

DCダイワ・ワールドアセット
(六つの羽/安定コース)

DCダイワ・ワールドアセット
(六つの羽/6分散コース)

DCダイワ・ワールドアセット
(六つの羽/成長コース)

(以下、上記のファンドを総称して「DCダイワ・ワールドアセット」といいます。)

★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/内外/資産複合	
信託期間	無期限(設定日:2006年1月12日)	
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長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	下記の各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
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	内外の公社債等(各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。)
	ダイワ・グローバルREIT・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
	ダイワJ-REITアクティブ・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
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券(上場予定および店頭登録予定を含みます。)
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	欧州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。)
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	アジア・オセアニア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。)
ダイワ好配当日本株マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式(上場予定を含みます。)	
組入制限	株式組入上限比率	
	外国債券インデックスマザーファンド	純資産総額の30%以下
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	純資産総額の10%以下
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	無制限
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	
投資信託証券組入上限比率		
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	無制限	
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益等とし、原則として、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、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

運用報告書(全体版) 第18期

(決算日 2024年1月10日)

(作成対象期間 2023年1月11日~2024年1月10日)

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、内外の債券、リート(不動産投資信託)および株式に投資し、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長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/>

<3719>

<3720>

<3721>

DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			合成指数		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	投資証券組入比率	不動産投資先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率						
14期末(2020年1月10日)	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
15期末(2021年1月12日)	17,628	0	12.2	18,471	12.9	18.0	-	50.3	28.9	0.3	4,925
16期末(2022年1月11日)	17,702	0	0.4	18,411	△ 0.3	19.0	-	49.4	28.6	0.4	5,838
17期末(2023年1月10日)	19,976	0	12.8	20,945	13.8	18.0	-	49.9	28.7	0.3	7,477
18期末(2024年1月10日)	19,057	0	△ 4.6	20,097	△ 4.0	17.1	-	50.8	28.7	0.2	7,978
18期末(2024年1月10日)	21,309	0	11.8	22,661	12.8	17.5	0.1	49.8	29.4	0.3	9,782

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 合成指数は、下記の指数と配分比率をもとに、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。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。

投資対象資産	指数	配分比率
海外債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	25%
国内債券	NOMURA-BPI総合指数	25%
海外リート	S&P先進国REIT指数 (除く日本、税引後配当込み、円換算)	15%
国内リート	東証REIT指数 (配当込み)	15%
海外株式	MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円換算)	10%
国内株式	TOPIX (配当込み)	10%

※上記指数のうち「S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算)」を「S&P先進国REIT指数 (除く日本、税引後配当込み、円換算)」に、「MSCIコクサイ指数 (配当込み、円換算)」を「MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円換算)」に変更しました。

(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) 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。

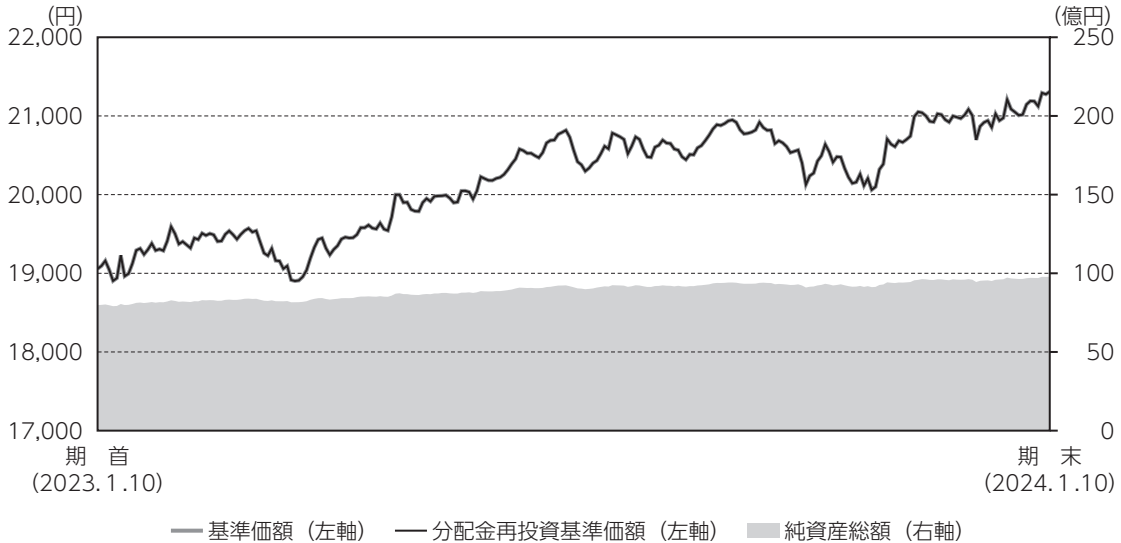
(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。

(注6) 公社債組入比率はハイブリッド優先証券を含みます。また、新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



(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はありません。

* 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：19,057円

期末：21,309円 (分配金0円)

騰落率：11.8% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、主に内外の

株式およびリートの価格上昇と円安がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

■ 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	12.9%	24.5%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)	1.1%	24.5%
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	18.7%	15.3%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	3.7%	14.8%
ダイワ好配当日本株マザーファンド	37.1%	10.1%
ダイワ北米好配当株マザーファンド	28.7%	7.8%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	24.4%	1.9%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	19.1%	0.3%

DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)

年 月 日	基 準 価 額		合 成 指 数		株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 組 入 比 率	投 資 証 券 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 先 物 比 率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率					
(期首)2023年 1 月10日	19,057	－	20,097	－	17.1	－	50.8	28.7	0.2
1 月末	19,290	1.2	20,360	1.3	17.3	－	49.7	29.3	0.2
2 月末	19,539	2.5	20,634	2.7	17.4	－	49.9	29.3	0.2
3 月末	19,329	1.4	20,465	1.8	17.2	0.2	50.4	28.5	0.3
4 月末	19,717	3.5	20,878	3.9	17.0	0.3	49.7	29.5	0.3
5 月末	20,033	5.1	21,255	5.8	17.3	0.1	50.0	29.2	0.3
6 月末	20,693	8.6	22,011	9.5	17.5	0.2	49.7	29.0	0.2
7 月末	20,616	8.2	21,914	9.0	17.9	0.1	49.4	29.4	0.3
8 月末	20,889	9.6	22,179	10.4	17.5	0.2	49.7	29.2	0.3
9 月末	20,550	7.8	21,776	8.4	17.3	0.3	50.2	28.6	0.3
10月末	20,099	5.5	21,277	5.9	17.1	0.2	50.6	28.7	0.3
11月末	20,999	10.2	22,278	10.9	17.2	0.2	49.6	29.4	0.3
12月末	21,187	11.2	22,516	12.0	17.2	0.1	49.9	29.6	0.3
(期末)2024年 1 月10日	21,309	11.8	22,661	12.8	17.5	0.1	49.8	29.4	0.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2023.1.11～2024.1.10)

■海外債券市況

主要国の国債金利は、上昇（債券価格は下落）しました。

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

■国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇基調で推移しました。

国内長期金利は、当作成期首より2023年2月にかけて、日銀が長期金利の変動許容幅を拡大した影響により、0.4%から0.5%前後で推移しました。3月は、欧米の金融不安の高まりを受けて金利は低下しましたが、4月から6月にかけては、欧米の金融不安が落ち着いたことで上昇し、0.4%から0.5%前後で推移しました。7月から8月にかけては、日銀が金融政策決定会合で長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）の運用を柔軟化することを決定したことなどから長期金利は上昇し、0.6%前後で推移しました。9月から10月にかけては、米国金利の上昇を受けて国内金利も上昇し、0.7%から1.0%前後で推移しました。その後当作成期末にかけては、米国で利上げサイクルの終了が意識されたことにより、金利は低下基調で推移しました。

■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、米国長期金利の落ち着きなどを好感し、上昇して始まりました。2023年3月中旬にかけては、米国の利上げ長期化観測や米国の地方銀行の経営破綻をきっかけとする金融システム不安などを背景に、下落しました。9月中旬にかけては、主要中央銀行の金融政策や長期金利、米国の債務上限問題の動向などに左右される中、上下する展開となりました。その後は、米国での堅調な経済指標を受けた金融引き締め長期化観測や長期金利の上昇、中東における地政学リスクの高まりなどを背景に、下落しました。当作成期末にかけては、米国の早期利下げ観測を受けた長期金利の急低下を好感し、大きく上昇しました。

■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、国内金利の上昇懸念が高まる中で下落しましたが、2023年1月中旬に、日銀が主要政策の現状維持を発表すると反発し、その後はおおむね横ばい圏での推移となりました。3月中旬には、欧米の金融機関の経営破綻や経営危機が報じられて下落に転じましたが、月末にかけては、政府の支援策が打ち出されたこともあり反発しました。4月中旬以降は、好調な決算が発

表されたことや、月末に日銀が金融緩和策の維持を決定したことを受け、国内リート市況は上昇しました。7月末に、日銀が長期金利の実質的な許容上限の引き上げを発表すると、国内リート市況は一時下落しましたが、長期金利の上昇幅が限定的だったこともあり、9月上旬にかけて上昇しました。9月中旬以降は、日米で長期金利の上昇が続き、国内リート市況も下落基調となりました。12月に入ると、金融政策の早期修正が警戒されたことや需給悪化などにより下落しましたが、年末に日銀が金融政策を据え置いたことや割安感が意識され、国内リート市況は反発して当作成期末を迎えました。

■海外株式市況

・北米

北米株式市況は上昇しました。

米国株式市況は、当作成期首より、賃金上昇率の鈍化でF R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げペースが減速するとの期待などから上昇しました。2023年2月から3月半ばにかけては、予想を上回る経済指標の発表が相次ぎ金利が上昇したことや、米国の地方銀行の経営破綻を受けて下落しましたが、その後は、F R Bによる緊急融資枠の新設で資金繰り懸念が後退したことなどが好感され、成長株を中心に上昇に転じました。4月以降は、地方銀行の経営不安や米国の債務上限問題への懸念が上値を抑えた一方、予想を上回る企業決算の発表が好感され、底堅い展開となりました。5月下旬からは、A I（人工知能）関連の半導体企業の強気見通しや債務上限問題の解決、インフレ率の鈍化などが好感され、大幅に上昇しました。8月以降は、米国国債の増発やF R Bの政策金利見通しの引き上げ、政府機関の閉鎖懸念などから長期金利が大幅に上昇したことを受け、株価は下落しました。10月に入ると、つなぎ予算の成立により政府機関の閉鎖が回避され一時的に反発しましたが、景気の先行き不透明感や企業業績の伸びの鈍化、パレスチナ情勢の悪化、長期金利のさらなる上昇などが嫌気され、続落しました。11月以降は、欧米のインフレ率が予想以上に鈍化し金利が低下したことやF R B議長発言を受けて利下げ観測が高まったことなどが好感され、急上昇して当作成期末を迎えました。

米国ハイブリッド優先証券市況は上昇しました。

米国ハイブリッド優先証券市況は、当作成期首より、米国のインフレ鈍化や景気減速懸念などが金利低下材料となり、上昇して始まりました。2023年2月に入ると、発表された経済指標が軒並み強い結果となったことで金融引き締め観測が高まったことのほか、3月には米国の地方銀行の経営破綻に端を発する信用不安が広がったことから下落しました。F R Bによる緊急融資枠の新設で資金繰り懸念が後退したことや、景気減速懸念が高まったことで金利が急低下したことを受けていったんは反発しましたが、5月月初にかけては、地方銀行の経営不安の再燃などにより再び下落しました。その後6月上旬から9月中旬にかけては、米国国債の需給悪化や好調な米国経済を背景に長期金利が上昇基調で推移する中、上値の重い展開となり、方向感のない動きとなりました。9月下旬に入ると、F R Bの政策金利見通しが引き上げられ高水準の政策金利が長期化するとの見方が強まったことなどから長期金利が大幅に上昇し、下落しました。11月から当作成期末にかけては、F R Bによる追加利上げへの懸念が後退したことから長期金利が低下し、上昇しました。

・欧州

欧州株式市況は上昇しました。

欧州株式市場は、中国におけるゼロコロナ政策撤廃による経済正常化期待や、暖冬でエネルギー価

格上昇への懸念が後退したことなどを背景に、当作成期首から上昇して始まりました。2023年3月に入ると、米国の地方銀行の経営破綻などにより信用不安が高まり弱含みましたが、信用不安が後退すると4月中旬にかけて反発しました。その後4月下旬から10月にかけては、欧州では各国中央銀行が相次いで利上げに踏み切ったほか、米国では高水準の政策金利が長期化するとの見方が強まったことなどを受けて、上値の重い展開が続きました。11月に入ると、インフレ率の予想以上の鈍化を受けECB（欧州中央銀行）による追加利上げ観測が後退したことなどを背景に、当作成期末にかけて上昇しました。

・アジア・オセアニア

アジア・オセアニア株式市況はおおむね横ばいとなりました。

アジア・オセアニア株式市況は、当作成期首より上昇して始まりましたが、2023年5月半ばにかけては、世界的な景気減速懸念などを背景に、下落基調で推移しました。7月下旬にかけては、半導体市況の回復期待やAI（人工知能）関連ビジネスの拡大期待から、台湾や韓国が上昇しました。10月末にかけては、米国の金融引き締め長期化観測や米国金利の上昇を受けて、軟調に推移しました。当作成期末にかけては、FOMC（米国連邦公開市場委員会）を受けた米国金利の低下を好感し、堅調に推移しました。

■国内株式市況

国内株式市況は、大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、中国のゼロコロナ政策見直しにより景気回復期待が高まったことや、日銀総裁人事への不透明感が解消して円安が進んだことなどが好感され、2023年3月上旬にかけて上昇しました。3月半ばには、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による金融不安の高まりで下落しましたが、4月以降は、経済活動正常化や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたこと、日銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調し円安が進行したこと、米国著名投資家の強気見通しにより海外投資家の資金が大量に流入したことなどから、大幅に上昇しました。9月下旬以降は、米国における長期金利の上昇や景気の先行き不透明感、パレスチナ情勢の悪化などが懸念されて反落しました。11月以降は、欧米におけるインフレ率の鈍化や金利の低下を受けて海外株式市場が大幅に上昇したこと、決算発表で好調な企業業績が確認されたこと、株主還元拡充の発表が相次いだことなどが好感され、上昇して当作成期末を迎えました。

■為替相場

為替相場は、円安となりました。

対円為替相場は、当作成期首より、インフレ率の低下期待などから米国金利が低下したことで日米金利差の縮小が意識されたことや、日銀が想定外の政策修正を行ったことで金融緩和政策の転換などが意識され、日本の長期金利が大きく上昇したことなどから、円高が進行しました。2月は、堅調な米国の経済指標を受けて米国金利が大きく上昇したことで、円安に転じて推移しました。3月は、欧米の信用不安により円高に推移しましたが、4月より10月にかけては、過度な信用不安の後退や主要国の金利が上昇したことなどを受けて、円安に推移しました。その後当作成期末にかけては、主要国の金利が低下したことを受けて、円高に推移しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行い、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行います。

- ・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の25%
 - ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I) …純資産総額の25%
 - ・ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド …純資産総額の15%
 - ・ダイワ J - R E I T アクティブ ・マザーファンド …純資産総額の15%
 - ・ダイワ北米好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ好配当日本株マザーファンド
- } … 3 ファンド合計で純資産総額の10%
(各地域の時価総額に応じて配分します。)
- …純資産総額の10%

■外国債券インデックスマザーファンド

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。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

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ってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド (国債以外の債券における国債との利回り格差) への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入出や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、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、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド

安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。外貨建資産の運用にあたっては、C & S に運用の指図にかかる権限を委託します。海外リートへの投資にあたっては、個別銘柄の投資価値を分析して、配当利回り、期待される成長性、割安度などを勘案し投資銘柄を選定し、分散投資を行います。

■ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

個別銘柄ごとの流動性を勘案しつつ国内リートに幅広く分散投資を行い、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。ポートフォリオ構築にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資します。

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、C & S に運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行ってまいります。普通株式については、今後も企業のファンダメンタルズ、キャッシュフローおよび配当の成長、配当利回り、バリュエーションなどを考慮しながら、ポートフォリオを構築します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築します。

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・アイルランドに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行ってまいります。銘柄選定では、収益基盤が強固で安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

当ファンドでは、主としてオーストラリアや中国（香港）、台湾、韓国を中心にアジア・オセアニア地域に上場する株式に投資し、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。ポートフォリオの構築にあたっては、各国の投資比率の分散に配慮しつつ、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮して銘柄選択を行います。

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

株式等の組入比率は、高位を維持する方針です。個別銘柄の選別にあたりましては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、中長期的な業績回復・成長の動向やP E R（株価収益率）・P B R（株価純資産倍率）などのバリュエーション指標、配当・自社株買いなどの株主還元政策や資本効率の向上に対する経営姿勢などに注目してまいります。

※C & S：コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

※アムンディ・アイルランド：アムンディ・アイルランド・リミテッド

ポートフォリオについて

(2023.1.11~2024.1.10)

■当ファンド

当ファンドは、各マザーファンドの受益証券を通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行いました。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、以下の標準組入比率をめどに投資を行いました。

- | | |
|--------------------------------|---|
| ・外国債券インデックスマザーファンド | …純資産総額の25% |
| ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I) | …純資産総額の25% |
| ・ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド | …純資産総額の15% |
| ・ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド | …純資産総額の15% |
| ・ダイワ北米好配当株マザーファンド | } … 3 ファンド合計で純資産総額の10%
(各地域の時価総額に応じて配分しました。) |
| ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ好配当日本株マザーファンド | …純資産総額の10% |

■外国債券インデックスマザーファンド

当作成期におきましては、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。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

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99%前後の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、ファンドへ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。

■ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、C & S に運用の指図にかかる権限を委託しております。当ファンドでは、信託財産の中長期的な成長をめざし、保有不動産の価値や期待される成長性などと比べてリート価格が魅力的であると考え、銘柄に着目するとともに、安定的な配当利回りの確保をめざしてポートフォリオを構築しました。国・地域別配分では、大きなリスクを取らず各地域に分散して投資を行いました。

■ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド

リートの組入比率につきましては、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本としており、おおむね95~98%台程度で推移させました。また、東証 R E I T 指数先物へ

の投資も行い、先物と合計で95～100%程度で推移させました。リート銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資しました。個別銘柄では、当作成期を通じてみると、三菱地所物流リート、ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト（現KDX不動産投資法人）、GLPなどを東証REIT指数と比較してオーバーウエートとし、ジャパンリアルエステイト、日本ロジスティクスファンド、森トラストリートなどをアンダーウエートとしました。

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、C&Sに運用の指図にかかる権限を委託しております。普通株式については、企業のファンダメンタルズやキャッシュフローの成長性、配当利回りやバリュエーション等を考慮し、キャッシュフローを生み出し、魅力的な配当利回りを将来にわたって提供できると考える銘柄を中心としたポートフォリオとしました。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心としたポートフォリオとしました。

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、アムンディ・アイルランドに運用の指図にかかる権限を委託しております。株式組入比率は高位に維持しました。銘柄選定にあたって、アムンディ・アイルランドは、収益基盤が強固で安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資しました。

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

オーストラリアや中国（香港）、台湾、韓国を中心に、高い利益成長が見込まれた銘柄や予想配当利回りが高いと判断された銘柄などを組み入れました。国別では、各国の投資比率の分散に配慮しつつ、オーストラリア、台湾、韓国を高位に組み入れました。セクター別では、情報技術や金融を高位に組み入れました。

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

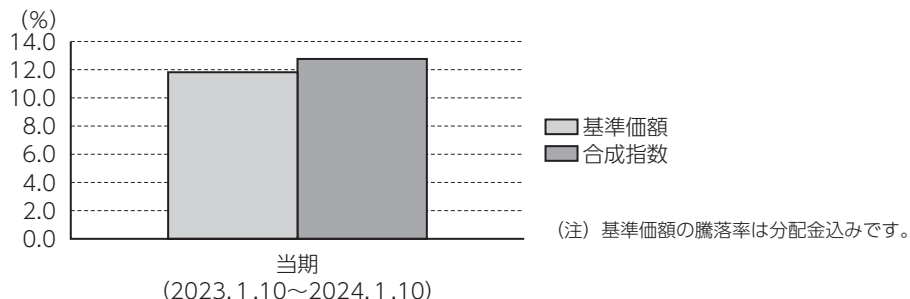
株式等の組入比率は、おおむね高位で推移させました。国内の経済活動の正常化が進み、日米の金融政策の転換が警戒された環境下では、回復・成長する企業業績の変化に注目したほか、株主還元の上に取り組み企業などに注目して、銘柄の入替えを行いました。業種構成は非鉄金属、機械、海運業などの比率を引き上げた一方、保険業、電気機器、化学などの比率を引き下げました。個別銘柄では、業績見通しや配当利回りの水準などを総合的に勘案して、トヨタ自動車、三井住友フィナンシャルG、住友電工などを買付けました。一方で、伊藤忠商事、東レ、第一生命HLDSなどを売却しました。

* 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）
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	NOMURA-BPI総合指数

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数（合成指数）との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、確定拠出型年金向けファンドであることを考慮し、収益分配を見送らせていただきました。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当 期	
	2023年1月11日 ～2024年1月10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）	—
翌期繰越分配可能額	（円）	11,730

(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、「翌期繰越分配可能額」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。

※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等です。



今後の運用方針

■当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行い、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行います。

- | | |
|---------------------------------|--|
| ・外国債券インデックスマザーファンド | …純資産総額の25% |
| ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I） | …純資産総額の25% |
| ・ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド | …純資産総額の15% |
| ・ダイワ J - R E I T アクティブ ・マザーファンド | …純資産総額の15% |
| ・ダイワ北米好配当株マザーファンド | } … 3 ファンド合計で純資産総額の10%
(各地域の時価総額に応じて配分します。) |
| ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ好配当日本株マザーファンド | …純資産総額の10% |

■外国債券インデックスマザーファンド

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。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

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ってまいります。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、売買コストなどに十分配慮しつつ、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、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■ダイワ・グローバル R E I T ・マザーファンド

安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。外貨建資産の運用にあたっては、C & S に運用の指図にかかる権限を委託します。海外リートへの投資にあたっては、個別銘柄の投資価値を分析して、配当利回り、期待される成長性、割安度などを勘案し投資銘柄を選定し、分散投資を行います。

■ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

個別銘柄ごとの流動性を勘案しつつ国内リートに幅広く分散投資を行い、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。ポートフォリオ構築にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資します。

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、C & S に運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行ってまいります。普通株式については、今後も企業のファンダメンタルズ、キャッシュフローおよび配当の成長、配当利回り、バリュエーションなどを考慮しながら、ポートフォリオを構築します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築します。

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・アイルランドに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行ってまいります。銘柄選定では、収益基盤が強固で安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

当ファンドでは、主としてオーストラリアや中国（香港）、台湾、韓国を中心にアジア・オセアニア地域に上場する株式へ投資し、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。ポートフォリオの構築にあたっては、各国の投資比率の分散に配慮しつつ、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮して銘柄選択を行います。

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

株式等の組入比率は、高位を維持する方針です。個別銘柄の選別にあたりましては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、中長期的な業績回復・成長の動向やP E R（株価収益率）・P B R（株価純資産倍率）などのバリュエーション指標、配当・自社株買いなどの株主還元策や資本効率の向上に対する経営姿勢などに注目してまいります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2023.1.11~2024.1.10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	200円	0.990%	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20,192円です。
（投 信 会 社）	(100)	(0.495)	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）	(89)	(0.440)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(11)	(0.055)	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	13	0.064	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）	(6)	(0.029)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
（ハイブリッド優先証券）	(1)	(0.003)	
（投 資 証 券）	(6)	(0.032)	
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）	(0)	(0.000)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.000)	
（投 資 証 券）	(2)	(0.009)	
そ の 他 費 用	4	0.019	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(2)	(0.011)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監 査 費 用）	(2)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	219	1.082	

(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。

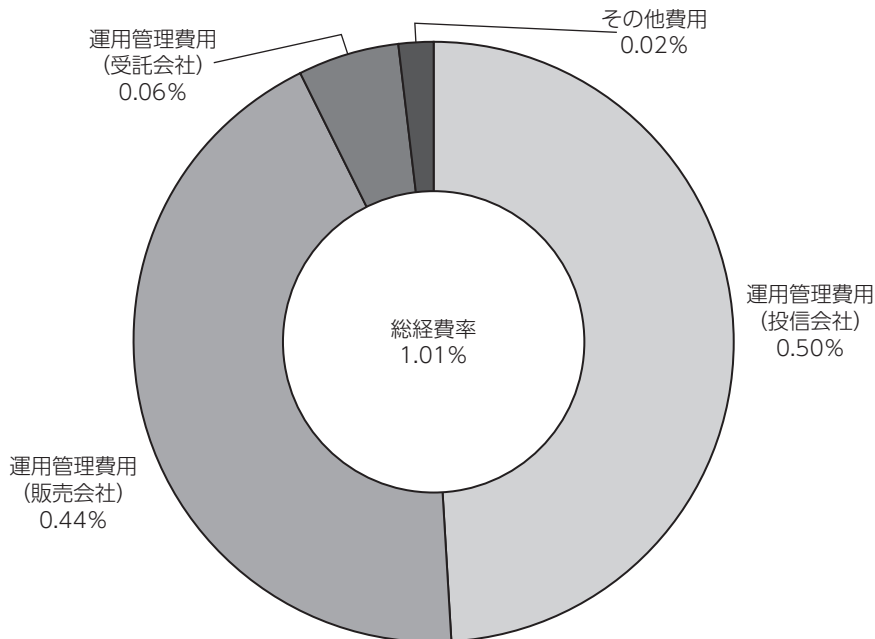
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.01%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2023年1月11日から2024年1月10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	61,429	196,251	11,438	37,738
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (BPI)	325,935	402,569	11,198	13,728
ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド	53,842	187,408	34,945	132,222
ダイワ好配当日本株 マザーファンド	5,252	22,730	24,578	106,657
ダイワ北米好配当株 マザーファンド	6,591	30,692	11,159	56,062
ダイワ欧州好配当株 マザーファンド	4,869	11,664	9,741	25,416
ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド	916	2,759	2,275	7,383
ダイワJ-REIT アクティブ・マザーファンド	75,898	256,383	7,292	24,998

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

項 目	当 期
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	45,744,122千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	23,266,001千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.96
	ダイワ北米好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	3,658,753千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,845,475千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.95
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	137,896千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,609,582千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.08
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	898,854千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	681,572千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.31

(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) 外国債券インデックス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。

(3) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI) における当作成期中の利害関係人との取引状況

(2023年1月11日から2024年1月10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
区 分						
公社債	百万円 21,063	百万円 1,218	% 5.8	百万円 9,031	百万円 300	% 3.3
コール・ローン	65,829	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合4.6%

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

(4) ダイワ・グローバルREIT・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。

(5) ダイワ好配当日本株マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2023年1月11日から2024年1月10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
区 分						
株式	百万円 27,829	百万円 7,085	% 25.5	百万円 17,914	百万円 4,966	% 27.7
株式先物取引	4,583	1,200	26.2	4,241	795	18.8
コール・ローン	339,163	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合3.7%

(6) ダイワ北米好配当株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。

(7) ダイワ欧州好配当株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。

(8) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株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。

(9) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
投資証券	百万円 91,515	百万円 15,870	% 17.3	百万円 61,645	百万円 8,529	% 13.8
不動産投信 指数先物取引	12,929	-	-	12,151	-	-
コール・ローン	774,335	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合0.9%

(10) 利害関係人の発行する有価証券等

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

種 類	当 期		
	ダイワJ-REITアクティブ・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 2,821	百万円 -	百万円 4,515

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(11) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

種 類	当 期	
	買	付 額
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	
投資証券	百万円 6,618	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)	
公社債	百万円 1,800	

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(12) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	5,720千円
うち利害関係人への支払額 (B)	882千円
(B)/(A)	15.4%

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

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社、大和証券オフィス投資法人、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	口 数	評 価 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 647,312	千口 697,303	千円 2,400,536	
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,630,806	1,945,543	2,397,493	
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	350,726	369,623	1,492,799	
ダイワ好配当日本株マザーファンド	221,786	202,460	986,995	
ダイワ北米好配当株マザーファンド	138,629	134,061	760,623	
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	68,720	63,848	181,105	
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	10,032	8,674	30,536	
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	349,951	418,558	1,448,546	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年1月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックスマザーファンド	千円 2,400,536	% 24.4
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	2,397,493	24.4
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	1,492,799	15.2
ダイワ好配当日本株マザーファンド	986,995	10.0
ダイワ北米好配当株マザーファンド	760,623	7.7
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	181,105	1.8
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	30,536	0.3
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	1,448,546	14.7
コール・ローン等、その他	137,208	1.5
投資信託財産総額	9,835,844	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、1月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=144.69円、1カナダ・ドル=108.09円、1オーストラリア・ドル=96.80円、1香港ドル=18.51円、1シンガポール・ドル=108.72円、1ニュージーランド・ドル=90.20円、1台湾ドル=4.659円、1イギリス・ポンド=183.96円、1イスラエル・シケル=38.749円、1スイス・フラン=169.76円、1デンマーク・クローネ=21.21円、1ノルウェー・クローネ=13.98円、1スウェーデン・クローネ=14.12円、1メキシコ・ペソ=8.525円、100韓国ウォン=10.96円、1オフショア人民元=20.138円、1マレーシア・リンギット=31.087円、1ポーランド・ズロチ=36.38円、1ユーロ=158.20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(284,021,393千円)の投資信託財産総額(288,390,543千円)に対する比率は、98.5%です。
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(94,523,244千円)の投資信託財産総額(95,458,077千円)に対する比率は、99.0%です。
ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(5,714,817千円)の投資信託財産総額(5,765,545千円)に対する比率は、99.1%です。
ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(1,738,151千円)の投資信託財産総額(1,743,881千円)に対する比率は、99.7%です。
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(683,283千円)の投資信託財産総額(688,075千円)に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年1月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	9,835,844,062円
コール・ローン等	137,184,060
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	2,400,536,030
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)(評価額)	2,397,493,240
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド(評価額)	1,492,799,964
ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額)	986,995,039
ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額)	760,623,444
ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額)	181,105,373
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド(評価額)	30,536,203
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド(評価額)	1,448,546,709
未収入金	24,000
(B) 負債	53,029,537
未払解約金	5,928,839
未払信託報酬	46,711,521
その他未払費用	389,177
(C) 純資産総額(A-B)	9,782,814,525
元本	4,590,954,586
次期繰越損益金	5,191,859,939
(D) 受益権総口数	4,590,954,586口
1万口当り基準価額(C/D)	21,309円

*期首における元本額は4,186,631,287円、当作成期間中における追加設定元本額は793,333,632円、同解約元本額は389,010,333円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は21,309円です。

■損益の状況

当期 自2023年1月11日 至2024年1月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 32,007円
受取利息	160
その他収益金	1,589
支払利息	△ 33,756
(B) 有価証券売買損益	1,037,776,862
売買益	1,083,556,576
売買損	△ 45,779,714
(C) 信託報酬等	△ 89,190,364
(D) 当期損益金(A+B+C)	948,554,491
(E) 前期繰越損益金	860,927,705
(F) 追加信託差損益金	3,382,377,743
(配当等相当額)	(3,575,764,791)
(売買損益相当額)	(△ 193,387,048)
(G) 合計(D+E+F)	5,191,859,939
次期繰越損益金(G)	5,191,859,939
追加信託差損益金	3,382,377,743
(配当等相当額)	(3,575,764,791)
(売買損益相当額)	(△ 193,387,048)
分配準備積立金	1,809,514,203
繰越損益金	△ 32,007

(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。

(注4) 投資信託財産(親投資信託)の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用: 11,029,026円(未監査)

■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	612,044,911
(c) 収益調整金	3,575,764,791
(d) 分配準備積立金	1,197,469,292
(e) 当期分配可能額(a+b+c+d)	5,385,278,994
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e-f)	5,385,278,994
(h) 受益権総口数	4,590,954,586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商標又は商標は、株式会社JPIX総研又は株式会社JPIX総研の関連会社(以下「JPIX」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商標又は商標に関するすべての権利はJPIXが有する。JPIX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、JPIX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JPIXは責任を負わない。

NOMURA-BPI総合指数の知的財産権およびその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等並びに当ファンド及び同指数に関連して行われる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。

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。

DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			合成指数		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	投資証券組入比率	不動産投資先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率						
14期末(2020年1月10日)	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
	18,888	0	14.7	19,404	15.9	29.9	-	34.8	32.1	0.3	5,783
15期末(2021年1月12日)	18,830	0	△ 0.3	19,425	0.1	31.3	-	34.0	31.5	0.5	6,484
16期末(2022年1月11日)	21,960	0	16.6	22,804	17.4	29.9	-	34.5	31.7	0.3	8,604
17期末(2023年1月10日)	20,999	0	△ 4.4	21,893	△ 4.0	28.5	-	35.5	31.9	0.3	9,398
18期末(2024年1月10日)	24,153	0	15.0	25,443	16.2	29.0	0.2	34.4	32.8	0.3	11,710

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 合成指数は、下記の指数と配分比率をもとに、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。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。

投資対象資産	指数	配分比率
海外債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	16.7%
国内債券	NOMURA-BPI総合指数	16.7%
海外リート	S&P先進国REIT指数 (除く日本、税引後配当込み、円換算)	16.7%
国内リート	東証REIT指数 (配当込み)	16.7%
海外株式	MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円換算)	16.7%
国内株式	TOPIX (配当込み)	16.7%

※上記指数のうち「S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算)」を「S&P先進国REIT指数 (除く日本、税引後配当込み、円換算)」に、「MSCIコクサイ指数 (配当込み、円換算)」を「MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円換算)」に変更しました。

(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) 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。

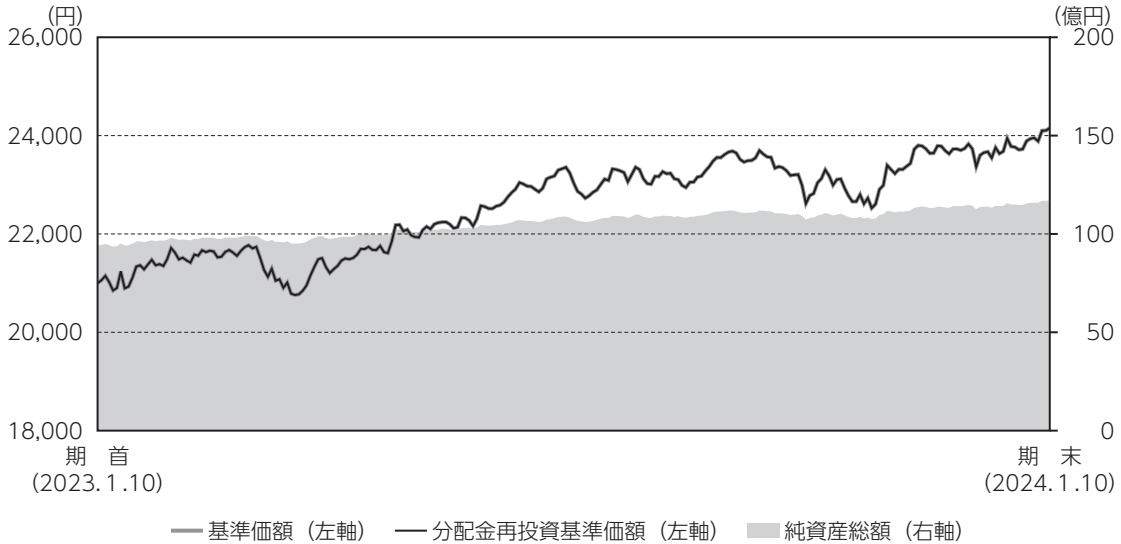
(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。

(注6) 公社債組入比率はハイブリッド優先証券を含みます。また、新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



(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はありません。

* 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：20,999円

期末：24,153円（分配金0円）

騰落率：15.0%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、主に内外の株式およびリーートの価格上昇と円安がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

■ 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
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	18.7%	17.2%
ダイワ好配当日本株マザーファンド	37.1%	16.7%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	3.7%	16.3%
外国債券インデックスマザーファンド	12.9%	16.2%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)	1.1%	16.2%
ダイワ北米好配当株マザーファンド	28.7%	12.9%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	24.4%	3.1%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	19.1%	0.5%

DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／6分散コース)

年 月 日	基 準 価 額		合 成 指 数		株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 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	(参考指数)	騰 落 率					
(期首)2023年 1 月10日	円 20,999	% -	21,893	% -	% 28.5	% -	% 35.5	% 31.9	% 0.3
1 月末	21,364	1.7	22,310	1.9	28.7	-	34.5	32.4	0.3
2 月末	21,674	3.2	22,645	3.4	28.9	-	34.7	32.3	0.2
3 月末	21,330	1.6	22,397	2.3	28.6	0.3	34.9	31.6	0.3
4 月末	21,847	4.0	22,929	4.7	28.3	0.5	34.5	32.6	0.3
5 月末	22,274	6.1	23,429	7.0	28.9	0.2	34.5	32.4	0.3
6 月末	23,177	10.4	24,449	11.7	29.1	0.3	34.4	32.1	0.3
7 月末	23,209	10.5	24,478	11.8	29.8	0.2	34.0	32.5	0.3
8 月末	23,556	12.2	24,777	13.2	29.0	0.3	34.5	32.3	0.3
9 月末	23,202	10.5	24,308	11.0	28.8	0.4	34.8	31.8	0.3
10月末	22,607	7.7	23,653	8.0	28.6	0.3	35.2	32.0	0.3
11月末	23,726	13.0	24,900	13.7	28.7	0.3	34.4	32.6	0.3
12月末	23,954	14.1	25,226	15.2	28.6	0.2	34.5	33.1	0.3
(期末)2024年 1 月10日	24,153	15.0	25,443	16.2	29.0	0.2	34.4	32.8	0.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2023.1.11~2024.1.10)

4～6ページをご参照ください。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行い、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行います。

- ・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の16.7%
 - ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I) …純資産総額の16.7%
 - ・ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンド …純資産総額の16.7%
 - ・ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンド …純資産総額の16.7%
 - ・ダイワ北米好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
 - ・ダイワ好配当日本株マザーファンド
- } … 3ファンド合計で純資産総額の16.7%
(各地域の時価総額に応じて配分します。)
- } …純資産総額の16.7%

■外国債券インデックスマザーファンド

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

■ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンド

■ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンド

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

7～8ページをご参照ください。

ポートフォリオについて

(2023.1.11~2024.1.10)

■当ファンド

当ファンドは、各マザーファンドの受益証券を通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行いました。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、以下の標準組入比率をめどに投資を行いました。

- | | |
|--------------------------------|---|
| ・外国債券インデックスマザーファンド | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I) | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ・グローバル R E I T・マザーファンド | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド | …純資産総額の16.7% |
| ・ダイワ北米好配当株マザーファンド | } … 3 ファンド合計で純資産総額の16.7%
(各地域の時価総額に応じて配分しました。) |
| ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ好配当日本株マザーファンド | …純資産総額の16.7% |

■外国債券インデックスマザーファンド

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

■ダイワ・グローバル R E I T・マザーファンド

■ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

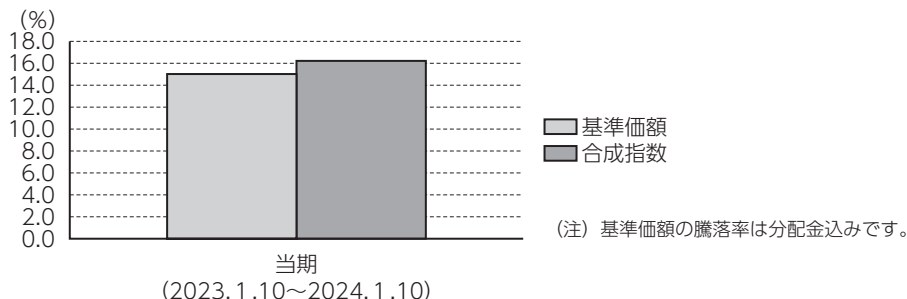
■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

9~10ページをご参照ください。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数（合成指数）との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、確定拠出型年金向けファンドであることを考慮し、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2023年1月11日 ～2024年1月10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）	—
翌期繰越分配可能額	（円）	14,805

（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、「翌期繰越分配可能額」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。

※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等です。



今後の運用方針

■当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行い、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行います。

- ・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の16.7%
- ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I) …純資産総額の16.7%
- ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド …純資産総額の16.7%
- ・ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド …純資産総額の16.7%
- ・ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド } …3ファンド合計で純資産総額の16.7%
(各地域の時価総額に応じて配分します。)
- ・ダイワ好配当日本株マザーファンド …純資産総額の16.7%

■外国債券インデックスマザーファンド

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

■ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

■ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

12～13ページをご参照ください。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2023.1.11~2024.1.10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	261円	1.155%	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22,589円です。
(投 信 会 社)	(132)	(0.583)	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)	(117)	(0.517)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(12)	(0.055)	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	20	0.089	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)	(11)	(0.048)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(ハイブリッド優先証券)	(1)	(0.005)	
(投 資 証 券)	(8)	(0.035)	
有 価 証 券 取 引 税	2	0.010	有価証券取引税=当作成期中の有価証券取引税/当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.001)	
(ハイブリッド優先証券)	(0)	(0.000)	
(投 資 証 券)	(2)	(0.010)	
そ の 他 費 用	5	0.022	その他費用=当作成期中のその他費用/当作成期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(3)	(0.013)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(2)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	288	1.276	

(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。

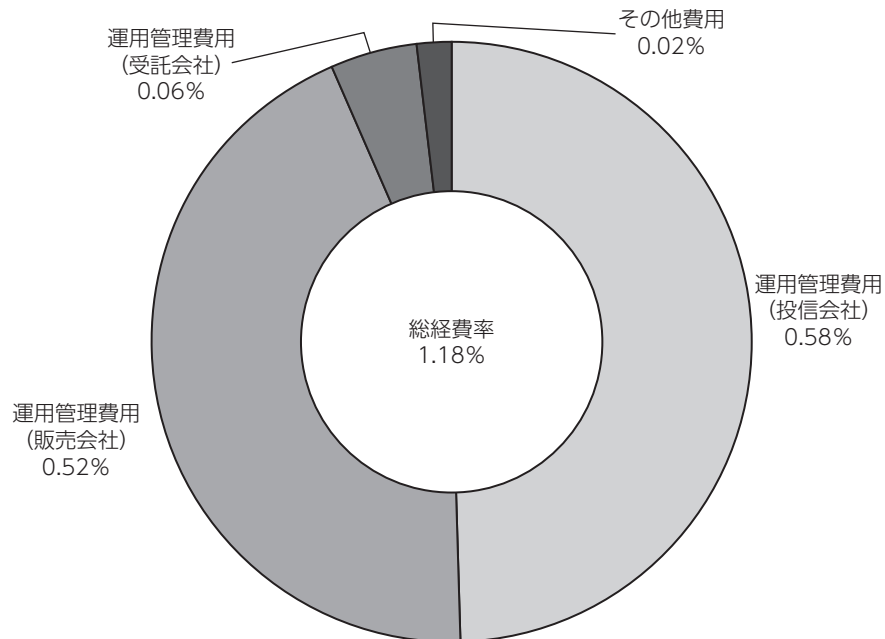
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.18%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2023年1月11日から2024年1月10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	54,843	176,236	11,413	36,879
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (BPI)	277,474	342,459	15,265	18,838
ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド	68,998	240,855	31,233	116,728
ダイワ好配当日本株 マザーファンド	8,708	39,593	43,049	185,769
ダイワ北米好配当株 マザーファンド	11,793	55,658	17,703	88,061
ダイワ欧州好配当株 マザーファンド	8,789	20,972	16,111	41,443
ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド	1,852	5,566	4,087	13,151
ダイワJ-REIT アクティブ・マザーファンド	101,877	345,613	8,183	27,934

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

項 目	当 期
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	45,744,122千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	23,266,001千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.96
	ダイワ北米好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	3,658,753千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,845,475千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.95
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	137,896千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,609,582千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.08
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	898,854千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	681,572千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.31

(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) 外国債券インデックス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。

(3) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI) における当作成期中の利害関係人との取引状況

(2023年1月11日から2024年1月10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
区 分						
公社債	百万円 21,063	百万円 1,218	% 5.8	百万円 9,031	百万円 300	% 3.3
コール・ローン	65,829	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合3.6%

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

(4) ダイワ・グローバルREIT・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。

(5) ダイワ好配当日本株マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2023年1月11日から2024年1月10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
区 分						
株式	百万円 27,829	百万円 7,085	% 25.5	百万円 17,914	百万円 4,966	% 27.7
株式先物取引	4,583	1,200	26.2	4,241	795	18.8
コール・ローン	339,163	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合7.3%

(6) ダイワ北米好配当株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。

(7) ダイワ欧州好配当株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。

(8) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株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。

(9) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
投資証券	百万円 91,515	百万円 15,870	% 17.3	百万円 61,645	百万円 8,529	% 13.8
不動産投信 指数先物取引	12,929	-	-	12,151	-	-
コール・ローン	774,335	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合1.1%

(10) 利害関係人の発行する有価証券等

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

種 類	当 期		
	ダイワJ-REITアクティブ・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 2,821	百万円 -	百万円 4,515

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(11) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

種 類	当 期	
	買	付 額
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	
投資証券	百万円 6,618	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)	
公社債	百万円 1,800	

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(12) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	9,377千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1,566千円
(B)/(A)	16.7%

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

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社、大和証券オフィス投資法人、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	口 数	評 価 額
外国債券インデックスマザーファンド		千口	千口	千円
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,279,480	1,541,689	1,901,704	1,899,823
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	459,562	497,326	2,008,554	
ダイワ好配当日本株マザーファンド	436,012	401,671	1,958,148	
ダイワ北米好配当株マザーファンド	272,054	266,144	1,510,023	
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	134,800	127,478	361,594	
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	19,730	17,495	61,590	
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	457,604	551,298	1,907,933	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年1月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックスマザーファンド	千円 1,901,704	% 16.1
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	1,899,823	16.1
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	2,008,554	17.0
ダイワ好配当日本株マザーファンド	1,958,148	16.6
ダイワ北米好配当株マザーファンド	1,510,023	12.8
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	361,594	3.1
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	61,590	0.5
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	1,907,933	16.2
コール・ローン等、その他	171,339	1.6
投資信託財産総額	11,780,712	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、1月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=144.69円、1カナダ・ドル=108.09円、1オーストラリア・ドル=96.80円、1香港ドル=18.51円、1シンガポール・ドル=108.72円、1ニュージーランド・ドル=90.20円、1台湾ドル=4.659円、1イギリス・ポンド=183.96円、1イスラエル・シケル=38.749円、1スイス・フラン=169.76円、1デンマーク・クローネ=21.21円、1ノルウェー・クローネ=13.98円、1スウェーデン・クローネ=14.12円、1メキシコ・ペソ=8.525円、100韓国ウォン=10.96円、1オフショア人民元=20.138円、1マレーシア・リンギット=31.087円、1ポーランド・ズロチ=36.38円、1ユーロ=158.20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(284,021,393千円)の投資信託財産総額(288,390,543千円)に対する比率は、98.5%です。
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(94,523,244千円)の投資信託財産総額(95,458,077千円)に対する比率は、99.0%です。
ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(5,714,817千円)の投資信託財産総額(5,765,545千円)に対する比率は、99.1%です。
ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(1,738,151千円)の投資信託財産総額(1,743,881千円)に対する比率は、99.7%です。
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(683,283千円)の投資信託財産総額(688,075千円)に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年1月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	11,780,712,431円
コール・ローン等	168,567,562
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	1,901,704,313
ダイブ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)(評価額)	1,899,823,756
ダイブ・グローバルREIT・マザーファンド(評価額)	2,008,554,296
ダイブ好配当日本株マザーファンド(評価額)	1,958,148,513
ダイブ北米好配当株マザーファンド(評価額)	1,510,023,998
ダイブ欧州好配当株マザーファンド(評価額)	361,594,152
ダイブ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド(評価額)	61,590,813
ダイブJ-REITアクティブ・マザーファンド(評価額)	1,907,933,028
未収入金	2,772,000
(B) 負債	69,941,400
未払解約金	4,840,651
未払信託報酬	64,639,139
その他未払費用	461,610
(C) 純資産総額(A-B)	11,710,771,031
元本	4,848,519,962
次期繰越損益金	6,862,251,069
(D) 受益権総口数	4,848,519,962口
1万口当り基準価額(C/D)	24,153円

*期首における元本額は4,475,748,849円、当作成期間中における追加設定元本額は850,834,868円、同解約元本額は478,063,755円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は24,153円です。

■損益の状況

当期 自2023年1月11日 至2024年1月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 38,916円
受取利息	170
その他収益金	2,283
支払利息	△ 41,369
(B) 有価証券売買損益	1,519,641,994
売買益	1,594,357,333
売買損	△ 74,715,339
(C) 信託報酬等	△ 122,776,828
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,396,826,250
(E) 前期繰越損益金	1,195,592,703
(F) 追加信託差損益金	4,269,832,116
(配当等相当額)	(4,586,045,975)
(売買損益相当額)	(△ 316,213,859)
(G) 合計(D+E+F)	6,862,251,069
次期繰越損益金(G)	6,862,251,069
追加信託差損益金	4,269,832,116
(配当等相当額)	(4,586,045,975)
(売買損益相当額)	(△ 316,213,859)
分配準備積立金	2,592,457,869
繰越損益金	△ 38,916

(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。

(注4) 投資信託財産(親投資信託)の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用: 17,279,620円(未監査)

■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	1,030,169,221
(c) 収益調整金	4,586,045,975
(d) 分配準備積立金	1,562,288,648
(e) 当期分配可能額(a+b+c+d)	7,178,503,844
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e-f)	7,178,503,844
(h) 受益権総口数	4,848,519,962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商標又は商標は、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商標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。

NOMURA-BPI総合指数の知的財産権およびその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等並びに当ファンド及び同指数に関連して行われる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。

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。

DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			合成指数		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	投資証券組入比率	不動産投資先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率						
14期末(2020年1月10日)	円 20,384	円 0	% 18.5	20,567	% 20.1	% 44.8	% -	% 13.1	% 38.5	% 0.4	百万円 6,327
15期末(2021年1月12日)	20,216	0	△ 0.8	20,564	△ 0.0	46.5	-	12.4	37.6	0.6	7,237
16期末(2022年1月11日)	24,728	0	22.3	25,267	22.9	44.7	-	12.8	37.9	0.4	10,544
17期末(2023年1月10日)	23,715	0	△ 4.1	24,235	△ 4.1	42.7	-	14.0	38.3	0.3	12,038
18期末(2024年1月10日)	28,278	0	19.2	29,265	20.8	43.2	0.3	13.1	39.2	0.4	15,653

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 合成指数は、下記の指数と配分比率をもとに、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。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。

投資対象資産	指数	配分比率
海外債券	FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	5%
国内債券	NOMURA-BPI総合指数	5%
海外リート	S&P先進国REIT指数 (除く日本、税引後配当込み、円換算)	20%
国内リート	東証REIT指数 (配当込み)	20%
海外株式	MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円換算)	25%
国内株式	TOPIX (配当込み)	25%

※上記指数のうち「S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算)」を「S&P先進国REIT指数 (除く日本、税引後配当込み、円換算)」に、「MSCIコクサイ指数 (配当込み、円換算)」を「MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円換算)」に変更しました。

(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) 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。

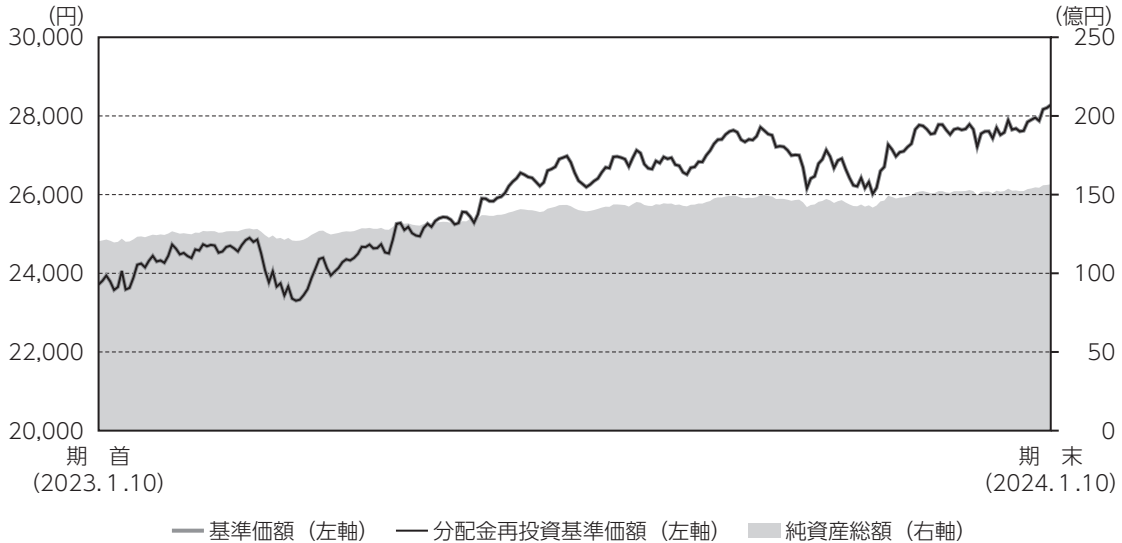
(注5) 先物比率は買建比率-売建比率です。

(注6) 公社債組入比率はハイブリッド優先証券を含みます。また、新株予約権付社債券 (転換社債券) および債券先物を除きます。



運用経過

基準価額等の推移について



(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はありません。

* 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：23,715円

期末：28,278円（分配金0円）

騰落率：19.2%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資した結果、主に内外の株式およびリートの価格上昇と円安がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

■ 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
ダイワ好配当日本株マザーファンド	37.1%	24.9%
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	18.7%	20.5%
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	3.7%	19.4%
ダイワ北米好配当株マザーファンド	28.7%	19.2%
外国債券インデックスマザーファンド	12.9%	4.8%
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	1.1%	4.8%
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	24.4%	4.6%
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	19.1%	0.8%

DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽／成長コース)

年 月 日	基 準 価 額		合 成 指 数		株式組入 比 率	株式先物 比 率	公 社 債 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	(参考指数)	騰 落 率					
(期首)2023年 1 月10日	円 23,715	% -	24,235	% -	% 42.7	% -	% 14.0	% 38.3	% 0.3
1 月末	24,298	2.5	24,892	2.7	42.7	-	13.3	38.8	0.3
2 月末	24,699	4.1	25,317	4.5	43.1	-	13.4	38.7	0.3
3 月末	24,113	1.7	24,914	2.8	43.0	0.5	12.9	38.1	0.3
4 月末	24,848	4.8	25,636	5.8	42.3	0.7	13.0	39.0	0.3
5 月末	25,441	7.3	26,313	8.6	42.7	0.2	13.0	39.2	0.3
6 月末	26,707	12.6	27,729	14.4	43.2	0.5	13.0	38.6	0.3
7 月末	26,934	13.6	27,976	15.4	44.2	0.3	12.9	38.7	0.4
8 月末	27,398	15.5	28,323	16.9	43.2	0.5	13.2	38.6	0.4
9 月末	27,010	13.9	27,740	14.5	43.1	0.6	13.2	38.1	0.4
10月末	26,173	10.4	26,833	10.7	43.0	0.5	13.3	38.6	0.4
11月末	27,657	16.6	28,461	17.4	42.9	0.5	13.0	39.1	0.4
12月末	27,957	17.9	28,941	19.4	42.8	0.3	13.2	39.7	0.4
(期末)2024年 1 月10日	28,278	19.2	29,265	20.8	43.2	0.3	13.1	39.2	0.4

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2023.1.11~2024.1.10)

4～6ページをご参照ください。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行い、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行います。

- ・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の5%
- ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I) …純資産総額の5%
- ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド …純資産総額の20%
- ・ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド …純資産総額の20%
- ・ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド } …3ファンド合計で純資産総額の25%
(各地域の時価総額に応じて配分します。)
- ・ダイワ好配当日本株マザーファンド …純資産総額の25%

■外国債券インデックスマザーファンド

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

■ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

■ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

7～8ページをご参照ください。

ポートフォリオについて

(2023.1.11~2024.1.10)

■当ファンド

当ファンドは、各マザーファンドの受益証券を通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行いました。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、以下の標準組入比率をめどに投資を行いました。

- | | |
|--------------------------------|---|
| ・外国債券インデックスマザーファンド | …純資産総額の5% |
| ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I) | …純資産総額の5% |
| ・ダイワ・グローバル R E I T・マザーファンド | …純資産総額の20% |
| ・ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド | …純資産総額の20% |
| ・ダイワ北米好配当株マザーファンド | } … 3 ファンド合計で純資産総額の25%
(各地域の時価総額に応じて配分しました。) |
| ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド | |
| ・ダイワ好配当日本株マザーファンド | …純資産総額の25% |

■外国債券インデックスマザーファンド

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

■ダイワ・グローバル R E I T・マザーファンド

■ダイワ J - R E I T アクティブ・マザーファンド

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

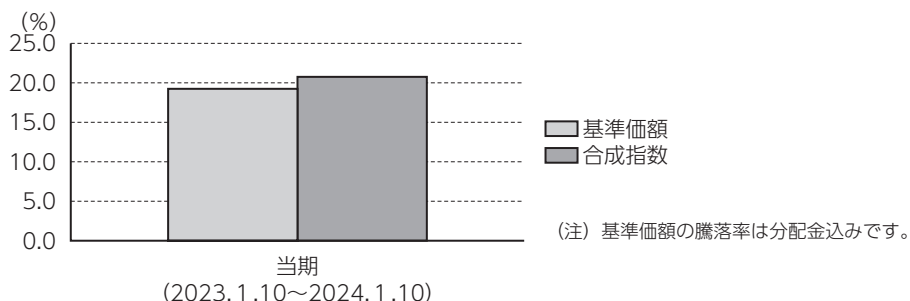
■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

9~10ページをご参照ください。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数 (合成指数) との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、確定拠出型年金向けファンドであることを考慮し、収益分配を見送らせていただきました。
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2023年1月11日 ～2024年1月10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）	—
翌期繰越分配可能額	（円）	19,348

（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、「翌期繰越分配可能額」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。

※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益等です。



今後の運用方針

■当ファンド

各マザーファンドを通じて、内外の債券、リートおよび株式に投資を行い、安定的な配当等収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率をめどに投資を行います。

- ・外国債券インデックスマザーファンド …純資産総額の5%
- ・ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I) …純資産総額の5%
- ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド …純資産総額の20%
- ・ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド …純資産総額の20%
- ・ダイワ北米好配当株マザーファンド
- ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド
- ・ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド } …3ファンド合計で純資産総額の25%
(各地域の時価総額に応じて配分します。)
- ・ダイワ好配当日本株マザーファンド …純資産総額の25%

■外国債券インデックスマザーファンド

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

■ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

■ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

■ダイワ北米好配当株マザーファンド

■ダイワ欧州好配当株マザーファンド

■ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

■ダイワ好配当日本株マザーファンド

12~13ページをご参照ください。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2023.1.11~2024.1.10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	343円	1.320%	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26,003円です。
（投 信 会 社）	(174)	(0.671)	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）	(154)	(0.594)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(14)	(0.055)	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	32	0.122	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）	(19)	(0.072)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
（ハイブリッド優先証券）	(2)	(0.008)	
（投 資 証 券）	(11)	(0.042)	
有 価 証 券 取 引 税	3	0.013	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株 式）	(0)	(0.001)	
（ハイブリッド優先証券）	(0)	(0.000)	
（投 資 証 券）	(3)	(0.011)	
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)	(0.015)	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）	(2)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	385	1.479	

(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。

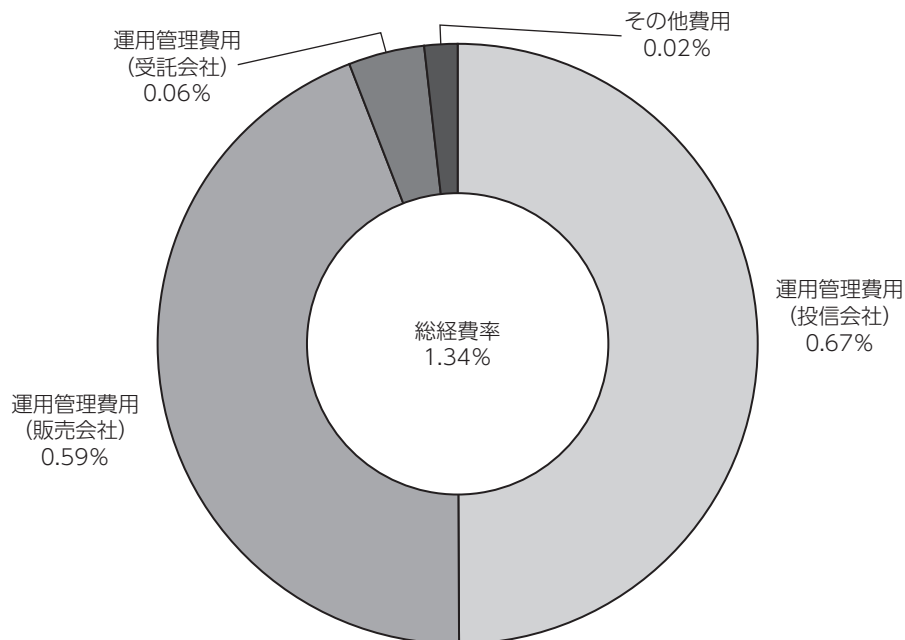
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.34%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2023年1月11日から2024年1月10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	29,898	96,012	5,584	17,993
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (BPI)	133,568	164,940	9,449	11,634
ダイワ・グローバル REIT・マザーファンド	142,424	497,646	56,779	212,698
ダイワ好配当日本株 マザーファンド	26,269	118,816	61,751	266,267
ダイワ北米好配当株 マザーファンド	30,284	148,395	23,305	114,995
ダイワ欧州好配当株 マザーファンド	22,482	55,158	28,476	73,444
ダイワ・アジア・オセアニア 好配当株マザーファンド	4,601	13,940	7,674	24,439
ダイワJ-REIT アクティブ・マザーファンド	183,312	624,798	7,210	24,624

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

項 目	当 期
	ダイワ好配当日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	45,744,122千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	23,266,001千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.96
	ダイワ北米好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	3,658,753千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,845,475千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.95
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	137,896千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,609,582千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.08
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	898,854千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	681,572千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.31

(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) 外国債券インデックス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。

(3) ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI) における当作成期中の利害関係人との取引状況

(2023年1月11日から2024年1月10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	売却額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
区 分						
公社債	百万円 21,063	百万円 1,218	% 5.8	百万円 9,031	百万円 300	% 3.3
コール・ローン	65,829	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合1.4%

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

(4) ダイワ・グローバルREIT・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。

(5) ダイワ好配当日本株マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2023年1月11日から2024年1月10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	売却額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
区 分						
株式	百万円 27,829	百万円 7,085	% 25.5	百万円 17,914	百万円 4,966	% 27.7
株式先物取引	4,583	1,200	26.2	4,241	795	18.8
コール・ローン	339,163	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合14.2%

(6) ダイワ北米好配当株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。

(7) ダイワ欧州好配当株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。

(8) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株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。

(9) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
投資証券	百万円 91,515	百万円 15,870	% 17.3	百万円 61,645	百万円 8,529	% 13.8
不動産投信 指数先物取引	12,929	-	-	12,151	-	-
コール・ローン	774,335	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合1.8%

(10) 利害関係人の発行する有価証券等

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

種 類	当 期		
	ダイワJ-REITアクティブ・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 2,821	百万円 -	百万円 4,515

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(11) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

種 類	当 期	
	買	付 額
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	
投資証券	百万円 6,618	
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)	
公社債	百万円 1,800	

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 単位未満は切捨て。

(12) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	16,972千円
うち利害関係人への支払額 (B)	2,942千円
(B)/(A)	17.3%

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

*利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社、大和証券オフィス投資法人、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	口 数	評 価 額
外国債券インデックスマザーファンド	千口 195,815	千口 220,129	千口 757,819	
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	490,703	614,822	757,646	
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	708,970	794,616	3,209,216	
ダイワ好配当日本株マザーファンド	835,574	800,092	3,900,450	
ダイワ北米好配当株マザーファンド	523,508	530,488	3,009,830	
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	259,462	253,469	718,966	
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	37,914	34,841	122,654	
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	702,833	878,935	3,041,819	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年1月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックスマザーファンド	千円 757,819	% 4.8
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	757,646	4.8
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	3,209,216	20.4
ダイワ好配当日本株マザーファンド	3,900,450	24.7
ダイワ北米好配当株マザーファンド	3,009,830	19.1
ダイワ欧州好配当株マザーファンド	718,966	4.6
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	122,654	0.8
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	3,041,819	19.3
コール・ローン等、その他	241,760	1.5
投資信託財産総額	15,760,163	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、1月10日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=144.69円、1カナダ・ドル=108.09円、1オーストラリア・ドル=96.80円、1香港ドル=18.51円、1シンガポール・ドル=108.72円、1ニュージーランド・ドル=90.20円、1台湾ドル=4.659円、1イギリス・ポンド=183.96円、1イスラエル・シケル=38.749円、1スイス・フラン=169.76円、1デンマーク・クローネ=21.21円、1ノルウェー・クローネ=13.98円、1スウェーデン・クローネ=14.12円、1メキシコ・ペソ=8.525円、100韓国ウォン=10.96円、1オフショア人民元=20.138円、1マレーシア・リンギット=31.087円、1ポーランド・ズロチ=36.38円、1ユーロ=158.20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 (284,021,393千円) の投資信託財産総額 (288,390,543千円) に対する比率は、98.5%です。
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (94,523,244千円) の投資信託財産総額 (95,458,077千円) に対する比率は、99.0%です。
ダイワ北米好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (5,714,817千円) の投資信託財産総額 (5,765,545千円) に対する比率は、99.1%です。
ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (1,738,151千円) の投資信託財産総額 (1,743,881千円) に対する比率は、99.7%です。
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (683,283千円) の投資信託財産総額 (688,075千円) に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年1月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	15,760,163,477円
コール・ローン等	237,094,552
外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	757,819,052
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)(評価額)	757,646,095
ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド(評価額)	3,209,216,047
ダイワ好配当日本株マザーファンド(評価額)	3,900,450,201
ダイワ北米好配当株マザーファンド(評価額)	3,009,830,429
ダイワ欧州好配当株マザーファンド(評価額)	718,966,679
ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド(評価額)	122,654,749
ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド(評価額)	3,041,819,673
未収入金	4,666,000
(B) 負債	106,346,921
未払解約金	7,647,309
未払信託報酬	98,086,663
その他未払費用	612,949
(C) 純資産総額(A-B)	15,653,816,556
元本	5,535,598,650
次期繰越損益金	10,118,217,906
(D) 受益権総口数	5,535,598,650口
1万口当り基準価額(C/D)	28,278円

*期首における元本額は5,076,067,557円、当作成期間中における追加設定元本額は1,000,538,169円、同解約元本額は541,007,076円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は28,278円です。

■損益の状況

当期 自2023年1月11日 至2024年1月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 45,334円
受取利息	57
その他収益金	10,525
支払利息	△ 55,916
(B) 有価証券売買損益	2,490,735,124
売買益	2,611,219,753
売買損	△ 120,484,629
(C) 信託報酬等	△ 183,828,020
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,306,861,770
(E) 前期繰越損益金	1,784,398,025
(F) 追加信託差損益金	6,026,958,111
(配当等相当額)	(6,619,156,400)
(売買損益相当額)	(△ 592,198,289)
(G) 合計(D+E+F)	10,118,217,906
次期繰越損益金(G)	10,118,217,906
追加信託差損益金	6,026,958,111
(配当等相当額)	(6,619,156,400)
(売買損益相当額)	(△ 592,198,289)
分配準備積立金	4,091,305,129
繰越損益金	△ 45,334

(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。

(注4) 投資信託財産(親投資信託)の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用: 30,435,229円(未監査)

■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	1,874,463,717
(c) 収益調整金	6,619,156,400
(d) 分配準備積立金	2,216,841,412
(e) 当期分配可能額(a+b+c+d)	10,710,461,529
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e-f)	10,710,461,529
(h) 受益権総口数	5,535,598,650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商標又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JJPX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商標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。

NOMURA-BPI総合指数の知的財産権およびその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等並びに当ファンド及び同指数に関連して行われる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。

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。

外国債券インデックスマザーファンド

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（2023年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2024年1月10日）現在における外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■外国債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄 公 社 債

（2023年1月11日から2024年1月10日まで）

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
CHINA GOVERNMENT BOND (中国)	2.39% 2026/11/15	1,193,027	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	0.375% 2024/9/15	1,052,371
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	3.375% 2033/5/15	1,087,492	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	2.25% 2024/5/25	951,259
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	3.5% 2033/2/15	1,079,241	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.375% 2024/8/15	896,117
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	4.5% 2033/11/15	1,035,813	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.25% 2024/11/15	816,780
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	3.875% 2033/8/15	970,806	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	1.75% 2024/7/31	796,277
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	4.375% 2026/8/15	893,623	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス)	1.75% 2024/11/25	769,312
CHINA GOVERNMENT BOND (中国)	2.52% 2033/8/25	814,297	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	0.375% 2024/7/15	767,167
CHINA GOVERNMENT BOND (中国)	2.67% 2033/5/25	799,368	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2% 2024/5/31	722,463
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ)	4.125% 2053/8/15	714,685	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	0.25% 2024/5/15	705,397
CHINA GOVERNMENT BOND (中国)	2.67% 2033/11/25	708,157	United States Treasury Note/Bond (アメリカ)	2.5% 2024/5/15	694,072

（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

下記は、2024年1月10日現在における外国債券インデックスマザーファンド（82,950,829千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

2024年1月10日現在									
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちBBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
アメリカ	千アメリカ・ドル 1,023,031	千アメリカ・ドル 921,390	千円 133,315,937	% 46.7	% -	% 20.3	% 17.5	% 8.9	
カナダ	千カナダ・ドル 54,233	千カナダ・ドル 50,790	5,489,919	1.9	-	1.2	0.4	0.3	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 44,461	千オーストラリア・ドル 40,096	3,881,299	1.4	-	0.9	0.3	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 10,436	千シンガポール・ドル 10,122	1,100,494	0.4	-	0.2	0.1	0.0	
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 7,830	千ニュージーランド・ドル 6,911	623,456	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 92,938	千イギリス・ポンド 77,894	14,329,560	5.0	-	3.7	1.0	0.4	
イスラエル	千イスラエル・シェケル 20,900	千イスラエル・シェケル 19,460	754,088	0.3	-	0.1	0.1	0.1	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 34,865	千デンマーク・クローネ 35,849	760,372	0.3	-	0.2	0.0	0.0	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 36,535	千ノルウェー・クローネ 34,397	480,873	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 38,837	548,381	0.2	-	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 275,983	千メキシコ・ペソ 255,926	2,181,978	0.8	-	0.6	0.2	0.0	

2024年1月10日現在									
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
中国	千オフショア人民元 1,023,500	千オフショア人民元 1,045,757	千円 21,059,988	% 7.4	% -	% 3.5	% 2.6	% 1.3	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 41,846	千マレーシア・リンギット 42,590	1,324,031	0.5	-	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 42,455	千ポーランド・ズロチ 40,537	1,474,772	0.5	-	0.2	0.2	0.1	
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 11,546	千ユーロ 10,439	1,651,455	0.6	-	0.4	0.1	0.1	
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 28,349	千ユーロ 26,687	4,221,904	1.5	-	1.0	0.4	0.1	
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 33,793	千ユーロ 31,434	4,973,006	1.7	-	1.2	0.4	0.1	
ユーロ (フランス)	千ユーロ 159,279	千ユーロ 147,833	23,387,247	8.2	-	4.9	2.4	1.0	
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 120,595	千ユーロ 114,654	18,138,360	6.4	-	3.7	2.0	0.6	
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 91,253	千ユーロ 86,148	13,628,696	4.8	-	2.8	1.4	0.5	
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 136,862	千ユーロ 130,094	20,580,937	7.2	-	4.1	2.3	0.8	
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 11,177	千ユーロ 9,908	1,567,526	0.5	-	0.3	0.2	0.1	
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 23,038	千ユーロ 20,814	3,292,831	1.2	-	0.7	0.3	0.1	
ユーロ (小計)	615,892	578,014	91,441,966	32.0	-	19.1	9.5	3.3	
合 計	-	-	278,767,121	97.6	-	50.7	32.3	14.7	

(注1) 邦貨換算金額は、2024年1月10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手しています。

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

2024年1月10日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	6.0000	% 千アメリカ・ドル 855	千アメリカ・ドル 883	千円 127,855	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	6.1250	709	761	110,222	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	5.2500	738	778	112,687	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	6.2500	714	802	116,055	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	5.3750	2,391	2,602	376,574	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	4.5000	1,176	1,238	179,267	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	5.0000	847	934	135,267	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	4.3750	548	567	82,094	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	4.5000	519	543	78,640	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	3.5000	1,049	977	141,454	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	4.2500	1,121	1,136	164,414	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	4.5000	1,060	1,103	159,720	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	4.3750	1,210	1,240	179,481	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	4.6250	1,010	1,064	154,010	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	4.3750	1,678	1,714	248,099	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond		国 債 証 券	3.8750	1,091	1,046	151,474	2040/08/15

外国債券インデックスマザーファンド

2024年1月10日現在								
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,473	213,242	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,334	193,158	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,385	200,505	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,420	205,591	2041/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,240	179,448	2041/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,384	200,311	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,127	163,119	2042/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,231	4,175	604,212	2042/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	1,297	187,701	2042/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	2,210	319,888	2043/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	1,857	268,787	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	2,910	421,125	2043/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	1,915	277,216	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	2,985	431,956	2044/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	2,887	417,860	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	1,607	232,546	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,746	2,235	323,500	2044/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,574	806,507	2045/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	1,907	275,942	2045/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,601	810,507	2025/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,835	1,488	215,312	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,524	799,270	2045/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,873	1,484	214,754	2045/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,618	812,871	2025/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	659	532	77,054	2045/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,866	4,605	666,323	2046/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,148	2,317	335,268	2046/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,729	7,281	1,053,603	2026/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,823	2,072	299,878	2046/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	5,045	729,985	2026/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,780	1,937	280,283	2046/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	4,997	723,146	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,000	785	113,617	2046/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,640	3,446	498,615	2027/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,345	1,879	271,988	2047/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	6,061	877,085	2027/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	1,601	231,700	2047/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,546	802,459	2027/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,450	1,869	270,511	2047/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,153	745,667	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	1,906	275,800	2047/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	2,731	395,194	2024/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,350	6,045	874,652	2028/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,539	367,424	2025/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,641	382,205	2025/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,000	2,394	346,531	2048/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	2,830	409,585	2025/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,800	3,102	448,830	2048/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	6,206	897,975	2028/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	1,857	268,799	2025/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,467	501,717	2025/05/31	

2024年1月10日現在

区 分	銘	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	2.7500	3,000	2,924	423,183	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	6,384	923,714	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,220	2,567	371,482	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,438	352,841	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,501	506,575	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,439	353,032	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,438	352,891	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,700	3,557	514,709	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,020	2,576	372,861	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	2,918	422,250	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	1,500	1,451	210,081	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	6,182	894,591	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,417	349,755	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	3,743	541,627	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,408	348,540	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,394	346,405	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	3,615	523,068	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	3,596	520,315	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,686	388,655	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,859	413,668	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	2,650	383,489	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,360	341,587	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,158	601,729	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	3,137	453,988	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,605	377,007	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,339	338,520	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	2,801	405,412	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,850	2,528	365,909	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	3,152	456,164	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	1,864	269,835	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,336	338,060	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,426	351,126	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,700	1,641	237,452	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,000	4,329	626,471	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	6,500	6,018	870,785	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	3,463	501,173	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	274	39,663	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	4,994	722,698	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,500	2,377	344,033	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,434	207,543	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,800	5,525	799,412	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,555	369,754	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,400	2,137	309,231	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	2,934	424,659	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	3,166	458,175	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,107	449,656	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,825	408,872	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	6,105	883,388	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,100	448,552	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,183	460,687	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	8,000	6,446	932,787	2030/08/15

外国債券インデックスマザーファンド

2024年1月10日現在								
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,396	636,151	2027/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	6,700	3,629	525,223	2050/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	3,133	453,451	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,083	446,176	2027/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,724	538,889	2025/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,498	506,131	2027/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,268	472,854	2025/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	9,800	8,001	1,157,794	2030/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,713	537,291	2025/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,000	3,505	507,190	2027/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,800	3,941	570,263	2050/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,100	3,322	480,724	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,100	4,732	684,722	2025/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,392	635,500	2027/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,381	634,017	2027/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,628	669,755	2025/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	7,000	6,149	889,801	2028/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,900	3,647	527,756	2051/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	10,700	8,863	1,282,406	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,614	667,650	2026/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,453	644,362	2028/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,700	3,321	480,593	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,000	2,769	400,698	2026/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,574	517,127	2028/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,706	536,267	2026/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	8,700	7,405	1,071,480	2031/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,500	4,157	601,607	2026/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,349	774,050	2028/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	4,454	644,516	2051/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,800	2,847	411,965	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,339	772,557	2028/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,400	4,055	586,793	2026/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	4,441	642,597	2028/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	5,000	4,615	667,874	2026/06/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	10,300	8,459	1,224,018	2031/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	6,900	4,391	635,436	2051/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	5,700	3,894	563,556	2041/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	6,000	5,486	793,835	2026/07/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	5,000	4,380	633,879	2028/07/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	5,000	4,396	636,093	2028/08/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	5,000	4,576	662,123	2026/08/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	5,000	4,413	638,582	2028/09/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,500	3,209	464,387	2026/09/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	10,000	8,240	1,192,274	2031/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	6,600	4,064	588,108	2051/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	4,000	2,845	411,660	2041/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	6,000	5,318	769,467	2028/10/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	7,000	6,444	932,512	2026/10/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,689	533,790	2026/11/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	5,600	4,984	721,272	2028/11/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	4,000	3,532	511,091	2028/12/31	

2024年1月10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	1.2500	4,000	3,684	533,124	2026/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	1.1250	1,000	963	139,456	2025/01/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	1.8750	10,400	8,872	1,283,754	2032/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	1.5000	3,700	3,571	516,760	2025/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	1.7500	4,300	3,861	558,656	2029/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.2500	3,900	2,635	381,291	2052/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.3750	2,500	1,886	272,946	2042/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	1.8750	5,000	4,512	652,841	2029/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	1.8750	5,000	4,675	676,461	2027/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	1.7500	5,000	4,832	699,142	2025/03/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.3750	3,000	2,771	400,972	2029/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.5000	5,000	4,764	689,433	2027/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.6250	3,000	2,925	423,309	2025/04/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.8750	9,300	8,549	1,237,012	2025/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.7500	3,000	2,927	423,556	2025/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.8750	5,000	3,884	562,113	2052/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.2500	1,500	1,295	187,385	2042/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.8750	3,000	2,839	410,786	2029/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.7500	3,000	2,877	416,290	2027/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.7500	6,000	5,636	815,539	2029/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.6250	2,000	1,908	276,198	2027/05/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.8750	4,000	3,906	565,292	2025/06/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.2500	4,000	3,852	557,357	2029/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.2500	3,000	2,922	422,836	2027/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.0000	3,000	2,933	424,437	2025/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.7500	4,070	3,894	563,430	2027/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.1250	4,500	4,405	637,496	2025/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.7500	9,500	8,627	1,248,343	2032/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.0000	5,200	4,149	600,375	2052/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.3750	2,000	1,755	254,064	2042/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	2.6250	3,360	3,130	452,924	2029/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.1250	2,500	2,421	350,355	2027/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.1250	3,500	3,344	483,869	2029/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.5000	2,300	2,263	327,552	2025/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.8750	2,500	2,482	359,124	2029/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	4.1250	3,500	3,509	507,746	2027/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	4.2500	3,400	3,389	490,396	2025/10/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	4.1250	3,000	3,007	435,185	2027/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	4.1250	9,700	9,774	1,414,229	2032/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	4.5000	1,500	1,502	217,432	2025/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	4.0000	3,700	3,567	516,246	2052/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	4.0000	3,000	2,997	433,688	2029/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.8750	2,500	2,481	358,975	2029/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.8750	3,000	2,981	431,456	2027/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	4.0000	2,500	2,395	346,532	2042/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	4.0000	3,500	3,475	502,930	2025/12/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.8750	1,500	1,486	215,114	2026/01/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.8750	5,000	4,962	718,024	2029/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	3.8750	1,500	1,491	215,876	2027/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	4.2500	3,000	2,982	431,595	2024/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND		国債証券	4.1250	1,000	993	143,746	2025/01/31

外国債券インデックスマザーファンド

2024年1月10日現在								
区 分	銘	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	5,000	4,862	703,526	2030/01/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,500	3,477	503,219	2026/02/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	8,000	7,684	1,111,844	2033/02/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,349	339,898	2043/02/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	4,500	4,059	587,303	2053/02/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	3,700	3,627	524,902	2028/01/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	4,500	4,494	650,336	2025/02/28	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	1,000	998	144,536	2030/02/28	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,000	2,997	433,709	2028/02/29	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	2,500	2,516	364,166	2026/03/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	3,000	2,971	429,955	2025/03/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	1,800	1,761	254,860	2030/03/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	3,700	3,644	527,360	2028/03/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.7500	2,000	1,977	286,167	2026/04/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	3,000	2,914	421,742	2030/04/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	2,000	1,960	283,612	2028/04/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	1,000	986	142,725	2026/05/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.3750	7,800	7,412	1,072,502	2023/05/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	4,400	3,972	574,812	2053/05/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,347	339,710	2043/05/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	4,000	3,961	573,140	2025/04/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,600	3,582	518,388	2025/05/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.6250	3,700	3,645	527,424	2028/05/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.7500	1,500	1,477	213,799	2030/05/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,000	2,993	433,084	2026/06/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	2,500	2,502	362,126	2025/06/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.7500	3,000	2,955	427,589	2030/06/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,500	3,500	506,511	2028/06/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	2,000	2,013	291,396	2026/07/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.7500	4,000	4,013	580,745	2025/07/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,500	3,519	509,230	2028/07/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	7,000	6,921	1,001,435	2033/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	6,000	6,025	871,812	2026/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	5,000	4,937	714,406	2053/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	1,300	1,307	189,110	2043/08/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.0000	3,000	2,997	433,761	2030/07/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	5.0000	3,900	3,930	568,743	2025/08/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	3,100	3,119	451,364	2030/08/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	3,000	3,049	441,214	2028/08/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	3,000	3,033	438,935	2026/09/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	5.0000	1,000	1,008	145,966	2025/09/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	1,500	1,553	224,804	2030/09/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	4,200	4,313	624,154	2028/09/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	1,000	1,011	146,419	2026/10/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	5.0000	1,000	1,009	146,107	2025/10/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.8750	2,000	2,076	300,512	2028/10/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.5000	7,000	7,273	1,052,391	2033/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.6250	3,800	3,848	556,821	2026/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.7500	1,300	1,373	198,705	2043/11/15	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.8750	3,100	3,258	471,490	2030/10/31	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.7500	2,800	3,068	444,028	2053/11/15	

外国債券インデックスマザーファンド

2024年1月10日現在								
区分	銘柄	種類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.8750	3,500	3,529	510,724	2025/11/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	3,000	3,065	443,493	2030/11/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	4,000	4,072	589,200	2028/11/30	
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	2,000	2,013	291,333	2026/12/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	275銘柄		1,023,031	921,390	1,333,159.937		
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	558	60,374	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,104	119,405	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,343	145,215	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,203	130,098	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	913	1,009	109,064	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	961	1,008	108,975	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,242	134,326	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,125	121,682	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	921	99,556	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,144	123,762	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	650	616	66,602	2028/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,710	2,917	315,381	2051/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,162	125,704	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	3,057	330,488	2030/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	700	675	73,025	2025/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,728	294,874	2025/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,000	1,666	180,108	2030/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,100	1,950	210,779	2026/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	300	280	30,318	2026/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,400	3,014	325,874	2031/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,650	1,941	209,884	2053/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,200	2,052	221,848	2027/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,100	1,848	199,807	2031/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	200	193	20,874	2025/04/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,500	1,366	147,667	2032/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	100	95	10,271	2029/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	390	42,207	2027/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,000	982	106,180	2025/10/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,270	2,144	231,783	2032/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	200	200	21,719	2028/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	300	297	32,152	2025/02/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	600	590	63,773	2026/04/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	600	577	62,417	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	300	297	32,181	2025/05/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	368	39,826	2025/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,200	1,196	129,316	2028/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	500	494	53,503	2025/08/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,000	1,002	108,392	2033/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,000	2,016	217,991	2025/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	300	310	33,512	2029/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,000	2,025	218,901	2026/02/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,700	1,666	180,083	2034/06/01	
通貨小計	銘柄数 金 額	42銘柄		54,233	50,790	5,489,919		

外国債券インデックスマザーファンド

2024年1月10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	
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7500	1,989	2,051	198,540	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	1,354	1,317	127,580	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	1,798	1,781	172,474	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.5000	2,258	2,329	225,472	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.2500	1,748	1,765	170,939	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.7500	1,113	1,059	102,574	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,307	1,140	110,442	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.2500	792	697	67,492	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,672	1,613	156,180	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	1,178	1,107	107,211	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	3.0000	1,252	987	95,612	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,500	1,432	138,642	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,900	1,790	173,353	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.5000	2,870	2,645	256,129	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	2.7500	1,390	1,114	107,843	2041/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.5000	2,840	2,390	231,354	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.2500	2,700	2,169	209,992	2032/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	2,000	1,645	159,294	2030/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	1,400	801	77,619	2051/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	1,600	1,497	144,949	2025/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.0000	2,500	1,996	193,258	2031/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	1,200	1,101	106,596	2026/09/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	1,600	1,325	128,308	2032/11/21
AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)		国債証券	3.0000	1,300	1,184	114,672	2033/11/21	
AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)		国債証券	3.7500	1,200	1,163	112,615	2034/05/21	
AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)		国債証券	3.5000	1,100	1,038	100,571	2034/12/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND		国債証券	4.7500	900	946	91,575	2054/06/21	
通貨小計	銘 柄 数	27銘柄			44,461	40,096	3,881,299	
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	3.5000	772	786	85,560	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.8750	809	811	88,262	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.7500	400	392	42,720	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	3.3750	568	592	64,467	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.8750	625	628	68,289	2029/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.3750	524	516	56,143	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.7500	688	671	73,004	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.1250	450	440	47,842	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.2500	750	702	76,402	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.6250	550	548	59,634	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.3750	350	328	35,711	2039/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	1.8750	540	443	48,199	2050/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	0.5000	750	714	77,626	2025/11/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	1.6250	600	551	59,948	2031/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	1.8750	500	411	44,755	2051/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	1.2500	200	191	20,778	2026/11/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.6250	240	235	25,654	2032/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	3.0000	620	650	70,743	2072/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.8750	100	100	10,928	2027/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.8750	400	403	43,821	2028/08/01
通貨小計	銘 柄 数	20銘柄			10,436	10,122	1,100,494	

2024年1月10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	
ニュージーランド	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.5000	千ニュージーランド・ドル 600	千ニュージーランド・ドル 601	千円 54,239	2027/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.5000	1,500	1,380	124,553	2033/04/14
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.7500	490	392	35,365	2037/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.0000	600	562	50,771	2029/04/20
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.5000	530	432	39,003	2031/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.7500	350	222	20,045	2041/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.2500	1,100	923	83,287	2028/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	500	455	41,073	2026/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.0000	440	363	32,811	2032/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.7500	380	258	23,357	2051/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.7500	640	622	56,106	2025/04/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.2500	200	193	17,486	2034/05/15
	NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.5000	500	502	45,355	2030/05/15
通貨小計	銘 柄 数	13銘柄			7,830	6,911	623,456	
イギリス	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	2.0000	千イギリス・ポンド 921	千イギリス・ポンド 889	163,675	2025/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	2.5000	1,282	846	155,711	2065/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.5000	1,465	1,384	254,689	2026/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.5000	1,760	1,021	187,857	2047/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.7500	1,450	1,097	201,923	2037/09/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.7500	1,810	996	183,331	2057/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.2500	1,410	1,296	238,464	2027/07/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.6250	1,500	1,370	252,101	2028/10/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.6250	1,740	840	154,610	2071/10/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.7500	1,210	731	134,529	2049/01/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.6250	850	460	84,640	2054/10/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	0.8750	1,500	1,287	236,842	2029/10/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	0.6250	1,900	1,806	332,414	2025/06/07
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.2500	1,190	745	137,192	2041/10/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	0.3750	1,300	1,047	192,750	2030/10/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	0.5000	1,700	529	97,447	2061/10/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	0.1250	1,500	1,389	255,548	2026/01/30
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	0.1250	1,600	1,389	255,542	2028/01/31
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	0.6250	1,100	457	84,250	2050/10/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	0.6250	1,700	1,180	217,129	2035/07/31
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	0.2500	2,500	1,939	356,841	2031/07/31
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	0.8750	2,000	1,021	187,896	2046/01/31
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	0.3750	3,500	3,184	585,783	2026/10/22
	United Kingdom Gilt		国 債 証 券	1.2500	1,800	909	167,282	2051/07/31
	UNITED KINGDOM GILT		国 債 証 券	0.2500	1,100	1,051	193,432	2025/01/31
	UNITED KINGDOM GILT		国 債 証 券	1.1250	2,100	1,385	254,814	2039/01/31
	UNITED KINGDOM GILT		国 債 証 券	0.5000	2,700	2,311	425,178	2029/01/31
UNITED KINGDOM GILT		国 債 証 券	0.8750	2,300	1,763	324,367	2033/07/31	
UNITED KINGDOM GILT		国 債 証 券	1.5000	1,300	686	126,325	2053/07/31	
UNITED KINGDOM GILT		国 債 証 券	1.0000	3,600	2,926	538,301	2032/01/31	
UNITED KINGDOM GILT		国 債 証 券	1.1250	820	315	58,083	2073/10/22	
UNITED KINGDOM GILT		国 債 証 券	4.1250	2,000	2,012	370,127	2027/01/29	
UNITED KINGDOM GILT		国 債 証 券	3.7500	1,000	958	176,379	2038/01/29	
UNITED KINGDOM GILT		国 債 証 券	3.2500	2,100	2,015	370,817	2033/01/31	
UNITED KINGDOM GILT		国 債 証 券	3.5000	400	395	72,697	2025/10/22	

外国債券インデックスマザーファンド

2024年1月10日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
	UNITED KINGDOM GILT		国債証券	3.7500	2,500	2,218	408,161	2053/10/22
	UNITED KINGDOM GILT		国債証券	4.0000	800	751	138,190	2063/10/22
	UNITED KINGDOM GILT		国債証券	4.5000	700	721	132,790	2028/06/07
	UNITED KINGDOM GILT		国債証券	4.6250	1,000	1,062	195,486	2034/01/31
	UNITED KINGDOM GILT		国債証券	4.7500	1,000	1,051	193,397	2043/10/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	6.0000	949	1,047	192,751	2028/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	2,240	2,328	428,429	2032/06/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	5.0000	1,472	1,481	272,495	2025/03/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	1,362	1,398	257,245	2036/03/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.7500	1,357	1,446	266,034	2038/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	1,708	1,672	307,599	2055/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	1,366	1,339	246,411	2046/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	1,232	1,256	231,098	2027/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.5000	2,116	2,167	398,796	2042/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.7500	1,600	1,707	314,144	2030/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	1,343	1,313	241,667	2049/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	1,446	1,451	267,051	2039/09/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.5000	1,560	1,642	302,190	2034/09/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.0000	1,174	1,105	203,421	2060/01/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	4.2500	1,577	1,575	289,901	2040/12/07
	United Kingdom Gilt		国債証券	3.7500	1,552	1,395	256,669	2052/07/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	3.2500	1,866	1,590	292,640	2044/01/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	3.5000	1,386	1,180	217,121	2068/07/22
	United Kingdom Gilt		国債証券	3.5000	1,524	1,342	246,880	2045/01/22
通貨小計	銘 柄 数 額	59銘柄			92,938	77,894	14,329,560	
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	6.2500	1,800	1,919	74,366	2026/10/30
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	5.5000	1,600	1,792	69,464	2042/01/31
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	1.7500	2,300	2,226	86,289	2025/08/31
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	2.0000	1,800	1,706	66,113	2027/03/31
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	3.7500	2,400	2,100	81,390	2047/03/31
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	2.2500	1,200	1,121	43,456	2028/09/28
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	1.0000	2,400	2,017	78,186	2030/03/31
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	0.5000	1,600	1,534	59,454	2025/04/30
	Israel Government Bond - Fixed		国債証券	1.5000	1,700	1,203	46,621	2037/05/31
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED		国債証券	0.5000	200	186	7,235	2026/02/27
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED		国債証券	1.3000	300	241	9,356	2032/04/30
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED		国債証券	2.8000	600	419	16,265	2052/11/29
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED		国債証券	3.7500	3,000	2,990	115,888	2029/02/28
通貨小計	銘 柄 数 額	13銘柄			20,900	19,460	754,088	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	4.5000	13,662	17,162	364,024	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	1.7500	6,013	5,915	125,465	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	5,100	4,770	101,192	2027/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.5000	4,090	3,703	78,547	2029/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	0.2500	3,500	1,904	40,387	2052/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	-	500	418	8,879	2031/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND		国債証券	2.2500	2,000	1,974	41,874	2033/11/15
通貨小計	銘 柄 数 額	7銘柄			34,865	35,849	760,372	

外国債券インデックスマザーファンド

2024年1月10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		
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,340	4,161	58,176	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,450	4,238	59,257	2027/02/17	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,322	46,444	2028/04/26	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	3,541	49,506	2029/09/06	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	4,800	4,244	59,336	2030/08/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,500	3,005	42,012	2031/09/17	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1250	1,700	1,545	21,602	2032/05/18	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,500	3,619	50,600	2042/10/06	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,500	1,452	20,310	2033/08/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	10銘柄		36,535	34,397	480,873		
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ	58,873	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,655	4,169	106,521	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	6,904	97,496	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,050	4,748	67,047	2028/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,300	3,313	46,792	2032/06/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	6,400	5,920	83,594	2029/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	5,000	4,316	60,945	2031/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,000	1,919	27,109	2033/11/11	
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄		40,180	38,837	548,381		
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	293,249	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	21,300	18,881	160,978	2047/11/07	
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	7,000	6,248	53,273	2027/03/04	
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	1,000	948	8,086	2025/03/06	
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	14,000	12,306	104,920	2053/07/31	
	MEXICAN BONOS	国債証券	7.5000	10,000	8,995	76,692	2033/05/26	
	MEXICAN BONOS	国債証券	7.0000	3,000	2,816	24,009	2026/09/03	
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	5,000	4,610	39,306	2035/05/24	
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.5000	10,000	9,697	82,677	2029/03/01	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	27,968	26,452	225,527	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	9,504	81,037	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,544	28,819	245,707	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	18,894	17,898	152,600	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	44,515	41,293	352,063	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	29,654	25,861	220,490	2042/11/13	
Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,944	7,196	61,355	2034/11/23		
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄		275,983	255,926	2,181,978		
中国	China Government Bond	国債証券	3.2200	千オフショア人民元	千オフショア人民元	106,804	2025/12/06	
	China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,211	104,941	2028/11/22	
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,000	5,232	105,369	2029/05/23	
	China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,123	103,185	2026/06/06	
	China Government Bond	国債証券	3.1200	12,000	12,296	247,633	2026/12/05	
	China Government Bond	国債証券	3.1300	8,000	8,310	167,350	2029/11/21	
	China Government Bond	国債証券	2.8500	13,000	13,203	265,897	2027/06/04	
	China Government Bond	国債証券	2.6800	11,500	11,636	234,334	2030/05/21	

外国債券インデックスマザーファンド

2024年1月10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	3.0200	18,000	18,270	367,941	2025/10/22	
	China Government Bond	国債証券	3.2800	9,000	9,325	187,807	2027/12/03	
	China Government Bond	国債証券	3.2700	12,500	13,167	265,163	2030/11/19	
	China Government Bond	国債証券	3.0300	7,000	7,125	143,494	2026/03/11	
	China Government Bond	国債証券	3.8100	7,300	8,626	173,734	2050/09/14	
	China Government Bond	国債証券	3.0100	7,000	7,186	144,729	2028/05/13	
	China Government Bond	国債証券	3.7200	14,000	16,291	328,095	2051/04/12	
	China Government Bond	国債証券	3.0200	15,800	16,372	329,719	2031/05/27	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,543	91,489	2026/08/12	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7400	5,000	5,054	101,798	2026/08/04	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5900	5,500	5,761	116,018	2027/08/03	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	5,000	5,301	106,761	2028/05/17	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6100	17,000	17,402	350,464	2025/06/07	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5400	4,500	4,752	95,716	2028/08/16	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0800	4,500	5,455	109,858	2048/10/22	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8600	6,300	7,461	150,260	2049/07/22	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7700	11,000	11,240	226,363	2025/03/08	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	12,000	13,198	265,791	2050/03/16	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	5,500	5,627	113,322	2028/10/14	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	11,500	12,961	261,035	2051/10/18	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	16,000	16,441	331,099	2031/11/18	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	17,000	17,019	342,741	2027/01/20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	7,200	7,313	147,292	2032/02/17	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2600	10,000	10,015	201,687	2025/02/24	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	15,000	15,278	307,687	2029/03/24	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	5,500	6,004	120,913	2052/04/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	5,000	5,089	102,492	2032/05/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	4,000	4,060	81,768	2029/06/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,000	4,044	81,454	2032/08/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	25,000	24,980	503,059	2025/08/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	32,000	32,196	648,388	2032/09/01	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	9,500	9,582	192,982	2029/09/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	17,200	17,237	347,137	2027/10/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	14,000	14,784	297,744	2052/10/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	5,500	5,614	113,073	2032/11/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	18,000	18,015	362,804	2025/11/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	19,000	19,331	389,316	2029/12/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6400	20,000	20,192	406,652	2028/01/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4600	18,000	18,068	363,881	2026/02/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8800	15,000	15,423	310,608	2033/02/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	23,000	23,049	464,190	2025/03/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	15,000	15,271	307,548	2030/03/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	25,000	25,248	508,471	2028/04/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	23,000	24,811	499,670	2053/04/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	7,000	7,003	141,037	2026/05/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	40,000	40,353	812,652	2033/05/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	9,000	8,968	180,615	2025/06/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	33,000	33,245	669,508	2030/06/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	35,000	35,026	705,390	2028/07/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5200	40,000	39,979	805,121	2033/08/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	30,000	29,924	602,632	2026/08/15	

2024年1月10日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千オフショア人民元	千オフショア人民元	千円		
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	25,000	25,108	505,647	2028/09/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2200	30,000	30,000	604,161	2025/09/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	20,000	20,145	405,694	2030/09/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	11,000	11,550	232,606	2053/10/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	20,000	20,146	405,714	2028/10/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3900	60,000	60,156	1,211,463	2026/11/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	35,000	35,590	716,745	2033/11/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3300	18,000	18,037	363,246	2025/12/15	
通貨小計	銘柄数 金 額	67銘柄		1,023,500	1,045,757	21,059,988		
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			
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,364	73,520	2027/05/31	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,224	38,062	2030/04/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,543	47,968	2026/04/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,332	41,424	2031/06/30	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	738	22,952	2027/03/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,417	44,073	2033/04/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,890	58,759	2028/06/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	1,300	1,425	44,327	2043/09/30	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,751	54,435	2025/09/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,240	38,566	2035/05/31	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	992	30,863	2046/03/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,550	1,566	48,697	2026/11/30	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,201	37,339	2027/11/16	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,950	2,091	65,024	2037/04/07	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,208	37,562	2025/03/14	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,278	39,747	2033/11/07	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	2,000	2,189	68,065	2038/06/08	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	656	20,419	2026/07/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,310	2,328	72,376	2029/08/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,320	41,040	2048/07/06	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,287	40,012	2034/07/05	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,674	52,044	2040/05/22	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	2,650	2,557	79,507	2050/06/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,800	1,667	51,840	2031/04/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	1,400	1,371	42,623	2032/07/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	1,900	2,038	63,357	2042/10/15	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5040	500	518	16,110	2029/04/30	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4570	700	718	22,343	2053/03/31	
	MALYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5190	1,000	995	30,962	2028/04/20	
通貨小計	銘柄数 金 額	29銘柄		41,846	42,590	1,324,031		
ポーランド				千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ			
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,377	4,147	150,896	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	2,948	107,254	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840	4,346	158,133	2029/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	2,000	1,900	69,151	2025/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,388	86,879	2030/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	2,200	1,947	70,864	2026/10/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	1,408	51,252	2032/04/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	500	485	17,645	2027/05/25	

外国債券インデックスマザーファンド

2024年1月10日現在								
区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	POLAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	7.5000	5,000	5,532	201,284	2028/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	1,500	1,382	50,296	2025/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	6.0000	5,000	5,326	193,788	2033/10/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	5.7500	827	860	31,292	2029/04/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	2.7500	3,650	3,374	122,764	2028/04/25
	Poland Government Bond		国 債 証 券	3.2500	4,591	4,487	163,268	2025/07/25
通貨小計	銘 柄 数 金 額	14銘柄			42,455	40,537	1,474,772	
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY		国 債 証 券	5.4000	1,031	1,058	167,375	2025/03/13
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	2.4000	961	961	152,083	2030/05/15
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	2.0000	931	789	124,911	2045/02/18
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	1.0000	1,073	1,036	163,953	2026/05/15
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	1.7000	550	483	76,426	2037/05/15
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	0.9000	800	753	119,163	2028/05/15
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	1.3000	750	673	106,490	2033/05/15
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	1.3500	750	697	110,380	2031/03/18
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	1.1000	950	889	140,791	2029/05/15
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	1.5000	600	441	69,797	2050/05/15
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	0.4000	350	273	43,332	2035/05/15
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	0.2000	500	465	73,630	2027/05/15
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	0.2000	800	691	109,335	2030/10/18
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	-	800	664	105,046	2031/10/18
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	0.5500	400	274	43,368	2041/04/22
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	0.3500	100	83	13,185	2032/10/18
	IRISH TREASURY		国 債 証 券	3.0000	200	203	32,181	2043/10/18
国小計	銘 柄 数 金 額	17銘柄			11,546	10,439	1,651,455	
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	5.5000	1,139	1,273	201,538	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.0000	1,755	2,010	318,087	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.7500	1,729	1,992	315,265	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.5000	1,468	1,474	233,187	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.7500	1,929	1,964	310,822	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.2500	1,791	1,725	272,912	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	1,938	1,847	292,313	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.7500	2,200	2,083	329,673	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.7500	1,350	1,259	199,324	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.2500	1,200	1,072	169,694	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	900	650	102,879	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	1,400	1,203	190,353	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	800	745	117,955	2027/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	1,250	615	97,368	2052/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	1,300	1,090	172,491	2031/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	900	621	98,383	2038/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	900	801	126,847	2029/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	-	100	94	15,026	2026/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	600	511	80,966	2032/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.0000	900	783	123,927	2054/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.5000	900	900	142,468	2033/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.5000	1,300	1,310	207,255	2030/01/15

2024年1月10日現在

区 分	銘	柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	%	千ユーロ 600	千ユーロ 652	千円 103,160	2044/01/15
国 小 計	銘 柄 数 金 額	23銘柄			28,349	26,687	4,221,904	
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	1,648	260,823	2025/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	1.0000	1,774	1,584	250,617	2031/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	1.9000	1,058	916	145,061	2038/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	1.0000	1,463	1,409	222,996	2026/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	1.6000	1,244	912	144,416	2047/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	2.1500	740	563	89,136	2066/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	0.8000	1,100	1,040	164,614	2027/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	2.2500	580	460	72,907	2057/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	1.4500	600	497	78,748	2037/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	0.8000	1,490	1,389	219,856	2028/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	1.2500	650	575	90,989	2033/04/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	0.9000	1,500	1,383	218,809	2029/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	1.7000	700	507	80,310	2050/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	0.1000	1,220	1,046	165,622	2030/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	0.4000	860	561	88,765	2040/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	-	1,200	1,095	173,358	2027/10/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	-	1,600	1,308	207,026	2031/10/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	0.6500	530	224	35,589	2071/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.3500	1,400	1,156	182,949	2032/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	1.4000	800	520	82,289	2053/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.7500	400	384	60,762	2039/04/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.0000	1,500	1,530	242,190	2033/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.3000	600	596	94,341	2054/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.4500	700	724	114,542	2043/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	5.5000	1,706	1,914	302,802	2028/03/28
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	5.0000	1,904	2,287	361,813	2035/03/28
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	4.2500	1,604	1,839	290,991	2041/03/28
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	4.5000	1,001	1,040	164,638	2026/03/28
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	4.0000	780	857	135,702	2032/03/28
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	3.7500	643	696	110,188	2045/06/22
	Belgium Government Bond		国 債 証 券	3.0000	747	759	120,143	2034/06/22
国 小 計	銘 柄 数 金 額	31銘柄			33,793	31,434	4,973,006	
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	3,193	505,258	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	5.5000	3,323	3,813	603,286	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	5.7500	3,227	4,008	634,116	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.7500	2,659	3,153	498,840	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.0000	1,764	2,024	320,341	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.0000	2,374	2,666	421,851	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.5000	3,164	3,775	597,345	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	4.0000	1,717	1,992	315,255	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.5000	3,646	3,718	588,327	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.7500	5,899	5,960	942,927	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	3.2500	3,088	3,144	497,451	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	2.5000	5,087	5,094	805,873	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND		国 債 証 券	0.5000	3,492	3,378	534,480	2025/05/25

外国債券インデックスマザーファンド

2024年1月10日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	4,943	782,058	2025/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,120	4,775	755,439	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,387	4,180	661,334	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	4,169	3,465	548,285	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,387	952	150,658	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,050	3,799	601,146	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	2,184	345,535	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,240	512,599	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,550	2,049	324,260	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,400	5,026	795,121	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	3,422	541,442	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	4,569	722,933	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,850	2,007	317,597	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,350	4,833	764,593	2029/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	4,330	4,175	660,612	2025/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	4,200	3,642	576,268	2029/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,770	1,532	242,490	2052/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	3,000	2,840	449,375	2026/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	1,483	234,704	2040/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	5,000	4,219	667,493	2030/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,480	584	92,518	2072/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	912	144,347	2044/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	4,600	3,773	596,963	2031/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	3,100	2,871	454,320	2027/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,600	1,408	222,750	2053/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	3,600	2,908	460,046	2032/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,100	2,028	320,944	2025/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,200	1,755	277,648	2038/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,300	4,016	635,471	2028/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	4,800	4,566	722,341	2032/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,000	908	143,678	2043/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,100	2,004	317,057	2054/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,200	2,196	347,531	2026/09/24
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,200	2,260	357,590	2033/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,600	1,621	256,501	2029/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	700	747	118,227	2033/11/25
国小計	銘柄数 金 額	49銘柄		159,279	147,833	23,387,247	
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	1,332	210,761	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	2,445	386,875	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,056	167,080	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	2,401	379,976	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,048	3,716	587,890	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,305	2,842	449,709	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,271	3,867	611,797	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	1,636	258,878	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,739	2,283	361,263	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,974	2,207	349,202	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	2,832	448,156	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	2,713	429,242	2046/08/15

外国債券インデックスマザーファンド

2024年1月10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	0.5000	2,194	2,133	337,524	2025/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,076	328,551	2025/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,168	4,001	633,022	2026/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,420	2,281	360,884	2026/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,200	3,955	625,809	2027/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,300	3,113	492,594	2027/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,470	2,737	433,102	2048/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,781	281,799	2028/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,100	3,773	597,009	2028/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,700	4,290	678,710	2029/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	3,000	2,674	423,082	2029/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,850	1,527	241,675	2050/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,750	1,544	244,392	2030/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,100	1,625	257,221	2035/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,000	1,843	291,575	2027/11/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,800	1,572	248,760	2030/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,200	1,049	166,073	2030/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	900	778	123,143	2031/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,400	1,052	166,570	2036/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,000	1,810	286,373	2028/11/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,100	592	93,721	2050/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	3,600	3,079	487,150	2031/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	700	599	94,796	2031/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	3,800	3,211	508,070	2032/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,600	1,331	210,588	2038/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	2,700	2,611	413,108	2032/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,700	1,482	234,609	2053/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	3,200	3,199	506,103	2029/11/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	1,600	1,620	256,296	2033/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	1,700	1,722	272,449	2033/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,000	874	138,388	2053/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	900	932	147,492	2033/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	1,500	1,527	241,616	2030/11/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,100	1,071	169,581	2052/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,500	1,490	235,861	2025/03/13	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,000	998	158,029	2025/06/12	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	100	100	15,917	2025/09/18	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	300	302	47,896	2025/12/12	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,400	2,314	366,091	2025/04/11	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,300	2,197	347,686	2025/10/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	100	95	15,149	2025/10/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,200	2,085	329,938	2026/04/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,800	2,630	416,147	2026/10/09	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	100	93	14,731	2027/04/16	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	3,000	2,909	460,224	2027/10/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	430	418	66,131	2027/10/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	100	100	15,856	2028/04/13	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	100	101	16,011	2028/10/19	
国 小 計	銘 柄 数 金 額	60銘柄			120,595	114,654	18,138,360	

外国債券インデックスマザーファンド

2024年1月10日現在

区分	銘柄	種類	年 利率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ (スペイン)	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	3,055	483,359	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	2,005	317,278	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	1,942	307,317	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,164	342,405	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	2,681	424,163	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	1,713	271,150	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	1,397	221,032	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,630	2,530	400,288	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	1,827	289,157	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,750	1,641	259,696	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	1,957	309,738	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,400	2,273	359,591	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	2,200	1,836	290,561	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,900	2,738	433,221	2028/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,498	237,011	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,250	1,943	307,451	2035/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,473	391,346	2029/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,560	2,219	351,160	2030/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,500	2,417	382,389	2025/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	757	119,864	2050/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,246	355,353	2027/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,400	2,160	341,829	2030/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,300	909	143,865	2040/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	500	471	74,668	2026/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	2,200	1,798	284,446	2031/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	650	312	49,482	2071/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	2,500	2,242	354,795	2028/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	1,900	1,372	217,105	2037/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,578	249,685	2031/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	600	389	61,649	2042/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	900	828	131,110	2027/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	2,100	1,749	276,789	2032/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9000	1,600	1,068	169,084	2052/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	-	100	95	15,163	2025/05/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	1,100	988	156,304	2029/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	1,700	1,635	258,722	2032/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,000	966	152,848	2043/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1500	1,500	1,505	238,121	2033/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,300	2,299	363,801	2026/05/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.9000	800	831	131,490	2039/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5500	1,500	1,549	245,147	2033/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	600	620	98,238	2029/05/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,179	2,626	415,512	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,754	1,907	301,773	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,858	2,157	341,303	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,973	2,254	356,644	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,789	2,857	451,998	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,112	334,246	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	1,960	310,188	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	1,574	249,138	2044/10/31
国小計	銘柄数 金額	50銘柄		91,253	86,148	13,628,696	

2024年1月10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 (イタリア)	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,236	195,585	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	2,684	424,766	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	1,290	204,199	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,429	384,362	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	1,786	282,626	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,891	2,835	448,638	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	1,249	197,725	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,386	2,309	365,439	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	1,926	304,713	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	1,017	160,950	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	693	109,661	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,347	213,107	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,470	232,635	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,650	1,451	229,664	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,700	2,611	413,146	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,137	180,020	2038/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	2,013	318,598	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,270	201,005	2025/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,550	2,507	396,640	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,535	242,892	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,206	190,924	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	650	604	95,692	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,900	2,859	452,425	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	2,100	2,054	325,093	2026/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	1,250	1,092	172,908	2040/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	1,685	266,641	2030/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,300	1,259	199,268	2025/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,206	348,991	2027/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,550	1,111	175,830	2050/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,139	180,345	2036/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,500	1,471	232,724	2025/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	1,711	270,727	2030/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,100	1,867	295,403	2030/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,200	2,041	322,925	2027/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,614	255,449	2026/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,500	1,065	168,585	2041/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,900	1,588	251,375	2031/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	1,200	721	114,103	2051/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	700	483	76,537	2037/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,688	267,188	2028/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,800	1,454	230,123	2031/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,200	1,367	216,268	2045/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	1,100	1,029	162,825	2026/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	460	275	43,630	2072/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	711	112,586	2028/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,563	247,290	2031/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	-	3,100	2,873	454,609	2026/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,700	1,376	217,819	2032/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	900	783	123,975	2029/02/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	800	523	82,889	2052/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1000	300	282	44,685	2027/04/01

外国債券インデックスマザーファンド

2024年1月10日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	500	484	76,723	2025/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	800	780	123,501	2029/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,600	1,461	231,177	2032/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,300	2,089	330,595	2038/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6500	200	196	31,158	2027/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	500	504	79,870	2035/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,300	3,329	526,716	2026/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	2,800	2,952	467,119	2033/05/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	300	307	48,677	2029/12/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4000	1,500	1,515	239,805	2028/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4500	100	101	16,096	2043/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	500	507	80,350	2053/10/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4000	400	400	63,329	2025/03/28
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	500	508	80,455	2026/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	900	928	146,832	2031/10/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7000	1,200	1,218	192,793	2030/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.3500	2,100	2,199	348,023	2033/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	700	718	113,624	2028/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	400	408	64,625	2026/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6000	300	302	47,813	2025/09/29
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	400	413	65,366	2034/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,500	1,547	244,874	2030/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1000	600	623	98,632	2029/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	3,254	3,589	567,795	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	3,314	524,398	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,088	330,416	2032/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	2,528	400,050	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	2,743	434,035	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	2,230	352,912	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,156	341,175	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	2,450	387,711	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,132	337,350	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	2,571	406,856	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	1,922	304,100	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,318	2,337	369,736	2030/03/01
国小計	銘柄数 金 額	86銘柄		136,862	130,094	20,580,937	
ユーロ (フィンランド)				千ユーロ	千ユーロ		
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	364	320	50,683	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	270	42,803	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	774	122,457	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	265	41,991	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	745	117,871	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	470	401	63,585	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	456	72,282	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	447	70,845	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	222	35,157	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	258	40,897	2040/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	-	500	422	66,842	2030/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	188	29,873	2052/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	497	78,631	2031/09/15

外国債券インデックスマザーファンド

2024年1月10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	
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	2026/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.5000	200	186	29,562	2043/04/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.5000	450	286	45,402	2032/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.3750	800	728	115,249	2027/04/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	270	260	41,200	2027/04/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.7500	400	390	61,761	2038/04/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	400	390	61,761	2038/04/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.0000	300	307	48,581	2033/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.8750	1,000	1,018	161,098	2029/04/15
	Finland Government Bond	国 債 証 券	4.0000	667	678	107,261	2025/07/04
	Finland Government Bond	国 債 証 券	2.7500	389	393	62,289	2028/07/04
	Finland Government Bond	国 債 証 券	2.6250	407	386	61,195	2042/07/04
国 小 計	銘 柄 数 額	23銘柄			11,177	9,908	1,567,526
ユーロ (オーストリア)	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.2000	千ユーロ	千ユーロ		
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.2000	1,373	1,338	211,702	2025/10/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.7500	1,126	1,072	169,648	2026/10/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.5000	784	584	92,482	2047/02/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	1.5000	240	143	22,657	2086/11/02
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.5000	1,280	1,200	189,947	2027/04/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	2.1000	540	399	63,175	2117/09/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.7500	1,200	1,118	176,913	2028/02/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.5000	1,280	1,158	183,204	2029/02/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	-	980	840	133,031	2030/02/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.7500	1,200	703	111,282	2051/03/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	-	400	243	38,562	2040/10/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	0.8500	350	150	23,816	2120/06/30
	Austria Government Bond	国 債 証 券	-	1,200	997	157,870	2031/02/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	-	480	462	73,178	2025/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.2500	600	429	67,962	2036/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.7000	300	136	21,543	2071/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	-	300	266	42,161	2028/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	0.9000	1,500	1,306	206,633	2032/02/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	1.8500	300	237	37,566	2049/05/23
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.0000	300	295	46,813	2026/07/15
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.9000	300	303	48,082	2033/02/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.1500	300	303	48,060	2053/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	2.9000	1,000	1,021	161,525	2029/05/23
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国 債 証 券	3.4500	800	839	132,832	2030/10/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	6.2500	825	927	146,666	2027/07/15
	Austria Government Bond	国 債 証 券	4.1500	1,373	1,547	244,776	2037/03/15
	Austria Government Bond	国 債 証 券	4.8500	875	915	144,770	2026/03/15
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.8000	338	392	62,029	2062/01/26
	Austria Government Bond	国 債 証 券	3.1500	723	733	116,112	2044/06/20
	Austria Government Bond	国 債 証 券	2.4000	771	744	117,820	2034/05/23
国 小 計	銘 柄 数 額	30銘柄			23,038	20,814	3,292,831
通貨小計	銘 柄 数 額	369銘柄			615,892	578,014	91,441,966
合 計	銘 柄 数 額	969銘柄					278,767,121

(注1) 邦貨換算金額は、2024年1月10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。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）」の決算日（2023年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2024年1月10日）現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）の主要な売買銘柄 公 社 債

（2023年1月11日から2024年1月10日まで）

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
369	10年国債 0.5% 2032/12/20	653,004	139	5年国債 0.1% 2024/3/20	640,972
156	5年国債 0.2% 2027/12/20	602,022	141	5年国債 0.1% 2024/9/20	621,066
370	10年国債 0.5% 2033/3/20	549,825	337	10年国債 0.3% 2024/12/20	551,864
371	10年国債 0.4% 2033/6/20	469,550	140	5年国債 0.1% 2024/6/20	471,066
149	5年国債 0.005% 2026/9/20	459,615	351	10年国債 0.1% 2028/6/20	469,877
158	5年国債 0.1% 2028/3/20	429,374	439	2年国債 0.005% 2024/8/1	390,454
161	5年国債 0.3% 2028/6/20	401,005	334	10年国債 0.6% 2024/6/20	322,403
446	2年国債 0.005% 2025/3/1	400,415	142	5年国債 0.1% 2024/12/20	320,416
347	10年国債 0.1% 2027/6/20	399,144	149	5年国債 0.005% 2026/9/20	259,657
372	10年国債 0.8% 2033/9/20	393,973	433	2年国債 0.005% 2024/2/1	250,142

（注1）金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

（注2）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2024年1月10日現在におけるダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）（43,756,341千円）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）

2024年1月10日現在								
区 分	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
国債証券	46,931,000	46,031,468	85.4	—	55.2	20.5	9.6	
地方債証券	3,034,160	3,079,923	5.7	—	3.5	0.9	1.3	
特殊債券(除く金融債券)	1,285,940	1,319,842	2.4	—	1.7	0.4	0.4	
普通社債券	3,400,000	3,381,227	6.3	—	1.8	4.1	0.4	
合 計	54,651,100	53,812,461	99.8	—	62.2	25.9	11.6	

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

（注2）額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

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

2024年1月10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	445 2年国債	0.0050	110,000	110,074	2025/02/01
	446 2年国債	0.0050	400,000	400,292	2025/03/01
	143 5年国債	0.1000	900,000	901,602	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	80,000	80,427	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	14,000	14,357	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	25,000	25,578	2025/03/20
	447 2年国債	0.0050	90,000	90,065	2025/04/01
	448 2年国債	0.0050	70,000	70,045	2025/05/01
	449 2年国債	0.0050	300,000	300,165	2025/06/01
	144 5年国債	0.1000	800,000	801,432	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	165,000	166,008	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	17,000	17,470	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	14,000	14,407	2025/06/20
	451 2年国債	0.0050	20,000	20,010	2025/08/01
	452 2年国債	0.0050	110,000	110,035	2025/09/01
	145 5年国債	0.1000	1,070,000	1,072,075	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	190,000	191,331	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	65,000	67,214	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	28,000	29,001	2025/09/20
	453 2年国債	0.0050	60,000	60,010	2025/10/01
	455 2年国債	0.0050	70,000	70,006	2025/12/01
	146 5年国債	0.1000	540,000	541,096	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	15,000	15,088	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	800,000	800,000	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	140,000	140,289	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	31,000	32,419	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	6,000	6,301	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	35,000	36,679	2026/03/20
	148 5年国債	0.0050	550,000	549,928	2026/06/20
	343 10年国債	0.1000	300,000	300,657	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	33,000	34,842	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	15,000	15,800	2026/06/20
	149 5年国債	0.0050	650,000	649,733	2026/09/20
	344 10年国債	0.1000	90,000	90,193	2026/09/20
	150 5年国債	0.0050	560,000	559,585	2026/12/20
	345 10年国債	0.1000	410,000	410,840	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	60,000	63,647	2026/12/20
	151 5年国債	0.0050	450,000	449,496	2027/03/20
	152 5年国債	0.1000	150,000	150,285	2027/03/20
	346 10年国債	0.1000	250,000	250,475	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	18,000	19,122	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	45,000	47,949	2027/03/20
	1 フイリピン共和国	0.7600	100,000	99,282	2027/04/22
	153 5年国債	0.0050	270,000	269,489	2027/06/20
	347 10年国債	0.1000	690,000	690,945	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	30,000	32,305	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	63,000	67,409	2027/06/20
	154 5年国債	0.1000	520,000	520,379	2027/09/20
	348 10年国債	0.1000	430,000	430,313	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	25,000	26,955	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	64,000	68,769	2027/09/20

2024年1月10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	
	155 5年国債	0.3000	90,000	90,705	2027/12/20
	156 5年国債	0.2000	600,000	602,352	2027/12/20
	349 10年国債	0.1000	430,000	430,000	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	53,000	57,170	2027/12/20
	157 5年国債	0.2000	60,000	60,174	2028/03/20
	158 5年国債	0.1000	430,000	429,462	2028/03/20
	350 10年国債	0.1000	400,000	399,500	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	35,000	38,024	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	18,000	19,705	2028/03/20
	159 5年国債	0.1000	200,000	199,514	2028/06/20
	161 5年国債	0.3000	400,000	402,464	2028/06/20
	351 10年国債	0.1000	170,000	169,586	2028/06/20
	102 20年国債	2.4000	10,000	10,992	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	21,000	22,990	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	64,000	69,502	2028/06/20
	162 5年国債	0.3000	180,000	180,919	2028/09/20
	352 10年国債	0.1000	390,000	388,365	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	38,000	41,383	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	16,000	17,499	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	520,000	517,327	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	40,000	43,728	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	68,000	73,671	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	280,000	278,348	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	60,000	65,218	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	27,000	29,625	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	290,000	288,129	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	35,000	38,745	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	40,000	44,064	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	440,000	436,783	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	70,000	77,395	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	420,000	416,434	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	45,000	49,916	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	42,000	46,834	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	9,000	10,170	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	600,000	594,150	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	27,000	30,216	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	77,000	85,704	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	4,000	4,510	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	240,000	237,266	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	13,000	14,427	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	23,000	25,234	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	98,000	106,247	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	500,000	493,275	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	8,000	9,397	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	510,000	501,870	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	42,000	47,091	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	100,000	111,443	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	550,000	539,792	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	25,000	28,261	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	21,000	23,437	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	110,000	121,994	2031/03/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

2024年1月10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	
	5 30年国債	2.2000	8,000	9,057	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	460,000	450,192	2031/06/20
	128 20年国債	1.9000	32,000	35,531	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	95,000	104,796	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	450,000	439,105	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	110,000	121,489	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	164,548	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	9,000	10,367	2031/11/20
	365 10年国債	0.1000	410,000	398,995	2031/12/20
	132 20年国債	1.7000	25,000	27,448	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	150,000	165,840	2031/12/20
	366 10年国債	0.2000	600,000	587,226	2032/03/20
	134 20年国債	1.8000	15,000	16,605	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	20,000	21,982	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	180,000	196,419	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	12,000	13,787	2032/05/20
	367 10年国債	0.2000	330,000	322,245	2032/06/20
	137 20年国債	1.7000	18,000	19,804	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	250,000	273,037	2032/06/20
	368 10年国債	0.2000	400,000	389,516	2032/09/20
	140 20年国債	1.7000	100,000	110,131	2032/09/20
	369 10年国債	0.5000	500,000	498,715	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	140,000	154,309	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	210,000	233,259	2032/12/20
	370 10年国債	0.5000	550,000	547,591	2033/03/20
	10 30年国債	1.1000	25,000	26,236	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	100,000	109,420	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	50,000	54,272	2033/03/20
	371 10年国債	0.4000	480,000	472,478	2033/06/20
	11 30年国債	1.7000	9,000	9,933	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	40,000	44,146	2033/06/20
	372 10年国債	0.8000	390,000	397,686	2033/09/20
	12 30年国債	2.1000	11,000	12,562	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	160,000	176,683	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	11,000	12,467	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	240,000	262,756	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	22,000	25,826	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	290,000	314,751	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	21,000	24,907	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	310,000	336,415	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	26,000	30,885	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	280,000	300,840	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	17,000	20,038	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	280,000	294,674	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	20,000	23,392	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	285,000	299,626	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	15,000	17,550	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	275,000	291,700	2035/06/20
	20 30年国債	2.5000	16,000	19,101	2035/09/20
	154 20年国債	1.2000	305,000	319,749	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	16,000	18,748	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	400,000	409,608	2035/12/20

2024年1月10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	
	22 30年国債	2.5000	17,000	20,333	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	220,000	209,530	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	16,000	19,141	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	310,000	286,846	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	15,000	17,968	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	285,000	272,947	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	17,000	19,966	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	300,000	290,073	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	32,000	38,016	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	280,000	273,397	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	220,000	211,327	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	32,000	38,451	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	270,000	258,549	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	230,000	219,415	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	34,000	40,869	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	300,000	281,187	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	220,000	205,473	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	43,000	51,136	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	320,000	306,329	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	260,000	240,754	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	56,000	65,771	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	250,000	227,080	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	230,000	204,635	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	76,000	88,129	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	255,000	225,889	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	150,000	132,201	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	45,000	52,781	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	275,000	245,346	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	230,000	204,175	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	95,000	106,905	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	340,000	300,298	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	195,000	174,310	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	110,000	126,755	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	245,000	217,925	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	190,000	165,338	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	120,000	134,400	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	335,000	295,600	2041/09/20
	179 20年国債	0.5000	210,000	184,487	2041/12/20
	36 30年国債	2.0000	138,000	154,249	2042/03/20
	180 20年国債	0.8000	250,000	230,932	2042/03/20
	181 20年国債	0.9000	220,000	206,144	2042/06/20
	37 30年国債	1.9000	165,000	181,523	2042/09/20
	182 20年国債	1.1000	230,000	222,580	2042/09/20
	183 20年国債	1.4000	190,000	192,886	2042/12/20
	38 30年国債	1.8000	250,000	270,232	2043/03/20
	184 20年国債	1.1000	170,000	163,647	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	105,000	115,132	2043/06/20
	185 20年国債	1.1000	180,000	172,803	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	80,000	86,270	2043/09/20
	186 20年国債	1.5000	220,000	225,834	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	80,000	84,798	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	100,000	105,888	2044/03/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

2024年1月10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	
	43 30年国債	1.7000	105,000	111,063	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	155,000	163,773	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	125,000	127,436	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	170,000	173,060	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	135,000	139,681	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	145,000	144,398	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	120,000	119,298	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	170,000	149,443	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	155,000	121,030	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	150,000	122,430	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	130,000	108,275	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	140,000	121,675	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	140,000	121,321	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	160,000	138,248	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	135,000	116,305	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	30,000	35,484	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	210,000	180,387	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	110,000	91,960	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	150,000	131,067	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	110,000	91,213	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	48,000	54,641	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	135,000	105,869	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	140,000	106,356	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	120,000	90,806	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	125,000	94,303	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	19,000	21,602	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	175,000	131,395	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	140,000	110,698	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	140,000	110,307	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	161,000	130,049	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	54,000	61,299	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	166,000	133,643	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	130,000	104,309	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	203,000	162,485	2051/09/20
	73 30年国債	0.7000	140,000	111,785	2051/12/20
	5 40年国債	2.0000	61,000	66,515	2052/03/20
	74 30年国債	1.0000	155,000	133,941	2052/03/20
	75 30年国債	1.3000	160,000	148,872	2052/06/20
	76 30年国債	1.4000	120,000	114,268	2052/09/20
	77 30年国債	1.6000	195,000	194,613	2052/12/20
	6 40年国債	1.9000	68,000	72,563	2053/03/20
	78 30年国債	1.4000	150,000	142,612	2053/03/20
	79 30年国債	1.2000	160,000	144,587	2053/06/20
	80 30年国債	1.8000	130,000	135,642	2053/09/20
	7 40年国債	1.7000	41,000	41,749	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	40,000	37,746	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	40,000	27,630	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	240,000	194,316	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	85,000	66,032	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	99,000	68,401	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	252,000	172,282	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	273,000	199,011	2061/03/20

2024年1月10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	
	15 40年国債	1.0000	250,000	200,650	2062/03/20
	16 40年国債	1.3000	370,000	324,874	2063/03/20
種別 小計	銘柄数 金額		260銘柄 46,931,000	46,031,468	
	地方債証券				
	3 兵庫県公債12年	0.5600	100,000	100,611	2025/04/16
	32 東京都5年	0.0200	100,000	99,897	2025/06/20
	151 共同発行地方	0.4660	100,000	100,658	2025/10/24
	401 大阪府公債	0.4770	100,000	100,668	2025/10/29
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	102,927	2025/11/21
	27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	100,709	2025/11/27
	75-1 東京都公債	0.3700	100,000	100,509	2025/12/19
	27-15 北海道公債	0.2200	100,000	100,196	2026/02/26
	28-1 静岡県公債	0.0800	100,000	99,911	2026/03/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,851	2026/06/19
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,181	2027/03/25
	29-6 千葉県公債	0.2450	100,000	100,076	2028/01/25
	30-3 新潟県公債	0.1460	134,160	132,952	2029/02/28
	6 札幌市20年	2.2400	100,000	110,250	2029/06/20
	797 東京都公債	0.0400	100,000	98,225	2029/09/20
	1 埼玉県15年	0.9410	100,000	103,335	2029/10/19
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	110,298	2029/12/14
	2-1 千葉市公債	0.1310	100,000	98,374	2030/04/24
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	110,996	2030/05/24
	457 大阪府公債	0.1000	100,000	98,008	2030/06/28
	11兵庫県公債20年	1.8400	100,000	109,207	2030/08/16
	2-2 横浜市公債	0.1350	100,000	98,144	2030/08/19
	2-1 静岡県公債	0.1400	100,000	97,890	2030/11/18
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	97,114	2031/06/30
	3-1 茨城県公債	0.1400	100,000	97,156	2031/06/30
	10 京都市20年	1.8030	100,000	109,481	2031/11/21
	3-3 堺市公債	0.1250	100,000	96,506	2031/12/22
	4-3 長崎県公債	0.3640	100,000	97,947	2032/06/18
	24-1 広島県20年	1.7000	100,000	108,913	2032/09/14
	244 共同発行地方	0.5900	100,000	98,922	2033/07/25
種別 小計	銘柄数 金額		30銘柄 3,034,160	3,079,923	
	特殊債券 (低金利債券)				
	241 政保道路機構	0.4500	100,000	100,519	2025/03/31
	261 政保道路機構	0.3810	100,000	100,599	2025/11/28
	127 都市再生	0.0750	100,000	99,711	2026/09/18
	80 住宅支援機構	1.5890	100,000	103,777	2026/09/18
	3 地方公共団15年	1.1760	100,000	103,561	2029/01/26
	81 政保道路機構	2.1000	100,000	109,658	2029/05/31
	47日本政策投資CO	1.0270	100,000	103,472	2029/09/20
	129 地方公共団体	0.0950	100,000	97,519	2030/02/28
	F231地方公共団体	1.1760	100,000	104,072	2030/04/30
	174 日本政策投資	0.6490	100,000	98,948	2033/07/14
	235 政保道路機構	1.2240	100,000	104,588	2034/12/28
	47 住宅機構RMBS	1.9200	185,940	193,414	2046/04/10
種別 小計	銘柄数 金額		12銘柄 1,285,940	1,319,842	
	普通社債券				
	497 関西電力	1.0020	100,000	101,175	2025/06/20
	14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	99,889	2025/12/19

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

2024年1月10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	
	11 ヒューリック	0.3200	100,000	99,974	2026/04/13
	36 芙蓉総合リース	0.2700	100,000	99,760	2026/06/05
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,530	2026/08/21
	32大和ハウス工業	0.3100	100,000	100,100	2026/09/07
	17 パナソニック	0.4700	100,000	100,170	2026/09/18
	7 三井住友海上	0.1900	100,000	99,751	2026/11/13
	6 楽天カード	0.6200	100,000	91,318	2026/12/17
	80 三菱地所	2.3050	100,000	106,307	2027/03/19
	42 リコーリース	0.3900	100,000	99,693	2027/06/01
	9 ソフトバンク	0.4800	100,000	98,641	2027/12/03
	16 クボタ	0.4790	100,000	100,043	2028/04/20
	16 JERA	0.6400	100,000	100,066	2028/04/25
	1 SOMPOHD	0.4790	100,000	99,975	2028/04/27
	11サントリーホールディング	0.3890	100,000	99,739	2028/05/25
	29 東急不動産HD	0.4500	100,000	99,592	2028/06/01
	50 大阪瓦斯	0.3900	100,000	99,694	2028/06/02
	82 三井不動産	0.3600	100,000	99,605	2028/06/06
	22 積水ハウス	0.3600	100,000	99,695	2028/06/07
	26 リソナホールディング	0.4150	100,000	99,877	2028/06/07
	81 ホンダファイナンス	0.3890	100,000	99,834	2028/06/20
	101 中日本高速道	0.4390	200,000	200,152	2028/08/17
	32 住友電工	0.4640	100,000	99,604	2029/07/13
	489 九州電力	0.4400	100,000	97,973	2030/05/24
	65 東京瓦斯	0.2250	100,000	97,138	2030/09/10
	18 セブンアンドアイ	1.0400	100,000	101,644	2030/11/01
	35 東レ	0.9730	100,000	101,430	2030/11/22
	5 NTTファイナンス	0.4890	100,000	96,302	2032/09/17
	143 三菱地所	0.9000	100,000	99,603	2033/05/02
	448 中国電力	0.9200	100,000	98,475	2033/05/25
	31 トヨタ自動車	0.7350	100,000	98,495	2033/06/01
	214 オリックス	0.8500	100,000	95,968	2033/06/13
種別	銘柄数	33銘柄			
小計	金額		3,400,000	3,381,227	
合計	銘柄数	335銘柄			
	金額		54,651,100	53,812,461	

(注) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の決算日（2023年9月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2024年1月10日）現在におけるダイワ・グローバル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・グローバルREIT・マザーファンドの主要な売買銘柄
投資証券

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

買				付				売				付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円		千口	千円	円		千口	千円	円
CAPITALAND INTEGRATED COMMER (シンガポール)	8,482.8	1,752,367	206	CAPITALAND ASCENDAS REIT (シンガポール)	8,716.1	2,481,194	284	CAPITALAND ASCENDAS REIT (シンガポール)	8,716.1	2,481,194	284	CAPITALAND ASCENDAS REIT (シンガポール)	8,716.1	2,481,194	284
IRON MOUNTAIN INC (アメリカ)	199.582	1,725,248	8,644	WELLTOWER INC (アメリカ)	190.73	2,173,029	11,393	WELLTOWER INC (アメリカ)	190.73	2,173,029	11,393	WELLTOWER INC (アメリカ)	190.73	2,173,029	11,393
AMERICAN TOWER CORP (アメリカ)	58.922	1,576,422	26,754	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	50.484	2,052,980	40,665	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	50.484	2,052,980	40,665	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	50.484	2,052,980	40,665
EXTRA SPACE STORAGE INC (アメリカ)	75.312	1,572,621	20,881	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR (カナダ)	1,021.878	1,977,587	1,935	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR (カナダ)	1,021.878	1,977,587	1,935	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR (カナダ)	1,021.878	1,977,587	1,935
LAND SECURITIES GROUP PLC (イギリス)	1,439.007	1,564,142	1,086	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	108.218	1,796,313	16,599	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	108.218	1,796,313	16,599	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	108.218	1,796,313	16,599
VICI PROPERTIES INC (アメリカ)	342.926	1,497,556	4,366	BRITISH LAND CO PLC (イギリス)	2,656.136	1,698,465	639	BRITISH LAND CO PLC (イギリス)	2,656.136	1,698,465	639	BRITISH LAND CO PLC (イギリス)	2,656.136	1,698,465	639
MAPLETREE LOGISTICS TRUST (シンガポール)	7,581.5	1,374,021	181	COVIVIO (フランス)	217.008	1,541,909	7,105	COVIVIO (フランス)	217.008	1,541,909	7,105	COVIVIO (フランス)	217.008	1,541,909	7,105
FRASERS CENTREPOINT TRUST (シンガポール)	5,594.1	1,295,985	231	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI (シンガポール)	11,430.2	1,443,678	126	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI (シンガポール)	11,430.2	1,443,678	126	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI (シンガポール)	11,430.2	1,443,678	126
COFINIMMO (ベルギー)	107.345	1,278,993	11,914	KLEPIERRE (フランス)	382.351	1,373,967	3,593	KLEPIERRE (フランス)	382.351	1,373,967	3,593	KLEPIERRE (フランス)	382.351	1,373,967	3,593
WP CAREY INC (アメリカ)	148.395	1,273,932	8,584	DEXUS/AU (オーストラリア)	1,899.918	1,314,118	691	DEXUS/AU (オーストラリア)	1,899.918	1,314,118	691	DEXUS/AU (オーストラリア)	1,899.918	1,314,118	691

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2024年1月10日現在におけるダイワ・グローバルREIT・マザーファンド（23,487,254千口）の内容です。

外国投資証券

銘柄	2024年1月10日現在			
	口数	評価額		邦貨換算金額
		外貨建金額	千円	
(シンガポール)	千口	千アメリカ・ドル	千円	
DIGITAL CORE REIT UNITS (アメリカ)	12,723.056	8,269	1,196,584	
SIMON PROPERTY GROUP INC	199.035	28,292	4,093,688	
EQUINIX INC	20.453	16,335	2,363,598	
AMERICAN TOWER CORP	35.376	7,494	1,084,416	
HOST HOTELS & RESORTS INC	301.022	5,972	864,128	
KIMCO REALTY CORP	461.486	9,571	1,384,859	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	588.714	10,190	1,474,483	
INVITATION HOMES INC	667.633	22,632	3,274,733	
AMERICOLD REALTY TRUST	314.371	9,471	1,370,503	
VICI PROPERTIES INC	376.758	11,924	1,725,340	
APARTMENT INCOME REIT CO	98.171	3,437	497,436	
STAG INDUSTRIAL INC	24.659	951	137,649	
IRON MOUNTAIN INC	166.837	11,201	1,620,735	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	64.452	2,911	421,235	
SUN COMMUNITIES INC	104.747	14,148	2,047,099	
PROLOGIS INC	245.521	32,671	4,727,236	
CAMDEN PROPERTY TRUST	31.923	3,131	453,117	
SITE CENTERS CORP	110.954	1,486	215,122	

銘柄	2024年1月10日現在			
	口数	評価額		邦貨換算金額
		外貨建金額	千円	
	千口	千アメリカ・ドル	千円	
EASTGROUP PROPERTIES INC	8.929	1,626	235,352	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	27.87	6,908	999,578	
WELLTOWER INC	321.426	28,796	4,166,573	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	101.201	2,335	337,955	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	48.221	6,383	923,697	
REALTY INCOME CORP	347.912	20,627	2,984,622	
PUBLIC STORAGE	13.946	4,140	599,098	
UDR INC	251.849	9,603	1,389,458	
WP CAREY INC	145.373	9,712	1,405,282	
AGREE REALTY CORP	44.816	2,848	412,085	
DIGITAL REALTY TRUST INC	173.901	23,236	3,362,111	
EXTRA SPACE STORAGE INC	109.819	17,354	2,511,051	
アメリカ・ドル 通貨計	口数、金額 計	18,130,431 30銘柄	333,670 <50.9%>	48,278,840 <50.9%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	651.951	8,905	962,611	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	225.612	10,716	1,158,354	
カナダ・ドル 通貨計	口数、金額 計	877,563 2銘柄	19,622 <2.2%>	2,120,965 <2.2%>

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

銘柄	2024年1月10日現在			
	□ 数	評 価 額		千円
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル		千円
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REIT	2,857.845	3,886		376,229
NATIONAL STORAGE REIT	4,934.999	10,807		1,046,180
GPT GROUP	3,136.794	14,178		1,372,460
MIRVAC GROUP	5,469.19	11,102		1,074,717
STOCKLAND	4,192.433	18,362		1,777,524
GOODMAN GROUP	2,371.559	57,486		5,564,701
CHARTER HALL GROUP	1,441.127	16,385		1,586,127
INGENIA COMMUNITIES GROUP	3,466.951	15,462		1,496,779
オーストラリア・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	27,870.898	147,672	14,294,721 <15.1%>
(香港)	千口	千香港ドル		千円
LINK REIT	3,279.392	140,194		2,594,991
香港ドル計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	3,279.392	140,194	2,594,991 < 2.7%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル		千円
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	7,479.8	15,034		1,634,539
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	7,425.5	12,400		1,348,191
FRASERS CENTREPOINT TRUST	4,274.8	9,746		1,059,644
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	4,843.177	17,871		1,942,970
シンガポール・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	24,023.277	55,052	5,985,345 < 6.3%>
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランド・ドル		千円
GOODMAN PROPERTY TRUST	3,869.435	8,706		785,301
ニュージーランド・ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	3,869.435	8,706	785,301 < 0.8%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド		千円
LXI REIT PLC	2,924.485	3,032		557,893
LAND SECURITIES GROUP PLC	1,257.214	8,765		1,612,463
SEGRO PLC	1,309.167	11,381		2,093,813
UNITE GROUP PLC/THE	603.371	6,269		1,153,249
BRITISH LAND CO PLC	968.97	3,865		711,046
WORKSPACE GROUP PLC	297.117	1,595		293,511
SAFESTORE HOLDINGS PLC	523.548	4,463		821,058
BIG YELLOW GROUP PLC	350.341	4,060		746,960
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	177.173	326		60,068
TRITAX BIG BOX REIT PLC	5,014.286	8,298		1,526,618
イギリス・ポンド 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	13,425.672	52,058	9,576,685 <10.1%>
ユーロ (オランダ)	千口	千ユーロ		千円
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	166.042	3,765		595,754
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	166.042	3,765	595,754 < 0.6%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ		千円
AEDIFICA	71.296	4,374		691,968
COFINIMMO	95.153	6,627		1,048,455
WAREHOUSES DE PAUW SCA	265.823	7,225		1,143,005
XIOR STUDENT HOUSING NV	121.82	3,557		562,740
MONTEA NV	38.498	3,237		512,201
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	592.59	25,021	3,958,371 < 4.2%>

銘柄	2024年1月10日現在			
	□ 数	評 価 額		千円
		外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ		千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	171.171	11,242		1,778,565
KLEPIERRE	354.594	8,779		1,388,956
MERCIALYS	180.896	1,795		284,031
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	706.661	21,817	3,451,552 < 3.6%>
ユーロ (スペイン)	千口	千ユーロ		千円
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	652.77	6,233		986,211
国 小 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	652.77	6,233	986,211 < 1.0%>
ユーロ通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	2,118.063	56,838	8,991,890 < 9.5%>
合 計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	93,594.731	-	92,628,742 <97.7%>

(注1) 邦貨換算金額は、2024年1月10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。

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド」の決算日（2023年11月10日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2024年1月10日）現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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アクティブ・マザーファンドの主要な売買銘柄
投資証券

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

買				売			
銘柄	柄	口数	金額 平均単価	銘柄	柄	口数	金額 平均単価
		千口	千円 円			千口	千円 円
ジャパン・ホテル・リート投資法人		77.946	5,675,652 72,815	KDX不動産投資法人		21.676	6,642,670 306,452
日本プロロジスリート		19.399	5,564,994 286,870	日本ビルファンド		7.736	4,657,187 602,014
大和ハウスリート投資法人		17.266	4,584,765 265,537	GLP投資法人		22.605	3,242,889 143,458
GLP投資法人		29.44	4,191,940 142,389	三井不ロジパーク		6.126	2,984,388 487,167
オリックス不動産投資		23.427	4,017,902 171,507	ラサールロジポート投資		16.9	2,583,768 152,885
日本都市ファンド投資法人		40.986	3,954,074 96,473	ジャパンリアルエステイト		4.062	2,266,338 557,936
ジャパンリアルエステイト		6.785	3,859,329 568,803	野村不動産マスターF		13.494	2,206,929 163,548
日本ビルファンド		6.036	3,513,313 582,059	スターアジア不動産投		35.567	2,011,922 56,567
日本アコモデーションファンド投資法人		5.319	3,318,216 623,842	インヴィンシブル投資法人		35.005	1,979,498 56,549
大和証券リビング投資法人		22.911	2,496,410 108,961	コンフォリア・レジデンシャル		6.168	1,955,988 317,118

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2024年1月10日現在におけるダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド（49,244,470千口）の内容です。

(1) 国内投資証券

銘柄	柄	2024年1月10日現在	
		口数	評価額
		千口	千円
サンケイリアルエステート		6.651	603,245
SOIL A物流リート投		6.405	776,926
日本アコモデーションファンド投資法人		10.475	6,337,375
森ビルズリート		18.33	2,579,031
産業ファンド		26.756	3,794,000
アドバンス・レジデンス		15.524	5,006,490
API投資法人		5.683	2,207,845
GLP投資法人		70.744	10,031,499
コンフォリア・レジデンシャル		9.466	2,967,591
日本プロロジスリート		41.151	11,287,719
星野リゾート・リート		2.08	1,189,760
Oneリート投資法人		4.206	1,132,675
イオンリート投資		28.349	4,000,043
ヒューリックリート投資法		24.849	3,719,895

銘柄	柄	2024年1月10日現在	
		口数	評価額
		千口	千円
日本リート投資法人		8.725	2,966,500
積水ハウス・リート投資		25.302	1,960,905
トーセイ・リート投資法人		1.07	146,055
ヘルスケア&メディカル投資		4.266	597,240
野村不動産マスターF		37.33	6,069,858
いちごホテルリート投資		1.867	210,597
ラサールロジポート投資		23.57	3,592,068
三井不ロジパーク		4.428	2,043,522
投資法人みらい		10.26	452,979
三菱地所物流REIT		13.984	5,271,968
CREロジスティクスファンド		11.213	1,751,470
ザイマックス・リート		5.774	685,373
アドバンス・ロジスティクス投資法人		2.908	372,514
日本ビルファンド		18.258	11,137,380

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

銘柄	2024年1月10日現在	
	口数	評価額
	千口	千円
ジャパンリアルエステイト	11.913	6,945,279
日本都市ファンド投資法人	78.986	8,064,470
オリックス不動産投資	37.736	6,335,874
日本プライムリアルティ	14.406	5,178,957
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	14.954	1,860,277
東急リアル・エステート	4.938	848,842
グローバル・ワン不動産投資法人	2.508	278,638
ユナイテッド・アーバン投資法人	34.854	5,140,965
森トラストリート投資法人	1.16	85,608
インヴィンシブル投資法人	53.15	3,141,165
フロンティア不動産投資	5.205	2,258,970
平和不動産リート	5.953	800,678
日本ロジスティクスファンド投資法人	3.588	1,021,144
KDX不動産投資法人	53.16152	8,596,217
いちごオフィスリート投資法人	20.369	1,690,627
大和証券オフィス投資法人	3.18	2,130,600
阪急阪神リート投資法人	6.365	886,644
スターツプロシード投資法人	0.635	127,698
大和ハウスリート投資法人	35.363	9,095,363
ジャパン・ホテル・リート投資法人	93.693	6,577,248
大和証券リビング投資法人	22.911	2,385,035
合計	944.65252	166,342,836
	銘柄数<比率>	49銘柄 <97.6%>

(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) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2024年1月10日現在	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
国内 東証REIT	3,212	-

(注) 単位未満は切捨て。

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の決算日（2023年10月16日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2024年1月10日）現在におけるダイワ北米好配当株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。

■ダイワ北米好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

買				付				売				付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円		千株	千円	円		千株	千円	円
CHEVRON CORP (アメリカ)	4.99	110,991	22,242	EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	6.694	98,627	14,733	CANADIAN NATURAL RESOURCES (カナダ)	8.49	81,162	9,559	META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)	1.654	68,579	41,462
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	5.979	88,231	14,756	CANADIAN NATURAL RESOURCES (カナダ)	8.49	81,162	9,559	META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)	1.654	68,579	41,462	BROADCOM INC (アメリカ)	0.518	67,566	130,437
CANADIAN NATURAL RESOURCES (カナダ)	8.49	74,052	8,722	BAKER HUGHES CO (アメリカ)	14.756	58,191	3,943	BROADCOM INC (アメリカ)	0.518	67,566	130,437	UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)	1.027	67,154	65,388
BAKER HUGHES CO (アメリカ)	14.756	58,191	3,943	WASTE MANAGEMENT INC (アメリカ)	2.296	50,704	22,083	UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)	1.027	67,154	65,388	SUNCOR ENERGY INC (カナダ)	10.512	49,089	4,669
WASTE MANAGEMENT INC (アメリカ)	2.296	50,704	22,083	SUNCOR ENERGY INC (カナダ)	10.512	49,089	4,669	KLA CORP (アメリカ)	0.859	65,249	75,960	UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)	0.644	46,543	72,271
SUNCOR ENERGY INC (カナダ)	10.512	49,089	4,669	UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)	0.644	46,543	72,271	BAKER HUGHES CO (アメリカ)	11.817	61,932	5,240	STANLEY BLACK & DECKER INC (アメリカ)	3.462	46,133	13,325
UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)	0.644	46,543	72,271	STANLEY BLACK & DECKER INC (アメリカ)	3.462	46,133	13,325	VERIZON COMMUNICATIONS INC (アメリカ)	10.983	57,078	5,196	IMPERIAL OIL LTD (カナダ)	5.121	45,130	8,812
STANLEY BLACK & DECKER INC (アメリカ)	3.462	46,133	13,325	IMPERIAL OIL LTD (カナダ)	5.121	45,130	8,812	DIAMONDBACK ENERGY INC (アメリカ)	2.902	55,384	19,085	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	2.727	42,698	15,657
IMPERIAL OIL LTD (カナダ)	5.121	45,130	8,812	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	2.727	42,698	15,657	SUNCOR ENERGY INC (カナダ)	11.618	51,341	4,419				

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

買				付				売				付			
銘柄	証券数	金額	平均単価	銘柄	証券数	金額	平均単価	銘柄	証券数	金額	平均単価	銘柄	証券数	金額	平均単価
	千証券	千円	円		千証券	千円	円		千証券	千円	円		千証券	千円	円
BANK OF AMERICA CORP 4.375 NN (アメリカ)	20.301	52,897	2,605	GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K (アメリカ)	18.193	64,866	3,565	REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B (アメリカ)	15.75	52,975	3,363	STATE STREET CORP 5.9 D (アメリカ)	11.283	41,079	3,640
GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K (アメリカ)	13.125	48,461	3,692	REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B (アメリカ)	15.75	52,975	3,363	STATE STREET CORP 5.9 D (アメリカ)	11.283	41,079	3,640	FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I (アメリカ)	11.633	41,323	3,552
SCE TRUST 7 7.5 (アメリカ)	11.053	41,510	3,755	STATE STREET CORP 5.9 D (アメリカ)	11.283	41,079	3,640	FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I (アメリカ)	11.633	41,323	3,552	REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B (アメリカ)	11.96	41,042	3,431
FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I (アメリカ)	11.633	41,323	3,552	FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I (アメリカ)	10.783	39,727	3,684	AT&T INC 5.625 (アメリカ)	11.405	37,461	3,284	TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R (アメリカ)	14.806	40,951	2,765
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B (アメリカ)	11.96	41,042	3,431	AT&T INC 5.625 (アメリカ)	11.405	37,461	3,284	RGA FR (アメリカ)	9.463	36,955	3,905	STATE STREET CORP 5.9 D (アメリカ)	11.283	38,510	3,413
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R (アメリカ)	14.806	40,951	2,765	RGA FR (アメリカ)	9.463	36,955	3,905	FIFTH THIRD BANCORP 6 A (アメリカ)	10.855	34,030	3,135	WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA (アメリカ)	10.828	28,322	2,615
STATE STREET CORP 5.9 D (アメリカ)	11.283	38,510	3,413	FIFTH THIRD BANCORP 6 A (アメリカ)	10.855	34,030	3,135	WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R (アメリカ)	9.163	33,196	3,622	GOLDMAN SACHS GROUP INC FR J (アメリカ)	8.043	27,926	3,472
WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA (アメリカ)	10.828	28,322	2,615	WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R (アメリカ)	9.163	33,196	3,622	FIRST HORIZON CORP 6.1 D (アメリカ)	12.104	33,163	2,739	WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R (アメリカ)	7.873	27,624	3,508
GOLDMAN SACHS GROUP INC FR J (アメリカ)	8.043	27,926	3,472	FIRST HORIZON CORP 6.1 D (アメリカ)	12.104	33,163	2,739	TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R (アメリカ)	12.017	32,822	2,731				
WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R (アメリカ)	7.873	27,624	3,508	TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R (アメリカ)	12.017	32,822	2,731								

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2024年1月10日現在におけるダイワ北米好配当株マザーファンド（1,015,888千口）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	2024年1月10日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円	
(アメリカ)	百株			
ABBOTT LABORATORIES	20.4	229	33,274	ヘルスケア
ADOBE INC	8.43	494	71,500	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	23.39	183	26,526	素材
CITIGROUP INC	67.13	359	51,945	金融
DANAHER CORP	11.16	257	37,279	ヘルスケア
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	35.25	447	64,794	金融
APPLE INC	117.3	2,171	314,222	情報技術
BECTON DICKINSON AND CO	10.84	257	37,303	ヘルスケア
NISOURCE INC	58.85	159	23,109	公益事業
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	65.01	344	49,806	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	105.35	411	59,509	コミュニケーション・サービス
JPMORGAN CHASE & CO	30.77	525	75,979	金融
SERVICENOW INC	4.62	322	46,703	情報技術
MORGAN STANLEY	35.53	327	47,326	金融
BROADCOM INC	10.23	1,107	160,227	情報技術
DEERE & CO	8.34	327	47,450	資本財・サービス
CONSOLIDATED EDISON INC	21.19	198	28,278	公益事業
COLGATE-PALMOLIVE CO	27.6	223	32,275	生活必需品
COSTCO WHOLESALE CORP	5.76	384	55,603	生活必需品
CUMMINS INC	10.6	253	36,718	資本財・サービス
CSX CORP	108.64	376	54,403	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11.17	254	36,879	ヘルスケア
AMAZON.COM INC	72.73	1,100	159,291	一般消費財・サービス
EXXON MOBIL CORP	17.72	176	25,554	エネルギー
FORD MOTOR CO	102.76	121	17,604	一般消費財・サービス
NEXTERA ENERGY INC	12.91	80	11,583	公益事業
FREEMPORT-MCMORAN INC	44.83	186	27,048	素材
GENERAL MOTORS CO	64.91	237	34,317	一般消費財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	11.64	446	64,629	金融
ALPHABET INC-CL A	70.55	994	143,880	コミュニケーション・サービス
HOME DEPOT INC	12.48	432	62,512	一般消費財・サービス
HUMANA INC	3.39	155	22,528	ヘルスケア
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	152.78	246	35,678	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20.33	325	47,088	情報技術
JOHNSON & JOHNSON	23.47	379	54,887	ヘルスケア
ELI LILLY & CO	4.77	298	43,168	ヘルスケア
MCDONALD'S CORP	18.72	544	78,784	一般消費財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	20.37	728	105,346	コミュニケーション・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	27.92	188	27,320	生活必需品
MOTOROLA SOLUTIONS INC	8.94	278	40,359	情報技術
BAKER HUGHES CO	29.39	92	13,446	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	4.68	141	20,515	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	27.28	323	46,746	ヘルスケア
NIKE INC-CL B	30.1	309	44,745	一般消費財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	29.24	279	40,441	生活必需品
PFIZER INC	22.15	65	9,422	ヘルスケア
DOW INC	33.01	178	25,762	素材
PROCTER & GAMBLE CO/THE	16.01	239	34,585	生活必需品
PEPSICO INC	16.31	272	39,450	生活必需品

銘柄	2024年1月10日現在			業種等
	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	
CHEVRON CORP	26.94	392	56,793	エネルギー
TESLA INC	16.08	377	54,666	一般消費財・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	34.62	337	48,859	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	19.49	311	45,103	資本財・サービス
UNITEDHEALTH GROUP INC	4.82	259	37,546	ヘルスケア
ELEVANCE HEALTH INC	3.99	192	27,898	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	27.28	244	35,394	コミュニケーション・サービス
WASTE MANAGEMENT INC	18.68	332	48,172	資本財・サービス
WALMART INC	14.03	223	32,339	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	10.23	245	35,505	金融
VISA INC-CLASS A SHARES	15.52	408	59,133	金融
PPL CORP	50.01	139	20,130	公益事業
NVIDIA CORP	15.53	825	119,407	情報技術
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5.63	305	44,139	ヘルスケア
MASTERCARD INC - A	9.24	390	56,498	金融
ONEOK INC	16.4	115	16,702	エネルギー
BANK OF AMERICA CORP	152.04	511	73,981	金融
ADVANCED MICRO DEVICES	25.53	381	55,135	情報技術
KENVUE INC	144.72	316	45,752	生活必需品
EATON CORP PLC	20.71	495	71,760	資本財・サービス
APPLIED MATERIALS INC	16.98	256	37,105	情報技術
GILEAD SCIENCES INC	35.17	302	43,793	ヘルスケア
CHORD ENERGY CORP	11.02	173	25,101	エネルギー
CARDINAL HEALTH INC	21.64	223	32,366	ヘルスケア
MICROSOFT CORP	54.65	2,053	297,148	情報技術
MEDTRONIC PLC	31.03	268	38,908	ヘルスケア
CENTERPOINT ENERGY INC	58.07	169	24,559	公益事業
CHUBB LTD	9.92	223	32,339	金融
PAYPAL HOLDINGS INC	18.93	115	16,721	金融
CLEVELAND-CLIFFS INC	66.76	124	18,043	素材
COMCAST CORP-CLASS A	66.93	289	41,912	コミュニケーション・サービス
アメリカ・ドル 通貨計	株数・金額 総額数<比率>	2,719.54 80銘柄	29,450 4,261,191 <73.9%>	
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル		
SUNCOR ENERGY INC	77.47	339	36,685	エネルギー
TC ENERGY CORP	35.47	188	20,323	エネルギー
AGNICO EAGLE MINES LTD	35.61	246	26,597	素材
カナダ・ドル 通貨計	株数・金額 総額数<比率>	148.55 3銘柄	773 83,606 <1.5%>	
ファンド合計	株数・金額 総額数<比率>	2,868.09 83銘柄	- 4,344,797 <75.4%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2024年1月10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) ハイブリッド優先証券

銘柄	2024年1月10日現在		
	証券数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千証券	千アメリカ・ドル	千円
SCE TRUST IV FR	2.828	62	9,108
SCE TRUST V 5.45 K	4.103	99	14,431
MORGAN STANLEY 5.85 K	6.644	162	23,456
AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	2.72	58	8,398
AT&T INC 5.35	3.943	94	13,732
BANK OF AMERICA CORP 6 GG	1.547	38	5,636
METLIFE INC 5.625 E	2.277	55	8,081
RENAISSANCE HOLDINGS I 5.75 F	4.265	102	14,767
BANK OF AMERICA CORP 5.875 HH	3.819	94	13,742
US BANCORP 5.5 K	7.158	167	24,193
JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	9.438	234	33,962
JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	1.545	39	5,678
CMS ENERGY CORP 5.875	12.484	309	44,850
NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.65 N	2.22	55	8,072
REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	0.985	21	3,044
ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.2 19-A	2.275	56	8,107
ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	1.1	26	3,827
BANK OF AMERICA CORP 5.375 KK	10.786	250	36,190
ALLSTATE CORP 5.1 H	6.377	143	20,788
ENSTAR GROUP LTD FR	3.906	98	14,196
SEMPRA 5.75	6.407	158	22,943
MORGAN STANLEY 4.875 L	2.561	56	8,244
AMERICAN FINANCIAL GROUP 5.125	4.604	102	14,785
BERKLEY (WR) CORPORATION 5.1	4.569	106	15,449
METLIFE INC 4.75 F	4.771	99	14,406
SOUTHERN CO 4.95 2020	9.007	206	29,928
WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	11.675	233	33,818
ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	8.166	202	29,313
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	6.948	144	20,839
UNITED STATES CELLULAR C 6.25	1.403	27	4,015
AMERICAN FINANCIAL GROUP 4.5	5.3	101	14,677
BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	3.167	55	8,023
WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA	13.966	280	40,536
BANK OF AMERICA CORP 4.375 NN	12.469	244	35,433
EQUITABLE HOLDINGS INC 4.3 C	8.593	142	20,639
BANK OF AMERICA CORP 4.125 PP	7.37	136	19,813
WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC	8.391	156	22,582
US BANCORP 4 M	7.954	141	20,462
JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ	12.443	257	37,303
CHARLES SCHWAB CORP 4.45 J	2.458	49	7,184
JPMORGAN CHASE & CO 4.625 LL	12.263	257	37,296
JPMORGAN CHASE AND CO DS REPTST T 4.2	8.177	157	22,846

銘柄	2024年1月10日現在		
	証券数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千証券	千アメリカ・ドル	千円
RENAISSANCE HOLDINGS LTD 4.2	0.961	16	2,401
BANK OF AMERICA CORP 4.75	5.718	120	17,374
US BANCORP 4.5	4.012	79	11,546
WESCO INTERNATIONAL INC FR	0.699	18	2,674
MORGAN STANLEY DEP REPTST SH NON 6.5	0.689	17	2,585
ARCH CAPITAL GROUP LTD. 4.55	0.342	6	998
RGAFR	2.712	70	10,253
LINCOLN NATIONAL CORPORATION 9	4.9	134	19,482
ATHENE HLDG LTD DEP SHR REPTST I	3.25	84	12,263
WR BERKLEY CORPORATION 4.125	3.226	63	9,251
ALLSTATE CORP 7.375	3.154	84	12,243
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC 7.625	6.428	175	25,400
SCE TRUST 7 7.5	11.053	287	41,644
F&G ANNUITIES & LIFE INC 7.95	3.815	99	14,418
FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I	1.499	37	5,487
MORGAN STANLEY 6.875 F	4.5	112	16,303
GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K	1.495	38	5,501
ALLSTATE CORP FR	1.482	37	5,422
MOMORGAN STANLEY FR	2.327	58	8,437
MORGAN STANLEY 6.375 I	8.993	222	32,230
CITIGROUP INC FR J	2.828	72	10,524
合計	証券数、金額 銘柄数<比率>	327.165 63銘柄	7,334 <18.4%>

(注1) 邦貨換算金額は、2024年1月10日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 外国投資証券

銘柄	2024年1月10日現在		
	□ 数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千□	千アメリカ・ドル	千円
DIGITALBRIDGE GROUP INC 7.125 J	7.569	176	25,539
PUBLIC STORAGE 4.625 L	5.992	128	18,588
PUBLIC STORAGE 3.9 O	7.8	136	19,761
合計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	21.361 3銘柄	441 <1.1%>

(注1) 邦貨換算金額は、2024年1月10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。

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の決算日（2023年10月16日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2024年1月10日）現在におけるダイワ欧州好配当株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。

■ダイワ欧州好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

買				付				売				付			
銘柄	柄	株数	金額	平均単価	銘柄	柄	株数	金額	平均単価	銘柄	柄	株数	金額	平均単価	
		千株	千円	円			千株	千円	円			千株	千円	円	
NOVO NORDISK A/S-B (デンマーク)		1.232	16,630	13,499	MUENCHENER RUECKVER AG-REG (ドイツ)		0.399	23,518	58,944	ZURICH INSURANCE GROUP AG (スイス)		0.211	15,652	74,181	
					AXA SA (フランス)		3.323	15,241	4,586	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG (ドイツ)		3.305	10,377	3,139	
					TOTALENERGIES SE (フランス)		1.075	9,957	9,262	INTESA SANPAOLO (イタリア)		23.195	9,704	418	
					NESTLE SA-REG (スイス)		0.167	2,905	17,397	SCHNEIDER ELECTRIC SE (フランス)		0.081	2,025	25,009	
					SIEMENS AG-REG (ドイツ)		0.084	1,920	22,862	NOVARTIS AG-REG (スイス)		0.132	1,907	14,447	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2024年1月10日現在におけるダイワ欧州好配当株マザーファンド（614,800千口）の内容です。

外国株式

銘柄	柄	2024年1月10日現在		業種等
		株数	評価額	
			外貨建金額	
(イギリス)	百株	千イギリス・ポンド	千円	
SHELL PLC	120.54	299	55,015	エネルギー
UNILEVER PLC	46.02	177	32,678	生活必需品
PRUDENTIAL PLC	152.13	128	23,670	金融
AVIVA PLC	316.77	137	25,267	金融
GSK	130.36	205	37,798	ヘルスケア
M&G PLC	704.74	159	29,338	金融
TESCO PLC	906.43	272	50,107	生活必需品
VODAFONE GROUP PLC	1,041.83	72	13,417	コミュニケーション・サービス
NATIONAL GRID PLC	183.18	196	36,191	公益事業
HSBC HOLDINGS PLC	444.84	282	51,922	金融
イギリス・ポンド 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,046.84 10銘柄	1,931 <20.4%>	355,407
(スイス)	百株	千スイス・フラン	千円	
SANDOZ GROUP AG	8.99	26	4,486	ヘルスケア
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	13.46	339	57,638	ヘルスケア
NESTLE SA-REG	57.18	565	95,923	生活必需品
ZURICH INSURANCE GROUP AG	7.42	325	55,297	金融
NOVARTIS AG-REG	44.98	409	69,592	ヘルスケア

銘柄	柄	2024年1月10日現在		業種等
		株数	評価額	
			外貨建金額	
GIVAUDAN-REG	百株	千スイス・フラン	千円	素材
	0.79	267	45,369	
スイス・フラン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	132.82 6銘柄	1,933 <18.8%>	328,308
(デンマーク)	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	12.32	890	18,895	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>	12.32 1銘柄	890 <1.1%>	18,895
(スウェーデン)	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ELECTROLUX AB-SER B	25.48	267	3,775	一般消費財・サービス
スウェーデン・クローネ 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	25.48 1銘柄	267 <0.2%>	3,775
ユーロ (オランダ)	百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	66.69	179	28,459	生活必需品
KONINKLIJKE DSM NV	18.45	210	33,288	素材
KONINKLIJKE KPN NV	901.14	281	44,493	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>	986.28 3銘柄	671 <6.1%>	106,241

銘柄	2024年1月10日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ（フランス）	百株	千ユーロ	千円	
TOTALENERGIES SE	55.7	334	52,976	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	88.35	279	44,223	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	27.84	484	76,599	資本財・サービス
BNP PARIBAS	40.89	256	40,514	金融
CAPGEMINI SE	17.93	330	52,333	情報技術
AXA SA	94.7	280	44,397	金融
SANOFI	39.9	379	60,085	ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	365.31 7銘柄	2,345 371,130	<21.3%>
ユーロ（ドイツ）	百株	千ユーロ	千円	
SIEMENS AG-REG	28.7	457	72,373	資本財・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	30.71	309	48,981	一般消費財・サービス
BASF SE	37.68	171	27,128	素材
ALLIANZ SE-REG	11.74	285	45,233	金融
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6.95	261	41,428	金融
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	190.03	427	67,671	コミュニケーション・サービス
DHL GROUP	61.08	273	43,236	資本財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	366.89 7銘柄	2,187 346,053	<19.8%>
ユーロ（スペイン）	百株	千ユーロ	千円	
ENAGAS SA	87.58	137	21,801	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	87.58 1銘柄	137 21,801	< 1.3%>
ユーロ（イタリア）	百株	千ユーロ	千円	
INTESA SANPAOLO	828.89	228	36,152	金融
ENI SPA	132.57	197	31,299	エネルギー
ENEL SPA	493.5	330	52,300	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	1,454.96 3銘柄	756 119,752	< 6.9%>
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,261.02 21銘柄	6,099 964,978	<55.3%>
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	7,478.48 39銘柄	- 1,671,365	<95.8%>

(注1) 邦貨換算金額は、2024年1月10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。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の決算日（2023年10月16日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2024年1月10日）現在におけるダイワ・アジア・オセアニア好配当株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・アジア・オセアニア好配当株マザーファンドの主要な売買銘柄

株 式

(2023年1月11日から2024年1月10日まで)

買 付				売 付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
MEDIATEK INC (台湾)	8	26,382	3,297	UNITED OVERSEAS BANK LTD (シンガポール)	10.5	31,829	3,031
ASIA CEMENT CORP (台湾)	86	16,325	189	QUANTA COMPUTER INC (台湾)	25	26,073	1,042
ANZ GROUP HOLDINGS LTD (オーストラリア)	7.8	16,292	2,088	MEDIATEK INC (台湾)	7	22,530	3,218
BHP GROUP LTD (オーストラリア)	3.95	15,942	4,036	CHAILEASE HOLDING CO LTD (ケイマン諸島)	22	21,057	957
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP (シンガポール)	12	15,736	1,311	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	8	20,646	2,580
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD (韓国)	2.13	14,455	6,786	CAPITALAND INVESTMENT LTD (シンガポール)	42.8	16,039	374
QUANTA COMPUTER INC (台湾)	32	13,362	417	SHENG SIONG GROUP LTD (シンガポール)	93.5	15,935	170
SUN HUNG KAI PROPERTIES (香港)	6	11,254	1,875	CHINA RESOURCES BEER HOLDING (香港)	14	15,340	1,095
KT&G CORP (韓国)	1.3	10,862	8,355	AIA GROUP LTD (香港)	9	12,667	1,407
LG CORP (韓国)	1.2	10,285	8,570	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT (台湾)	134	12,589	93

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2024年1月10日現在におけるダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド（195,040千口）の内容です。

外国株式

銘柄	2024年1月10日現在			業 種 等
	株数	評価額	業 種 等	
(オーストラリア)	百株	千円		
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	65.5	169	16,415	金融
BHP GROUP LTD	86.9	425	41,193	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	37.78	117	11,373	エネルギー
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	63	194	18,844	金融
WESTPAC BANKING CORP	70	161	15,652	金融
RIO TINTO LTD	12.2	160	15,576	素材
ORIGIN ENERGY LTD	90	75	7,335	公益事業
SEEK LTD	28	72	7,060	コミュニケーション・サービス
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	26.9	304	29,429	金融
MACQUARIE GROUP LTD	9.2	165	15,986	金融
CSL LTD	8	232	22,465	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	36.8	209	20,258	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 534.28 12銘柄	2,289	221,591	<32.3%>
(香港)	百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	80	356	6,604	公益事業
SUN HUNG KAI PROPERTIES	45	356	6,605	不動産

銘柄	2024年1月10日現在			業 種 等
	株数	評価額	業 種 等	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	29	711	13,162	金融
AIA GROUP LTD	196	1,246	23,073	金融
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	25	215	3,981	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	270	542	10,045	金融
香港・ドル 通貨計	株数、金額 645 6銘柄	3,429	63,472	<9.2%>
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	50	164	17,868	金融
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	111	142	15,543	金融
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	598	142	15,538	コミュニケーション・サービス
シンガポール・ドル 通貨計	株数、金額 759 3銘柄	450	48,950	<7.1%>
(台湾)	百株	千台湾ドル	千円	
ASIA CEMENT CORP	710	2,911	13,564	素材
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	180	2,277	10,609	情報技術
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	270	1,641	7,649	素材
DELTA ELECTRONICS INC	70	2,068	9,638	情報技術

銘柄	2024年1月10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		
ACCTON TECHNOLOGY CORP	10	516	2,404	情報技術	
QUANTA COMPUTER INC	70	1,512	7,045	情報技術	
MEDIATEK INC	40	3,712	17,296	情報技術	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	90	1,363	6,353	資本財・サービス	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	40	2,000	9,319	情報技術	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	60	975	4,543	情報技術	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	220	12,892	60,071	情報技術	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	340	3,434	16,001	情報技術	
ASUSTEK COMPUTER INC	60	2,730	12,720	情報技術	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	520	2,605	12,139	情報技術	
台湾ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,680 14銘柄	40,637	189,355 <27.6%>	
(韓国)	百株	千韓国ウォン	千円		
KIA CORP	10.4	92,664	10,155	一般消費財・サービス	
SK HYNIX INC	12	164,880	18,070	情報技術	
LG CORP	9	71,550	7,841	資本財・サービス	
POSCO	1.4	64,470	7,065	素材	
SAMSUNG SDS CO LTD	6.4	107,648	11,798	情報技術	
KT&G CORP	13	117,780	12,908	生活必需品	
NAVER CORP	2.5	57,375	6,288	コミュニケーション・サービス	
LG CHEM LTD	1.65	77,797	8,526	素材	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	76.3	569,961	62,467	情報技術	
SK INNOVATION CO LTD	2.9	38,164	4,182	エネルギー	
韓国ウォン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	135.55 10銘柄	1,362,289	149,306 <21.7%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	4,753.83 45銘柄	—	672,677 <98.0%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2024年1月10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。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

<補足情報>

当ファンド（DCダイワ・ワールドアセット）が投資対象としている「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の決算日（2023年10月16日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2024年1月10日）現在におけるダイワ好配当日本株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。

■ダイワ好配当日本株マザーファンドの主要な売買銘柄 株 式

（2023年1月11日から2024年1月10日まで）

買		付			売		付		
銘柄	柄	株数	金額	平均単価	銘柄	柄	株数	金額	平均単価
		千株	千円	円			千株	千円	円
トヨタ自動車		567.5	1,164,761	2,052	伊藤忠		150.8	739,556	4,904
三井住友フィナンシャルG		136.2	912,241	6,697	第一生命HLDGS		229.8	660,676	2,875
三菱UFJフィナンシャルG		717	800,917	1,117	AGC		127.5	649,661	5,095
三菱商事		130.6	775,340	5,936	関西電力		264.6	526,218	1,988
住友電工		429.5	723,764	1,685	三菱UFJフィナンシャルG		480.8	500,508	1,040
大東建託		43	702,515	16,337	信越化学		97.9	452,290	4,619
本田技研		193.6	646,910	3,341	デンソー		167.4	438,522	2,619
日本郵船		160.8	643,253	4,000	アサヒグループホールディング		75	411,512	5,486
SANKYO		79.6	608,174	7,640	東レ		538.2	401,621	746
東京海上HD		177.3	569,629	3,212	豊田合成		158.5	398,536	2,514

（注1）金額は受渡し代金。

（注2）金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2024年1月10日現在におけるダイワ好配当日本株マザーファンド（6,963,731千口）の内容です。

国内株式

銘柄	柄	2024年1月10日現在			銘柄	柄	2024年1月10日現在			銘柄	柄	2024年1月10日現在		
		株数	評価額	金額			株数	評価額	金額			株数	評価額	金額
		千株	千円	千円			千株	千円	千円			千株	千円	千円
水産・農林業 (0.5%)					トクヤマ		81.5	201,916		住友電工		429.5	804,668	
ニッセイ		203.6	161,699		東亜合成		47.6	64,450		フジクラ		340.5	379,998	
鉱業 (0.3%)					三井化学		75.6	326,289		SWCC		32.9	95,048	
INPEX		45.7	89,160		リケンテクノス		72.9	62,256		金属製品 (2.0%)				
建設業 (3.1%)					花王		46.2	275,444		SUMCO		152.7	321,967	
鹿島建設		175	439,687		富士フィルムHLDGS		62.9	554,966		日東精工		93.2	51,166	
五洋建設		130.5	109,620		信越ポリマー		89.7	146,838		マルゼン		35.4	96,571	
住友林業		75.4	325,577		医薬品 (2.2%)					日本発条		145.9	176,320	
九電工		6.6	34,445		アステラス製薬		294.5	519,203		機械 (8.0%)				
大気社		23.5	99,522		サワイグループHD		31.8	174,518		芝浦機械		96.3	342,346	
食料品 (1.1%)					石油・石炭製品 (0.4%)					小松製作所		209.6	806,960	
コカ・コーラボトラーズJHD		61.7	125,220		コスモエネルギーHLDGS		19.6	119,050		SANKYO		79.6	689,893	
日清オイリオグループ		53.2	238,336		ゴム製品 (1.0%)					三菱重工業		83.8	740,037	
繊維製品 (1.3%)					TOYO TIRE		139.4	336,302		電気機器 (8.0%)				
グンゼ		65.4	334,194		鉄鋼 (2.7%)					日立		106.6	1,129,960	
セーレン		34.7	86,298		日本製鉄		138.4	461,979		富士電機		21.9	135,867	
パルプ・紙 (0.3%)					中部鋼板		22.8	55,746		ダイヘン		69.5	450,360	
レンゴー		94.9	91,331		大同特殊鋼		227	341,294		堀場製作所		16	178,160	
化学 (6.0%)					非鉄金属 (4.9%)					芝浦電子		10.3	57,680	
共和レザー		74.7	57,967		大紀アルミニウム		96.7	117,877		東京エレクトロン		23.9	606,701	
日本曹達		39.9	227,031		UACJ		47.5	179,550		輸送用機器 (9.4%)				
										いすゞ自動車		287	556,206	

銘柄	2024年1月10日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
トヨタ自動車	623.8	1,712,331
プレス工業	168	100,464
本田技研	423.4	649,283
その他製品 (1.2%)		
大日本印刷	87.8	369,901
電気・ガス業 (1.6%)		
大阪瓦斯	166.4	524,659
陸運業 (2.1%)		
鴻池運輸	2	3,892
センコーグループHLDGS	145.5	168,052
セイノーホールディングス	76.8	168,499
九州旅客鉄道	103.8	334,443
海運業 (2.3%)		
日本郵船	160.8	745,629
倉庫・運輸関連業 (2.4%)		
渋沢倉庫	23.7	72,877
上組	196.6	681,415
情報・通信業 (7.3%)		
BIPROGY	93.4	415,163
日本電信電話	6,530.1	1,155,174
KDDI	94.7	440,828
光通信	13.4	333,258
卸売業 (9.0%)		
エレマテック	32.2	58,282
ダイワボウHD	247	769,158
レスターホールディングス	16.5	47,322
三洋貿易	76.8	95,078
萩原電気HLDGS	26.8	129,712
グイトロン	53.2	150,236
豊田通商	38.7	349,964
三菱商事	487.5	1,134,168
阪和興業	27.7	142,101
小売業 (2.5%)		
アダストリア	28.1	93,994
パルグループHLDGS	95.6	220,931
丸井グループ	194.2	486,276
銀行業 (9.9%)		
三菱UFJフィナンシャルG	1,103.9	1,390,914
三井住友トラストHD	185.4	526,165
三井住友フィナンシャルG	131.2	934,668
ふくおかフィナンシャルG	44.4	151,093
山陰合同銀行	165.5	167,155
証券・商品先物取引業 (0.1%)		
SBIホールディングス	10.4	35,204
保険業 (4.8%)		
東京海上HD	399.8	1,436,081
T&Dホールディングス	41.8	96,955
その他金融業 (0.7%)		
オリックス	84.2	232,434
不動産業 (3.7%)		
大東建託	43	700,255
東急不動産HD	387.4	377,327

銘柄	2024年1月10日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
AND DOホールディングス	58.2	62,274
東京建物	21.7	48,195
サービス業 (1.3%)		
日本空調サービス	86.3	71,629
ベルシステム24HLDGS	191	335,205
合計	18,002.2	32,096,346
銘柄数<比率>	91銘柄	<94.5%>

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

(2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2024年1月10日現在	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
TOPIX	415	-

(注) 単位未満は切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第24期 (決算日 2023年11月30日)

(作成対象期間 2022年12月1日～2023年11月30日)

外国債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

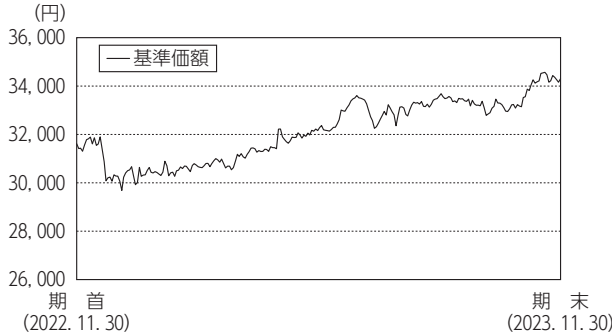
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：31,615円 期末：34,304円 騰落率：8.5%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外債券市況

主要国の国債金利は上昇しました。

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

○為替相場

為替相場は円安となりました。

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は9.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は8.5%となりました。

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

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

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	%	円	%		
(期首) 2022年11月30日	31,615	—	31,857	—	98.1	—
12月末	30,067	△ 4.9	30,508	△ 4.2	98.1	—
2023年1月末	30,422	△ 3.8	30,754	△ 3.5	97.9	—
2月末	30,793	△ 2.6	31,063	△ 2.5	97.9	—
3月末	31,180	△ 1.4	31,326	△ 1.7	97.7	—
4月末	31,408	△ 0.7	31,717	△ 0.4	97.6	—
5月末	32,222	1.9	32,574	2.3	97.7	—
6月末	33,512	6.0	33,818	6.2	97.5	—
7月末	32,788	3.7	32,998	3.6	97.5	—
8月末	33,682	6.5	33,966	6.6	97.5	—
9月末	33,183	5.0	33,500	5.2	97.5	—
10月末	33,143	4.8	33,410	4.9	97.3	—
(期末) 2023年11月30日	34,304	8.5	34,765	9.1	97.0	—

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

外国債券インデックスマザーファンド

《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、ベンチマークに運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)	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

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカ・ドル 219,648	千アメリカ・ドル 173,686 (—)
	カナダ	千カナダ・ドル 11,254	千カナダ・ドル 10,478 (—)
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 5,034	千オーストラリア・ドル 569 (—)
	シンガポール	千シンガポール・ドル 1,033	千シンガポール・ドル 1,396 (—)
	ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 2,295	千ニュージーランド・ドル 669 (—)
	イギリス	千イギリス・ポンド 17,677	千イギリス・ポンド 4,067 (—)
	イスラエル	千イスラエル・シケル 3,504	千イスラエル・シケル 3,458 (—)
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 1,907	千デンマーク・クローネ 4,812 (—)

		買付額	売付額
外	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 4,825	千ノルウェー・クローネ 5,868 (—)
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 1,835	千スウェーデン・クローネ 9,190 (—)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 54,466	千メキシコ・ペソ 50,442 (—)
	中国	千オフショア・人民元 598,197	千オフショア・人民元 85,651 (—)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 5,716	千マレーシア・リンギット 3,027 (—)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 4,388	千ポーランド・ズロチ 7,038 (—)
	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 199	千ユーロ 609 (—)
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 3,266	千ユーロ 2,858 (—)
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 3,549	千ユーロ 2,512 (—)
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 19,169	千ユーロ 12,379 (—)
国	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 20,353	千ユーロ 16,407 (—)
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 12,476	千ユーロ 8,133 (—)
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 19,389	千ユーロ 16,094 (—)
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 2,553	千ユーロ 1,147 (—)
	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 3,526	千ユーロ 1,689 (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 84,483	千ユーロ 61,832 (—)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国(外貨建)公社債(通貨別)

区 分	額 面 金 額	当 期			組入比率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
		評 価 額		%			%	%	%	%
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額							
アメリカ	千アメリカ・ドル 1,018,352	千アメリカ・ドル 898,347	千円 132,119,911	46.6	—	19.6	17.7	9.3		
カナダ	千カナダ・ドル 50,893	千カナダ・ドル 46,522	5,034,152	1.8	—	1.1	0.4	0.3		
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 46,861	千オーストラリア・ドル 41,660	4,059,779	1.4	—	0.9	0.3	0.2		
シンガポール	千シンガポール・ドル 10,436	千シンガポール・ドル 10,003	1,104,228	0.4	—	0.2	0.1	0.0		
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 7,830	千ニュージーランド・ドル 6,743	611,648	0.2	—	0.1	0.1	0.0		
イギリス	千イギリス・ポンド 90,238	千イギリス・ポンド 73,673	13,765,099	4.9	—	3.6	0.9	0.4		
イスラエル	千イスラエル・シェケル 21,800	千イスラエル・シェケル 20,291	809,921	0.3	—	0.2	0.1	0.1		
デンマーク	千デンマーク・クローネ 40,365	千デンマーク・クローネ 39,919	864,665	0.3	—	0.2	0.0	0.1		
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 36,535	千ノルウェー・クローネ 34,079	470,635	0.2	—	0.1	0.1	0.0		
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 40,180	千スウェーデン・クローネ 38,137	541,938	0.2	—	0.1	0.1	0.0		
メキシコ	千メキシコ・ペソ 299,902	千メキシコ・ペソ 276,497	2,353,161	0.8	—	0.5	0.2	0.1		
中国	千オフショア・人民元 894,500	千オフショア・人民元 904,995	18,643,275	6.6	—	3.1	2.2	1.2		
マレーシア	千マレーシア・リンギット 41,846	千マレーシア・リンギット 42,382	1,338,933	0.5	—	0.3	0.1	0.0		
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 35,455	千ポーランド・ズロチ 32,266	1,199,821	0.4	—	0.1	0.2	0.1		

外国債券インデックスマザーファンド

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

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

		当 期				末		償還年月日
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	880	129,448	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	755	111,078	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	769	113,226	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	791	116,439	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	2,559	376,382	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,204	177,148	2036/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	905	133,136	2037/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	547	80,496	2038/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	523	76,984	2038/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	936	137,745	2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,090	160,336	2039/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,058	155,738	2039/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,189	174,915	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,020	150,136	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	1,643	241,642	2040/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,001	147,312	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,411	207,587	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,279	188,210	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,329	195,535	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,361	200,174	2041/08/15	

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

外国債券インデックスマザーファンド

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

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

外国債券インデックスマザーファンド

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

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

外国債券インデックスマザーファンド

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

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

外国債券インデックスマザーファンド

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

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

外国債券インデックスマザーファンド

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

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

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3000	7,000	6,973	143,666	2026/05/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	40,000	39,894	821,832	2033/05/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	9,000	8,938	184,141	2025/06/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	33,000	32,888	677,515	2030/06/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	35,000	34,750	715,865	2028/07/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5200	40,000	39,384	811,334	2033/08/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	30,000	29,766	613,191	2026/08/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	25,000	24,885	512,656	2028/09/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2200	30,000	29,883	615,620	2025/09/25
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	20,000	19,916	410,277	2030/09/15
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	20,000	19,985	411,711	2028/10/15
通貨小計	銘柄数 金 額	64銘柄			894,500	904,995	18,643,275	
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,358	74,525	2027/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,220	38,544	2030/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,540	48,681	2026/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,325	41,880	2031/06/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	736	23,263	2027/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,414	44,701	2033/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,885	59,563	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	1,300	1,419	44,843	2043/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,750	55,316	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,239	39,172	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	981	30,992	2046/03/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,550	1,563	49,388	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,198	37,872	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,950	2,079	65,696	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,208	38,174	2025/03/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,278	40,401	2033/11/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	2,000	2,187	69,096	2038/06/08
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	656	20,741	2026/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,310	2,310	72,978	2029/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,303	41,176	2048/07/06
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,279	40,427	2034/07/05
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,651	52,165	2040/05/22
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	2,650	2,528	79,878	2050/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,800	1,650	52,156	2031/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	1,400	1,363	43,066	2032/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	1,900	2,021	63,874	2042/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5040	500	516	16,301	2029/04/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4570	700	715	22,614	2053/03/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5190	1,000	995	31,437	2028/04/20
通貨小計	銘柄数 金 額	29銘柄			41,846	42,382	1,338,933	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,377	4,083	151,845	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	2,886	107,341	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840	4,237	157,559	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.7500	2,000	1,880	69,911	2025/04/25

		当 期			末			
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円		
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,316	86,133	2030/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	2,200	1,911	71,096	2026/10/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	1,362	50,646	2032/04/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	500	476	17,724	2027/05/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	1,000	1,087	40,442	2028/07/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,361	50,625	2025/10/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,000	2,078	77,288	2033/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	841	31,303	2029/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,650	3,298	122,667	2028/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,591	4,443	165,234	2025/07/25	
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金 額			35,455	32,266	1,199,821		
				千ユーロ	千ユーロ			
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	1,031	1,060	171,252	2025/03/13	
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	961	943	152,435	2030/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	931	744	120,173	2045/02/18	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,028	166,148	2026/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	464	74,980	2037/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	742	119,965	2028/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	750	655	105,828	2033/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	750	683	110,348	2031/03/18	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	950	875	141,377	2029/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	600	407	65,759	2050/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	350	264	42,646	2035/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	500	459	74,272	2027/05/15	
	IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	674	108,985	2030/10/18	
	IRISH TREASURY	国債証券	—	800	646	104,443	2031/10/18	
	IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	400	260	42,063	2041/04/22	
	IRISH TREASURY	国債証券	0.3500	100	80	13,079	2032/10/18	
	IRISH TREASURY	国債証券	3.0000	200	195	31,543	2043/10/18	
国小計	銘柄数	17銘柄						
	金 額			11,546	10,187	1,645,306		
				千ユーロ	千ユーロ			
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,139	1,266	204,478	2028/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,755	1,965	317,452	2037/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,729	1,924	310,861	2042/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,468	1,443	233,099	2033/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,929	1,882	304,078	2047/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,715	276,996	2025/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,938	1,830	295,637	2026/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,061	332,918	2027/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,244	200,972	2028/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,056	170,630	2029/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	624	100,806	2040/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,181	190,874	2030/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	737	119,106	2027/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,250	572	92,418	2052/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,066	172,182	2031/07/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	598	96,688	2038/01/15	
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	790	127,697	2029/01/15	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		当 期			末			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
銘柄数		23銘柄			千ユーロ	千円		
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	94	15,222	2026/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	600	500	80,785	2032/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	900	739	119,461	2054/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	900	880	142,277	2033/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,300	1,292	208,738	2030/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	600	628	101,582	2044/01/15
国 小 計	金 額				28,349	26,097	4,214,970	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (ベルギー)		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,699	1,640	264,883	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	1,551	250,586	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	883	142,703	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,463	1,398	225,795	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	863	139,405	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	740	531	85,832	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,100	1,029	166,253	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	580	435	70,310	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	600	480	77,620	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,490	1,372	221,681	2028/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	650	559	90,384	2033/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,362	220,109	2029/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	700	478	77,256	2050/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,026	165,838	2030/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	860	534	86,287	2040/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,081	174,725	2027/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,600	1,277	206,283	2031/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	530	208	33,666	2071/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,400	1,127	182,021	2032/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	800	487	78,708	2053/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	370	59,826	2039/04/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,500	1,496	241,649	2033/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3000	600	564	91,181	2054/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	700	693	111,995	2043/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	1,902	307,228	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,904	2,232	360,641	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	1,774	286,571	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,037	167,507	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	842	136,054	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	643	665	107,486	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	740	119,581	2034/06/22
国 小 計	銘柄数	31銘柄						
	金 額				33,793	30,648	4,950,081	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (フランス)		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	3,194	515,868	2025/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	3,780	610,558	2029/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,227	3,941	636,517	2032/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	3,080	497,523	2035/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,764	1,923	310,730	2055/04/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	2,581	416,893	2038/10/25
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,164	3,647	589,131	2041/04/25

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

外国債券インデックスマザーファンド

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

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

外国債券インデックスマザーファンド

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

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

外国債券インデックスマザーファンド

区 分		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	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	千ユーロ 2,318	千ユーロ 2,300	千円 371,576	2030/03/01
国 小 計	銘柄数 金 額	89銘柄			138,576	129,521	20,918,985	
ユーロ (フィンランド)		Finland Government Bond	国債証券	0.7500	千ユーロ 364	千ユーロ 314	50,820	2031/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	268	43,442	2025/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	768	124,195	2026/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	254	41,044	2047/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	738	119,255	2027/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	1.1250	470	391	63,299	2034/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	451	72,856	2028/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	441	71,285	2029/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	214	34,705	2036/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	247	39,971	2040/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	—	500	414	67,006	2030/09/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	177	28,717	2052/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	486	78,646	2031/09/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	185	29,913	2026/09/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	400	274	44,255	2043/04/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	850	713	115,252	2032/09/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	270	258	41,726	2027/04/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	377	61,029	2038/04/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	300	300	48,553	2033/09/15
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8750	1,000	1,007	162,743	2029/04/15
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	676	109,250	2025/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	390	63,062	2028/07/04
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	373	60,342	2042/07/04
国 小 計	銘柄数 金 額	23銘柄			11,177	9,729	1,571,376	
ユーロ (オーストリア)		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	千ユーロ 1,373	千ユーロ 1,329	214,783	2025/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,062	171,656	2026/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	559	90,389	2047/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	135	21,940	2086/11/02
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,187	191,831	2027/04/20
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	378	61,078	2117/09/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	1,106	178,760	2028/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,141	184,374	2029/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	980	824	133,184	2030/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	664	107,342	2051/03/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	234	37,866	2040/10/20
		Austria Government Bond	国債証券	0.8500	350	150	24,252	2120/06/30
		Austria Government Bond	国債証券	—	1,200	978	157,972	2031/02/20
		Austria Government Bond	国債証券	—	480	460	74,302	2025/04/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	416	67,293	2036/10/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	300	128	20,701	2071/04/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	262	42,433	2028/10/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,500	1,280	206,775	2032/02/20
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	226	36,660	2049/05/23
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	293	47,473	2026/07/15

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	300	298	48,149	2033/02/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1500	300	290	46,995	2053/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,000	1,009	162,976	2029/05/23
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	800	829	134,014	2030/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	923	149,125	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,373	1,514	244,538	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	912	147,378	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	374	60,493	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	723	712	114,996	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	728	117,613	2034/05/23
国 小 計	銘柄数	30銘柄					
	金 額			23,038	20,415	3,297,356	
通 貨 小 計	銘柄数	375銘柄					
	金 額			617,102	568,392	91,801,136	
合 計	銘柄数	974銘柄					
	金 額					274,718,308	

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

■投資信託財産の構成

2023年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	274,718,308	96.9
コール・ローン等、その他	8,689,892	3.1
投資信託財産総額	283,408,201	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=147.07円、1カナダ・ドル=108.21円、1オーストラリア・ドル=97.45円、1シンガポール・ドル=110.38円、1ニュージーランド・ドル=90.70円、1イギリス・ポンド=186.84円、1イスラエル・シェケル=39.913円、1デンマーク・クローネ=21.66円、1ノルウェー・クローネ=13.81円、1スウェーデン・クローネ=14.21円、1メキシコ・ペソ=8.51円、1オフショア・人民元=20.60円、1マレーシア・リンギット=31.591円、1ポーランド・ズロチ=37.184円、1ユーロ=161.51円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産(281,210,137千円)の投資信託財産総額(283,408,201千円)に対する比率は、99.2%です。

外国債券インデックスマザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年11月30日現在

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

* 期首における元本額は76,340,507,617円、当作成期間中における追加設定元本額は11,600,344,011円、同解約元本額は5,345,172,874円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワ外国債券インデックスVA	391,220,587円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募）	7,319,300円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募）	40,271,896円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）	15,003,665円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）	206,248,674円
外国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	566,369,227円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	804,205,846円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし）	3,747,848,437円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	850,255,984円
D-1's 外国債券インデックス	2,616,753円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	19,605,277円
iFree 外国債券インデックス	2,159,651,283円
iFree 8資産バランス	2,274,181,036円
iFree 年金バランス	497,028,931円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	317,728円
DCダイワ外国債券インデックス	51,424,951,579円
ダイワ・ライフ・バランス30	1,152,680,509円
ダイワ・ライフ・バランス50	811,578,029円
ダイワ・ライフ・バランス70	624,049,099円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	691,231,526円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	546,358,716円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	218,171,346円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	36,831,686円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	18,569,302円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,946,640,644円
ダイワつみたてインデックスバランス30	4,601,402円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,919,154円
ダイワつみたてインデックスバランス70	3,291,011円
ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ラップ専用）	1,093,939,740円
ダイワ世界バランスファンド40VA	93,247,794円
ダイワ世界バランスファンド60VA	25,462,305円
ダイワ・バランスファンド35VA	2,826,420,113円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	174,572,917円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	160,388,033円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	66,632,761円
ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジなし）（ダイワSMA専用）	3,178,053,407円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,811,265,010円

ダイワライフスタイル25

26,830,233円

ダイワライフスタイル50

59,333,757円

ダイワライフスタイル75

16,514,057円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は34,304円です。

■損益の状況

当期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日

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

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

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

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

運用報告書 第19期（決算日 2023年11月30日）

（作成対象期間 2022年12月1日～2023年11月30日）

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）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。

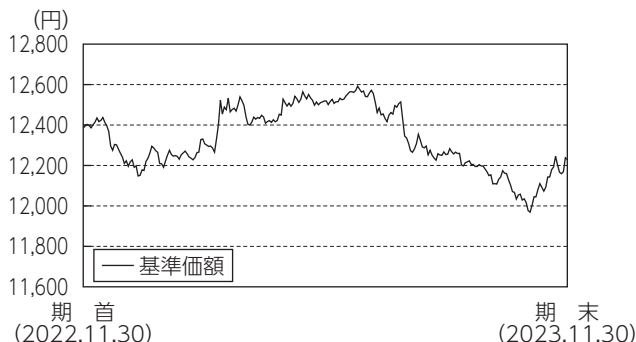
運用方針	投資成果をNOMURA-BPI総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
株式組入制限	純資産総額の10%以下

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		NOMURA-BPI 総 合 指 数		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首)2022年11月30日	12,385	-	12,408	-	99.1	-
12月末	12,223	△1.3	12,250	△1.3	99.4	-
2023年 1 月末	12,191	△1.6	12,217	△1.5	99.3	-
2 月末	12,328	△0.5	12,350	△0.5	99.1	-
3 月末	12,497	0.9	12,522	0.9	99.4	-
4 月末	12,528	1.2	12,551	1.2	99.5	-
5 月末	12,514	1.0	12,540	1.1	99.8	-
6 月末	12,541	1.3	12,574	1.3	99.3	-
7 月末	12,345	△0.3	12,378	△0.2	99.2	-
8 月末	12,256	△1.0	12,289	△1.0	99.3	-
9 月末	12,169	△1.7	12,201	△1.7	99.2	-
10 月末	11,977	△3.3	12,007	△3.2	99.4	-
(期末)2023年11月30日	12,229	△1.3	12,260	△1.2	99.1	-

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) NOMURA-BPI 総合指数は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。
 (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：12,385円 期末：12,229円 騰落率：△1.3%

【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」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇基調で推移しました。

国内長期金利は、当作成期首より2023年2月にかけて、日銀が長期金利の変動許容幅を拡大したことにより上昇し、0.4%から0.5%前後で推移しました。3月は欧米の金融不安の高まりを受け

て金利は低下しましたが、4月から6月にかけては欧米の金融不安が落ち着いたことで上昇し、0.4%から0.5%前後で推移しました。7月から8月にかけては、日銀が金融政策決定会合で長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)の運用を柔軟化することを決定したことなどから長期金利は上昇し、0.6%前後で推移しました。9月から10月にかけては、米国金利の上昇を受けて国内金利も上昇し、0.7%から1.0%前後で推移しました。当作成期末にかけては、米国で利上げサイクルの終了が意識されたことにより、金利は低下基調で推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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ってまいります。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パース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、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、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は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99%前後の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、ファンドへの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニパース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△1.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△1.3%となりました。当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差は△0.1%程度で、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。金利や信用スプレッド(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NOMURA-BPI 総合指数です。

《今後の運用方針》

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ってまいります。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パース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、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、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	-円
有価証券取引税	-
その他費用	-
合計	-

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況
公社債

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	15,804,275	8,375,812 (-)
	地方債証券	1,641,256	(-)
内	特殊債券	608,675	100,523 (3,336)
	社債券	2,497,020	363,218 (-)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債券(転換社債券)は含まれておりません。

(注4) 単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄
公社債

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

		当期			
		買付		売付	
		金額	銘柄	金額	銘柄
		千円		千円	
369	10年国債 0.5% 2032/12/20	653,004	139 5年国債 0.1% 2024/3/20	640,972	
156	5年国債 0.2% 2027/12/20	602,022	141 5年国債 0.1% 2024/9/20	621,066	
370	10年国債 0.5% 2033/3/20	549,825	138 5年国債 0.1% 2023/12/20	561,080	
371	10年国債 0.4% 2033/6/20	469,550	140 5年国債 0.1% 2024/6/20	471,066	
149	5年国債 0.005% 2026/9/20	429,643	351 10年国債 0.1% 2028/6/20	469,877	
158	5年国債 0.1% 2028/3/20	429,374	439 2年国債 0.005% 2024/8/1	390,454	
446	2年国債 0.005% 2025/3/1	400,415	334 10年国債 0.6% 2024/6/20	322,403	
347	10年国債 0.1% 2027/6/20	399,144	149 5年国債 0.005% 2026/9/20	259,657	
154	5年国債 0.1% 2027/9/20	379,693	433 2年国債 0.005% 2024/2/1	250,142	
145	5年国債 0.1% 2025/9/20	361,092	145 20年国債 1.7% 2033/6/20	224,370	

(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) 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BIB格以下組入比率	残存期間別組入比率	5年以上	2年以上	2年未満	
区分	千円	千円	%	%	%	%	%	%	
国債証券	46,261,000	45,033,250	84.7	-	54.8	19.7	10.2		
地方債証券	3,034,160	3,067,174	5.8	-	3.5	1.1	1.1		
特殊債券(除く金融債券)	1,189,084	1,216,626	2.3	-	1.5	0.4	0.4		
普通社債券	3,400,000	3,365,723	6.3	-	1.8	4.3	0.2		
合計	53,884,244	52,682,775	99.1	-	61.7	25.5	11.9		

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

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

区分	当			期			末		
	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	142 5年国債	0.1000	320,000	320,419	2024/12/20				
	337 10年国債	0.3000	550,000	551,881	2024/12/20				
	444 2年国債	0.0050	170,000	170,073	2025/01/01				
	445 2年国債	0.0050	110,000	110,044	2025/02/01				
	446 2年国債	0.0050	400,000	400,148	2025/03/01				
	143 5年国債	0.1000	900,000	901,458	2025/03/20				
	338 10年国債	0.4000	80,000	80,441	2025/03/20				
	75 20年国債	2.1000	14,000	14,386	2025/03/20				
	76 20年国債	1.9000	25,000	25,625	2025/03/20				
	447 2年国債	0.0050	90,000	90,029	2025/04/01				
	448 2年国債	0.0050	70,000	70,014	2025/05/01				
	449 2年国債	0.0050	300,000	300,021	2025/06/01				
	144 5年国債	0.1000	650,000	651,105	2025/06/20				
	339 10年国債	0.4000	165,000	166,047	2025/06/20				
	78 20年国債	1.9000	17,000	17,503	2025/06/20				
	79 20年国債	2.0000	14,000	14,436	2025/06/20				
	451 2年国債	0.0050	20,000	20,003	2025/08/01				
	452 2年国債	0.0050	110,000	110,000	2025/09/01				
	145 5年国債	0.1000	1,070,000	1,071,829	2025/09/20				
	340 10年国債	0.4000	190,000	191,352	2025/09/20				
	81 20年国債	2.0000	65,000	67,337	2025/09/20				
	82 20年国債	2.1000	28,000	29,057	2025/09/20				
	453 2年国債	0.0050	60,000	59,977	2025/10/01				
	146 5年国債	0.1000	540,000	540,826	2025/12/20				
341 10年国債	0.3000	15,000	15,084	2025/12/20					
147 5年国債	0.0050	800,000	799,352	2026/03/20					
342 10年国債	0.1000	140,000	140,191	2026/03/20					
85 20年国債	2.1000	31,000	32,466	2026/03/20					
86 20年国債	2.3000	6,000	6,311	2026/03/20					
87 20年国債	2.2000	35,000	36,736	2026/03/20					
148 5年国債	0.0050	500,000	499,360	2026/06/20					
343 10年国債	0.1000	300,000	300,342	2026/06/20					
88 20年国債	2.3000	33,000	34,886	2026/06/20					
89 20年国債	2.2000	15,000	15,819	2026/06/20					

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

区 分	当 期	年 率	期 末		償還年月日
			額 面 金 額	評 価 額	
銘 柄	年 率	%	千 円	千 円	
149	5年国債	0.0050	620,000	618,958	2026/09/20
344	10年国債	0.1000	90,000	90,087	2026/09/20
150	5年国債	0.0050	500,000	498,780	2026/12/20
345	10年国債	0.1000	410,000	410,184	2026/12/20
92	20年国債	2.1000	60,000	63,690	2026/12/20
151	5年国債	0.0050	450,000	448,519	2027/03/20
152	5年国債	0.1000	150,000	149,974	2027/03/20
346	10年国債	0.1000	250,000	249,957	2027/03/20
93	20年国債	2.0000	18,000	19,124	2027/03/20
94	20年国債	2.1000	45,000	47,958	2027/03/20
1	フィリピン共和国	0.7600	100,000	98,830	2027/04/22
153	5年国債	0.0050	270,000	268,852	2027/06/20
347	10年国債	0.1000	690,000	689,385	2027/06/20
95	20年国債	2.3000	30,000	32,312	2027/06/20
96	20年国債	2.1000	63,000	67,410	2027/06/20
154	5年国債	0.1000	520,000	519,110	2027/09/20
348	10年国債	0.1000	430,000	429,264	2027/09/20
97	20年国債	2.2000	25,000	26,948	2027/09/20
98	20年国債	2.1000	64,000	68,744	2027/09/20
155	5年国債	0.3000	90,000	90,470	2027/12/20
156	5年国債	0.2000	600,000	600,720	2027/12/20
349	10年国債	0.1000	430,000	428,787	2027/12/20
99	20年国債	2.1000	53,000	57,127	2027/12/20
157	5年国債	0.2000	60,000	60,012	2028/03/20
158	5年国債	0.1000	430,000	428,258	2028/03/20
350	10年国債	0.1000	400,000	398,380	2028/03/20
100	20年国債	2.2000	35,000	37,999	2028/03/20
101	20年国債	2.4000	18,000	19,696	2028/03/20
159	5年国債	0.1000	200,000	198,918	2028/06/20
161	5年国債	0.3000	100,000	100,360	2028/06/20
351	10年国債	0.1000	170,000	169,080	2028/06/20
102	20年国債	2.4000	10,000	10,987	2028/06/20
103	20年国債	2.3000	21,000	22,978	2028/06/20
104	20年国債	2.1000	64,000	69,452	2028/06/20
162	5年国債	0.3000	180,000	180,426	2028/09/20
352	10年国債	0.1000	320,000	317,721	2028/09/20
105	20年国債	2.1000	38,000	41,355	2028/09/20
106	20年国債	2.2000	16,000	17,488	2028/09/20
353	10年国債	0.1000	520,000	515,720	2028/12/20
107	20年国債	2.1000	40,000	43,680	2028/12/20
108	20年国債	1.9000	68,000	73,578	2028/12/20
354	10年国債	0.1000	280,000	277,368	2029/03/20
109	20年国債	1.9000	60,000	65,108	2029/03/20
110	20年国債	2.1000	27,000	29,580	2029/03/20
355	10年国債	0.1000	290,000	286,911	2029/06/20
111	20年国債	2.2000	35,000	38,672	2029/06/20
112	20年国債	2.1000	40,000	43,978	2029/06/20
356	10年国債	0.1000	440,000	434,728	2029/09/20
113	20年国債	2.1000	70,000	77,207	2029/09/20
357	10年国債	0.1000	420,000	414,267	2029/12/20
114	20年国債	2.1000	45,000	49,770	2029/12/20
115	20年国債	2.2000	42,000	46,701	2029/12/20
2	30年国債	2.4000	9,000	10,135	2030/02/20
358	10年国債	0.1000	480,000	472,454	2030/03/20
116	20年国債	2.2000	27,000	30,106	2030/03/20

区 分	当 期	年 率	期 末		償還年月日
			額 面 金 額	評 価 額	
銘 柄	年 率	%	千 円	千 円	
117	20年国債	2.1000	77,000	85,382	2030/03/20
3	30年国債	2.3000	4,000	4,493	2030/05/20
359	10年国債	0.1000	240,000	235,704	2030/06/20
118	20年国債	2.0000	13,000	14,364	2030/06/20
119	20年国債	1.8000	23,000	25,111	2030/06/20
120	20年国債	1.6000	98,000	105,742	2030/06/20
360	10年国債	0.1000	500,000	489,740	2030/09/20
4	30年国債	2.9000	8,000	9,359	2030/11/20
361	10年国債	0.1000	510,000	498,137	2030/12/20
123	20年国債	2.1000	42,000	46,848	2030/12/20
124	20年国債	2.0000	100,000	110,859	2030/12/20
362	10年国債	0.1000	550,000	535,826	2031/03/20
125	20年国債	2.2000	25,000	28,121	2031/03/20
126	20年国債	2.0000	21,000	23,316	2031/03/20
127	20年国債	1.9000	110,000	121,356	2031/03/20
5	30年国債	2.2000	8,000	9,011	2031/05/20
363	10年国債	0.1000	460,000	446,936	2031/06/20
128	20年国債	1.9000	32,000	35,349	2031/06/20
129	20年国債	1.8000	95,000	104,251	2031/06/20
364	10年国債	0.1000	430,000	416,455	2031/09/20
130	20年国債	1.8000	110,000	120,829	2031/09/20
131	20年国債	1.7000	150,000	163,639	2031/09/20
6	30年国債	2.4000	9,000	10,318	2031/11/20
365	10年国債	0.1000	410,000	396,076	2031/12/20
132	20年国債	1.7000	25,000	27,300	2031/12/20
133	20年国債	1.8000	150,000	164,965	2031/12/20
366	10年国債	0.2000	600,000	583,098	2032/03/20
134	20年国債	1.8000	15,000	16,520	2032/03/20
135	20年国債	1.7000	20,000	21,868	2032/03/20
136	20年国債	1.6000	180,000	195,386	2032/03/20
7	30年国債	2.3000	12,000	13,720	2032/05/20
367	10年国債	0.2000	330,000	319,911	2032/06/20
137	20年国債	1.7000	18,000	19,698	2032/06/20
139	20年国債	1.6000	250,000	271,547	2032/06/20
368	10年国債	0.2000	400,000	386,620	2032/09/20
140	20年国債	1.7000	100,000	109,517	2032/09/20
369	10年国債	0.5000	500,000	495,065	2032/12/20
141	20年国債	1.7000	140,000	153,419	2032/12/20
142	20年国債	1.8000	210,000	231,934	2032/12/20
370	10年国債	0.5000	550,000	543,477	2033/03/20
10	30年国債	1.1000	25,000	26,055	2033/03/20
143	20年国債	1.6000	100,000	108,711	2033/03/20
144	20年国債	1.5000	50,000	53,915	2033/03/20
371	10年国債	0.4000	480,000	468,993	2033/06/20
11	30年国債	1.7000	9,000	9,876	2033/06/20
145	20年国債	1.7000	40,000	43,895	2033/06/20
372	10年国債	0.8000	70,000	70,836	2033/09/20
12	30年国債	2.1000	11,000	12,487	2033/09/20
146	20年国債	1.7000	160,000	175,561	2033/09/20
13	30年国債	2.0000	11,000	12,389	2033/12/20
147	20年国債	1.6000	240,000	261,019	2033/12/20
14	30年国債	2.4000	22,000	25,666	2034/03/20
148	20年国債	1.5000	290,000	312,434	2034/03/20
15	30年国債	2.5000	21,000	24,750	2034/06/20
149	20年国債	1.5000	310,000	333,873	2034/06/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

区 分	当 期	年 率	期 末			償還年月日
			額 面 金 額	評 価 額	價 値	
銘 柄		%	千円	千円		
16	30年国債	2.5000	26,000	30,684		2034/09/20
150	20年国債	1.4000	280,000	298,485		2034/09/20
17	30年国債	2.4000	17,000	19,903		2034/12/20
151	20年国債	1.2000	280,000	292,261		2034/12/20
18	30年国債	2.3000	20,000	23,228		2035/03/20
152	20年国債	1.2000	285,000	297,118		2035/03/20
19	30年国債	2.3000	15,000	17,434		2035/06/20
153	20年国債	1.3000	275,000	289,385		2035/06/20
20	30年国債	2.5000	16,000	18,974		2035/09/20
154	20年国債	1.2000	305,000	317,129		2035/09/20
21	30年国債	2.3000	16,000	18,617		2035/12/20
155	20年国債	1.0000	250,000	253,820		2035/12/20
22	30年国債	2.5000	17,000	20,179		2036/03/20
156	20年国債	0.4000	220,000	207,473		2036/03/20
23	30年国債	2.5000	16,000	19,004		2036/06/20
157	20年国債	0.2000	310,000	283,925		2036/06/20
24	30年国債	2.5000	15,000	17,836		2036/09/20
158	20年国債	0.5000	285,000	270,205		2036/09/20
25	30年国債	2.3000	17,000	19,802		2036/12/20
159	20年国債	0.6000	300,000	286,974		2036/12/20
26	30年国債	2.4000	32,000	37,678		2037/03/20
160	20年国債	0.7000	280,000	270,457		2037/03/20
161	20年国債	0.6000	220,000	208,997		2037/06/20
27	30年国債	2.5000	32,000	38,098		2037/09/20
162	20年国債	0.6000	270,000	255,506		2037/09/20
163	20年国債	0.6000	230,000	216,793		2037/12/20
28	30年国債	2.5000	34,000	40,481		2038/03/20
164	20年国債	0.5000	300,000	277,758		2038/03/20
165	20年国債	0.5000	220,000	202,807		2038/06/20
29	30年国債	2.4000	43,000	50,631		2038/09/20
166	20年国債	0.7000	320,000	302,547		2038/09/20
167	20年国債	0.5000	260,000	237,705		2038/12/20
30	30年国債	2.3000	56,000	65,055		2039/03/20
168	20年国債	0.4000	250,000	224,002		2039/03/20
169	20年国債	0.3000	230,000	201,813		2039/06/20
31	30年国債	2.2000	76,000	87,078		2039/09/20
170	20年国債	0.3000	255,000	222,589		2039/09/20
171	20年国債	0.3000	150,000	130,251		2039/12/20
32	30年国債	2.3000	45,000	52,138		2040/03/20
172	20年国債	0.4000	275,000	241,711		2040/03/20
173	20年国債	0.4000	200,000	174,888		2040/06/20
33	30年国債	2.0000	95,000	105,552		2040/09/20
174	20年国債	0.4000	340,000	295,759		2040/09/20
175	20年国債	0.5000	195,000	171,785		2040/12/20
34	30年国債	2.2000	110,000	125,397		2041/03/20
176	20年国債	0.5000	245,000	214,889		2041/03/20
177	20年国債	0.4000	180,000	154,312		2041/06/20
35	30年国債	2.0000	120,000	132,814		2041/09/20
178	20年国債	0.5000	335,000	291,202		2041/09/20
179	20年国債	0.5000	210,000	181,717		2041/12/20
36	30年国債	2.0000	138,000	152,392		2042/03/20
180	20年国債	0.8000	250,000	227,650		2042/03/20
181	20年国債	0.9000	220,000	203,350		2042/06/20
37	30年国債	1.9000	165,000	179,280		2042/09/20
182	20年国債	1.1000	230,000	219,564		2042/09/20

区 分	当 期	年 率	期 末			償還年月日
			額 面 金 額	評 価 額	價 値	
銘 柄		%	千円	千円		
183	20年国債	1.4000	190,000	190,285		2042/12/20
38	30年国債	1.8000	250,000	266,610		2043/03/20
184	20年国債	1.1000	170,000	161,270		2043/03/20
39	30年国債	1.9000	105,000	113,580		2043/06/20
185	20年国債	1.1000	180,000	170,143		2043/06/20
40	30年国債	1.8000	80,000	85,027		2043/09/20
186	20年国債	1.5000	50,000	50,540		2043/09/20
41	30年国債	1.7000	80,000	83,560		2043/12/20
42	30年国債	1.7000	100,000	104,329		2044/03/20
43	30年国債	1.7000	105,000	109,415		2044/06/20
44	30年国債	1.7000	155,000	161,449		2044/09/20
45	30年国債	1.5000	125,000	125,501		2044/12/20
46	30年国債	1.5000	170,000	170,411		2045/03/20
47	30年国債	1.6000	125,000	127,450		2045/06/20
48	30年国債	1.4000	145,000	142,266		2045/09/20
49	30年国債	1.4000	120,000	117,524		2045/12/20
50	30年国債	0.8000	170,000	146,922		2046/03/20
51	30年国債	0.3000	155,000	118,850		2046/06/20
52	30年国債	0.5000	150,000	120,223		2046/09/20
53	30年国債	0.6000	130,000	106,316		2046/12/20
54	30年国債	0.8000	140,000	119,569		2047/03/20
55	30年国債	0.8000	140,000	119,210		2047/06/20
56	30年国債	0.8000	160,000	135,827		2047/09/20
57	30年国債	0.8000	135,000	114,257		2047/12/20
1	40年国債	2.4000	30,000	34,963		2048/03/20
58	30年国債	0.8000	210,000	177,193		2048/03/20
59	30年国債	0.7000	110,000	90,242		2048/06/20
60	30年国債	0.9000	150,000	128,727		2048/09/20
61	30年国債	0.7000	110,000	89,571		2048/12/20
2	40年国債	2.2000	48,000	53,865		2049/03/20
62	30年国債	0.5000	135,000	103,950		2049/03/20
63	30年国債	0.4000	140,000	104,417		2049/06/20
64	30年国債	0.4000	120,000	89,142		2049/09/20
65	30年国債	0.4000	125,000	92,567		2049/12/20
3	40年国債	2.2000	19,000	21,287		2050/03/20
66	30年国債	0.4000	175,000	128,966		2050/03/20
67	30年国債	0.6000	140,000	108,743		2050/06/20
68	30年国債	0.6000	140,000	108,448		2050/09/20
69	30年国債	0.7000	161,000	127,848		2050/12/20
4	40年国債	2.2000	54,000	60,500		2051/03/20
70	30年国債	0.7000	166,000	131,491		2051/03/20
71	30年国債	0.7000	130,000	102,716		2051/06/20
72	30年国債	0.7000	203,000	159,992		2051/09/20
73	30年国債	0.7000	120,000	94,339		2051/12/20
5	40年国債	2.0000	61,000	65,625		2052/03/20
74	30年国債	1.0000	155,000	131,874		2052/03/20
75	30年国債	1.3000	160,000	146,710		2052/06/20
76	30年国債	1.4000	120,000	112,603		2052/09/20
77	30年国債	1.6000	195,000	191,766		2052/12/20
6	40年国債	1.9000	68,000	71,498		2053/03/20
78	30年国債	1.4000	150,000	140,374		2053/03/20
79	30年国債	1.2000	160,000	142,304		2053/06/20
80	30年国債	1.8000	70,000	71,953		2053/09/20
7	40年国債	1.7000	41,000	41,123		2054/03/20
8	40年国債	1.4000	40,000	37,168		2055/03/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

		当 期			末	
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千 円	千 円		
	9 40年国債	0.4000	40,000	27,122	2056/03/20	
	10 40年国債	0.9000	240,000	191,049	2057/03/20	
	11 40年国債	0.8000	85,000	64,909	2058/03/20	
	12 40年国債	0.5000	99,000	67,093	2059/03/20	
	13 40年国債	0.5000	252,000	168,774	2060/03/20	
	14 40年国債	0.7000	273,000	195,099	2061/03/20	
	15 40年国債	1.0000	250,000	196,635	2062/03/20	
	16 40年国債	1.3000	300,000	258,339	2063/03/20	
種別	銘柄数					
小計	金額		46,261,000	45,033,250		
地方債証券						
	3 兵庫県公債12年	0.5600	100,000	100,635	2025/04/16	
	32 東京都5年	0.0200	100,000	99,879	2025/06/20	
	151 共同発行地方	0.4660	100,000	100,649	2025/10/24	
	401 大阪府公債	0.4770	100,000	100,650	2025/10/29	
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	103,036	2025/11/21	
	27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	100,679	2025/11/27	
	751 東京都公債	0.3700	100,000	100,480	2025/12/19	
	27-15 北海道公債	0.2200	100,000	100,134	2026/02/26	
	28-1 静岡県公債	0.0800	100,000	99,821	2026/03/19	
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,722	2026/06/19	
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	99,976	2027/03/25	
	29-6 千葉県公債	0.2450	100,000	99,798	2028/01/25	
	30-3 新潟県公債	0.1460	134,160	132,422	2029/02/28	
	6 札幌市20年	2.2400	100,000	109,966	2029/06/20	
	797 東京都公債	0.0400	100,000	97,735	2029/09/20	
	1 埼玉県15年	0.9410	100,000	102,882	2029/10/19	
	11 名古屋市中20年	2.1300	100,000	109,949	2029/12/14	
	2-1 千葉市公債	0.1310	100,000	97,658	2030/04/24	
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	110,407	2030/05/24	
	457 大阪府公債	0.1000	100,000	97,165	2030/06/28	
	11兵庫県公債20年	1.8400	100,000	108,474	2030/08/16	
	2-2 横浜市公債	0.1350	100,000	97,351	2030/08/19	
	2-1 静岡市公債	0.1400	100,000	97,099	2030/11/18	
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	96,225	2031/06/30	
	3-1 茨城県公債	0.1400	100,000	96,336	2031/06/30	
	10 京都市20年	1.8030	100,000	108,783	2031/11/21	
	3-3 堺市公債	0.1250	100,000	95,715	2031/12/22	
	4-3 長崎県公債	0.3640	100,000	97,085	2032/06/18	
	24-1 広島県20年	1.7000	100,000	108,333	2032/09/14	
	244 共同発行地方	0.5900	100,000	98,116	2033/07/25	
種別	銘柄数					
小計	金額		3,034,160	3,067,174		
特殊債券 (除く金融債券)						
	241 政保道路機構	0.4500	100,000	100,526	2025/03/31	
	261 政保道路機構	0.3810	100,000	100,549	2025/11/28	
	127 都市再生	0.0750	100,000	99,579	2026/09/18	
	80 住宅支援機構	1.5890	100,000	103,814	2026/09/18	
	3 地方公共団15年	1.1760	100,000	103,679	2029/01/26	
	81 政保道路機構	2.1000	100,000	109,294	2029/05/31	
	47日本政策投資CO	1.0270	100,000	103,072	2029/09/20	
	129 地方公共団体	0.0950	100,000	97,323	2030/02/28	
	F231地方公共団体	1.1760	100,000	103,928	2030/04/30	
	174 日本政策投資	0.6490	100,000	98,210	2033/07/14	
	47 住宅機構RMBS	1.9200	189,084	196,647	2046/04/10	
種別	銘柄数					
小計	金額		1,189,084	1,216,626		

		当 期			末	
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千 円	千 円		
普通社債券	497 関西電力	1.0020	100,000	101,187	2025/06/20	
	14 セブリアンドアイ	0.1900	100,000	99,761	2025/12/19	
	11 ヒューリック	0.3200	100,000	99,874	2026/04/13	
	36 芙蓉総合リース	0.2700	100,000	99,632	2026/06/05	
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,525	2026/08/21	
	32大和ハウス工業	0.3100	100,000	99,975	2026/09/07	
	17 パナソニック	0.4700	100,000	100,049	2026/09/18	
	7 三井住友海上	0.1900	100,000	99,610	2026/11/13	
	6 楽天カード	0.6200	100,000	89,980	2026/12/17	
	80 三菱地所	2.3050	100,000	106,323	2027/03/19	
	42 リコーリース	0.3900	100,000	99,460	2027/06/01	
	9 ソフトバンク	0.4800	100,000	98,287	2027/12/03	
	16 クボタ	0.4790	100,000	99,785	2028/04/20	
	16 JERA	0.6400	100,000	99,812	2028/04/25	
	1 SOMPOHD	0.4790	100,000	100,021	2028/04/27	
	11サントリーホールディング	0.3890	100,000	99,413	2028/05/25	
	29 東急不動産HD	0.4500	100,000	99,285	2028/06/01	
	50 大阪瓦斯	0.3900	100,000	99,314	2028/06/02	
	82 三井不動産	0.3600	100,000	99,294	2028/06/06	
	22 積水ハウス	0.3600	100,000	99,385	2028/06/07	
	26 リゾナホールディング	0.4150	100,000	99,576	2028/06/07	
	81 ホンダファイナンス	0.3890	100,000	99,434	2028/06/20	
	101 中日本高速道	0.4390	200,000	199,566	2028/08/17	
	32 住友電工	0.4640	100,000	99,137	2029/07/13	
	489 九州電力	0.4400	100,000	97,192	2030/05/24	
	65 東京瓦斯	0.2250	100,000	96,250	2030/09/10	
	18 セブリアンドアイ	1.0400	100,000	100,833	2030/11/01	
	35 東レ	0.9730	100,000	99,902	2030/11/22	
	5 NTTファイナンス	0.4890	100,000	95,639	2032/09/17	
	143 三菱地所	0.9000	100,000	98,829	2033/05/02	
	448 中国電力	0.9200	100,000	96,688	2033/05/25	
	31 トヨタ自動車	0.7350	100,000	97,542	2033/06/01	
	214 オリックス	0.8500	100,000	95,150	2033/06/13	
種別	銘柄数					
小計	金額		3,400,000	3,365,723		
合計	銘柄数					
金額			53,884,244	52,682,775		

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	52,682,775	98.6
コール・ローン等、その他	765,322	1.4
投資信託財産総額	53,448,097	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	53,448,097,700円
コール・ローン等	568,530,714
公社債(評価額)	52,682,775,133
未収入金	100,484,000
未収利息	92,305,414
前払費用	4,002,439
(B) 負債	305,316,203
未払金	297,126,800
未払解約金	8,189,403
(C) 純資産総額(A - B)	53,142,781,497
元本	43,455,436,599
次期繰越損益金	9,687,344,898
(D) 受益権総口数	43,455,436,599口
1万口当り基準価額(C/D)	12,229円

* 期首における元本額は34,135,552,866円、当作成期間中における追加設定元本額は10,094,084,082円、同解約元本額は774,200,349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：
 日本債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用) 2,738,982,458円
 iFree 日本債券インデックス 3,361,141,887円
 iFree 8資産バランス 6,400,564,081円
 ダイワ・ライフ・バランス30 11,825,100,390円
 ダイワ・ライフ・バランス50 9,124,633,659円
 ダイワ・ライフ・バランス70 3,495,533,334円
 DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース) 1,935,570,741円
 DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース) 1,530,659,908円
 DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース) 611,361,968円
 ダイワつみたてインデックス日本債券 2,117,596,780円
 ダイワつみたてインデックスバランス30 47,452,814円
 ダイワつみたてインデックスバランス50 21,682,780円
 ダイワつみたてインデックスバランス70 18,604,243円
 ダイワ世界バランスファンド40VA 184,289,943円
 ダイワ世界バランスファンド60VA 42,261,613円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,229円です。

■損益の状況

当期 自2022年12月1日 至2023年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	291,775,248円
受取利息	291,882,286
支払利息	△ 107,038
(B) 有価証券売買損益	△ 935,059,647
売買益	31,781,335
売買損	△ 966,840,982
(C) 当期損益金(A + B)	△ 643,284,399
(D) 前期繰越損益金	8,141,435,887
(E) 解約差損益金	△ 179,515,833
(F) 追加信託差損益金	2,368,709,243
(G) 合計(C + D + E + F)	9,687,344,898
次期繰越損益金(G)	9,687,344,898

(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。

NOMURA-BPIの知的財産権およびその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等並びに当ファンド及び同指数に関連して行われる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

運用報告書 第37期 (決算日 2023年9月15日)

(作成対象期間 2023年3月16日～2023年9月15日)

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

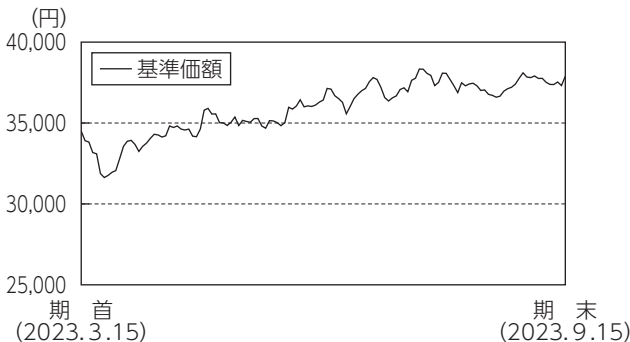
運用方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投資信託証券 組入制限	無制限

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、税引後 配当込み、円換算)		投資証券 組入比率
	円	%	騰落率 (参考指数)	騰落率	
(期首)2023年3月15日	34,498	-	25,273	-	98.2
3月末	33,559	△ 2.7	24,800	△ 1.9	97.7
4月末	34,631	0.4	25,367	0.4	98.1
5月末	35,025	1.5	25,750	1.9	98.3
6月末	36,994	7.2	27,606	9.2	97.3
7月末	37,510	8.7	27,748	9.8	98.9
8月末	38,102	10.4	28,164	11.4	98.1
(期末)2023年9月15日	37,895	9.8	28,124	11.3	98.0

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) S & P先進国REIT指数(除く日本、税引後配当込み、円換算)は、S & P先進国REIT指数(除く日本、税引後配当込み、米ドルベース)をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。
 (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。
 ※参考指数を「S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算)」から「S & P先進国REIT指数(除く日本、税引後配当込み、円換算)」に変更しました。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：34,498円 期末：37,895円 騰落率：9.8%

【基準価額の主な変動要因】

為替相場が円安に推移したことが主なプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

◆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、米国の地方銀行の経営破綻をきっかけに金融システムに対する警戒感が高まる中、投資家心理の悪化などを背景に、下落して始まりました。2023年3月末にかけては、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を受けて、金融システムへの過度な警戒感が後退する中、値を

戻しました。6月中旬にかけては、主要中央銀行の金融政策や米国債務上限問題の動向に左右され、上下する展開となりました。その後は、米国のインフレ指標の鈍化を好感して上昇したものの、当作成期末にかけては、堅調な米国経済指標を背景に米国で利上げ継続観測が再燃したことなどから、軟調に推移しました。

○為替相場

主要通貨の為替相場は対円で上昇(円安)しました。

当作成期首より2023年6月にかけては、堅調な米国経済指標などを背景に米国金利が上昇する中、投資先通貨は対円で堅調に推移しました。7月半ばにかけては、米国のインフレ指標の鈍化を受け、投資先通貨は対円で下落(円高)しました。当作成期末にかけては、堅調な米国経済指標を背景に米国の利上げ継続観測が再燃したことなどから、対円で再び上昇基調となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。外貨建資産の運用にあたっては、C & Sに運用の指図にかかる権限を委託します。海外リートへの投資にあたっては、個別銘柄の投資価値を分析して、配当利回り、期待される成長性、割安度などを勘案し投資銘柄を選定し、分散投資を行います。

※C & S：コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

◆ポートフォリオについて

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、C & Sに運用の指図にかかる権限を委託しております。信託財産の中長期的な成長をめざし、保有不動産の価値や期待される成長性などと比べてリート価格が魅力的であるとする銘柄に着目するとともに、安定的な配当利回りの確保をめざしてポートフォリオを構築しました。国・地域別配分では、大きなリスクを問わず各地域に分散して投資を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。

《今後の運用方針》

安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。外貨建資産の運用にあたっては、C & Sに運用の指図にかかる権限を委託します。海外リートへの投資にあたっては、個別銘柄の投資価値を分析して、配当利回り、期待される成長性、割安度などを勘案し投資銘柄を選定し、分散投資を行います。

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (投資証券)	14円 (14)
有価証券取引税 (投資証券)	11 (11)
その他費用 (保管費用) (その他)	4 (4) (0)
合計	28

(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
投資証券

(2023年3月16日から2023年9月15日まで)

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
	1,036.702 ()	50,298 (△ 160)	1,027.324 ()	67,294 ()
国	千口	千カナダ・ドル	千口	千カナダ・ドル
	539.933 ()	13,252 ()	101.276 ()	2,086 ()
国	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
	6,106.099 ()	16,315 ()	4,131.668 ()	19,512 ()

■ 主要な売買銘柄
投資証券

(2023年3月16日から2023年9月15日まで)

当				期			
銘柄	口数	付		銘柄	口数	付	
		金額	平均単価			金額	平均単価
CAPITALLAND INTEGRATED COMMER (シンガポール)	千口	千円	円	CAPITALLAND ASCENDAS REIT (シンガポール)	千口	千円	円
LAND SECURITIES GROUP PLC (イギリス)	1,418.966	1,688,728	207	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	5,579.7	1,607,520	288
AMERICAN TOWER CORP (アメリカ)	50.689	1,351,174	26,656	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	37.297	1,517,765	40,694
FRASERS CENTREPOINT TRUST (シンガポール)	5,594.1	1,295,985	231	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	92.723	1,498,836	16,164
UNITE GROUP PLC/THE (イギリス)	637.393	1,029,100	1,614	BRITISH LAND CO PLC (イギリス)	2,244.249	1,421,667	633
TRITAX BIG BOX REIT PLC (イギリス)	3,581.756	925,206	258	WELLTOWER INC (アメリカ)	106.284	1,198,293	11,274
MAPLETREE LOGISTICS TRUST (シンガポール)	4,985.3	892,461	179	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN (アメリカ)	139.561	1,026,664	7,356
EXTRA SPACE STORAGE INC (アメリカ)	42.222	859,255	20,350	ICADE (フランス)	161.91	992,160	6,127
AEDIFICA (ベルギー)	89.723	823,015	9,172	FRASERS LOGISTICS & COMMERC (シンガポール)	7,462.865	961,300	128
COFINIMMO (ベルギー)	63.288	749,158	11,837	CAPITALLAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU (シンガポール)	8,397.6	915,905	109
				AEDIFICA (ベルギー)	82.87	851,696	10,277

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	581.7 ()	26,795 ()	196.9 ()	9,033 ()
	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
	18,915.8 ()	37,084 (△ 214)	22,009.165 ()	34,979 ()
国	千口	千ニューージーランド・ドル	千口	千ニューージーランド・ドル
	()	()	483.532 ()	1,052 ()
	千口	千イギリス・ポンド	千口	千イギリス・ポンド
	7,230.255 ()	23,833 ()	7,134.526 ()	25,353 ()
国	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	30.184 ()	707 ()	54.004 ()	1,077 ()
	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	211.512 ()	11,825 ()	98.435 ()	6,404 ()
国	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	204.403 ()	8,612 ()	654.652 ()	18,790 ()
	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	25.548 ()	207 ()	98.585 ()	819 ()
国	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	471.647 ()	21,353 ()	905.676 ()	27,091 ()

(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。

■組入資産明細表
外国投資証券

銘柄	期首		期末	
	□数	□数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
DIGITAL CORE REIT UNITS (アメリカ)	13,162.156	13,162.156	7,699	1,136,653
SIMON PROPERTY GROUP INC	176.634	213.319	25,039	3,696,313
EQUINIX INC	20.67	20.417	15,969	2,357,427
AMERICAN TOWER CORP	-	50.689	9,178	1,354,969
HOST HOTELS & RESORTS INC	390.253	345.569	5,618	829,469
KIMCO REALTY CORP	338.868	517.958	9,872	1,457,345
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	566.327	549.697	9,256	1,366,503
INVITATION HOMES INC	777.356	668.615	23,501	3,469,338
AMERICOLD REALTY TRUST	354.365	346.534	11,321	1,671,245
VICI PROPERTIES INC	141.974	194.963	6,143	906,871
APARTMENT INCOME REIT CO	137.832	137.832	4,519	667,170
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	139.561	-	-	-
IRON MOUNTAIN INC	-	54.311	3,466	511,669
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	141.69	136.923	5,053	746,046
SUN COMMUNITIES INC	74.868	94.871	11,997	1,771,054
PROLOGIS INC	265.028	238.359	29,635	4,374,744
CAMDEN PROPERTY TRUST	105.29	103.022	10,654	1,572,822
COUSINS PROPERTIES INC	194.352	-	-	-
SITE CENTERS CORP	126.095	126.095	1,737	256,502
EASTGROUP PROPERTIES INC	-	7.692	1,385	204,468
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9.024	-	-	-
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	93.257	60.912	3,139	463,438
WELLTOWER INC	414.455	327.655	27,690	4,087,616
HIGHWOODS PROPERTIES INC	109.582	101.201	2,311	341,213
MID-AMERICA APARTMENT COMM	97.421	101.06	13,943	2,058,302
REALTY INCOME CORP	378.906	365.942	20,170	2,977,602
PUBLIC STORAGE	53.934	16.637	4,593	678,064
UDR INC	264.885	222.825	8,565	1,264,423
WP CAREY INC	-	20.833	1,329	196,269
AGREE REALTY CORP	44.816	44.816	2,692	397,473
DIGITAL REALTY TRUST INC	233.707	180.4	23,177	3,421,505
EXTRA SPACE STORAGE INC	67.208	97.113	12,256	1,809,323
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	-	381.476	2,510	370,542
アメリカ・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	18,880.514 28銘柄	18,889.892 30銘柄	314,431 46,416,392 <50.3%>
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	-	301.489	4,250	464,421
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	-	133.443	6,644	725,870
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	832.305	836.03	16,578	1,811,198
カナダ・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	832.305 1銘柄	1,270.962 3銘柄	27,473 3,001,490 < 3.3%>
(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	1,691.484	1,734.684	12,975	1,234,872
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	4,022.219	4,832.717	7,249	689,894
NATIONAL STORAGE REIT	5,396.794	5,141.919	11,415	1,086,371
MIRVAC GROUP	4,341.128	5,665.792	13,031	1,240,190
STOCKLAND	3,774.667	4,398.084	17,592	1,674,262
GOODMAN GROUP	2,527.394	2,391.46	54,046	5,143,652

銘柄	期首		期末	
	□数	□数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
CHARTER HALL GROUP	2,403.331	1,680.022	17,220	1,638,848
INGENIA COMMUNITIES GROUP	3,381.765	3,668.535	15,774	1,501,278
オーストラリア・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	27,538.782 8銘柄	29,513.213 8銘柄	149,305 14,209,371 <15.4%>
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円
LINK REIT	3,273.892	3,658.692	136,469	2,573,809
香港・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	3,273.892 1銘柄	3,658.692 1銘柄	136,469 2,573,809 < 2.8%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポール・ドル	千円
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	10,938.5	3,623.635	4,167	451,097
CAPITALAND ASCENDAS REIT	5,579.7	-	-	-
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	-	8,042.9	15,281	1,654,223
MAPLE TREE LOGISTICS TRUST	-	4,985.3	8,425	912,023
CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRUST	8,397.6	-	-	-
FRASERS CENTREPOINT TRUST	-	5,594.1	12,362	1,338,290
PARKWAYWAY REAL ESTATE	5,558.177	5,134.677	19,306	2,089,916
シンガポール・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	30,473.977 4銘柄	27,380.612 5銘柄	59,543 6,445,550 < 7.0%>
(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
GOODMAN PROPERTY TRUST	5,190.882	4,707.35	9,979	871,716
ニュージーランド・ドル 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	5,190.882 1銘柄	4,707.35 1銘柄	9,979 871,716 < 0.9%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
INDUSTRIALS REIT LIMITED LTD	518.981	-	-	-
LXI REIT PLC	4,155.97	4,804.276	4,489	822,404
URBAN LOGISTICS REIT PLC	1,740.264	888.246	1,030	188,742
LAND SECURITIES GROUP PLC	-	1,337.539	8,030	1,471,042
SEGRO PLC	1,531.391	1,294.929	9,704	1,777,614
UNITE GROUP PLC/THE	394.449	850.181	7,893	1,446,010
BRITISH LAND CO PLC	2,845.082	600.833	1,967	360,338
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	917.071	299.09	1,276	233,832
DERWENT LONDON PLC	58.792	-	-	-
WORKSPACE GROUP PLC	274.534	365.658	1,815	332,494
SAFESTORE HOLDINGS PLC	858.059	522.114	4,310	789,515
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	747.301	-	-	-
TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,320.804	4,504.771	6,441	1,180,013
イギリス・ポンド 通貨計	□数、金額 銘柄数<比率>	15,362.698 12銘柄	15,467.637 10銘柄	46,959 8,602,007 < 9.3%>
ユーロ (オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	203.725	201.09	4,395	690,188
NSI NV	12.697	-	-	-
国小計	□数、金額 銘柄数<比率>	216.422 2銘柄	201.09 1銘柄	4,395 690,188 < 0.7%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円
AEDIFICA	41.011	47.864	2,792	438,507
COFINIMMO	38.127	97.433	6,966	1,093,803
WAREHOUSES DE PAUW SCA	253.073	312.331	7,976	1,252,458
国小計	□数、金額 銘柄数<比率>	332.211 3銘柄	457.628 3銘柄	17,736 2,784,769 < 3.0%>

銘柄	期首		期末	
	口数	口数	評価額	評価額
ユーロ (フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	142,494	152,911	7,564	1,187,703
ICADE	161.91	-	-	-
ARGAN	18,284	-	-	-
GECINA SA	-	23,737	2,342	367,849
KLEPIERRE	482.76	342,991	8,605	1,351,172
COVIMIO	78,189	66,897	2,958	464,464
MERCIALYS	408,193	258,345	2,237	351,273
国小計	口数、金額 銘柄数<比率>	1,291.83 6銘柄	844,881 5銘柄	23,708 < 4.0%>
ユーロ (スペイン)	千口	千口	千ユーロ	千円
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	950,851	877,814	7,356	1,154,978
国小計	口数、金額 銘柄数<比率>	950,851 1銘柄	877,814 1銘柄	7,356 < 1.3%>
ユーロ通貨計	口数、金額 銘柄数<比率>	2,791,314 12銘柄	2,381,413 10銘柄	53,196 < 9.0%>
合計	口数、金額 銘柄数<比率>	104,344,364 67銘柄	103,269,771 68銘柄	- 90,472,738 <98.0%>

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

(注2) <>内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年9月15日現在

項目	期末	
	評価額	比率
投資証券	千円 90,472,738	% 97.4
コール・ローン等、その他	2,373,515	2.6
投資信託財産総額	92,846,254	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、9月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=147.62円、1カナダ・ドル=109.25円、1オーストラリア・ドル=95.17円、1香港ドル=18.86円、1シンガポール・ドル=108.25円、1ニューージーランド・ドル=87.35円、1イギリス・ポンド=183.18円、1ユーロ=157.01円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (91,717,077千円) の投資信託財産総額 (92,846,254千円) に対する比率は、98.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年9月15日現在

項目	当期末
(A) 資産	92,909,873,205円
コール・ローン等	1,949,033,655
投資証券(評価額)	90,472,738,613
未収入金	218,295,133
未収配当金	269,805,804
(B) 負債	617,325,284
未払金	241,524,784
未払解約金	375,800,500
(C) 純資産総額(A-B)	92,292,547,921
元本	24,354,654,451
次期繰越損益金	67,937,893,470
(D) 受益権総口数	24,354,654,451口
1万口当り基準価額(C/D)	37,895円

* 期首における元本額は25,415,147,137円、当作成期間中における追加設定元本額は847,872,040円、同解約元本額は1,908,364,726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:

グローバルREIT・オープン (適格機関投資家専用)	820,330円
ダイワ・グローバルREIT・オープン (毎月分配型)	18,805,889,501円
ダイワ・バランス3資産 (外債・海外リート・好配当日本株)	22,227,783円
安定重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	10,482,112円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	8,117,418円
成長重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	41,093,489円
6資産バランスファンド (分配型)	71,366,695円
6資産バランスファンド (成長型)	212,889,516円
りそなワールド・リート・ファンド	899,644,139円
世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	19,430,802円
常陽3分法ファンド	92,710,829円
ダイワ資産分散インカムオープン (奇数月決算型)	22,984,827円
ダイワ・グローバルREIT・オープン (為替ヘッジあり/毎月分配型)	40,885,327円
ダイワ・グローバルREIT・オープン (為替ヘッジなし/資産成長型)	581,200,246円
ダイワ・グローバルREIT・オープン (為替ヘッジあり/資産成長型)	819,335,327円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	369,727,747円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	486,028,884円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	773,878,289円
グローバルREITファンド2021-07 (適格機関投資家専用)	825,267,450円
ライフハモニー (ダイワ世界資産分散ファンド) (分配型)	207,708,483円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド (部分為替ヘッジあり)	17,262,483円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド (為替ヘッジなし)	25,702,774円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は37,895円です。

■損益の状況

当期 自2023年3月16日 至2023年9月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,925,163,756円
受取配当金	1,906,690,720
受取利息	18,541,213
その他収益金	16,368
支払利息	△ 84,545
(B) 有価証券売買損益	6,573,444,684
売買益	12,499,832,772
売買損	△ 5,926,388,088
(C) その他費用	△ 10,238,138
(D) 当期損益金(A + B + C)	8,488,370,302
(E) 前期繰越損益金	62,262,756,782
(F) 解約差損益金	△ 5,013,171,574
(G) 追加信託差損益金	2,199,937,960
(H) 合計(D + E + F + G)	67,937,893,470
次期繰越損益金(H)	67,937,893,470

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

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

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・マザーファンド

運用報告書 第36期（決算日 2023年11月10日）

（作成対象期間 2023年5月11日～2023年11月10日）

ダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブ・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。

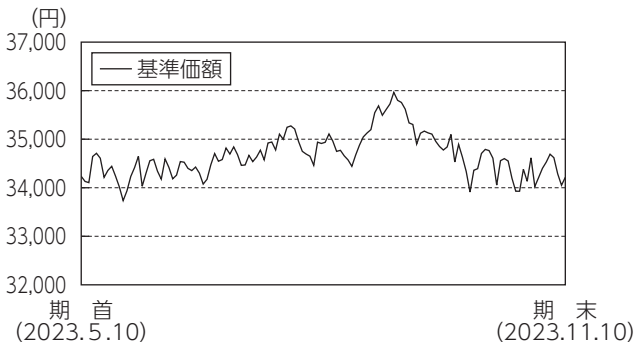
運用方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

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	不動産投信
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	組入比率	指 数 先 物 率
(期首)2023年5月10日	34,235	%	4,399.44	%	%	%
5月末	34,647	1.2	4,448.91	1.1	97.4	1.7
6月末	34,581	1.0	4,421.28	0.5	97.6	1.6
7月末	34,956	2.1	4,472.88	1.7	96.8	2.1
8月末	35,493	3.7	4,539.20	3.2	96.7	2.0
9月末	34,892	1.9	4,468.30	1.6	96.7	2.0
10月末	34,211	△0.1	4,372.14	△0.6	97.7	1.9
(期末)2023年11月10日	34,215	△0.1	4,365.46	△0.8	97.7	1.9

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：34,235円 期末：34,215円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

日銀の金融政策見直しや米国の長期金利の上昇に伴う国内長期金利の上昇を受けて、Ｊリート市況が下落したことにより、基準価額も下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○Ｊリート（不動産投信）市況

Ｊリート市況は下落しました。

Ｊリート市況は、米国での債務上限問題への懸念が後退し、2023年5月下旬に上昇しました。6月は、グローバルな不動産市場の不透明感や日銀による金融引き締めへの懸念から上値が重く、横ばい圏の推移でした。7月は日銀の金融政策修正懸念の台頭と後退に合せて、下落・上昇しました。7月末に日銀が長短金利操作の修正を発表し、8月中旬までは長期金利の動きに合わせた変動の大きな推移が続きまして。8月下旬から9月上旬にかけては、国内長期金利上昇への警戒感後退からＪリート市況は上昇しました。その後は日米で長期金利の上昇が続き、Ｊリート市況は変動の大きな推移の中で水準を切下げました。加えて、中東での地政学リスクの高まりも嫌気され、Ｊリート市況は軟調な推移が続きまして。11

月に入り、米国で軟調な経済指標が発表されたことなどにより日米の長期金利の上昇は一服したものの、Ｊリート市況は上値の重いまま、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」

個別銘柄ごとの流動性を勘案しつつＪリートに幅広く分散投資を行い、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資します。

◆ポートフォリオについて

リートの組入比率につきましては、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本としており、おおむね95～98%台程度で推移させました。また、東証REIT指数先物への投資も行い、先物と合計で95～100%程度で推移させました。リート銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資しました。個別銘柄では、当作成期を通じて見ると、日本プロロジリート、三菱地所物流リート、ケネディクス・レジデンシャル・ネットワークなどを東証REIT指数と比較してオーバーウエートとし、ジャパンリアルエステイト、日本ロジスティクスファンド、森トラストリートなどをアンダーウエートとしました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当ファンドは、参考指数として東証REIT指数（配当込み）を用いています。当作成期における参考指数の騰落率は△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△0.1%となりました。

投資口価格のパフォーマンスが参考指数を上回った日本ビルファンド、ケネディクス商業リート、ケネディクス・レジデンシャル・ネットワークをオーバーウエートとしたことなどがプラスに寄与しました。他方、投資口価格のパフォーマンスが参考指数を上回ったジャパンリアルエステイトをアンダーウエートとしていたことや、投資口価格のパフォーマンスが参考指数を下回った日本プロロジリートや三菱地所物流リートをオーバーウエートとしたことなどが、マイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

個別銘柄ごとの流動性を勘案しつつＪリートに幅広く分散投資を行い、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。銘柄の選択にあたっては、収益力や成長性に比して相対的に割安と判断された銘柄群の中から、財務体質や流動性を加味して選別投資します。

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (先物・オプション) (投資証券)	25円 (0) (25)
有価証券取引税	－
その他費用	－
合 計	25

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 投資証券

(2023年5月11日から2023年11月10日まで)

銘	柄	買		付		売		付	
		口	数	金	額	口	数	金	額
			千口		千円		千口		千円
国内	サンケイリアルエステート		0.767		67,983		5.235		474,733
	S O S I L A物流リート投		4.149		521,723		－		－
	日本アコモデーションファンド投資法人		2.752		1,785,715		0.366		224,824
	森ヒルズリート		9.9		1,459,593		0.948		134,977
	産業ファンド		6.458		908,007		1.224		189,565
	アドバンス・レジデンス		4.168		1,416,327		1.933		662,765
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	△	21.533		△4,545,850		3.267		730,452
	A P I 投資法人		0.448		180,651		1.123		462,362
	G L P 投資法人		24.792		3,495,100		4.152		564,227
	コンフォリア・レジデンシャル		4.725		1,568,021		1.845		607,421
	日本プロロジスリート		11.387		3,285,665		1.833		528,598
	星野リゾート・リート		1.839		1,166,949		－		－
	O n e リート投資法人		2.824		691,256		0.958		250,408
	イオンリート投資		8.721		1,303,890		2.664		411,514
	ヒューリックリート投資法		3.55		555,995		1.036		169,044
	日本リート投資法人		2.051		707,799		2.575		891,992
	積水ハウス・リート投資		4.166		342,219		11.749		970,162
	トーセイ・リート投資法人		2.929		400,325		1.859		261,129
	ケネディクス商業リート	△	9.041		△2,178,801		4.249		1,202,708
	ヘルスケア&メディカル投資		4.531		678,653		0.219		31,525
	野村不動産マスターF		4.565		743,373		10.025		1,670,757
	いちごホテルリート投資		1.354		142,487		－		－
	ラサールロジポート投資		9.985		1,515,355		4.104		610,033
	スターアジア不動産投		10.499		566,752		17.658		1,025,928
	三井不動産パーク		0.387		178,634		3.065		1,542,128
	三菱地所物流 R E I T		2.066		821,066		0.709		276,251
	C R E ロジスティクスファンド		2.29		393,200		0.7		132,400
	ザイマックス・リート		0.689		77,604		0.617		70,227

銘柄	買付		売付	
	数	金額	数	金額
	千口	千円	千口	千円
タカラレーベン不動産投	1.674	164,316	5.804	557,489
アドバンス・ロジスティクス投資法人	3.551	466,660	0.062	7,868
日本ビルファンド	4.995	2,925,750	2.117	1,276,153
ジャパンリアルエステイト	2.56	1,446,649	1.472	843,496
日本都市ファンド投資法人	24.392	2,356,437	3.626	351,946
オリックス不動産投資	6.37	1,116,326	2.868	521,649
日本プライムリアルティ	4.757	1,686,590	0.282	100,452
ＮＴＴ都市開発リート投資法人	3.42	446,286	2.388	326,467
東急リアル・エステート	3.467	643,348	－	－
グローバル・ワン不動産投資法人	－	－	0.396	41,453
ユナイテッド・アーバン投資法人	7.164	1,044,275	9.917	1,546,352
森トラストリート投資法人	4.207	297,349	4.207	312,496
インヴィンシブル投資法人	12.627	737,128	10.81	644,824
フロンティア不動産投資	2.364	1,114,620	0.591	275,868
平和不動産リート	4.268	604,624	0.053	7,653
日本ロジスティクスファンド投資法人	1.416	411,552	1.982	628,196
福岡リート投資法人	1.354	218,409	1.354	221,485
KDX不動産投資法人	56.25752	8,791,413	16.581	5,520,981
いちごオフィスリート投資法人	17.243	1,531,459	－	－
大和証券オフィス投資法人	0.31	197,824	－	－
阪急阪神リート投資法人	3.261	467,154	1.296	184,478
スタートアップシード投資法人	1.109	237,537	0.572	123,918
大和ハウスリート投資法人	9.489	2,552,774	4.242	1,176,236
ジャパン・ホテル・リート投資法人	48.921	3,508,016	5.463	421,094
大和証券リビング投資法人	21.511	2,351,054	－	－
ジャパンエクセレント投資法人	0.216	26,617	4.577	583,204

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2023年5月11日から2023年11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
国内	百万円	百万円	百万円	百万円
不動産投信指数先物取引	6,713	6,072	－	－

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内投資証券

銘柄	期首		当期末	
	□数	□数	□数	評価額
	千口	千口	千口	千円
サンケイリアルエステート	11.119	6.651	601,250	
S O S I L A物流リート投	3.652	7.801	932,219	
日本アコモデーションファンド投資法人	7.763	10.149	6,170,592	
森ヒルズリート	9.144	18.096	2,515,344	
産業ファンド	19.106	24.34	3,315,108	
アドバンス・レジデンス	12.897	15.132	4,917,900	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	24.8	－	－	
A P I 投資法人	6.044	5.369	2,147,600	
G L P 投資法人	54.348	74.988	10,243,360	
コンフォリア・レジデンシャル	8.536	11.416	3,630,288	
日本プロロジスリート	29.501	39.055	10,751,841	
星野リゾート・リート	0.192	2.031	1,208,445	
O n e リート投資法人	3.739	5.605	1,443,287	
イオンリート投資	21.441	27.498	3,929,464	
ヒューリックリート投資法	15.93	18.444	2,783,199	
日本リート投資法人	8.818	8.294	2,840,695	
積水ハウス・リート投資	36.48	28.897	2,259,745	
トーセイ・リート投資法人	－	1.07	145,413	
ケネディクス商業リート	13.29	－	－	
ヘルスケア&メディカル投資	－	4.312	621,790	
野村不動産マスターF	42.451	36.991	6,170,098	
いちごホテルリート投資	－	1.354	138,649	
ラサールロジポート投資	20.661	26.542	3,981,300	
スターアジア不動産投	8.582	1.423	81,253	
三井不ロジパーク	6.101	3.423	1,600,252	
三菱地所物流R E I T	11.654	13.011	4,911,652	
C R E ロジスティクスファンド	5.118	6.708	1,077,304	
ザイマックス・リート	5.702	5.774	676,712	
タカラレーベン不動産投	5.237	1.107	107,932	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1.461	4.95	617,265	
日本ビルファンド	19.691	22.569	13,721,952	
ジャパンリアルエステイト	7.11	8.198	4,615,474	
日本都市ファンド投資法人	64.387	85.153	8,344,994	
オリックス不動産投資	23.573	27.075	4,627,117	
日本プライムリアルティ	11.975	16.45	5,716,375	
N T T 都市開発リート投資法人	12.395	13.427	1,719,998	
東急リアル・エステート	－	3.467	619,206	
グローバル・ワン不動産投資法人	0.396	－	－	
ユナイテッド・アーバン投資法人	33.045	30.292	4,537,741	
インヴィンシブル投資法人	43.438	45.255	2,575,009	
フロンティア不動産投資	3.388	5.161	2,335,352	
平和不動産リート	－	4.215	596,001	

銘柄	期首		当期末	
	□数	□数	□数	評価額
	千口	千口	千口	千円
日本ロジスティクスファンド投資法人	3.485	2.919	831,331	
K D X 不動産投資法人	15.53	55.20652	8,904,811	
いちごオフィスリート投資法人	－	17.243	1,450,136	
大和証券オフィス投資法人	2.68	2.99	1,949,480	
阪急阪神リート投資法人	4.635	6.6	933,240	
スターツプロシード投資法人	－	0.537	109,548	
大和ハウスリート投資法人	25.769	31.016	8,433,250	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	45.899	89.357	5,951,176	
大和証券リビング投資法人	－	21.511	2,346,850	
ジャパンエクセレント投資法人	4.361	－	－	
合計	□数、金額	715.524	899.07252	160,139,011
	銘柄数<比率>	44銘柄	48銘柄	<97.7%>

(注1) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内 東証R E I T	百万円 3,035	百万円 －

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年11月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	160,139,011	97.4
コール・ローン等、その他	4,343,591	2.6
投資信託財産総額	164,482,603	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年11月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	165,630,203,577円
コール・ローン等	2,136,949,072
投資証券(評価額)	160,139,011,976
未収入金	527,070,181
未収配当金	1,522,993,448
差入委託証拠金	1,304,178,900
(B) 負債	1,672,962,465
未払金	524,362,465
未払解約金	1,000,000
差入委託証拠金代用有価証券	1,147,600,000
(C) 純資産総額(A - B)	163,957,241,112
元本	47,919,612,913
次期繰越損益金	116,037,628,199
(D) 受益権総口数	47,919,612,913口
1万口当り基準価額(C / D)	34,215円

* 期首における元本額は41,918,129,534円、当作成期間中における追加設定元本額は6,850,703,242円、同解約元本額は849,219,863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ファンド (F O F s 用) (適格機関投資家専用)	44,781,255,344円
安定重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	11,754,235円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	8,632,593円
成長重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	45,244,207円
6資産バランスファンド (分配型)	74,993,956円
6資産バランスファンド (成長型)	224,587,231円
世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	20,266,803円
ダイワ資産分散インカムオープン (奇数月決算型)	24,225,499円
D Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	399,551,777円
D Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	524,240,012円
D Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	833,969,411円
D CダイワＪ－ＲＥＩＴアクティブファンド	232,254,283円
ライフハーモニー (ダイワ世界資産分散ファンド) (成長型)	55,354,600円
ライフハーモニー (ダイワ世界資産分散ファンド) (安定型)	17,468,024円
ライフハーモニー (ダイワ世界資産分散ファンド) (分配型)	90,988,033円
ダイワ・アクティブリリート・ファンド (年4回決算型)	574,826,905円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は34,215円です。

■損益の状況

当期 自2023年5月11日 至2023年11月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,097,761,296円
受取配当金	2,944,176,410
その他収益金	154,446,164
支払利息	△ 861,278
(B) 有価証券売買損益	△ 3,466,450,488
売買益	4,022,961,257
売買損	△ 7,489,411,745
(C) 先物取引等損益	△ 29,044,070
取引益	120,100,360
取引損	△ 149,144,430
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 397,733,262
(E) 前期繰越損益金	101,586,514,840
(F) 解約差損益金	△ 2,088,404,137
(G) 追加信託差損益金	16,937,250,758
(H) 合計(D + E + F + G)	116,037,628,199
次期繰越損益金(H)	116,037,628,199

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

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

配当込み東証REIT指数(本書類における「東証REIT指数(配当込み)」をいう。)の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社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章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。

ダイワ北米好配当株マザーファンド

運用報告書 第36期（決算日 2023年10月16日）

（作成対象期間 2023年4月18日～2023年10月16日）

ダイワ北米好配当株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。

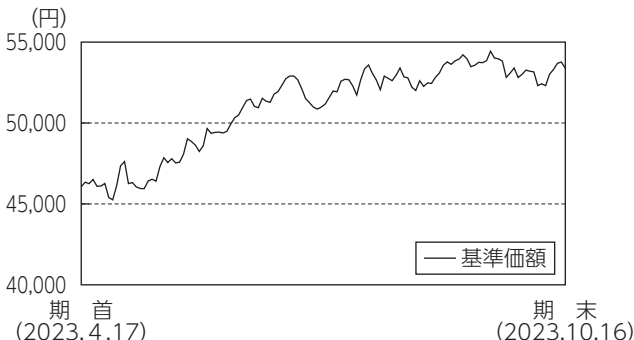
運用方針	北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	北米の金融商品取引所上場または店頭登録の株式およびハイブリッド優先証券
株式組入制限	無制限

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



年月日	基準価額		MSCIノースアメリカ指数 (税引後配当込み、円換算)		株式組入 比率	ハイブリッド 優先証券 組入比率	投資証券 組入比率
	円	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首)2023年4月17日	46,057	-	50,411	-	73.2	17.3	1.0
4月末	46,127	0.2	50,378	△ 0.1	72.4	18.0	1.2
5月末	48,637	5.6	53,398	5.9	73.2	17.1	1.1
6月末	52,339	13.6	58,012	15.1	74.3	17.8	1.1
7月末	52,665	14.3	58,896	16.8	75.8	17.5	1.1
8月末	53,778	16.8	60,152	19.3	74.0	18.6	1.1
9月末	53,270	15.7	58,777	16.6	74.1	18.4	0.8
(期末)2023年10月16日	53,381	15.9	59,115	17.3	74.7	18.1	0.7

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) MSCIノースアメリカ指数 (税引後配当込み、円換算) は、MSCI Inc. (「MSCI」) の承諾を得て、MSCIノースアメリカ指数 (税引後配当込み、米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIノースアメリカ指数 (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。

※参考指数を「MSCIノースアメリカ指数 (配当込み、円換算)」から「MSCIノースアメリカ指数 (税引後配当込み、円換算)」に変更しました。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：46,057円 期末：53,381円 騰落率：15.9%

【基準価額の主な変動要因】

当作成期は、米国ハイブリッド優先証券市況が下落したことはマイナス要因となりましたが、北米株式市況が上昇したことや米ドルの対円為替市況が上昇 (円安) したことから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○北米株式市況

北米株式市況は上昇しました。

北米株式市況は、当作成期首より、米国における地方銀行の経営不安や債務上限問題への懸念が上値を抑えた一方、予想を上回る企業決算の発表が好感され、底堅い展開となりました。2023年5月下旬以降は、AI (人工知能) 関連の半導体企業の強気見通しや債務上限問題の解決、インフレ率の鈍化などが好感されて上昇しました。8月以降は、インフレが沈静化傾向となり利上げ打ち止め期待などから上昇する局面もありましたが、原油価格が上昇に転じたことやFRB (米国連邦準備制度理事会) の政策金利見通しが引き上げられ高水準の政策金利が長期化するとの見方が強まったこと、米国における予算審議の不調で政府機関の閉鎖観測が強まり米国債の格下げが懸念されたことなどから長期金利が大幅に上昇し、株価は反落して当作成期末を迎えました。

○米国ハイブリッド優先証券市況

米国ハイブリッド優先証券市況は下落しました。

米国ハイブリッド優先証券市況は、当作成期を通じて、米国債の需給悪化や好調な米国経済を背景に長期金利が上昇基調で推移する中、おおむね上値の重い展開となりました。当作成期首は、強弱入り混じった経済指標を背景に金利が小幅低下する中で底堅く推移して始まりましたが、2023年4月末に入ると、米国の地方銀行の経営破綻に端を発する信用不安が再度意識され、地銀セクターに売りが集まったことなどから下落しました。5月中旬以降は戻す展開となりましたが、6月上旬から9月中旬にかけては方向感のない動きとなりました。9月下旬に入ると、FRB (米国連邦準備制度理事会) の政策金利見通しが引き上げられ、高水準の政策金利が長期化するとの見方が強まったことなどから長期金利が大幅に上昇し、下落しました。

○為替相場

米ドル為替相場は、対円で上昇しました。

米ドル対円為替相場は、当作成期首より、信用不安の後退や経済指標の上振れなどを背景に米国金利が上昇するに連れて、上昇基調となりました。2023年6月に入ると、FRB (米国連邦準備制度理事会) が政策金利見通しを引き上げた一方で、日銀は現状の金融緩和政策の維持を決定したことなどから、米ドルは対円での上昇幅を拡大しました。その後は、日本の政府要人等による円安けん制発言や日銀の政策運営の柔軟化決定を受けて米ドルは対円で下落 (円高) する場面もありましたが、再度米国で金利が上昇基調となると、円は弱含み展開となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

外貨建資産の運用にあたっては、C&Sに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行ってまいります。普通株式については、今後も企業ファンダメンタルズ、キャッシュフローおよび配当の成長、配当利回り、バリュエーションなどを考慮しながら、ポートフォリオを構築します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築します。

※C&S：コーペン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

◆ポートフォリオについて

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、C&Sに運用の指図にかかる権限を委託しております。

普通株式については、企業ファンダメンタルズやキャッシュフローの成長性、配当利回りやバリュエーション等を考慮し、キャッ

ダイワ北米好配当株マザーファンド

シュフローを生み出し、魅力的な配当利回りを将来にわたって提供できると考える銘柄を中心としたポートフォリオとしました。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心としたポートフォリオとしました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標標準となるベンチマークを設けておりません。

当ファンドの当作成期の基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。

《今後の運用方針》

外貨建資産の運用にあたっては、C & Sに運用の指図にかかる権限を委託し、運用を行ってまいります。普通株式については、今後も企業のファンダメンタルズ、キャッシュフローおよび配当の成長、配当利回り、バリュエーションなどを考慮しながら、ポートフォリオを構築します。ハイブリッド優先証券については、利回り水準やバリュエーションが相対的に魅力的な銘柄を中心にポートフォリオを構築します。

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	14円
(株式)	(5)
(ハイブリッド優先証券)	(9)
(投資証券)	(0)
有価証券取引税	0
(株式)	(0)
(ハイブリッド優先証券)	(0)
(投資証券)	(0)
その他費用	6
(保管費用)	(6)
(その他)	(0)
合計	20

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株式

(2023年4月18日から2023年10月16日まで)

		買付		売却	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 639.62 (64.2)	千アメリカ・ドル 4,524 (△ 1)	百株 770.93	千アメリカ・ドル 5,306
	カナダ	百株 181.3 (-)	千カナダ・ドル 1,244 (-)	百株 146.85	千カナダ・ドル 771

(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) ハイブリッド優先証券

(2023年4月18日から2023年10月16日まで)

		買付		売却	
		証券数	金額	証券数	金額
外国	アメリカ	千証券 180.779 (△ 10.812)	千アメリカ・ドル 4,125 (△ 271)	千証券 146.616 (-)	千アメリカ・ドル 3,117 (-)

(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) 投資証券

(2023年4月18日から2023年10月16日まで)

		買付		売却	
		□数	金額	□数	金額
外国	アメリカ	千□ 3.011 (-)	千アメリカ・ドル 55 (-)	千□ 7.237 (-)	千アメリカ・ドル 129 (-)

(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。

■主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2023年4月18日から2023年10月16日まで)

当				期				
買		付		売		付		
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	
	千株	千円	円		千株	千円	円	
CANADIAN NATURAL RESOURCES (カナダ)	6.697	57,028	8,515	UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)	1.027	67,154	65,388	
CHEVRON CORP (アメリカ)	2.1	50,802	24,191	BAKER HUGHES CO (アメリカ)	11.817	61,932	5,240	
EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	3.485	49,358	14,163	BROADCOM INC (アメリカ)	0.434	54,769	126,195	
UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)	0.644	46,543	72,271	EXXON MOBIL CORP (アメリカ)	3.255	51,637	15,864	
IMPERIAL OIL LTD (カナダ)	5.121	45,218	8,829	CHEVRON CORP (アメリカ)	1.832	40,844	22,294	
ELI LILLY & CO (アメリカ)	0.477	41,205	86,384	DIAMONDBACK ENERGY INC (アメリカ)	2.063	39,173	18,988	
BECTON DICKINSON AND CO (アメリカ)	1.084	40,188	37,074	AT&T INC (アメリカ)	19.06	37,076	1,945	
VERIZON COMMUNICATIONS INC (アメリカ)	8.389	38,740	4,618	SKYWORKS SOLUTIONS INC (アメリカ)	2.403	36,793	15,311	
CUMMINS INC (アメリカ)	1.06	37,631	35,501	UNION PACIFIC CORP (アメリカ)	1.238	36,411	29,411	
FREEPORT-MCMORAN INC (アメリカ)	5.955	31,903	5,357	SUNCOR ENERGY INC (カナダ)	7.918	34,689	4,381	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) ハイブリッド優先証券

(2023年4月18日から2023年10月16日まで)

当				期				
買		付		売		付		
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	
	千証券	千円	円		千証券	千円	円	
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B (アメリカ)	11.96	41,042	3,431	RGA FR (アメリカ)	9.463	36,957	3,905	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K (アメリカ)	10.658	40,138	3,766	STATE STREET CORP 5.9 D (アメリカ)	7.689	27,911	3,630	
FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I (アメリカ)	7.5	27,393	3,652	WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC (アメリカ)	10.567	27,423	2,595	
MOMORGAN STANLEY FR (アメリカ)	6.964	26,532	3,809	BANK OF AMERICA CORP 6 GG (アメリカ)	6.588	23,620	3,585	
STATE STREET CORP 5.9 D (アメリカ)	7.094	24,794	3,495	WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z (アメリカ)	7.731	22,132	2,862	
ALLSTATE CORP 7.375 (アメリカ)	6.95	24,498	3,524	BANK OF AMERICA CORP 4.375 NN (アメリカ)	7.832	20,872	2,665	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC 7.625 (アメリカ)	6.428	23,800	3,702	ARCH CAPITAL GROUP LTD. 4.55 (バミューダ)	6.86	19,466	2,837	
NISOURCE INC 6.5 B (アメリカ)	5.896	21,704	3,681	STATE STREET CORP 5.35 G (アメリカ)	5.659	18,915	3,342	
CITIGROUP INC 7.125 J (アメリカ)	5.374	19,920	3,706	WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA (アメリカ)	6.579	18,315	2,783	
MORGAN STANLEY 6.875 F (アメリカ)	4.961	18,512	3,731	AT&T INC 5.625 (アメリカ)	4.823	16,213	3,361	

(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	
ABBOTT LABORATORIES	10.61	20.4	185	27,732	ヘルスケア
ADOBE INC	8.43	8.43	462	69,205	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	18.81	18.81	159	23,792	素材
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	8.89	7.68	219	32,797	素材
CITIGROUP INC	50.75	50.75	210	31,454	金融
DANAHER CORP	9.54	9.54	199	29,889	ヘルスケア
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	35.25	35.25	389	58,234	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	17.27	-	-	-	生活必需品
BUNGE LTD	-	16.95	173	25,907	生活必需品
APPLE INC	110.02	110.02	1,967	294,369	情報技術
BECTON DICKINSON AND CO	-	10.84	280	41,952	ヘルスケア
NISOURCE INC	59.84	58.85	151	22,696	公益事業
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	34.67	34.67	142	21,358	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	50.93	134.82	413	61,858	コミュニケーション・サービス
JPMORGAN CHASE & CO	45.9	30.77	455	68,127	金融
SERVICENOW INC	6.08	6.08	334	49,995	情報技術
CATERPILLAR INC	7.81	7.81	209	31,305	資本財・サービス
MORGAN STANLEY	35.53	35.53	276	41,347	金融
BROADCOM INC	15.41	11.07	977	146,260	情報技術
DEERE & CO	8.34	8.34	317	47,493	資本財・サービス
CONSOLIDATED EDISON INC	-	21.19	186	27,902	公益事業
TELEFLEX INC	9.71	-	-	-	ヘルスケア
COLGATE-PALMOLIVE CO	27.6	27.6	195	29,294	生活必需品
COSTCO WHOLESALE CORP	6.97	6.97	395	59,105	生活必需品
CUMMINS INC	-	10.6	241	36,110	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	12.31	-	-	-	エネルギー
CSX CORP	83.77	83.77	260	39,024	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	13.4	11.17	225	33,681	ヘルスケア
AMAZON.COM INC	62.83	72.73	943	141,216	一般消費財・サービス
EXXON MOBIL CORP	19.92	22.22	244	36,522	エネルギー
FORD MOTOR CO	102.76	102.76	121	18,155	一般消費財・サービス
NEXTERA ENERGY INC	28.71	28.71	156	23,403	公益事業
FREEPORT-MCMORAN INC	-	44.83	158	23,774	素材
GENERAL MOTORS CO	39.82	39.82	118	17,668	一般消費財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	11.64	11.64	360	53,859	金融
ALPHABET INC-CL A	71.3	71.3	979	146,514	コミュニケーション・サービス
HOME DEPOT INC	8.39	8.39	244	36,640	一般消費財・サービス
HUMANA INC	-	3.39	171	25,659	ヘルスケア
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	-	107.88	177	26,596	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20.33	20.33	281	42,110	情報技術
JOHNSON & JOHNSON	30.56	23.47	368	55,071	ヘルスケア
KLA CORP	8.59	4.84	235	35,248	情報技術
ELI LILLY & CO	-	4.77	290	43,472	ヘルスケア
MCDONALD'S CORP	18.72	18.72	464	69,539	一般消費財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	32.79	32.79	1,031	154,367	コミュニケーション・サービス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6.78	8.94	257	38,537	情報技術
BAKER HUGHES CO	46.23	-	-	-	エネルギー
MERCK & CO. INC.	21.48	21.48	223	33,422	ヘルスケア
NIKE INC-CL B	34.06	24.01	239	35,886	一般消費財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	26.3	33.22	306	45,850	生活必需品
EVERGY INC	36.49	-	-	-	公益事業
PFIZER INC	22.15	22.15	71	10,640	ヘルスケア
DOW INC	23.77	23.77	118	17,683	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		
PROCTER & GAMBLE CO/THE	28.29	32.13	464	69,547	生活必需品	
PEPSICO INC	14.14	14.14	226	33,845	生活必需品	
CHEVRON CORP	25.49	28.17	462	69,138	エネルギー	
TESLA INC	16.08	16.08	403	60,408	一般消費財・サービス	
AT&T INC	190.6	-	-	-	コミュニケーション・サービス	
UNION PACIFIC CORP	12.38	-	-	-	資本財・サービス	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	21.94	21.94	340	50,900	資本財・サービス	
UNITEDHEALTH GROUP INC	8.65	4.82	259	38,894	ヘルスケア	
ELEVANCE HEALTH INC	7.84	7.84	356	53,260	ヘルスケア	
WALT DISNEY CO/THE	30.22	20.54	173	25,918	コミュニケーション・サービス	
WASTE MANAGEMENT INC	20.93	20.93	332	49,725	資本財・サービス	
WALMART INC	14.03	14.03	224	33,546	生活必需品	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14.03	14.03	299	44,756	金融	
VISA INC-CLASS A SHARES	15.52	15.52	368	55,182	金融	
PPL CORP	29.37	29.37	70	10,496	公益事業	
NVIDIA CORP	15.53	15.53	706	105,618	情報技術	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	6.7	-	-	-	金融	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	6.26	3.43	165	24,776	ヘルスケア	
MASTERCARD INC - A	9.24	9.24	367	55,019	金融	
ONEOK INC	12.73	12.73	87	13,163	エネルギー	
BANK OF AMERICA CORP	140.12	140.12	374	56,094	金融	
ADVANCED MICRO DEVICES	19.93	25.53	268	40,136	情報技術	
KENVUE INC	-	56.94	110	16,499	生活必需品	
VERALTO CORP	-	0.01	0	10	資本財・サービス	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	24.03	-	-	-	情報技術	
EATON CORP PLC	25.21	25.21	525	78,671	資本財・サービス	
BARRICK GOLD CORP	103.09	60.52	95	14,250	素材	
GILEAD SCIENCES INC	-	24.56	190	28,529	ヘルスケア	
CARDINAL HEALTH INC	41.81	41.81	389	58,307	ヘルスケア	
TARGET CORP	12.53	-	-	-	生活必需品	
MICROSOFT CORP	61.73	61.73	2,023	302,652	情報技術	
MEDTRONIC PLC	32.62	17.92	128	19,291	ヘルスケア	
CHUBB LTD	9.92	9.92	209	31,304	金融	
CLEVELAND-CLIFFS INC	81.94	54.64	82	12,392	素材	
COMCAST CORP-CLASS A	43.33	61.13	267	40,064	コミュニケーション・サービス	
アメリカ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,457.69 77銘柄	2,390.58 78銘柄	26,571	3,975,148 <72.9%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
IMPERIAL OIL LTD	-	51.21	424	46,566	エネルギー	
SUNCOR ENERGY INC	51.53	-	-	-	エネルギー	
TC ENERGY CORP	-	35.47	169	18,616	エネルギー	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	-	36.71	334	36,679	エネルギー	
ENBRIDGE INC	37.41	-	-	-	エネルギー	
カナダ・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	88.94 2銘柄	123.39 3銘柄	929	101,861 <1.9%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,546.63 79銘柄	2,513.97 81銘柄	-	4,077,010 <74.7%>	

(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) ハイブリッド優先証券

銘柄	期首		当 期		期 末	
	証 券 数	証 券 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額
			千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)	千証券	千証券	千アメリカ・ドル	千円		
SCE TRUST IV FR	-	2,828	54	8,186		
SCE TRUST V 5.45 K	-	4,103	87	13,018		
STATE STREET CORP 5.35 G	3,435	-	-	-		
MORGAN STANLEY 5.85 K	1,933	1,933	42	6,338		
AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	6,877	2,72	51	7,776		
AT&T INC 5.35	-	3,943	83	12,416		
BANK OF AMERICA CORP 6 GG	6,887	3,651	85	12,846		
METLIFE INC 5.625 E	-	2,277	50	7,514		
RENAISSANCE HOLDINGS L 5.75 F	4,535	4,265	89	13,341		
BANK OF AMERICA CORP 5.875 HH	4,965	3,819	85	12,837		
AT&T INC 5.625	4,823	-	-	-		
JPMORGAN CHASE & CO 5.75 DD	4,796	4,796	113	16,975		
NISOURCE INC 6.5 B	2,81	8,706	217	32,586		
JPMORGAN CHASE & CO 6 EE	5,388	3,649	89	13,445		
CMS ENERGY CORP 5.875	12,484	12,484	277	41,516		
NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.65 N	-	2,22	51	7,738		
REGIONS FINANCIAL CORP 5.7 C	1,39	6,041	109	16,348		
ALGONQUIN PWR & UTILITY 6.219-A	9,83	9,83	234	35,146		
ATHENE HOLDING LTD 6.35 A	1.1	1.1	23	3,442		
BANK OF AMERICA CORP 5.375 KK	9,586	10,786	226	33,820		
ALLSTATE CORP 5.1 H	3,069	4,102	77	11,573		
ENSTAR GROUP LTD FR	-	3,906	91	13,650		
SEMPRA 5.75	6,407	6,407	141	21,230		
AMERICAN FINANCIAL GROUP 5.125	4,97	4,604	88	13,299		
BERKLEY (WR) CORPORATION 5.1	4,992	4,569	89	13,451		
SOUTHERN CO 4.95 2020	3,781	3,781	73	11,058		
WELLS FARGO & COMPANY 4.75 Z	13,547	5,816	103	15,504		
FIRST HORIZON CORP 6.5	0,044	-	-	-		
ATHENE HOLDING LTD 6.375 C	5,492	8,166	192	28,867		
TRUIST FINANCIAL CORP 4.75 R	0,328	2,849	50	7,616		
UNITED STATES CELLULAR C 6.25	1,403	1,403	24	3,654		
AMERICAN FINANCIAL GROUP 4.5	-	5,3	91	13,756		
BROOKFIELD FINANCE INC 4.625 50	3,167	3,167	47	7,064		
WELLS FARGO & COMPANY 4.7 AA	13,524	8,729	154	23,178		
BANK OF AMERICA CORP 4.375 NN	4,493	2,986	49	7,424		
BANK OF AMERICA CORP 4.125 PP	12,288	7,37	115	17,343		
WELLS FARGO & COMPANY 4.375 CC	13,615	3,048	49	7,441		
US BANCORP 4 M	-	2,31	33	4,948		
WASHINGTON FEDERAL INC 4.875 A	4,812	-	-	-		
FIRST HORIZON CORP 6.1 D	2,156	3,277	74	11,201		
JPMORGAN CHASE & CO 4.55 JJ	12,6	8,36	157	23,487		
JPMORGAN CHASE & CO 4.625 LL	8,403	8,246	157	23,537		
JPMORGAN CHASE AND CO DS REPSTG T 4.2	-	2,9	50	7,544		
RENAISSANCE HOLDINGS LTD 4.2	-	0,961	15	2,282		
BANK OF AMERICA CORP 4.75	-	1,161	21	3,183		
KEMPER CORP FR	0,888	-	-	-		
WESCO INTERNATIONAL INC FR	5,224	5,224	137	20,538		
WTFNL FR	1,744	-	-	-		
MORGAN STANLEY DEP REPSTG SH NON 6.5	2,704	0,689	17	2,575		
PRUDENTIAL FINANCIAL INC 5.95	1,269	-	-	-		

銘柄	期首		当 期		期 末	
	証 券 数	証 券 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額
			千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)	千証券	千証券	千アメリカ・ドル	千円		
ARCH CAPITAL GROUP LTD. 4.55	4,47	0,342	5	868		
RG A FR	12,175	2,712	69	10,382		
AQNCN FR	0,703	4,905	122	18,359		
LINCOLN NATIONAL CORPORATION 9	4,9	4,9	128	19,212		
ATHENE HLDG LTD DEP SHR REPSTG I	3,25	3,25	80	11,989		
WR BERKLEY CORPORATION 4.125	4,917	3,226	52	7,914		
ALLSTATE CORP 7.375	-	3,154	82	12,324		
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC 7.625	-	6,428	166	24,867		
GOLDMAN SACHS GROUP INC FR J	6,027	-	-	-		
CITIGROUP INC 6.875 K	-	4,118	104	15,598		
FIFTH THIRD BANCORP 6.625 I	4,782	8,953	222	33,229		
MORGAN STANLEY 6.875 F	1,589	6,55	163	24,408		
REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 B	-	9,46	210	31,531		
WELLS FARGO & COMPANY 6.625 R	4,822	7,873	198	29,633		
GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K	2,732	11,331	286	42,852		
ALLSTATE CORP FR	1,591	4,257	107	16,144		
MOMORGAN STANLEY FR	-	6,964	174	26,045		
MORGAN STANLEY 6.375 I	5,449	4,091	97	14,523		
STATE STREET CORP 5.9 D	4,189	3,594	90	13,495		
WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	3,258	-	-	-		
CITIGROUP INC 7.125 J	0,269	5,643	143	21,442		
合 計	証券数、金額 銘柄数<比率>	276,882 300,233	6,587 62銘柄	985,536 <18.1%>		

(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) 外国投資証券

銘柄	期首		当 期		期 末	
	口 数	口 数	評 価 額		外貨建金額	邦貨換算金額
			千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円		
DIGITALBRIDGE GROUP INC 7.125 J	7,569	7,569	158	23,722		
PUBLIC STORAGE 4.625 L	8,468	5,992	113	17,049		
AGREE RLT DEPOSITARY SHS 4.25	1,75	-	-	-		
合 計	口数、金額 銘柄数<比率>	17,787 13,561	272 2銘柄	40,771 <0.7%>		

(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。

ダイワ北米好配当株マザーファンド

■投資信託財産の構成

2023年10月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	4,077,010	74.7
公社債	985,536	18.1
投資証券	40,771	0.7
コール・ローン等、その他	356,485	6.5
投資信託財産総額	5,459,804	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、10月16日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.60円、1カナダ・ドル=109.57円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(5,372,361千円)の投資信託財産総額(5,459,804千円)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10月16日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	5,459,804,491円
コール・ローン等	345,688,375
株式(評価額)	4,077,010,481
公社債(評価額)	985,536,968
投資証券(評価額)	40,771,831
未収入金	3,185,285
未収配当金	4,354,042
未収利息	3,257,509
(B) 負債	4,215,000
未払解約金	4,215,000
(C) 純資産総額(A - B)	5,455,589,491
元本	1,022,018,282
次期繰越損益金	4,433,571,209
(D) 受益権総口数	1,022,018,282口
1万口当り基準価額(C/D)	53,381円

* 期首における元本額は1,047,088,606円、当作成期間中における追加設定元本額は29,400,181円、同解約元本額は54,470,505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：

安定重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	5,133,235円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	3,726,684円
成長重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	68,400,657円
ダイワ資産分散インカムオープン (奇数月決算型)	10,454,540円
D/Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	135,275,827円
D/Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	267,330,029円
D/Cダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	531,697,310円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は53,381円です。

■損益の状況

当期 自2023年4月18日 至2023年10月16日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	70,200,228円
受取配当金	34,985,852
受取利息	35,229,064
支払利息	△ 14,688
(B) 有価証券売買損益	690,273,536
売買益	991,393,833
売買損	△ 301,120,297
(C) その他費用	△ 597,900
(D) 当期損益金(A + B + C)	759,875,864
(E) 前期繰越損益金	3,775,443,592
(F) 解約差損益金	△ 221,662,066
(G) 追加信託差損益金	119,913,819
(H) 合計(D + E + F + G)	4,433,571,209
次期繰越損益金(H)	4,433,571,209

(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。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

運用報告書 第36期（決算日 2023年10月16日）

（作成対象期間 2023年4月18日～2023年10月16日）

ダイワ欧州好配当株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。

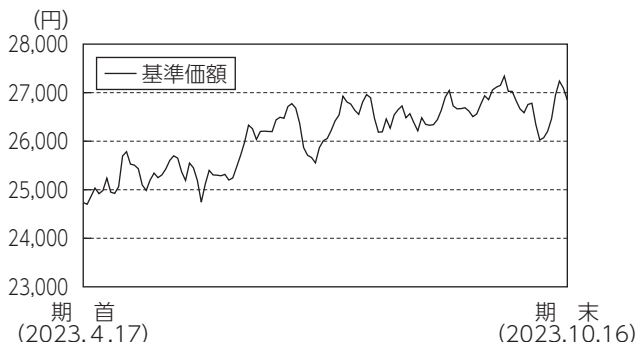
運用方針	欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	欧州の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
株式組入制限	無制限

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ヨーロッパ指数 (税引後配当込み、円換算)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
	円	%	騰落率 (参考指数)	騰落率	%	%
(期首)2023年 4月17日	24,735	-	26,907	-	93.8	-
4月末	25,065	1.3	27,010	0.4	95.6	-
5月末	25,192	1.8	27,146	0.9	93.7	-
6月末	26,472	7.0	28,548	6.1	95.4	-
7月末	26,808	8.4	29,002	7.8	96.9	-
8月末	27,044	9.3	29,201	8.5	96.6	-
9月末	26,757	8.2	28,260	5.0	95.7	-
(期末)2023年10月16日	26,850	8.6	28,221	4.9	97.1	-

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) MSCIヨーロッパ指数 (税引後配当込み、円換算) は、MSCI Inc. (「MSCI」) の承諾を得て、MSCIヨーロッパ指数 (税引後配当込み、ユーロベース) 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ヨーロッパ指数 (税引後配当込み、ユーロベース) は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。 (<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>)

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

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

(注5) 株式先物比率は買建比率 - 売建比率です。

※参考指数を「MSCIヨーロッパ指数 (配当込み、円換算)」から「MSCIヨーロッパ指数 (税引後配当込み、円換算)」に変更しました。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：24,735円 期末：26,850円 騰落率：8.6%

【基準価額の主な変動要因】

欧州の株式に投資した結果、保有株式が直上がりしたことや、ユーロが対円で上昇 (円安) したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○欧州株式市況

欧州株式市場は下落しました。

欧州株式市場は、当作成期首から2023年6月にかけては、米国における債務上限問題への懸念を受けて米国株式市場が上値の重い展開となったことが重しとなったほか、欧州の各国中央銀行が相次いで利上げに踏み切ったことなどを受けて、冴えない動きとなりました。7月に入ると、米国においてCPI (消費者物価指数) が市場予想を下回り、金融引き締め観測が後退したことなどを受けて、上昇に転じました。8月から当作成期末にかけては、原油価格が上昇に転じたことやFRB (米国連邦準備制度理事会) の政策金利見通しが引き上げられ高水準の政策金利が長期化するとの見方が強まったこと、根強い中国不動産市場への懸念などを受けて、下落しました。なお、本ファンドが組み入れる欧州株式ポートフォリオは小幅ながら上昇しました。

○為替相場

ユーロは対円で上昇しました。

ユーロ円為替相場は、当作成期首より、ECB (欧州中央銀行) 高官からの利上げ継続を示唆する発言などを背景に上昇してまいりました。2023年6月に入ると、ECBが理事会で政策金利の引上げを決定した一方で、日銀は現状の金融緩和政策の維持を決定したことから、ユーロは対円での上昇幅を拡大しました。その後、日銀の政策修正期待を背景に円が買われる局面もありましたが、インフレ抑制を目的としたECBによる金融引き締めは長期化するとの見方からユーロは買い戻され、当作成期末にかけてユーロ円為替相場はおおむね狭いレンジ内での推移となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・アイルランドに運用の指図にかかるとの権限を委託し、運用を行ってまいります。銘柄選定では、収益基盤が強固で、安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

※アムンディ・アイルランド：アムンディ・アイルランド・リミテッド

◆ポートフォリオについて

当ファンドは、外貨建資産の運用にあたって、アムンディ・アイルランドに運用の指図にかかる権限を委託しております。

株式組入比率は高位を維持しました。銘柄選定にあたって、アムンディ・アイルランドは、収益基盤が強固で安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資しました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標標準となるベンチマークを設けておりません。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。参考指数は欧州株式市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。

《今後の運用方針》

外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・アイルランドに運用の指図にかかるとの権限を委託し、運用を行ってまいります。銘柄選定では、収益基盤が強固で、安定した配当を継続できる銘柄や、収益改善が見込まれる銘柄に選別投資する方針です。

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式)	0円 (0)
有価証券取引税	-
その他費用 (保管費用) (その他)	10 (9) (0)
合計	10

(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

株式

(2023年4月18日から2023年10月16日まで)

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外	イギリス	百株 (-)	千イギリス・ポンド (-)	百株 118.95	千イギリス・ポンド 54
	スイス	百株 (8.99)	千スイス・フラン (-)	百株 3.67	千スイス・フラン 57
国	デンマーク	百株 (-)	千デンマーク・クローネ 782 (-)	百株 -	千デンマーク・クローネ -

■ 主要な売買銘柄

株式

(2023年4月18日から2023年10月16日まで)

当				期				
買		付		売			付	
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	
NOVO NORDISK A/S-B (デンマーク)	千株 1.232	千円 16,505	円 13,397	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG (ドイツ)	千株 3.305	千円 10,377	円 3,139	
				TOTALENERGIES SE (フランス)	千株 1.075	千円 9,957	円 9,262	
				MUENCHENER RUECKVER AG-REG (ドイツ)	千株 0.179	千円 9,904	円 55,334	
				NESTLE SA-REG (スイス)	千株 0.167	千円 2,905	円 17,397	
				SCHNEIDER ELECTRIC SE (フランス)	千株 0.081	千円 2,025	円 25,009	
				SIEMENS AG-REG (ドイツ)	千株 0.084	千円 1,920	円 22,862	
				NOVARTIS AG-REG (スイス)	千株 0.132	千円 1,907	円 14,447	
				ZURICH INSURANCE GROUP AG (スイス)	千株 0.027	千円 1,862	円 68,988	
				SANOFI (フランス)	千株 0.117	千円 1,786	円 15,273	
				ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN (スイス)	千株 0.039	千円 1,741	円 44,642	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

		買付		売付		
		株数	金額	株数	金額	
外	スウェーデン	百株 (-)	千スウェーデン・クローネ (-)	百株 0.75	千スウェーデン・クローネ 11	
	ユーロ (オランダ)	百株 (-)	千ユーロ (-)	百株 28.45	千ユーロ 14	
	ユーロ (フランス)	百株 (-)	千ユーロ (-)	百株 20.69	千ユーロ 120	
	ユーロ (ドイツ)	百株 (-)	千ユーロ (-)	百株 39.81	千ユーロ 171	
	ユーロ (スペイン)	百株 (-)	千ユーロ (-)	百株 2.57	千ユーロ 4	
	ユーロ (イタリア)	百株 (-)	千ユーロ (-)	百株 48.71	千ユーロ 21	
	国	ユーロ (ユーロ 通貨計)	百株 (-)	千ユーロ (-)	百株 140.23	千ユーロ 333

(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。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

■組入資産明細表

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	
(イギリス)	百株	百株	千円	千円	
SHELL PLC	124.08	120.54	328	59,624	エネルギー
UNILEVER PLC	47.36	46.02	180	32,836	生活必需品
PRUDENTIAL PLC	156.6	152.13	134	24,438	金融
AVIVA PLC	326.08	316.77	129	23,612	金融
GSK	134.19	130.36	196	35,770	ヘルスケア
M&G PLC	725.46	704.74	138	25,152	金融
TESCO PLC	933.08	906.43	249	45,395	生活必需品
VODAFONE GROUP PLC	1,072.47	1,041.83	80	14,626	コミュニケーション・サービス
NATIONAL GRID PLC	188.56	183.18	179	32,601	公益事業
HSBC HOLDINGS PLC	457.91	444.84	290	52,753	金融
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額 総額<比率>	4,165.79 10銘柄	4,046.84 10銘柄	1,908 346,812	<20.6%>
(スイス)	百株	百株	千円	千円	
SANDOZ GROUP AG	-	8.99	24	4,143	ヘルスケア
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	13.85	13.46	343	56,911	ヘルスケア
NESTLE SA-REG	58.85	57.18	589	97,712	生活必需品
ZURICH INSURANCE GROUP AG	9.53	9.26	396	65,718	金融
NOVARTIS AG-REG	46.3	44.98	393	65,261	ヘルスケア
GIVAUDAN-REG	0.81	0.79	228	37,914	素材
スイス・フラン通貨計	株数、金額 総額<比率>	129.34 5銘柄	134.66 6銘柄	1,976 327,663	<19.5%>
(デンマーク)	百株	百株	千円	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	-	12.32	882	18,625	ヘルスケア
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 総額<比率>	- 1銘柄	12.32 1銘柄	882 <1.1%>	
(スウェーデン)	百株	百株	千円	千円	
ELECTROLUX AB-SER B	26.23	25.48	288	3,922	一般消費・サービス
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 総額<比率>	26.23 1銘柄	25.48 1銘柄	288 <0.2%>	
(ユーロ(オランダ))	百株	百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	68.64	66.69	184	28,994	生活必需品
KONINKLIJKE DSM NV	18.45	18.45	210	33,109	素材
KONINKLIJKE KPN NV	927.64	901.14	285	44,863	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額 総額<比率>	1,014.73 3銘柄	986.28 3銘柄	679 106,967	<6.4%>
(ユーロ(フランス))	百株	百株	千ユーロ	千円	
TOTALENERGIES SE	66.45	55.7	351	55,364	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	90.94	88.35	256	40,357	一般消費・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	28.65	27.84	426	67,076	資本財・サービス
BNP PARIBAS	42.09	40.89	235	37,085	金融
CAPGEMINI SE	18.45	17.93	297	46,748	情報技術
AXA SA	127.93	124.28	348	54,774	金融
SANOFI	41.07	39.9	412	64,904	ヘルスケア
国小計	株数、金額 総額<比率>	415.58 7銘柄	394.89 7銘柄	2,328 366,311	<21.8%>
(ユーロ(ドイツ))	百株	百株	千ユーロ	千円	
SIEMENS AG-REG	29.54	28.7	383	60,278	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	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	百株	百株	千ユーロ	千円	一般消費・サービス
BASF SE	31.61	30.71	300	47,239	素材
ALLIANZ SE-REG	38.78	37.68	158	24,925	金融
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	12.08	11.74	261	41,157	金融
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	10.94	9.15	345	54,408	金融
DHL GROUP	223.08	190.03	387	60,983	コミュニケーション・サービス
国小計	株数、金額 総額<比率>	62.87 7銘柄	61.08 7銘柄	237 326,408	<19.4%>
(ユーロ(スペイン))	百株	百株	千ユーロ	千円	
ENAGAS SA	90.15	87.58	141	22,214	公益事業
国小計	株数、金額 総額<比率>	90.15 1銘柄	87.58 1銘柄	141 22,214	<1.3%>
(ユーロ(イタリア))	百株	百株	千ユーロ	千円	
INTESA SANPAOLO	1,060.84	1,030.53	247	39,014	金融
ENI SPA	136.46	132.57	205	32,328	エネルギー
ENEL SPA	508.01	493.5	282	44,440	公益事業
国小計	株数、金額 総額<比率>	1,705.31 3銘柄	1,656.6 3銘柄	735 115,783	<6.9%>
ユーロ通貨計	株数、金額 総額<比率>	3,634.67 21銘柄	3,494.44 21銘柄	5,959 937,686	<55.7%>
ファンド合計	株数、金額 総額<比率>	7,956.03 37銘柄	7,713.74 39銘柄	- 1,634,709	<97.1%>

(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。

■投資信託財産の構成

2023年10月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 1,634,709	% 96.9
コール・ローン等、その他	52,166	3.1
投資信託財産総額	1,686,875	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、10月16日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.60円、1イギリス・ポンド=181.72円、1スイス・フラン=165.78円、1デンマーク・クローネ=21.10円、1ノルウェー・クローネ=13.68円、1スウェーデン・クローネ=13.58円、1ユーロ=157.35円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(1,675,891千円)の投資信託財産総額(1,686,875千円)に対する比率は、99.3%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年10月16日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,686,875,898円
コール・ローン等	50,561,485
株式(評価額)	1,634,709,346
未収配当金	1,605,067
(B) 負債	3,433,000
未払解約金	3,433,000
(C) 純資産総額(A-B)	1,683,442,898
元本	626,973,286
次期繰越損益金	1,056,469,612
(D) 受益権総口数	626,973,286口
1万口当り基準価額(C/D)	26,850円

* 期首における元本額は686,970,902円、当作成期間中における追加設定元本額は24,139,645円、同解約元本額は84,137,261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：

安定重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	10,166,436円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	7,398,359円
成長重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	135,867,417円
ダイワ資産分散インカムオープン (奇数月決算型)	20,829,809円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	65,561,785円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	129,703,659円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	257,445,821円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は26,850円です。

■損益の状況

当期 自2023年4月18日 至2023年10月16日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	39,089,244円
受取配当金	38,280,825
受取利息	811,665
支払利息	△ 3,246
(B) 有価証券売買損益	101,347,251
売買益	174,700,873
売買損	△ 73,353,622
(C) その他費用	△ 625,928
(D) 当期損益金(A+B+C)	139,810,567
(E) 前期繰越損益金	1,012,246,298
(F) 解約差損益金	△ 133,960,608
(G) 追加信託差損益金	38,373,355
(H) 合計(D+E+F+G)	1,056,469,612
次期繰越損益金(H)	1,056,469,612

(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・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

運用報告書 第36期 (決算日 2023年10月16日)

(作成対象期間 2023年4月18日～2023年10月16日)

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株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。

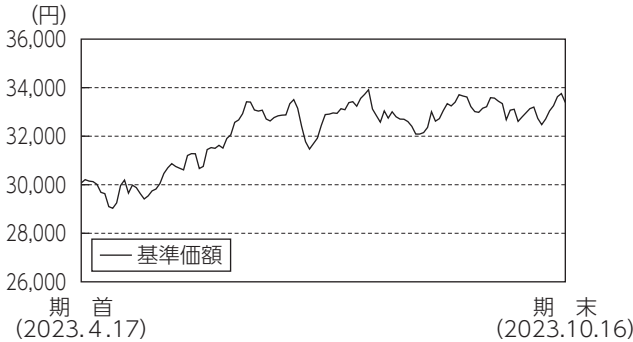
運用方針	アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	アジア・オセアニアの金融商品取引所上場株式および店頭登録株式
株式組入制限	無制限

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パシフィック指数 (除く日本、税引後配当込み、円換算)		株式組入比率		株式先物比率		投資証券比率	
	円	%	騰落率 (参考指数)	%	%	%	%	%	%	
期首)2023年4月17日	30,074	-	34,681	-	98.2	-	-	-	-	
4月末	29,251	△ 2.7	34,023	△1.9	97.8	-	-	-	-	
5月末	31,277	4.0	34,147	△1.5	97.1	-	-	-	-	
6月末	32,867	9.3	36,030	3.9	97.6	-	-	-	-	
7月末	33,559	11.6	36,389	4.9	98.1	-	-	-	-	
8月末	33,341	10.9	35,808	3.2	97.1	-	-	-	-	
9月末	32,962	9.6	35,076	1.1	96.9	-	-	-	-	
期末)2023年10月16日	33,390	11.0	35,028	1.0	97.0	-	-	-	-	

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：30,074円 期末：33,390円 騰落率：11.0%

【基準価額の主な変動要因】

アジア・オセアニア地域の通貨が円に対して上昇(円安)したことや、台湾および韓国のテック株を中心に保有株式が上昇したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○アジア・オセアニア株式市況

アジア・オセアニア株式市況は下落しました。

アジア・オセアニア株式市況は、当作成期首より2023年5月半ばにかけて、世界的な景気減速懸念などを背景に、下落基調で推移しました。その後7月下旬にかけては、半導体市況の回復期待やAI(人工知能)関連ビジネスの拡大期待から、台湾や韓国が上昇しました。当作成期末にかけては、米国の金融引き締めの長期化観測や米国金利の上昇を受け、軟調に推移しました。

○為替相場

アジア・オセアニア地域の通貨は、対円で上昇しました。

アジア・オセアニア地域の通貨は、米国金利の上昇を背景に、対米ドルでは軟調に推移したものの、日米の金融政策のかい離が意識されたことなどから円安米ドル高が進行し、対円では上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンドでは、主としてオーストラリアや中国(香港)、台湾、韓国を中心にアジア・オセアニア地域に上場する株式へ投資し、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。

ポートフォリオの構築にあたっては、各国の投資比率の分散に配慮しつつ、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮して銘柄選択を行います。

◆ポートフォリオについて

オーストラリアや中国(香港)、台湾、韓国を中心に、高い利益成長が見込まれた銘柄や予想配当利回りが高いと判断された銘柄などを組み入れました。国別では、各国の投資比率の分散に配慮しつつ、オーストラリア、台湾、韓国を高位に組み入れました。セクター別では、情報技術や金融を高位に組み入れました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。

《今後の運用方針》

当ファンドでは、主としてオーストラリアや中国(香港)、台湾、韓国を中心にアジア・オセアニア地域に上場する株式へ投資し、安定的な配当等収益の確保と値上がり益の獲得による信託財産の中長期的な成長をめざします。

ポートフォリオの構築にあたっては、各国の投資比率の分散に配慮しつつ、企業のファンダメンタルズ、成長性を勘案し、予想配当利回りおよび各種バリュエーション指標や株価水準等を考慮して銘柄選択を行います。

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式)	33円 (33)
有価証券取引税 (株式)	13 (13)
その他費用 (保管費用) (その他)	57 (57) (1)
合計	104

(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

株式

(2023年4月18日から2023年10月16日まで)

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外	オーストラリア	百株 25.5 (-)	千オーストラリア・ドル 162 (-)	百株 157.4	千オーストラリア・ドル 552
	香港	百株 90 (-)	千香港ドル 333 (-)	百株 249	千香港ドル 877
	シンガポール	百株 35 (-)	千シンガポール・ドル 66 (-)	百株 115	千シンガポール・ドル 61
	台湾	百株 390 (-)	千台湾ドル 3,945 (△ 56)	百株 680	千台湾ドル 13,180
国	韓国	百株 18.1 (-)	千韓国ウォン 302,204 (-)	百株 165.25	千韓国ウォン 313,455

(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。

■ 主要な売買銘柄

株式

(2023年4月18日から2023年10月16日まで)

当				期			
買	付			売	付		
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
POSCO (韓国)	千株 0.16	千円 9,001	円 56,256	QUANTA COMPUTER INC (台湾)	千株 25	千円 26,212	円 1,048
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE (台湾)	27	7,745	286	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	5	13,082	2,616
NAVER CORP (韓国)	0.25	5,370	21,481	WOORI FINANCIAL GROUP INC (韓国)	7.3	9,959	1,364
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD (韓国)	0.68	5,143	7,564	INDUSTRIAL BANK OF KOREA (韓国)	7.7	9,660	1,254
LG CHEM LTD (韓国)	0.08	5,015	62,688	FORTESCUE METALS GROUP LTD (オーストラリア)	4.7	9,268	1,972
SK INNOVATION CO LTD (韓国)	0.29	4,623	15,943	BHP GROUP LTD (オーストラリア)	1.75	7,365	4,208
EVERGREEN MARINE CORP LTD (台湾)	9	4,352	483	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD (韓国)	0.86	6,839	7,952
DBS GROUP HOLDINGS LTD (シンガポール)	1	3,703	3,703	AIA GROUP LTD (香港)	4.4	6,365	1,446
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP (シンガポール)	2.5	3,550	1,420	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL (オーストラリア)	0.56	5,261	9,395
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD (香港)	8	3,323	415	WESFARMERS LTD (オーストラリア)	1.1	5,193	4,721

(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
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	
(オーストラリア)	百株	百株	千円	千円	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	73	65.5	168	15,883	金融
BHP GROUP LTD	101.5	89.5	402	37,995	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	44.78	37.78	135	12,739	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	47	—	—	—	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	72	63	184	17,422	金融
WESTPAC BANKING CORP	83	70	150	14,181	金融
RIO TINTO LTD	12	13.7	157	14,826	素材
ORIGIN ENERGY LTD	104	90	83	7,869	公益事業
SEEK LTD	34	28	64	6,100	コミュニケーション・サービス
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	32	28.9	291	27,522	金融
MACQUARIE GROUP LTD	9.2	10.2	173	16,351	金融
CSL LTD	10.2	8.7	210	19,808	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	46.3	39.8	210	19,839	一般消費・サービス
MINERAL RESOURCES LTD	8	—	—	—	素材
オーストラリア・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	676.98 14銘柄	545.08 12銘柄	2,232 <30.8%>	210,540
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	100	80	299	5,728	公益事業
SUN HUNG KAI PROPERTIES	60	55	459	8,791	不動産
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	30	29	847	16,212	金融
AIA GROUP LTD	246	208	1,420	27,162	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	150	—	—	—	資本財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	25	25	184	3,527	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	215	270	579	11,073	金融
香港・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	826 7銘柄	667 6銘柄	3,791 <10.6%>	72,496
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	48	50	168	18,440	金融
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	95	111	144	15,734	金融
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	696	598	142	15,543	コミュニケーション・サービス
シンガポール・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	839 3銘柄	759 3銘柄	455 <7.3%>	49,718
(台湾)	百株	百株	千台湾ドル	千円	
ASIA CEMENT CORP	860	710	2,882	13,380	素材
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	200	180	2,097	9,733	情報技術
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	—	270	1,695	7,870	素材
DELTA ELECTRONICS INC	80	70	2,299	10,673	情報技術
ACCTON TECHNOLOGY CORP	—	10	545	2,529	情報技術
QUANTA COMPUTER INC	310	70	1,582	7,343	情報技術
MEDIATEK INC	50	40	3,368	15,633	情報技術
EVERGREEN MARINE CORP LTD	—	90	945	4,386	資本財・サービス
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	40	40	1,746	8,104	情報技術
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	80	60	1,014	4,706	情報技術
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	40	—	—	—	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	270	230	12,719	59,037	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY	400	340	3,655	16,965	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	
ASUSTEK COMPUTER INC	百株	百株	千台湾ドル	千円	情報技術
UNITED MICROELECTRONICS CORP	80	70	2,555	11,859	情報技術
台湾・ドル 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	2,990 12銘柄	2,700 14銘柄	39,547 <26.8%>	183,568
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
KIA CORP	11.5	11.5	96,830	10,709	一般消費・サービス
SK HYNIX INC	11	12	149,640	16,550	情報技術
LG CORP	12	9	74,790	8,271	資本財・サービス
POSCO	—	1.6	81,920	9,060	素材
WOORI FINANCIAL GROUP INC	73	—	—	—	金融
SAMSUNG SDS CO LTD	8	7	94,850	10,490	情報技術
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	77	—	—	—	金融
KT&G CORP	13	13	113,100	12,508	生活必需品
NAVER CORP	—	2.5	47,950	5,303	コミュニケーション・サービス
LG CHEM LTD	1	1.65	87,120	9,635	素材
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	82.6	80.8	549,440	60,768	情報技術
SK INNOVATION CO LTD	—	2.9	42,659	4,718	エネルギー
韓国ウォン 通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	289.1 9銘柄	141.95 10銘柄	1,338,299 <21.6%>	148,015
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	5,621.08 45銘柄	4,813.03 45銘柄	— <97.0%>	664,339

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

■投資信託財産の構成

2023年10月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	664,339	94.8
コール・ローン等、その他	36,449	5.2
投資信託財産総額	700,788	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、10月16日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=149.60円、1オーストラリア・ドル=94.32円、1香港ドル=19.12円、1シンガポール・ドル=109.21円、1台湾ドル=4.641円、100韓国ウォン=11.06円、1オフショア人民元=20.456円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(683,882千円)の投資信託財産総額(700,788千円)に対する比率は、97.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年10月16日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	700,788,987円
コール・ローン等	36,449,215
株式(評価額)	664,339,772
(B) 負債	16,104,013
未払金	15,739,013
未払解約金	365,000
(C) 純資産総額(A - B)	684,684,974
元本	205,057,082
次期繰越損益金	479,627,892
(D) 受益権総口数	205,057,082口
1万口当り基準価額(C / D)	33,390円

* 期首における元本額は235,103,916円、当作成期間中における追加設定元本額は12,648,788円、同解約元本額は42,695,622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：
 安定重視ポートフォリオ (奇数月分配型) 8,240,971円
 インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型) 6,147,132円
 成長重視ポートフォリオ (奇数月分配型) 110,470,704円
 ダイワ資産分散インカムオープン (奇数月決算型) 16,768,695円
 DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース) 9,195,697円
 DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース) 18,212,315円
 DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース) 36,021,568円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は33,390円です。

■損益の状況

当期 自2023年4月18日 至2023年10月16日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	16,980,013円
受取配当金	16,958,113
受取利息	23,758
支払利息	△ 1,858
(B) 有価証券売買損益	60,224,716
売買益	97,399,551
売買損	△ 37,174,835
(C) その他費用	△ 1,249,173
(D) 当期損益金(A + B + C)	75,955,556
(E) 前期繰越損益金	471,947,147
(F) 解約差損益金	△ 96,322,023
(G) 追加信託差損益金	28,047,212
(H) 合計(D + E + F + G)	479,627,892
次期繰越損益金(H)	479,627,892

(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。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

運用報告書 第37期 (決算日 2023年10月16日)

(作成対象期間 2023年4月18日～2023年10月16日)

ダイワ好配当日本株マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

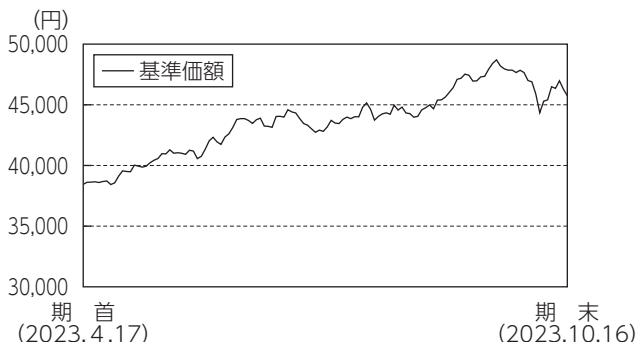
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）
株式組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		TOPIX (配当込み)		株 式 組 込 率	株 式 先 比
	円	%	騰落率 (参考指数)	騰落率		
(期首)2023年 4月17日	38,446	-	3,363.69	-	92.0	2.0
4 月末	39,125	1.8	3,414.45	1.5	92.5	2.9
5 月末	40,562	5.5	3,537.93	5.2	94.8	1.0
6 月末	43,987	14.4	3,805.00	13.1	93.7	1.8
7 月末	44,798	16.5	3,861.80	14.8	95.6	1.2
8 月末	46,020	19.7	3,878.51	15.3	93.9	1.9
9 月末	47,004	22.3	3,898.26	15.9	92.0	2.5
(期末)2023年10月16日	45,749	19.0	3,814.63	13.4	94.3	1.3

(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。

《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：38,446円 期末：45,749円 騰落率：19.0%

【基準価額の主な変動要因】

国内株式市況は、日本の経済活動正常化への期待や、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上昇しました。このような投資環境を受けて、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ベンチマークとの差異について」をご参照ください。

◆ 投資環境について

○ 国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、経済活動正常化や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたこと、日銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調したこと、米国著名投資家の強見通しにより海外投資家の資金が大量に流入したことなどから、大幅に上昇しました。2023年7月に入り、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇、中国の不動産大手の債務不履行懸念などから下落する場面もありましたが、8月半ばに発表された2023年4-6月期GDP（国内総生産）成長率が予想を上回る高い伸びとなったことなどが好感され、9月中旬にかけて再び上昇しました。その後、米国における長期金利の上昇や政府機関の閉鎖などが懸念されて反落し、当作成期末を迎えました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

欧米金融機関の信用不安の動向、米国のインフレや景気動向が不安材料となる一方で、国内経済活動の正常化や中国・欧州の経済の回復期待などが株価の下支えとなると考えます。東京証券取引所より、割

安な株価水準にとどまる企業に対して、企業価値向上の取り組みや、その開示を求める方針が公表されました。上場企業全体に企業価値を意識した経営を促進することで、割安株の再評価につながる取り組みとして注目されます。

企業業績は、内需関連企業を中心に安定した推移が続くと予想され、配当や自社株買いなどの株主還元への拡充が進むと考えます。また、外需関連企業でも、中国や欧州における景気の底打ち、原材料などのコストのピークアウトなどが業績の下支えとなることから、2023年度の回復に注目します。個別銘柄の選別にあたりましては、中長期的な実力と株価との乖離が大きい企業や、持続的成長に向けた事業構造改革の進展や新規事業の成長に変化が見られる企業、経営陣が意思を持って株主還元策の向上に取り組む企業などに注目して調査を進めてまいります。

◆ ポートフォリオについて

配当利回りや企業業績のほか、PER（株価収益率）やPBR（株価純資産倍率）などのバリュエーション指標、株主還元や資本効率の向上に対する経営姿勢などにも注目し、投資します。

株式等の組入比率は、おおむね高位で推移させました。業種構成は、銀行業、輸送用機器、建設業などの組入比率を引き上げた一方、ガラス・土製品、電気機器、化学などの組入比率を引き下げました。当作成期末では、輸送用機器、銀行業、卸売業などを中心としたポートフォリオとしました。

個別銘柄では、業績の先行き不透明感などを考慮してAGCや伊藤忠、TDKなどを売却した一方で、三菱UFJフィナンシャルGや三菱重工業、本田技研などを買付けました。三菱UFJフィナンシャルGは、日銀の金融政策の見直しを背景にした株価の再評価への期待と、安定したキャッシュフローを背景にした継続的な株主還元の実施に注目しました。三菱重工業は、不採算事業の構造改革が一巡したことや、発電プラント分野や航空分野の成長と収益性の向上を評価しました。本田技研は、サプライチェーン（供給網）問題の解消による生産回復を通じた、北米事業の業績の回復とアジアの二輪事業の成長に注目しました。

◆ ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。

参考指数の騰落率を上回った輸送用機器をオーバーウエートとしていたことや、参考指数の騰落率を下回ったサービス業をアンダーウエートとしていたことなどがプラス要因となりました。一方、参考指数の騰落率を下回った非鉄金属や化学をオーバーウエートとしていたことなどはマイナス要因となりました。

個別銘柄では、三菱重工業や三菱UFJフィナンシャルGなどはプラスに寄りましたが、AGCや九州旅客鉄道などがマイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

米国景気や米ドル円の動向などは不透明ながら、株主還元強化への期待などにより相対的に安心感がある日本株は底堅い株価推移を予想します。今後の注目点は、2024年の春闘における賃上げ動向です。2023年に続き、来春の春闘においても、高い賃上げが実現すれば、賃金上昇を伴う適度な物価上昇と経済拡大の好循環への期待が高まり、株式市場はポジティブに評価すると考えられます。

2023年度の国内企業業績全体では堅調な推移が見込まれ、積極的な株主還元もすでに多く発表されるなど、自己株買いの金額や配当金総額は過去最高の水準が予想されます。個別銘柄の選別にあたりましては、そうした堅調な業績の背景にある中長期的な実力に対して、株価評価との乖離が大きい企業や、持続的成長に向けた事業構造改革の進展や新規事業の成長に変化が見られる企業、経営陣が意思を持って株主還元策の向上に取り組む企業などに注目して調査を進めてまいります。

■ 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)	69円 (69) (0)
有価証券取引税	-
その他費用	-
合 計	69

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2023年4月18日から2023年10月16日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
	千株	千円	千株	千円
国内	7,817.2 (5,240.4)	17,020,554 (-)	4,045.3	10,038,172

(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

(2023年4月18日から2023年10月16日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	2,843	2,861	-	-

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

株 式

(2023年4月18日から2023年10月16日まで)

当					期				
買		付			売		付		
銘	柄	株 数	金 額	平均単価	銘	柄	株 数	金 額	平均単価
		千株	千円	円			千株	千円	円
三菱UFJフィナンシャルG		625.4	689,166	1,101	AGC		127.5	649,661	5,095
三井住友フィナンシャルG		87	618,709	7,111	伊藤忠		106.5	557,693	5,236
本田技研		141.6	567,830	4,010	関西電力		264.6	526,218	1,988
トヨタ自動車		257.9	547,009	2,121	信越化学		85.5	399,337	4,670
三菱商事		77.6	498,912	6,429	T D K		79.5	395,331	4,972
東京海上HD		148.6	469,253	3,157	トヨタ紡織		133.5	351,719	2,634
フジクラ		387.6	468,850	1,209	MS & AD		69.4	347,661	5,009
大東建託		28.3	461,726	16,315	大阪瓦斯		151.5	338,270	2,232
三菱重工業		78.5	457,126	5,823	I H I		81.4	276,227	3,393
小松製作所		106.7	432,155	4,050	大阪ソーダ		44.1	260,377	5,904

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
鉱業 (1.0%)		千株	千株			千円	機械 (7.4%)		千株	千株		千円	伊藤忠		千株	千株		千円		
INPEX	-		134			285,621	ツガミ	106.7	-	-			伊藤忠	94.2	-	-	-	-	-	
建設業 (3.9%)							芝浦機械	-	66.4	257,964			豊田通商	-	17.7	147,954				
オリエンタル白石	294.4	-	-				オーエスジー	26.7	-	-			スターゼン	20.8	-	-				
大成建設	11.8	-	-				フリュー	48	-	-			三菱商事	74.5	152.1	1,080,366				
鹿島建設	-	163.8	392,874				小松製作所	116.7	223.4	853,611			阪和興業	27.7	-	-				
五洋建設	-	155.3	131,523				三精テクノロジーズ	6.8	-	-			小売業 (2.3%)							
住友林業	-	23.1	83,183				SANKYO	-	28.9	188,225			バルグループHLDGS	64	112	206,304				
九電工	31.7	82.9	369,568				三菱重工	-	78.5	648,567			丸井グループ	78.5	181.8	419,049				
大気社	-	22	97,570				IHI	72.6	-	-		銀行業 (11.7%)								
食料品 (2.8%)							スター精密	-	44.4	83,960			三菱UFJフィナンシャルG	641.2	1,266.6	1,566,150				
ブルボン	22.4	-	-				電気機器 (7.6%)						三井住友トラストHD	77.6	86.7	482,572				
アサヒグループホールディング	53.8	72.3	388,684				日立	75.7	99.8	901,393			三井住友フィナンシャルG	35.8	122.8	891,282				
コカ・コーポラズJHD	-	94.2	171,491				富士電機	50.3	67.9	438,430			ふくおかフィナンシャルG	-	41.5	153,716				
日清オイリオグループ	34.2	49.8	195,465				ダイヘン	11.6	-	-			山陰合同銀行	-	154.9	152,111				
太陽化学	22.3	13.6	20,264				IDEC	60.1	-	-			証券・商品先物取引業 (0.1%)							
繊維製品 (0.8%)							TDK	62.2	-	-			SBIホールディングス	9.5	10	31,420				
グンゼ	15.8	33	148,995				堀場製作所	-	24.1	189,859			保険業 (6.2%)							
東レ	294.6	-	-				芝浦電子	-	9.6	56,064			MS&AD	54.2	-	-				
セーレン	24	32.5	69,940				東京エレクトロン	30	25.4	518,033			第一生命HLDGS	-	113.5	354,801				
パルプ・紙 (0.3%)							輸送用機器 (12.2%)						東京海上HD	253.1	374.2	1,262,176				
レンゴウ	208	88.8	88,356				トヨタ紡織	86.5	-	-			T&Dホールディングス	-	39.1	98,844				
化学 (6.7%)							デンソー	36.4	152	361,380			その他金融業 (0.8%)							
クラレ	-	121.1	208,594				いすゞ自動車	184.7	268.6	483,614			プレミアグループ	68.1	-	-				
共和レザー	64.4	69.9	43,547				トヨタ自動車	361.9	583.8	1,552,908			オリックス	-	78.8	212,169				
日本曹達	40.8	37.3	199,555				プレス工業	127.9	204.6	136,468			不動産業 (2.8%)							
トクヤマ	-	39.7	89,325				マツダ	-	79.3	126,166			大東建託	-	28.3	437,801				
東亜合成	70.6	-	-				本田技研	-	371.4	617,638			オープンハウスグループ	10.9	-	-				
大阪ソーダ	38	-	-				豊田合成	49.5	29.1	89,657			東急不動産HD	93.7	265.6	237,446				
信越化学	73	12.4	54,535				精密機器 (-)					AND DOホールディングス	46.8	56.1	54,809					
三井化学	-	37.8	142,317				セイコーグループ	38.9	-	-			三井不動産	56.6	-	-				
東京応化工業	10.9	7.3	66,021				その他製品 (1.4%)						東京建物	40.7	20.3	40,934				
住友ベークライト	26.2	11.5	76,084				大日本印刷	-	98.1	379,548			サービス業 (0.6%)							
旭有機材	25.2	-	-				電気・ガス業 (1.6%)						ディップ	13.5	-	-				
リケンテクノス	-	68.2	48,831				関西電力	169	-	-			ジャパンベストレスキューS	-	47.8	28,727				
富士フィルムHLDGS	44.6	58.9	509,661				九州電力	-	126.7	120,808			日本空調サービス	74.6	80.8	60,761				
デクセリアルズ	55.6	75.2	286,060				大阪瓦斯	136.2	133.4	325,496			フルキャストホールディングス	34.5	-	-				
信越ポリマー	68	95.8	127,030				陸運業 (2.5%)						ペルシステム24HLDGS	97.9	60.6	85,385				
医薬品 (1.9%)							鴻池運輸	-	6.6	12,414			ポピンス	10.2	-	-				
アステラス製薬	189.7	275.7	525,346				丸全昭和運輸	6.4	-	-			日本管財ホールディング	5.9	-	-				
ゴム製品 (0.3%)							セイノーホールディングス	-	71.9	153,506			合計	株数、金額	千株	千株	千円			
TOYO TIRE	-	38.8	86,756				九州旅客鉄道	107.7	172.2	511,778				7,283.4	16,295.7	27,634.318				
ガラス・土石製品 (-)							倉庫・運輸関連業 (2.0%)							銘柄数<比率>	96銘柄	90銘柄	<94.3%>			
AGC	111.6	-	-				三井倉庫HOLD	30.9	-	-				(注1)						
鉄鋼 (1.9%)							上組	126.6	184	561,384				(注2)						
日本製鉄	56.8	89.8	289,245				情報・通信業 (7.3%)													
大同特殊鋼	17.9	39.7	234,944				フューチャー	20.8	-	-				(注3)						
非鉄金属 (5.0%)							BIPROGY	137.8	87.4	315,776										
大紀アルミニウム	37	90.5	110,410				日本電信電話	158	6,111.6	1,052,417										
UACJ	13.4	-	-				KDDI	61	88.7	394,981										
住友電工	249.4	362.9	613,663				光通信	11.1	12.5	263,562										
フジクラ	-	387.6	457,368				卸売業 (8.4%)													
SWCC	56.1	102.3	206,952				エレマテック	21.7	30.2	53,605										
リョービ	24.6	-	-				ダイワポウHD	150.8	231.1	655,515										
金属製品 (0.5%)							レスターホールディングス	11.1	15.4	38,392										
日東精工	77.4	89.8	51,545				三洋貿易	77.9	71.9	92,894										
ファインシンター	30.9	33.2	73,040				第一興商	29.2	-	-										
	17.8	-	-				萩原電気HLDGS	17.3	25.1	101,529										
							ダイトロン	42.5	49.8	147,607										

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
TOPIX	387	-

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年10月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	27,634,318	94.2
コール・ローン等、その他	1,709,186	5.8
投資信託財産総額	29,343,505	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10月16日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	29,343,487,516円
コール・ローン等	1,339,717,316
株式(評価額)	27,634,318,440
未収入金	295,680
未収配当金	345,191,080
差入委託証拠金	23,965,000
(B) 負債	37,889,484
未払金	25,599,484
未払解約金	12,290,000
(C) 純資産総額(A - B)	29,305,598,032
元本	6,405,736,049
次期繰越損益金	22,899,861,983
(D) 受益権総口数	6,405,736,049口
1万口当り基準価額(C / D)	45,749円

* 期首における元本額は4,861,603,007円、当作成期間中における追加設定元本額は1,955,216,802円、同解約元本額は411,083,760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：
 ダイワ好配当日本株投信(季節点描) 4,702,374,183円
 ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株) 16,962,642円
 安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 17,736,137円
 インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 13,506,883円
 成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型) 234,118,856円
 ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型) 36,014,798円
 DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) 200,666,689円
 DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース) 396,327,202円
 DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース) 788,028,659円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は45,749円です。

■損益の状況

当期 自2023年4月18日 至2023年10月16日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	390,169,274円
受取配当金	390,552,380
その他収益金	3,253
支払利息	△ 386,359
(B) 有価証券売買損益	3,455,934,964
売買益	3,894,948,924
売買損	△ 439,013,960
(C) 先物取引等損益	39,945,850
取引益	69,084,900
取引損	△ 29,139,050
(D) 当期損益金(A + B + C)	3,886,050,088
(E) 前期繰越損益金	13,829,172,806
(F) 解約差損益金	△ 1,376,872,109
(G) 追加信託差損益金	6,561,511,198
(H) 合計(D + E + F + G)	22,899,861,983
次期繰越損益金(H)	22,899,861,983

(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章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。