	37,290	33,350	240,865	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	21,300	18,817	135,906	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	23,800	22,992	166,057	2024/09/05
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	7,000	6,065	43,808	2027/03/04
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	1,000	898	6,486	2025/03/06
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	3,000	2,636	19,039	2053/07/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	28,033	27,286	197,068	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	23,919	23,833	172,131	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	27,968	26,130	188,719	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	9,413	67,983	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,544	28,513	205,928	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	18,894	17,700	127,833	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	32,515	29,769	214,998	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	21,654	18,672	134,859	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,944	7,104	51,311	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金額			292,735	273,185	1,972,998	
				千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		
中国	China Government Bond	国債証券	3.2200	5,200	5,313	103,162	2025/12/06
	China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,155	100,100	2028/11/22
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,000	5,171	100,408	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,132	99,656	2026/06/06
	China Government Bond	国債証券	3.1200	12,000	12,285	238,532	2026/12/05
	China Government Bond	国債証券	3.1300	8,000	8,191	159,047	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2.8500	13,000	13,116	254,661	2027/06/04
	China Government Bond	国債証券	2.6800	6,500	6,405	124,358	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	2.8800	37,000	37,276	723,735	2023/11/05
	China Government Bond	国債証券	3.0200	18,000	18,336	356,001	2025/10/22
	China Government Bond	国債証券	3.2800	9,000	9,257	179,741	2027/12/03
	China Government Bond	国債証券	3.2700	12,500	12,986	252,130	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3.0300	7,000	7,125	138,335	2026/03/11
	China Government Bond	国債証券	3.8100	7,300	7,983	154,999	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	3.0100	7,000	7,089	137,644	2028/05/13
	China Government Bond	国債証券	3.7200	8,000	8,618	167,320	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.0200	5,800	5,868	113,936	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,513	87,620	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7400	5,000	5,037	97,803	2026/08/04
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5700	11,000	11,249	218,402	2024/06/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5900	5,500	5,751	111,661	2027/08/03
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	15,000	15,413	299,248	2024/09/21
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	5,000	5,297	102,851	2028/05/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6100	17,000	17,537	340,488	2025/06/07
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5400	4,500	4,722	91,690	2028/08/16
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0800	4,500	5,070	98,444	2048/10/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8600	6,300	6,931	134,575	2049/07/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7700	11,000	11,372	220,804	2025/03/08
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	12,000	12,187	236,619	2050/03/16
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	5,500	5,543	107,635	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	3,500	3,632	70,524	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	6,000	6,011	116,709	2031/11/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	17,000	16,825	326,662	2027/01/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	7,200	7,116	138,165	2032/02/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2600	10,000	9,963	193,451	2025/02/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	15,000	14,962	290,508	2029/03/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	5,500	5,547	107,703	2052/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	5,000	4,931	95,740	2032/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	4,000	3,977	77,230	2029/06/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,000	3,924	76,196	2032/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	12,000	11,715	227,456	2032/09/01
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9900	2,000	1,988	38,602	2024/09/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	9,500	9,349	181,528	2029/09/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	2,200	2,174	42,217	2027/10/15
通貨小計	銘柄数	44銘柄					
	金額			381,000	388,062	7,534,316	
				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,325	71,598	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,197	36,857	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,535	47,288	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,298	39,969	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	728	22,427	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,371	42,220	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,853	57,061	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	1,300	1,368	42,127	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,067	32,864	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,740	53,583	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,206	37,133	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	949	29,233	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,550	1,546	47,601	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,550	1,563	48,140	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,184	36,474	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,950	2,036	62,688	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,201	36,991	2025/03/14

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		
					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	4.6420	1,200	1,231	37,917	2033/11/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	600	632	19,462	2038/06/08
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	649	19,987	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,310	2,266	69,782	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,254	38,626	2048/07/06
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400	400	12,316	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,237	38,086	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,604	49,396	2040/05/22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	2,650	2,439	75,111	2050/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,800	1,596	49,161	2031/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	500	478	14,735	2032/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	400	412	12,687	2042/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5040	500	510	15,733	2029/04/30
通貨小計	銘柄数 金 額	30銘柄		39,353	38,885	1,197,267	
ポーランド				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,377	3,742	114,954	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	2,624	80,601	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,870	2,712	83,292	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840	3,811	117,058	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,400	3,122	95,909	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	2,000	1,742	53,509	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,019	62,022	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	2,200	1,703	52,332	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	891	27,392	2024/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	1,192	36,612	2032/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	500	436	13,416	2027/05/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	785	24,137	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,650	2,996	92,013	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,591	4,176	128,273	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄		38,225	31,959	981,527	
ユーロ (アイルランド)				千ユーロ	千ユーロ		
	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,031	1,105	158,770	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	617	88,676	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	961	973	139,774	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	931	832	119,510	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,035	148,700	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	491	70,602	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	746	107,202	2028/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	750	671	96,369	2033/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	750	700	100,569	2031/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	950	884	127,024	2029/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	600	475	68,280	2050/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	350	270	38,879	2035/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	500	458	65,857	2027/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	681	97,851	2030/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	—	800	653	93,791	2031/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	400	277	39,905	2041/04/22
	IRISH TREASURY	国債証券	0.3500	100	82	11,849	2032/10/18
国 小 計	銘柄数 金 額	17銘柄		11,953	10,959	1,573,613	
ユーロ (オランダ)				千ユーロ	千ユーロ		
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,139	1,327	190,588	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,755	2,127	305,453	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,729	2,158	309,937	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,468	1,508	216,597	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,929	2,193	314,923	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,512	217,232	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,711	245,690	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,938	1,836	263,735	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,078	298,458	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,367	196,404	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,258	180,698	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,064	152,892	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	687	98,719	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,198	172,016	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	736	105,758	2027/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,250	720	103,458	2052/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,087	156,158	2031/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	646	92,812	2038/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	792	113,801	2029/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	93	13,471	2026/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	600	513	73,684	2032/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	298	42,884	2054/01/15
国 小 計	銘柄数 金 額	22銘柄		27,863	26,921	3,865,379	
ユーロ (ベルギー)				千ユーロ	千ユーロ		
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,699	1,646	236,460	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	1,594	228,883	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	950	136,508	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,463	1,408	202,171	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	999	143,439	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	740	665	95,480	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,100	1,035	148,616	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,019	146,371	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	580	533	76,568	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	600	510	73,329	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,490	1,384	198,813	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	650	580	83,277	2033/04/22

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,377	197,752	2029/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	700	565	81,205	2050/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,037	149,016	2030/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	860	583	83,840	2040/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,079	154,933	2027/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,600	1,298	186,456	2031/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	530	265	38,076	2071/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	400	328	47,112	2032/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	800	588	84,552	2053/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	400	57,556	2039/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	1,994	286,336	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,904	2,372	340,706	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	1,946	279,416	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,078	154,876	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	879	126,347	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	643	750	107,812	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,515	217,635	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	776	111,424	2034/06/22
国小計	銘柄数	30銘柄						
	金額				32,548	31,167	4,474,981	
ユーロ (フランス)					千ユーロ	千ユーロ		
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	3,350	481,028	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	3,967	569,715	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,227	4,190	601,600	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	3,264	468,649	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,764	2,273	326,393	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	2,785	399,960	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,164	3,996	573,760	2041/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,217	1,599	229,611	2060/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,646	3,803	546,138	2026/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	5,899	6,062	870,422	2027/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,088	3,404	488,750	2045/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	6,086	6,091	874,684	2024/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,087	5,200	746,737	2030/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,899	4,856	697,314	2024/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,352	481,356	2025/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	4,934	708,437	2025/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,120	4,839	694,815	2031/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,387	4,145	595,159	2026/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	4,169	3,533	507,360	2036/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,387	1,113	159,901	2066/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,050	3,761	540,078	2026/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	2,294	329,495	2039/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,233	464,300	2027/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,550	2,254	323,636	2048/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,400	5,000	717,996	2028/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	3,449	495,306	2034/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	4,550	653,408	2028/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,305	474,674	2024/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,850	2,244	322,263	2050/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,350	3,904	560,641	2029/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,330	4,116	591,039	2025/03/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	3,604	517,597	2029/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,770	1,752	251,555	2052/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,798	401,802	2026/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	1,550	222,683	2040/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	3,350	481,004	2030/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,480	689	99,047	2072/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	97	13,985	2024/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	991	142,307	2044/06/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,600	3,756	539,311	2031/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,100	2,831	406,592	2027/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,500	930	133,574	2053/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,687	242,242	2032/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,999	287,075	2025/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	200	164	23,684	2038/05/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	300	278	40,003	2028/02/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,300	1,256	180,354	2032/11/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,000	973	139,740	2043/05/25
国小計	銘柄数	48銘柄						
	金額				150,364	143,593	20,617,203	
ユーロ (ドイツ)					千ユーロ	千ユーロ		
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,020	146,464	2024/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,397	200,596	2027/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	2,544	365,364	2028/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,090	156,531	2028/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	2,512	360,744	2030/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,048	3,856	553,669	2031/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,305	2,978	427,616	2034/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,271	4,089	587,184	2037/01/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	1,744	250,423	2039/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,739	2,448	351,552	2040/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,974	2,395	343,938	2042/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	3,123	448,521	2044/07/04
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,556	223,523	2024/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	3,024	434,255	2046/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,582	227,200	2024/05/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,042	3,977	571,029	2024/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,125	305,157	2025/02/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,080	298,773	2025/08/15
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,368	2,264	325,091	2026/02/15

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,257	324,141	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,200	3,926	563,742	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,300	3,099	445,096	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,770	2,474	355,284	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,772	254,453	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,100	3,744	537,610	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	1,994	286,385	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,651	380,722	2029/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,850	1,770	254,262	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,531	219,934	2030/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,646	236,402	2035/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,825	262,044	2027/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,562	224,362	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,041	149,571	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	773	111,026	2031/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,077	154,666	2036/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,791	257,281	2028/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	684	98,333	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,600	3,065	440,202	2031/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	596	85,618	2031/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,515	217,609	2032/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	400	348	49,967	2038/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	2,700	2,650	380,517	2032/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,200	1,197	171,963	2053/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	200	202	29,114	2029/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	721	103,610	2052/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	4,116	591,047	2023/12/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	97	13,997	2024/03/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2000	100	97	13,965	2024/06/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	530	515	73,947	2024/09/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,869	268,442	2024/04/05
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,637	235,086	2024/10/18
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,291	329,009	2025/04/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,177	312,635	2025/10/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	94	13,635	2025/10/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,065	296,506	2026/04/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,207	173,308	2026/10/09
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	92	13,218	2027/04/16
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	3,000	2,915	418,631	2027/10/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	430	418	60,058	2027/10/15
国 小 計	銘柄数	59銘柄					
	金 額			113,416	111,332	15,985,058	
ユーロ (スペイン)	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	3,177	456,296	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	2,015	289,384	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	1,951	280,224	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,187	314,107	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	2,700	387,750	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	1,872	268,869	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	1,603	230,249	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,630	2,530	363,315	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	1,828	262,599	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,750	1,663	238,812	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	1,954	280,649	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,400	2,264	325,194	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,200	1,098	157,749	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,900	2,728	391,786	2028/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,496	214,834	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,250	1,974	283,477	2035/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,226	319,742	2024/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,452	352,140	2029/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,360	1,166	167,542	2030/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,383	342,190	2025/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	844	121,300	2050/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,226	319,667	2027/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,400	2,157	309,839	2030/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,300	944	135,615	2040/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	464	66,684	2026/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	2,200	1,770	254,188	2031/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	289	41,626	2024/05/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	650	365	52,450	2071/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	439	63,106	2028/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	1,900	1,384	198,779	2037/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,562	224,316	2031/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	600	412	59,176	2042/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	813	116,794	2027/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	2,100	1,736	249,261	2032/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9000	600	444	63,775	2052/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	94	13,548	2025/05/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	100	88	12,752	2029/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	1,000	970	139,282	2032/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,000	1,022	146,832	2043/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,179	2,733	392,465	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,754	1,980	284,429	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,158	1,434	205,974	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	1,732	248,799	2024/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,973	2,406	345,478	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,789	2,961	425,260	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,214	317,906	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	1,937	278,117	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,018	289,774	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	1,705	244,854	2044/10/31

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,012	288,965	2024/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,116	303,911	2024/10/31
国 小 計	銘柄数 金 額	51銘柄			87,203	84,565	12,141,857	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (イタリア)		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	906	958	137,686	2023/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,287	184,838	2026/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	2,759	396,158	2027/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,809	259,802	2024/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	1,377	197,760	2046/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,407	345,681	2025/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	1,745	250,625	2032/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,891	2,814	404,064	2025/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	1,338	192,191	2047/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,386	2,275	326,689	2026/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	1,941	278,829	2036/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	997	143,281	2026/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	756	108,569	2067/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,312	188,422	2033/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,454	208,898	2027/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,285	184,597	2024/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,250	1,175	168,744	2048/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,700	2,574	369,643	2027/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,566	224,933	2024/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,152	165,524	2038/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	1,978	284,108	2028/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,260	180,953	2025/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,550	2,481	356,349	2028/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,533	220,136	2025/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,198	172,016	2035/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,650	1,650	237,015	2049/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	1,855	266,464	2029/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,200	2,170	311,668	2024/07/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	2,100	2,034	292,092	2026/07/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	1,250	1,119	160,673	2040/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	1,638	235,313	2030/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,300	1,236	177,552	2025/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,152	309,019	2027/01/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,550	1,196	171,741	2050/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,135	162,968	2036/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,500	1,460	209,688	2025/07/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	1,652	237,323	2030/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,100	1,823	261,811	2030/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,200	1,987	285,362	2027/09/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,571	225,706	2026/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,500	1,096	157,431	2041/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,900	1,536	220,669	2031/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,069	153,533	2024/01/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	1,200	784	112,647	2051/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	700	484	69,572	2037/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,620	232,664	2028/03/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,800	1,399	200,999	2031/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	700	459	66,022	2045/04/30
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	993	142,709	2026/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,448	207,978	2024/04/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	460	302	43,387	2072/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	684	98,331	2028/07/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,509	216,683	2031/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	956	137,377	2024/08/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,165	167,359	2024/01/30
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,100	2,776	398,705	2026/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,700	1,331	191,243	2032/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	900	753	108,121	2029/02/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	285	40,952	2024/12/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	800	569	81,787	2052/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	195	28,029	2023/11/29
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1000	300	275	39,581	2027/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	500	477	68,555	2025/08/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	800	769	110,476	2029/06/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,300	2,950	423,675	2032/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	300	275	39,541	2038/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	100	98	14,157	2024/05/30
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6500	200	194	27,884	2027/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	500	504	72,484	2035/04/30
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	300	303	43,568	2026/01/15
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	3,254	3,638	522,447	2029/11/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	3,361	482,669	2031/05/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,096	301,055	2033/02/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	2,529	363,198	2034/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	2,785	399,959	2037/02/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	2,304	330,851	2039/08/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,223	319,225	2025/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	2,543	365,265	2040/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,167	311,221	2026/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	2,591	372,090	2028/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	2,027	291,120	2044/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	2.194	2,245	2,245	322,385	2024/03/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,242	322,023	2024/09/01
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,318	2,329	334,472	2030/03/01
国 小 計	銘柄数 金 額	84銘柄			135,077	128,493	18,449,036	

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	
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	364	318	45,696	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	269	38,765	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	768	110,313	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	297	42,672	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	736	105,721	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	470	405	58,202	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	451	64,832	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	442	63,535	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	192	27,691	2024/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	225	32,404	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	269	38,764	2040/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	500	416	59,801	2030/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	219	31,568	2052/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	493	70,830	2031/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	183	26,407	2026/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	450	308	44,354	2043/04/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	300	275	39,491	2032/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	270	259	37,306	2027/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	700	100,523	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	398	57,262	2028/07/04
Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	413	59,392	2042/07/04	
Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	528	75,897	2024/04/15	
国 小 計	銘柄数 金 額	22銘柄		9,706	8,576	1,231,438	
ユーロ (オーストリア)	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	1,373	1,340	192,406	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,070	153,750	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	645	92,621	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	170	24,516	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,191	171,119	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	465	66,812	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	1,115	160,188	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,148	164,924	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	800	773	111,020	2024/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	—	980	826	118,690	2030/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	464	66,622	2051/03/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	255	36,677	2040/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.8500	350	177	25,537	2120/06/30
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,200	984	141,336	2031/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	480	456	65,493	2025/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	438	62,987	2036/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	300	157	22,561	2071/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	262	37,690	2028/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	500	434	62,439	2032/02/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	264	37,954	2049/05/23
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	298	42,875	2026/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	974	139,886	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,373	1,623	233,065	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	951	136,652	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	441	63,427	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	723	800	114,895	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	762	109,419	2034/05/23
Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	923	132,618	2024/10/21	
国 小 計	銘柄数 金 額	28銘柄		20,870	19,419	2,788,191	
通貨小計	銘柄数 金 額	361銘柄		589,000	565,028	81,126,760	
合 計	銘柄数 金 額	920銘柄				236,705,030	

(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

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 236,705,030	% 98.0
コール・ローン等、その他	4,798,267	2.0
投資信託財産総額	241,503,298	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=138.87円、1カナダ・ドル=102.16円、1オーストラリア・ドル=92.79円、1シンガポール・ドル=101.04円、1ニュージーランド・ドル=86.13円、1イギリス・ポンド=166.23円、1イスラエル・シェケル=40.334円、1デンマーク・クローネ=19.31円、1ノルウェー・クローネ=13.90円、1スウェーデン・クローネ=13.14円、1メキシコ・ペソ=7.222円、1オフショア・人民元=19.415円、1マレーシア・リンギット=30.789円、1ポーランド・ズロチ=30.711円、1ユーロ=143.58円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産 (239,018,141千円) の投資信託財産総額 (241,503,298千円) に対する比率は、99.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	243,630,679,092円
コール・ローン等	3,229,062,310
公社債（評価額）	236,705,030,930
未収入金	2,127,602,130
未収利息	1,496,086,797
前払費用	72,896,925
(B) 負債	2,278,360,508
未払金	2,156,399,997
未払解約金	121,960,511
(C) 純資産総額（A－B）	241,352,318,584
元本	76,340,507,617
次期繰越損益金	165,011,810,967
(D) 受益権総口数	76,340,507,617口
1万口当り基準価額（C/D）	31,615円

* 期首における元本額は74,475,307,643円、当作成期間中における追加設定元本額は9,175,662,845円、同解約元本額は7,310,462,871円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワ外国債券インデックスVA	447,343,827円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募）	9,071,985円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募）	51,739,813円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）	19,793,735円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）	243,846,488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）	347,889,324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）	589,471,225円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	2,679,395,542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）	612,758,959円
D-1's 外国債券インデックス	992,049円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	12,619,026円
iFree 外国債券インデックス	2,022,055,185円
iFree 8資産バランス	1,843,024,587円
iFree 年金バランス	342,801,665円
DCダイワ外国債券インデックス	50,603,926,450円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,059,415,494円
ダイワ・ライフ・バランス50	676,505,626円
ダイワ・ライフ・バランス70	451,133,774円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	638,338,066円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	501,969,526円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	192,677,874円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	31,943,484円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	13,831,284円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,384,617,622円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,873,500円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,528,422円
ダイワつみたてインデックスバランス70	2,590,775円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	159,668,286円
ダイワ世界バランスファンド40VA	115,798,326円
ダイワ世界バランスファンド60VA	36,264,152円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,287,759,159円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	199,611,808円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	150,551,922円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	49,437,293円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	1,733,569,277円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,720,730,269円
ダイワライフスタイル25	28,448,488円
ダイワライフスタイル50	58,536,147円
ダイワライフスタイル75	14,977,183円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は31,615円です。

■損益の状況

当期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	4,847,008,138円
受取利息	4,848,738,797
その他収益金	670,149
支払利息	△ 2,400,808
(B) 有価証券売買損益	△ 3,113,711,608
売買益	39,783,690,491
売買損	△ 42,897,402,099
(C) その他費用	△ 30,384,699
(D) 当期損益金（A+B+C）	1,702,911,831
(E) 前期繰越損益金	159,156,806,959
(F) 解約差損益金	△ 15,621,363,864
(G) 追加信託差損益金	19,773,456,041
(H) 合計（D+E+F+G）	165,011,810,967
次期繰越損益金（H）	165,011,810,967

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

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

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

運用報告書(全体版)

第7期

(決算日 2023年6月15日)

(作成対象期間 2022年6月16日～2023年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券	
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）	
運用方針	海外の債券市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	イ. 外国債券インデックスマザーファンドの受益証券 ロ. ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	新興国通貨建ての債券
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	外国債券インデックスマザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の30%以下
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2733>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率			
3期末(2019年6月17日)	円 11,026	円 0	% 2.6	% 98.0	% —	百万円 1,344
4期末(2020年6月15日)	11,508	0	4.4	97.8	—	1,706
5期末(2021年6月15日)	12,204	0	6.0	98.3	—	1,952
6期末(2022年6月15日)	11,993	0	△ 1.7	98.1	—	2,294
7期末(2023年6月15日)	12,748	0	6.3	97.4	—	3,070

(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



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：11,993円

期末：12,748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
外国債券インデックスマザーファンド	4.6%	79.6%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	15.6%	20.1%

■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて、主に海外の債券に投資した結果、債券市場で金利が上昇(債券価格は下落)したものの、為替相場で円安が進んだことから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率		
(期首) 2022年 6月15日	11,993	—	98.1	—
6月末	12,372	3.2	97.9	—
7月末	12,385	3.3	97.6	—
8月末	12,350	3.0	97.3	—
9月末	12,235	2.0	97.5	—
10月末	12,573	4.8	97.7	—
11月末	12,260	2.2	97.4	—
12月末	11,716	△ 2.3	97.3	—
2023年 1月末	11,888	△ 0.9	97.3	—
2月末	12,030	0.3	97.3	—
3月末	12,183	1.6	97.1	—
4月末	12,281	2.4	97.1	—
5月末	12,605	5.1	97.2	—
(期末) 2023年 6月15日	12,748	6.3	97.4	—

(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

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■ 海外債券市況

海外債券市場では、金利は上昇しました。

主要国の国債金利は、当作成期首より2022年10月にかけて、世界の主要な中央銀行が政策金利見通しを大幅に引き上げたことや、商品市況の高止まりなどから期待インフレ率が上昇したことにより、上昇基調で推移しました。11月には、米国のCPI（消費者物価指数）が予想を下振れたことで長期のインフレ期待が低下したことや、世界的な景気減速懸念が高まったことなどから、金利は低下しました。その後、2023年2月は主要国の経済指標が堅調な結果となり、さらなる金融引き締め観測が織り込まれたことで、金利は上昇に転じて推移しました。3月は欧米の金融不安により低下しましたが、当作成期末にかけては、景気減速懸念や金融不安の後退により上昇しました。

新興国では、多くの国で利上げが行われましたが、インフレが沈静化してきたことにより、金利は低下しました。

■ 為替相場

為替相場は円安となりました。

為替相場は、当作成期首より2022年10月にかけて、世界の主要な中央銀行が政策金利見通しを大幅に引き上げたのに対し、日銀は指値オペを行い長期金利上昇の抑制を図るなど、金融政策の相違が明確となって円安が大きく進行しました。11月に入ると、インフレ率の低下期待などから米国金利が低下したことで日米金利差の縮小が意識され、円高に転じました。12月には、日銀が想定外の政策修正を行ったことで金融緩和政策の転換などが意識され、日本の長期金利が大きく上昇するとともに円高が進行しました。2023年2月は、堅調な米国の経済指標を受けて米国金利が大きく上昇したことで、円安に転じて推移しました。3月は欧米の金融不安により円高に推移しましたが、当作成期末にかけては、日銀の金融緩和政策維持を受けて円安に推移しました。

新興国でも、多くの国で利上げが行われたことなどから、多くの通貨は対円で上昇（円安）しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

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

*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックスマザーファンド	FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	JP モルガン ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット グローバル ダイバースィファイド (円換算)

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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	
	2022年6月16日 ～2023年6月15日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	2,748

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
 (注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
 (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。
 (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



今後の運用方針

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」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

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

■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 (2022. 6. 16~2023. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	52円	0.429%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12,237円です。
(投信会社)	(36)	(0.297)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(13)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	4	0.035	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.026)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	57	0.464	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

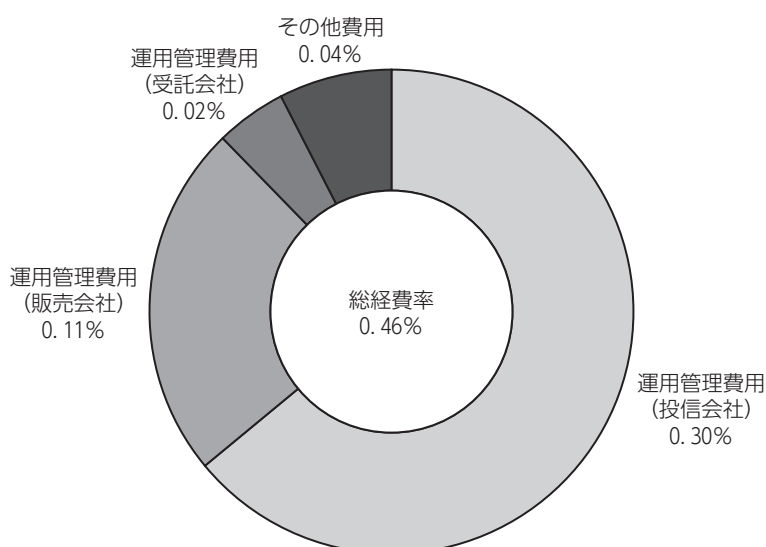
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.46%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

種 類	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ダイワ新興国債券 インデックス・ マザーファンド	101,008	153,943	48,984	72,351
外国債券 インデックス マザーファンド	209,831	662,474	45,778	145,848

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
ダイワ新興国債券 インデックス・マザーファンド	320,250	372,273	372,273	616,261
外国債券インデックス マザーファンド	590,145	754,198	754,198	2,445,562

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ダイワ新興国債券インデックス・ マザーファンド	616,261	20.0
外国債券インデックス マザーファンド	2,445,562	79.5
コール・ローン等、その他	15,093	0.5
投資信託財産総額	3,076,918	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=140.39円、1カナダ・ドル=105.30円、1オーストラリア・ドル=95.37円、1シンガポール・ドル=104.58円、1ニュージーランド・ドル=86.93円、1イギリス・ポンド=177.72円、1エジプト・ポンド=4.54円、1イスラエル・シェケル=39.178円、1トルコ・リラ=5.953円、1デンマーク・クローネ=20.42円、1ノルウェー・クローネ=13.16円、1スウェーデン・クローネ=13.09円、1メキシコ・ペソ=8.185円、1フィリピン・ペソ=2.509円、1アルゼンチン・ペソ=0.565円、100チリ・ペソ=17.506円、100コロンビア・ペソ=3.363円、100インドネシア・ルピア=0.95円、1ブラジル・レアル=29.151円、1チェコ・コルナ=6.395円、1ルーマニア・レイ=30.748円、1オフショア・人民元=19.553円、1マレーシア・リンギット=30.359円、1南アフリカ・ランド=7.66円、1タイ・バーツ=4.03円、1ペルー・ソル=38.337円、1ポーランド・ズロチ=34.16円、100ハンガリー・フォリント=40.987円、1ウルグアイ・ペソ=3.653円、1ドミニカ・ペソ=2.559円、1ユーロ=152.15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(34,720,782千円)の投資信託財産総額(35,049,606千円)に対する比率は、99.1%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(256,068,945千円)の投資信託財産総額(257,290,651千円)に対する比率は、99.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,076,918,128円
コール・ローン等	15,093,946
ダイワ新興国債券インデックス・ マザーファンド(評価額)	616,261,310
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	2,445,562,872
(B) 負債	6,066,438
未払解約金	589,368
未払信託報酬	5,373,819
その他未払費用	103,251
(C) 純資産総額(A-B)	3,070,851,690
元本	2,408,871,747
次期繰越損益金	661,979,943
(D) 受益権総口数	2,408,871,747口
1万口当り基準価額(C/D)	12,748円

* 期首における元本額は1,913,328,634円、当作成期間中における追加設定元本額は728,642,263円、同解約元本額は233,099,150円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,748円です。

■損益の状況

当期自2022年6月16日至2023年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3,725円
受取利息	168
支払利息	△ 3,893
(B) 有価証券売買損益	169,918,463
売買益	176,691,024
売買損	△ 6,772,561
(C) 信託報酬等	△ 10,619,459
(D) 当期損益金(A+B+C)	159,295,279
(E) 前期繰越損益金	105,503,145
(F) 追加信託差損益金	397,181,519
(配当等相当額)	(201,009,945)
(売買損益相当額)	(196,171,574)
(G) 合計(D+E+F)	661,979,943
次期繰越損益金(G)	661,979,943
追加信託差損益金	397,181,519
(配当等相当額)	(201,009,945)
(売買損益相当額)	(196,171,574)
分配準備積立金	264,802,149
繰越損益金	△ 3,725

(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	129,205,780
(c) 収益調整金	397,181,519
(d) 分配準備積立金	135,596,369
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	661,983,668
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	661,983,668
(h) 受益権総口数	2,408,871,747口

★「外国債券インデックスマザーファンド」の第23期にかかる運用状況については213~227ページをご参照ください。

＜補足情報＞

当ファンド(ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし))が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日(2022年11月30日)と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日(2023年6月15日)現在における外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。200~212ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の決算日（2022年7月5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（2023年6月15日）現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL (ブラジル) 2026/1/1	418,960	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2023/7/1	574,758
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	307,598	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	273,253
BRAZIL LETRAS DO TESOIRO NACIONAL (ブラジル) 2025/7/1	279,340	Mexican Bonos (メキシコ) 8% 2023/12/7	214,452
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8% 2030/1/31	203,917	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	185,947
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 10.5% 2026/12/21	173,994	Thailand Government Bond (タイ) 2.4% 2023/12/17	150,262
MEXICAN BONOS (メキシコ) 5% 2025/3/6	172,439	Poland Government Bond (ポーランド) 4% 2023/10/25	144,004
THAILAND GOVERNMENT BOND (タイ) 2.65% 2028/6/17	172,176	Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2023/1/25	126,768
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8.875% 2035/2/28	162,782	Mexican Bonos (メキシコ) 6.75% 2023/3/9	123,892
THAILAND GOVERNMENT BOND (タイ) 2.35% 2026/6/17	145,966	China Government Bond (中国) 2.36% 2023/7/2	120,500
POLAND GOVERNMENT BOND (ポーランド) 7.5% 2028/7/25	145,655	China Government Bond (中国) 2.88% 2023/11/5	96,933

(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、2023年6月15日現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（21,168,871千円）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち8日格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
		千円	千円			%	%	%
エジプト	千エジプト・ポンド 66,600	千エジプト・ポンド 53,213	千円 241,606	0.7	0.7	0.1	0.5	0.1
トルコ	千トルコ・リラ 52,860	千トルコ・リラ 49,759	296,264	0.8	0.8	0.1	0.7	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 440,900	千メキシコ・ペソ 412,628	3,377,489	9.6	—	5.0	2.5	2.1
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 9,765	24,501	0.1	—	0.1	—	—
チリ	千チリ・ペソ 4,705,000	千チリ・ペソ 4,685,511	820,264	2.3	—	1.6	0.2	0.5
コロンビア	千コロンビア・ペソ 53,780,000	千コロンビア・ペソ 46,194,383	1,553,655	4.4	—	2.5	1.5	0.4
インドネシア	千インドネシア・ルピア 335,319,000	千インドネシア・ルピア 355,428,565	3,376,571	9.6	—	6.6	2.3	0.7
ブラジル	千ブラジル・レアル 137,240	千ブラジル・レアル 122,765	3,578,733	10.2	—	1.6	4.1	4.5
チェコ	千チェコ・コルナ 321,900	千チェコ・コルナ 285,902	1,828,374	5.2	—	3.2	1.4	0.6
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 43,250	千ルーマニア・レイ 40,339	1,240,385	3.5	—	1.5	1.3	0.7
中国	千オフショア・人民元 165,700	千オフショア・人民元 169,592	3,316,036	9.5	—	4.7	3.4	1.3
ロシア	千ロシア・ルーブル 1,116,020	千ロシア・ルーブル —	—	—	—	—	—	—
マレーシア	千マレーシア・リンギット 108,630	千マレーシア・リンギット 109,861	3,335,293	9.5	—	5.6	2.9	1.1
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 487,710	千南アフリカ・ランド 396,210	3,034,968	8.7	—	7.2	1.5	—
タイ	千タイ・バーツ 823,560	千タイ・バーツ 827,870	3,336,316	9.5	—	6.0	2.2	1.3
ペルー	千ペルー・ソル 23,010	千ペルー・ソル 22,209	851,455	2.4	—	2.1	0.2	0.1
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 84,780	千ポーランド・ズロチ 74,898	2,558,555	7.3	—	2.2	3.4	1.6
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 3,237,000	千ハンガリー・フォリント 2,588,505	1,060,958	3.0	—	1.4	1.3	0.3
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 9,800	千ウルグアイ・ペソ 9,044	33,042	0.1	—	0.1	0.0	—
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 22,400	千ドミニカ・ペソ 24,898	63,716	0.2	0.2	0.1	0.1	—
合 計	—	—	33,928,192	96.8	1.7	51.8	29.5	15.5

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の中値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

2023年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
エジプト	ARAB REP EGYPT	国債証券	16.1000	千エジプト・ポンド 1,500	千エジプト・ポンド 1,126	千円 5,115	2029/05/07
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3500	1,000	893	4,055	2024/09/10
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4000	4,000	2,763	12,546	2029/09/10
	ARAB REP EGYPT	国債証券	13.5360	1,500	1,294	5,876	2025/01/14
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.6640	4,500	3,056	13,876	2030/10/06
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5560	2,000	1,487	6,754	2027/10/13
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3690	9,000	7,431	33,740	2025/10/20
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.2920	6,000	4,444	20,180	2028/01/05
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.0600	18,800	15,220	69,105	2026/01/12
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4830	9,000	7,241	32,877	2026/04/06
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5630	1,000	801	3,638	2026/07/06
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5310	8,300	7,453	33,839	2024/09/14
	通貨小計	銘柄数	12銘柄				
	金 額			66,600	53,213	241,606	
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	千トルコ・リラ 1,630	千トルコ・リラ 1,503	8,950	2024/07/24
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	2,690	2,345	13,967	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	5,570	5,139	30,603	2026/02/11
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,605	15,510	2027/02/24
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	9,000	7,915	47,129	2027/08/11
	Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	5,000	4,856	28,917	2028/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	12.6000	9,100	8,926	53,144	2025/10/01
	Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	8,400	7,430	44,240	2030/11/13
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	16.9000	8,500	9,036	53,801	2026/09/02
	通貨小計	銘柄数	9銘柄				
	金 額			52,860	49,759	296,264	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 52,400	千メキシコ・ペソ 47,698	390,423	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	29,300	26,360	215,772	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	39,000	37,719	308,746	2024/09/05
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	23,000	20,355	166,613	2027/03/04
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	25,700	23,639	193,499	2025/03/06
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	16,000	14,273	116,836	2053/07/31
	MEXICAN BONOS	国債証券	7.5000	15,300	13,945	114,145	2033/05/26
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	30,550	30,286	247,902	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	40,030	37,853	309,842	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	9,390	10,240	83,821	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	35,230	34,644	283,578	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	25,100	24,027	196,670	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	55,350	51,921	424,994	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	34,120	30,048	245,952	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,430	9,613	78,689	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			440,900	412,628	3,377,489	
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 9,765	24,501	2036/01/14
通貨小計	銘柄数	1銘柄					
	金 額			10,000	9,765	24,501	
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ 500,000	千チリ・ペソ 483,275	84,604	2026/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	720,000	713,196	124,854	2035/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	630,000	700,963	122,713	2043/01/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	685,000	663,669	116,184	2030/09/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	1,000,000	926,820	162,252	2025/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.3000	250,000	215,015	37,641	2028/10/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	200,000	196,810	34,454	2028/10/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	7.0000	220,000	254,553	44,563	2034/05/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	500,000	531,210	92,995	2033/04/01
	通貨小計	銘柄数	9銘柄				
	金 額			4,705,000	4,685,511	820,264	
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 86,751	2,917	2027/06/28
	Colombian TES	国債証券	10.0000	3,850,000	3,858,354	129,768	2024/07/24
	Colombian TES	国債証券	6.0000	5,570,000	4,710,103	158,414	2028/04/28
	Colombian TES	国債証券	7.5000	5,410,000	5,037,305	169,419	2026/08/26
	Colombian TES	国債証券	7.7500	3,600,000	3,143,232	105,716	2030/09/18
	Colombian TES	国債証券	7.0000	4,650,000	3,731,950	125,516	2032/06/30
	Colombian TES	国債証券	6.2500	3,700,000	3,410,623	114,709	2025/11/26
	Colombian TES	国債証券	7.2500	4,900,000	3,823,519	128,596	2034/10/18
	Colombian TES	国債証券	5.7500	3,200,000	2,719,456	91,463	2027/11/03
	Colombian TES	国債証券	7.2500	4,510,000	3,099,181	104,234	2050/10/26
	Colombian TES	国債証券	6.2500	1,900,000	1,322,400	44,476	2036/07/09
	COLOMBIAN TES	国債証券	7.0000	5,400,000	4,454,136	149,805	2031/03/26
	COLOMBIAN TES	国債証券	9.2500	4,500,000	3,908,295	131,447	2042/05/28
	COLOMBIAN TES	国債証券	13.2500	2,500,000	2,889,075	97,168	2033/02/09
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金 額			53,780,000	46,194,383	1,553,655	
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 9,537,495	90,606	2036/05/15

2023年6月15日現在							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	8,000,000	9,222,400	87,612	2031/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	5,963,045	56,648	2032/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,976,126	75,773	2038/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	10,224,400	97,131	2024/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	6,000,000	7,050,720	66,981	2039/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	12,000,000	13,333,680	126,669	2029/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	17,300,000	18,045,630	171,433	2030/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	16,700,000	16,958,015	161,101	2025/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	13,300,000	14,528,654	138,022	2035/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	13,500,000	14,715,945	139,801	2040/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	14,400,000	14,371,344	136,527	2026/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	20,800,000	21,084,336	200,301	2031/02/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	7,300,000	7,252,915	68,902	2036/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	20,600,000	20,788,490	197,490	2032/04/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	5.1250	12,000,000	11,792,520	112,028	2027/04/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	11,700,000	12,365,847	117,475	2042/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	2,700,000	2,709,855	25,743	2037/07/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.0000	11,300,000	11,914,833	113,190	2033/02/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	7,600,000	7,776,320	73,875	2028/08/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	4,600,000	4,916,802	46,709	2043/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	2,200,000	2,344,518	22,272	2038/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	3,600,000	3,993,516	37,938	2025/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	3,480,000	4,305,560	40,902	2030/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,554,614	33,768	2031/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,824,000	13,786,056	130,967	2026/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,337,955	50,710	2032/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	12,530,000	13,016,414	123,655	2027/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	11,450,000	11,555,225	109,774	2028/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	10,575,000	10,827,425	102,860	2033/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	14,320,000	16,569,099	157,406	2034/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	15,150,000	15,460,272	146,872	2024/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	10,620,000	12,148,536	115,411	2029/03/15
通貨小計	銘柄数	33銘柄					
	金額			335,319,000	355,428,565	3,376,571	
				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	12,890	12,683	369,748	2025/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	14,850	14,593	425,411	2027/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,600	10,221	297,975	2029/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	4,600	4,379	127,655	2031/01/01
	BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F	国債証券	10.0000	4,800	4,503	131,284	2033/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	33,700	31,532	919,201	2024/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	11,100	9,878	287,953	2024/07/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	15,500	12,590	367,030	2025/07/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	23,700	18,335	534,505	2026/01/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	5,500	4,046	117,967	2026/07/01
通貨小計	銘柄数	10銘柄					
	金額			137,240	122,765	3,578,733	
				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	2.5000	19,600	17,777	113,691	2028/08/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	12,100	12,098	77,368	2024/05/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	21,100	19,851	126,952	2025/09/17
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	23,900	21,311	136,290	2026/06/26
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	22,000	17,557	112,285	2030/05/15
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	22,500	19,149	122,466	2027/02/10
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	24,500	22,270	142,422	2029/07/23
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	22,000	17,845	114,126	2033/10/13
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	22,700	18,054	115,461	2031/03/13
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	10,000	7,601	48,609	2029/11/29
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	13,500	13,292	85,004	2036/12/04
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	20,500	16,707	106,846	2032/06/23
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	17,500	16,402	104,896	2025/02/14
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	10,000	6,540	41,823	2040/04/24
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	-	5,000	4,607	29,465	2024/12/12
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	6,000	5,562	35,569	2035/05/30
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	15,500	15,996	102,296	2026/02/26
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	15,500	16,073	102,791	2030/09/30
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	12,000	12,666	81,000	2028/12/12
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	6,000	4,536	29,008	2037/07/30
通貨小計	銘柄数	20銘柄					
	金額			321,900	285,902	1,828,374	
				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	4.7500	2,450	2,387	73,421	2025/02/24
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,800	2,725	83,810	2027/07/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,600	1,559	47,943	2024/04/29
	Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,410	74,106	2029/02/12
	Romania Government Bond	国債証券	4.8500	2,500	2,397	73,708	2026/04/22
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,900	2,378	73,137	2031/09/24
	Romania Government Bond	国債証券	4.5000	2,500	2,456	75,545	2024/06/17
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,300	2,184	67,161	2025/07/28
	Romania Government Bond	国債証券	4.1500	1,600	1,450	44,586	2028/01/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.7000	2,200	2,125	65,366	2024/11/25
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	2,100	1,921	59,088	2026/06/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1500	2,500	2,149	66,087	2030/10/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,700	2,296	70,605	2034/10/11

2023年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ	千円	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,300	1,956	60,145	2027/10/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	2,300	2,098	64,517	2029/07/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.7000	2,000	2,008	61,772	2032/02/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,100	870	26,755	2036/04/28
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,000	1,872	57,574	2025/11/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.2500	2,100	2,325	71,497	2032/09/29
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.7500	700	765	23,552	2028/10/30
通貨小計	銘柄数	20銘柄					
	金 額			43,250	40,339	1,240,385	
				千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		
中国	China Government Bond	国債証券	3.2200	3,700	3,794	74,201	2025/12/06
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	5,010	97,962	2028/11/22
	China Government Bond	国債証券	3.1900	4,000	4,043	79,063	2024/04/11
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,900	6,161	120,475	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,946	96,713	2026/06/06
	China Government Bond	国債証券	3.1200	4,200	4,314	84,357	2026/12/05
	China Government Bond	国債証券	3.1300	5,700	5,898	115,328	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2.9400	4,500	4,555	89,082	2024/10/17
	China Government Bond	国債証券	2.8500	4,800	4,884	95,502	2027/06/04
	China Government Bond	国債証券	2.6800	8,000	8,037	157,165	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	1.9900	6,500	6,483	126,771	2025/04/09
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,137	139,550	2025/10/22
	China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,195	101,584	2027/12/03
	China Government Bond	国債証券	3.2700	6,300	6,618	129,404	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3.0300	3,900	3,988	77,986	2026/03/11
	China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	6,576	128,588	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	2.8400	4,000	4,030	78,810	2024/04/08
	China Government Bond	国債証券	3.0100	5,000	5,135	100,405	2028/05/13
	China Government Bond	国債証券	3.7200	2,000	2,232	43,648	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,180	140,407	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	2,500	2,529	49,449	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4700	3,900	3,920	76,665	2024/09/02
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	1,800	1,837	35,921	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	1,000	1,082	21,163	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	1,000	1,016	19,869	2031/11/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	2,800	2,799	54,742	2027/01/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,000	3,015	58,959	2032/02/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,500	3,550	69,432	2029/03/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	2,200	2,207	43,157	2027/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	1,000	1,044	20,428	2052/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	2,500	2,513	49,140	2032/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,600	3,634	71,065	2029/06/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,700	3,711	72,579	2027/07/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	3,000	3,000	58,663	2032/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	3,900	3,898	76,229	2025/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	1,600	1,587	31,048	2032/09/01
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,300	3,305	64,628	2029/09/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	3,200	3,202	62,619	2027/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	1,200	1,219	23,854	2052/10/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,700	3,737	73,086	2032/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	1,200	1,212	23,716	2029/12/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6400	1,200	1,211	23,697	2028/01/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4600	2,600	2,615	51,134	2026/02/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8800	2,500	2,548	49,831	2033/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,700	1,722	33,683	2030/03/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	1,200	1,240	24,255	2053/04/15
通貨小計	銘柄数	46銘柄					
	金 額			165,700	169,592	3,316,036	
				千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル		
ロシア	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	46,760	—	—	2027/02/03
	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	43,000	—	—	2031/09/17
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	45,600	—	—	2026/09/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	46,100	—	—	2033/03/23
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	48,600	—	—	2024/10/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	48,000	—	—	2024/02/28
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.2500	55,000	—	—	2034/05/10
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.9000	49,000	—	—	2029/05/23
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.9500	46,000	—	—	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	68,000	—	—	2027/10/06
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	4.5000	71,000	—	—	2025/07/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.1000	63,000	—	—	2035/07/18
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	5.7000	65,000	—	—	2028/05/17
	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ	国債証券	6.9000	74,000	—	—	2031/07/23
	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ	国債証券	6.7000	50,000	—	—	2029/03/14
通貨小計	銘柄数	21銘柄					
	金 額			1,116,020	—	—	
				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,843	55,973	2027/07/26

2023年6月15日現在							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	3,500	3,624	110,051	2028/10/31
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1280	1,900	1,933	58,710	2025/08/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	2,900	2,958	89,831	2029/07/09
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.6550	2,700	2,707	82,212	2024/10/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	4,200	4,225	128,268	2026/03/31
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	5,100	4,983	151,297	2030/10/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4220	3,500	3,477	105,571	2027/09/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4470	3,100	2,922	88,734	2036/07/15
	MALAYSIA T-BILL	国債証券	4.4170	3,300	3,409	103,497	2041/09/30
	MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE	国債証券	3.9900	3,800	3,849	116,868	2025/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,450	2,441	74,130	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	3,250	3,263	99,087	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,753	53,247	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	4,350	4,396	133,474	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	2,300	2,361	71,704	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	3,800	3,845	116,758	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,720	1,735	52,677	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	3,820	3,867	117,399	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	4,300	4,620	140,284	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	2,800	2,826	85,817	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	2,100	2,306	70,009	2038/06/08
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	2,000	2,026	61,519	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,950	2,982	90,559	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	2,100	2,346	71,235	2048/07/06
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	3,300	3,306	100,387	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	3,000	2,969	90,138	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	3,500	3,339	101,396	2040/05/22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	4,300	4,217	128,044	2050/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	2,900	2,667	80,996	2031/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	2,400	2,372	72,035	2032/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1930	2,900	2,980	90,475	2032/10/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	2,300	2,478	75,243	2042/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5990	600	601	18,247	2028/07/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2910	2,100	2,140	64,968	2043/08/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6620	1,400	1,507	45,765	2038/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2450	2,400	2,478	75,249	2030/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4570	750	789	23,957	2053/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5190	1,300	1,299	39,463	2028/04/20
通貨小計	銘柄数						
	金額			108,630	109,861	3,335,293	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	65,650	67,748	518,956	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	17,720	11,268	86,314	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	16,280	9,649	73,912	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	29,540	23,432	179,493	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	63,020	46,032	352,612	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	48,800	37,288	285,626	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	62,200	54,385	416,595	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	42,700	31,446	240,879	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	52,200	43,553	333,616	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	50,200	41,005	314,104	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	39,400	30,399	232,856	2040/01/31
通貨小計	銘柄数						
	金額			487,710	396,210	3,034,968	
タイ	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	36,050	41,162	165,886	2029/06/22
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	31,610	32,937	132,737	2025/12/12
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	32,700	35,614	143,526	2031/06/20
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	29,600	31,359	126,379	2036/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	35,400	35,346	142,445	2026/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	37,500	41,397	166,831	2032/06/25
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	34,900	33,107	133,423	2046/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	34,500	35,467	142,932	2028/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	40,500	42,711	172,126	2038/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.4500	42,000	41,598	167,643	2024/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	36,500	34,858	140,480	2029/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	15,500	13,755	55,432	2035/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	0.9500	43,000	42,034	169,399	2025/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	0.7500	32,900	32,477	130,885	2024/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.5850	32,900	28,965	116,730	2035/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	51,000	49,363	198,936	2031/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	23,000	19,686	79,337	2042/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	48,000	45,804	184,593	2027/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	43,000	42,293	170,442	2024/09/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6500	43,000	43,740	176,275	2028/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	24,500	26,048	104,974	2037/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	36,500	36,747	148,090	2026/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	20,000	21,099	85,029	2043/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	19,000	20,291	81,773	2033/06/17
通貨小計	銘柄数						
	金額			823,560	827,870	3,336,316	
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	5.7000	1,230	1,226	47,020	2024/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	2,870	2,861	109,705	2028/08/12

2023年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	Peru Government Bond	国債証券	6.1500	千ペルー・ソル 3,350	千ペルー・ソル 3,153	千円 120,877	2032/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.9400	3,400	3,288	126,087	2029/02/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.4000	2,050	1,784	68,405	2034/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.3500	1,500	1,236	47,385	2040/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	2,075	2,204	84,502	2026/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	3,465	3,383	129,720	2037/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	3,070	3,071	117,751	2031/08/12
通貨小計	銘柄数	9銘柄					
	金 額			23,010	22,209	851,455	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	千ポーランド・ズロチ 8,190	千ポーランド・ズロチ 7,428	253,769	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,240	4,617	157,744	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,600	5,438	185,772	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	8,250	6,944	237,228	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	6,700	6,375	217,806	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	5,550	5,061	172,887	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	6,900	5,043	172,302	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	5,700	4,748	162,211	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,950	4,976	170,013	2032/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	5,500	5,107	174,477	2027/05/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	4,200	4,495	153,551	2028/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,300	1,143	39,071	2025/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,600	1,613	55,121	2033/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	6,950	6,068	207,299	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	6,150	5,834	199,299	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			84,780	74,898	2,558,555	
ハンガリー	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	千ハンガリー・フォリント 98,500	千ハンガリー・フォリント 89,982	36,881	2024/06/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	270,000	219,483	89,960	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000	106,680	43,725	2026/12/22
	Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	153,000	145,103	59,474	2028/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	225,000	174,546	71,541	2030/08/21
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	220,000	195,624	80,180	2024/10/24
	Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	272,000	208,936	85,637	2031/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	270,000	221,967	90,978	2025/11/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	202,000	130,714	53,576	2038/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	169,000	137,785	56,474	2026/04/22
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	135,000	100,966	41,383	2029/05/23
	Hungary Government Bond	国債証券	2.2500	215,000	145,834	59,773	2033/04/20
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	100,000	80,182	32,864	2026/08/26
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	150,000	93,747	38,424	2041/04/25
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	75,000	49,387	20,242	2034/06/22
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	100,000	86,131	35,302	2028/03/23
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	170,000	143,284	58,728	2032/11/24
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	282,500	258,148	105,808	2025/06/24
通貨小計	銘柄数	18銘柄					
	金 額			3,237,000	2,588,505	1,060,958	
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	千ウルグアイ・ペソ 2,800	千ウルグアイ・ペソ 2,653	9,693	2028/03/15
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.2500	7,000	6,391	23,348	2031/05/21
通貨小計	銘柄数	2銘柄					
	金 額			9,800	9,044	33,042	
ドミニカ共和国	Dominican Republic International Bond	国債証券	9.7500	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 11,022	28,206	2026/06/05
	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND	国債証券	13.6250	11,400	13,876	35,510	2033/02/03
通貨小計	銘柄数	2銘柄					
	金 額			22,400	24,898	63,716	
合 計	銘柄数	330銘柄					
	金 額					33,928,192	

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

運用報告書 第12期 (決算日 2022年7月5日)

(作成対象期間 2021年7月6日～2022年7月5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。

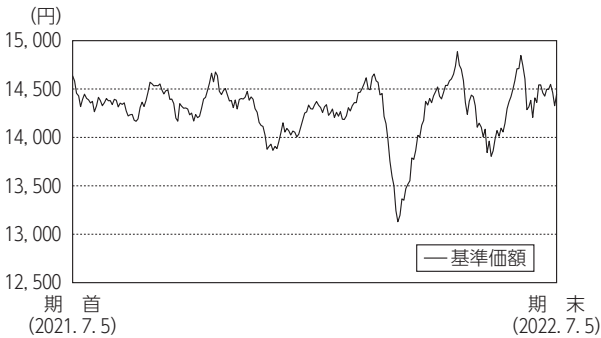
運用方針	投資成果を J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマーゼィング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (円換算) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	新興国通貨建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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



《運用経過》

【基準価額・騰落率】

期首：14,635円 期末：14,445円 騰落率：△1.3%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券からの利息収入や、多くの投資対象国通貨の対円為替レートが上昇(円安)したことがプラス要因となった一方で、金利が上昇(債券価格は下落)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。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

○新興国債券市場

新興国債券市場は、多くの国で金利が上昇しました。

新興国債券の金利は、当作成期首より横ばいで推移したものの、2021年9月には、F R B (米連邦準備制度理事会) の利上げ見通しが市場予想を上回ったことなどから金利は上昇し、債券価格は下落しました。その後も、供給制約の長期化を背景にインフレへの懸念が高まったことや、F R B 議長が毎会合での利上げの可能性を否定しなかったことから利上げの織り込みが加速し、金利は上昇しました。2022年2月後半には、ロシアがウクライナに侵攻したことで投資家のリスク回避姿勢が強まり、金利は大幅に上昇しました。当作成期末にかけても、各国で積極的な利上げの観測が高まったことなどから、金利はさらに上昇しました。

○為替相場

新興国為替市場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

新興国通貨は、当作成期首より新型コロナウイルスの感染拡大により円に対して下落(円高)したものの、世界的に新型コロナウイルスのワクチン接種が進む中で、世界経済への楽観的な見方が強まったことで上昇に転じました。その後は、商品価格の上昇によるインフレ圧力の高まりを受けて各国が利上げを実施する中で、日銀は指値オペを行い長期金利上昇の抑制を図るなど、日本と各国の金融政策の相違がより明確となって、新興国通貨は対円で大きく上昇しました。

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

◆ポートフォリオについて

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△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△1.3%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。

*ベンチマークは J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマーゼィング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (円換算) です。

年 月 日	基準価額		J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマーゼィング・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)		公社債組入比率
	円	%	円	%	
(期首) 2021年7月5日	14,635	—	15,713	—	97.1
7月末	14,403	△ 1.6	15,504	△ 1.3	96.7
8月末	14,465	△ 1.2	15,557	△ 1.0	96.6
9月末	14,294	△ 2.3	15,382	△ 2.1	96.6
10月末	14,377	△ 1.8	15,487	△ 1.4	96.7
11月末	13,908	△ 5.0	14,929	△ 5.0	96.0
12月末	14,293	△ 2.3	15,372	△ 2.2	97.3
2022年1月末	14,273	△ 2.5	15,337	△ 2.4	96.8
2月末	14,142	△ 3.4	15,403	△ 2.0	97.4
3月末	14,403	△ 1.6	15,387	△ 2.1	96.5
4月末	14,374	△ 1.8	15,170	△ 3.5	95.7
5月末	14,297	△ 2.3	15,433	△ 1.8	96.0
6月末	14,549	△ 0.6	15,689	△ 0.2	96.9
(期末) 2022年7月5日	14,445	△ 1.3	15,584	△ 0.8	96.7

(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-エマーゼィング・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-エマーゼィング・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-エマーゼィング・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ていません。Copyright 2016, J. P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

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

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

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

《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)	15 (11)
(その他)	(3)
合 計	15

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2021年7月6日から2022年7月5日まで)

		買付額	売付額
外	エジプト	千エジプト・ポンド 52,664	千エジプト・ポンド (—)
	トルコ	千トルコ・リラ 9,915	千トルコ・リラ (9,970)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 122,564	千メキシコ・ペソ (49,642)
	チリ	千チリ・ペソ 1,139,508	千チリ・ペソ (181,857)
	コロンビア	千コロンビア・ペソ 10,732,817	千コロンビア・ペソ (3,697,994)
	インドネシア	千インドネシア・ルピア 67,063,170	千インドネシア・ルピア (40,365,782)
	ブラジル	千ブラジル・リアル 36,864	千ブラジル・リアル (20,695)
	チェコ	千チェコ・コルナ 101,016	千チェコ・コルナ (14,302)
	ルーマニア	千ルーマニア・レイ 14,036	千ルーマニア・レイ (2,774)
	中国	千オフショア・人民元 23,805	千オフショア・人民元 (22,312)
	ロシア	千ロシア・ルーブル 226,399	千ロシア・ルーブル (69,128)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 36,957	千マレーシア・リンギット (9,194)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 123,999	千南アフリカ・ランド (19,292)
	タイ	千タイ・バーツ 256,179	千タイ・バーツ (64,749)
	パルー	千パルー・ソル 3,058	千パルー・ソル (—)
	国	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 20,115
ハンガリー		千ハンガリー・フォリント 813,731	千ハンガリー・フォリント (361,490)

(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

(2021年7月6日から2022年7月5日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄		銘 柄	
	千円		千円
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 10.5% 2026/12/21	151,198	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2022/7/1	209,806
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2023/7/1	149,929	Mexican Bonos (メキシコ) 6.5% 2022/6/9	159,570
THAILAND GOVERNMENT BOND (タイ) 1% 2027/6/17	142,014	Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2023/1/25	132,408
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	140,106	Poland Government Bond (ポーランド) 5.75% 2022/9/23	105,665
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8% 2030/1/31	135,753	Colombian TES (コロンビア) 7% 2022/5/4	104,290
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8.5% 2037/1/31	130,732	Malaysia Government Investment Issue (マレーシア) 3.948% 2022/4/14	94,312
Mexican Bonos (メキシコ) 7.75% 2031/5/29	127,532	Poland Government Bond (ポーランド) 2.25% 2022/4/25	93,023
China Government Bond (中国) 3.02% 2031/5/27	125,668	Thailand Government Bond (タイ) 2% 2022/12/17	91,955
Thailand Government Bond (タイ) 2% 2031/12/17	122,269	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 7% 2022/5/15	90,178
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8.75% 2048/2/28	108,189	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	88,072

(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 区分	当 期				末			
	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
エジプト	千エジプト・ポンド 52,500	千エジプト・ポンド 50,411	千円 363,803	1.4%	1.4%	0.5%	0.9%	—%
トルコ	千トルコ・リラ 35,120	千トルコ・リラ 27,594	223,628	0.9	0.9	0.3	0.4	0.2
メキシコ	千メキシコ・ペソ 398,550	千メキシコ・ペソ 374,878	2,519,855	9.9	—	4.5	4.2	1.2
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 9,743	24,080	0.1	—	0.1	—	—
チリ	千チリ・ペソ 3,815,000	千チリ・ペソ 3,474,882	509,932	2.0	—	1.1	0.7	0.1
コロンビア	千コロンビア・ペソ 39,925,000	千コロンビア・ペソ 31,972,041	1,038,931	4.1	—	2.7	1.3	0.0
インドネシア	千インドネシア・ルピア 270,129,000	千インドネシア・ルピア 276,003,589	2,511,632	9.8	—	6.3	2.4	1.2
ブラジル	千ブラジル・レアル 105,350	千ブラジル・レアル 91,705	2,341,904	9.2	—	1.1	2.2	5.8
チェコ	千チェコ・コルナ 257,800	千チェコ・コルナ 218,783	1,256,540	4.9	—	2.5	1.9	0.5
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 32,480	千ルーマニア・レイ 27,674	794,978	3.1	—	1.2	0.7	1.2
中国	千オフショア・人民元 122,950	千オフショア・人民元 125,027	2,541,692	9.9	—	4.8	3.4	1.7
ロシア	千ロシア・ルーブル 1,194,420	千ロシア・ルーブル —	—	—	—	—	—	—
マレーシア	千マレーシア・リンギット 84,780	千マレーシア・リンギット 82,564	2,545,591	10.0	—	5.3	3.3	1.3
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 352,590	千南アフリカ・ランド 296,379	2,474,766	9.7	—	7.7	1.7	0.3
タイ	千タイ・バーツ 682,360	千タイ・バーツ 667,003	2,541,282	9.9	—	5.5	2.9	1.5
ペルー	千ペルー・ソル 18,100	千ペルー・ソル 16,507	587,207	2.3	—	2.0	0.3	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 67,260	千ポーランド・ズロチ 55,634	1,676,102	6.6	—	2.5	3.1	1.0
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 2,753,800	千ハンガリー・フォリント 2,093,349	739,454	2.9	—	1.3	1.1	0.4
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 9,800	千ウルグアイ・ペソ 8,550	29,137	0.1	—	0.1	—	—
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 10,730	26,637	0.1	0.1	—	0.1	—
合計	—	—	24,747,159	96.7	2.4	49.6	30.7	16.5

(注1) 邦貨換算金額は、期末の時価を対顧客直物電信売相場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			末			償還年月日
				額 面 金 額	評 価 額		額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
エジプト	ARAB REP EGYPT	国債証券	16.1000	千エジプト・ポンド 1,500	千エジプト・ポンド 1,470	千円 10,609			2029/05/07	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3500	1,000	988	7,135			2024/09/10	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4000	4,000	3,650	26,345			2029/09/10	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	13.5360	1,500	1,449	10,461			2025/01/14	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.6640	4,500	4,280	30,889			2030/10/06	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5560	2,000	1,973	14,239			2027/10/13	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3690	9,000	8,691	62,721			2025/10/20	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.2920	6,000	5,571	40,204			2028/01/05	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.0600	10,000	9,656	69,687			2026/01/12	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4830	9,000	8,735	63,038			2026/04/06	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5630	1,000	969	6,995			2026/07/06	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5310	3,000	2,975	21,472			2024/09/14	
	通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄		52,500	50,411	363,803			
	トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	千トルコ・リラ 2,780	千トルコ・リラ 2,524	20,460			2023/03/08
Turkey Government Bond		国債証券	10.4000	680	572	4,638			2024/03/20	
Turkey Government Bond		国債証券	9.0000	1,630	1,294	10,487			2024/07/24	
Turkey Government Bond		国債証券	8.0000	2,690	1,970	15,971			2025/03/12	
Turkey Government Bond		国債証券	10.6000	2,570	1,866	15,128			2026/02/11	
Turkey Government Bond		国債証券	11.0000	2,970	2,227	18,053			2027/02/24	
Turkey Government Bond		国債証券	10.5000	2,500	1,872	15,175			2027/08/11	
Turkey Government Bond		国債証券	12.4000	2,000	1,600	12,966			2028/03/08	
Turkey Government Bond		国債証券	16.2000	2,800	2,659	21,551			2023/06/14	
Turkey Government Bond		国債証券	12.6000	6,100	4,843	39,253			2025/10/01	

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
				%	千トルコ・リラ	外 貨 建 金 額 千トルコ・リラ	邦 貨 換 算 金 額 千円	
		Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	8,400	6,162	49,941	2030/11/13
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金 額				35,120	27,594	223,628	
メキシコ		Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 52,400	千メキシコ・ペソ 46,605	313,270	2026/03/05
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	29,300	26,207	176,162	2047/11/07
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	41,000	39,908	268,260	2024/09/05
		Mexican Bonos	国債証券	6.7500	17,500	17,205	115,649	2023/03/09
		MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	13,000	11,173	75,103	2027/03/04
		MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	1,700	1,525	10,255	2025/03/06
		Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,250	26,739	179,740	2023/12/07
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	26,550	26,918	180,939	2024/12/05
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000	36,230	33,879	227,732	2027/06/03
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000	11,890	12,851	86,382	2036/11/20
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	31,730	30,860	207,438	2029/05/31
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,100	27,684	186,090	2038/11/18
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	44,350	40,963	275,350	2031/05/29
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	26,120	22,906	153,972	2042/11/13
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,430	9,448	63,507	2034/11/23
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金 額				398,550	374,878	2,519,855	
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 9,743	24,080	2036/01/14
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金 額				10,000	9,743	24,080	
チリ		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ 500,000	千チリ・ペソ 470,025	68,975	2026/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	570,000	504,723	74,067	2035/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	510,000	491,900	72,185	2043/01/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	685,000	613,143	89,977	2030/09/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.0000	250,000	242,287	35,555	2023/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	850,000	769,428	112,912	2025/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.3000	250,000	197,750	29,019	2028/10/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	200,000	185,624	27,239	2028/10/01
通貨小計	銘柄数	8銘柄						
	金 額				3,815,000	3,474,882	509,932	
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 88,662	2,881	2027/06/28
		Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	43,025	1,398	2023/03/21
		Colombian TES	国債証券	10.0000	3,850,000	3,844,032	124,911	2024/07/24
		Colombian TES	国債証券	6.0000	4,870,000	3,830,108	124,459	2028/04/28
		Colombian TES	国債証券	7.5000	4,710,000	4,209,750	136,795	2026/08/26
		Colombian TES	国債証券	7.7500	3,600,000	2,927,556	95,130	2030/09/18
		Colombian TES	国債証券	7.0000	4,650,000	3,451,881	112,168	2032/06/30
		Colombian TES	国債証券	6.2500	2,700,000	2,372,787	77,103	2025/11/26
		Colombian TES	国債証券	7.2500	4,200,000	3,040,464	98,799	2034/10/18
		Colombian TES	国債証券	5.7500	3,200,000	2,534,624	82,362	2027/11/03
		Colombian TES	国債証券	7.2500	2,310,000	1,465,048	47,606	2050/10/26
		Colombian TES	国債証券	6.2500	1,900,000	1,208,609	39,273	2036/07/09
		COLOMBIAN TES	国債証券	7.0000	2,300,000	1,747,977	56,800	2031/03/26
		COLOMBIAN TES	国債証券	9.2500	1,500,000	1,207,515	39,238	2042/05/28
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金 額				39,925,000	31,972,041	1,038,931	
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 8,711,670	79,276	2036/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	8,000,000	8,677,120	78,961	2031/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	5,536,960	50,386	2032/08/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,273,647	66,190	2038/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	10,529,200	95,815	2024/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	4,700,000	5,010,811	45,598	2039/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	12,000,000	12,767,760	116,186	2029/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	14,300,000	14,167,725	128,926	2030/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	12,400,000	12,696,732	115,540	2025/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	9,300,000	9,322,506	84,834	2035/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	11,500,000	11,491,720	104,574	2040/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	14,400,000	14,147,280	128,740	2026/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	15,800,000	15,075,096	137,183	2031/02/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	4,300,000	3,881,438	35,321	2036/06/15
		INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	12,600,000	11,823,714	107,595	2032/04/15
		INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	5.1250	9,000,000	8,619,210	78,434	2027/04/15
		INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	5,700,000	5,627,496	51,210	2042/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	3,600,000	4,116,312	37,458	2025/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	4,680,000	5,556,283	50,562	2030/08/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,375,405	30,716	2031/07/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,824,000	13,845,431	125,993	2026/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,006,025	45,554	2032/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	12,530,000	12,879,837	117,206	2027/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	6,910,000	7,006,256	63,756	2023/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	11,450,000	11,218,366	102,087	2028/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	7,075,000	6,681,630	60,802	2033/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,520,000	13,314,018	121,157	2034/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	15,150,000	15,947,496	145,122	2024/03/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	10,620,000	11,696,443	106,437	2029/03/15
通貨小計	銘柄数	29銘柄						
	金 額				270,129,000	276,003,589	2,511,632	

ダイワ新興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	期 末			償 還 年 月 日	
					額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
					千ブラジル・リアル	千円			
ブラジル		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,710	10,529	268,880	2023/01/01	
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,890	10,261	262,047	2025/01/01	
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,950	9,926	253,505	2027/01/01	
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	8,100	7,082	180,865	2029/01/01	
		Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	4,600	3,922	100,170	2031/01/01	
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	19,300	16,986	433,776	2023/07/01	
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	27,700	22,968	586,550	2024/01/01	
		Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	10,200	7,997	204,238	2024/07/01	
		BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	2,900	2,031	51,869	2025/07/01	
	通貨小計	銘柄数	9銘柄						
		金額			105,350	91,705	2,341,904		
チェコ		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	19,600	17,223	98,920	2028/08/25	
		Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	12,100	12,033	69,113	2024/05/25	
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	21,100	19,257	110,603	2025/09/17	
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	17,900	15,209	87,353	2026/06/26	
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	16,000	12,230	70,243	2030/05/15	
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	11,900	11,028	63,338	2023/10/25	
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	22,500	18,056	103,706	2027/02/10	
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	18,000	15,951	91,612	2029/07/23	
		Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	19,000	14,850	85,288	2033/10/13	
		Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	16,200	12,376	71,083	2031/03/13	
		Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	10,000	7,169	41,178	2029/11/29	
		Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	9,500	9,177	52,711	2036/12/04	
		CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	14,500	11,393	65,435	2032/06/23	
		CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	17,500	15,547	89,291	2025/02/14	
		CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	10,000	6,294	36,151	2040/04/24	
		CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,000	4,346	24,961	2024/12/12	
		CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	6,000	5,460	31,358	2035/05/30	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	11,000	11,176	64,187	2026/02/26		
通貨小計	銘柄数	18銘柄							
	金額			257,800	218,783	1,256,540			
ルーマニア		Romania Government Bond	国債証券	5.8500	1,430	1,399	40,196	2023/04/26	
		Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,044	30,007	2025/02/24	
		Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,100	1,852	53,223	2027/07/26	
		Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,600	1,459	41,923	2024/04/29	
		Romania Government Bond	国債証券	4.2500	1,500	1,441	41,398	2023/06/28	
		Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,118	60,843	2029/02/12	
		Romania Government Bond	国債証券	4.8500	1,600	1,405	40,362	2026/04/22	
		Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,900	1,989	57,138	2031/09/24	
		Romania Government Bond	国債証券	4.5000	2,500	2,316	66,550	2024/06/17	
		Romania Government Bond	国債証券	4.4000	2,400	2,287	65,700	2023/09/25	
		Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,500	1,304	37,473	2025/07/28	
		Romania Government Bond	国債証券	4.0000	1,600	1,513	43,468	2023/10/25	
		Romania Government Bond	国債証券	4.1500	1,600	1,283	36,861	2028/01/26	
		Romania Government Bond	国債証券	3.7000	1,300	1,164	33,453	2024/11/25	
		Romania Government Bond	国債証券	3.2500	2,100	1,728	49,650	2026/06/24	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1500	2,500	1,843	52,951	2030/10/24	
		ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	800	558	16,049	2034/10/11	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,300	965	27,727	2027/10/25		
通貨小計	銘柄数	18銘柄							
	金額			32,480	27,674	794,978			
中国		China Government Bond	国債証券	3.2900	2,700	2,741	55,734	2023/10/18	
		China Government Bond	国債証券	3.2200	3,700	3,782	76,901	2025/12/06	
		China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,927	100,179	2028/11/22	
		China Government Bond	国債証券	3.1900	4,000	4,067	82,680	2024/04/11	
		China Government Bond	国債証券	3.2900	5,900	6,087	123,760	2029/05/23	
		China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,921	100,056	2026/06/06	
		China Government Bond	国債証券	3.1200	4,200	4,288	87,174	2026/12/05	
		China Government Bond	国債証券	3.1300	5,700	5,795	117,822	2029/11/21	
		China Government Bond	国債証券	2.9400	4,500	4,557	92,651	2024/10/17	
		China Government Bond	国債証券	2.8500	4,800	4,837	98,341	2027/06/04	
		China Government Bond	国債証券	2.6800	8,000	7,874	160,090	2030/05/21	
		China Government Bond	国債証券	1.9900	6,500	6,417	130,467	2025/04/09	
		China Government Bond	国債証券	2.3600	6,150	6,169	125,415	2023/07/02	
		China Government Bond	国債証券	2.8800	4,900	4,945	100,538	2023/11/05	
		China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,109	144,525	2025/10/22	
		China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,152	104,745	2027/12/03	
		China Government Bond	国債証券	3.2700	6,300	6,493	132,005	2030/11/19	
		China Government Bond	国債証券	3.0300	3,900	3,965	80,624	2026/03/11	
		China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	6,253	127,129	2050/09/14	
		China Government Bond	国債証券	2.8400	4,000	4,038	82,091	2024/04/08	
		China Government Bond	国債証券	3.0100	5,000	5,061	102,887	2028/05/13	
		China Government Bond	国債証券	3.7200	2,000	2,124	43,186	2051/04/12	
		China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,063	143,588	2031/05/27	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	2,500	2,505	50,943	2026/08/12	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	1,800	1,809	36,781	2028/10/14	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	1,000	1,034	21,022	2051/10/18	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	1,000	1,000	20,344	2031/11/18	
	通貨小計	銘柄数	27銘柄						
		金額			122,950	125,027	2,541,692		
	ロシア		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	46,760	—	—	2027/02/03

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	
					千ロシア・ルーブル	千円	
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	24,400	—	—	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	43,000	—	—	2031/09/17
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	45,600	—	—	2026/09/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	54,000	—	—	2022/12/07
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	46,100	—	—	2033/03/23
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	48,600	—	—	2024/10/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	48,000	—	—	2024/02/28
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.2500	55,000	—	—	2034/05/10
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.9000	49,000	—	—	2029/05/23
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.9500	46,000	—	—	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	68,000	—	—	2027/10/06
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	4.5000	71,000	—	—	2025/07/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.1000	63,000	—	—	2035/07/18
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	5.7000	65,000	—	—	2028/05/17
	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ	国債証券	6.9000	74,000	—	—	2031/07/23
	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ	国債証券	6.7000	50,000	—	—	2029/03/14
通貨小計	銘柄数 金 額	23銘柄		1,194,420	—	—	
マレーシア	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,814	55,940	2027/07/26
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0940	2,000	2,023	62,402	2023/11/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	3,500	3,536	109,026	2028/10/31
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1280	1,900	1,936	59,706	2025/08/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	1,600	1,601	49,377	2029/07/09
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.6550	3,700	3,724	114,847	2024/10/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	4,200	4,212	129,869	2026/03/31
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	5,100	4,788	147,648	2030/10/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4220	2,300	2,237	68,991	2027/09/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4470	3,100	2,721	83,917	2036/07/15
	MALAYSIA T-BILL	国債証券	4.4170	2,100	1,975	60,900	2041/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,450	2,396	73,875	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	2,500	2,508	77,332	2023/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	3,250	3,179	98,019	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,771	54,617	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	4,450	4,488	138,378	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	2,300	2,212	68,221	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,400	1,409	43,468	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	3,800	3,798	117,110	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,720	1,748	53,916	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	2,520	2,506	77,280	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	2,600	2,645	81,579	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,500	1,516	46,754	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,407	43,405	2023/04/20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	2,000	2,005	61,832	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,950	2,891	89,149	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	3,300	3,312	102,137	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	2,000	1,857	57,280	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	3,100	2,710	83,558	2040/05/22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	3,600	3,135	96,661	2050/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	2,900	2,541	78,361	2031/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	1,000	950	29,309	2032/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1930	1,000	996	30,710	2032/10/07
通貨小計	銘柄数 金 額	33銘柄		84,780	82,564	2,545,591	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	47,950	50,922	425,206	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	14,720	9,607	80,224	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	13,280	8,202	68,489	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	19,540	15,462	129,107	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	8,880	8,950	74,734	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	45,520	35,298	294,742	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	36,400	28,887	241,206	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	45,900	40,089	334,743	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	27,600	21,574	180,150	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	34,900	29,387	245,386	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	34,800	29,285	244,537	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	23,100	18,711	156,236	2040/01/31
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄		352,590	296,379	2,474,766	
タイ	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	36,050	41,091	156,560	2029/06/22
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	23,300	23,864	90,923	2023/06/16
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	31,610	33,421	127,334	2025/12/12
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	28,700	30,816	117,410	2031/06/20
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	29,600	29,549	112,583	2036/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	35,400	35,138	133,875	2026/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	37,500	40,898	155,822	2032/06/25
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	34,900	29,729	113,268	2046/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.4000	37,500	38,088	145,118	2023/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	26,500	26,944	102,659	2028/12/17

ダイワ新興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	期 末			償 還 年 月 日
				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	3.3000	40,500	39,659	151,103	2038/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.4500	42,000	41,598	158,490	2024/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	36,500	33,923	129,248	2029/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	15,500	12,779	48,690	2035/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	0.9500	34,000	33,000	125,732	2025/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	0.7500	39,900	39,205	149,373	2024/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.5850	32,900	26,970	102,757	2035/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	44,000	41,586	158,443	2031/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	19,000	14,699	56,003	2042/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	41,000	38,390	146,267	2027/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	16,000	15,647	59,615	2024/09/17
通貨小計	銘柄数	21銘柄					
	金 額			682,360	667,003	2,541,282	
				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	724	25,789	2024/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	2,870	2,704	96,205	2028/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.1500	2,550	2,256	80,284	2032/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.9400	2,700	2,465	87,717	2029/02/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.4000	2,050	1,657	58,950	2034/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.3500	1,000	750	26,702	2040/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	1,565	1,632	58,070	2026/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	2,065	1,873	66,646	2037/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	2,570	2,441	86,840	2031/08/12
通貨小計	銘柄数	9銘柄					
	金 額			18,100	16,507	587,207	
				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	7,490	6,313	190,212	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,240	4,274	128,770	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,700	4,328	130,411	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	8,250	6,485	195,382	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	5,000	4,480	134,976	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	4,700	3,982	119,988	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	5,600	3,781	113,938	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	5,700	4,329	130,423	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,500	1,656	49,897	2032/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,700	1,479	44,578	2027/05/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	4,530	4,350	131,081	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	5,700	4,652	140,160	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	6,150	5,519	166,279	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	13銘柄					
	金 額			67,260	55,634	1,676,102	
				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	89,293	31,541	2024/06/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	170,000	132,348	46,750	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000	103,307	36,492	2026/12/22
	Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	88,000	81,587	28,819	2028/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	225,000	158,782	56,088	2030/08/21
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	220,000	193,721	68,430	2024/10/24
	Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	272,000	189,080	66,790	2031/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	40,000	37,600	13,281	2023/08/23
	Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	200,000	157,550	55,652	2025/11/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	202,000	111,239	39,294	2038/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	169,000	132,479	46,796	2026/04/22
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	135,000	92,738	32,758	2029/05/23
	Hungary Government Bond	国債証券	2.2500	215,000	128,290	45,317	2033/04/20
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	100,000	76,502	27,023	2026/08/26
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	70,000	36,554	12,912	2041/04/25
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	75,000	42,712	15,087	2034/06/22
	Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	201,800	197,693	69,833	2023/11/24
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	142,500	131,869	46,581	2025/06/24
通貨小計	銘柄数	18銘柄					
	金 額			2,753,800	2,093,349	739,454	
				千ウルグアイ・ペソ	千ウルグアイ・ペソ		
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	2,800	2,555	8,706	2028/03/15
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.2500	7,000	5,995	20,430	2031/05/21
通貨小計	銘柄数	2銘柄					
	金 額			9,800	8,550	29,137	
				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	10,730	26,637	2026/06/05
通貨小計	銘柄数	1銘柄					
	金 額			11,000	10,730	26,637	
合 計	銘柄数	294銘柄					
	金 額					24,747,159	

(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

2022年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 24,747,159	% 94.7
コール・ローン等、その他	1,393,658	5.3
投資信託財産総額	26,140,817	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5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=136.14円、1エジプト・ポンド=7.216円、1トルコ・リラ=8.104円、1メキシコ・ペソ=6.721円、1フィリピン・ペソ=2.471円、1アルゼンチン・ペソ=1.08円、100チリ・ペソ=14.674円、100コロンビア・ペソ=3.249円、100インドネシア・ルピア=0.91円、1ブラジル・レアル=25.537円、1チェコ・コルナ=5.743円、1ルーマニア・レイ=28.726円、1オフショア・人民元=20.329円、1マレーシア・リンギット=30.831円、1南アフリカ・ランド=8.35円、1タイ・バーツ=3.81円、1ペルー・ソル=35.572円、1ポーランド・ズロチ=30.126円、100ハンガリー・フォリント=35.324円、1ウルグアイ・ペソ=3.407円、1ドミニカ・ペソ=2.482円です。
 (注3) 当期末における外貨建純資産(25,218,677千円)の投資信託財産総額(26,140,817千円)に対する比率は、96.5%です。

■損益の状況

当期 自 2021年7月6日 至 2022年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,340,788,071円
受取利息	1,340,855,602
その他収益金	1,552
支払利息	△ 69,083
(B) 有価証券売買損益	△ 1,524,211,635
売買益	3,946,750,939
売買損	△ 5,470,962,574
(C) その他費用	△ 23,867,804
(D) 当期損益金 (A+B+C)	△ 207,291,368
(E) 前期繰越損益金	6,745,631,134
(F) 解約差損益金	△ 335,242,681
(G) 追加信託差損益金	1,668,027,580
(H) 合計 (D+E+F+G)	7,871,124,665
次期繰越損益金 (H)	7,871,124,665

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

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	26,344,678,768円
コール・ローン等	1,017,664,060
公社債(評価額)	24,747,159,762
未収入金	207,480,589
未収利息	336,198,173
前払費用	36,176,184
(B) 負債	764,727,310
未払金	727,092,262
未払解約金	37,629,108
その他未払費用	5,940
(C) 純資産総額 (A-B)	25,579,951,458
元本	17,708,826,793
次期繰越損益金	7,871,124,665
(D) 受益権総口数	17,708,826,793口
1万口当り基準価額 (C/D)	14,445円

* 期首における元本額は14,553,919,275円、当作成期間中における追加設定元本額は3,933,705,045円、同解約元本額は778,797,527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：
 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) 236,473,927円
 ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマーシングプラス (為替ヘッジなし) 320,249,481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 エマーシングプラス (為替ヘッジなし) 332,025,577円
 D-I's 新興国債券インデックス 59,523,115円
 i F r e e 新興国債券インデックス 5,204,607,369円
 i F r e e 8資産バランス 3,623,504,790円
 ダイワ新興国債券インデックス (為替ヘッジなし) (投資一任専用) 734,959円
 DCダイワ新興国債券インデックスファンド 7,754,073,709円
 ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券 145,588,599円
 ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド 32,045,267円
 * 当期末の計算口数当りの純資産額は14,445円です。

ダイワファンドラップ J-REITインデックス

運用報告書(全体版) 第7期

(決算日 2023年6月15日)

(作成対象期間 2022年6月16日～2023年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／不動産投信（リート）／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）		
運用方針	投資成果を東証REIT指数（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券	
	ダイワJ-REITマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、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、わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果をあげることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<4640>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			東証REIT指数 (配当込み)		投資証券 組入比率	不動産投信 指数先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
3期末(2019年6月17日)	円	円	%		%	%	%	百万円
3期末(2019年6月17日)	11,818	0	15.3	3,934.65	15.8	98.4	1.4	3,254
4期末(2020年6月15日)	10,318	0	△12.7	3,448.87	△12.3	96.3	2.6	4,081
5期末(2021年6月15日)	14,075	0	36.4	4,720.99	36.9	96.9	2.4	6,102
6期末(2022年6月15日)	12,709	0	△9.7	4,278.73	△9.4	97.2	2.4	6,943
7期末(2023年6月15日)	13,091	0	3.0	4,424.14	3.4	97.3	2.2	8,364

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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：12,709円
 期末：13,091円（分配金0円）
 騰落率：3.0%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券を通じて、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、国内リート市況が上昇したことを反映して、基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数 (配当込み)		投資証券 組入比率	不動産投信 指 先 物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%		%	%	%
(期首)2022年6月15日	12,709	—	4,278.73	—	97.2	2.4
6月末	13,325	4.8	4,487.40	4.9	97.6	2.3
7月末	13,740	8.1	4,628.79	8.2	97.7	2.3
8月末	13,898	9.4	4,683.62	9.5	97.7	2.3
9月末	13,316	4.8	4,488.86	4.9	97.7	2.2
10月末	13,537	6.5	4,564.72	6.7	97.7	2.2
11月末	13,535	6.5	4,565.38	6.7	97.7	2.2
12月末	13,052	2.7	4,403.82	2.9	97.8	2.2
2023年1月末	12,633	△ 0.6	4,263.06	△ 0.4	97.8	2.2
2月末	12,828	0.9	4,331.37	1.2	97.8	2.2
3月末	12,452	△ 2.0	4,204.73	△ 1.7	97.8	2.2
4月末	13,086	3.0	4,420.34	3.3	97.8	2.2
5月末	13,166	3.6	4,448.91	4.0	97.7	2.2
(期末)2023年6月15日	13,091	3.0	4,424.14	3.4	97.3	2.2

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

国内リート市況

国内リート市況は上昇しました。

国内リート市況は、当作成期首より、米国のインフレ懸念がやや後退し、米国の利上げペース鈍化期待から米国の長期金利が低下する中で上昇しました。2022年9月下旬以降は、欧米を中心とした金融引き締めによる世界的な景気後退リスクが投資家に強く意識され、米国の長期金利が上昇する中、他のリスク資産と同様に国内リート市況も下落しました。10月末には、米国長期金利が低下に転じる中、国内リート市況は割安感が意識され大きく反発しました。しかし、12月下旬に日銀が金融緩和の見直しを発表すると大幅に下落し、その後は荒い展開ながらやや戻しました。2023年1月に入ると、国内金利の上昇懸念が高まり、下落しました。1月中旬に日銀が主要政策の現状維持を発表しましたが、発表当日は上昇、翌日は下落と乱高下しました。3月中旬には、海外の銀行の経営破綻や経営危機が報じられて金融システムへの不安から下落に転じましたが、月末に政府の支援策が打ち出されたこともあり、値を戻しました。4月に入り、日銀新総裁就任後初となる金融政策決定会合が開催されて大規模な金融緩和策の維持が決定されると、国内リート市況は一段と上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

ダイワJ-REITマザーファンド

当ファンドの運用の基本方針に基づき、ベンチマーク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

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■当ファンド

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

■ダイワJ-REITマザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

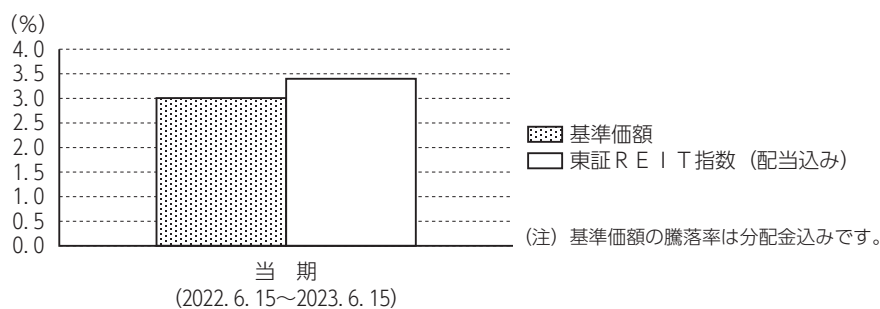
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワJ-REITマザーファンド	東証REIT指数（配当込み）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は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3.0%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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	
	2022年6月16日 ~2023年6月15日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	3,934

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
- (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。
- (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



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 (2022. 6. 16~2023. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	45円	0.341%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は13,113円です。
(投信会社)	(27)	(0.209)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(14)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0.004	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資証券)	(0)	(0.003)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合計	46	0.351	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

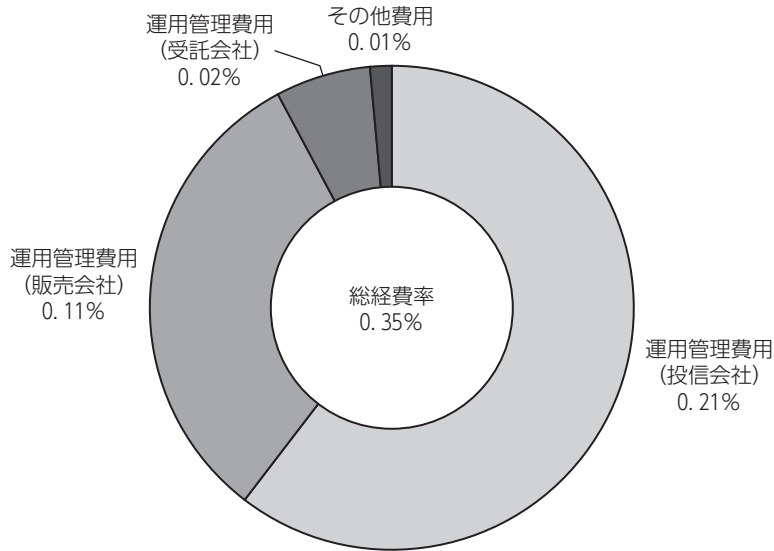
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

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



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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ダイワ J-REIT マザーファンド	千口 593,579	千円 1,936,770	千口 231,580	千円 772,870

(注) 単位未満は切捨て。

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

種 類	当 期	
	ダイワ J-REIT マザーファンド	買 付 額
投資証券	百万円 1,079	

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドおよび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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(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。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

種 類	当 期		
	ダイワ J-REIT マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
投資証券	百万円 2,809	百万円 1,836	百万円 13,659

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

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

■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
ダイワ J-REIT マザーファンド	千口 2,188,150	千口 2,550,149	千円 8,359,898

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ダイワJ-REIT マザーファンド	8,359,898 千円	99.7 %
コール・ローン等、その他	27,759	0.3
投資信託財産総額	8,387,658	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■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	1,658,250,976
(d) 分配準備積立金	855,646,964
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,513,897,940
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,513,897,940
(h) 受益権総口数	6,389,175,673口

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	8,387,658,371円
コール・ローン等	27,759,808
ダイワJ-REITマザーファンド (評価額)	8,359,898,563
(B) 負債	23,614,767
未払解約金	10,591,876
未払信託報酬	12,816,270
その他未払費用	206,621
(C) 純資産総額 (A - B)	8,364,043,604
元本	6,389,175,673
次期繰越損益金	1,974,867,931
(D) 受益権総口数	6,389,175,673口
1万口当り基準価額 (C / D)	13,091円

* 期首における元本額は5,463,295,501円、当作成期間中における追加設定元本額は1,930,903,164円、同解約元本額は1,005,022,992円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,091円です。

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

■損益の状況

当期 自 2022年6月16日 至 2023年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 6,531円
受取利息	457
支払利息	△ 6,988
(B) 有価証券売買損益	206,938,734
売買益	258,325,447
売買損	△ 51,386,713
(C) 信託報酬等	△ 26,043,726
(D) 当期損益金 (A + B + C)	180,888,477
(E) 前期繰越損益金	330,509,219
(F) 追加信託差損益金	1,463,470,235
(配当等相当額)	(1,658,250,976)
(売買損益相当額)	(△ 194,780,741)
(G) 合計 (D + E + F)	1,974,867,931
次期繰越損益金 (G)	1,974,867,931
追加信託差損益金	1,463,470,235
(配当等相当額)	(1,658,250,976)
(売買損益相当額)	(△ 194,780,741)
分配準備積立金	855,646,964
繰越損益金	△ 344,249,268

(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。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ Ｊ－ＲＥＩＴインデックス）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド」の決算日（2023年3月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2023年6月15日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの主要な売買銘柄
投資証券

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
日本ビルファンド	9.169	5,835,386	636,425	日本ビルファンド	6.706	3,977,141	593,072
ＧＬＰ投資法人	36.946	5,701,348	154,315	ＧＬＰ投資法人	24.443	3,863,822	158,074
日本プロロジスリート	17.148	5,483,484	319,773	ジャパンリアルエステイト	5.791	3,285,586	567,360
ジャパンリアルエステイト	8.978	5,310,028	591,448	野村不動産マスターＦ	18.673	2,973,247	159,227
日本都市ファンド投資法人	39.649	4,166,051	105,073	日本都市ファンド投資法人	29.129	2,958,824	101,576
野村不動産マスターＦ	25.415	4,139,086	162,859	日本プロロジスリート	9.285	2,865,442	308,609
大和ハウスリート投資法人	11.995	3,616,669	301,514	大和ハウスリート投資法人	8.61	2,497,885	290,114
オリックス不動産投資	15.658	2,895,475	184,919	オリックス不動産投資	11.503	2,075,089	180,395
アドバンス・レジデンス	7.862	2,733,936	347,740	アドバンス・レジデンス	5.777	1,966,173	340,345
産業ファンド	16.084	2,677,447	166,466	ユナイテッド・アーバン投資法人	12.942	1,913,909	147,883

(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、2023年6月15日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド（143,357,852千口）の内容です。

(1) 国内投資証券

銘柄	2023年6月15日現在		銘柄	2023年6月15日現在	
	口数	評価額		口数	評価額
	千口	千円		千口	千円
エスコンジャパンリート	8.81	1,040,461	オリックス不動産投資	86.352	15,586,536
サンケイリアルエステート	13.883	1,223,092	日本プライムリアルティ	29.639	10,432,928
SOSILA 物流リート投	21.557	2,880,015	NTT 都市開発リート投資法人	41.66	5,482,456
東海道リート投資法	7.208	874,330	東急リアル・エステート	29.057	5,465,621
日本アコモデーションファンド投資法人	14.964	9,921,132	グローバル・ワン不動産投資法人	31.892	3,485,795
森ヒルズリート	50.962	7,700,358	ユナイテッド・アーバン投資法人	96.945	14,279,998
産業ファンド	66.125	10,375,012	森トラストリート投資法人	80.662	5,710,869
アドバンス・レジデンス	43.332	15,577,854	インヴェンシブル投資法人	190.751	10,834,656
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	31.782	6,858,555	フロンティア不動産投資	16.08	7,871,160
ＡＰＩ投資法人	22.88	9,289,280	平和不動産リート	30.536	4,601,775
ＧＬＰ投資法人	146.113	21,274,052	日本ロジスティクスファンド投資法人	29.222	9,351,040
コンフォリア・レジデンシャル	20.724	7,263,762	福岡リート投資法人	22.414	3,666,930
日本プロロジスリート	75.358	22,388,861	ケネディクス・オフィス投資法人	25.217	8,182,916
星野リゾート・リート	7.58	5,010,380	いちごオフィスリート投資法人	35.511	3,160,479
Oneリート投資法人	7.56	1,818,180	大和証券オフィス投資法人	8.978	5,485,558
イオンリート投資	49.752	7,761,312	阪急阪神リート投資法人	19.576	2,820,901
ヒューリックリート投資法	40.548	6,325,488	スターツプロシード投資法人	7.512	1,754,052
日本リート投資法人	14.077	4,736,910	大和ハウスリート投資法人	65.327	18,768,447
積水ハウス・リート投資	130.228	10,392,194	ジャパン・ホテル・リート投資法人	139.758	10,146,430
トーセイ・リート投資法人	9.614	1,262,318	大和証券リビング投資法人	60.055	6,840,264
ケネディクス商業リート	18.84	5,098,104	ジャパンエクセレント投資法人	39.757	4,834,451
ヘルスケア&メディカル投資	10.685	1,758,751			
サムティ・レジデンシャル	11.265	1,333,776	合 計	2,642.1	457,635,466
野村不動産マスターＦ	140.147	22,633,740	銘柄数 < 比率 >	60 銘柄	< 97.4% >
いちごホテルリート投資	7.18	724,462			
ラサールロジポート投資	53.055	8,568,382			
スターアジア不動産投	54.111	3,235,837			
マリモ地方創生リート	6.62	877,150			
三井不ロジパーク	17.12	8,799,680			
大江戸温泉リート	6.995	456,773			
投資法人みらい	52.652	2,429,889			
三菱地所物流 REIT	14.889	6,305,491			
CRE ロジスティクスファンド	18.568	3,533,490			
ザイマックス・リート	7.03	783,142			
タカラレーベン不動産投	20.429	1,920,326			
アドバンス・ロジスティクス投資法人	18.891	2,584,288			
日本ビルファンド	50.558	28,514,712			
ジャパンリアルエステイト	44.441	24,042,581			
日本都市ファンド投資法人	218.666	21,298,068			

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

(2) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別	2023年6月15日現在	
	買 建 額	売 建 額
国内	百万円	百万円
東証 REIT	10,329	—

(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38期（決算日 2023年3月15日）

（作成対象期間 2022年9月16日～2023年3月15日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

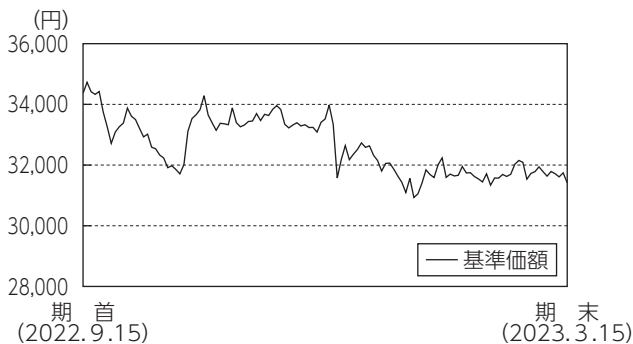
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		東証REIT指数(配当込み)		投資証券組入比率	不動産投資信託先物比率
	円	%	(ベンチマーク)	%		
(期首)2022年9月15日	34,364	-	4,637.15	-	97.5	2.2
9月末	33,265	△3.2	4,488.86	△3.2	97.8	2.2
10月末	33,826	△1.6	4,564.72	△1.6	97.8	2.2
11月末	33,831	△1.6	4,565.38	△1.5	97.8	2.2
12月末	32,633	△5.0	4,403.82	△5.0	97.8	2.2
2023年1月末	31,595	△8.1	4,263.06	△8.1	97.8	2.2
2月末	32,091	△6.6	4,331.37	△6.6	97.8	2.2
(期末)2023年3月15日	31,413	△8.6	4,239.09	△8.6	97.5	2.2

(注1) 騰落率は期首比。

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

(注3) 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：34,364円 期末：31,413円 騰落率：△8.6%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、日銀が金融緩和の見直しを発表したことなどを背景に国内リート市況が下落したことにより、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内リート市況

国内リート市況は下落しました。

国内リート市況は、2022年9月下旬以降10月中旬にかけて、欧米を中心とした金融引き締めによる世界的な景気後退リスクが投資家に強く意識され、米国の長期金利が上昇する中、他のリスク資産と同様に下落しました。加えて、10月に入ると国内リート市場では公募増資の発表が相次ぎ、需給悪化が懸念されたこともマイナス材料になりました。10月末には米国長期金利が低下に転じる中、国内リート市場は割安感が意識され大きく反発し、その後は横ばいで推移しました。12月下旬に日銀が金融緩和の見直しを発表すると大幅に下落しました。その後反発する局面はあったものの、2023年1月に入ると国内金利の上昇懸念が高まり、下落しました。1月下旬にはやや反発し上昇したものの、2月以降は国内外の金利上昇懸念が上値を抑え、ほぼ横ばいの推移となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド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（不動産投資信託先物を含む。）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△8.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△8.6%となりました。

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

*ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 投資証券

(2022年9月16日から2023年3月15日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内	千口 294.36612	千円 43,071,609	千口 176.32 (-)	千円 30,928,867 (-)

(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

(2022年9月16日から2023年3月15日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 不動産投資信託先物取引	百万円 20,880	百万円 21,088	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
投資証券

(2022年9月16日から2023年3月15日まで)

当 期				期 末			
銘	口数	買 付		銘	口数	売 付	
		金額	平均単価			金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
G L P 投資法人	17.779	2,663,027	149,784	日本ビルファンド	3.449	2,054,391	595,648
日本ビルファンド	4.251	2,600,437	611,723	ジャパンリアルエステイト	2.957	1,698,419	574,372
日本プロロジスリート	8.035	2,530,623	314,950	日本都市ファンド投資法人	14.911	1,546,913	103,743
ジャパンリアルエステイト	3.644	2,148,997	589,735	野村不動産マスターF	9.559	1,505,824	157,529
日本都市ファンド投資法人	18.378	1,937,597	105,430	日本プロロジスリート	4.824	1,458,690	302,381
野村不動産マスターF	11.781	1,889,958	160,424	G L P 投資法人	9.093	1,359,441	149,504
大和ハウスリート投資法人	5.493	1,618,110	294,576	大和ハウスリート投資法人	4.457	1,280,323	287,261
オリックス不動産投資	7.259	1,350,122	185,992	オリックス不動産投資	5.89	1,073,491	182,256
アドバンス・レジデンス	3.643	1,236,685	339,469	ユナイテッド・アーバン投資法人	6.627	985,476	148,706
三菱地所物流 R E I T	2.744	1,154,587	420,767	アドバンス・レジデンス	2.956	984,404	333,019

(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) 国内投資証券

銘	口数	期 首		当 期 末	
		口数	評価額	口数	評価額
	千口	千円	千円	千口	千円
エスコンジャパンリート	8.883	9,023	969,972		
サンケイリアルエステート	14	14.22	1,153,242		
S O S I L A 物流リート投	20.429	22.08	2,938,848		
東海道リート投資法	5.299	7.382	834,166		
日本アコモデーションファンド投資法人	15.09	15.327	9,088,911		
森ヒルズリート	51.39	52.198	7,735,743		
産業ファンド	65.307	66.334	9,366,360		
アドバンス・レジデンス	44.382	44.382	14,157,858		
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	31.343	32.553	6,608,259		
A P I 投資法人	23.072	23.435	8,694,385		
G L P 投資法人	134.583	143.269	21,447,369		
コンフォリア・レジデンシャル	20.33	21.227	6,527,302		
日本プロロジスリート	71.61	74.821	21,825,285		
星野リゾート・リート	7.643	7.764	5,372,688		
O n e リート投資法人	7.623	7.743	1,807,990		
イオンリート投資	48.376	50.958	7,378,718		
ヒューリックリート投資法	40.888	41.53	6,158,899		
日本リート投資法人	14.195	14.418	4,570,506		
積水ハウス・リート投資	132.808	133.384	9,416,910		
トーセイ・リート投資法人	9.694	9.847	1,278,140		
ケネディクス商業リート	18.367	19.297	4,679,522		
ヘルスケア&メディカル投資	10.775	10.944	1,805,760		
サムティ・レジデンシャル	11.36	11.538	1,272,641		
野村不動産マスターF	141.322	143.544	21,402,410		
いちごホテルリート投資	7.24	7.354	831,177		
ラサールロジポート投資	53.499	54.34	8,466,732		
スターアジア不動産投	54.565	55.423	3,009,468		
マリモ地方創生リート	5.458	6.78	832,584		
三井不動産リート	17.264	17.535	8,031,030		
大江戸温泉リート	7.054	7.165	452,828		
投資法人みらい	53.928	53.928	2,378,224		
森トラスト・ホテルリート投	10.253	-	-		
三菱地所物流 R E I T	13.485	15.25	6,061,875		
C R E ロジスティクスファンド	16.925	17.191	3,121,885		
ザイマックス・リート	7.089	7.2	790,560		
タカラレーベン不動産投	19.14	20.924	1,853,866		
アドバンス・ロジスティクス投資法人	17.04	19.348	2,575,218		
日本ビルファンド	50.981	51.783	28,998,480		
ジャパンリアルエステイト	43.702	44.389	24,369,561		
日本都市ファンド投資法人	220.499	223.966	22,329,410		
オリックス不動産投資	87.075	88.444	15,265,434		
日本プライムリアルティ	29.887	30.357	10,503,522		
N T T 都市開発リート投資法人	42.009	42.67	5,645,241		
東急リアル・エステート	29.3	29.761	5,595,068		
グローバル・ワン不動産投資法人	29.94	32.665	3,534,353		
ユナイテッド・アーバン投資法人	98.38	99.294	14,357,912		
森トラストリート投資法人	31.234	82.61712	5,684,057		
インヴェンシブル投資法人	192.349	195.373	10,667,365		
フロンティア不動産投資	16.215	16.47	7,847,955		
平和不動産リート	29.867	30.336	4,702,080		
日本ロジスティクスファンド投資法人	29.467	29.93	8,757,518		
福岡リート投資法人	22.602	22.957	3,741,991		
ケネディクス・オフィス投資法人	12.843	25.829	8,161,964		
いちごオフィスリート投資法人	35.809	36.372	3,222,559		
大和証券オフィス投資法人	9.134	9.195	5,664,120		
阪急阪神リート投資法人	19.74	20.05	2,794,970		
スタートアップリート投資法人	6.805	7.694	1,800,396		
大和ハウスリート投資法人	65.874	66.91	18,373,486		
ジャパン・ホテル・リート投資法人	140.93	143.145	10,692,931		
大和証券リビング投資法人	59.128	61.51	6,852,214		
ジャパンエクセレント投資法人	40.09	40.72	4,837,536		
合 計	2,574.047	2,692.09312	449,297,467		
	銘 口数 <比率>	61銘口	60銘口	<97.5%>	

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
		百万円	百万円
国内	東証 R E I T	10,035	-

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年3月15日現在

項 目	当 期 末		
	評 価 額	比 率	
		千円	%
投資証券	449,297,467	96.7	
コール・ローン等、その他	15,529,177	3.3	
投資信託財産総額	464,826,645	100.0	

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年3月15日現在

項 目	当 期 末	
		469,856,020,655円
(A) 資産		
コール・ローン等	5,342,523,520	
投資証券(評価額)	449,297,467,856	
未収入金	4,208,511,227	
未収配当金	5,923,263,052	
差入委託証拠金	5,084,255,000	
(B) 負債	8,845,916,000	
未払金	161,896,000	
未払解約金	3,654,645,000	
差入委託証拠金代用有価証券	5,029,375,000	
(C) 純資産総額(A-B)	461,010,104,655	
元本	146,757,535,055	
次期繰越損益金	314,252,569,600	
(D) 受益権総口数	146,757,535,055口	
1万口当り基準価額(C/D)	31,413円	

*期首における元本額は146,038,189,431円、当作成期間中における追加設定元本額は14,660,692,769円、同解約元本額は13,941,347,145円です。

*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額:

ダイワJ-REITオープン	4,495,828,160円
ダイワJ-REITオープン(毎月分配型)	129,464,704,492円
ダイワJ-REITオープン(年1回決算型)	370,123,728円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	16,037,151円
iFree J-REITインデックス	628,818,799円
iFree 8資産バランス	1,950,408,867円
DC・ダイワJ-REITオープン	5,543,192,416円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	7,158,595円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	6,716,298円
ダイワ国内REITインデックス(投資一任専用)	1,145,254円
ダイワ・ノーロード J-REITファンド	102,823,639円
ダイワファンドラップ J-REITインデックス	2,353,458,731円
ダイワJ-REITインデックス(ダイワSMA専用)	388,781,309円
ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス	504,817,707円
ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	923,519,909円

*当期末の計算口数当りの純資産額は31,413円です。

■損益の状況

当期 自2022年9月16日 至2023年3月15日

項 目	当 期	
		9,481,351,586円
(A) 配当等収益		
受取配当金	9,468,248,026	
受取利息	1,378	
その他収益金	14,728,491	
支払利息	△ 1,626,309	
(B) 有価証券売買損益	△ 52,104,018,617	
売買益	2,601,952,210	
売買損	△ 54,705,970,827	
(C) 先物取引等損益	△ 965,384,000	
取引損	△ 965,384,000	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 43,588,051,031	
(E) 前期繰越損益金	355,810,150,065	
(F) 解約差損益金	△ 31,381,109,435	
(G) 追加信託差損益金	33,411,580,001	
(H) 合計(D+E+F+G)	314,252,569,600	
次期繰越損益金(H)	314,252,569,600	

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

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

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

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス (為替ヘッジあり)

運用報告書(全体版)

第7期

(決算日 2023年6月15日)

(作成対象期間 2022年6月16日～2023年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）／インデックス型	
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）	
運用方針	投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの受益証券
	先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	イ. 先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。） ロ. 先進国のリート指数との連動をめざすETF（上場投資信託証券） ハ. 先進国のリートを対象としたリート指数先物取引
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率 マザーファンドの株式組入上限比率	無制限
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、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、先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券に投資し、S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）に連動する投資成果をあげることがめざしております。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/>

<2736>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (税引後配当込み、 円ヘッジ・円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率	不動産投信 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
3期末(2019年6月17日)	10,760	0	10.7	10,672	10.5	0.6	98.4	1.0	10,895
4期末(2020年6月15日)	9,117	0	△ 15.3	9,003	△ 15.6	2.2	94.5	3.2	12,056
5期末(2021年6月15日)	12,187	0	33.7	12,033	33.7	0.9	97.8	1.7	17,785
6期末(2022年6月15日)	10,481	0	△ 14.0	10,346	△ 14.0	3.6	98.8	2.3	16,269
7期末(2023年6月15日)	10,021	0	△ 4.4	9,881	△ 4.5	2.2	95.7	3.3	18,252

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P先進国REIT指数 (除く日本) (税引後配当込み、円ヘッジ・円ベース) は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。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) 不動産投信先物比率は買建比率-売建比率です。

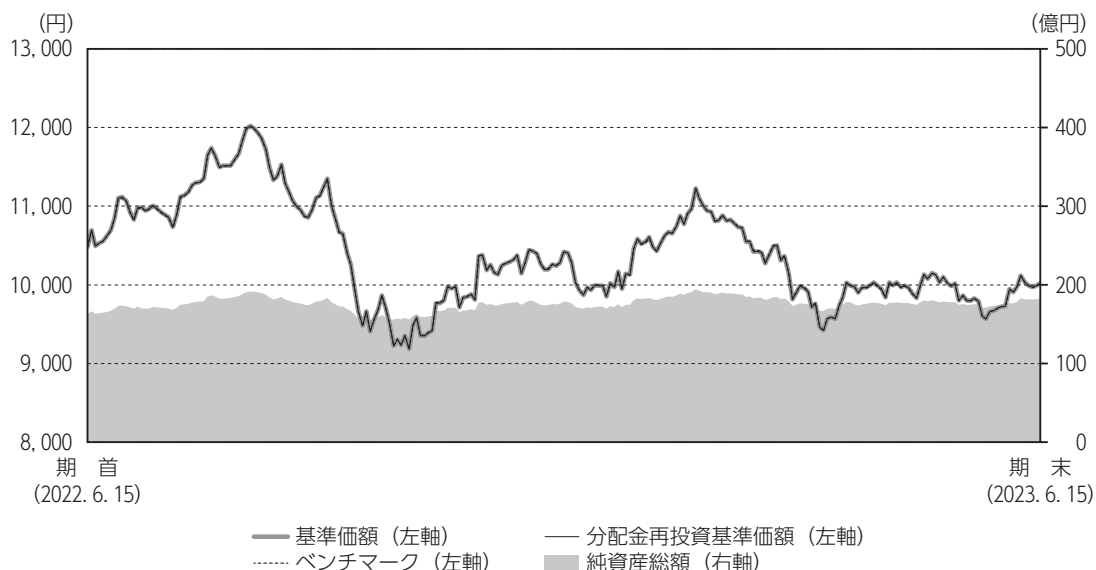
※ベンチマークを「S & P先進国REIT指数 (除く日本) (配当込み、円ヘッジ・円ベース)」から「S & P先進国REIT指数 (除く日本) (税引後配当込み、円ヘッジ・円ベース)」に変更しました。

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



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：10,481円

期末：10,021円(分配金0円)

騰落率：△4.4%(分配金込み)

■ 基準価額の変動要因

「先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド」の受益証券を通じて海外リートに投資した結果、海外リート市況はやや上昇したものの、為替ヘッジコスト等の各種コスト要因に伴い、基準価額も下落しました。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。

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (税引後配当込み、 円ヘッジ・円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率	不動産投信 指数 先物比率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
	円	%		%	%	%	%
(期首) 2022年 6月15日	10,481	—	10,346	—	3.6	98.8	2.3
6月末	10,925	4.2	10,771	4.1	1.2	102.5	2.4
7月末	11,651	11.2	11,492	11.1	3.0	93.7	2.7
8月末	11,069	5.6	10,924	5.6	4.9	94.9	3.9
9月末	9,409	△ 10.2	9,285	△ 10.3	3.8	96.9	3.8
10月末	9,975	△ 4.8	9,850	△ 4.8	4.6	95.2	3.0
11月末	10,283	△ 1.9	10,153	△ 1.9	0.5	92.0	2.0
12月末	10,019	△ 4.4	9,888	△ 4.4	1.4	88.6	5.6
2023年 1月末	10,775	2.8	10,634	2.8	2.0	94.3	3.6
2月末	10,424	△ 0.5	10,303	△ 0.4	4.0	96.6	4.0
3月末	9,841	△ 6.1	9,715	△ 6.1	1.1	93.8	3.6
4月末	9,992	△ 4.7	9,852	△ 4.8	1.9	94.8	4.5
5月末	9,703	△ 7.4	9,575	△ 7.4	1.3	98.4	3.2
(期末) 2023年 6月15日	10,021	△ 4.4	9,881	△ 4.5	2.2	95.7	3.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■海外リート市況

海外リート市況は、当作成期を通して見るとやや上昇しました。

海外リート市況は、当作成期首より、インフレ懸念の一部後退や長期金利が低下したことなどから上昇基調で始まりました。2022年8月中旬にかけては、インフレのピークアウトが期待される中、良好な決算を発表した貸倉庫などを中心に上昇しました。しかしその後は、長期金利の上昇への警戒感などを背景に軟調な推移となりました。また9月下旬には、大規模な財政政策が発表されたことをきっかけに金融市場が混乱した英国に引きずられる格好で大きく下落しました。10月に英国が政権交代により大規模な財政政策を撤回したこと、また、10月半ば以降はFRB（米国連邦準備制度理事会）が利上げ幅を縮小させるとの思惑などを受けて長期金利が低下したこと、やや持ち直しました。2023年1月には、米国の経済指標の結果を受けたインフレ圧力の緩和期待や長期金利の低下を支援材料に大きく上昇しました。しかし、2月には好調な経済指標を受けた米国の利上げ長期化観測が嫌気され、さらに3月に入ると欧米の金融機関の信用不安から、銀行による貸出態度の厳格化観測や景気見通しの不透明感を受けた不動産市況の悪化懸念などを理由に下落しました。その後は、米国当局が必要に応じて支援を拡充する構えを示したことなどから、金融システムへの警戒感が後退する中で反発しましたが、4月以降当作成期末にかけては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

主として「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の受益証券に投資します。

■先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場または店頭登録のリートに投資し、保有する外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、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

（2022. 6. 16～2023. 6. 15）

■当ファンド

「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の受益証券への投資をほぼ100%行いました。

■先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエイトで組成し、保有する外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物を組み入れました。

*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

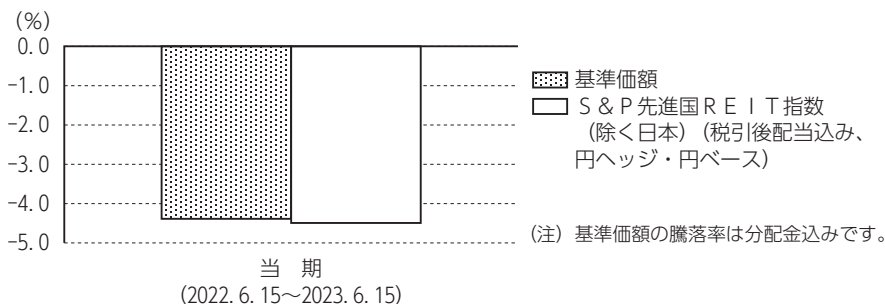
組入ファンド	ベンチマーク
先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	S & P先進国REIT指数（除く日本）（税引後配当込み、円ヘッジ・円ベース）

ベンチマークとの差異について

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

マザーファンドについては、保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、ベンチマークとファンドの為替の評価基準のズレも、かい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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	
	2022年6月16日 ～2023年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	3,133

- （注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- （注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
- （注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。
- （注4）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



今後の運用方針

■当ファンド

主として「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の受益証券に投資します。

■先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、保有する外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2022. 6. 16~2023. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	45円	0.434%	信託報酬＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は10,377円です。
(投信会社)	(31)	(0.302)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(11)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(2)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	3	0.027	売買委託手数料＝当期中の売買委託手数料／当期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.008)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.004)	
(投資証券)	(1)	(0.014)	
有価証券取引税	1	0.011	有価証券取引税＝当期中の有価証券取引税／当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)	
(投資証券)	(1)	(0.011)	
その他費用	5	0.048	その他費用＝当期中のその他費用／当期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.025)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(2)	(0.017)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	54	0.520	

(注1) 当期中の費用(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。

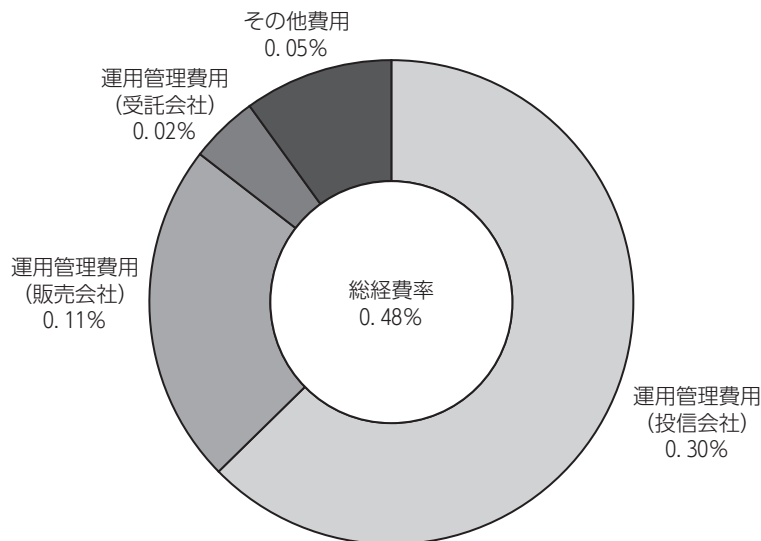
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

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



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	4,755,162	4,092,993	1,633,479	1,416,479

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	18,535,989	18,253,086	21,657,672	18,253,086

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	18,253,086	99.7
コール・ローン等、その他	53,848	0.3
投資信託財産総額	18,306,934	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=140.39円、1カナダ・ドル=105.30円、1オーストラリア・ドル=95.37円、1香港・ドル=17.93円、1シンガポール・ドル=104.58円、1ニュージーランド・ドル=86.93円、1イギリス・ポンド=177.72円、1イスラエル・シケル=39.178円、100韓国・ウォン=11.02円、1ユーロ=152.15円です。

(注3) 先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (23,235,601千円) の投資信託財産総額 (23,531,762千円) 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

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	18,306,934,696円
コール・ローン等	53,848,388
先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド (評価額)	18,253,086,308
(B) 負債	54,838,548
未払解約金	15,666,831
未払信託報酬	38,682,165
その他未払費用	489,552
(C) 純資産総額 (A - B)	18,252,096,148
元本	18,214,604,055
次期繰越損益金	37,492,093
(D) 受益権総口数	18,214,604,055口
1万口当り基準価額 (C/D)	10,021円

* 期首における元本額は15,522,412,035円、当作成期間中における追加設定元本額は5,389,055,347円、同解約元本額は2,696,863,327円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,021円です。

■損益の状況

当期 自 2022年6月16日 至 2023年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 11,855円
受取利息	861
支払利息	△ 12,716
(B) 有価証券売買損益	△ 655,056,040
売買益	100,866,400
売買損	△ 755,922,440
(C) 信託報酬等	△ 77,266,570
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 732,334,465
(E) 前期繰越損益金	△ 165,438,610
(F) 追加信託差損益金	935,265,168
(配当等相当額)	(3,539,154,470)
(売買損益相当額)	(△ 2,603,889,302)
(G) 合計 (D + E + F)	37,492,093
次期繰越損益金 (G)	37,492,093
追加信託差損益金	935,265,168
(配当等相当額)	(3,539,154,470)
(売買損益相当額)	(△ 2,603,889,302)
分配準備積立金	2,167,517,921
繰越損益金	△ 3,065,290,996

(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いません。

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

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

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	3,539,154,470
(d) 分配準備積立金	2,167,517,921
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	5,706,672,391
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	5,706,672,391
(h) 受益権総口数	18,214,604,055口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の決算日（2022年8月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2023年6月15日）現在における先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 325.21	千円 3,922,570	円 12,061	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 344.462	千円 4,106,459	円 11,921

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資証券

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
PROLOGIS INC (アメリカ)	千口 24.317	千円 385,892	円 15,869	PROLOGIS INC (アメリカ)	千口 15.906	千円 257,022	円 16,158
EQUINIX INC (アメリカ)	2.647	243,353	91,935	EQUINIX INC (アメリカ)	1.608	149,109	92,729
REALTY INCOME CORP (アメリカ)	22.363	192,799	8,621	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	2.764	113,318	40,998
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	4.684	185,616	39,627	GOODMAN GROUP (オーストラリア)	65.444	111,848	1,709
VICI PROPERTIES INC (アメリカ)	43.417	179,656	4,137	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	6.506	91,751	14,102
WELLTOWER INC (アメリカ)	15.805	153,350	9,702	REALTY INCOME CORP (アメリカ)	10.175	90,222	8,867
LINK REIT (香港)	156.4	146,082	934	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	5.015	80,805	16,112
GOODMAN GROUP (オーストラリア)	79.945	138,373	1,730	WELLTOWER INC (アメリカ)	7.664	80,165	10,460
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	8.967	133,676	14,907	LINK REIT (香港)	80.4	75,966	944
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	7.78	112,564	14,468	VICI PROPERTIES INC (アメリカ)	16.702	70,688	4,232

(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、2023年6月15日現在における先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド（27,483,964千口）の内容です。

(1) 外国投資信託受益証券

銘柄	口数	2023年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ) VANGUARD REAL ESTATE ETF	千口 44.26	千アメリカ・ドル 3,697	千円 519,089
合計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	44.26	3,697 <2.2%>

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資証券

銘柄	口数	2023年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)	千口	千アメリカ・ドル	千円
DIGITAL CORE REIT UNITS	38.7	18	2,607
MANULIFE US REAL ESTATE INV	203.4	34	4,825
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	82.3	25	3,581
PRIME US REIT	68.4	15	2,112
(アメリカ)			
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	16.643	226	31,823
URBAN EDGE PROPERTIES	14.866	222	31,180
XENIA HOTELS & RESORTS INC	14.412	178	25,068
AVALONBAY COMMUNITIES INC	17.309	3,291	462,090
SIMON PROPERTY GROUP INC	40.452	4,486	629,807
BOSTON PROPERTIES INC	17.65	957	134,375

銘柄	2023年6月15日現在		
	口数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	18.199	152	21,436
VORNADO REALTY TRUST	19.757	301	42,381
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11.496	166	23,369
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10.362	364	51,118
NEXPOINT RESIDENTIAL	2.878	130	18,266
EQUITY RESIDENTIAL	42.14	2,796	392,647
APPLE HOSPITALITY REIT INC	26.085	395	55,590
EPR PROPERTIES	9.199	420	59,032
CITY OFFICE REIT INC	4.603	25	3,541
GLOBAL NET LEASE INC	13.139	140	19,700
EQUINIX INC	11.449	8,881	1,246,930
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10.286	271	38,065
CHATHAM LODGING TRUST	5.858	55	7,730
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6.764	634	89,043
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	15.765	212	29,768
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2.824	97	13,697
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6.929	28	3,949
HOST HOTELS & RESORTS INC	88.468	1,544	216,853
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	37.977	1,322	185,699
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	15.392	73	10,372
RLJ LODGING TRUST	20.514	211	29,749
FARMLAND PARTNERS INC	5.962	74	10,395
PHYSICIANS REALTY TRUST	27.988	404	56,856
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8.574	102	14,408
KIMCO REALTY CORP	76.523	1,476	207,341
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7.392	69	9,796
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	47.087	921	129,302
WHITESTONE REIT	5.635	54	7,586
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	31.862	1,597	224,236
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14.81	101	14,283
PARK HOTELS & RESORTS INC	27.569	369	51,902
INVITATION HOMES INC	71.866	2,446	343,438
JBG SMITH PROPERTIES	12.531	191	26,880
ALEXANDER & BALDWIN INC	9.177	171	24,092
CLIPPER REALTY INC	1.647	9	1,267
GLADSTONE LAND CORP	3.874	66	9,354
AMERICOLD REALTY TRUST	33.332	1,060	148,947
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7.31	18	2,637
VICI PROPERTIES INC	124.184	4,021	564,519
BRT APARTMENTS CORP	1.402	27	3,869
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3.429	249	34,978
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	16.991	119	16,840
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17.458	430	60,415
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4.936	112	15,758
BROADSTONE NET LEASE INC	21.227	346	48,634
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13.532	89	12,500
LIFE STORAGE INC	10.517	1,345	188,945
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6.248	121	17,095
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	27.446	508	71,360
PARAMOUNT GROUP INC	20.87	95	13,448
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	15.789	110	15,449
NETSTREIT CORP	6.947	127	17,847
APARTMENT INCOME REIT CO	18.237	672	94,474
CTO REALTY GROWTH INC	2.544	42	5,982
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	23.399	1,243	174,531
STAG INDUSTRIAL INC	21.975	805	113,067
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1.311	20	2,930
INDUS REALTY TRUST INC	0.564	37	5,300
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2.085	30	4,346
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	14.361	482	67,782
ORION OFFICE REIT INC	6.028	38	5,449
VENTAS INC	49.49	2,292	321,826
CARETRUST REIT INC	12.202	242	34,038
INVENTRUST PROPERTIES CORP	8.535	200	28,146
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	36.774	792	111,307
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	6.148	48	6,766
SABRA HEALTH CARE REIT INC	28.321	335	47,155
UMH PROPERTIES INC	6.804	110	15,474
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3.103	71	10,076
BLUEROCK HOMES TRUST INC CLASS A	0.392	6	881
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	3.471	40	5,672
STAR HOLDINGS SHARES OF BENEFICIAL	1.592	22	3,175

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

銘柄	2023年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
IRON MOUNTAIN INC	35.969	2,040	286,418
TERRENO REALTY CORP	8.946	522	73,296
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17.124	683	95,897
SUN COMMUNITIES INC	15.329	2,050	287,899
ACADIA REALTY TRUST	12.02	171	24,046
ALEXANDER'S INC	0.272	50	7,051
PROLOGIS INC	114.21	13,964	1,960,470
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19.488	2,375	333,563
BRANDYWINE REALTY TRUST	21.718	95	13,476
SAUL CENTERS INC	1.633	60	8,427
VERIS RESIDENTIAL INC	10.031	170	23,912
CAMDEN PROPERTY TRUST	13.627	1,522	213,807
COUSINS PROPERTIES INC	18.58	404	56,785
SITE CENTERS CORP	22.493	296	41,651
EASTGROUP PROPERTIES INC	5.392	937	131,631
ESSEX PROPERTY TRUST INC	7.993	1,865	261,895
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	16.349	855	120,040
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9.059	854	119,942
GETTY REALTY CORP	5.383	188	26,465
WELLTOWER INC	58.464	4,767	669,260
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	67.652	1,400	196,601
HIGHWOODS PROPERTIES INC	12.901	290	40,715
SERVICE PROPERTIES TRUST	20.944	185	26,051
EQUITY COMMONWEALTH	13.434	286	40,171
KILROY REALTY CORP	12.921	394	55,380
LTC PROPERTIES INC	5.127	174	24,508
LXP INDUSTRIAL TRUST	33.808	347	48,792
MID-AMERICA APARTMENT COMM	14.288	2,191	307,703
MACERICH CO/THE	26.392	296	41,572
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	21.646	1,464	205,549
NATL HEALTH INVESTORS INC	5.32	286	40,211
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	22.452	956	134,213
REALTY INCOME CORP	77.596	4,747	666,476
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	13.785	329	46,311
PUBLIC STORAGE	19.558	5,556	780,121
REGENCY CENTERS CORP	19.055	1,159	162,754
RPT REALTY	10.232	105	14,853
SAFEHOLD INC	4.575	108	15,273
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	12.795	275	38,674
SL GREEN REALTY CORP	8.15	212	29,805
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	29.173	88	12,491
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3.667	76	10,749
UDR INC	38.263	1,649	231,575
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.607	78	11,002
WP CAREY INC	26.06	1,822	255,806
ELME	11.078	174	24,495
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4.132	16	2,378
AGREE REALTY CORP	10.86	714	100,275
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	28.983	904	126,950
CUBESMART	27.786	1,215	170,624
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	25.798	261	36,761
DIGITAL REALTY TRUST INC	35.574	3,752	526,841
EXTRA SPACE STORAGE INC	16.57	2,374	333,399
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4.032	24	3,413
CENTERSPACE	1.908	118	16,666
KITE REALTY GROUP TRUST	26.865	565	79,353
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1.965	41	5,776
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4.549	58	8,270
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	26.504	216	30,325
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	73.445	666	93,623
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	11.605	16	2,297
DOUGLAS EMMETT INC	21.554	269	37,824
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金 額	3,094,356	17,101,786
	銘柄 数 < 比 率 >	144 銘柄	<73.8%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2	6	676
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4.6	14	1,545
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	5.6	15	1,657
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	3.6	30	3,233
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	6.525	83	8,780
PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	3.5	18	1,964

銘柄	2023年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千カナダ・ドル	千円
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	2.026	33	3,549
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	7.1	51	5,382
SLATE GROCERY REIT	3.6	46	4,946
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7.3	130	13,690
SLATE OFFICE REIT	4.9	9	1,031
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2.5	38	4,004
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15.7	120	12,729
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5.5	13	1,453
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2.4	27	2,946
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4.2	337	35,513
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	16.3	226	23,874
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	8.9	113	11,939
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	13.5	204	21,536
CHOICE PROPERTIES REIT	20.8	277	29,261
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2.4	39	4,174
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	7	104	11,019
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	9.2	231	24,335
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10.9	544	57,319
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	17.7	182	19,234
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	19	377	39,793
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3	44	4,662
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2.9	174	18,325
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6.9	100	10,549
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8.1	184	19,412
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	227.651 30銘柄	3,784 <1.7%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU	141.069	1,110	105,881
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	52.157	73	6,988
HMC CAPITAL LTD	25.139	114	10,908
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	46.291	30	2,891
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	45.483	132	12,622
CROMWELL PROPERTY GROUP	184.36	96	9,230
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	69.8	212	20,303
RURAL FUNDS GROUP	50.015	85	8,132
WAYPOINT REIT	86.888	235	22,456
CHARTER HALL LONG WALE REIT	86.457	351	33,476
CENTURIA OFFICE REIT	52.359	73	6,965
CENTURIA CAPITAL GROUP	92.458	148	14,152
HOMECO DAILY NEEDS REIT	200.894	228	21,745
REGION GROUP	152.66	361	34,505
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	38.675	111	10,622
NATIONAL STORAGE REIT	155.886	383	36,572
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	26.925	72	6,933
GDI PROPERTY GROUP	64.299	44	4,200
SCENTRE GROUP	680.758	1,763	168,152
ARENA REIT	46.46	171	16,394
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	26.404	86	8,259
BWP TRUST	62.311	225	21,512
GPT GROUP	251.243	1,009	96,323
CHARTER HALL RETAIL REIT	66.904	242	23,161
MIRVAC GROUP	517.53	1,128	107,597
STOCKLAND	313.096	1,274	121,530
ABACUS PROPERTY GROUP	52.859	136	13,006
GOODMAN GROUP	224.441	4,419	421,463
VICINITY CENTRES	507.506	943	90,025
CHARTER HALL GROUP	61.174	665	63,475
INGENIA COMMUNITIES GROUP	47.821	190	18,197
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,430.322 31銘柄	1,537,690 <6.6%>
(香港)	千口	千香港・ドル	千円
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	291	494	8,869
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	128	362	6,494
FORTUNE REIT	188	1,054	18,910
PROSPERITY REIT	156	268	4,810
LINK REIT	331.7	15,506	278,040
CHAMPION REIT	246	671	12,041
香港・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,340.7 6銘柄	329,167 <1.4%>

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

銘柄	2023年6月15日現在		
	□ 数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)			
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	66.1	38	4,043
AIMS APAC REIT	2.39	0	14
KEPPEL DC REIT	175.8	356	37,321
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	153.8	39	4,181
AIMS APAC REIT	68.3	80	8,428
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	374.4	464	48,551
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	66.4	45	4,756
LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	244.5	163	17,131
EC WORLD REIT	32.9	10	1,135
CAPITALAND ASCENDAS REIT	440.8	1,176	123,083
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	660.4	1,300	136,057
SUNTEC REIT	291.2	369	38,676
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	423.2	702	73,468
KEPPEL REIT	256.5	228	23,874
CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRUST	280.9	297	31,139
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	761.7	239	25,092
CDL HOSPITALITY TRUSTS	108.2	130	13,691
FRASERS CENTREPOINT TRUST	142.6	310	32,510
STARHILL GLOBAL REIT	188.2	95	10,037
CAPITALAND CHINA TRUST	152.8	154	16,139
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	50.5	186	19,540
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	258.9	577	60,378
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	298	494	51,733
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	143.2	85	8,985
PARAGON REIT	141.9	133	13,949
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	316.2	101	10,581
シンガポール・ドル通貨計	6,099.79	7,788	814,508
□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	26銘柄		<3.5%>
(ニュージーランド)			
STRIDE PROPERTY GROUP	64.452	86	7,507
ARGOSY PROPERTY LTD	108.963	120	10,514
KIWI PROPERTY GROUP LTD	202.139	180	15,726
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	60.746	140	12,198
GOODMAN PROPERTY TRUST	136.116	294	25,558
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	183.185	227	19,746
ニュージーランド・ドル通貨計	755.601	1,049	91,251
□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	6銘柄		<0.4%>
(イギリス)			
WAREHOUSE REIT PLC	55.82	49	8,868
EDISTON PROPERTY INVESTMENT COMPANY	24.551	15	2,705
ASSURA PLC	380.806	177	31,483
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	74.712	64	11,538
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITED	51.354	26	4,636
CLS HOLDINGS PLC	20.382	27	4,962
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	112.677	60	10,833
PICTON PROPERTY INCOME LTD	64.471	49	8,730
REGIONAL REIT LTD	54.681	27	4,815
NEWRIVER REIT PLC	39.166	34	6,201
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	228.947	269	47,808
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	73.284	58	10,380
CUSTODIAN REIT PLC	51.902	47	8,356
PRS REIT PLC/THE	64.664	52	9,377
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	53.298	49	8,809
LXI REIT PLC	220.524	217	38,740
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	46.825	24	4,352
AEW UK REIT PLC	20.041	20	3,632
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST	102.818	79	14,124
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	163.262	129	22,950
URBAN LOGISTICS REIT PLC	58.444	75	13,502
HOME REIT PLC	84.338	32	5,703
LAND SECURITIES GROUP PLC	95.938	569	101,243
SEGRO PLC	154.426	1,166	207,316
HAMMERSON PLC	514.732	135	24,168
UNITE GROUP PLC/THE	51.114	454	80,847
BRITISH LAND CO PLC	119.772	400	71,243
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	32.654	150	26,776
DERWENT LONDON PLC	14.136	298	53,058
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	171.906	170	30,337
WORKSPACE GROUP PLC	17.748	91	16,291
SAFESTORE HOLDINGS PLC	27.984	255	45,431

銘柄	2023年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千円	千円	千円
BIG YELLOW GROUP PLC	22,516	252	44,817
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	126,393	224	39,983
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	71,398	32	5,741
TRITAX BIG BOX REIT PLC	235,253	323	57,571
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	3,702,937 36 銘柄	6,118 <4.7%>
(イスラエル)	千円	千イスラエル・シケル	千円
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	82,303	142	5,588
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT REIT 1 LTD	26.7 22,083	212 357	8,344 14,024
イスラエル・シケル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	131,086 3 銘柄	713 <0.1%>
(韓国)	千円	千韓国・ウォン	千円
SK REITS LTD	7,476	38,426	4,234
D&D PLATFORM REIT LTD	6,865	22,963	2,530
SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD	3,286	12,059	1,328
NH ALL ONE REIT LTD	3,459	12,850	1,416
E KOCREF CR	2,796	14,958	1,648
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	7,432	46,375	5,110
LOTTE REIT CO LTD	15,417	60,974	6,719
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	11,781	52,130	5,744
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	3,918	19,041	2,098
JR REIT XXVII	16,902	77,495	8,540
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5,393	30,039	3,310
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	18,659	76,408	8,420
韓国・ウォン通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	103,384 12 銘柄	463,724 <0.2%>
ユーロ (アイルランド)	千円	千ユーロ	千円
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	44,558	45	6,874
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	44,558 1 銘柄	45 <0.0%>
ユーロ (オランダ)	千円	千ユーロ	千円
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	4.98	111	16,987
WERELDHAVE NV	4,699	66	10,045
NSI NV	1,842	37	5,675
VASTNED RETAIL NV	1,879	37	5,774
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	13.4 4 銘柄	252 <0.2%>
ユーロ (ベルギー)	千円	千ユーロ	千円
AEDIFICA	4.65	308	46,871
COFINIMMO	3,567	269	40,975
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS RETAIL ESTATES	3.07 1,315	48 84	7,333 12,824
WAREHOUSES DE PAUW SCA	18,023	475	72,339
CARE PROPERTY INVEST	4,054	53	8,215
XIOR STUDENT HOUSING NV	2,745	81	12,362
MONTEA NV	1,577	121	18,523
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	39,001 8 銘柄	1,442 <0.9%>
ユーロ (フランス)	千円	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	12,422	582	88,584
ICADE	3,736	149	22,805
CARMILA	6,707	98	14,919
ALTAREA	0,505	52	7,914
GECINA SA	6,325	619	94,310
KLEPIERRE	22,678	505	76,979
COVIVIO	5,419	250	38,124
MERCIALYS	8,982	72	11,062
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	66,774 8 銘柄	2,331 <1.5%>
ユーロ (ドイツ)	千円	千ユーロ	千円
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	0,914	4	721
HAMBORNER REIT AG	8,342	57	8,821
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	9,256 2 銘柄	62 <0.0%>
ユーロ (スペイン)	千円	千ユーロ	千円
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7,263	38	5,856
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	34,627	197	29,977

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

銘柄		2023年6月15日現在		
		□ 数	評 価 額	
	外 貨 建 金 額		千ユーロ	邦 貨 換 算 金 額
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		千口 38.915	千ユーロ 307	千円 46,745
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	80.805 3 銘柄	542	82,580 <0.4%>
ユーロ（イタリア） IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		千口 6.703	千ユーロ 17	千円 2,595
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	6.703 1 銘柄	17	2,595 <0.0%>
ユーロ（その他） CROMWELL REIT EUR		千口 38	千ユーロ 60	千円 9,135
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	38 1 銘柄	60	9,135 <0.0%>
ユ ー ロ 通 貨 計		□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	298.497 28 銘柄	4,754 723,358 <3.1%>
合 計		□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	20,184.324 322 銘柄	— 22,162,714 <95.7%>

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別		2023年6月15日現在	
		買 建 額	売 建 額
外 国	DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	百万円 621	百万円 —
	STOXX 600 REAL (ドイツ)	148	—

(注1) 外貨建の評価額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) 単位未満は切捨て。

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

運用報告書 第1期（決算日 2022年8月15日）

（作成対象期間 2021年10月6日～2022年8月15日）

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	イ. 先進国（日本を除きます。以下同じ。）の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）または店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「リート」といいます。） ロ. 先進国のリート指数との連動をめざすETF（上場投資信託証券） ハ. 先進国のリートを対象としたリート指数先物取引
株式組入制限	無制限

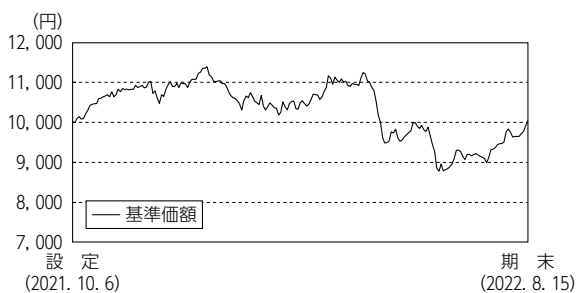
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）		投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物組入比率
	円	騰落率%	円	騰落率%	%	%	%
(期首) 2021年10月6日	10,000	—	10,000	—	—	—	—
10月末	10,769	7.7	10,739	7.4	0.5	96.5	5.2
11月末	10,795	8.0	10,773	7.7	0.3	95.9	2.8
12月末	11,358	13.6	11,341	13.4	1.3	96.4	3.9
2022年1月末	10,548	5.5	10,549	5.5	1.2	96.1	2.6
2月末	10,518	5.2	10,522	5.2	1.3	96.7	2.5
3月末	11,113	11.1	11,171	11.7	0.1	98.7	7.2
4月末	10,805	8.1	10,866	8.7	1.3	100.8	3.2
5月末	9,999	△ 0.0	10,053	0.5	2.5	94.6	2.2
6月末	9,150	△ 8.5	9,207	△ 7.9	1.2	102.5	2.4
7月末	9,762	△ 2.4	9,827	△ 1.7	3.0	93.7	2.7
(期末) 2022年8月15日	10,040	0.4	10,114	1.1	4.1	92.1	3.8

- (注1) 騰落率は期首比。
 (注2) S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。
 (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
 (注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
 (注5) 不動産投信指数先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

設定時：10,000円 期末：10,040円 騰落率：0.4%

【基準価額の主な変動要因】

米国を中心としたリート市況の上昇を受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は上昇しました。

海外リート市況は、当作成期首より、好調な決算発表や米国長期金利の低下に加え、中国大手不動産会社に対する信用不安の後退などから上昇して始まりました。2022年に入ると、2021年12月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）議事録を受けて米国の金融引き締めに対する懸念が高まり、米国を中心に下落に転じました。2月から3月にかけては、欧米の中央銀行高官の金融政策に対する発言やロシアのウクライナへの侵攻、ロシアとウクライナの断片的な停戦協定による状況改善期待などから一進一退の展開となりましたが、4月以降は、米国の金融引き締めの加速懸念などからリスク回避の展開となり、リート市況も米国を中心に大きく下落しました。7月以降は、過度な金融引き締め懸念の後退を受けて持ち直す展開となり、当作成期末を迎えました。

◆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ェイトで組成し、保有する外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物を組み入れました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は1.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は0.4%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。

なお、組み入れているリートポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異も、かい離要因としてあげられます。

※ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ヘッジ・円ベース）です。

《今後の運用方針》

先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行うことにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）および不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 （先物・オプション）	6円 (0)
（投資信託受益証券）	(0)
（投資信託証券）	(5)
有価証券取引税 （投資信託受益証券）	8 (0)
（投資信託証券）	(8)
その他費用 （保管費用）	4 (3)
（その他）	(1)
合計	18

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2021年10月6日から2022年8月15日まで)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外 国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	173.749	17,049	101.337	9,599
	()	()	()	()

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

(2) 投資信託証券

(2021年10月6日から2022年8月15日まで)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外 国	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	3,583.288	167,973	644.183	29,380
	(△ 42,856)	(△ 2,777)	()	()
カナダ	266.5	5,786	40.4	886
	(△ 0.075)	(△ 10)	()	()
オーストラリア	5,038.1	21,880	978.476	4,154
	(4,581)	(1)	()	()
香港	1,418.4	25,386	216.55	4,120
	(5.55)	()	()	()
シンガポール	7,091.2	10,421	1,545.9	2,248
	()	(△ 39)	()	()
ニュージーランド	726.487	1,232	67.721	114
	()	(△ 1)	()	()
イギリス	3,755.908	9,808	573.628	1,657
	()	(△ 0)	()	()
イスラエル	52.597	823	—	—
	()	()	()	()
韓国	110.011	653,383	14.519	56,887
	(5,096)	(10)	()	()

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外 国	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
ユーロ (アイルランド)	145.075	192	100.517	157
	()	()	()	()
ユーロ (オランダ)	15.374	352	3.373	74
	(0.06)	(0)	()	()
ユーロ (ベルギー)	43.057	2,452	9.011	478
	()	()	()	()
ユーロ (フランス)	72.403	3,338	15.838	677
	()	(△ 46)	()	()
ユーロ (ドイツ)	12.307	133	3.19	39
	()	()	()	()
ユーロ (スペイン)	88.046	794	18.111	157
	()	(△ 14)	()	()
ユーロ (イタリア)	10.074	53	3.371	30
	()	()	()	()
ユーロ (その他)	41	95	8.9	18
	()	(△ 0)	()	()
ユーロ (ユーロ通貨計)	427.336	7,412	162.311	1,633
	(0.06)	(△ 61)	()	()

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2021年10月6日から2022年8月15日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
不動産投信指数先物取引	3,319	2,537	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2021年10月6日から2022年8月15日まで)

銘 柄	当 期			期 付		
	口数	金額	平均単価	口数	金額	平均単価
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口	千円	円	千口	千円	円
	173.749	2,247,755	12,936	101.337	1,281,704	12,647

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2021年10月6日から2022年8月15日まで)

銘 柄	当 期			期 付		
	口数	金額	平均単価	口数	金額	平均単価
PROLOGIS INC (アメリカ)	千口	千円	円	千口	千円	円
	102.012	1,929,150	18,911	19.275	364,476	18,909
EQUINIX INC (アメリカ)	12.41	1,091,987	87,992	2.237	205,820	92,007
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	21.03	934,286	44,426	3.962	183,191	46,237
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	45.299	727,396	16,057	7.285	131,553	18,058
WELLTOWER INC (アメリカ)	61.641	686,142	11,131	8.601	128,673	14,960
REALTY INCOME CORP (アメリカ)	80.144	663,334	8,276	14.261	127,874	8,966
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	39.102	661,667	16,921	10.902	127,490	11,694
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	19.255	564,377	29,310	3.628	105,717	29,139
GOODMAN GROUP (オーストラリア)	259.055	526,384	2,031	51.621	103,647	2,007
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	47.084	500,991	10,640	8.838	93,793	10,612

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国投資信託受益証券

銘柄	当 期 末		
	□ 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
VANGUARD REAL ESTATE ETF	72.412	7,365	979,423
合 計	□ 数、金 額	72.412	7,365 979,423
	銘柄数<比率>	1銘柄	<4.1%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)	千口	千アメリカ・ドル	千円
DIGITAL CORE REIT UNITS	38.7	34	4,554
MANULIFE US REAL ESTATE INV	203.4	112	15,010
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	95.4	63	8,499
PRIME US REIT	68.4	45	6,048
(アメリカ)			
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	14.681	298	39,628
URBAN EDGE PROPERTIES	12.73	215	28,606
XENIA HOTELS & RESORTS INC	13.204	234	31,199
AVALONBAY COMMUNITIES INC	15.627	3,409	453,319
SIMON PROPERTY GROUP INC	36.698	4,251	565,317
BOSTON PROPERTIES INC	15.939	1,436	190,979
APARTMENT INVT & MGMT CO - A	17.065	163	21,783
VORNADO REALTY TRUST	17.787	542	72,183
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	10.146	192	25,660
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9.405	539	71,783
NEXPOINT RESIDENTIAL	2.585	167	22,304
EQUITY RESIDENTIAL	38.246	3,058	406,642
APPLE HOSPITALITY REIT INC	23.791	410	54,601
EPR PROPERTIES	8.379	463	61,679
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.138	81	10,894
CITY OFFICE REIT INC	5.316	71	9,535
GLOBAL NET LEASE INC	11.978	179	23,874
EQUINIX INC	10.173	7,167	953,060
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8.982	261	34,755
CHATHAM LODGING TRUST	5.953	81	10,828
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6.164	577	76,815
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	13.882	253	33,724
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2.634	107	14,296
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6.929	38	5,067
HOST HOTELS & RESORTS INC	79.888	1,560	207,461
AMERICAN HOMES 4 RENT - A	33.028	1,267	168,598
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	16.164	249	33,164
RLJ LODGING TRUST	18.648	250	33,276
FARMLAND PARTNERS INC	3.465	51	6,892
PHYSICIANS REALTY TRUST	25.181	457	60,805
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	7.567	108	14,378
KIMCO REALTY CORP	69.073	1,612	214,461
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7.367	90	11,970
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	42.547	1,120	149,017
WHITESTONE REIT	5.635	62	8,369
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	26.284	1,368	181,913
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	13.784	185	24,706
PARK HOTELS & RESORTS INC	26.083	418	55,665
INVITATION HOMES INC	68.214	2,700	359,097
JBG SMITH PROPERTIES	12.152	297	39,523
ALEXANDER & BALDWIN INC	8.385	170	22,633
CLIPPER REALTY INC	1.647	15	2,001
GLADSTONE LAND CORP	3.8	98	13,147
AMERICOLD REALTY TRUST	30.096	976	129,860
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7.31	70	9,370
VICI PROPERTIES INC	107.632	3,809	506,495
BRT APARTMENTS CORP	1.402	35	4,725
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3.126	307	40,917
SAFEHOLD INC	1.726	79	10,582
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	15.076	120	16,057

銘柄	当 期 末		
	□ 数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	15.538	394	52,457
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4.8	101	13,492
STORE CAPITAL CORP	28.222	824	109,653
CREATIVE MEDIA AND COMMUNITY TRUST	1.854	13	1,762
BROADSTONE NET LEASE INC	18.923	400	53,318
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	11.966	106	14,129
LIFE STORAGE INC	9.429	1,278	169,974
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6.088	185	24,633
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	24.689	550	73,241
PARAMOUNT GROUP INC	18.985	149	19,867
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	15.266	124	16,604
NETSTREIT CORP	5.478	114	15,223
APARTMENT INCOME REIT CO	17.558	804	106,952
CTO REALTY GROWTH INC	2.184	49	6,551
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	18.444	1,251	166,377
STAG INDUSTRIAL INC	20.03	695	92,446
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1.311	24	3,224
INDUS REALTY TRUST INC	0.807	51	6,847
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2.085	34	4,604
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	12.73	438	58,347
ORION OFFICE REIT INC	6.912	75	10,036
VENTAS INC	44.673	2,343	311,621
CARETRUST REIT INC	11.218	247	32,935
INVENTRUST PROPERTIES CORP	7.532	222	29,615
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	33.478	807	107,371
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5.412	111	14,795
SABRA HEALTH CARE REIT INC	25.813	427	56,805
UMH PROPERTIES INC	6.036	118	15,763
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3.127	99	13,284
IRON MOUNTAIN INC	32.475	1,754	233,312
TERRENO REALTY CORP	8.442	556	74,031
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	15.011	671	89,281
SUN COMMUNITIES INC	13.592	2,333	310,300
ACADIA REALTY TRUST	10.605	188	25,100
ALEXANDER'S INC	0.262	68	9,062
PROLOGIS INC	82.737	11,354	1,509,851
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16.601	2,823	375,462
BRANDYWINE REALTY TRUST	19.784	175	23,281
SAUL CENTERS INC	1.591	80	10,645
VERIS RESIDENTIAL INC	9.253	137	18,332
CAMDEN PROPERTY TRUST	11.906	1,734	230,695
COUSINS PROPERTIES INC	16.627	510	67,874
SITE CENTERS CORP	20.314	305	40,571
DUKE REALTY CORP	42.969	2,786	370,583
EASTGROUP PROPERTIES INC	4.658	826	109,839
ESSEX PROPERTY TRUST INC	7.302	2,169	288,497
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	14.753	815	108,443
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7.989	892	118,637
GETTY REALTY CORP	4.815	145	19,399
WELLTOWER INC	50.739	4,195	557,889
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	60.305	1,710	227,492
HIGHWOODS PROPERTIES INC	11.753	416	55,416
SERVICE PROPERTIES TRUST	19.087	156	20,836
EQUITY COMMONWEALTH	12.593	342	45,579
KILROY REALTY CORP	11.741	628	83,617
LTC PROPERTIES INC	4.552	202	26,880
LXP INDUSTRIAL TRUST	32.038	361	48,011
MID-AMERICA APARTMENT COMM	12.901	2,422	322,143
MACERICH CO/THE	23.99	275	36,684
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19.335	1,485	197,553
NATL HEALTH INVESTORS INC	5.125	339	45,086
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	19.661	946	125,801
REALTY INCOME CORP	67.239	5,020	667,607
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	12.564	349	46,493
PENN REAL ESTATE INVEST TST	0.509	3	460
PUBLIC STORAGE	17.068	6,002	798,194
REGENCY CENTERS CORP	17.338	1,149	152,850
RPT REALTY	9.513	103	13,813
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	12.022	214	28,486
SL GREEN REALTY CORP	7.167	363	48,383
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	29.173	58	7,719
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3.682	67	9,018
UDR INC	33.452	1,676	222,983
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.565	87	11,678
WP CAREY INC	21.558	1,894	251,913

銘柄	当期末		
	□数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
WASHINGTON REIT	9.771	211	28,141
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4.132	47	6,334
AGREE REALTY CORP	8.402	663	88,226
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	26.29	882	117,318
CUBESMART	25.085	1,269	168,812
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	24.053	284	37,772
DIGITAL REALTY TRUST INC	31.817	4,181	555,999
CEDAR REALTY TRUST INC	1.501	43	5,776
EXTRA SPACE STORAGE INC	15.008	3,181	422,990
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4.032	44	5,918
CENTERSPACE	1.717	152	20,335
KITE REALTY GROUP TRUST	24.481	538	71,647
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1.965	53	7,073
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4.549	94	12,617
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	23.567	232	30,960
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	67.071	1,121	149,116
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	11.605	38	5,061
DOUGLAS EMMETT INC	19.647	445	59,302
アメリカ・ドル □数、金額	2,896.249	128,291	17,058,901
通貨計 銘柄数 <比率>	147銘柄		<70.7%>
	千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)			
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2	14	1,499
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4.6	17	1,872
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	5.6	20	2,168
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	3.6	38	4,002
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	5.725	83	8,719
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	7.1	84	8,817
SLATE GROCERY REIT	3.6	54	5,688
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	6.7	121	12,638
SLATE OFFICE REIT	4.9	22	2,356
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2.5	38	4,041
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	14.2	187	19,468
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	11	212	22,100
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5.5	34	3,629
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2.4	31	3,315
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3.8	311	32,401
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	14.6	190	19,818
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	8.1	105	10,970
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	13	206	21,503
CHOICE PROPERTIES REIT	18.7	270	28,148
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2.4	43	4,514
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	6.2	106	11,088
PLAZA RETAIL REIT	6.3	27	2,872
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	8.7	262	27,369
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10.4	494	51,468
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	16.5	229	23,875
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	18.5	397	41,367
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3	59	6,230
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2.7	136	14,261
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6.1	102	10,649
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7.6	260	27,160
カナダ・ドル □数、金額	226.025	4,169	434,019
通貨計 銘柄数 <比率>	30銘柄		<1.8%>
	千口	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)			
DEXUS/AU	130.887	1,198	113,586
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	33.012	54	5,129
HOME CONSORTIUM LTD	21.693	108	10,255
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	46.291	38	3,618
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	39.378	147	13,990
CROMWELL PROPERTY GROUP	167.757	134	12,714
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	65.291	195	18,557
RURAL FUNDS GROUP	45.313	119	11,333
WAYPOINT REIT	87.433	223	21,205
CHARTER HALL LONG WALE REIT	74.981	334	31,682
CENTURIA OFFICE REIT	52.359	89	8,482
CENTURIA CAPITAL GROUP	75.235	145	13,792
HOMEACO DAILY NEEDS REIT	176.023	228	21,679
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	136.23	396	37,557
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	34.802	128	12,133
NATIONAL STORAGE REIT	132.724	323	30,681
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	26.502	75	7,105

銘柄	当期末		
	□数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千オーストラリア・ドル	千円
GDI PROPERTY GROUP	64.299	59	5,634
SCENTRE GROUP	631.6	1,806	171,136
ARENA REIT	41.056	182	17,308
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	22.847	72	6,904
BWP TRUST	58.372	236	22,452
GPT GROUP	233.736	1,005	95,219
CHARTER HALL RETAIL REIT	63.834	255	24,251
MIRVAC GROUP	481.108	1,019	96,629
STOCKLAND	290.569	1,109	105,158
ABACUS PROPERTY GROUP	50.221	143	13,607
GOODMAN GROUP	207.434	4,188	396,779
VICINITY CENTRES	472.13	972	92,142
CHARTER HALL GROUP	57.697	717	67,945
INGENIA COMMUNITIES GROUP	43.391	202	19,197
オーストラリア・ドル □数、金額	4,064.205	15,915	1,507,874
通貨計 銘柄数 <比率>	31銘柄		<6.3%>
	千口	千香港・ドル	千円
(香港)			
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	267	686	11,644
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	128	482	8,189
FORTUNE REIT	177	1,210	20,545
PROSPERITY REIT	156	380	6,459
LINK REIT	257.4	17,091	290,040
CHAMPION REIT	222	772	13,110
香港・ドル □数、金額	1,207.4	20,623	349,989
通貨計 銘柄数 <比率>	6銘柄		<1.5%>
	千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)			
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	41.3	30	2,926
KEPPEL DC REIT	160.9	325	31,546
FIRST REAL ESTATE INVST TRUST	153.8	42	4,105
AIMS APAC REIT	57.8	78	7,629
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	354.7	503	48,886
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	66.4	52	5,091
LENDELEASE GLOBAL COMMERCIAL	225.9	188	18,308
EC WORLD REIT	32.9	18	1,756
IREIT GLOBAL	64.5	39	3,787
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	408.5	1,213	117,757
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	620.5	1,315	127,678
SUNTEC REIT	265.3	429	41,715
MAPLE TREE LOGISTICS TRUST	389.4	693	67,275
KEPPEL REIT	239.9	263	25,613
ASCOTT RESIDENCE TRUST	235.9	278	27,017
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	621.4	257	25,029
CDL HOSPITALITY TRUSTS	103.4	133	12,946
FRASERS CENTREPOINT TRUST	130.4	303	29,489
STARHILL GLOBAL REIT	166.8	97	9,470
CAPITALAND CHINA TRUST	133.9	153	14,945
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	45.9	221	21,473
MAPLE TREE INDUSTRIAL TRUST	237.7	639	62,061
MAPLE TREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	266.7	512	49,700
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	124.3	78	7,600
SPH REIT	113	106	10,309
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	284.1	106	10,340
シンガポール・ドル □数、金額	5,545.3	8,082	784,464
通貨計 銘柄数 <比率>	26銘柄		<3.3%>
	千口	千ニュージーランド・ドル	千円
(ニュージーランド)			
ARGOSY PROPERTY LTD	107.307	146	12,566
KIWI PROPERTY GROUP LTD	199.256	205	17,606
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	54.226	153	13,188
GOODMAN PROPERTY TRUST	132.996	301	25,900
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	164.981	238	20,452
ニュージーランド・ドル □数、金額	658.766	1,045	89,713
通貨計 銘柄数 <比率>	5銘柄		<0.4%>
	千口	千イギリス・ポンド	千円
(イギリス)			
ASSURA PLC	336.071	237	38,411
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	71.016	69	11,174
STANDARD LIFE INV PROP INC	51.354	40	6,471
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	100.969	78	12,739
PICTON PROPERTY INCOME LTD	64.471	58	9,467

銘柄	当期末		
	□数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千イギリス・ポンド	千円
REGIONAL REIT LTD	54.681	41	6,722
NEWRIVER REIT PLC	39.166	34	5,624
CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	96.764	138	22,400
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	73.284	62	10,146
CUSTODIAN REIT PLC	51.902	56	9,089
PRS REIT PLC/THE	64.664	69	11,240
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	45.413	54	8,862
LXI REIT PLC	263.618	397	64,221
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	46.825	43	7,103
AEW UK REIT PLC	20.041	23	3,716
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	94.111	108	17,453
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	140.841	175	28,327
HOME REIT PLC	94.127	112	18,247
LAND SECURITIES GROUP PLC	85.402	619	100,053
SEGRO PLC	136.681	1,470	237,479
HAMMERSON PLC	417.915	110	17,823
UNITE GROUP PLC/THE	45.368	533	86,118
BRITISH LAND CO PLC	106.618	509	82,383
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	28.857	170	27,621
DERWENT LONDON PLC	12.762	349	56,531
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	151.509	222	35,980
WORKSPACE GROUP PLC	16.231	96	15,654
SAFESTORE HOLDINGS PLC	23.965	280	45,258
SHAFTESBURY PLC	32.755	158	25,558
BIG YELLOW GROUP PLC	19.661	278	45,039
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	111.412	274	44,348
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	71.398	39	6,378
TRITAX BIG BOX REIT PLC	212.428	411	66,473
イギリス・ポンド	□数、金額	3,182.28	7,329
通貨計	銘柄数<比率>	33銘柄	<4.9%>
	千口	千イスラエル・シェケル	千円
(イスラエル)			
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	26.7	287	11,868
REIT 1 LTD	25.897	551	22,756
イスラエル・シェケル	□数、金額	52.597	839
通貨計	銘柄数<比率>	2銘柄	<0.1%>
	千口	千韓国・ウォン	千円
(韓国)			
SK REITS LTD	7.476	40,968	4,186
D&D PLATFORM REIT LTD	6.865	31,922	3,262
SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD	3.286	15,772	1,611
NH ALL ONE REIT LTD	3.459	16,067	1,642
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	7.432	57,598	5,886
LOTTE REIT CO LTD	15.417	78,164	7,988
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	11.781	53,250	5,442
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	3.918	19,746	2,018
JR REIT XXVII	16.902	79,861	8,161
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5.393	30,308	3,097
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	18.659	102,624	10,488
韓国・ウォン	□数、金額	100.588	526,284
通貨計	銘柄数<比率>	11銘柄	<0.2%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (アイルランド)			
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	44.558	60	8,210
国小計	□数、金額	44.558	60
	銘柄数<比率>	1銘柄	<0.0%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (オランダ)			
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	4.157	97	13,356
WERELDHAVE NV	4.183	64	8,809
NSI NV	1.842	60	8,208
VASTNED RETAIL NV	1.879	44	6,091
国小計	□数、金額	12.061	267
	銘柄数<比率>	4銘柄	<0.2%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (ベルギー)			
AEDIFICA	4.098	425	58,059
COFINIMMO	3.066	339	46,367
BEFIMMO	2.541	120	16,474
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	2.459	67	9,196
RETAIL ESTATES	1.182	81	11,164
WAREHOUSES DE PAUW SCA	14.678	496	67,714

銘柄	当期末		
	□数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千ユーロ	千円
CARE PROPERTY INVEST	2.797	67	9,238
XIOR STUDENT HOUSING NV	2.164	97	13,261
MONTEA NV	1.061	105	14,467
国小計	□数、金額	34.046	1,801
	銘柄数<比率>	9銘柄	<1.0%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (フランス)			
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	12.108	736	100,512
ICADE	3.326	161	22,108
CARMILA	4.689	80	10,995
ALTAREA	0.443	64	8,839
GECINA SA	5.647	564	77,075
KLEPIERRE	20.263	465	63,583
COVIVIO	4.92	306	41,769
MERCIALYS	5.169	46	6,384
国小計	□数、金額	56.565	2,427
	銘柄数<比率>	8銘柄	<1.4%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (ドイツ)			
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1.766	23	3,225
HAMBORNER REIT AG	7.351	64	8,799
国小計	□数、金額	9.117	88
	銘柄数<比率>	2銘柄	<0.0%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (スペイン)			
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7.263	35	4,817
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	28.026	187	25,571
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	34.646	345	47,099
国小計	□数、金額	69.935	567
	銘柄数<比率>	3銘柄	<0.3%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (イタリア)			
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUJZ	6.703	25	3,513
国小計	□数、金額	6.703	25
	銘柄数<比率>	1銘柄	<0.0%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (その他)			
CROMWELL REIT EUR	32.1	67	9,200
国小計	□数、金額	32.1	67
	銘柄数<比率>	1銘柄	<0.0%>
ユーロ (通貨)	□数、金額	265.085	5,305
通貨計	銘柄数<比率>	29銘柄	<3.0%>
合計	□数、金額	18,198.495	22,221,611
	銘柄数<比率>	320銘柄	<92.1%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	725	—
STOXX 600 REAL (ドイツ)	189	—

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年8月15日現在

項目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円 979,423	% 4.0
投資信託証券	22,221,611	91.8
コール・ローン等、その他	1,016,193	4.2
投資信託財産総額	24,217,229	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、8月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=132.97円、1カナダ・ドル=104.10円、1オーストラリア・ドル=94.74円、1香港・ドル=16.97円、1シンガポール・ドル=97.06円、1ニュージーランド・ドル=85.79円、1イギリス・ポンド=161.55円、1イスラエル・シェケル=41.234円、100韓国・ウォン=10.22円、1ユーロ=136.49円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(23,621,814千円)の投資信託財産総額(24,217,229千円)に対する比率は、97.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年8月15日現在

項目	当 期 末
(A) 資産	46,842,454,174円
コール・ローン等	779,021,621
投資信託受益証券(評価額)	979,423,597
投資信託証券(評価額)	22,221,611,954
未収入金	22,722,444,102
未収配当金	46,432,673
差入委託証拠金	93,520,227
(B) 負債	22,726,162,232
未払金	22,721,274,292
未払解約金	4,882,000
その他未払費用	5,940
(C) 純資産総額(A-B)	24,116,291,942
元本	24,020,097,532
次期繰越損益金	96,194,410
(D) 受益権総口数	24,020,097,532口
1万口当り基準価額(C/D)	10,040円

* 期首における元本額は1,492,500,000円、当作成期間中における追加設定元本額は25,478,685,273円、同解約元本額は2,951,087,741円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) 19,006,473,950円
 ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス(為替ヘッジあり) 938,576,332円
 ダイワ海外REITインデックス(為替ヘッジあり)(投資一任専用) 959,693円
 ダイワ・マクロ・ナビゲーター・ファンド2021-10(為替ヘッジあり/適格機関投資家専用) 1,467,517,525円
 ダイワ外国REITインデックス(為替ヘッジあり)(ダイワSMA専用) 2,606,570,032円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,040円です。

■損益の状況

当期 自2021年10月6日 至2022年8月15日

項目	当 期
(A) 配当等収益	354,795,711円
受取配当金	354,436,480
受取利息	240,676
その他収益金	181,710
支払利息	△ 63,155
(B) 有価証券売買損益	△ 1,629,105,741
売買益	3,591,490,108
売買損	△ 5,220,595,849
(C) 先物取引等損益	28,087,901
取引益	140,308,053
取引損	△ 112,220,152
(D) その他費用	△ 4,975,029
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 1,251,197,158
(F) 解約差損益金	△ 147,046,259
(G) 追加信託差損益金	1,494,437,827
(H) 合計(E+F+G)	96,194,410
次期繰越損益金(H)	96,194,410

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

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

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

【お知らせ】
■NDF取引の利用について
 為替ヘッジを為替予約取引で行えない通貨のシェアが上昇した場合に備えるため、NDF取引(直物為替先渡取引)の利用を可能とし、当該取引により為替ヘッジを行えるよう信託約款の変更を行いました。

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス (為替ヘッジなし)

運用報告書(全体版)

第7期

(決算日 2023年6月15日)

(作成対象期間 2022年6月16日～2023年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／不動産投信（リート）／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）		
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。		

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、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あげることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2737>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (税引後配当込み、 円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率	不動産投信 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
3期末(2019年6月17日)	11,931	0	9.8	11,912	9.6	0.6	98.2	1.0	1,667
4期末(2020年6月15日)	10,120	0	△ 15.2	10,087	△ 15.3	2.2	94.6	3.2	2,091
5期末(2021年6月15日)	14,252	0	40.8	14,174	40.5	0.9	97.3	1.7	3,226
6期末(2022年6月15日)	14,737	0	3.4	14,635	3.3	4.0	94.8	1.8	3,454
7期末(2023年6月15日)	15,400	0	4.5	15,251	4.2	5.6	91.7	2.7	4,650

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P先進国REIT指数 (除く日本) (税引後配当込み、円ベース) は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。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) 不動産投信先物比率は買建比率-売建比率です。

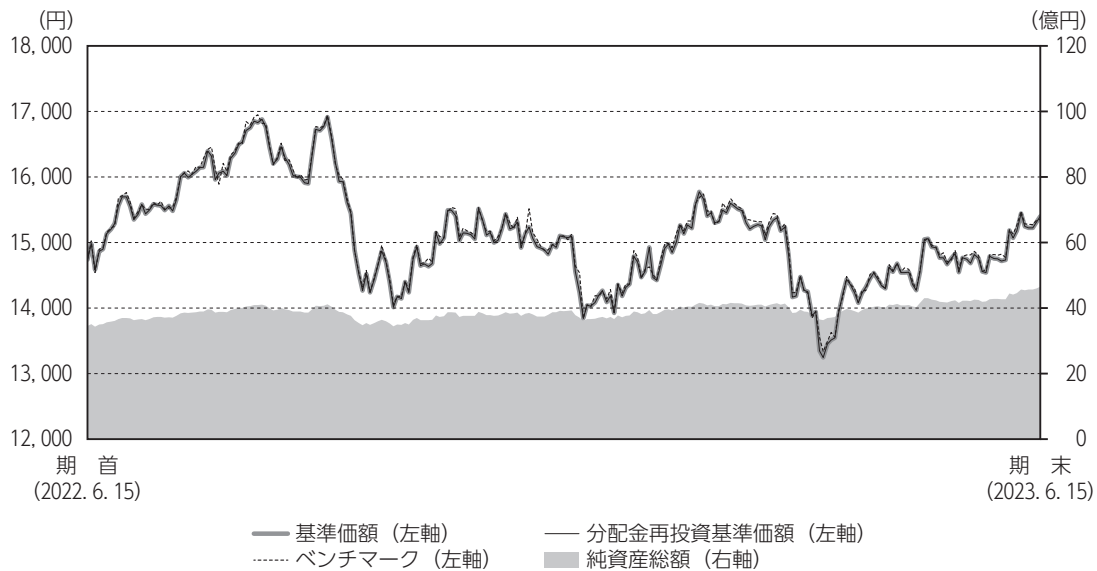
※ベンチマークを「S & P先進国REIT指数 (除く日本) (配当込み、円ベース)」から「S & P先進国REIT指数 (除く日本) (税引後配当込み、円ベース)」に変更しました。

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



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：14,737円

期末：15,400円 (分配金 0円)

騰落率：4.5% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券を通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、為替相場が円安となったことが主因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (税引後配当込み、 円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資証券 組入比率	不動産投信 指 先物比率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首)2022年 6月15日	円 14,737	% —	14,635	% —	% 4.0	% 94.8	% 1.8
6月末	15,554	5.5	15,511	6.0	0.9	97.2	1.9
7月末	16,393	11.2	16,307	11.4	2.1	96.3	1.9
8月末	16,026	8.7	16,001	9.3	0.6	97.3	2.2
9月末	14,238	△ 3.4	14,140	△ 3.4	2.2	95.4	2.5
10月末	15,492	5.1	15,360	5.0	4.0	93.7	2.4
11月末	15,135	2.7	15,028	2.7	4.6	92.9	2.5
12月末	14,185	△ 3.7	14,183	△ 3.1	5.8	91.2	3.0
2023年 1月末	15,136	2.7	15,074	3.0	6.3	90.8	2.9
2月末	15,273	3.6	15,210	3.9	6.6	90.0	3.4
3月末	14,221	△ 3.5	14,074	△ 3.8	3.8	93.5	2.8
4月末	14,550	△ 1.3	14,481	△ 1.1	4.7	92.5	2.8
5月末	14,748	0.1	14,704	0.5	5.3	92.2	2.7
(期末)2023年 6月15日	15,400	4.5	15,251	4.2	5.6	91.7	2.7

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15)

■海外リート市況

海外リート市況は、当作成期を通して見るとやや上昇しました。

海外リート市況は、当作成期首より、インフレ懸念の一部後退や長期金利が低下したことなどから上昇基調で始まりました。2022年8月中旬にかけては、インフレのピークアウトが期待される中、良好な決算を発表した貸倉庫などを中心に上昇しました。しかしその後は、長期金利の上昇への警戒感などを背景に軟調な推移となりました。また9月下旬には、大規模な財政政策が発表されたことをきっかけに金融市場が混乱した英国に引きずられる格好で大きく下落しました。10月に英国が政権交代により大規模な財政政策を撤回したこと、また、10月半ば以降はFRB（米国連邦準備制度理事会）が利上げ幅を縮小させるとの思惑などを受けて長期金利が低下したこと、やや持ち直しました。2023年1月には、米国の経済指標の結果を受けたインフレ圧力の緩和期待や長期金利の低下を支援材料に大きく上昇しました。しかし、2月には好調な経済指標を受けた米国の利上げ長期化観測が嫌気され、さらに3月に入ると欧米の金融機関の信用不安から、銀行による貸出態度の厳格化観測や景気見通しの不透明感を受けた不動産市況の悪化懸念などを理由に下落しました。その後は、米国当局が必要に応じて支援を拡充する構えを示したことなどから、金融システムへの警戒感が後退する中で反発しましたが、4月以降当作成期末にかけては横ばい圏で推移しました。

■為替相場

為替相場は上昇（円安）しました。

米ドルの対円為替相場は、当作成期首より、米国で大幅な利上げが行われたことなどから、上昇基調で推移しました。2022年7月後半に、米国金利が低下に転じると日米金利差の縮小が意識され、円が買い戻されました。8月以降は、米国金利の上昇により日米金利差が再度拡大したことなどから、円安米ドル高が進行し、9月には日本政府・日銀は円買い介入を実施したものの影響は限定的なものにとどまりました。10月中旬にかけてさらに米ドルは対円で上昇したものの、10月後半以降は、インフレ率の低下期待などから米国金利が低下したことで日米金利差の縮小が意識され、

米ドルは対円で下落しました。さらに12月は、日銀が想定外の政策修正を行ったことで金融緩和政策の転換などが意識され、2023年1月下旬にかけて円高米ドル安が進行しました。しかし3月上旬にかけては、堅調な米国の経済指標を受けて米国金利が大きく上昇したことで、円安米ドル高に転じました。その後、信用不安の拡大により米国金利が大きく低下したことや、リスク回避による円買い需要が高まったものの、当作成期末にかけては、米国金利の上昇に連動して米ドルは対円で上昇しました。ユーロや英ポンドは、中央銀行による金融引き締めの継続などを背景に対円で上昇しました。オーストラリア・ドルやカナダ・ドルも対円で上昇しましたが、資源価格の下落を背景に相対的に軟調な推移となりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

（2022. 6. 16 ~ 2023. 6. 15）

■当ファンド

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

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

海外の金融商品取引所上場および店頭登録のリートに投資し、ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウェイトで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

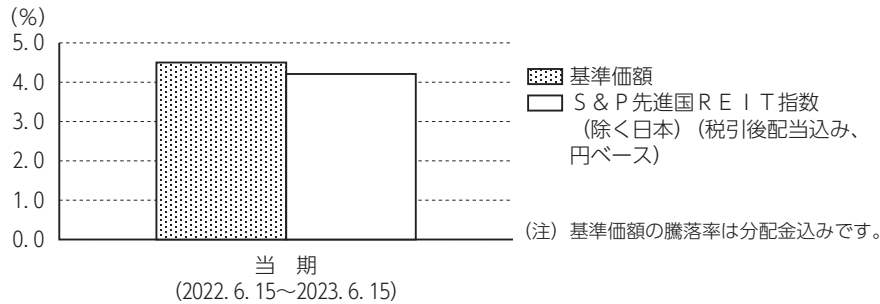
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は4.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.5%となりました。

マザーファンドについては、保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



*ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（税引後配当込み、円ベース）です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、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	
	2022年6月16日 ～2023年6月15日	
当期分配金（税込み）（円）	—	
対基準価額比率（%）	—	
当期の収益（円）	—	
当期の収益以外（円）	—	
翌期繰越分配対象額（円）	5,399	

- (注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
- (注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
- (注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。
- (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2022. 6. 16~2023. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	66円	0.434%	信託報酬＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は15,103円です。
(投信会社)	(46)	(0.302)	投信会社は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(17)	(0.110)	販売会社は、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)	受託会社は、運用資産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	2	0.014	売買委託手数料＝当期中の売買委託手数料／当期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.005)	
(投資信託受益証券)	(1)	(0.004)	
(投資証券)	(1)	(0.006)	
有価証券取引税	1	0.008	有価証券取引税＝当期中の有価証券取引税／当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)	
(投資証券)	(1)	(0.008)	
その他費用	8	0.050	その他費用＝当期中のその他費用／当期中の平均受益権口数
(保管費用)	(5)	(0.031)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(2)	(0.013)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	77	0.507	

(注1) 当期中の費用(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。

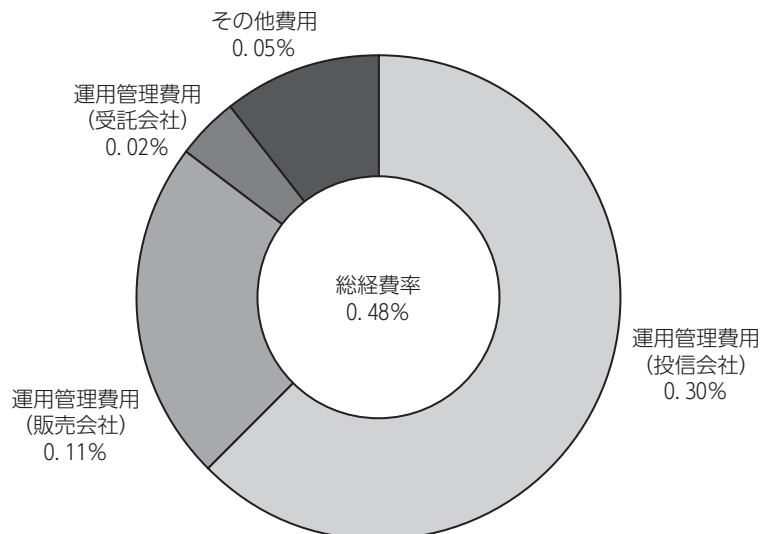
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

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



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	412,775	1,274,529	91,204	285,518

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	1,136,729	1,458,299	4,650,518

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	4,650,518	99.7
コール・ローン等、その他	14,893	0.3
投資信託財産総額	4,665,411	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=140.39円、1カナダ・ドル=105.30円、1オーストラリア・ドル=95.37円、1香港・ドル=17.93円、1シンガポール・ドル=104.58円、1ニュージーランド・ドル=86.93円、1イギリス・ポンド=177.72円、1イスラエル・シェケル=39.178円、100韓国・ウォン=11.02円、1ユーロ=152.15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(30,956,216千円)の投資信託財産総額(31,447,022千円)に対する比率は、98.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,665,411,297円
コール・ローン等	14,893,229
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)	4,650,518,068
(B) 負債	14,463,335
未払解約金	5,626,218
未払信託報酬	8,726,738
その他未払費用	110,379
(C) 純資産総額(A-B)	4,650,947,962
元本	3,020,170,856
次期繰越損益金	1,630,777,106
(D) 受益権総口数	3,020,170,856口
1万口当り基準価額(C/D)	15,400円

* 期首における元本額は2,343,884,195円、当作成期間中における追加設定元本額は1,053,030,359円、同解約元本額は376,743,698円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は15,400円です。

■損益の状況

当期自2022年6月16日至2023年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,547円
受取利息	155
支払利息	△ 2,702
(B) 有価証券売買損益	195,020,401
売買益	212,257,604
売買損	△ 17,237,203
(C) 信託報酬等	△ 17,185,587
(D) 当期損益金(A+B+C)	177,832,267
(E) 前期繰越損益金	527,427,893
(F) 追加信託差損益金	925,516,946
(配当等相当額)	(800,238,889)
(売買損益相当額)	(125,278,057)
(G) 合計(D+E+F)	1,630,777,106
次期繰越損益金(G)	1,630,777,106
追加信託差損益金	925,516,946
(配当等相当額)	(800,238,889)
(売買損益相当額)	(125,278,057)
分配準備積立金	705,262,707
繰越損益金	△ 2,547

(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	177,833,824
(c) 収益調整金	925,516,946
(d) 分配準備積立金	527,428,883
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,630,779,653
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	1,630,779,653
(h) 受益権総口数	3,020,170,856口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の決算日（2022年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2023年6月15日）現在におけるダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	□数	金額	平均単価	銘柄	□数	金額	平均単価
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 434.84	千円 5,092,976	円 11,712	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 370.4	千円 4,289,007	円 11,579

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資証券

(2022年6月16日から2023年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	□数	金額	平均単価	銘柄	□数	金額	平均単価
PROLOGIS INC (アメリカ)	千口 21.249	千円 337,906	円 15,902	PROLOGIS INC (アメリカ)	千口 2.494	千円 38,855	円 15,579
EQUINIX INC (アメリカ)	千口 2.536	千円 229,600	円 90,536	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI (カナダ)	千口 15	千円 35,338	円 2,355
VICI PROPERTIES INC (アメリカ)	千口 47.766	千円 196,671	円 4,117	SHAFTESBURY PLC (イギリス)	千口 45.398	千円 31,498	円 693
REALTY INCOME CORP (アメリカ)	千口 22.369	千円 196,079	円 8,765	INVITATION HOMES INC (アメリカ)	千口 5.541	千円 29,567	円 5,336
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	千口 4.298	千円 179,046	円 41,658	BEFIMMO (ベルギー)	千口 3.13	千円 21,193	円 6,771
WELLTOWER INC (アメリカ)	千口 15.614	千円 155,318	円 9,947	HIBERNIA REIT PLC (アイルランド)	千口 84.78	千円 19,322	円 227
LINK REIT (香港)	千口 138.5	千円 128,994	円 931	VICI PROPERTIES INC (アメリカ)	千口 3.081	千円 14,324	円 4,649
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	千口 7.775	千円 108,182	円 13,914	IRONGATE GROUP (オーストラリア)	千口 77.4	千円 13,810	円 178
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	千口 6.953	千円 106,503	円 15,317	EQUINIX INC (アメリカ)	千口 0.139	千円 12,574	円 90,466
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT (アメリカ)	千口 5.32	千円 93,289	円 17,535	TERRENO REALTY CORP (アメリカ)	千口 1.47	千円 12,452	円 8,471

(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、2023年6月15日におけるダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド（9,843,782千円）の内容です。

(1) 外国投資信託受益証券

銘柄	□数	2023年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円
VANGUARD REAL ESTATE ETF	149.6	12,497	1,754,535
合計	□数、金額 銘柄数 < 比率 >	149.6 1銘柄	1,754,535 <5.6%>

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資証券

銘柄	□数	2023年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)	千口	千アメリカ・ドル	千円
DIGITAL CORE REIT UNITS	49.4	23	3,328
MANULIFE US REAL ESTATE INV	265.962	44	6,310
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	110.2	34	4,796
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90	—	—
PRIME US REIT	92.2	20	2,847
(アメリカ)			
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	21.004	286	40,161
URBAN EDGE PROPERTIES	18.762	280	39,351
XENIA HOTELS & RESORTS INC	18.188	225	31,636
AVALONBAY COMMUNITIES INC	22.35	4,250	596,668
SIMON PROPERTY GROUP INC	52.233	5,792	813,228

銘柄	2023年6月15日現在		
	口数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
BOSTON PROPERTIES INC	22.79	1,235	173,508
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24.225	203	28,533
VORNADO REALTY TRUST	25.742	393	55,220
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	14.508	210	29,492
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13.5	474	66,599
NEXPOINT RESIDENTIAL	3.633	164	23,058
EQUITY RESIDENTIAL	54.412	3,611	506,993
APPLE HOSPITALITY REIT INC	33.987	515	72,430
EPR PROPERTIES	11.985	547	76,910
CITY OFFICE REIT INC	6	32	4,616
GLOBAL NET LEASE INC	16.582	177	24,862
EQUINIX INC	14.784	11,469	1,610,151
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13.402	353	49,596
CHATHAM LODGING TRUST	7.231	67	9,542
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8.813	826	116,017
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	19.897	267	37,570
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3.759	129	18,232
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7.8	31	4,445
HOST HOTELS & RESORTS INC	114.233	1,994	280,009
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	49.037	1,707	239,780
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	20.508	98	13,819
RLJ LODGING TRUST	25.89	267	37,546
FARMLAND PARTNERS INC	7.936	98	13,837
PHYSICIANS REALTY TRUST	36.467	527	74,080
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	10.821	129	18,184
KIMCO REALTY CORP	98.809	1,907	267,725
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9.06	85	12,007
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	60.818	1,189	167,007
WHITESTONE REIT	7.417	71	9,985
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	41.141	2,062	289,540
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	19.721	135	19,020
PARK HOTELS & RESORTS INC	35.921	481	67,625
INVITATION HOMES INC	92.795	3,158	443,455
JBG SMITH PROPERTIES	15.816	241	33,927
ALEXANDER & BALDWIN INC	11.583	216	30,408
CLIPPER REALTY INC	1.89	10	1,454
GLADSTONE LAND CORP	5.156	88	12,450
AMERICOLD REALTY TRUST	43.039	1,369	192,324
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9	23	3,247
VICI PROPERTIES INC	160.35	5,192	728,923
BRT APARTMENTS CORP	1.6	31	4,416
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4.468	324	45,576
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	21.444	151	21,254
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	22.746	560	78,715
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	6.229	141	19,885
BROADSTONE NET LEASE INC	27.657	451	63,366
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	17.078	112	15,776
LIFE STORAGE INC	13.579	1,737	243,956
AMERICAN ASSETS TRUST INC	8.342	162	22,825
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	35.761	662	92,979
PARAMOUNT GROUP INC	26.339	120	16,972
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21.017	146	20,565
NETSTREIT CORP	8.767	160	22,523
APARTMENT INCOME REIT CO	23.761	876	123,091
CTO REALTY GROWTH INC	3.211	53	7,550
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	30.213	1,605	225,356
STAG INDUSTRIAL INC	28.632	1,049	147,320
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2.066	32	4,617
INDUS REALTY TRUST INC	0.861	57	8,091
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2.825	41	5,889
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	18.712	629	88,318
ORION OFFICE REIT INC	9.048	58	8,180
VENTAS INC	63.903	2,959	415,552
CARETRUST REIT INC	15.898	315	44,348
INVENTRUST PROPERTIES CORP	10.772	253	35,523
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	47.914	1,033	145,026
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7.759	60	8,540
SABRA HEALTH CARE REIT INC	36.901	437	61,441
UMH PROPERTIES INC	8.587	139	19,529
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3.916	90	12,716
BLUEROCK HOMES TRUST INC CLASS A	0.487	7	1,095
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ESTATE C	4.8	55	7,843

銘柄	2023年6月15日現在		
	口数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
STAR HOLDINGS SHARES OF BENEFICIAL	2.122	30	4,233
IRON MOUNTAIN INC	46.445	2,634	369,837
TERRENO REALTY CORP	11.656	680	95,499
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22.312	890	124,950
SUN COMMUNITIES INC	19.793	2,647	371,739
ACADIA REALTY TRUST	15.17	216	30,348
ALEXANDER'S INC	0.343	63	8,891
PROLOGIS INC	147.471	18,031	2,531,411
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	25.164	3,067	430,715
BRANDYWINE REALTY TRUST	27.41	121	17,008
SAUL CENTERS INC	2.061	75	10,636
VERIS RESIDENTIAL INC	12.66	214	30,179
CAMDEN PROPERTY TRUST	17.595	1,966	276,065
COUSINS PROPERTIES INC	24.209	527	73,989
SITE CENTERS CORP	29.307	386	54,269
EASTGROUP PROPERTIES INC	6.962	1,210	169,959
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10.321	2,408	338,173
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21.11	1,104	154,998
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11.697	1,103	154,870
GETTY REALTY CORP	6.794	237	33,402
WELLTOWER INC	75.49	6,155	864,164
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	87.354	1,808	253,857
HIGHWOODS PROPERTIES INC	16.809	377	53,048
SERVICE PROPERTIES TRUST	26.433	234	32,878
EQUITY COMMONWEALTH	17.503	372	52,339
KILROY REALTY CORP	16.835	513	72,156
LTC PROPERTIES INC	6.471	220	30,933
LXP INDUSTRIAL TRUST	44.05	452	63,573
MID-AMERICA APARTMENT COMM	18.449	2,830	397,314
MACERICH CO/THE	34.387	385	54,165
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27.95	1,890	265,412
NATL HEALTH INVESTORS INC	6.932	373	52,396
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	28.99	1,234	173,296
REALTY INCOME CORP	100.194	6,129	860,572
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	17.961	429	60,340
PUBLIC STORAGE	25.254	7,175	1,007,321
REGENCY CENTERS CORP	24.605	1,496	210,159
RPT REALTY	13.619	140	19,769
SAFEHOLD INC	6.107	145	20,388
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	16.67	358	50,386
SL GREEN REALTY CORP	10.285	267	37,613
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	38.295	116	16,397
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4.628	96	13,566
UDR INC	49.406	2,129	299,015
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2.029	98	13,892
WP CAREY INC	33.649	2,352	330,300
ELME	13.982	220	30,916
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4.7	19	2,705
AGREE REALTY CORP	14.15	930	130,653
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	37.424	1,167	163,923
CUBESMART	35.878	1,569	220,314
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	33.614	341	47,898
DIGITAL REALTY TRUST INC	45.935	4,845	680,285
EXTRA SPACE STORAGE INC	21.395	3,066	430,482
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4.575	27	3,872
CENTERSPACE	2.407	149	21,025
KITE REALTY GROUP TRUST	35.003	736	103,392
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2.592	54	7,619
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6.328	81	11,504
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33.45	272	38,272
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	95.694	868	121,985
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13.105	18	2,594
DOUGLAS EMMETT INC	28.084	351	49,283
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,095.323 145銘柄	157,379 <70.4%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2.3	7	777
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	5.1	16	1,713
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	6.2	17	1,834
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	5.6	47	5,029
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	7.841	100	10,551

銘柄	2023年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千カナダ・ドル	千円
PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4.4	23	2,469
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	2,758	45	4,832
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9.8	70	7,429
SLATE GROCERY REIT	4.7	61	6,458
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	9.8	174	18,378
SLATE OFFICE REIT	5.1	10	1,074
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2.8	42	4,484
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	20.1	154	16,297
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	6.1	15	1,612
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2.7	31	3,315
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5.4	433	45,660
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	21.8	303	31,930
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11.8	150	15,829
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18.1	274	28,874
CHOICE PROPERTIES REIT	27.4	366	38,546
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3.3	54	5,740
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9.1	136	14,325
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12.1	303	32,006
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14.5	724	76,250
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	22.266	229	24,196
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	25.7	511	53,826
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3.3	48	5,128
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3.8	228	24,012
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8.9	129	13,607
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10.7	243	25,643
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	293.465 30銘柄	4,955 <1.7%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU	188.008	1,479	141,111
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	38.4	53	5,145
HMC CAPITAL LTD	34.174	155	14,829
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	53.9	35	3,366
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	57.979	168	16,090
CROMWELL PROPERTY GROUP	247.199	129	12,377
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	92.172	281	26,810
RURAL FUNDS GROUP	67.167	114	10,921
WAYPOINT REIT	117.959	319	30,486
CHARTER HALL LONG WALE REIT	113.735	461	44,038
CENTURIA OFFICE REIT	68.959	96	9,174
CENTURIA CAPITAL GROUP	120.539	193	18,450
HOMECO DAILY NEEDS REIT	269.082	305	29,126
REGION GROUP	200.826	475	45,392
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	50.422	145	13,849
NATIONAL STORAGE REIT	208.797	513	48,985
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	35.122	94	9,043
GDI PROPERTY GROUP	87.347	59	5,706
SCENTRE GROUP	907.275	2,349	224,104
ARENA REIT	60.571	224	21,373
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	31.154	102	9,745
BWP TRUST	84.216	304	29,074
GPT GROUP	334.842	1,346	128,374
CHARTER HALL RETAIL REIT	90.423	328	31,303
MIRVAC GROUP	689.734	1,503	143,400
STOCKLAND	417.276	1,698	161,968
ABACUS PROPERTY GROUP	70.207	181	17,274
GOODMAN GROUP	299.121	5,889	561,699
VICINITY CENTRES	676.374	1,258	119,980
CHARTER HALL GROUP	81.938	891	85,020
INGENIA COMMUNITIES GROUP	63.546	253	24,180
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,858.464 31銘柄	21,415 <6.5%>
(香港)	千口	千香港・ドル	千円
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	398	676	12,131
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	160	452	8,118
FORTUNE REIT	254	1,424	25,549
PROSPERITY REIT	205	352	6,322
LINK REIT	442.1	20,668	370,580
CHAMPION REIT	331	903	16,202
香港・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,790.1 6銘柄	24,478 <1.4%>

銘柄	2023年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)			
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	84.7	49	5,181
AIMS APAC REIT	3,118	0	18
KEPPEL DC REIT	231,283	469	49,100
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	210,276	54	5,717
AIMS APAC REIT	89.1	105	10,995
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	506.09	627	65,629
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	87.9	60	6,296
LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	327.84	219	22,971
EC WORLD REIT	36.5	12	1,259
CAPITALAND ASCENDAS REIT	587,477	1,568	164,040
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	880,122	1,733	181,325
SUNTEC REIT	393.6	499	52,276
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	559	927	97,043
KEPPEL REIT	343.6	305	31,980
CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRUST	353,056	374	39,137
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,042,402	328	34,339
CDL HOSPITALITY TRUSTS	145.7	176	18,437
FRASERS CENTREPOINT TRUST	187,576	408	42,764
STARHILL GLOBAL REIT	247.6	126	13,205
CAPITALAND CHINA TRUST	196,542	198	20,759
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	66.1	244	25,577
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	346,769	773	80,871
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUST	399,084	662	69,282
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	169	101	10,604
PARAGON REIT	177	166	17,400
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	412,463	131	13,803
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,083,898 26銘柄	10,327 <3.4%>
(ニュージーランド)			
STRIDE PROPERTY GROUP	92,477	123	10,772
ARGOSY PROPERTY LTD	144,609	160	13,953
KIWI PROPERTY GROUP LTD	261,44	233	20,340
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	80,882	186	16,241
GOODMAN PROPERTY TRUST	179,742	388	33,749
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	230,216	285	24,815
ニュージーランド・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	989,366 6銘柄	1,378 <0.4%>
(イギリス)			
WAREHOUSE REIT PLC	70,605	63	11,217
EDISTON PROPERTY INVESTMENT COMPANY	31,488	19	3,469
ASSURA PLC	490,928	228	40,587
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	101,879	88	15,734
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST LIMITED	67,467	34	6,091
CLS HOLDINGS PLC	57,322	78	13,956
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	135,056	73	12,985
PICTON PROPERTY INCOME LTD	86,237	65	11,678
REGIONAL REIT LTD	71,837	35	6,325
NEWRIVER REIT PLC	51,721	46	8,189
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	307,101	360	64,129
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	98,025	78	13,884
CUSTODIAN REIT PLC	69,425	62	11,178
PRS REIT PLC/THE	86,496	70	12,543
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	69,968	65	11,564
LXI REIT PLC	284,295	281	49,943
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	51,24	26	4,762
AEW UK REIT PLC	21,93	22	3,975
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST	134,976	104	18,542
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	206,054	162	28,966
URBAN LOGISTICS REIT PLC	78,434	101	18,121
HOME REIT PLC	117,587	44	7,951
LAND SECURITIES GROUP PLC	126,863	753	133,878
SEGRO PLC	204,206	1,542	274,145
HAMMERSON PLC	663,583	175	31,157
UNITE GROUP PLC/THE	67,59	601	106,907
BRITISH LAND CO PLC	158,38	530	94,208
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	42,097	194	34,519
DERWENT LONDON PLC	18,961	400	71,169
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	221,618	220	39,110
WORKSPACE GROUP PLC	22,88	118	21,002
SAFESTORE HOLDINGS PLC	36,736	335	59,639

銘柄	2023年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千イギリス・ポンド	千円
BIG YELLOW GROUP PLC	29.558	331	58,834
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	162.943	290	51,545
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	93.799	42	7,543
TRITAX BIG BOX REIT PLC	315.559	434	77,223
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	4,854,844 36 銘柄	8,083 <4.6%>
	千口	千イスラエル・シケル	千円
(イスラエル)			
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	105.526	182	7,164
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT REIT 1 LTD	37.152 33.128	296 537	11,610 21,039
イスラエル・シケル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	175,806 3 銘柄	1,016 <0.1%>
	千口	千韓国・ウォン	千円
(韓国)			
SK REITS LTD	11.423	58,714	6,470
D&D PLATFORM REIT LTD	8	26,760	2,948
SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD	3.93	14,423	1,589
NH ALL ONE REIT LTD	6.454	23,976	2,642
E KOCREF CR	3.584	19,174	2,113
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	12.235	76,346	8,413
LOTTE REIT CO LTD	20.132	79,622	8,774
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	15.855	70,158	7,731
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5.6	27,216	2,999
JR REIT XXVII	25.282	115,917	12,774
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5.99	33,364	3,676
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	27.294	111,768	12,316
韓国・ウォン通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	145,779 12 銘柄	657,442 <0.2%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (アイルランド)			
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	64.959	65	10,021
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	64.959 1 銘柄	65 <0.0%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (オランダ)			
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	6.463	144	22,046
WERELDHAVE NV	6.098	85	13,035
NSI NV	2.733	55	8,420
VASTNED RETAIL NV	2.739	55	8,418
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	18,033 4 銘柄	341 <0.2%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (ベルギー)			
AEDIFICA	6.035	399	60,832
COFINIMMO	4.63	349	53,186
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS RETAIL ESTATES	3.984 1.706	62 109	9,516 16,638
WAREHOUSES DE PAUW SCA	23.476	619	94,226
CARE PROPERTY INVEST	5.601	74	11,351
XIOR STUDENT HOUSING NV	3.526	104	15,879
MONTEA NV	2.047	158	24,044
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	51,005 8 銘柄	1,877 <0.9%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (フランス)			
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	16.18	758	115,383
ICADE	4.849	194	29,599
CARMILA	8.705	127	19,363
ALTAREA	0.71	73	11,126
GECINA SA	8.238	807	122,834
KLEPIERRE	29.539	659	100,269
COVIVIO	7.033	325	49,480
MERCIALYS	11.658	94	14,358
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	86,912 8 銘柄	3,039 <1.5%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (ドイツ)			
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1.82	9	1,437
HAMBORNER REIT AG	10.717	74	11,332
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	12,537 2 銘柄	83 <0.0%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (スペイン)			
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8.842	46	7,130
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	44.944	255	38,909

銘柄		2023年6月15日現在		
		口数	評価額	
	外貨建金額		邦貨換算金額	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		千口 50.509	千ユーロ 398	千円 60,672
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	104.295 3銘柄	701	106,712 <0.3%>
ユーロ (イタリア) IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		千口 6.93	千ユーロ 17	千円 2,683
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	6.93 1銘柄	17	2,683 <0.0%>
ユーロ (その他) CROMWELL REIT EUR		千口 54.52	千ユーロ 86	千円 13,106
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	54.52 1銘柄	86	13,106 <0.0%>
ユーロ通貨計		千口 399.191	千ユーロ 6,212	千円 945,305
国小計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	28銘柄		<3.0%>
合計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	26,686.236 323銘柄	—	28,791,803 <91.7%>

(注1) 邦貨換算金額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別		2023年6月15日現在	
		買建額	売建額
外	DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	百万円 649	百万円 —
国	STOXX 600 REAL (ドイツ)	200	—

(注1) 外貨建の評価額は、2023年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) 単位未満は切捨て。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

運用報告書 第18期（決算日 2022年11月30日）

（作成対象期間 2021年12月1日～2022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。

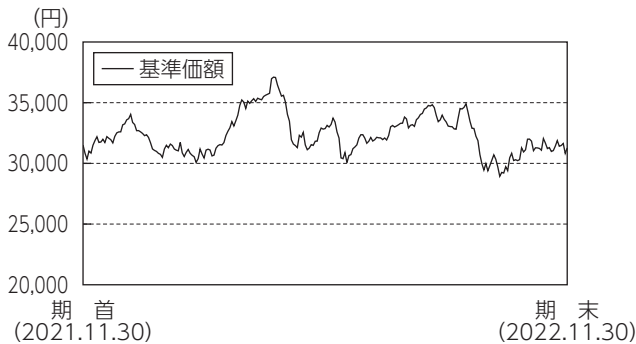
運用方針	S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行いません。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

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 受益証券		不動産 投資信託	
	円	騰落率 (ベンチマーク)	円	騰落率	組入比率	組入比率	先物比率	先物比率
(期首)2021年11月30日	31,508	-	36,274	-	0.9	97.0	2.3	
12月末	33,585	6.6	38,720	6.7	1.7	95.8	2.6	
2022年1月末	31,183	△ 1.0	35,945	△ 0.9	1.5	95.8	2.7	
2月末	31,178	△ 1.0	36,082	△ 0.5	0.7	96.5	2.7	
3月末	35,049	11.2	40,404	11.4	0.9	96.9	2.1	
4月末	35,608	13.0	40,997	13.0	-	98.6	1.5	
5月末	32,909	4.4	37,898	4.5	2.0	96.2	1.8	
6月末	32,075	1.8	37,190	2.5	0.9	97.2	1.9	
7月末	33,816	7.3	39,114	7.8	2.1	96.3	1.9	
8月末	33,072	5.0	38,402	5.9	0.6	97.3	2.2	
9月末	29,392	△ 6.7	33,992	△ 6.3	2.2	95.4	2.5	
10月末	31,993	1.5	36,940	1.8	4.1	93.7	2.4	
(期末)2022年11月30日	31,268	△ 0.8	36,159	△ 0.3	4.6	93.0	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。
(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：31,508円 期末：31,268円 騰落率：△0.8%

【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、好調な決算発表などから上昇して始まりました。2022年に入ると、2021年12月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）議事録を受け、米国の金融引き締めに対する懸念が高まり、

米国を中心に下落に転じました。2月から3月にかけては、欧米中央銀行高官の金融政策に対する発言や、ロシアのウクライナへの侵攻、ロシアとウクライナの断片的な停戦協定による状況改善期待などから一進一退の展開となりましたが、4月以降については、米国の金融引き締めの加速懸念などからリスク回避姿勢が強まり、リートも米国を中心に大きく下落しました。7月以降は過度な金融引き締め観測の後退を受け、持ち直す展開となりましたが、その後はFRB（米国連邦準備制度理事会）議長が景気を犠牲にしてでもインフレを抑制する姿勢を強調したことや、予想以上のインフレ率の上昇で欧米の金利が上昇したこと、英国の財政悪化懸念から英国債が急落したことなどが嫌気され、10月半ばにかけて下落しました。10月下旬以降からは、英国発の混乱が収束し欧米の金利上昇が一服したことなどからリートは反発し、当作成期末を迎えました。

○為替相場

為替相場は対円でおおむね上昇（円安）しました。

対円為替相場は、当作成期首よりおおむねレンジ内での推移が続きましたが、米国の利上げ回数増加観測などを受けて米ドルを中心に上昇しました。2022年に入ってから、米国で大幅な利上げが行われたことなどから、米ドルを中心にさらに上昇しました。7月後半に米国金利が低下に転じると、日米金利差の縮小が意識され、円が買い戻されたことで円高となりました。8月は、米国金利の上昇により日米金利差が再度拡大したことなどから、円安が進行しました。9月に入ると、FRB（米国連邦準備制度理事会）が大幅な金融引き締めを決定したのに対し、日銀は金融緩和政策の維持を決定したことで米国を中心に急速に円安が進行しました。これを受け、日本政府・日銀は円買い介入を実施したものの影響は限定的なものにとどまり、円安基調のまま当作成期末を迎えました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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ェイトで組成し、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。

また、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）および不動産投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△0.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△0.8%となりました。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。

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

*ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）です。

《今後の運用方針》

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

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

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投資信託証券)	8円 (1) (1) (5)
有価証券取引税 (投資信託受益証券) (投資信託証券)	3 (0) (3)
その他費用 (保管費用) (その他)	23 (10) (13)
合計	33

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

■ 売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

		買付		売却	
		数	金額	数	金額
外国	アメリカ	千口 540.13 (-)	千アメリカ・ドル 53,098 (-)	千口 464.88 (-)	千アメリカ・ドル 47,007 (-)

(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) 売却()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

		買付		売却	
		数	金額	数	金額
外国	アメリカ	千口 646.937 (△ 153.622)	千アメリカ・ドル 24,475 (△ 6,181)	千口 3,164.84 (-)	千アメリカ・ドル 151,648 (-)
	カナダ	千口 48.558 (9.541)	千カナダ・ドル 928 (-)	千口 251.79 (-)	千カナダ・ドル 5,344 (-)
	オーストラリア	千口 852.348 (132.841)	千オーストラリア・ドル 3,559 (△ 31)	千口 4,374.24 (-)	千オーストラリア・ドル 19,118 (-)
	香港	千口 313.7 (163.54)	千香港ドル 3,670 (-)	千口 1,373.84 (-)	千香港ドル 22,138 (-)
	シンガポール	千口 1,519.5 (36.54)	千シンガポール・ドル 1,775 (△ 65)	千口 6,335.324 (-)	千シンガポール・ドル 9,245 (-)
	ニュージーランド	千口 197.638 (-)	千ニュージーランド・ドル 347 (△ 1)	千口 655.907 (-)	千ニュージーランド・ドル 1,113 (-)
	イギリス	千口 1,062.225 (-)	千イギリス・ポンド 1,899 (△ 3)	千口 3,415.576 (-)	千イギリス・ポンド 8,865 (-)
	イスラエル	千口 136.596 (-)	千イスラエル・シェケル 524 (-)	千口 22.74 (-)	千イスラエル・シェケル 492 (-)
	韓国	千口 43.383 (12.142)	千韓国ウォン 237,929 (83,628)	千口 81.402 (-)	千韓国ウォン 406,773 (-)
	ユーロ (アイルランド)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)	千口 206.35 (-)	千ユーロ 295 (-)
	ユーロ (オランダ)	千口 0.73 (0.067)	千ユーロ 15 (0)	千口 12.88 (-)	千ユーロ 302 (-)
	ユーロ (ベルギー)	千口 4.02 (-)	千ユーロ 289 (-)	千口 40.312 (-)	千ユーロ 2,307 (-)
	ユーロ (フランス)	千口 11.654 (△ 0.01)	千ユーロ 328 (△ 53)	千口 68.648 (-)	千ユーロ 3,136 (-)
	ユーロ (ドイツ)	千口 - (-)	千ユーロ - (△ 7)	千口 50.25 (-)	千ユーロ 865 (-)
ユーロ (スペイン)	千口 11.665 (-)	千ユーロ 83 (△ 17)	千口 78.43 (-)	千ユーロ 711 (-)	

		買付		売却	
		数	金額	数	金額
外国	ユーロ (イタリア)	千口 - (-)	千ユーロ - (-)	千口 11.5 (-)	千ユーロ 73 (-)
	ユーロ (その他)	千口 - (-)	千ユーロ - (△ 3)	千口 37.4 (-)	千ユーロ 85 (-)
国内	ユーロ (ユーロ通貨計)	千口 28.069 (0.057)	千ユーロ 715 (△ 81)	千口 505.77 (-)	千ユーロ 7,777 (-)

(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) 売却()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

種類別	買付		売却	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 不動産投信指数先物取引	百万円 4,595	百万円 4,948	百万円 -	百万円 -

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当				期			
買		付		売		付	
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	540.13	6,798,680	12,587	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	464.88	5,899,115	12,689

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当				期			
買		付		売		付	
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
VICI PROPERTIES INC (アメリカ)	62.165	240,519	3,869	PROLOGIS INC (アメリカ)	92.9	1,800,011	19,375
PROLOGIS INC (アメリカ)	10.9	181,927	16,690	EQUINIX INC (アメリカ)	11.349	1,000,952	88,197
REALTY INCOME CORP (アメリカ)	17.715	155,247	8,763	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	19.155	867,049	45,264
EQUINIX INC (アメリカ)	1.547	137,970	89,185	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	41.873	680,182	16,243
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	2.997	129,071	43,066	WELLTOWER INC (アメリカ)	53.1	601,983	11,336
WELLTOWER INC (アメリカ)	12.168	125,689	10,329	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	35.301	599,910	16,994
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC (アメリカ)	30.469	119,513	3,922	REALTY INCOME CORP (アメリカ)	69.1	570,729	8,259
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN (アメリカ)	32.437	99,667	3,072	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	17.681	525,112	29,699
GOODMAN GROUP (オーストラリア)	52.378	98,742	1,885	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	43.712	470,278	10,758
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	4.605	81,488	17,695	GOODMAN GROUP (オーストラリア)	225.52	464,787	2,060

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国投資信託受益証券

銘柄	期首		期末	
	口数	口数	評価額	評価額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
VANGUARD REAL ESTATE ETF	33.95	109.2	9,403	1,305,824
合計	口数、金額	口数	9,403	1,305,824
	銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄	<4.6%>

(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) < >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	
	口数	口数	評価額	評価額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(シンガポール)				
DIGITAL CORE REIT UNITS	-	49.4	29	4,047
MANULIFE US REAL ESTATE INV	364.562	265.962	99	13,850
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	193.4	110.2	60	8,340
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90	90	-	-
PRIME US REIT	147	92.2	43	6,017
(アメリカ)				
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	33.2	19.596	317	44,085
URBAN EDGE PROPERTIES	28.682	17.277	270	37,524
XENIA HOTELS & RESORTS INC	28.8	16.4	247	34,321
AVALONBAY COMMUNITIES INC	36	20.571	3,513	487,894
SIMON PROPERTY GROUP INC	84.847	48.158	5,656	785,537
BOSTON PROPERTIES INC	36.7	20.983	1,483	205,984
APARTMENT INVT & MGMT CO-A	36.789	22.688	183	25,426
VORNADO REALTY TRUST	41.064	23.721	600	83,374
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	21.2	13.078	209	29,112
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	21.1	12.5	481	66,883
NEXPOINT RESIDENTIAL	5.5	3.326	155	21,583
EQUITY RESIDENTIAL	88	49.799	3,166	439,693
APPLE HOSPITALITY REIT INC	54.8	31.7	533	74,044
EPR PROPERTIES	18.9	11.184	455	63,320
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	7.1	-	-	-
CITY OFFICE REIT INC	10.9	6	58	8,148
GLOBAL NET LEASE INC	25.933	14.833	195	27,190
EQUINIX INC	23.2	13.398	8,989	1,248,374
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	19.829	11.929	318	44,197
CHATHAM LODGING TRUST	10.8	6.665	87	12,124
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	8.8	-	-	-
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	14.2	8.114	728	101,152
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	31.4	18.5	280	38,896
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	6	3.5	120	16,768
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	13.1	7.8	28	3,910
HOST HOTELS & RESORTS INC	184.3	105.17	1,962	272,528
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	70.708	44.506	1,446	200,929
CORESITE REALTY CORP	11.4	-	-	-
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	39.4	18.964	213	29,600
RLJ LODGING TRUST	41.871	23.943	284	39,567
FARMLAND PARTNERS INC	6.7	7.101	93	12,977

銘柄	期首		期末	
	口数	口数	評価額	評価額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(シンガポール)				
PHYSICIANS REALTY TRUST	56.1	33.5	483	67,176
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	15.7	9.961	118	16,447
CYRUSONE INC	32	-	-	-
KIMCO REALTY CORP	158.362	90.987	2,067	287,075
GLOBAL MEDICAL REIT INC	15.6	9.06	89	12,367
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	56.55	56.003	1,116	154,998
WHITESTONE REIT	11.2	6.4	61	8,514
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	57.437	37.584	1,938	269,158
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	32.3	17.7	181	25,268
PARK HOTELS & RESORTS INC	61.08	33.077	409	56,820
DIGITALBRIDGE GROUP INC	126.711	-	-	-
INVITATION HOMES INC	148.797	85.302	2,722	378,120
JBG SMITH PROPERTIES	29.932	14.641	294	40,867
ALEXANDER & BALDWIN INC	18.7	10.4	202	28,090
CLIPPER REALTY INC	1.4	1.89	13	1,923
GLADSTONE LAND CORP	6.4	4.68	94	13,115
AMERICOLD REALTY TRUST	67.4	39.627	1,169	162,393
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	16.9	9	35	4,986
VICI PROPERTIES INC	157.4	141.684	4,770	662,479
RETAIL VALUE INC	4.49	-	-	-
BRT APARTMENTS CORP	2.9	1.6	32	4,490
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	6.1	4.189	493	68,556
SAFEHOLD INC	3.3	2.562	73	10,193
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	29.6	19.143	126	17,518
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	30.5	20.776	470	65,406
COREPOINT LODGING INC	10.7	-	-	-
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	7.4	5.372	108	15,039
STORE CAPITAL CORP	63.1	39.092	1,243	172,687
CREATIVE MEDIA AND COMMUNITY TRUST	5.9	-	-	-
BROADSTONE NET LEASE INC	41	25.2	418	58,057
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	25.3	15.726	133	18,475
LIFE STORAGE INC	20.25	12.414	1,284	178,375
AMERICAN ASSETS TRUST INC	13.2	7.574	215	29,934
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	26.582	32.919	578	80,274
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	12.2	-	-	-
PARAMOUNT GROUP INC	40.2	24.493	156	21,734
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	36.5	19.5	148	20,688

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
NETSTREIT CORP	9.9	7.406	144	20,034
APARTMENT INCOME REIT CO	40.489	22.683	842	117,022
CTO REALTY GROWTH INC	1.2	2.58	54	7,577
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	35.6	25.166	1,360	188,998
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	29.7	—	—	—
STAG INDUSTRIAL INC	41.8	26.365	841	116,832
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	2.6	1.5	28	3,995
INDUS REALTY TRUST INC	1.1	0.861	54	7,633
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	3.2	2.3	35	4,890
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	—	16.969	541	75,219
ORION OFFICE REIT INC	14.223	7.823	71	9,940
VENTAS INC	101.629	58.803	2,669	370,735
CARETRUST REIT INC	24.503	14.404	282	39,165
GEO GROUP INC/THE	31.6	—	—	—
INVENTRUST PROPERTIES CORP	—	9.92	246	34,191
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	76.7	44.085	1,016	141,114
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	11.8	7.128	108	15,095
SABRA HEALTH CARE REIT INC	56.987	34.343	443	61,522
UMH PROPERTIES INC	10.6	7.244	127	17,644
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	—	3.6	104	14,573
BLUEROCK HOMES TRUST INC CLASS A	—	0.487	12	1,690
IRON MOUNTAIN INC	74.7	42.755	2,302	319,787
TERRENO REALTY CORP	18.2	9.78	562	78,093
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	30.72	19.993	813	113,000
SUN COMMUNITIES INC	29.9	18.143	2,627	364,851
ACADIA REALTY TRUST	22.811	13.611	206	28,730
ALEXANDER'S INC	0.5	0.3	73	10,189
PROLOGIS INC	190.919	135.822	15,457	2,146,638
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	35.8	21.844	3,331	462,665
BRANDYWINE REALTY TRUST	43.3	24.642	167	23,201
SAUL CENTERS INC	3.2	1.8	76	10,598
VERIS RESIDENTIAL INC	20.1	11.9	188	26,126
CAMDEN PROPERTY TRUST	26	15.672	1,845	256,267
COUSINS PROPERTIES INC	38.406	22.155	575	79,931
SITE CENTERS CORP	46.278	27.078	364	50,576
DUKE REALTY CORP	97.7	—	—	—
EASTGROUP PROPERTIES INC	10.4	6.409	974	135,291
ESSEX PROPERTY TRUST INC	16.767	9.581	2,055	285,381
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	33.3	19.429	958	133,097
FEDERAL REALTY INVS TRUST	18.1	10.71	1,178	163,691
GETTY REALTY CORP	9.803	6.256	204	28,374
WELLTOWER INC	109.1	68.168	4,717	655,081
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	139.2	79.379	2,035	282,638
HIGHWOODS PROPERTIES INC	26.9	15.7	459	63,859
SERVICE PROPERTIES TRUST	41.7	24.6	187	26,065
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	37.6	—	—	—
EQUITY COMMONWEALTH	31.475	16.365	437	60,701
KILROY REALTY CORP	27.1	15.609	654	90,866
LTC PROPERTIES INC	9.6	5.959	232	32,298
LXP INDUSTRIAL TRUST	70.1	41.176	430	59,811
MID-AMERICA APARTMENT COMM	29.928	16.983	2,749	381,876
MACERICH CO/THE	54.979	31.979	414	57,598
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	44.1	25.715	1,682	233,653
NATL HEALTH INVESTORS INC	11.9	6.569	360	50,090
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	45.3	26.056	1,180	163,913
REALTY INCOME CORP	142.239	90.854	5,660	786,032
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	28.5	16.71	457	63,512
PENN REAL ESTATE INVEST TST	17	—	—	—
PUBLIC STORAGE	39.4	23.242	6,754	937,945
PS BUSINESS PARKS INC/CA	5.1	—	—	—
REGENCY CENTERS CORP	39.52	22.656	1,491	207,085
RPT REALTY	21.1	12.53	139	19,349
ISTAR INC	—	12.56	124	17,267
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	26.3	15.016	292	40,621
SL GREEN REALTY CORP	17.357	9.538	396	55,127
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	57.5	32.9	33	4,614
URSTADT BIDDLE - CLASS A	7.6	4.1	76	10,664
UDR INC	72	44.932	1,830	254,268
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3.1	1.8	93	12,948
WP CAREY INC	47.6	30.533	2,388	331,662
ELME	21.6	12.6	242	33,647
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	7	4.7	29	4,131
AGREE REALTY CORP	17.8	11.744	810	112,596
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	61.648	34.441	1,035	143,867
CUBESMART	52.1	33.02	1,306	181,493
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	56.326	31.234	336	46,757
DIGITAL REALTY TRUST INC	72.978	42.282	4,598	638,547
CEDAR REALTY TRUST INC	3.1	—	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	34.5	19.7	3,024	419,990
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7.875	4.575	43	6,029
CENTERSPACE	3.66	2.261	143	19,969
KITE REALTY GROUP TRUST	55.741	32.569	732	101,719
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	24.9	—	—	—
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3.633	2.2	52	7,243
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	35.9	—	—	—

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8.8	5.521	102	14,229
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	54.342	31.03	284	39,514
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	153.8	88.121	1,143	158,840
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21	13.105	38	5,368
DOUGLAS EMMETT INC	45.3	26.186	442	61,419
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	6,511.212 157銘柄	3,839.687 145銘柄	146,165 <71.6%>
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	4.2	2.3	10	1,050
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	9.4	5.1	19	1,979
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	11.4	6.2	20	2,058
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	4.3	4.3	45	4,603
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	—	7.841	119	12,215
PRO REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	—	4.4	27	2,854
BSR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST U	—	2.758	52	5,373
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	17.1	8.4	78	7,997
SLATE GROCERY REIT	7	4	62	6,403
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	14.7	9.1	152	15,553
SLATE OFFICE REIT	5.1	5.1	23	2,360
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4.2	2.8	40	4,159
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	28	18.7	189	19,352
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	22.2	15	337	34,479
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11.2	6.1	36	3,751
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4.1	2.7	30	3,138
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	8.5	5.1	408	41,764
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	27	19.9	240	24,578
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	17.5	11	136	13,912
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	27.6	16.7	286	29,293
CHOICE PROPERTIES REIT	43.2	25.3	369	37,710
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4.2	2.7	44	4,537
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	14.1	8.4	131	13,455
PLAZA RETAIL REIT	11.1	—	—	—
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	19.1	11.3	311	31,873
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	22.8	13.5	584	59,717
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21.79	—	—	—
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	38.166	20.866	260	26,603
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	42	23.7	504	51,498
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	7.2	3.3	50	5,208
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5.9	3.6	180	18,414
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	12.3	8.2	133	13,671
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	16.8	10.1	267	27,363
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	482.156 30銘柄	288.465 31銘柄	5,157 <1.9%>
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU	284.343	171.638	1,349	125,180
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	—	38.4	61	5,665
HMC CAPITAL LTD	—	31.078	160	14,937
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	—	53.9	39	3,701
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	93.38	46.82	156	14,553
CROMWELL PROPERTY GROUP	371.284	199.444	140	13,047
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	144.87	88	280	26,048
AVENTUS GROUP	103	—	—	—
RURAL FUNDS GROUP	108.595	53.875	137	12,797
WAYPOINT REIT	202.491	113.781	312	29,033
CHARTER HALL LONG WALE REIT	149.458	99.512	437	40,628
CENTURIA OFFICE REIT	118.83	62.25	98	9,184
CENTURIA CAPITAL GROUP	166.05	105.967	199	18,485
IRONGATE GROUP	149.63	—	—	—
HOME CONSORTIUM	48	—	—	—
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	130.34	234.898	306	28,444
REGION GROUP	291.52	178.136	488	45,290
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	79.167	41.377	133	12,362
NATIONAL STORAGE REIT	288.195	167.575	402	37,318
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	54.67	31.51	91	8,449
GDI PROPERTY GROUP	123.31	71.46	54	5,039
SCENTRE GROUP	1,372.159	828.278	2,435	225,956
ARENA REIT	93.89	56.81	219	20,400
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	47.12	27.16	90	8,366
BWP TRUST	123.87	77.951	319	29,655
GPT GROUP	506.413	305.687	1,335	123,953
CHARTER HALL RETAIL REIT	139.51	83.41	338	31,422
MIRVAC GROUP	1,042.307	629.679	1,397	129,709
STOCKLAND	631.087	380.944	1,447	134,321
ABACUS PROPERTY GROUP	107.93	65.96	178	16,525
GOODMAN GROUP	444.441	271.299	5,070	470,498
VICINITY CENTRES	1,022.946	617.483	1,253	116,311
CHARTER HALL GROUP	123.136	73.759	1,002	93,011
INGENIA COMMUNITIES GROUP	94.74	59.59	254	23,610
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	8,656.682 31銘柄	5,267.631 31銘柄	20,195 <6.6%>
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	398	321	593	10,558
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	250	142	424	7,549
FORTUNE REIT	378	233	1,293	22,992
PROSPERITY REIT	300	174	306	5,444

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
LINK REIT	千口	千口	千香港ドル	千円
CHAMPION REIT	564.6	337	17,726	315,171
香港ドル 通貨計	□ 数、金額 6銘柄	1,475	21,072	374,677
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	—	84.7	54	5,477
KEPPEL DC REIT	331.683	204.483	380	38,429
FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	419.876	170.976	41	4,232
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	583.9	—	—	—
AIMS APAC REIT	119	81.1	99	10,079
FRASERS LOGISTICS & COMMERC	783.99	460.09	515	52,065
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	134	73.8	56	5,667
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	208.9	291.14	211	21,327
EC WORLD REIT	57	36.5	16	1,641
IREIT GLOBAL	175.124	—	—	—
CAPITALAND ASCENDAS REIT	905.877	536.277	1,480	149,551
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,346.522	803.522	1,671	168,870
SUNTEC REIT	565.4	357.6	493	49,862
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	770.8	501.8	807	81,630
KEPPEL REIT	501.4	317.6	285	28,881
CAPITALAND SCOTT STAPLED UNIT TRU	505.456	312.656	295	29,853
ESR LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	709.902	894.402	313	31,629
CDL HOSPITALITY TRUSTS	191.6	127.7	153	15,483
FRASERS CENTREPOINT TRUST	281.176	166.176	338	34,252
STARHILL GLOBAL REIT	383.8	198.4	110	11,125
CAPITALAND CHINA TRUST	269.442	178.942	187	18,984
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	98.3	62.6	241	24,414
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	513.769	310.269	701	70,850
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	354.5	—	—	—
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	579.884	367.484	635	64,235
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	248.1	147.8	90	9,184
SPH REIT	275.6	163	146	14,822
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	651.063	337.763	118	11,944
シンガポール・ドル 通貨計	□ 数、金額 27銘柄	7,186.78	9,446	954,496
(ニュージーランド)	千口	千口	千ニュージーランド・ドル	千円
STRIDE PROPERTY GROUP	—	82.638	122	10,534
ARGOSY PROPERTY LTD	224.47	119.25	138	11,914
KIWI PROPERTY GROUP LTD	423.8	261.44	237	20,491
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	102.92	71.483	165	14,222
GOODMAN PROPERTY TRUST	299.22	172.8	347	29,915
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	328.82	213.35	258	22,234
ニュージーランド・ドル 通貨計	□ 数、金額 6銘柄	920.961	1,269	109,312
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
WAREHOUSE REIT PLC	—	63.302	71	11,953
EDISTON PROPERTY INVESTMENT COMPAN	—	31.488	20	3,433
ASSURA PLC	707.1	456.627	251	41,861
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	159.57	83.32	73	12,146
STANDARD LIFE INV PROP INC	100	56.2	30	5,063
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	220.71	118.46	70	11,736
PICTON PROPERTY INCOME LTD	146.11	75.64	65	10,825
REGIONAL REIT LTD	111.31	59.84	35	5,968
NEWRIVER REIT PLC	69.33	42.86	32	5,464
CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	224.81	132.59	137	22,855
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	155.49	85.98	52	8,704
CUSTODIAN REIT PLC	109.42	60.9	55	9,303
GCP STUDENT LIVING PLC	112.86	—	—	—
PRS REIT PLC/THE	119.64	75.872	64	10,720
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	90.9	53.28	54	9,140
LXI REIT PLC	180.188	255.448	297	49,427
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	98.2	51.24	35	5,826
AEW UK REIT PLC	49.61	21.93	21	3,517
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	201.12	128.42	116	19,426
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	207	194.253	208	34,712
URBAN LOGISTICS REIT PLC	—	70.322	98	16,307
HOME REIT PLC	60	117.587	65	10,906
LAND SECURITIES GROUP PLC	198.461	115.934	719	119,600
SEGRO PLC	317.05	186.572	1,508	250,716
HAMMERSON PLC	1,076.984	545.564	135	22,490
UNITE GROUP PLC/THE	105.39	61.739	584	97,138
BRITISH LAND CO PLC	247.76	144.736	585	97,368
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	67.061	36.781	186	30,967
DERWENT LONDON PLC	29.63	17.327	414	68,953
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	346.37	205.675	233	38,804
WORKSPACE GROUP PLC	32.26	20.759	87	14,624
SAFESTORE HOLDINGS PLC	54.57	32.544	295	49,202
SHAFTESBURY PLC	75.77	41.75	152	25,275
BIG YELLOW GROUP PLC	45.64	26.76	293	48,842
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	237.15	149.787	271	45,142
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	121.6	78.138	35	5,825
TRITAX BIG BOX REIT PLC	454.53	280.618	410	68,244
イギリス・ポンド 通貨計	□ 数、金額 34銘柄	4,180,243	7,775	1,292,499

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(イスラエル)	千口	千口	千イスラエル・シケル	千円
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	—	105.526	186	7,529
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	—	31.07	271	10,961
REIT 1 LTD	48.84	26.1	488	19,717
イスラエル・シケル 通貨計	□ 数、金額 1銘柄	162.696	947	38,208
(韓国)	千口	千口	千韓国ウォン	千円
ESR KENDALL SQUARE REIT LTD	13.16	—	—	—
SK REITS LTD	—	11.423	52,488	5,500
D&D PLATFORM REIT LTD	—	8	27,360	2,867
SHINHAN SEOBU T&D REIT LTD	—	3.93	14,835	1,554
NH ALL ONE REIT LTD	—	6.454	20,265	2,123
E KOCREF CR	—	3.584	19,389	2,032
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	11.44	8.26	56,663	5,938
LOTTE REIT CO LTD	34.375	17.135	67,340	7,057
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	25.06	13.09	54,061	5,665
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5.6	5.6	25,452	2,667
JR REIT XXVII	31.29	22.64	97,352	10,202
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	8.5	5.99	29,650	3,107
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	27	24.442	97,768	10,246
韓国ウォン 通貨計	□ 数、金額 8銘柄	156.425	562,627	58,963
(ユーロ (アイルランド))	千口	千口	千ユーロ	千円
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	102.05	54.94	63	9,087
HIBERNIA REIT PLC	159.24	—	—	—
国小計	□ 数、金額 2銘柄	261.29	63	9,087
(ユーロ (オランダ))	千口	千口	千ユーロ	千円
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	9.887	5.854	137	19,684
WERELDHAVE NV	8.97	5.16	70	10,053
NSI NV	4.131	2.271	55	7,939
VASTNED RETAIL NV	4.7	2.32	50	7,211
国小計	□ 数、金額 4銘柄	27,688	312	44,890
(ユーロ (ベルギー))	千口	千口	千ユーロ	千円
AEDIFICA	8.886	5.376	407	58,547
COFINIMMO	6.88	4.064	341	49,102
BEFIMMO	5.86	—	—	—
INTERVEST OFFICES & WAREHOU	5.48	3.03	63	9,092
RETAIL ESTATES	2.54	1.457	90	12,949
WAREHOUSES DE PAUW SCA	34.45	19.268	495	71,154
CARE PROPERTY INVEST	6.1	3.45	52	7,529
XIOR STUDENT HOUSING NV	4.58	2.67	76	10,925
MONTEA NV	2.5	1.669	108	15,552
国小計	□ 数、金額 9銘柄	77,276	1,635	234,853
(ユーロ (フランス))	千口	千口	千ユーロ	千円
ALTAREA RIGHTS	0.01	—	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	28.68	14.478	752	108,053
ICADE	7.67	4.098	165	23,818
CARMILA	11.8	7.789	108	15,567
ALTAREA	1.01	0.55	76	11,008
GECINA SA	13.391	7.453	706	101,392
KLEPIERRE	48.64	26.957	600	86,234
COVIVIO	11.652	6.222	350	50,340
MERCIALYS	12.13	10.432	99	14,236
国小計	□ 数、金額 9銘柄	134,983	2,860	410,651
(ユーロ (ドイツ))	千口	千口	千ユーロ	千円
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	43.86	1.82	13	1,907
HAMBORNER REIT AG	17.28	9.07	67	9,701
国小計	□ 数、金額 2銘柄	61.14	80	11,609
(ユーロ (スペイン))	千口	千口	千ユーロ	千円
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14.53	7.5	33	4,781
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	63.533	40.217	240	34,501
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	82.17	45.751	414	59,514
国小計	□ 数、金額 3銘柄	160,233	688	98,797
(ユーロ (イタリア))	千口	千口	千ユーロ	千円
COIMA RES SPA	5.19	—	—	—
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	13.24	6.93	22	3,238
国小計	□ 数、金額 2銘柄	18.43	22	3,238
(ユーロ (その他))	千口	千口	千ユーロ	千円
CROMWELL REIT EUR	80.92	43.52	67	9,747
国小計	□ 数、金額 1銘柄	80.92	67	9,747
ユーロ通貨計	□ 数、金額 32銘柄	821.96	5,731	822,875
合計	□ 数、金額 331銘柄	38,927,763	23,796,327	26,349,822

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国	百万円	百万円
DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	493	-
STOXX 600 REAL (ドイツ)	208	-

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

■投資信託財産の構成

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	1,305,824	4.6
投資信託証券	26,349,822	92.3
コール・ローン等、その他	885,130	3.1
投資信託財産総額	28,540,777	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=138.87円、1カナダ・ドル=102.16円、1オーストラリア・ドル=92.79円、1香港ドル=17.78円、1シンガポール・ドル=101.04円、1ニュージーランド・ドル=86.13円、1イギリス・ポンド=166.23円、1イスラエル・シケル=40.334円、100韓国ウォン=10.48円、1ユーロ=143.58円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産(27,997,680千円)の投資信託財産総額(28,540,777千円)に対する比率は、98.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	28,892,444,962円
コール・ローン等	574,697,288
投資信託受益証券(評価額)	1,305,824,050
投資信託証券(評価額)	26,349,822,166
未収入金	356,657,924
未収配当金	43,173,851
差入委託証拠金	262,269,683
(B) 負債	544,093,403
未払金	528,017,403
未払解約金	16,076,000
(C) 純資産総額(A-B)	28,348,351,559
元本	9,066,118,780
次期繰越損益金	19,282,232,779
(D) 受益権総口数	9,066,118,780口
1万口当り基準価額(C/D)	31,268円

* 期首における元本額は15,433,680,362円、当作成期間中における追加設定元本額は3,053,614,153円、同解約元本額は9,421,175,735円です。
* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：
ダイワファンドラップ 外国REITインデックス (為替ヘッジなし) 1,224,238,742円
ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス (為替ヘッジなし) 253,344,510円
D-I's グローバルREITインデックス 1,829,770円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050 12,799,703円
iFree 外国REITインデックス 751,541,670円
iFree 8資産バランス 1,876,522,826円
グローバル・リート・インデックスファンド (資産形成型) 328,188,529円
グローバル・リート・インデックスファンド (毎月決算型) 179,838,342円
DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド 3,948,646,182円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030 7,043,305円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040 6,531,985円
ダイワ海外REITインデックス (為替ヘッジなし) (投資一任専用) 820,015円
ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用) 149,216,410円
ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT 250,077,120円
ダイワ・ノーロード グローバルREIT ファンド 71,541,533円
ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用) 3,938,138円
* 当期末の計算口数当りの純資産額は31,268円です。

■損益の状況

当期 自2021年12月1日 至2022年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,254,932,311円
受取配当金	1,254,027,617
受取利息	282,365
その他収益金	830,605
支払利息	△ 208,276
(B) 有価証券売買損益	235,073,693
売買益	8,126,209,009
売買損	△ 7,891,135,316
(C) 先物取引等損益	△ 210,406,239
取引益	105,531,907
取引損	△ 315,938,146
(D) その他費用	△ 23,316,693
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	1,256,283,072
(F) 前期繰越損益金	33,195,260,573
(G) 解約差損益金	△21,830,237,413
(H) 追加信託差損益金	6,660,926,547
(I) 合計(E+F+G+H)	19,282,232,779
次期繰越損益金(I)	19,282,232,779

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

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