

●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
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。
主要投資対象	<p>下記の各投資信託の受益証券</p> <p>※各投資対象ファンドは、それぞれ『』内に掲げる指数に採用されている資産に投資を行い、投資成果を当該指数の動きに連動させることをめざして運用を行います。</p> <p><auスマート・ベーシック（安定）> <auスマート・ベーシック（安定成長）></p> <p>イ）日本株式インデックスファンド（FOFs用） （適格機関投資家専用） 『東証株価指数』</p> <p>ロ）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） 『NOMURA－BPI総合指数』</p> <p>ハ）外国株式インデックスファンド（FOFs用） （適格機関投資家専用） 『MSCIコクサイ指数（円ベース）』</p> <p>ニ）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） 『FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）』</p> <p><auスマート・ベーシック（安定成長）>のみ</p> <p>ホ）新興国株式インデックスファンド（FOFs用） （適格機関投資家専用） 『FTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）』</p> <p>ヘ）新興国債券インデックスファンド（FOFs用） （適格機関投資家専用） 『JPモルガンガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケットズ グローバル ダイバーシファイド（円換算）』</p>
組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・株式への直接投資は、行いません。 ・外貨建資産への直接投資は、行いません。
分配方針	<ul style="list-style-type: none"> ・分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ・原則として、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

auスマート・ベーシック（安定）

auスマート・ベーシック（安定成長）

運用報告書（全体版）

第5期

（決算日 2023年9月19日）

（作成対象期間 2022年9月21日～2023年9月19日）

受益者の皆様へ

平素より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、投資対象ファンドへの投資を通じて、内外の債券、株式に投資を行い、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざしております。当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。

auアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区西神田三丁目2番1号



ホームページ

<https://www.kddi-am.com/>



お問い合わせ先 03-5657-7185

（受付時間 営業日の午前9時～午後5時）

auスマート・ベーシック（安定）

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			投資信託 受益証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税引前 分配金	期中 騰落率		
(設定日) 2018年9月19日	円 10,000	円 —	% —	% —	百万円 10
1期(2019年9月18日)	10,141	0	1.4	99.0	81
2期(2020年9月18日)	10,255	0	1.1	99.0	233
3期(2021年9月21日)	10,883	0	6.1	99.0	500
4期(2022年9月20日)	10,669	0	△2.0	98.8	935
5期(2023年9月19日)	11,048	0	3.6	99.0	1,484

(注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。また、期中騰落率は、各期末の基準価額（税引前分配金含む）を各期首の基準価額で除して算出したものです。

(注2) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

(注3) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

■当期中の基準価額と市況等の推移

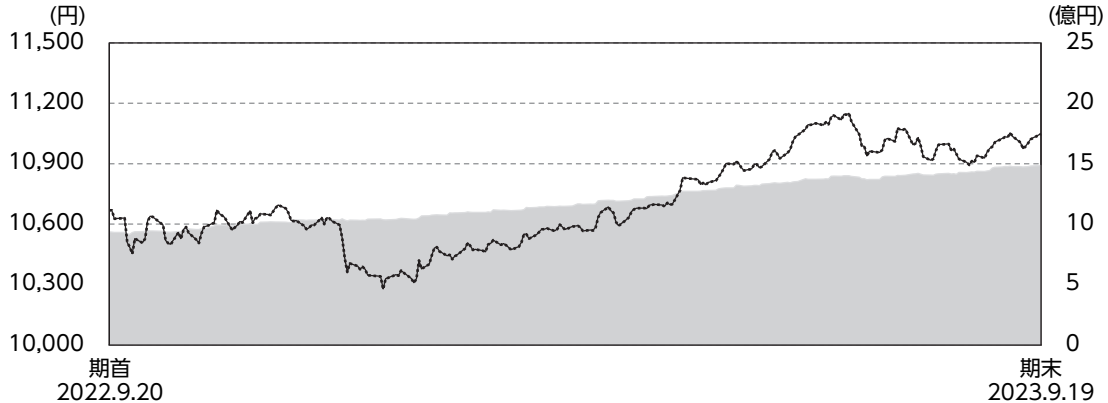
年月日	基準価額		投資信託受益証券 組入比率
		騰落率	
(期首)2022年9月20日	円 10,669	% —	% 98.8
9月末	10,528	△1.3	99.0
10月末	10,607	△0.6	98.9
11月末	10,619	△0.5	99.0
12月末	10,346	△3.0	99.0
2023年1月末	10,448	△2.1	99.0
2月末	10,508	△1.5	99.0
3月末	10,658	△0.1	99.0
4月末	10,699	0.3	98.9
5月末	10,897	2.1	99.0
6月末	11,140	4.4	99.0
7月末	10,994	3.0	98.9
8月末	10,985	3.0	99.0
(期末)2023年9月19日	11,048	3.6	99.0

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

■運用経過

□基準価額等の推移について



.....基準価額（左軸） — 分配金再投資基準価額（左軸）
 ■ 純資産総額（右軸）

第5期首：10,669円

第5期末：11,048円（既払分配金0円）

騰落率：3.6%（分配金再投資ベース）

（注1）分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

（注2）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などにより課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

□基準価額の主な変動要因

投資対象ファンドの受益証券を通じて、内外（国内及び先進国）の債券、株式に投資しました。当期は内外の株式市況ならびに先進国の債券市況がプラス要因となった一方、国内の債券市況がマイナス要因となりました。基準価額は、期首の10,669円から期末の11,048円に上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

資産区分	ファンド名称	当期末時点 組入比率	騰落率
国内株式	日本株式インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	15.5%	29.6%
国内債券	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)	63.8%	△2.3%
先進国株式	外国株式インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	5.0%	21.8%
先進国債券	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)	14.7%	4.0%

（2022年9月21日～2023年9月19日）

□投資環境について

＜株式市況＞

国内株式市況は、期初は英国の財政悪化や欧米の金利上昇などが嫌気された後、2022年11月下旬にかけては、欧米の金利上昇が一服したことや国内で経済活動正常化への期待感などから上昇し、12月には世界的な景況感の悪化や日銀の政策変更による急速な円高などで下落しました。2023年に入ると、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、上昇しました。3月半ばにかけては、米国地方銀行の経営破綻や欧州金融機関の破綻懸念などで金融不安が高まり下落しましたが、その後は、欧州金融機関の破綻回避などを受けて金融不安が一定程度後退したことにより、上昇に転じました。4月以降は、経済活動正常化や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたことや日銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調したこと、米国著名投資家の強気見直しにより日本株見直しの動きが強まったことなどから、大幅に上昇しました。7月以降は、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を受けて下落する局面もありましたが、良好な企業業績や株式需給が相場を下支えし、期末にかけて上昇しました。

先進国株式市況は、期初はFRB（米国連邦準備制度理事会（以下FRB））議長講演において利上げ継続姿勢が強調されたことへの懸念から下落しましたが、2022年10月以降は、英国政府が市場の混乱を招いていた減税策の一部撤回を表明したことやFRBが今後利上げ幅を縮小させるのではないかとの期待を背景に、上昇しました。2023年2月には、米国の利上げ長期化への懸念から軟調な展開となりました。3月には、複数の米国の地方銀行の経営破綻や欧州金融機関の株価急落により信用不安が高まり下落しましたが、下旬には破綻した地方銀行の預金保護やFRBによる金融機関への流動性供給、欧州金融機関の救済合併の決定などにより信用不安が後退したことから、株式市況は上昇に転じました。6月には、米国の債務上限問題の解決や、米国のインフレ警戒感の後退、中国の経済対策への期待から上昇しました。8月に入ると、米国の堅調な経済指標が追加利上げ観測からの米国金利上昇を招き下落し期末を迎えました。

新興国株式市況は、期初より世界的なインフレ率の高止まりや主要中央銀行の積極的な利上げによる景気悪化懸念などを背景に下落しました。2023年5月下旬以降は、AI（人工知能）関連で使用される半導体メーカーの強気見直しや米国の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が、8月以降は、米国での長期金利が上昇したことやFRB高官発言への警戒感が高まったこと、中国の不動産使用問題が嫌気されたことなどから下落して期末を迎えました。

＜債券市況＞

国内長期金利は、期初より世界的なインフレの進行や海外金利の上昇、日銀が金融政策を一部修正するのではないかとの思惑などにより、0.25%程度を上限とした狭いレンジでの推移が続きました。2022年12月には、金融政策決定会合において日銀が長期金利の許容上限を引き上げたことを受けて長期金利は急上昇し、2023年1月には0.5%まで上昇しました。3月に入ると、米国の地方銀行の経営破綻をきっかけとした信用不安が警戒されたことで投資家心理が悪化し、長期金利は一時0.2%台まで急低下したものの、当局の迅速な対応などが評価され、再び0.4%台後半まで上昇しました。その後、日銀が7月の金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールの運用を一部変更したことや、日銀総裁の発言を受け、さらなる金融政策の修正が警戒されたことにより、9月に入ると長期金利は

0.7%台まで上昇して期末を迎えました。

先進国の債券市況では、期初より堅調な労働市場に加えてCPI（消費者物価指数）が予想を上振れたことや英国で大規模な財政政策が発表され同国の金利急上昇を受け、グローバルで金利上昇基調となりました。その後は、英国の財政政策が撤回されたことにより英国金利は大きく低下し、他の国の金利も連れて低下しました。2023年以降は米国で発表された経済指標が市場予想を上振れ、底堅い米国経済が確認されたことで米国金利は上昇に転じ、他の国も連れて金利上昇に転じましたが、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、金利は大きく低下（債券価格は上昇）しました。5月からは、経済指標の上振れや過度な信用不安の後退などを背景に金利は上昇、その後も米国を中心に景気の先行き不透明感が後退して期待インフレ率が上昇したことを受け、金利上昇は継続し、期末にかけて、底堅い経済指標を背景に利上げの継続スタンスが意識されたことに加え、財政赤字の拡大などによる国債の増発や格付会社による米国債の格下げが嫌気され、長期金利主導で上昇しました。

新興国の債券市況は、期初より米国の金融引き締めによる景気悪化が意識され、金利は低下しました。FRBが政策金利見通しを上方修正したことなどから、世界的な金融引き締めが意識され、金利は上昇しましたが、2023年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り、その後、過度な信用不安は徐々に後退したものの6月以降も多くの新興国にてインフレ率が市場予想を下振れ利下げ観測が高まったことなどを受け、金利は総じて低下基調で期末を迎えました。

<為替市況>

期初より各国金利の上昇から日本との金利差が意識され、円安となりました。2023年3月以降は、信用不安の拡大により米国金利が大きく低下したことやリスク回避による円買い需要の高まりや日銀の政策運営の柔軟化決定を受けたことなどを背景に円高となりましたが、期末にかけては、米国金利の上昇による日米金利差の拡大が意識され米ドルを中心に対円で上昇し、円安となりました。

□ポートフォリオについて

投資対象ファンドへの投資を通じて、内外の債券、株式に投資を行い、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないました。リスクの低減をめざして各資産クラスへ分散投資し、以下の配分比率の通りに資産配分することを目標としました。当期末時点の各投資対象ファンドの組入比率は以下のとおりです。

資産区分	配分比率	投資対象ファンド	当期末時点 組入比率
国内株式	15%	日本株式インデックスファンド	15.5%
国内債券	65%	日本債券インデックスファンド	63.8%
先進国株式	5%	外国株式インデックスファンド	5.0%
先進国債券	15%	外国債券インデックスファンド	14.7%

(注1) 投資対象ファンドについては、「(POFs用) (適格機関投資家専用)」を省略しています。

(注2) 配分比率は、純資産総額に対する各資産の目標とする組入比率です。

□ベンチマークとの差異について

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

□分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

<分配原資の内訳（1万口当り）>

項目	当期
	2022年9月21日～2023年9月19日
当期分配金（税引前）（円）	0
（対基準価額比率）（％）	（－）
当期の収益（円）	－
当期の収益以外（円）	－
翌期繰越分配対象額（円）	1,047

（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・繰越欠損金補填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（税引前）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（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

■今後の運用方針

引き続き、投資対象ファンドを通じて、内外の債券、株式に投資を行なうことにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

■ 1 万口当りの費用の明細

項目	当期 (2022. 9. 21～2023. 9. 19)		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
運用管理費用 (信託報酬)	26円	0.241%	運用管理費用（信託報酬）＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は10,716円です。
(投信会社)	(12)	(0.110)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(12)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	－	－	売買委託手数料＝当期中の売買委託手数料／当期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	－	－	有価証券取引税＝当期中の有価証券取引税／当期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0.010	その他費用＝当期中のその他費用／当期中の平均受益権口数
(監査費用)	(1)	(0.010)	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)	信託事務の処理にかかるその他の費用等
合計	27	0.251	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

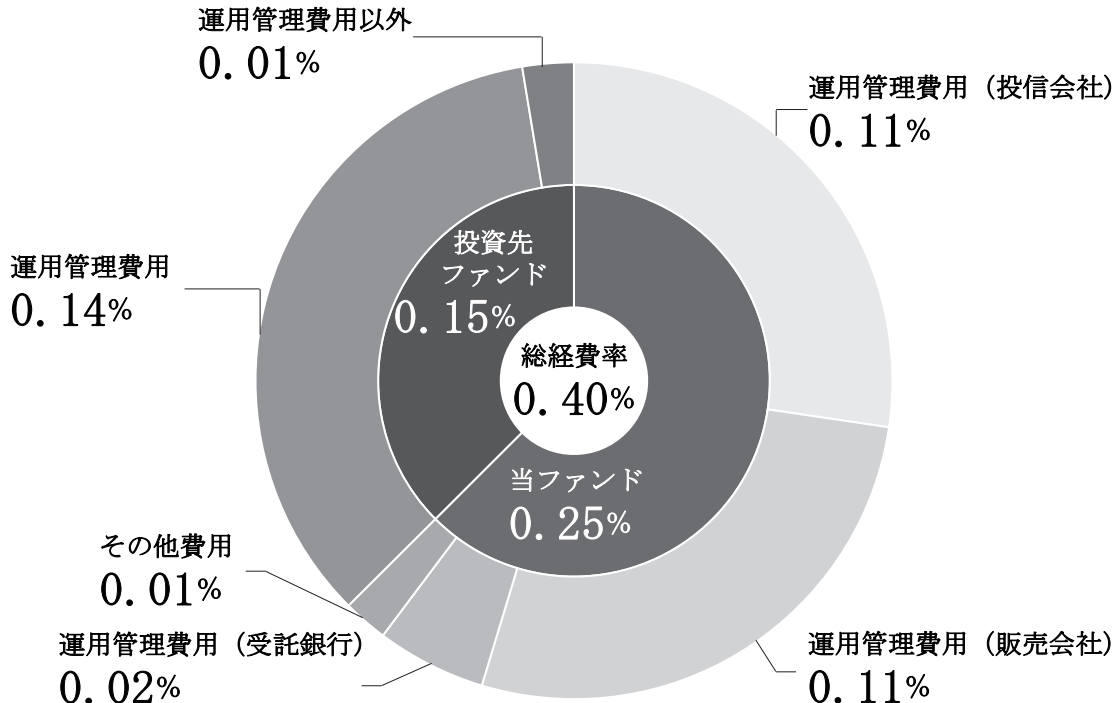
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

（参考情報）

■総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.40%です。**



総経費率（①+②+③）	0.40%
①当ファンドの費用の比率	0.25%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.14%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.01%

（注1）①の費用は、1万円当た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、売買委託手数料及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。

（注4）投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券です。

（注5）①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

（注6）①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

（注7）上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

■売買および取引の状況

投資信託受益証券

(2022年9月21日から2023年9月19日まで)

銘柄名		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	日本株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	千口	千円	千口	千円
	42,428.936	54,220	8,763.348	11,580	
	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)	386,596.674	375,430	9,404.279	9,100
	外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	14,062.799	23,320	4,707.576	8,310
	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)	70,843.795	80,160	8,421.635	9,710

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等 (2022年9月21日から2023年9月19日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 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す。

■組入資産明細表

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘 柄	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
日本株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	146,291.851	230,526	15.5
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）	990,688.217	947,989	63.8
外国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	36,635.55	73,864	5.0
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）	181,236.926	217,756	14.7
合 計	口 数 、 金 額	1,354,852.544	1,470,137
	銘 柄 数 < 比 率 >	4 銘柄	< 99.0% >

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年9月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	1,470,137	98.8
コール・ローン等、その他	17,677	1.2
投資信託財産総額	1,487,814	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2023年9月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,487,814,066円
コール・ローン等	17,677,053
投資信託受益証券（評価額）	1,470,137,013
(B) 負 債	2,829,802
未 払 解 約 金	1,139,751
未 払 信 託 報 酬	1,623,719
そ の 他 未 払 費 用	66,332
(C) 純 資 産 総 額 (A－B)	1,484,984,264
元 本	1,344,175,198
次 期 繰 越 損 益 金	140,809,066
(D) 受 益 権 総 口 数	1,344,175,198口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	11,048円

(注1) 期首における元本額は876,461,746円、当期中における追加設定元本額は627,019,037円、同解約元本額は159,305,585円です。

(注2) 当期末の計算口数当りの純資産額は11,048円です。

■損益の状況

当期 自2022年9月21日 至2023年9月19日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 3,486円
受 取 利 息	85
支 払 利 息	△ 3,571
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	50,763,043
売 買 益 損	73,192,652
買 買 損	△ 22,429,609
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,986,024
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	47,773,533
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	7,084,733
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	85,950,800
(配 当 等 相 当 額)	(68,592,711)
(売 買 損 益 相 当 額)	(17,358,089)
(G) 合 計 (D+E+F)	140,809,066
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	140,809,066
追 加 信 託 差 損 益 金	85,950,800
(配 当 等 相 当 額)	(68,592,711)
(売 買 損 益 相 当 額)	(17,358,089)
分 配 準 備 積 立 金	54,861,752
繰 越 損 益 金	△ 3,486

(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「分配金の計算過程」をご参照ください。

分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	38,874,096円
(c) 収益調整金	85,950,800円
(d) 分配準備積立金	15,987,656円
(e) 分配対象額 (a+b+c+d)	140,812,552円
(f) 分配対象額 (1万口当たり)	1,047.58円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金 (1万口当たり)	0円

■お知らせ

該当事項はございません。

auスマート・ベーシック（安定成長）

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	基準価額		投資信託 受益証券 組入比率	純資産 総額
		税引前 分配金	期中 騰落率		
(設定日) 2018年9月19日	円 10,000	円 —	% —	% —	百万円 10
1期(2019年9月18日)	10,107	0	1.1	99.1	113
2期(2020年9月18日)	10,247	0	1.4	99.0	452
3期(2021年9月21日)	11,393	0	11.2	99.0	1,112
4期(2022年9月20日)	11,316	0	△0.7	98.7	2,182
5期(2023年9月19日)	12,148	0	7.4	99.0	4,172

(注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。また、期中騰落率は、各期末の基準価額（税引前分配金含む）を各期首の基準価額で除して算出したものです。

(注2) 設定日の純資産は、設定元本を表示しております。

(注3) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

■当期中の基準価額と市況等の推移

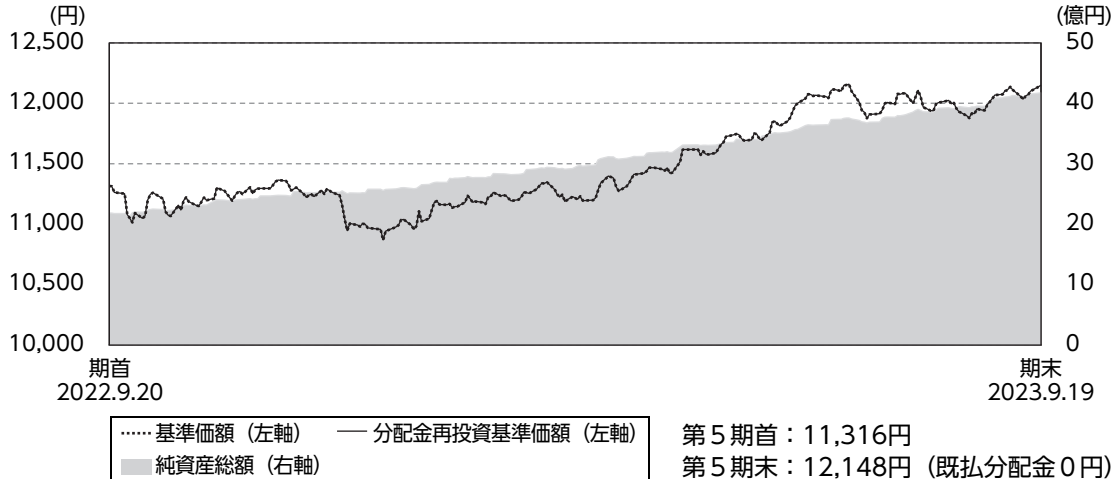
年月日	基準価額		投資信託受益証券 組入比率
	騰落率		
(期首)2022年9月20日	円 11,316	% —	% 98.7
9月末	11,092	△2.0	99.0
10月末	11,212	△0.9	98.8
11月末	11,279	△0.3	99.0
12月末	10,969	△3.1	99.0
2023年1月末	11,168	△1.3	99.0
2月末	11,225	△0.8	99.0
3月末	11,339	0.2	99.0
4月末	11,427	1.0	99.0
5月末	11,745	3.8	99.0
6月末	12,116	7.1	99.0
7月末	12,000	6.0	98.9
8月末	12,039	6.4	99.0
(期末)2023年9月19日	12,148	7.4	99.0

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

■運用経過

□基準価額等の推移について



(注1) 分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額などにより課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

□基準価額の主な変動要因

投資対象ファンドの受益証券を通じて、内外（国内、先進国及び新興国）の債券、株式に投資しました。当期は内外の株式市況ならびに先進国及び新興国の債券市況がプラス要因となった一方、国内の債券市況がマイナス要因となりました。基準価額は、期首の11,316円から期末の12,148円に上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

資産区分	ファンド名称	当期末時点 組入比率	騰落率
国内株式	日本株式インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	20.2%	29.6%
国内債券	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)	49.2%	△2.3%
先進国株式	外国株式インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	9.9%	21.8%
先進国債券	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)	9.8%	4.0%
新興国株式	新興国株式インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	5.0%	12.9%
新興国債券	新興国債券インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	4.9%	13.7%

（2022年9月21日～2023年9月19日）

□投資環境について

＜株式市況＞

国内株式市況は、期初は英国の財政悪化や欧米の金利上昇などが嫌気された後、2022年11月下旬にかけては、欧米の金利上昇が一服したことや国内で経済活動正常化への期待感などから上昇し、12月には世界的な景況感の悪化や日銀の政策変更による急速な円高などで下落しました。2023年に入ると、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、上昇しました。3月半ばにかけては、米国地方銀行の経営破綻や欧州金融機関の破綻懸念などで金融不安が高まり下落しましたが、その後は、欧州金融機関の破綻回避などを受けて金融不安が一定程度後退したことにより、上昇に転じました。4月以降は、経済活動正常化や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたことや日銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調したこと、米国著名投資家の強気見通しにより日本株見直しの動きが強まったことなどから、大幅に上昇しました。7月以降は、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を受けて下落する局面もありましたが、良好な企業業績や株式需給が相場を下支えし、期末にかけて上昇しました。

先進国株式市況は、期初はFRB（米国連邦準備制度理事会（以下FRB））議長講演において利上げ継続姿勢が強調されたことへの懸念から下落しましたが、2022年10月以降は、英国政府が市場の混乱を招いていた減税策の一部撤回を表明したことやFRBが今後利上げ幅を縮小させるのではないかとの期待を背景に、上昇しました。2023年2月には、米国の利上げ長期化への懸念から軟調な展開となりました。3月には、複数の米国の地方銀行の経営破綻や欧州金融機関の株価急落により信用不安が高まり下落しましたが、下旬には破綻した地方銀行の預金保護やFRBによる金融機関への流動性供給、欧州金融機関の救済合併の決定などにより信用不安が後退したことから、株式市況は上昇に転じました。6月には、米国の債務上限問題の解決や、米国のインフレ警戒感の後退、中国の経済対策への期待から上昇しました。8月に入ると、米国の堅調な経済指標が追加利上げ観測からの米国金利上昇を招き下落し期末を迎えました。

新興国株式市況は、期初より世界的なインフレ率の高止まりや主要中央銀行の積極的な利上げによる景気悪化懸念などを背景に下落しました。2023年5月下旬以降は、AI（人工知能）関連で使用される半導体メーカーの強気見通しや米国の債務上限問題の解決、インフレ率の鈍化などが好感されて上昇しましたが、8月以降は、米国での長期金利が上昇したことやFRB高官発言への警戒感が高まったこと、中国の不動産使用問題が嫌気されたことなどから下落して期末を迎えました。

＜債券市況＞

国内長期金利は、期初より世界的なインフレの進行や海外金利の上昇、日銀が金融政策を一部修正するのではないかとの思惑などにより、0.25%程度を上限とした狭いレンジでの推移が続きました。2022年12月には、金融政策決定会合において日銀が長期金利の許容上限を引き上げたことを受けて長期金利は急上昇し、2023年1月には0.5%まで上昇しました。3月に入ると、米国の地方銀行の経営破綻をきっかけとした信用不安が警戒されたことで投資家心理が悪化し、長期金利は一時0.2%台まで急低下したものの、当局の迅速な対応などが評価され、再び0.4%台後半まで上昇しました。その後、日銀が7月の金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールの運用を一部変更したことや、日銀総裁の発言を受け、さらなる金融政策の修正が警戒されたことにより、9月に入ると長期金利は

0.7%台まで上昇して期末を迎えました。

先進国の債券市況では、期初より堅調な労働市場に加えてCPI（消費者物価指数）が予想を上振れたことや英国で大規模な財政政策が発表され同国の金利急上昇を受け、グローバルで金利上昇基調となりました。その後は、英国の財政政策が撤回されたことにより英国金利は大きく低下し、他の国の金利も連れて低下しました。2023年以降は米国で発表された経済指標が市場予想を上振れ、底堅い米国経済が確認されたことで米国金利は上昇に転じ、他の国も連れて金利上昇に転じましたが、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、金利は大きく低下（債券価格は上昇）しました。5月からは、経済指標の上振れや過度な信用不安の後退などを背景に金利は上昇、その後も米国を中心に景気の先行き不透明感が後退して期待インフレ率が上昇したことを受け、金利上昇は継続し、期末にかけて、底堅い経済指標を背景に利上げの継続スタンスが意識されたことに加え、財政赤字の拡大などによる国債の増発や格付会社による米国債の格下げが嫌気され、長期金利主導で上昇しました。

新興国の債券市況は、期初より米国の金融引き締めによる景気悪化が意識され、金利は低下しました。FRBが政策金利見通しを上方修正したことなどから、世界的な金融引き締めが意識され、金利は上昇しましたが、2023年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り、その後、過度な信用不安は徐々に後退したものの6月以降も多くの新興国にてインフレ率が市場予想を下振れ利下げ観測が高まったことなどを受け、金利は総じて低下基調で期末を迎えました。

<為替市況>

期初より各国金利の上昇から日本との金利差が意識され、円安となりました。2023年3月以降は、信用不安の拡大により米国金利が大きく低下したことやリスク回避による円買い需要の高まりや日銀の政策運営の柔軟化決定を受けたことなどを背景に円高となりましたが、期末にかけては、米国金利の上昇による日米金利差の拡大が意識され米ドルを中心に対円で上昇し、円安となりました。

□ポートフォリオについて

投資対象ファンドへの投資を通じて、内外の債券、株式に投資を行い、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないました。リスクの低減をめざして各資産クラスへ分散投資し、以下の配分比率の通りに資産配分することを目標としました。当期末時点の各投資対象ファンドの組入比率は以下のとおりです。

資産区分	配分比率	投資対象ファンド	当期末時点 組入比率
国内株式	20%	日本株式インデックスファンド	20.2%
国内債券	50%	日本債券インデックスファンド	49.2%
先進国株式	10%	外国株式インデックスファンド	9.9%
先進国債券	10%	外国債券インデックスファンド	9.8%
新興国株式	5%	新興国株式インデックスファンド	5.0%
新興国債券	5%	新興国債券インデックスファンド	4.9%

（注1）投資対象ファンドについては、「（POFs用）（適格機関投資家専用）」を省略しています。

（注2）配分比率は、純資産総額に対する各資産の目標とする組入比率です。

□ベンチマークとの差異について

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

□分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

<分配原資の内訳（1万口当たり）>

項目	当期
	2022年9月21日～2023年9月19日
当期分配金（税引前）（円）	0
（対基準価額比率）（％）	（－）
当期の収益（円）	－
当期の収益以外（円）	－
翌期繰越分配対象額（円）	2,148

（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・繰越欠損金補填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（税引前）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（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

■今後の運用方針

引き続き、投資対象ファンドを通じて、内外の債券、株式に投資を行なうことにより、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

■ 1 万口当りの費用の明細

項目	当期 (2022. 9. 21～2023. 9. 19)		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
運用管理費用 (信託報酬)	28円	0.241%	運用管理費用（信託報酬）＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は11,495円です。
(投信会社)	(13)	(0.110)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(13)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(3)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	－	－	売買委託手数料＝当期中の売買委託手数料／当期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	－	－	有価証券取引税＝当期中の有価証券取引税／当期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0.010	その他費用＝当期中のその他費用／当期中の平均受益権口数
(監査費用)	(1)	(0.010)	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)	信託事務の処理にかかるその他の費用等
合計	29	0.251	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

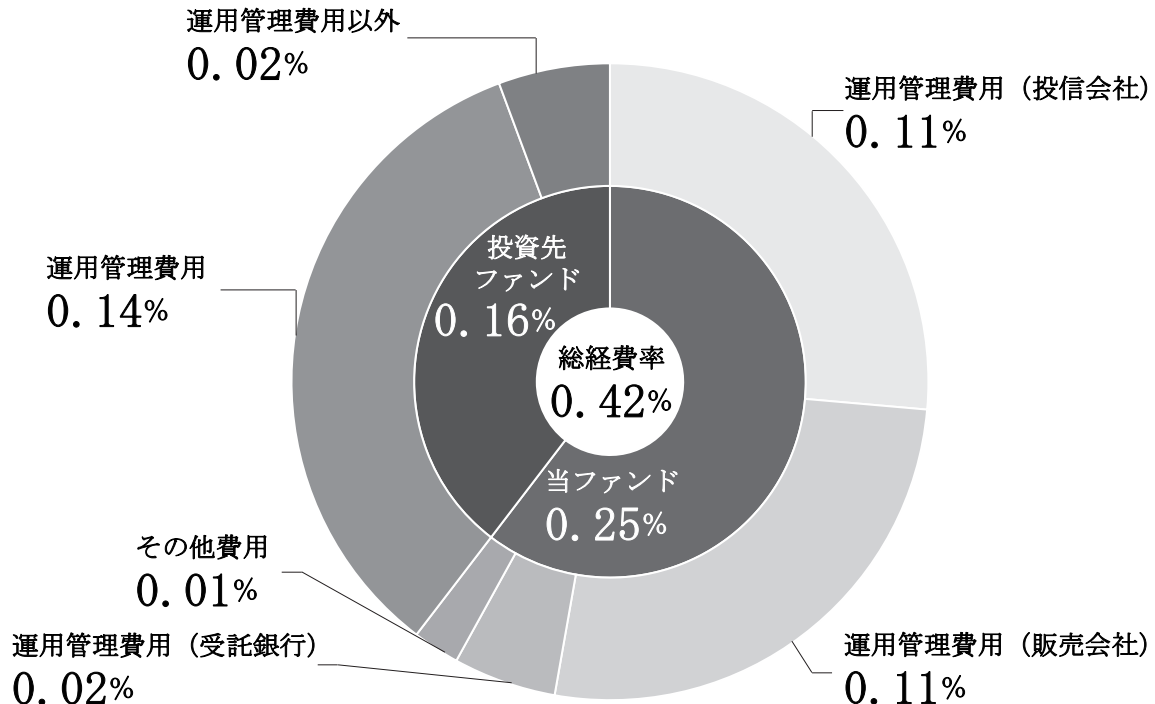
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

（参考情報）

■総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.42%です。**



総経費率（①+②+③）	0.42%
①当ファンドの費用の比率	0.25%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.14%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.02%

（注1）①の費用は、1万口当た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、売買委託手数料及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。

（注4）投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券です。

（注5）①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

（注6）①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

（注7）上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

■売買および取引の状況

投資信託受益証券

(2022年9月21日から2023年9月19日まで)

銘柄名		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	日本株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	千口	千円	千口	千円
	192,187.896	250,170	7,504.492	10,210	
	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)	1,041,633.505	1,011,340	1,009.071	990
	外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	85,636.375	144,160	7,936.56	13,650
	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)	160,692.578	183,070	5,676.52	6,700
	新興国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	62,184.886	81,620	3,121.99	3,990
	新興国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	62,251.884	75,750	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等（2022年9月21日から2023年9月19日まで）

当期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 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す。

■組入資産明細表

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘 柄	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千円	%
日本株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	535,887.639	844,451	20.2
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)	2,144,149.569	2,051,736	49.2
外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	205,298.209	413,922	9.9
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)	340,293.047	408,862	9.8
新興国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	139,142.617	206,738	5.0
新興国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	152,896.314	205,232	4.9
合 計	3,517,667.395	4,130,943	
	口数、金額 銘柄数 < 比率 > 6 銘柄		< 99.0% >

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年9月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	4,130,943	98.9
コール・ローン等、その他	46,536	1.1
投資信託財産総額	4,177,480	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2023年9月19日現在

項目	当期末
(A) 資産	4,177,480,097円
コール・ローン等	46,536,469
投資信託受益証券（評価額）	4,130,943,628
(B) 負債	4,884,962
未払解約金	383,410
未払信託報酬	4,324,719
その他未払費用	176,833
(C) 純資産総額（A－B）	4,172,595,135
元本	3,434,795,606
次期繰越損益金	737,799,529
(D) 受益権総口数	3,434,795,606口
1万口当たり基準価額（C／D）	12,148円

（注1）期首における元本額は1,928,889,946円、当期中における追加設定元本額は1,755,493,985円、同解約元本額は249,588,325円です。

（注2）当期末の計算口数当りの純資産額は12,148円です。

■損益の状況

当期 自2022年9月21日 至2023年9月19日

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 9,217円
受取利息	129
支払利息	△ 9,346
(B) 有価証券売買損益	260,307,235
売買益	307,280,062
売買損	△ 46,972,827
(C) 信託報酬等	△ 7,691,106
(D) 当期損益金（A+B+C）	252,606,912
(E) 前期繰越損益金	59,466,775
(F) 追加信託差損益金	425,725,842
（配当等相当額）	（ 273,705,828）
（売買損益相当額）	（ 152,020,014）
(G) 合計（D+E+F）	737,799,529
次期繰越損益金（G）	737,799,529
追加信託差損益金	425,725,842
（配当等相当額）	（ 273,705,828）
（売買損益相当額）	（ 152,020,014）
分配準備積立金	312,082,904
繰越損益金	△ 9,217

（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「分配金の計算過程」をご参照ください。

分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	251,247,898円
(c) 収益調整金	425,725,842円
(d) 分配準備積立金	60,835,006円
(e) 分配対象額（a+b+c+d）	737,808,746円
(f) 分配対象額（1万口当たり）	2,148.04円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金（1万口当たり）	0円

■お知らせ

該当事項はございません。

日本株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

運用報告書 (全体版) 第5期

(決算日 2022年11月30日)

(作成対象期間 2021年12月1日~2022年11月30日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信託期間	無期限（設定日：2018年9月18日）	
運用方針	投資成果を東証株価指数（TOPIX）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	トピックス・インデックス・マザーファンドの受益証券
	トピックス・インデックス・マザーファンド	東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率	無制限
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価格の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			TOPIX（※配当なし）		株式組入率	株式先物率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
1 期末(2018年11月30日)	円 9,721	円 0	% △ 2.8	1,667.45	% △3.5	% 98.7	% 1.3	百万円 4
2 期末(2019年12月 2 日)	10,236	0	5.3	1,714.49	2.8	98.7	1.4	52
3 期末(2020年11月30日)	10,724	0	4.8	1,754.92	2.4	97.9	1.8	147
4 期末(2021年11月30日)	12,020	0	12.1	1,928.35	9.9	97.2	3.0	318
5 期末(2022年11月30日)	12,700	0	5.7	1,985.57	3.0	97.1	2.8	641

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

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



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

*ベンチマークはTOPIX（※配当なし）です。

■基準価額・騰落率

期首：12,020円

期末：12,700円（分配金0円）

騰落率：5.7%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

わが国の株式に投資した結果、ベンチマークが上昇したことを受けて、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

日本株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

年 月 日	基 準 価 額		TOPIX（※配当なし）		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2021年11月30日	円	%		%	%	%
	12,020	—	1,928.35	—	97.2	3.0
12月末	12,441	3.5	1,992.33	3.3	98.2	1.8
2022年 1 月末	11,842	△1.5	1,895.93	△1.7	97.7	2.4
2 月末	11,790	△1.9	1,886.93	△2.1	97.5	2.7
3 月末	12,293	2.3	1,946.40	0.9	97.3	2.6
4 月末	11,998	△0.2	1,899.62	△1.5	96.8	3.3
5 月末	12,087	0.6	1,912.67	△0.8	96.0	4.0
6 月末	11,839	△1.5	1,870.82	△3.0	97.5	2.5
7 月末	12,278	2.1	1,940.31	0.6	97.2	2.8
8 月末	12,425	3.4	1,963.16	1.8	96.9	3.1
9 月末	11,742	△2.3	1,835.94	△4.8	96.1	3.9
10月末	12,338	2.6	1,929.43	0.1	96.7	3.2
(期末) 2022年11月30日	12,700	5.7	1,985.57	3.0	97.1	2.8

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021.12.1～2022.11.30)

■国内株式市況

国内株式市況は、おおむね一進一退で推移しました。

国内株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの変異株への警戒感後退により上昇し、2022年1月上旬に当作成期の高値を記録しました。それ以降は、F R B（米国連邦準備制度理事会）による金融引き締め懸念で金利が上昇したことや、ロシアによるウクライナ侵攻で地政学リスクが顕在化したことなどを受け、株価は3月上旬にかけて大きく下落して当作成期の安値を記録しましたが、F R Bの利上げ決定後は急反発しました。しかし4月に入ると、上海市のロックダウン（都市封鎖）の影響が懸念されて上値の重い展開となりました。5月半ば以降は一時的に反発したものの、6月上旬にはF R Bが利上げを加速するとの思惑が強まったことなどから下落しました。6月半ばにF R Bが利上げ幅拡大を決定した後は、悪材料出尽くし観測などから上昇に転じ、またインフレ率がピークアウトするとの期待感などもあり、8月中旬にかけて上昇が続きしました。その後は、予想以上のインフレ率の上昇を受けて欧米の金利が上昇したことや英国の財政悪化懸念から英国債が急落したことなどが嫌気され、9月末にかけて下落しましたが、欧米の金利上昇が一服したことや、国内における新型コロナウイルスの水際対策緩和による経済活動正常化への期待が高まったことなどから、当作成期末にかけて株価は反発しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021.12.1～2022.11.30)

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

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

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

*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

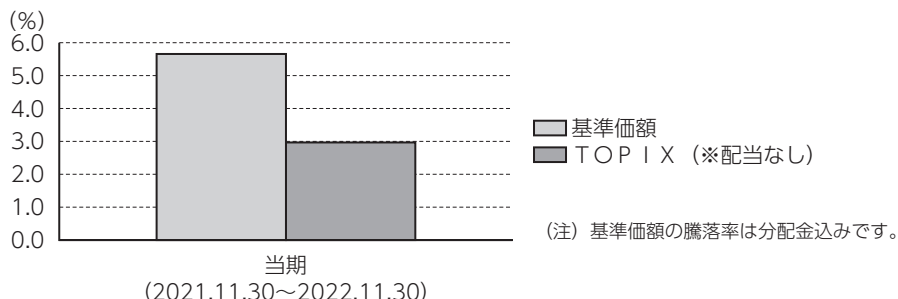
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は3.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は5.7%となりました。

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

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



*ベンチマークはTOPIX（※配当なし）です。

分配金について

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

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年12月1日 ～2022年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	3,185

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2021.12.1~2022.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	17円	0.143%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12,133円です。
（投 信 会 社）	(13)	(0.110)	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）	(1)	(0.011)	販売会社分は、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	1	0.011	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株 式）	(1)	(0.010)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
有 価 証 券 取 引 税	－	－	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（監 査 費 用）	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	19	0.159	

(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。

■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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	236,715	310,984	16,984	22,991

(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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

項 目	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	40,375,498千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	186,080,959千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.21

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
株式	百万円 28,116	百万円 10,509	% 37.4	百万円 12,258	百万円 57	% 0.5
株式先物取引	38,852	20,637	53.1	39,031	18,547	47.5
コール・ローン	2,637,421	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合0.3%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

種 類	当 期		
	トピックス・インデックス・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
株式	百万円 32	百万円 35	百万円 324

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

種 類	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド 買 付 額
株式	百万円 8

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	52千円
うち利害関係人への支払額 (B)	2千円
(B)÷(A)	5.7%

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

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

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末
	口 数	口 数 評 価 額
	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	242,143	461,873 641,773

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
	評 価 額 比 率
	千円 %
トピックス・インデックス・マザーファンド	641,773 99.9
コール・ローン等、その他	447 0.1
投資信託財産総額	642,221 100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	642,221,148円
コール・ローン等	447,817
トピックス・インデックス・マザーファンド(評価額)	641,773,331
(B) 負債	407,184
未払信託報酬	392,192
その他未払費用	14,992
(C) 純資産総額(A - B)	641,813,964
元本	505,373,849
次期繰越損益金	136,440,115
(D) 受益権総口数	505,373,849口
1万口当り基準価額(C / D)	12,700円

* 期首における元本額は264,557,838円、当作成期間中における追加設定元本額は259,473,335円、同解約元本額は18,657,324円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,700円です。

■損益の状況

当期 自2021年12月1日 至2022年11月30日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	35,089,913円
売買益	35,807,958
売買損	△ 718,045
(B) 信託報酬等	△ 699,014
(C) 当期損益金(A + B)	34,390,899
(D) 前期繰越損益金	34,904,783
(E) 追加信託差損益金	67,144,433
(配当等相当額)	(91,692,176)
(売買損益相当額)	(△ 24,547,743)
(F) 合計(C + D + E)	136,440,115
次期繰越損益金(F)	136,440,115
追加信託差損益金	67,144,433
(配当等相当額)	(91,692,176)
(売買損益相当額)	(△ 24,547,743)
分配準備積立金	69,295,682

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	34,390,899
(c) 収益調整金	91,692,176
(d) 分配準備積立金	34,904,783
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	160,987,858
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	160,987,858
(h) 受益権総口数	505,373,849口

《お知らせ》

■マザーファンドにおける主要投資対象の変更について

当ファンドの主要投資対象である「トピックス・インデックス・マザーファンド」において、東京証券取引所の市場改革を見据え、主要投資対象を以下の通り変更しました。

変更前：東京証券取引所第一部上場株式

変更後：東京証券取引所上場株式

<補足情報>

当ファンド（日本株式インデックスファンド（FOF s用）（適格機関投資家専用））が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（2022年9月20日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年11月30日）現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■トピックス・インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

買				付				売				付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円		千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	570.9	1,164,709	2,040	トヨタ自動車	160.7	342,481	2,131	トヨタ自動車	160.7	342,481	2,131	トヨタ自動車	160.7	342,481	2,131
ソニーグループ	74.4	849,539	11,418	ソフトバンクグループ	53	322,981	6,093	ソフトバンクグループ	53	322,981	6,093	ソフトバンクグループ	53	322,981	6,093
日本電信電話	206.5	790,043	3,825	三菱商事	76.7	316,705	4,129	三菱商事	76.7	316,705	4,129	三菱商事	76.7	316,705	4,129
キーエンス	9.3	500,814	53,850	日本電信電話	85.1	265,837	3,123	日本電信電話	85.1	265,837	3,123	日本電信電話	85.1	265,837	3,123
日本郵政	541.7	498,346	919	ダイキン工業	9	187,948	20,883	ダイキン工業	9	187,948	20,883	ダイキン工業	9	187,948	20,883
東京エレクトロン	6.5	349,539	53,775	スズキ	39.4	179,397	4,553	スズキ	39.4	179,397	4,553	スズキ	39.4	179,397	4,553
第一三共	89.9	348,310	3,874	伊藤忠	47.2	176,783	3,745	伊藤忠	47.2	176,783	3,745	伊藤忠	47.2	176,783	3,745
任天堂	7	345,748	49,392	東京海上HD	23.8	173,047	7,270	東京海上HD	23.8	173,047	7,270	東京海上HD	23.8	173,047	7,270
武田薬品	93.4	339,752	3,637	丸紅	126.5	163,980	1,296	丸紅	126.5	163,980	1,296	丸紅	126.5	163,980	1,296
ソフトバンクグループ	60.3	317,431	5,264	日立金属	71.5	155,941	2,181	日立金属	71.5	155,941	2,181	日立金属	71.5	155,941	2,181

(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、2022年11月30日現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンド（147,745,976千円）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			ファーストコーポレーション	2.3	1,644	不動テトラ	5.1	7,772	日本道路	千株	千円
極洋	3.8	14,041	ベステラ	2.1	2,081	大末建設	2.5	2,990	東亜建設	5.9	8,694
日本水産	97.6	50,947	キャンディル	2.1	1,047	鉄建建設	5.3	9,640	日本国土開発	20.6	11,783
マルハニチロ	15.1	37,085	ダイセイ環境ソリューション	1.9	1,567	西松建設	11.6	45,414	若築建設	3.1	8,472
雪国まいたけ	8.3	8,308	第一カッター興業	2.5	2,902	三井住友建設	55.5	23,421	東洋建設	22.3	18,665
カナコ種苗	3.3	4,715	安藤・間	56.7	49,555	大豊建設	2.9	12,876	五洋建設	97.2	62,888
サカタのタネ	12.3	57,687	東急建設	27.9	18,302	佐田建設	4.6	2,079	世紀東急	9.5	7,581
ホクト	8.7	16,443	コムシスホールディングス	33	81,411	ナカノフード建設	4.8	1,540	福田組	2.6	12,649
ホクリョウ	1.3	884	ビーアールホールディングス	16.1	5,425	興村組	11.1	32,589	住友林業	52.4	124,240
鉱業 (0.3%)			高松コンストラクションGP	6.4	12,544	東鉄工業	9.5	24,244	日本基礎技術	4.4	2,362
住石ホールディングス	15.2	3,860	東建コーポレーション	3.1	24,645	イチゲン	1.6	2,881	巴コーポレーション	7.9	3,017
日鉄鉱業	3.8	11,951	ソネック	1.1	1,060	富士ピー・エス	3.5	1,515	大和ハウス	190.6	602,105
三井松島HDGS	4.4	14,190	ヤマウラ	4.7	4,718	浅沼組	5.5	16,060	ライト工業	13.2	27,297
I N P E X	360.7	552,953	オリエンタル白石	34.9	9,702	戸田建設	83.9	61,414	積水ハウス	213.7	548,567
石油資源開発	11.3	48,985	大成建設	67.9	282,803	熊谷組	11.9	30,214	日特建設	7.1	6,468
K&Oエナジーグループ	4.4	10,678	大林組	244	249,856	北野建設	1.3	3,179	北陸電気工事	5.1	3,519
建設業 (2.0%)			清水建設	205.1	151,363	植木組	2.1	2,727	ユアテック	15.9	11,432
ショーボンドHD	13.4	81,204	飛鳥建設	8.1	8,278	矢作建設	9.3	6,872	日本リーテック	4.7	3,449
ミライト・ワン	34	51,476	長谷工コーポレーション	70.4	106,796	ピーエス三菱	9.4	5,668	四電工	3	5,322
タマホーム	6.9	17,105	松井建設	6.4	3,596	日本ハウスHDGS	13.5	5,899	中電工	11.1	23,143
サンヨーホームズ	1.2	844	銭高組	0.9	2,417	新日本建設	9.5	7,106	関電工	38.3	33,244
日本アーク	4.1	3,608	鹿島建設	151.3	234,515	東亜道路	1.4	8,540	きんでん	48.7	71,637

日本株式インデックスファンド (F O F s 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
東京エネシス	6.7	6,304	プリマハム	9.2	18,777	ミヨシ油脂	2.7	2,662	化学 (6.2%)		
トーエネック	2.4	8,208	日本ハム	26.8	99,160	理研ビタミン	5.9	10,478		北の達人コーポ	29.4
住友電設	6.7	17,018	林業産業	2.2	1,049	繊維製品 (0.4%)			クラレ	111.5	122,204
日本電設工業	11.5	19,492	丸大食品	6.9	9,832		片倉工業	6.5	12,837	旭化成	435.6
エクスオグループ	33.6	71,467	S Foods	7.6	22,138	グンゼ	5.4	21,492	共和レザー	3.8	1,938
新日本空調	3.8	7,288	柿安本店	2.7	5,861	東洋紡	31.1	32,188	昭和精工	67.3	147,252
九電工	16.8	55,272	伊藤ハム米久HLDGS	53.3	36,457	ユニチカ	21.8	5,842	住友化学	517.6	257,764
三機工業	15.5	24,769	サッポロホールディングス	22.6	81,134	富士紡ホールディングス	2.7	9,139	住友精化	3.1	13,144
日揮ホールディングス	67.4	127,588	アサヒグループホールディングス	158.3	696,203	倉敷紡績	5.2	11,330	日産化学	33.1	223,094
中外炉工業	2.1	3,353	キリンHD	309.2	669,418	シキボウ	3.7	3,248	ラサ工業	2.8	5,927
ヤマト	5.9	4,071	宝ホールディングス	46.8	49,982	日本毛織	20	20,160	クレハ	6	58,380
太平電業	4.2	13,209	オノンホールディングス	20.6	5,809	ダイトウボウ	10.7	920	多木化学	2.8	14,700
高砂熱学	16.7	29,959	養命酒	2.3	4,117	トア紡コーポレーション	2.6	920	テイカ	5.1	6,502
三晃金属	1	3,000	コカ・コーポラーツHD	53.7	78,402	ダイドールミツヅド	10.1	2,494	石原産業	12.9	14,460
朝日工業社	2.9	6,182	サントリー食品インター	48.2	224,853	帝国繊維	7.8	12,971	片倉コープアグリ	1.8	2,903
明星工業	12.3	8,905	グイードグループHD	3.9	18,915	帝人	66.9	88,843	日本曹達	7.6	32,528
大気社	8.4	29,694	伊藤園	25.5	134,385	東レ	467.3	345,147	東ソー	93.3	151,425
ダイダク	4.8	10,560	キーコーヒー	7.7	15,939	住江織物	1.2	2,113	トクヤマ	22.8	43,616
日比谷総合設備	6	11,370	ユニカフェ	2.3	2,277	日本フェルト	3.7	1,528	セントラル硝子	11.2	39,144
フィル・カンパニー	1.2	1,281	ジャパンフーズ	1	1,082	イチカワ	0.7	918	東亜合成	36.8	43,313
テスホールディングス	7.3	8,117	日清オイリオグループ	9.7	32,349	日東製網	0.7	968	大阪ソーダ	4.3	17,759
インフロンアHD	71.5	73,645	不二製油グループ	16	33,808	アツギ	3.8	1,444	関東電化	13.9	14,261
東洋エンジニア	8.9	5,179	かどや製油	0.8	2,800	ダイニック	1.6	990	デンカ	25.4	84,074
レイズネクスト	9.6	12,048	J-オーリルミルズ	7.1	10,749	セーレン	13.4	35,148	信越化学	119.3	2,096,101
食料品 (3.5%)			キッコーマン	45.4	350,488	ソトー	2.1	1,747	日本カーバイド	2.9	3,790
	ニッパン	18.5	29,359	味の素	167.6	726,546	東海染工	0.5	563	堺化学	5.6
日清製粉G本社	63.3	102,229	ブルドックソース	2.7	4,644	小松マテーレ	10	7,990	第一稀元素化学工	6.5	7,819
日東富士製粉	1.2	5,370	キューピー	36.8	90,049	フコルホールディングス	13.3	30,975	エア・ウォーター	66.1	106,751
昭和産業	6	14,688	ハウス食品G本社	21	56,994	ホギメディカル	9.5	33,155	日本酸素HLDGS	67.8	154,109
鳥越製粉	5.6	3,472	カゴメ	31.9	97,295	クラウディアHLDGS	1.6	456	日本化学工業	2.5	4,645
中部飼料	9.5	9,870	焼津水産化工	3	2,496	TSIホールディングス	24.8	11,928	東邦アセチレン	1.5	1,680
フィード・ワン	10.1	6,756	アリアケジャパン	6	27,630	マツオコーポレーション	1.8	1,877	日本パーカラライジング	35	34,685
東洋精糖	1.3	1,167	ピエトロ	1	1,807	ワールド	9	11,835	高圧ガス	11.2	7,257
日本甜菜糖	4.1	6,670	エバラ食品工業	1.8	5,751	三陽商会	2.6	3,437	チタン工業	1.1	1,728
DM三井製糖ホールディ	6.8	13,300	やまみ	0.6	781	ナイガイ	2.3	602	四国化成	8.6	11,618
塩水港精糖	8.5	1,666	ニチレイ	31.4	87,323	オンワードホールディングス	44.9	14,817	戸田工業	1.6	4,716
日新製糖	3.5	5,890	東洋水産	34.6	199,642	ルックホールディングス	2	4,994	ステラ ケミファ	4.3	11,253
森永製菓	14.1	52,099	イトアンドHLDGS	2.9	6,472	ゴールドウイン	12.3	115,866	保土谷化学	2	6,210
中村屋	1.7	5,287	大冷	0.9	1,709	デザート	12	40,200	日本触媒	10.7	58,957
江崎グリコ	19.6	70,266	ヨシムラ・フード・HLDGS	4.4	2,327	キング	2.8	1,358	大日精化	5.2	8,928
名糖産業	2.7	4,347	日清食品HD	24.4	255,712	ヤマトインターナショナル	4.8	1,190	カナカ	16.1	56,350
井村屋グループ	3.8	8,477	永谷園ホールディングス	3.4	6,810	パルプ・紙 (0.2%)			三菱瓦斯化学	52.3	102,560
不二家	4.7	12,375	一正蒲鉾	2.8	2,077		特種東海製紙	3.4	9,632	三井化学	58.8
山崎製パン	45.8	72,409	フジッコ	7	13,265	王子ホールディングス	289.7	152,961	J S R	65.2	187,319
第一屋製パン	1.3	525	ロックフィールド	8.3	12,250	日本製紙	36.3	35,029	東京応化工業	12.1	82,764
モロゾフ	2.2	7,988	日本たばこ産業	450.9	1,269,508	三菱製紙	7.9	2,204	大阪有機化学	5.3	11,198
亀田製菓	4.4	19,162	ケンコーマヨネーズ	4.7	7,759	北越コーポレーション	43.9	34,110	三菱ケミカルグループ	471.2	343,599
寿スプリッツ	7.3	56,721	わらべや日洋HD	5	9,240	中越パルプ	2.6	2,464	K Hネオケム	11.7	32,373
カルビー	31.4	91,185	なとり	4.3	8,858	巴川製紙	2.5	1,950	ダイセル	103.5	103,293
森永乳業	12.4	55,118	イフジ産業	1.2	1,152	大王製紙	30.6	32,558	住友ペークライト	10.4	44,928
六甲バター	5	6,975	ファーマフーズ	10.6	13,621	阿波製紙	1.1	333	積水化学	144.9	279,222
ヤクルト	49	428,750	ユーグレナ	44.1	39,734	レンゴー	63.2	54,731	日本ゼオン	42.3	56,047
明治ホールディングス	42.4	279,840	紀文食品	5.4	5,092	トーモク	4	6,400	アイカ工業	17.7	57,259
雪印メグミルク	16.6	28,701	ビックルスホールディングス	4	4,332	ザ・パック	5.2	13,109	UB E	35.9	71,764

日本株式インデックスファンド（FOF s用）（適格機関投資家専用）

銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
積水樹脂	10.2	18,451	ノビアホールディングス	6.2	36,146	久光製薬	15.5	59,985	住友大阪セメント	9.7	31,379
タキロンシーアイ	16.7	8,483	アジパホールディング	1.6	1,529	持田製薬	8.4	28,392	太平洋セメント	44.1	95,564
旭有機材	4.9	13,004	新日本製薬	4	5,492	新日本製薬	135.5	150,947	日本ヒューム	6.8	4,406
ニチパン	4.3	7,542	エステー	5.3	8,151	扶桑薬品	2.3	4,708	日本コンクリート	14.9	3,486
リケンテクノス	16.1	8,033	アグロカネショウ	3	4,653	日本ケミファ	0.7	1,189	三谷セキサン	2.9	12,209
大倉工業	3.2	6,444	コニシ	12.2	21,020	ツムラ	2.2	65,978	アジアパイルHD	12.1	6,485
積水化成成品	14.5	5,698	長谷川香料	14.6	44,895	日医工	10.4	2,132	東海カーボン	58.1	60,830
群栄化学	1.8	4,363	星光PMC	4.4	2,446	キッセイ薬品工業	10.8	27,367	日本カーボン	3.8	16,473
タイガース ポリマー	2.2	2,504	小林製薬	21.3	181,050	生化学工業	13.3	12,541	東洋炭素	4.6	18,078
ミライアル	6.1	3,603	荒川化学工業	6.8	6,766	栄研化学	11.4	21,694	ノリタケ	3.4	13,736
ダイキアクシス	2.6	1,926	メック	5.8	14,911	鳥居薬品	3.8	11,027	TOTO	46	218,270
ダイキョーニシカワ	16.6	9,794	日本高純度化学	2	5,008	JCRファーマ	23.6	45,123	日本碍子	82.1	148,683
竹本容器	2.2	1,663	タカラバイオ	18.8	33,858	東和薬品	10.7	22,598	日本特殊陶業	53.1	142,308
森六ホールディングス	3.8	6,676	JCU	8	26,960	富士製薬工業	4.5	4,585	ダントホールディングス	5	1,380
恵和	2.3	8,567	新田ゼラチン	4.4	4,734	ゼリア新薬工業	9.7	21,592	MA RUWA	2.6	48,932
日本化薬	53.3	66,518	OA T アグリオ	2.9	5,150	第一三共	607.9	2,746,492	品川リフラクトリーズ	1.9	7,495
カーリットホールディングス	6.4	4,601	デクセリアルズ	20.2	65,246	キョーリン製薬HD	15.2	26,904	黒崎播磨	1.4	7,042
日本精化	4.1	9,175	アース製薬	6.3	33,516	大幸薬品	12.8	6,694	ヨータイ	4.5	6,192
扶桑化学工業	6.5	22,912	北興化学	7.2	6,544	グイト	5.3	13,748	東京薬業	4.7	1,269
トリケミカル	9.4	22,663	大成ラミック	2.1	6,457	大塚ホールディングス	159.6	748,524	ニッカラー	2.5	1,277
ADEKA	24.5	55,174	クミアイ化学	28	25,844	大正製薬HD	15.5	86,800	フジミンコーポレートッド	5.5	38,610
日油	21.6	124,848	日本農薬	13.1	9,811	ペプチドリーム	33.8	57,865	クニミネ工業	1.8	1,549
新日本理化	10.2	2,601	アキレス	4.8	4,684	あすか製薬HD	7.2	9,208	エーアンドエーマテリアル	0.8	693
ハリマ化成グループ	5.5	4,625	有沢製作所	11.2	14,380	サウグループHD	16	67,840	ニチアス	17.6	42,556
花王	169.7	926,731	日東電工	50.7	436,527	石油・石炭製品 (0.5%)			ニチハ	8.7	24,560
第一工業製薬	2.7	5,424	レック	9.9	8,048	日本コークス工業	62.7	5,517	鉄鋼 (0.7%)		
石原ケミカル	3.5	4,319	三光合成	10.1	4,635	ニチレキ	8.6	11,137	日本製鉄	321.3	704,450
日華化学	3	2,673	きもと	10.2	2,427	ユシロ化学	3.5	2,898	神戸製鋼所	144.2	89,404
ニイタカ	1.4	2,933	藤森工業	5.6	17,892	ビーピー・カストロール	2.6	2,509	中山製鋼所	14.7	11,098
三洋化成	4.4	19,382	前澤化成工業	4.4	6,094	富士石油	14.4	3,960	合同製鐵	3.5	6,660
有機合成薬品	5.8	1,734	未来工業	2.5	3,720	MORE S CO	2.8	3,113	JFEホールディングス	191.8	292,686
大日本塗料	9.4	7,209	ウェーブックHLDGS	3.2	1,955	出光興産	77.5	251,100	東京製鐵	20.1	28,200
日本ペイントHOLD	308.6	345,632	ジェイ エス ピー	4.8	7,137	ENEOSホールディングス	1,260.2	587,253	共英製鋼	8.1	10,473
関西ペイント	64	120,128	エフピコ	13.2	49,962	コスモエネルギーHLDGS	26.5	102,820	大和工業	11.8	55,578
神東塗料	9.1	1,306	天馬	6.3	13,122	ゴム製品 (0.7%)			東京鐵鋼	3.3	4,659
中国塗料	13.5	13,945	信越ポリマー	12.7	15,836	横浜ゴム	39.7	89,523	大阪製鐵	3.2	3,632
日本特殊塗料	4.4	3,836	東リ	15.8	3,333	TOYO TIRE	40	62,680	淀川製鋼所	8.1	20,598
藤倉化成	10.8	4,417	ニフコ	25.4	91,186	ブリヂストン	222.8	1,151,207	丸一鋼管	21.8	61,977
太陽ホールディングス	10.8	27,421	バルカー	6.4	17,472	住友ゴム	68.3	81,140	モリ工業	1.6	4,500
DIC	27.6	69,165	ユニ・チャーム	145.3	738,559	藤倉コンビジット	5.2	4,404	大同特殊鋼	9	39,735
サカタインクス	16	17,680	ショーエイコーポ	2.8	1,590	オカモト	4.2	16,170	日本高周波	1.9	598
東洋インSCホールディ	14.1	26,508	医薬品 (5.8%)			フコク	3.5	3,836	日本冶金工	5.2	22,386
T&K TOKA	6.6	6,613	協和キリン	84.3	267,652	ニッタ	7.8	22,854	山陽特殊製鋼	7	15,491
富士フイルムHLDGS	133.8	978,747	武田薬品	617.5	2,500,875	住友理工	15.1	9,301	愛知製鋼	4.1	9,319
資生堂	145.7	844,914	アステラス製薬	668.7	1,422,993	三ツ星ベルト	10.5	36,015	日本金属	1.5	1,531
ライオン	83.8	122,767	住友ファーマ	51.8	55,270	バンドー化学	12.4	12,387	大平洋金属	5.1	10,455
高砂香料	4.9	13,935	塩野義製薬	89.2	619,940	ガラス・土石製品 (0.7%)			新日本電工	46	19,412
マンダム	15	21,570	わかもと製薬	6.6	1,557	日東紡績	8.2	17,908	栗本鉄工所	3.3	5,926
ミルボン	10.3	58,710	日本新薬	16.5	133,485	AGC	70.9	326,140	虹技	0.8	724
ファンケル	30.5	78,263	中外製薬	218.4	791,481	日本板硝子	35.3	21,321	日本鑄鉄管	0.8	763
コーサー	14.2	205,758	科研製薬	12	47,280	石塚硝子	1.3	1,931	三菱製鋼	4.6	4,577
コタ	5.8	9,761	エーザイ	84.9	792,286	日本山村硝子	2.2	1,342	日亜鋼業	6.6	1,564
シーボン	0.8	1,304	ロート製薬	33.8	151,762	日本電気硝子	28.2	71,402	日本精練	1	4,365
ポーラ・オルビスHD	35.7	63,760	小野薬品	134.6	473,253	オハラ	3.2	4,048	エンビプロHD	4.9	3,528

日本株式インデックスファンド (F O F s 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
シンニッタン	12.7	2,832	日東精工	11.2	5,857	平田機工	3.3	18,051	木村化工機	5.3	3,710
新家工業	1.6	3,699	三洋工業	0.8	1,416	ペガサスミシン製造	7.7	7,445	アネスト岩田	11.5	10,856
非鉄金属 (0.7%)			岡部	11.4	8,196	マルコム	3.4	6,463	ダイフク	36.2	254,848
大紀アルミニウム	10.2	13,209	ジーテクト	7.8	11,965	タツモ	3.8	6,710	サムコ	2.3	8,889
日本軽金属HD	19.2	29,414	東プレ	12.5	15,737	ナプテスコ	44	150,040	加藤製作所	3.3	2,653
三井金属	20.8	65,208	高周波熱錬	12.6	8,568	三井海洋開発	8.7	13,302	油研工業	0.7	1,276
東邦亜鉛	4.2	9,067	東京製綱	4.4	3,920	レオン自動機	7.3	8,541	タダノ	36.9	36,162
三菱マテリアル	47.7	104,319	サンコール	6.4	4,070	SMC	22.8	1,408,128	フジテック	25.7	77,357
住友鉱山	83.2	386,464	モリテックスチル	5.5	1,347	ホソカワミクロン	5.2	15,308	C K D	19.9	40,655
DOWAホールディングス	16.1	72,772	パイオラックス	9.9	17,226	ユニオンツール	2.9	10,179	平和	23.4	57,213
古河機金	10.2	13,168	エイチワン	7.2	4,665	オイレス工業	11.2	16,732	理想科学工業	6.2	14,743
エス・サイエンス	42.8	1,198	日本発条	63.4	58,011	日精工エスビー	3.1	13,051	S A N K Y O	13.8	73,968
大阪チタニウム	10.5	44,047	中央発条	4.9	3,459	サトーホールディングス	9.9	19,344	日本金銭機械	7.7	7,807
東邦チタニウム	13	35,724	アドパネクス	1.2	1,453	技研製作所	7.3	23,980	マースグループHLDGS	4.1	8,405
UAC J	10	23,050	立川ブラインド	3.2	3,654	日本エアテック	3.3	3,867	フクシマガリレイ	5.1	22,185
C K サンエツ	1.7	7,182	三益半導体	6.4	16,371	カワタ	1.9	1,615	オーイズミ	2.7	1,123
古河電工	24.5	63,626	機械 (5.2%)			日精樹脂工業	4.8	4,593	ダイコク電機	3.8	6,102
住友電工	247.8	396,603	日本ドライケミカル	1.5	2,325	オカダアイオン	2.1	3,248	竹内製作所	12.7	40,322
フジクラ	77	86,009	日本製鋼所	19.3	56,356	ワイエイシホールディングス	3	4,398	アmano	19.9	49,252
昭和電線H L D G S	8	14,360	三浦工業	29.2	95,192	小松製作所	329.1	1,046,208	J U K I	10.7	7,179
東京特殊電線	1	5,650	タクム	21.4	27,306	住友重機械	41.4	120,556	サンデン	10.2	2,315
タツタ電線	15	6,465	ツガミ	15.3	18,115	日立建機	27.9	89,559	ジャノメ	7	4,340
カナレ電気	0.8	1,198	オークマ	6.8	35,428	日工	10.1	6,262	マックス	8.5	17,501
平河ヒューテック	3.9	4,282	芝浦機械	7.7	21,113	巴工業	3.4	8,221	グローリー	18.1	41,702
リョービ	7.6	9,446	アマダ	111.2	122,097	井関農機	6.5	8,300	新晃工業	7	10,836
アーレステイ	7.8	3,042	アイダエンジニア	13.9	11,606	T O W A	7.2	14,176	大和冷機工業	10.6	12,985
アサヒHD	29	59,276	T A K I S A W A	1.4	1,548	丸山製作所	1	1,610	セガサニホールディングス	56.5	102,999
金属製品 (0.6%)			F U J I	30.2	62,634	北川鉄工所	2.8	3,323	日本ピストンリング	2.2	2,657
稲葉製作所	4.1	5,686	牧野フライス	7.7	35,535	ローツェ	3.7	31,043	リケン	2.7	6,147
宮地エンジニアリングG	2.1	7,150	オーエスジー	33.3	64,468	タカキタ	1.9	891	T P R	8	9,856
トーカロ	19.2	23,846	ダイジェット	0.4	342	クボタ	371.7	754,551	ツバキ・ナカシマ	17.3	17,905
アルファCO	2.6	2,488	旭ダイヤモンド	20	14,400	荏原実業	3.4	7,707	ホシザキ	45.2	209,502
S U M C O	136.6	276,341	DMG森精機	42.3	77,451	三菱化工機	2.1	4,443	大豊工業	5.9	4,124
川田テクノロジーズ	1.8	6,066	ソディック	18.5	14,115	月島機械	9.3	9,123	日本精工	129.4	98,344
RS TECHNOLOGIES	2.3	18,860	ディコ	11.3	458,780	帝国電機製作所	5.1	12,071	NTN	142.2	41,238
ジェテックコーポレーション	1	1,940	日東工器	3.7	5,646	東京機械	1.6	984	ジェイテクト	63.3	63,933
信和	3.8	2,998	日進工具	5.6	6,311	新東工業	13.2	8,844	不二越	5.3	20,511
東洋製罐グループHD	47.9	76,352	パンチ工業	5.5	2,231	渋谷工業	6.5	16,107	日本トムソン	18.4	11,205
ホッカンホールディングス	5	6,615	富士ダイス	2.3	1,403	アイチ コーポレーション	9.7	7,760	T H K	40.9	109,162
コロナ	3.9	3,381	豊和工業	3.8	3,347	小森コーポレーション	15.8	12,861	ユースン精機	4.6	3,164
横河ブリッジH L D G S	9.7	18,750	ニテックオーケーケー	2.8	2,710	鶴見製作所	5.2	10,379	前澤給装工業	5	4,665
駒井ハルテック	1.3	2,000	石川製作所	1.7	2,466	住友精密	1	3,640	イーグル工業	7.8	8,650
高田機工	0.8	1,964	東洋機械金属	4.4	2,389	日本ギア工業	4	1,304	前澤工業	4.7	2,876
三和ホールディングス	66.1	85,269	津田駒工業	1	593	酒井重工業	1.1	3,877	日本ピラー工業	6.7	18,525
文化シャッター	20.7	23,266	エンシュウ	1.3	932	荏原製作所	28.7	150,962	キッツ	27.3	23,041
三協立山	10.4	5,876	島精機製作所	11	23,012	石井鉄工所	0.7	1,801	マキタ	87.3	273,249
アルインコ	5.4	5,400	オプトラン	10.4	26,488	西島製作所	5.9	9,145	三井E&S HD	21.7	8,962
東洋シャッター	1.7	890	NCホールディングス	1.5	3,144	北越工業	7	8,071	日立造船	57.3	51,340
L I X I L	104.6	220,601	イワークポンプ	4.5	5,881	ダイキン工業	83.9	1,879,779	三菱重工業	122.9	670,665
日本ファイルン	7.1	3,308	フレュー	7.3	8,431	オルガン	9.6	27,052	I H I	44.2	166,192
ノーリツ	10.5	15,582	ヤマシンフィルタ	17.8	8,579	トーヨーカネツ	2.7	6,714	サノヤスホールディングス	8.4	1,066
長府製作所	7.2	14,198	日販製作所	6.3	5,153	栗田工業	39.3	239,730	スター精密	13.2	23,166
リンナイ	13	132,340	やまびこ	11.4	12,927	椿本チエイン	10.3	32,393	電気機器 (17.4%)		
ダイニチ工業	3.5	2,401	野村マイクロ・サイエンス	2.4	11,292	大同工業	2.5	1,925	日清紡ホールディングス	56.9	57,696

日本株式インデックスファンド（FOF s 用）（適格機関投資家専用）

銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
イビデン	千株	千円	E I Z O	千株	千円	澤藤電機	千株	千円	三桜工業	千株	千円
40.2	221,502	5.1	18,334	0.8	1,022	10.5	7,024	デンソー	143.5	1,078,259	
コニカミノルタ	156.8	89,219	ジャパンディスプレイ	61.7	3,023	2.9	2,389	東海理化電機	19.4	30,108	
93.7	207,451	15.8	16,321	8.9	7,573	6.4	30,464	川崎重工業	52.4	153,322	
プラザー工業	122.1	273,870	日本信号	14.2	5,878	12.7	27,254	名村造船所	17.8	8,668	
ミネベアミツミ	122.1	273,870	京三製作所	9.4	14,946	2.7	6,498	日本車輛	2.6	5,109	
日立	352.8	2,575,087	能美防災	5.1	7,369	34.3	862,130	三菱ロジスネクスト	11.1	9,923	
135.2	634,088	2.9	1,307	49.4	137,974	2.2	5,601	近畿車輛	0.8	851	
東芝	725.9	999,927	星和電機	16.7	24,248	36.1	64,330	日産自動車	987.9	485,256	
三菱電機	42.7	239,974	エレコム	829.8	1,057,165	4.8	1,344	いすゞ自動車	202.1	362,567	
富士電機	2.3	2,007	パナソニック ホールディング	84.6	82,315	6.3	2,809	トヨタ自動車	3,820.1	7,680,311	
83.1	369,379	49.7	72,860	6.3	2,809	1.7	3,301	日野自動車	89.5	55,490	
安川電機	7.6	11,453	アンリツ	19.9	64,376	7	18,529	三菱自動車工業	271.3	172,546	
シンフォニア テクノロジー	10.6	21,062	富士通ゼネラル	492.2	5,539,711	1.7	3,301	エフテック	4.6	2,451	
明電舎	1.6	2,105	SONYグループ	111.2	542,656	2.9	2,166	レシップホールディングス	2.4	1,176	
オリジン	3	18,600	T D K	3.1	4,349	5	5,615	GMB	1.3	990	
山洋電気	5.2	7,800	帝国通信工業	30.1	24,561	2.6	1,105	ファルテック	1.1	671	
デンヨー	9.8	15,631	タムラ製作所	62.6	81,505	5.9	10,885	武蔵精密工業	16.9	29,879	
P H Cホールディングス	10.5	38,797	アルプスアルパイン	2.1	1,152	6	19,740	日産車体	12.2	10,150	
東芝テック	1.3	14,274	池上通信機	8.4	14,658	17.5	79,800	新明和工業	21.6	21,880	
芝浦メカトロニクス	17.4	71,862	日本電波工業	3.9	3,584	51.8	69,412	極東開発工業	12.1	16,492	
マップモーター	170.6	1,455,900	鈴木	7.6	22,838	68.3	1,390,929	トピー工業	5.6	9,688	
日本電産	5	2,525	メイコー	1.5	3,693	14.6	8,438	ティラド	1.8	4,766	
ユームシーエレクトロニクス	3.3	9,655	日本トリム	3.9	12,031	2	8,940	タチエス	10.9	11,946	
トックス・セミコンダクター	4.2	7,757	ローランド ディー・ジー	6.4	6,150	8.4	7,047	N O K	26.8	33,875	
東光高岳	22.9	42,777	フオスター電機	1.6	4,222	32.1	348,285	フタバ産業	18.3	6,862	
ダブル・スコープ	6.3	25,704	S M K	5.5	13,277	55.8	399,528	K Y B	6.6	23,925	
ダイヘン	13.7	17,892	ヨコオ	10.8	1,285	7.2	57,312	大同メタル工業	13.5	6,682	
ヤーマン	64.1	23,717	ティアック	16.8	27,316	24.6	93,603	プレス工業	31	13,981	
J V Cケンウッド	6.6	4,316	ホシデン	11.6	211,120	108	753,948	ミクニ	8	2,720	
ミキエンジニアリング	3.8	4,974	ヒロセ電機	14.3	33,562	33.8	147,537	太平洋工業	15.8	17,048	
I - P E X	16.6	22,260	日本航空電子	7.9	6,051	210.9	1,574,157	河西工業	9.2	1,527	
日新電機	16.3	8,687	T O A	15.1	21,291	12.6	7,459	アイシン	53.6	201,804	
大崎電気	64.5	454,338	マクセル	9.1	9,282	2.4	3,096	マツダ	230	250,930	
オムロン	9.5	22,144	古野電気	6.3	9,210	14.1	19,937	今仙電機製作所	4.3	2,790	
日東工業	10.6	34,282	スミダコーポレーション	2.6	7,241	6.8	12,518	本田技研	565.4	1,897,482	
I D E C	1.1	1,246	アイコム	2.9	5,945	10.5	23,089	スズキ	127.7	627,390	
正興電機製作所	2.5	2,657	リオン	77.1	197,838	9.6	4,089	S U B A R U	220	517,330	
不二電機工業	23	49,703	横河電機	2.7	9,004	83.5	180,777	安永	2.8	2,021	
ジーエス・ユアサ コーポ	1.4	1,918	新元元工業	48.5	202,487	12.9	6,875	ヤマハ発動機	109.3	373,259	
サクサホールディングス	1.8	5,598	アズビル	32.3	103,198	11.9	107,457	T B K	5.9	1,539	
メルコホールディングス	2.1	3,637	東亜ディーケーケー	3.1	5,704	7.5	11,850	エクセディ	11.2	18,681	
テクノメディカ	2.1	3,143	日本光電工業	8.4	3,015	381.7	1,226,020	豊田合成	20.2	46,096	
ダイヤモンドエレクトロニクスHD	99.3	482,101	チノー	4.6	7,093	182.4	198,086	愛三工業	11.3	7,932	
日本電気	70	1,292,550	共同電業	15.5	96,720	20.7	33,099	盟和産業	0.9	836	
富士通	31.7	23,077	日本電子材料	54.8	500,324	0.9	1,548	日本プラスチック	5.1	2,177	
沖電気	3.1	2,427	堀場製作所	3.8	1,558	49.1	2,213,919	ヨロズ	6.2	4,991	
岩崎通信機	3.2	6,720	アドバンテスト	5.9	12,142	4.6	5,989	エフ・シー・シー	12.1	17,242	
電気興業	6.5	43,095	小野測器	69.6	3,976,944	29.2	55,801	シマノ	28.5	666,330	
サンケン電気	1	1,100	キーエンス	3.7	25,234	1.4	1,797	テイ・エス テック	31.7	50,941	
ナカヨ	4.3	8,243	日置電機	60	499,080	12.4	10,936	ジャムコ	3.8	6,121	
アイホン	458.2	602,991	シスメックス	11.4	16,632	50.8	396,748	精密機器 (2.8%)			
ルネサスエレクトロニクス	93.5	201,212	日本マイクロニクス	5.7	15,076	12	15,192	テルモ	217.5	879,352	
セイコーエプソン	55.6	36,028	メガチップス	3.1	10,803			クリエートメディック	3.2	2,902	
ワコム	16.6	98,438	O B A R A G R O U P								
アルバック	2.6	3,918									
アクセル											

日本株式インデックスファンド (F O F s 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
日機装	千株 17.4	千円 17,417	ホクシン	千株 5.4	千円 831	東武鉄道	千株 76.5	千円 253,215	パスコ	千株 1.4	千円 1,863
日本エム・ディ・エム	4.3	4,454	ウッドワン	2.3	2,143	相鉄ホールディングス	23.1	50,589	倉庫・運輸関連業 (0.1%)		
島津製作所	84.8	354,464	大建工業	4.2	8,979	東急	195.1	341,229	トランコム	2	15,840
JMS	7.2	3,679	凸版印刷	90.9	193,798	京浜急行	79	113,760	日新	5.3	10,780
クボテック	2.4	552	大日本印刷	82.5	234,382	小田急電鉄	105.5	190,111	三菱倉庫	14.9	49,766
長野計器	5.3	6,121	共同印刷	2	5,808	京王電鉄	36.8	188,416	三井倉庫HOLD	6.5	22,977
ブイ・テクノロジー	3.6	9,694	NISSHA	13.2	23,218	京成電鉄	44.9	175,783	住友倉庫	19.1	38,238
東京計器	5.6	6,591	光村印刷	0.6	703	富士急行	8.6	42,312	渋沢倉庫	2.8	5,818
愛知時計	2.7	3,696	TAKARA & COMPANY	4.8	10,027	東日本旅客鉄道	118	921,698	東陽倉庫	9.2	2,364
インターアクション	4.1	6,490	アシックス	64.2	189,711	西日本旅客鉄道	88.9	518,820	日本トランスシティ	14	7,014
オーバル	6.3	3,162	ツツミ	1.6	3,131	東海旅客鉄道	53.6	891,368	ケイヒン	1.2	1,844
東京精密	15.3	66,402	ローランド	5.1	20,706	西武ホールディングス	84.2	116,196	中央倉庫	3.3	3,075
マニー	30.7	69,382	小松ウォール工業	2.5	4,600	鴻池運輸	11.9	18,813	川西倉庫	1.2	1,207
ニコン	108.2	144,338	ヤマハ	43.8	236,958	西日本鉄道	18.6	52,191	安田倉庫	4.8	4,502
トプコン	36.8	60,609	河合楽器	1.9	4,900	ハマキョウレックス	5.5	18,837	ファイズホールディングス	1.3	1,298
オリンパス	435	1,220,610	クリナップ	7.8	5,226	サカイイ越センター	3.3	15,163	東洋埠頭	2	2,566
理研計器	4.4	22,000	ピジヨン	44.3	90,549	近鉄グループHLDGS	69.4	340,060	上組	34.5	96,565
タムロン	5.3	18,364	兼松サステック	0.5	797	阪急阪神HLDGS	92.7	397,683	サンリツ	1.5	1,093
HOYA	150.3	2,113,218	キングジム	6.1	5,453	南海電鉄	33.3	100,233	キムラユニティ	3.3	2,567
シード	4.3	2,158	リンテック	14.9	33,495	京阪ホールディングス	28.7	99,302	キューソー流通システム	4.2	4,338
ノーリツ鋼機	6.7	17,647	イトーキ	14.1	7,543	神戸電鉄	2	6,470	東海運	4.1	1,160
A&Dホールディングス	10.4	10,847	任天堂	439.2	2,588,644	名古屋鉄道	76.9	173,717	エーアイティー	4.4	6,322
朝日インテック	92	222,088	三菱鉛筆	9.8	13,661	山陽電鉄	5.3	11,845	内外トランスライン	2.5	5,510
シチズン時計	76.2	45,720	タカラスタンダード	13.4	17,741	アルプス物流	5.6	6,496	日本コンセプト	2.2	3,843
リズム	2.1	3,704	コクオ	33.4	60,353	ヤマトホールディングス	88.9	203,847	情報・通信業 (8.8%)		
大研医器	6.7	3,055	ナカバヤシ	7.3	3,657	山九	17.6	87,032	NECネットエスアイ	23.3	38,258
メニコン	23.8	69,139	グローブライド	5.6	14,996	丸連	3.6	799	クロスキャット	4	6,396
シンシア	0.7	387	オカムラ	20.9	29,573	丸全昭和運輸	4.3	13,846	システナ	117.2	49,224
松風	3.2	7,776	美津濃	6.9	19,796	センコーグループHLDGS	36.8	37,388	デジタルアーツ	4.4	28,380
セイコーグループ	10.7	33,865	電気・ガス業 (1.2%)			トナミホールディングス	1.5	5,475	日鉄ソリューションズ	11.9	40,876
ニプロ	58.8	59,799	東京電力HD	627.3	313,022	ニッコンホールディングス	22.2	53,701	キューブシステム	4.1	4,169
その他製品 (2.4%)			中部電力	256.4	330,243	白石輸送	0.7	1,591	コア	3	4,410
KYORITSU	10.1	1,242	関西電力	268.6	313,187	福山通運	5.8	20,300	手間いらず	1.2	6,180
中本パックス	2.1	3,290	中国電力	111	79,365	セイノーホールディングス	43.2	52,012	ラクーンホールディングス	6.9	8,694
スノーピーク	11.9	26,953	北陸電力	65.9	35,388	エスライン	2	1,646	ソリトンシステムズ	3.6	4,194
パラマウントベッドHD	16.3	43,700	東北電力	170.3	111,205	神奈川中央交通	2	6,730	ソフトクリエイイトHD	2.9	10,208
トランザクション	5.3	6,815	四国電力	59.5	44,803	日立物流	13.3	118,237	TIS	78.4	304,976
粧美堂	2	716	九州電力	160.6	115,310	AZ-COM丸和ホールディ	16.8	24,528	JNSホールディングス	3	1,077
ニホンフラッシュ	6.5	6,272	北海道電力	67.3	30,554	C&Fゾホールディングス	6.7	8,214	グリー	37.4	28,723
前田工織	7.7	24,986	沖縄電力	16.3	17,180	九州旅客鉄道	49.2	148,830	GMOペパボ	1	2,022
永大産業	7.6	1,717	電源開発	52.4	110,983	SGホールディングス	133.3	283,929	コーエーテックモHD	43.7	103,787
アートネイチャー	7.1	5,516	エフオン	5.1	2,794	NIPPON EXPRESS	25.9	209,531	三菱総合研究所	3.4	17,510
バンダイナムコHLDGS	63.5	574,357	イーレックス	12.4	31,272	海運業 (0.6%)			ボルテージ	2.1	686
アイフィスジャパン	2	1,256	レノバ	18.5	50,523	日本郵船	185.8	564,274	電算	0.7	1,141
SHO E I	7.3	40,442	東京瓦斯	147.1	371,574	商船三井	122.4	411,876	AGS	2.7	1,763
フランスベッセルHLDGS	8.3	7,735	大阪瓦斯	140.9	298,989	川崎汽船	59.2	153,801	ファインデックス	5.5	3,036
パイロットコーポレーション	10.9	53,955	東邦瓦斯	27.4	73,733	NSユナイテッド海運	3.7	13,986	ブレインパッド	6.9	6,161
萩原工業	4.3	4,570	北海道瓦斯	4.1	6,937	明治海運	6.7	4,830	K Lab	13.7	6,713
アジュールインターナショナル	14	26,166	広島ガス	14.5	4,930	飯野海運	25.5	23,791	ポルトゥウィンホールディ	11.9	11,150
タカラトミー	32	40,192	西部ガスHLDGS	6.5	10,907	共栄タンカー	1.3	1,235	ネクソン	180.3	521,788
広済堂ホールディングス	4.7	9,141	静岡ガス	15.8	17,380	乾汽船	8.8	16,077	アイスタイル	22.3	11,997
エステールホールディングス	1.6	1,008	メタウォーター	8.6	15,385	空運業 (0.5%)			エムアップホールディングス	8.6	11,644
タカノ	2.6	1,757	陸運業 (3.2%)			ANA航空	170.7	466,523	エイチーム	5.1	4,227
プロネクサス	5.7	5,506	SBSホールディングス	6.2	18,383	日本航空	189.1	556,804	エニグモ	8.9	5,313

日本株式インデックスファンド（FOF s用）（適格機関投資家専用）

銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
テクノスジャパン	千株	千円	ラクス	千株	千円	Link-U	千株	千円	ビジョン	千株	千円
enish	5.6	2,738	ランドコンピュータ	33	56,760	ギフティ	1.3	1,250	スマートバリュー	9.2	12,668
コプロラ	5.3	2,247	ダブルスタンダード	1.6	1,400	ダベス	7.5	16,957	USEN-NEXT HLDGS	1.7	799
オルトプラス	27.1	18,590	オープンドア	2.8	6,196	JMDC	2.4	9,276	ワイヤレスゲート	6.3	14,811
ブロードリーフ	5.4	1,566	マイネット	4.9	9,638	フォーカスシステムズ	11.4	58,368	コネクシオ	3.2	896
クロス・マーケティング	40.6	20,137	アカツキ	2.3	1,046	フジ・メディア・HD	5	5,010	日本通信	4.7	5,635
デジタルハーツHLDGS	2.8	2,192	ベネフィットジャパン	3.3	7,504	オービック	5.4	9,369	クロップス	64.5	14,319
システム情報	4.4	8,316	UBICOMホールディングス	0.4	520	ジャストシステム	67.2	72,374	日本電信電話	1.1	1,224
メディアアドゥ	6.1	5,477	カナミックネットワーク	2.2	5,049	TDCソフト	23.3	505,610	KDDI	894	3,415,080
じげん	2.8	5,348	チェンジ	10.7	6,901	Zホールディングス	10	33,000	ソフトバンク	539.1	2,216,240
ブイキューブ	20.3	7,247	シンクロ・フード	6.5	799	トレンドマイクロ	5.8	8,520	光通信	1,120.8	1,678,398
エンカレッジ・テクノロジ	8.4	6,678	オークネット	17.1	37,295	IDホールディングス	992.9	370,848	エムティーアイ	8.2	157,194
サイバーリンクス	1.3	670	キャピタル・アセット・プラン	4.4	2,094	日本オラクル	40.3	274,443	GMOインターネットグループ	6.4	3,238
ディー・エル・イー	2.2	2,488	セグエグループ	3.6	7,023	アルファシステムズ	4.6	4,222	ファイバーゲート	25.9	65,656
フィックスターズ	4.3	1,444	エイトレッド	1.3	773	フューチャー	13.3	106,799	アイドマーケティングコミュ	3.7	3,478
CARTA HOLDINGS	7.9	10,870	マクロミル	1.9	1,727	CAC HOLDINGS	2.2	9,328	KADOKAWA	1.6	457
オープンティム	3.3	5,610	ピーグリーン	1	1,517	S Bテクノロジー	17.4	29,075	学研ホールディングス	36.9	93,836
セレス	5.8	6,739	オロ	15.8	17,427	トーセ	4.3	6,180	ゼンリン	11.7	12,004
SHIFT	2.8	2,682	ユーザローカル	1.2	1,560	オービックビジネスC	3	6,180	昭文社ホールディングス	11.9	10,245
ティーガイア	5.1	147,237	テモナ	2.1	3,920	伊藤忠テクノソリューション	1.8	1,393	インプレスホールディングス	3	882
セック	7.4	12,224	ニーズウェル	2.5	3,975	アイティフォー	13.7	64,047	アイネット	6.2	1,326
テクマトリックス	0.9	2,102	マネーポワード	1.3	442	東計電算	37.4	125,290	松竹	4.2	5,481
プロシップ	12.7	20,904	サインボスト	2.1	1,533	エクサネット	9	7,209	東宝	4	47,600
ガホー・オンライン・インター	3	4,581	電算システムHD	16.8	82,068	大塚商会	1	5,910	東映	43.6	230,644
GMOインターネットウェア	21.4	44,512	ソルクシーズ	2.7	1,979	サイボウズ	0.8	798	NTTデータ	1.9	35,929
ザッパラス	15.9	193,344	フェイス	3.3	7,497	電通国際情報S	9.6	21,302	ピー・シー・イー	4.2	5,384
システムリサーチ	2.5	912	プロトコポレーション	5.6	2,066	ACCES S	8.5	38,887	ビジネスB太田昭和	3	5,853
インターネットエシアティブ	2.1	4,265	ハイマックス	2	1,088	デジタルガレージ	8.1	6,058	DT S	15.3	50,413
さくらインターネット	38.9	95,305	野村総合研究所	8.7	10,962	イーエムシステムズ	12.4	49,662	スクウェア・エニックス・HD	35.1	217,269
ヴィンクス	7.7	4,057	サイパネットシステム	143.1	428,727	ジーユーニューズ	11.6	11,460	シーイーシー	9.8	14,827
GMOグローバルサインHD	2.1	3,532	CEホールディングス	5.8	5,608	日本エンタープライズ	2.5	19,025	カプコン	69.3	289,327
S R Aホールディングス	2.1	8,400	日本システム技術	3.5	1,795	WOWOW	6.3	5,884	アイ・エス・ビー	3.5	4,578
システムインテグレータ	3.5	10,937	インテジホールディングス	2.9	5,028	スカラ	1.5	3,328	ジャステック	4.2	5,031
朝日ネット	1.9	875	ソースネクスト	9.5	14,554	インテリジェントウェイブ	7.1	1,008	S C S K	56.9	125,293
e B A S E	7.5	4,282	シンフォコム	1.9	1,936	WOW WORLD GROUP	3.9	4,882	N S W	2.7	5,859
アパントグループ	8.8	13,200	シンプレクスHD	35.5	9,904	IMAGICA GROUP	6.8	5,079	アイネス	4.8	6,931
アドソル日進	2.8	4,222	HE ROZ	9	18,414	ネットワンシステムズ	3.7	2,982	T K C	12.5	46,687
ODKソリューションズ	2.1	8,400	ラクスル	11.7	27,155	システムソフト	3.7	2,982	富士ソフト	7.9	64,306
フリービット	1.5	904	メルカリ	2.3	2,868	アルゴグラフィックス	1.2	1,270	N S D	24.8	63,488
コムチュア	4.3	4,970	I P S	9.8	30,037	マーベラス	5.8	4,379	コナミグループ	29.9	192,855
サイバーコム	1.1	1,723	F I G	31.4	88,265	エイベックス	26	88,400	福井コンピュータHLD S	4.8	14,131
アステリア	5.5	4,466	システムサポート	2.3	3,052	WOW	24.3	2,405	J B C Cホールディングス	5	9,795
アイル	3.9	7,764	イーンソル	6.4	24,320	スカラ	6.4	24,320	ミロク情報サービス	6.3	9,456
マークライズ	3.9	7,764	アルテリア・ネットワークス	2.9	4,326	インテリジェントウェイブ	11.9	18,195	ソフトバンクグループ	403.4	2,401,036
メディカル・データ・ビジ	10.6	10,621	東海ソフト	4.5	4,099	WOW	25.7	84,424	卸売業 (5.9%)		
g u m i	11.4	8,401	ウイングアーク1 S T	6.4	8,000	兼松エレクトロニクス	4.4	20,086	高千穂交易	2.6	5,694
シューケース	1.6	580	ヒト・コミュニケーションズHD	1.1	1,018	都築電気	4.4	20,086	オルパヘルスケアHLDGS	1.5	2,362
モバイルファクトリー	1.5	1,354	サパーワークス	7.2	15,976	TBSホールディングス	3.6	4,802	伊藤忠食品	1.7	8,823
テラスカイ	3	8,400	東名	1.9	3,129	日本テレビHD S	35.8	56,134	エレマテック	6.4	9,830
デジタル・インフォメーション	3.6	7,146	ヴィッツ	1.4	3,929	朝日放送グループHD	61.9	65,552	あらた	5.6	22,540
PCIホールディングス	3.6	7,146	トビラシステムズ	0.5	744	テレビ朝日HD	6.7	4,167	トーメンデバイス	1.1	6,127
アイビーン	2.9	2,897	S a n s a n	0.7	718	スカパーJ S A T H D	17.1	23,444	東京エレクトロデバイス	2.7	18,549
ネオジャパン	1.1	491		1.8	2,039	テレビ東京HD	61.8	31,394	円谷フィールズホールディ	6.3	14,943
P R T I M E S	2.3	2,302		26	43,420	日本B放送	5	9,205	双日	78.2	190,651
	1.7	4,212					2.5	2,292			

日本株式インデックスファンド (F O F s 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円	
アルフレッサホールディングス	74	123,284	尾家産業	1.8	1,666	岩谷産業	16.7	96,359	蔵王産業	0.9	1,595
横浜冷凍	20.1	19,999	シモジマ	5	4,805	ナイス	2.5	3,295	ズケン	26.9	99,395
神栄	1.1	881	ドウシシャ	7.7	11,734	ニチモウ	0.8	2,119	ジェコス	4.7	3,774
ラサ商事	3.1	3,127	小津産業	1.5	2,203	極東貿易	4.4	5,830	グローセル	8.1	3,499
アルコニック	9.6	12,624	高速	3.7	6,541	アステナホールディングス	13.2	5,504	小売業 (4.5%)		
神戸物産	56.9	203,417	たけびし	2.7	4,071	三菱オプリー	20.3	26,227	ローソン	18.1	89,142
ハイパー	1.4	686	リックス	1.9	4,191	稲畑産業	15	35,535	サンエー	5.4	23,544
あいホールディングス	11.8	26,196	丸文	6.7	6,097	G S I クレオス	4.3	6,269	カワチ薬品	5.4	11,399
ダイブイエックス	2.5	2,552	ハピネット	6.3	12,228	明和産業	9.8	6,869	エービーシー・マート	10.7	74,579
グイワボウHD	30	65,280	橋本総業HLDGS	3	2,976	クワザホールディングス	2.4	1,022	ハードオフコーポレーション	3	4,272
マクニカホールディングス	17.9	61,665	日本ライフライン	22	20,834	ワキタ	13.4	16,053	アスクル	17.8	28,141
ラクト・ジャパン	2.9	6,150	タカショー	6.3	4,435	東邦ホールディングス	18.4	39,192	グオホールディングス	7.8	15,295
グリムス	3.1	5,626	I DOM	22.2	16,605	サンゲツ	18.4	38,658	アダストリア	8.9	17,862
バイタルK S K HD	11	9,086	進和	4.7	9,672	ミツウロコグループ	9.4	9,945	ジューフト	3.5	1,029
八洲電機	5.7	5,785	エスケイジャパン	1.8	963	シナノンホールディングス	2.4	9,120	シー・ヴィ・エス・バイエリア	1	402
メディアスホールディングス	5.1	3,901	ダイترون	2.8	6,848	伊藤忠エネクス	18	18,360	くら寿司	8.6	28,810
レスターホールディングス	7	15,533	シークス	10.4	14,549	サンリオ	20.8	94,120	キャンドウ	2.6	5,597
ジューテックHD	1.8	2,075	田中商事	2.1	1,184	サンワテクノス	3.8	5,798	アイケイ	2.3	977
大光	3.3	2,230	オーハシテクニカ	3.5	4,896	リョーサン	7.8	22,167	パルグループHLDGS	7.2	17,431
OCHIホールディングス	1.7	2,126	白銅	2.6	6,481	新光商事	9.7	10,912	エディオン	29.2	36,616
TOKAIホールディングス	36.1	31,623	グアイコー通産	0.7	803	タイホー	3.2	5,539	サウコーポレーション	15.5	11,625
黒谷	2	1,174	伊藤忠	453.5	1,944,154	三信電気	2.9	6,513	ワッツ	3	2,076
Cominix	0.7	517	丸紅	581.5	900,162	東陽テクニカ	8.7	12,171	ハローズ	3.2	9,580
三洋貿易	7.5	8,542	高島	1.3	3,861	モスフード サービス	10.8	34,344	フジオフードG本社	6.2	8,605
ビューティガレージ	1.3	3,919	長瀬産業	34.9	70,463	加賀電子	5.9	25,901	あみやき亭	1.8	5,220
ウイン・パートナーズ	6	5,952	蝶理	4.2	8,345	ソーダニツカ	5.9	3,534	ひらまつ	15.9	2,957
ミタチ産業	1.9	2,105	豊田通商	64.5	337,335	立花エレクトック	5.1	9,057	大黒天物産	2.6	13,728
シッパヘルスケアHD	26.6	73,761	三共生興	10.2	4,926	フォーバル	2.8	2,895	ハニスホールディングス	6.5	7,982
明治電機工業	2.4	2,496	兼松	28.5	43,548	P A L T A C	11.6	50,054	ファーマライズHD	1.5	1,014
デリカフーズHLDGS	3	1,461	ツカモトコーポレーション	1	1,317	三谷産業	12.7	3,975	アルペン	6.1	12,383
スターティアホールディングス	1.4	1,614	三井物産	538.6	2,145,243	太平洋興発	2.6	1,944	ハブ	2.5	1,670
コマダホールディングス	18.1	43,657	日本紙パルプ	3.9	19,617	西本WISMETTAC HD	1.9	7,030	クオールホールディングス	10.1	11,514
ピーバンドットコム	0.8	423	カメイ	7.8	9,367	ヤマシタヘルスケアHLDGS	0.8	1,294	ジンスホールディングス	4.4	19,030
アセンテック	2.4	1,228	東都水産	0.4	2,028	コーア商事HLDGS	5.1	3,167	ビックカメラ	49	61,985
富士興産	1.6	1,801	OUGホールディングス	1.1	2,651	K P P グループホールディン	17.2	16,718	DCMホールディングス	45	51,660
協栄産業	0.7	1,251	スターゼン	5.6	11,631	ヤマタネ	3.3	5,596	ペッパーフードサービス	15.5	3,286
フルサト・マルカHD	7.3	28,981	山善	19.8	19,800	丸紅建材リース	0.6	1,043	MonotaRO	104.3	243,644
ヤマエグループHD	4.2	6,018	椿本興業	1.3	5,193	日鉄物産	5	25,500	東京一番フーズ	2	1,162
小野建	6.7	9,674	住友商事	455.9	1,024,407	泉州電業	3.6	10,036	DDホールディングス	4.9	3,351
南陽	1.1	2,027	内田洋行	3.3	15,312	トラスコ中山	15.4	32,139	きちりホールディングス	2.1	1,192
佐島電機	4.6	6,200	三菱商事	460.2	2,119,221	オートバックスセブン	25.7	37,470	アークランドサービスHD	6	13,332
エコートレーディング	1.5	963	第一実業	2.6	11,024	モリト	5	3,790	J. フロント リテイリング	91.2	105,700
伯東	4.2	15,687	キャンマーケティングJPN	17	52,870	加藤産業	9	31,455	ドトール・日レスHD	13.1	22,152
コンドーテック	5.6	5,622	西華産業	2.7	4,187	北恵	1.7	1,167	マツヨコカラ&カンパニー	44.6	255,112
中山福	3.7	1,221	佐藤商事	5	5,980	イエローハット	13	22,412	プロコンポリリー	3.9	9,750
ナガイレーベン	9.1	18,263	菱洋エレクトロ	6.3	14,792	J K ホールディングス	5.8	6,043	ZOZO	48.6	166,455
三菱食品	6.8	22,100	東京産業	6.4	5,056	日伝	4.9	8,330	トレジャー・ファクトリー	2.2	5,271
松田産業	5.6	12,896	ユアサ商事	6.6	23,694	北沢産業	4	820	物語コーポレーション	4.1	28,782
第一興商	14.2	58,078	神鋼商事	1.8	8,136	杉本商事	3.1	6,392	三越伊勢丹HD	123.6	163,646
メディアパルHD	76.4	139,812	トルク	7.1	1,661	因幡電機産業	19.1	53,136	Hamee	2.9	2,554
S P K	3.1	4,312	阪和興業	13.2	47,256	東テク	2.5	8,187	マーケットエンタープライズ	0.8	804
萩原電気HLDGS	2.8	7,047	正栄食品	4.9	20,947	ミスミグループ本社	111	371,850	ウエルシアHD	38	114,760
アズワン	10.8	65,988	カナデン	5.9	6,507	アルテック	3.8	1,193	クリエイトSDH	11.9	36,473
スズデン	2.5	5,732	菱電商事	5.9	9,947	タキヒョウ	1.7	1,530	丸善CHI HD	9.1	3,003

日本株式インデックスファンド（FOF s用）（適格機関投資家専用）

銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
ミサワ	千株	千円	コーナン商事	千株	千円	アグシアル リテイリング	千株	千円	33 F G	千株	千円
ティールライフ	1.2	741	エコス	9.9	32,769	井筒屋	4.9	16,635	第四北越フィナンシャルG	5.7	8,550
イー・ピーホールディングス	1	1,329	ワタミ	2.6	4,765	イオン	3.3	1,326	ひろぎんHLDGS	10.8	28,274
チムニー	1.7	766	マルシェ	8.9	9,425	イズミ	249.3	703,773	おきなわ F G	88.1	55,679
シュッピン	2.3	2,592	パンパシフィックHD	2.5	1,010	平和堂	11	33,165	十六 F G	6.4	13,721
オイシックス・ラ・大地	5.5	8,085	西松屋チェーン	165	393,360	フジ	11.9	24,168	北國 F HD	8.7	22,968
ネクステージ	9.9	19,077	ゼンショーホールディングス	16.3	22,738	ヤオコー	11.2	20,921	プロクリアホールディングス	5.8	25,839
ジョイフル本田	16.8	51,828	幸楽苑ホールディングス	40.3	139,639	ゼビオホールディングス	8.2	54,940	あいちフィナンシャルグル	8.3	17,919
鳥貴族ホールディングス	23.7	43,821	ハークスレイ	4.9	5,047	ケーズホールディングス	10.1	9,514	新生銀行	9.2	20,378
ホットランド	2.7	6,601	サイゼリヤ	2.7	1,779	OLYMPICグループ	58.6	66,804	あおぞら銀行	20.3	47,481
すかいーくHD	5.6	8,551	V Tホールディングス	12.2	34,318	日産東京販売HD	2.3	1,205	三菱UFJフィナンシャルG	42.7	110,806
S F Pホールディングス	4	6,844	魚力	27.7	14,071	シルバークライフ	8.9	2,652	りそなホールディングス	4,495.6	3,394,627
綿半ホールディングス	5.8	7,870	ポプラ	2.3	4,949	GENKY DRUGSTORES	1.7	2,646	三井住友トラストHD	877.5	579,939
ヨシックスホールディングス	4	6,844	フジ・コーポレーション	0.9	135	ナルミヤ・インターナショナル	3.6	12,456	千葉銀行	127.4	561,451
ユナイテッド・スーパーマケ	1.5	3,169	ユナイテッドアローズ	4.1	5,280	ブックオフGHD	1.1	946	群馬銀行	501.3	2,342,574
ゴルフダイジェスト・オン	23.3	25,653	ハイデイ日高	7.9	14,891	ギフトホールディングス	4.5	5,913	武蔵野銀行	190.2	158,626
B E E N O S	3.3	5,745	YU-WA CREATION H	10.9	21,342	アイホールディングス	1.6	6,320	千葉興業銀行	131.5	59,306
あさひ	4.2	13,356	コロナイド	4.6	966	元気寿司	10.1	67,973	筑波銀行	8.3	15,628
日本調剤	6.2	8,258	ピーシーデポコーポ	34	60,826	ヤマダホールディングス	2.3	7,314	七十七銀行	14.7	5,527
コスモス薬品	8	115,868	壱番屋	8.2	2,419	アークラunds	302.3	144,197	秋田銀行	27.6	5,851
トーエル	5.3	115,868	パンパシカルチャー	5.8	26,419	ニトリホールディングス	10.8	16,178	山形銀行	21.6	42,076
セブン&アイ・HLDGS	3.2	2,339	P L A N T	2.8	574	グルメ軒屋	29.8	463,837	岩手銀行	4.2	7,072
ツライイ・レストランツ・ホール	253.6	1,414,834	スギホールディングス	1.2	758	愛眼	6.1	6,081	東邦銀行	7.3	8,884
クリハホールディングス	55.4	52,020	スギホールディングス	14.7	90,993	ケユーホールディングス	6.5	1,144	東北銀行	4.5	8,707
サンマルグホールディングス	18	159,660	ヴィア・ホールディングス	4.1	10,578	吉野家ホールディングス	4.3	5,590	ふくおかフィナンシャルG	53.5	11,235
フェリシモ	6	10,140	スクロール	9.7	1,125	松屋フーズHLDGS	28.8	66,844	スルガ銀行	2.8	2,760
トリクルホールディングス	1.7	1,745	ヨドバシホールディングス	10.9	7,749	関西ミホールディングス	3.5	13,982	八十二銀行	54.4	146,390
T O K Y O B A S E	18.3	49,263	木曾路	6.2	10,738	開西フードマーケット	11.9	14,529	山梨中央銀行	63	27,027
ウイルプラスHLDGS	7.6	2,280	SRSホールディングス	11.2	23,990	プレナス	6.6	9,167	大垣共立銀行	139.5	72,400
JMホールディングス	1.3	1,548	千趣会	12.2	10,333	ミニストップ	4.9	29,694	福井銀行	6.7	6,988
サッドラホールディングス	5.9	10,378	タカキユー	13.8	5,644	アークス	1	2,637	清水銀行	12.8	23,603
アレザホールディングス	3.4	2,390	リテラルパートナーズ	6.1	481	パローホールディングス	4.7	6,688	富山銀行	5.7	8,344
串かつ田中H L D G S	5.6	5,510	上新電機	10.8	13,359	ベルク	13.1	27,496	滋賀銀行	2.3	3,516
パロックジャパン	2	3,606	日本瓦斯	6.6	12,573	ファーストリテイリング	13.6	23,908	南都銀行	0.9	1,571
クスのアオキHLDGS	4.5	3,595	ロイヤルホールディングス	39.4	82,858	サンドラッグ	4.1	4,350	紀陽銀行	11.3	29,560
かの源HD	7.4	56,092	東天紅	14.2	34,037	ザックスパーホールディング	11	888,910	ほくほくフィナンシャルG	10.1	23,583
FOOD&LIFE COMPAN	4.2	3,817	いなげや	0.6	489	ヤマザウ	27.8	101,748	山陰合同銀行	62.1	21,735
メディカルシステムネットワ	6.4	2,585	チヨダ	6.6	7,814	やまや	7.1	5,680	鳥取銀行	21.6	123,120
一家ホールディングス	1.7	1,062	ライフコーポレーション	7.3	5,569	ペルルーネ	0.1	1,048	百十四銀行	24.2	36,808
ジャパングラフトホールディ	2.4	1,564	リンガーハット	6.3	15,479	いよぎんホールディング	7.8	8,108	阿波銀行	43.6	40,504
はるやまHLDGS	3.3	1,438	Mer Ma x HD	9.5	20,852	しずおかフィナンシャル	17.8	12,264	大分銀行	42.2	31,861
ノジマ	24	33,480	テアライド	10.6	7,017	ちゅうぎんフィナンシャル	1.7	785	宮崎銀行	1.7	1,871
カップ・クリエイト	11.7	16,122	AOKIホールディングス	7.8	2,028	島根銀行	1.7	785	佐賀銀行	5.9	10,584
ライトオン	5.6	3,561	オークワ	13.7	9,398	じもとホールディングス	80.7	58,830	琉球銀行	9.9	9,098
良品計画	95	137,655	コメリ	11.1	10,456	めぶきフィナンシャルG	154.2	154,971	セブン銀行	9.7	19,807
パリティホールディングス	9.6	2,534	青山商事	11.4	29,526	九州フィナンシャルG	56.9	55,079	みずほフィナンシャルG	3.9	7,722
アドヴァングループ	7	6,230	しまむら	11.1	11,414	ゆうちょ銀行	1.7	785	高知銀行	4.2	9,735
アルピス	2.5	5,960	はせがわ	15.8	15,784	富士第一銀行	4	1,656	山口フィナンシャルG	3.5	5,635
コナカ	8.4	2,814	高島屋	8.6	107,414	コソルディア・フィナンシャル	337.5	105,300	名古屋銀行	14.9	12,441
ハウス ローゼ	0.9	1,455	松屋	3.7	1,357	西日本フィナンシャルHD	8.7	20,766		242.1	63,188
G-7ホールディングス	0.9	1,455	エイチ・ツー・オーリテイリング	55.3	98,765		119.5	47,441		992.4	1,703,950
イオン北海道	9.2	14,011	近鉄百貨店	12.3	11,992		194.5	204,419		1.8	1,206
コジマ	10.6	12,486	丸井グループ	35.6	43,432		16.4	9,315		74.6	60,873
ヒマラヤ	14.4	8,841		2.2	5,423		375.9	179,304		2	2,496
	2.3	2,109		54.2	126,502		42.7	37,319		4.4	14,146

日本株式インデックスファンド (F O F s 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円
北洋銀行	102.5	25,112	プレミアムグループ	11.5	22,137	フェイズネットワーク	0.9	1,238	サニーサイドアップG	2.5	1,562
大光銀行	1.8	2,131	ネットプロHD	22.7	10,805	パーク24	53.4	107,067	パーソルホールディングス	80.1	252,315
愛媛銀行	8.7	7,664	クレディセゾン	43.5	76,429	パラカ	2.4	4,579	リニカル	4	2,912
トマト銀行	1.8	1,796	芙蓉総合リース	6.3	55,377	宮越ホールディングス	3.1	2,740	クックパッド	19.6	4,155
京葉銀行	30.8	16,786	みずほリース	10.2	33,711	三井不動産	297.7	826,564	エスクリ	2.9	991
栃木銀行	30.6	9,822	東京センチュリー	12.8	60,416	三菱地所	434.3	842,542	アイ・ケイ・ケイホールディング	3.4	2,159
北日本銀行	2.1	4,067	日本証券金融	27.7	28,420	平和不動産	11.1	45,399	学情	3.2	4,793
東和銀行	11.2	6,126	アイフル	113.7	46,389	東京建物	65.2	125,249	スタジオアリス	3.5	7,304
福島銀行	5.7	1,282	リコーリース	6.6	24,090	京阪神ビルディング	8.8	11,281	シミックホールディングス	3.9	6,774
大東銀行	1.8	1,164	イオンフィナンシャルサービス	39.8	58,466	住友不動産	123.8	460,040	エプコ	1.4	1,034
トモニホールディングス	53.3	18,601	アコム	122.8	39,418	テーオーシー	12.3	8,942	N J S	1.6	3,312
フィデアホール	6.5	8,846	ジャックス	7.4	28,897	東京楽天地	1.1	4,790	総合警備保障	26.5	98,712
池田泉州HD	85.2	19,766	オリコ	18	21,546	スターツコーポレーション	9.8	26,930	カカコム	53.4	129,655
証券・商品先物取引業 (0.7%)			オリックス	458.3	1,013,072	フジ住宅	9.5	6,232	アイロムグループ	2.6	5,766
F P G	27.9	32,503	三菱HCキャピタル	267.6	175,010	空港施設	7.9	4,258	セントレア・ホールディング	4.5	3,843
ジャパンインベストメントA	5.6	6,871	九州リースサービス	3.5	2,366	明和地所	3.4	2,145	サイネックス	1.6	891
マキリアホールディングス	4.1	2,513	日本取引所グループ	192.5	380,283	住友不動産	6.5	11,466	ルネサンス	5	4,505
S B Iホールディングス	99.2	259,705	イー・ギャランティ	11.1	27,294	エスリード	3.2	6,041	ディップ	12.5	51,187
日本アジア投資	5.7	1,658	アサックス	3.4	2,067	日神グループHLDGS	11	4,730	デジタルホールディングス	5.6	6,647
ジャフコグループ	22.9	55,120	NECキャピタルソリューション	3.5	7,280	日本エスコン	15.4	12,905	新日本科学	7.6	20,998
大和証券G本社	490.8	298,400	不動産業 (2.1%)			M I R A R T Hホールディング	34.7	13,533	キャリアデザインセンター	1.5	2,410
野村ホールディングス	1,263.1	632,434	大東建託	25.1	384,532	A V A N T I A	3.4	2,726	ベネフィット・ワン	33.1	71,496
岡三証券グループ	61.4	23,761	いちご	79.3	24,503	イオンモール	35.4	58,587	エムスリー	141.3	594,166
丸三証券	23.2	9,790	日本駐車場開発	81.6	20,073	毎日コムネット	2.5	1,782	ツカダ・グローバルHOLD	4.5	1,777
東洋証券	23.1	6,537	スター・マイカ・HLDGS	6.2	4,439	ファースト住建	2.7	2,732	プラス	1	953
東海東京HD	75.9	27,096	S R Eホールディングス	3.4	15,555	ランド	410.6	4,106	アウトソーシング	42.6	42,940
光世証券	2.1	844	ADワークスグループ	17.2	2,683	カチダ	18.4	58,236	ウエルネット	6.3	4,044
水戸証券	19.2	4,339	ビューリック	159.6	184,018	トーセイ	11.4	15,982	ワールドホールディングス	3.2	9,296
いちよし証券	12.8	7,833	三栄建築設計	3.3	5,075	穴吹興産	1.6	3,188	ディー・エヌ・エー	30.5	56,425
松井証券	40.8	32,068	野村不動産HLDGS	42.8	142,096	サンフロンティア不動産	11.3	13,243	博報堂D Y HLDGS	91.2	121,387
マネックスG	76.7	32,981	三重交通グループHD	14.7	7,232	インテリックス	1.7	921	ぐるなび	13.1	5,488
極東証券	8.9	5,482	サムティ	10.4	23,649	ランドビジネス	2.4	547	タカミヤ	9.7	3,734
岩井コスモホールディング	8	10,192	地主	5.2	10,587	サンネクスタグループ	2.1	2,076	ジャパンバスターレキス	4.5	3,924
アイザワ証券グループ	10	6,870	プレサンスコーポレーション	9	14,301	グランディアハウス	5.7	3,123	ファンコミュニケーションズ	1.4	6,174
マネーパートナーズGP	7.4	2,057	ハウスコム	1	1,092	日本空港ビルディング	24.2	150,524	ライク	2.7	5,621
スパークス・グループ	7.7	13,143	J P M C	3.3	3,451	サービス業 (5.4%)			ビジネス・ブレイクスルー	2.5	980
小林洋行	3.7	817	サンセイイランディック	1.8	1,540	明豊ファシリティアワークス	3.5	2,506	エスプール	20.6	19,343
保険業 (2.4%)			エストラスト	0.9	545	日本工営	5.1	17,977	W D Bホールディングス	3.6	8,557
かんぽ生命保険	83.5	190,964	フージャースHD	10.5	8,368	L I F U L L	24.7	6,150	ティア	4	1,692
S O M P Oホールディングス	117.7	713,144	オープンハウスグループ	25	144,500	M I X I	16.3	40,163	C D G	0.7	826
アニコムホールディングス	23.5	17,037	東急不動産HD	205.9	152,777	ジェイエイシクルトメント	6.5	16,815	アドウエイズ	9.8	5,360
M S & A D	154.7	634,270	飯田GHD	60	131,580	日本M&Aセンターホールデ	122.6	225,584	パリュウコマース	5.4	11,291
第一生命HLDGS	349.1	887,935	イープランド	1	1,585	メンパーズ	2.1	4,758	インフォマート	74.2	33,686
東京海上HD	690.3	1,951,478	ビーロッド	4.7	2,702	中広	1.1	433	J Pホールディングス	20.5	5,699
T & Dホールディングス	184.2	307,245	ファーストブラザーズ	1.5	1,285	U Tグループ	10.5	28,297	エコナックホールディングス	11.9	1,118
アドバンスクリエイト	4.1	4,395	A N D D Oホールディングス	4	3,412	アイティメディア	2.7	5,027	C Lホールディングス	2	1,666
その他金融業 (1.1%)			シーアールイー	3.1	4,622	E・Jホールディングス	4.6	6,003	プレステージ・インター	30	21,360
全国保証	17.9	91,290	プロパティエージェン	0.8	1,038	夢真ビーネックスグループ	26.1	50,164	アミューズ	3.9	6,988
あんしん保証	3.4	873	ケイアイスター不動産	3.3	16,269	コシダカホールディングス	21.4	24,545	ドリームインキュベータ	2.2	6,217
ジェイリース	2.3	7,141	アグリ都市デザイン	1.2	1,860	アールナー	1.7	1,788	クワイック	5.5	11,456
イントラスト	2.7	2,068	ジェイ・エス・ビー	1.7	7,420	パソナグループ	8.7	17,904	T A C	3.8	786
日本モーゲージサービス	3.9	3,354	ロードスターキャピタル	2.9	5,046	C D S	1.8	3,310	電通グループ	75	330,000
C a s a	2.7	2,324	テンポイノベーション	2	1,988	リンクアンドモチベーション	20.6	14,646	ティクアンドギザニーズ	2.5	3,592
アルヒ	5.3	5,337	グローバルリンクマネジメント	1.3	1,630	エス・エム・エス	27.2	98,192	ぴあ	2.4	7,872

銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在		銘柄	2022年11月30日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
イオンファンタジー	千株 3.1	千円 9,061	アピスト	千株 1.1	千円 3,232	LITALICO	千株 5.6	千円 13,092
シーティーエス	7.8	6,513	シグマクス・ホールディング	10.8	14,407	アドバンテッジリスクマネ	3.4	1,397
ネオフィーズグループ	2.2	1,575	ウィルグループ	6	8,160	リログループ	39.8	90,067
HUグループHD	20.9	57,997	エスクローA J	7.6	1,185	東祥	5	6,130
アルプス技研	6.2	12,964	メドピア	5.6	9,234	ピーウィズ	2.1	2,492
サニックス	11.4	2,690	レアジョブ	1.4	1,356	TREホールディングス	15.1	23,722
ダイオーズ	0.3	449	リクルートホールディングス	529.5	2,292,205	人・夢・技術グループ	3.2	6,739
日本空調サービス	7.7	5,451	エラン	9.5	9,737	エイチ・アイ・エス	18.7	37,680
オリエンタルランド	75.7	1,492,804	土木管理総合試験	2.8	873	ラックランド	2.2	6,509
ダスキン	15.9	46,952	ネットマーケティング	1.7	1,524	共立メンテナンス	12.2	74,420
明光ネットワークジャパン	9.3	5,738	日本郵政	938.1	1,011,271	イチネンホールディングス	7.5	9,390
ファルコホールディングス	3.2	5,782	ベルシステム24HLDGS	9.6	12,940	建設技術研究所	3.7	12,043
秀英予備校	1.5	664	鎌倉新書	8.1	6,804	スペース	5.1	4,539
田谷	1.1	589	SMN	1.7	809	燦ホールディングス	3.2	5,827
ラウンドワン	59.8	36,478	一蔵	0.9	410	スバル興業	0.5	4,535
リゾートトラスト	28.2	68,667	グローバルキッズCOMP	1.1	645	東京テアトル	2.6	2,966
ビー・エム・エル	8.8	30,448	エアトリ	4.6	12,295	クナベコンサルティンググル	2.7	1,787
りらいあコミュニケーション	11.8	12,118	アトラエ	5.6	8,271	ナガワ	1.9	14,554
リソー教育	32.6	10,529	ストライク	3.5	15,627	東京都競馬	6	24,180
早稲田アカデミー	3.9	4,496	ソラスト	19.7	16,173	常興興産	2.5	2,997
ユー・エス・エス	73.5	168,756	セラク	2.5	3,097	カナモト	13	29,185
東京個別指導学院	8.4	4,443	インソース	8.9	30,037	西尾レントオール	6.6	20,394
サイバーエージェント	171.1	210,281	バイカレントコンサルティング	54.3	242,449	アゴラ ホスピタリティG	40.3	926
楽天グループ	330.8	216,012	ORCHESTRA HLDGS	1.5	3,457	トランス・コスモス	8.9	28,791
クリーク・アンド・リバー社	4.2	8,643	アイモバイル	3.7	4,684	乃村工藝社	31.2	32,198
モーニングスター	11.6	5,452	キャリアインデックス	2.4	840	藤田観光	3.2	9,536
テー・オー・ダブリュー	14.9	4,425	MS - Japan	2.3	2,470	KNT-CTホールディングス	4.3	7,439
山田コンサルティングGP	3.7	4,232	船場	1.6	1,227	日本管財	7.5	19,065
セントラルスポーツ	2.6	6,281	ジャパンエレベーターSHD	25.4	44,246	トーカイ	6.3	11,774
フルキャストホールディングス	6.8	20,910	フルテック	1	1,209	白洋舎	0.7	1,391
エン・ジャパン	12.9	31,579	グリーンズ	2.7	3,026	セコム	72.8	617,708
リソルホールディングス	0.6	2,739	ツナググループHLDGS	2.1	1,115	セントラル警備保障	3.9	9,512
テクノプロ・ホールディング	48	181,920	GAMEWITH	2	816	丹青社	13.9	11,092
アトラグループ	1.6	321	MS&CONSULTING	0.8	500	メイテック	28.5	72,618
インターワークス	1.7	625	ウェルビー	5.3	4,563	応用地質	7	14,672
アイ・アールジャパンHD	3.7	6,689	エル・ティエー・エス	0.9	3,145	船井総研ホールディン	15	41,925
Keeper 技研	5.2	22,126	ミダックホールディングス	4.3	14,491	進学会ホールディングス	2.6	793
ファーストロジック	1.1	909	日総工業	5.4	3,229	オオバ	4.5	3,064
三機サービス	1.3	1,241	キュービーネットHLDGS	3.7	5,524	いであ	1.6	2,747
Gunosy	4.4	2,943	RPAホールディングス	9.7	2,783	学究社	2.8	5,000
デザインワン・ジャパン	2.2	433	スプリックス	2.4	2,383	ベネッセホールディングス	26.7	53,159
イー・ガーディアン	2.7	7,738	マジメメントソリューションズ	3.9	14,917	イオンディライト	7.9	23,107
リブセンス	3.3	1,039	プロレド・パートナーズ	1.8	1,040	ナック	3	2,796
ジャパンマテリアル	21.9	53,282	AND FACTORY	2.1	789	ダイセキ	14.6	68,620
ベクトル	11.2	14,347	テノ、ホールディングス	0.9	496	ステップ	2.9	5,205
ウチヤマホールディングス	3.3	917	フンティア・マネジメント	2.4	3,372			
チャームアコホレーション	6	6,948	ピアラ	1.2	832	合計	株数、金額	81,438.6 199,365,246
キャリアリンク	2.6	7,839	コプロ・ホールディングス	1.2	1,174		銘柄数<比率>	2,152銘柄 <97.1%>
I B J	4.4	4,312	ギークス	1	878			
アサンテ	3.5	5,603	カープスホールディングス	22	21,604			
パリュウHR	6.3	10,552	フォーラムエンジニアリング	4.1	3,567			
M&Aキャピタルパートナー	6.6	32,043	FAST FITNESS JAP	2.4	3,204			
ライドオンエクスプレスHD	2.6	2,919	ダイレクトマーケティングミクス	8.1	12,109			
ERIホールディングス	2	2,160	ポピンズ	1	1,700			

(2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2022年11月30日現在	
	買建額	売建額
国内	百万円 5,810	百万円 -
TOPIX		

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付および借入状況

区分	2022年11月30日現在		
	貸付	借入	株入
株式	5,009,700 (34,400)		株 - 株 (-)

(注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
(注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、大和証券株式会社へ34,400株を貸付しています。

(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。

トピックス・インデックス・マザーファンド 運用報告書 第34期（決算日 2022年9月20日）

（作成対象期間 2021年9月22日～2022年9月20日）

トピックス・インデックス・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

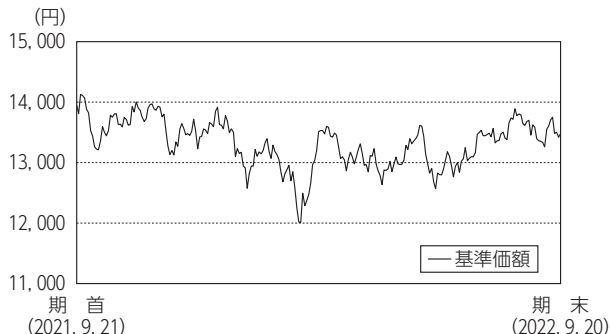
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



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

(注1) 騰落率は期首比。

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

(注3) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注4) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：13,951円 期末：13,480円 騰落率：△3.4%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークが下落したことを受けて、基準価額は下落しました。

くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、当作成期前半に下落しましたが、後半は持ち直しました。

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

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

*ベンチマークはT O P I X（※配当なし）です。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株 式

(2021年9月22日から2022年9月20日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2021年9月22日から2022年9月20日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 株式先物取引	百万円 41,019	百万円 35,992	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2021年9月22日から2022年9月20日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末				
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円			
水産・農林業 (0.1%)																						
極洋	3.1	3.3	12,111					奥村組	11.5	11.8	35,211					大気社	10.1	10	33,150			
日本水産	84.3	96.7	52,798					東鉄工業	8.5	9.5	22,676					ダイダ	4.6	4.4	9,878			
マルハニチロ	14	13.8	33,340					イチケン	1.5	1.7	3,085					日比谷総合設備	6.7	6.4	11,993			
雪国まいたけ	—	7.5	4,470					富士ピー・エス	2.4	3.5	1,641					フィル・カンパニー	1.3	1.1	1,328			
カネコ種苗	2.7	3	4,647					浅沼組	2.6	5.2	14,190					テスホールディングス	—	6.7	7,048			
サカタのタネ	10.8	11.3	54,748					戸田建設	86.1	91.8	70,594					インフロアHD	—	83.6	85,188			
ホクト	7.9	7.9	15,128					熊谷組	9.9	11.8	30,727					東洋エンジニア	9.1	10.1	6,413			
ホクリヨウ	2.3	1.3	791					北野建設	1.2	1.4	3,298					レイズネクスト	11.1	10.3	12,040			
								植木組	1.8	2.1	2,627				食品品 (3.4%)							
鉱業 (0.3%)								矢作建設	9.3	10.1	7,766				ニッポン	19.5	18.6	28,885				
住石ホールディングス	21.6	18.6	4,352					ピーエス三菱	6.8	7.8	5,023					日清製粉G本社	76.2	72.3	104,545			
日鉄鉱業	2.1	2	11,680					日本ハウスHLDGS	14.7	12.6	5,796					日東富士製粉	0.5	1.1	5,010			
三井松島HLDGS	3.6	4.4	14,674					大東建託	23	24.6	363,588					昭和産業	5.9	6	15,024			
I N P E X	367.2	329.6	496,707					新日本建設	8.4	10.5	7,528					鳥越製粉	6.4	5.4	3,564			
石油資源開発	12.4	12.3	46,063					N I P P O	17.7	—	—				中部飼料	8.4	7.8	8,447				
K&O エナジーグループ	4.3	4	6,652					東亜道路	1.3	1.3	7,813					フィード・ワン	9.3	8.9	6,203			
								前田道路	13.2	—	—					東洋精糖	1.5	1	873			
建設業 (2.2%)								日本道路	2.1	2.1	12,495					日本甜菜糖	3.5	3.9	6,279			
ヒノキヤグループ	2.3	—	—					東亜建設	6	5.3	12,894					DM三井製糖ホールディ	5.1	6.1	11,547			
ショーボンドHD	13.2	12.1	76,109					日本国土開発	20	18.8	11,637					塩水港精糖	10.3	7.9	1,595			
ミライト・ワン	31.9	33.5	51,389					若築建設	3.6	3.8	8,246					日新製糖	3.1	3.5	6,086			
タマホーム	5.9	6.3	14,956					東洋建設	24.2	27.1	23,360					森永製菓	15.7	15.5	59,597			
サンヨーホームズ	1.5	1.8	1,245					五洋建設	90.1	88.2	64,738					中村屋	1.6	1.6	5,040			
日本アква	4.4	4.2	2,805					世紀東急	10.2	10.8	8,208					江崎グリコ	18.4	17.9	62,023			
ファーストコーポレーション	3.2	2.6	1,908					福田組	2.4	2.4	11,868					名糖産業	3.2	2.8	4,617			
ベストエ	1.9	2.1	2,114					住友林業	54.4	47.8	112,377					井村屋グループ	3.8	3.8	8,546			
キャンディル	1.7	1.5	894					日本基礎技術	6.3	5.9	2,861					不二家	4.1	4.4	10,692			
スペースバリューHD	11.5	—	—					巴コーポレーション	8.4	9.6	3,907					山崎製パン	50.7	42	68,334			
ダイセキ環境ソリューション	1.8	2	1,822					大和ハウス	194.3	189.7	590,915					第一屋製パン	1.8	0.6	269			
第一カッター興業	2.3	2.2	2,802					ライト工業	12.2	13.2	25,713					モロゾフ	1.1	2.3	8,429			
安藤・間	58.4	47.2	42,149					積水ハウス	227.9	227.6	572,414					亀田製菓	3.8	4	17,960			
東急建設	29	28	18,928					日特建設	5.3	5.1	4,941					寿スピリッツ	6.6	6.7	55,409			
コムシスホールディングス	32.6	33.4	85,804					北陸電気工事	3.4	4.1	3,013					カルビー	30.6	35	103,775			
ピーアールホールディングス	12.5	12.8	4,492					ユアテック	12.1	13.9	10,313					森永乳業	12.6	13	53,560			
高松コンストラクションGP	5.7	6.9	13,248					日本リーテック	4.4	4.6	3,758					六甲バター	4.5	4.5	6,462			
東建コーポレーション	2.8	2.9	23,780					四電工	1.2	2.3	4,303					ヤクルト	46.4	48.8	401,136			
ソネック	1	1.1	1,125					中電工	10.1	9.2	19,872					明治ホールディングス	44.2	42.3	272,412			
ヤマウラ	4.1	4.8	4,656					関電工	34.9	39.1	33,547					雪印メグミルク	16	16.9	28,239			
オリエンタル白石	32.3	35	8,855					きんでん	42.2	48.8	75,249					プリマハム	9.6	9.6	20,265			
大成建設	65.4	66.6	286,713					東京エネシス	6.7	7	7,014					日本ハム	25.7	26.9	104,910			
大林組	209	222.6	219,038					トーエネック	2	2.4	8,448					林業産業	2.8	1.7	782			
清水建設	197.8	205.9	157,101					住友電設	5.9	5.9	15,788					丸大食品	6.4	6.8	10,050			
飛鳥建設	5.7	6.2	6,652					日本電設工業	11.1	10.2	18,584					S Foods	6	6.9	20,368			
長谷工コーポレーション	68.6	64.3	106,352					エクシオグループ	32.3	33	71,841					柿安本店	2.2	2.7	6,183			
松井建設	7.8	8	4,648					新日本空調	5.4	5.2	9,573					伊藤ハム米久HLDGS	42.8	48.5	32,446			
銭高組	0.9	0.9	2,853					九電工	14.8	15.2	43,639					サッポロホールディングス	22.8	20.7	66,136			
鹿島建設	153.9	163.1	243,182					三機工業	15.5	15.6	26,208					アサヒグループホールディ	158.6	144.4	685,900			
不動産トラ	5.1	5	7,720					日揮ホールディングス	70.1	67.9	133,355					キリンHD	247.6	282.1	643,329			
大末建設	2.5	2.6	4,035					中外炉工業	2.4	2.2	3,506					宝ホールディングス	50.2	42.7	46,116			
鉄建建設	3.9	4.7	8,460					ヤマト	6.8	5.9	4,631					オエノホールディングス	19.9	17.5	4,900			
西松建設	15.5	14.5	60,610					太平電業	4.9	4.3	14,663					養命酒	2.3	2	3,636			
三井住友建設	51.7	53.5	24,342					高砂熱学	18.7	18.2	30,612					コカ・コーラボトラーズJHD	47.2	48.9	70,024			
大豊建設	5	3.5	15,155					三晃金属	0.9	1	2,716					サントリー食品インター	45.2	44	226,600			
前田建設	53.4	—	—					朝日工業社	1.4	2.9	5,240					グイドーグループHD	3.8	3.9	18,817			
佐田建設	5.1	4.9	2,072					明星工業	13.1	12	8,724					伊藤園	20.5	23.3	138,402			
ナカノブドール建設	5	5.4	1,625																			

日本株式インデックスファンド（FOF s 用）（適格機関投資家専用）

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
キーコーヒー	6.9	7	14,763		日東製網	0.9	0.7	919		日本カーバイド	2.2	2.9	3,738	
ユニカフェ	2.5	2	1,836		アツギ	5.2	5.3	2,077		堺化学	4.4	4.8	9,312	
ジャパンフーズ	1	1.1	1,211		ダイニツク	2.5	2.1	1,266		第一稀元素化学工	7.3	6.3	8,656	
日清オйлリグループ	8.5	8.7	27,709		セーレン	16.4	13.8	28,952		エア・ウォーター	67.3	59.9	105,064	
不二製油グループ	16.5	16.6	40,089		ソトー	1.8	2.8	2,004		日本酸素 HLDGS	54.3	61.6	151,228	
かどや製油	0.7	0.7	2,509		東海染工	0.8	0.8	892		日本化学工業	1.9	2.1	4,166	
J-オイルミルズ	6.2	6.8	10,567		小松マテレ	10.5	11.3	9,299		東邦アセチレン	1.2	1.5	1,714	
キッコーマン	48.5	46	380,420		ワコールホールディングス	16.3	15.3	34,914		日本パーカラライジング	32	31.5	30,649	
味の素	160.3	152.9	608,083		ホギメディカル	8.7	9.3	31,573		高圧ガス	9.8	10.6	6,996	
ブルドックソース	—	2.8	5,163		クラウドディア HLDGS	2.1	2	578		チタン工業	0.9	0.9	1,452	
キュービー	37.8	33.6	76,003		T S Iホールディングス	19.7	22.8	9,576		四国化成	8	8.5	10,820	
ハウス食品G本社	25.1	24	69,792		マツオカコーポレーション	2	2.1	2,058		戸田工業	1.5	1.6	4,808	
カゴメ	25.4	29.2	86,811		ワールド	8.5	9.9	14,137		ステラ ケミファ	3.5	3.8	10,282	
焼津水産化工	3.1	3.1	2,700		三陽商会	4	3.4	3,216		保土谷化学	1.9	2	6,410	
アリアケジャパン	6.2	7	33,425		ナイガイ	3.2	2.3	586		日本触媒	11.7	10.7	60,241	
ビエトロ	0.9	0.9	1,602		オンワードホールディングス	41.8	41.6	12,438		大日精化	5	5.4	9,520	
エバラ食品工業	1.7	1.7	5,261		ルックホールディングス	2.3	2.1	4,592		カナカ	17	16.1	62,790	
やまみ	0.8	0.7	993		ゴールドウイン	11	12.4	101,184		三菱瓦斯化学	65.8	58.9	121,687	
ニチレイ	32.1	28.6	67,839		デサント	11.4	12.8	46,208		三井化学	57	58.2	178,092	
東洋水産	34.7	34.3	202,370		キング	3.4	3.7	1,531		J S R	66.3	69.7	210,145	
イートアンド HLDGS	2.3	3	6,663		ヤマインターナショナル	5.8	5.5	1,435		東京応化工業	11.4	11.1	71,928	
大冷	1.1	0.6	1,143		パルプ・紙 (0.2%)					大阪有機化学	6.1	4.8	10,785	
ヨシムラ・フード・HLDGS	4	3.8	1,843		特種東海製紙	3.9	3.9	11,895		三菱ケミカルグループ	439.1	464.6	330,562	
日清食品HD	26.4	24.8	244,528		王子ホールディングス	297.6	289.1	159,294		K Hネオケム	11.1	10.6	27,602	
永谷園ホールディングス	3.5	3.3	6,507		日本製紙	29.5	30	26,220		ダイセル	88.5	100.3	90,270	
一正蒲鉾	2.8	3	2,295		三菱製紙	7.8	9.6	2,841		住友ベークライト	10.4	10.6	44,679	
フジッコ	7.5	7.1	13,546		北越コーポレーション	48.7	44.6	33,806		積水化学	137.3	143	270,127	
ロックフィールド	7.5	7.7	11,611		中越パルプ	2.3	2.3	2,166		日本ゼオン	59.3	56.3	76,849	
日本たばこ産業	360.4	411.2	992,431		巴川製紙	2.1	2.3	1,835		アイカ工業	18.2	17.6	56,232	
ケンコーマヨネーズ	4	3.9	6,068		大王製紙	31.8	31.9	37,992		UBE	33.1	35.1	71,779	
わらべや日洋HD	4.6	4.7	10,495		阿波製紙	1.6	1.4	421		積水樹脂	10.2	10.4	17,784	
なとり	4.1	4.3	8,703		レンゴー	68.3	58.3	49,846		タキロンシーアイ	13.8	16.4	8,741	
イフジ産業	1.5	1.2	1,082		トーモク	4.1	3.6	5,486		旭有機材	3.6	4.3	9,872	
ビッグスコーポレーション	3.4	—	—		ザ・パック	4.8	4.8	11,198		ニチパン	3.2	4	6,484	
ファーマフーズ	—	9.7	12,241		化学 (6.1%)					リケンテクノス	16.2	15.2	7,995	
ユーグレナ	35.3	40.2	35,818		北の達人コーポ	24	27.1	6,856		大倉工業	3.5	3	5,304	
紀文食品	—	5.9	5,787		クラレ	96.3	101.2	108,992		積水化成品	7.9	7.7	3,172	
ビッグスホールディングス	—	3.7	3,922		旭化成	435.4	463	468,787		群衆化学	1.4	1.5	3,681	
ミヨシ油脂	2.3	2.3	2,281		共和レザー	3.3	4.1	2,197		タイガース ポリマー	2.2	4.1	1,730	
理研ビタミン	6.4	5.3	9,110		昭和電工	47	61.4	133,176		ミライアル	1.9	2.4	4,192	
繊維製品 (0.5%)					住友化学	518.1	510.7	275,267		ダイキアクシス	2.6	2.3	1,541	
片倉工業	8.8	6	12,096		住友精化	3.2	3	9,810		ダイキョーニシカワ	13.7	15.7	9,058	
グンゼ	4.8	4.4	17,182		日産化学	36	33.7	228,486		竹本容器	2.9	2.5	1,890	
東洋紡	25.6	29.4	32,604		ラサ工業	2.2	2.6	6,198		森六ホールディングス	3.5	3.7	6,645	
ユニチカ	18.5	20.9	6,123		クレハ	5.6	5.4	50,220		恵和	—	2.1	8,274	
富士紡ホールディングス	3.2	3	10,245		多木化学	2.6	2.5	12,675		日本化薬	39.9	52.5	63,525	
倉敷紡績	5.6	5.3	11,490		テイカ	4.6	4.3	5,461		カーリットホールディングス	6.3	6.4	4,345	
シキボウ	3.7	4.2	3,742		石原産業	12.1	13.4	14,257		日本精化	4.8	4.8	9,283	
日本毛織	20.2	18.6	20,385		片倉コープアグリ	1.6	1.7	2,068		扶桑化学工業	5.3	5.9	20,414	
ダイトウボウ	12.1	16.5	1,419		日本曹達	9.1	8.2	37,146		トリケミカル	6.4	7.7	16,578	
トーア紡コーポレーション	2.3	2.3	791		東ソー	101.6	92.7	159,536		A D E K A	30.2	29.5	67,525	
ダイドーリミテツド	7.6	12.6	1,839		トクヤマ	19.3	22.3	41,054		日油	24.9	21.6	111,888	
帝國繊維	7.6	7.2	11,649		セントラル硝子	12	11.3	38,759		新日本理化	13	10.7	2,568	
帝人	61.6	66.1	97,629		東亞合成	39	32.6	36,153		ハリマ化成グループ	4.7	5	4,640	
東レ	476.3	464.9	358,298		大阪ソーダ	6.4	5.8	22,417		花王	148.3	157.9	959,558	
住江織物	1.4	1.3	2,278		関東電化	15	13.7	13,590		第一工業製薬	2.3	2.5	5,262	
日本フェルト	3	4.1	1,685		デンカ	24	25.2	83,664		石原ケミカル	1.7	3.5	4,518	
イチカワ	0.8	0.9	1,224		信越化学	121.6	118.7	1,884,362		日華化学	2.7	2.9	2,505	

日本株式インデックスファンド (F O F s 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
ニイタカ	1.5	1.4	3,353		エフピコ	12.5	14.1	48,504		ブリヂストン	193.5	203.3	1,035	813
三洋化成	3.9	4.5	20,475		天馬	5.2	5.9	12,283		住友ゴム	60.9	62.5	76	625
有機合成薬品	5.7	5	1,560		信越ポリマー	9.9	13.8	17,512		藤倉コンポジット	6.2	6.3	5	865
大日本塗料	7	8.4	6,048		東リ	14.7	17.2	3,457		オカモト	3.9	3.5	13	527
日本ペイント HOLD	247.6	281.3	301,834		ニフコ	25	25.5	80,197		フコク	3.1	3.5	3	444
関西ペイント	74	64.7	138,263		バルカー	5.3	6.2	16,510		ニッタ	6.8	7.2	21	103
神東塗料	5.8	4.7	648		ユニ・チャーム	129.4	132.6	625,341		住友理工	13.3	14.9	8	656
中国塗料	16.4	15.9	14,039		ショーエイコーポ	2.2	2	1,154		三ツ星ベルト	7.7	9.4	31	020
日本特殊塗料	4.9	4.6	4,457		医薬品 (5.4%)					バンドー化学	11.1	12.5	13	037
藤倉化成	8.2	9.3	4,129		協和キリン	79	76.9	245,311		ガラス・土石製品 (0.7%)				
太陽ホールディングス	4.9	10.9	28,743		武田薬品	558.4	600.8	2,308,273		日東紡績	10	9.5	23	436
D I C	27.2	24.8	62,322		アステラス製薬	581.9	653.6	1,293,474		AGC	61.7	64.8	308	772
サカティンクス	13.7	14	13,944		住友ファーマ	50.2	47.3	48,577		日本板硝子	34.6	34.7	20	021
東洋インキSCホールディング	13.3	12.3	23,542		塩野義製薬	84.3	88.8	618,936		石塚硝子	1	1.2	1	886
T & K T O K A	4.6	6.1	5,953		わかもと製薬	8.5	7.6	1,793		日本山村硝子	2.4	2.2	1	331
富士フイルム HLDGS	118.1	134.3	919,552		日本新薬	19.1	16.7	124,582		日本電気硝子	26.9	26	68	172
資生堂	125.3	132.9	687,225		中外製薬	210.1	199.2	696,602		オハラ	2.8	3	4	155
ライオン	81.1	76.5	124,083		科研製薬	11.3	11	42,405		住友大阪セメント	11.9	11.5	40	192
高砂香料	4.2	4.3	11,665		エーザイ	74.4	84.5	509,535		太平洋セメント	38	43.5	93	438
マンダム	14.5	14.9	22,960		ロート製薬	31.8	36.5	159,505		日本ヒューム	5.6	7.1	4	636
ミルボン	8.5	9.4	60,160		小野薬品	153.7	147.4	501,454		日本コンクリート	15	13.6	3	644
ファンケル	24.7	30.9	88,374		久光製薬	19.4	16.2	54,918		三谷セキサン	3.1	3.1	11	594
コーセー	12.8	12.9	187,308		持田製薬	9.2	8.6	29,197		アジアパイルHD	9.6	11.3	5	785
コタ	4.7	5.3	8,140		参天製薬	117	133.2	130,402		東海カーボン	56.9	53.3	56	124
シーボン	0.8	1	1,660		扶桑薬品	2.1	2.5	4,982		日本カーボン	3.7	3.7	15	114
ノーラ・オルビス HD	28.9	32.7	53,137		日本ケミファ	0.8	0.8	1,463		東洋炭素	4.6	4.1	14	329
ノエビアホールディングス	5.6	5.6	32,704		ツムラ	22.5	21.8	67,907		ノリタケ	3.7	3.9	15	892
アジバンホールディング	1.9	1.7	1,625		日医工	19	22	9,526		T O T O	47.9	46.2	228	228
新日本製薬	—	3.7	6,049		キッセイ薬品工業	11.5	11.1	27,838		日本碍子	73.3	75.3	151	127
エステー	4.2	4.8	7,444		生化学工業	11.5	13.7	11,987		日本特殊陶業	51.5	53.4	157	156
アグロカネショウ	2.5	2.6	3,523		栄研化学	12	11.4	20,269		ダントーホールディングス	6.2	5.1	1	647
コニシ	10.9	11.6	18,618		日水製薬	2.5	—	—		M A R U W A	2.4	2.6	46	800
長谷川香料	11.5	13.2	41,646		鳥居薬品	4.2	3.4	9,557		品川リフラクトリーブ	1.5	1.8	7	182
星光PMC	3.8	3.5	1,918		J C R ファーマ	19.3	21.5	45,558		黒崎播磨	1.1	1.3	6	454
小林製薬	18.8	19.5	162,630		東和薬品	9.8	11	23,936		ヨータイ	5	4.9	6	904
荒川化学工業	5	5.4	5,589		富士製薬工業	4.5	4	4,148		インサイト	3	—	—	—
メック	5.2	5.2	12,188		ゼリア新薬工業	12.1	11.3	23,052		東京窯業	7.7	8	2	168
日本高純度化学	2	1.7	4,046		第一三共	527.7	554.6	2,329,874		ニッカトー	2.9	3.5	1	561
タカラバイオ	17.7	20	35,760		キョーリン製薬HD	14.8	13.8	24,274		フジインコポラーテッド	5.5	6.1	38	003
J C U	7.5	7.8	24,492		大幸薬品	10.5	11.6	7,134		クニミネ工業	2.2	2.4	1	968
新田ゼラチン	4	4.4	3,907		ダイト	4.3	4.8	12,408		エーアンドエムテリアル	0.9	1.2	1	041
O A T アグリコ	1.2	2.9	5,359		大塚ホールディングス	139	145.6	661,897		ニチアス	16.9	16.1	38	285
デクセラアルズ	19.6	19.9	77,809		大正製薬HD	16.8	14.2	73,840		ニチハ	9.2	9.8	27	900
アース製薬	5.6	5.8	30,566		ペプチドリーム	35.4	30.9	50,397		鉄鋼 (0.8%)				
北興化学	6.4	6.5	6,240		あすか製薬HD	7.8	7.2	8,100		日本製鉄	317	315.7	710	640
大成ラミック	2.4	2	5,810		サワイグループHD	14.8	14.6	59,276		神戸製鋼所	122.5	131.9	85	207
クミアイ化学	27.1	25.4	26,060		石油・石炭製品 (0.5%)				中山製鋼所	8.4	10.9	6	888	
日本農業	12.1	13.5	11,583		日本コークス工業	58.3	64.7	6,146		合同製鐵	3.5	3.6	6	566
アキレス	4.5	4.8	6,326		ニチレキ	7.7	8.5	11,160		J F Eホールディングス	192.4	175	257	250
有沢製作所	9	10.3	13,616		ユシロ化学	3.4	3.2	2,777		東京製鐵	26.2	22.2	28	904
日東電工	40.5	46.2	399,168		ビービー・カストロール	2.4	2.6	2,836		共英製鋼	7.4	7.4	11	433
レック	7.8	8.8	7,242		富士石油	18.9	16.7	5,377		大和工業	14.1	12.4	56	420
三光合成	7.2	8.7	4,236		M O R E S C O	2.1	2.7	2,967		東京製鋼	2.7	2.9	3	894
きもと	12.7	11.5	2,932		出光興産	73.9	77.8	267,243		大阪製鐵	3.3	4.1	4	940
藤森工業	6	5.9	20,001		ENEOSホールディングス	1,004.4	1,149.6	581,007		淀川製鋼所	8.4	8.2	20	393
前澤化成工業	4.5	4.3	5,645		コスモエネルギー-HLDGS	21.3	30.2	120,800		丸一鋼管	21.4	21.9	65	634
未来工業	2.5	2.7	4,009		ゴム製品 (0.7%)				モリ工業	1.9	1.9	5	074	
ウェーブロックHLDGS	2.3	3	1,845		横浜ゴム	39.2	36.3	84,942		大同特殊鋼	11	10.3	39	500
ジェイ エス ピー	4.3	4.5	6,579		TOYO TIRE	35.7	36.7	62,353		日本高周波	2.3	2.9	930	

日本株式インデックスファンド（FOF s 用）（適格機関投資家専用）

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			千株	千株	千円			千株	千株	千円	
日本冶金工	5.1	5.2	15,106		文化シャッター	20.2	22.4	23,542		イワキポンプ	4	4.9	6,468	
山陽特殊製鋼	7.8	6.5	13,149		三協立山	8.7	9.1	5,605		フリュー	6.8	6.8	7,126	
愛知製鋼	3.8	4.2	9,147		アルインコ	4.4	5.5	4,900		ヤマシンフィルタ	13.8	11.8	3,964	
日立金属	63.1	71.5	155,441		東洋シャッター	1.7	1.6	868		日版製作所	8.1	7.5	6,262	
日本金属	1.7	2	1,992		L I X I L	91.3	119	277,151		やまびこ	12.6	10.5	12,054	
大太平洋金属	4.5	4.7	11,515		日本フィルコン	4.2	4.8	2,246		野村マイクロ・サイエンス	—	2.4	8,796	
新日本電工	44.3	42	14,784		ノーリツ	13.6	9.7	15,102		平田機工	3	3.3	14,899	
栗本鉄工所	2.9	3	4,872		長府製作所	6.5	6.7	13,688		ペガサスミシン製造	6.6	7.7	7,161	
虹技	0.8	1	937		リンナイ	12.9	13.1	138,729		マルマエ	2.9	3.1	6,156	
日本鋳鉄管	0.7	0.8	776		ダイニチ工業	3.8	3.8	2,416		タツム	3.1	3.5	4,907	
三菱製鋼	5	4.8	4,752		日東精工	8.6	9.6	5,126		ナブテスコ	39	40.3	126,542	
日亜鋼業	8.8	8.7	2,114		三洋工業	0.7	0.8	1,360		三井海洋開発	7.3	8	11,736	
日本精練	1	1.2	5,580		岡部	12.2	10.7	7,179		レオン自動機	6.3	8.1	9,525	
エンビプロHD	3.2	5	4,410		ジーテクト	7.9	8.4	11,617		S M C	19.6	22.4	1,415,680	
シンニッタン	8.5	8.7	1,905		東プレ	12.3	11.6	14,314		ソソカワミクロン	2.3	4.9	12,563	
新家工業	1.6	1.5	2,550		高周波熱練	11.8	11.4	7,854		ユニオンツール	2.6	2.8	9,884	
非鉄金属 (0.8%)					東京製鋼	2.9	4.7	4,441		オイレス工業	8.9	9.7	14,608	
大紀アルミニウム	10.1	9.3	12,192		サンコール	5.4	6.6	4,930		日精工エーエスピー	2.2	2.9	11,701	
日本軽金属HD	17.7	19.2	31,084		モリテックスチル	5.4	5.9	1,569		サトーホールディングス	8.6	9.9	18,899	
三井金属	18	20.4	64,770		パイオラックス	9.3	10	19,550		技研製作所	5.9	6.7	22,478	
東邦亜鉛	3.6	3.9	9,410		エイチワン	6.4	6.8	4,100		日本エアテック	3.2	3.2	3,401	
三菱マテリアル	43.6	43.6	89,336		日本発条	66.5	63.9	60,129		カワタ	1.8	2.4	2,119	
住友鉱山	85	82.9	363,931		中央発条	4.4	3.6	2,509		日精樹脂工業	5.5	4.6	4,411	
DOWA ホールディングス	17	17.6	96,096		アドパネクス	1.1	1	1,218		オカダアイオン	2.1	2.4	3,470	
古河機金	10.3	11.1	13,863		立川プラインド	3.1	2.9	3,024		ワイエイティホールディングス	2.8	3	4,131	
エス・サイエンス	35.4	37.2	930		三益半導体	5	5.9	12,077		小松製作所	304	346.5	975,051	
大阪チタニウム	6.7	8.8	28,028		機械 (5.3%)					住友重機	38.5	40.9	118,691	
東邦チタニウム	12.5	13.6	33,632		日本ドライケミカル	1.6	1.7	2,563		日立建機	31.6	30.6	89,596	
U A C J	10	10.3	24,720		日本製鋼所	20.3	19.4	59,073		日工	10.1	9.3	5,924	
C K サンエツ	1.4	1.4	5,628		三浦工業	28.8	29.7	84,942		巴工業	2.6	2.7	6,712	
古河電工	20.6	21.8	54,173		タクマ	22.9	21.7	28,210		井関農機	6.3	6	7,422	
住友電工	230.9	263.8	428,411		ツガミ	14.3	15.4	18,295		T O W A	6.3	6.6	11,794	
フジクラ	80.7	84.5	81,880		オークマ	7.6	7.2	37,008		丸山製作所	1.3	1.2	1,854	
昭和電線 HLDGS	6.7	6.6	12,315		芝浦機械	6.8	8.6	24,905		北川鉄工所	2.7	3	3,897	
東京特殊電線	0.7	1	2,222		アマダ	97.1	119.3	128,366		ローツェ	3.1	3.8	31,198	
タツタ電線	12.5	13.6	6,201		アイダエンジニア	16.9	16.5	13,695		タカキタ	2.2	2.5	1,325	
カナレ電気	0.9	1.1	1,587		滝澤鉄工所	1.8	2.3	2,640		クボタ	327.4	341.8	738,458	
平河ヒューテック	3.7	4.3	4,695		F U J I	26.4	30.1	59,628		荏原実業	3.4	3.2	7,062	
リョービ	7.8	7.1	9,322		牧野フライス	7.7	7.7	34,342		住友精密	2.3	2.2	4,769	
アーレスティ	8.1	8	3,224		オーエスジー	30.3	30.7	58,115		月島機械	11.8	11.9	10,936	
アサヒHD	25.6	30.2	64,144		ダイジェット	0.7	0.9	778		帝国電機製作所	4.5	4.9	9,662	
金属製品 (0.6%)					旭ダイヤモンド	16.3	18.9	14,080		東京機械	3.4	3.1	2,077	
稲葉製作所	4.9	3.9	5,331		DMG 森精機	39.7	38.9	68,386		新東工業	15.3	14.2	10,039	
宮地エンジニアリングG	2.3	2.2	7,161		ソデイック	16.1	17.8	13,901		渋谷工業	5.9	6	14,562	
トーカロ	16.7	19.3	24,298		ディスコ	9	11.1	379,620		アイチ コーポレーション	11.2	10.7	8,656	
アルファ CO	2.2	2.7	2,546		日東工器	3.2	3.7	5,957		小森コーポレーション	16.8	17.4	12,789	
S U M C O	84.6	124.7	231,069		日進工具	5.1	6	6,786		鶴見製作所	5	5.4	12,555	
川田テクノロジーーズ	1.3	1.5	5,595		パンチ工業	5.8	6.4	2,758		0.9	0.9	1.2	3,178	
RS TECHNOLOGIES	2.2	2.1	13,986		富士ダイス	2.8	3.9	2,351		日本ギア工業	2.4	3.4	1,298	
ジェイテックコーポレーション	—	1	1,582		豊和工業	3.8	4	3,280		酒井重工業	1.1	1.2	3,642	
信和	3.5	4.7	3,802		ニテックオーケーケー	2.9	2.9	3,384		荏原製作所	28	26.2	133,882	
東洋製罐グループHD	42.4	38.5	69,569		石川製作所	1.8	2.1	2,885		石井鉄工所	0.9	1	2,789	
ホッカンホールディングス	3.1	3.3	4,372		東洋機械金属	3.9	5	2,915		西島製作所	6.6	6.3	8,568	
コロナ	3.7	3.4	2,869		津田駒工業	1.3	1.2	583		北越工業	6.8	6.5	6,500	
横河ブリッジHLDGS	11.6	10.8	21,060		エンシユウ	1.4	1.9	1,463		ダイキン工業	85.5	83.5	2,011,932	
駒井ホールディングス	1.4	1.2	2,006		島精機製作所	9.4	11.1	23,731		オルゴノ	2.3	2.2	19,954	
高田機工	0.6	0.6	1,440		オプトラン	8.3	9.5	22,382		トローカネツ	2.6	2.6	6,526	
三和ホールディングス	62.7	71.2	96,262		NC ホールディングス	2.7	2.1	3,840		栗田工業	36.7	38.6	211,142	

日本株式インデックスファンド (F O F s 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
樫本チエイン	9.6	10	32,850		コニカミノルタ	137.2	155.2	76,358		ホーチキ	4.6	4.8	6,432	
大同工業	3.3	3	2,139		プラザー工業	81.6	87.2	227,330		星和電機	3.4	3.1	1,373	
木村化工機	6.3	5.9	4,236		ミネベアミツミ	115.7	121.6	295,609		エレコム	15.6	17.5	27,860	
アネスト岩田	10.9	11.8	10,561		日立	322.9	367.7	2,473,885		パソニックホールディング	715.6	815.4	908,763	
ダイフク	37	36.1	263,891		東芝	133	133.6	681,493		シャープ	89.6	72.6	68,607	
サムコ	1.7	2.1	6,877		三菱電機	670.3	713.3	989,703		アンリツ	40.9	48.4	78,988	
加藤製作所	3.4	3.5	2,618		富士電機	40.6	42.5	248,200		富士通ゼネラル	20.8	20.7	61,272	
油研工業	0.9	1.2	2,138		東洋電機製造	2.4	2.3	2,030		ソニーグループ	420.6	478.9	4,959,009	
タダノ	32.7	36.9	33,283		安川電機	72.2	75.9	341,170		T D K	32.5	110.7	564,570	
フジテック	23.3	23.5	68,338		シンフォニアテクノロジー	8.6	7.7	11,026		帝国通信工業	2.7	3.3	4,725	
C K D	15.7	19.3	36,052		明電舎	11.3	10.9	21,919		タムラ製作所	25.2	27.6	18,878	
キトー	5.6	5.8	15,660		オリジーン	1.6	1.9	2,631		アルプスアルパイン	54.7	62.6	77,185	
平和	18.3	21.3	46,306		山洋電気	3.3	2.8	14,392		池上通信機	2.4	2.3	1,350	
理想科学工業	5	6.4	15,379		デンヨー	5.6	5.3	7,976		日本電波工業	7.1	7.7	11,349	
SANKYO	16	15.8	65,096		PHCホールディングス	—	11.8	18,585		鈴木	3.1	3.8	3,359	
日本金銭機械	6.6	7.9	5,174		東芝テック	7.2	8.2	32,964		メイコー	—	8.3	24,260	
マースグループHLDGS	3.8	4.9	8,158		芝浦メカトロニクス	1.3	1.4	14,952		日本トリム	1.6	1.5	3,549	
フクシマガリレイ	4.7	4.7	17,437		マブチモーター	15.7	15.9	64,713		ローランドディー・ジー	4	3.6	11,520	
オーイズミ	2.3	2.8	1,103		日本産産	161.6	169.8	1,559,443		フオスター電機	6.6	7.2	5,637	
ダイコク電機	2.6	3.5	4,623		ユーエムシーエレクトロニクス	3.9	2.6	1,258		S M K	1.6	1.7	4,148	
竹内製作所	11.6	11.7	31,356		トレックス・セミコンダクター	3.8	3.3	9,177		ヨコオ	5.5	5.2	11,076	
アマノ	17.6	20.1	50,049		東光高岳	3.4	4.3	8,161		ティアック	5.2	12.6	1,423	
J U K I	9.2	10	6,980		ダブル・スコープ	19.3	21	41,559		ホシデン	18	17	27,574	
サンデン	9.2	11.1	2,886		ダイヘン	7.4	7	28,385		ヒロセ電機	10.4	10.6	213,802	
ジャノメ	6.5	6.6	4,554		ヤーマン	11.5	12.5	15,675		日本航空電子	15.8	15.4	36,790	
マックス	8.8	9	17,937		J V C ケンウッド	60.1	62.6	12,645		T O A	7.4	8.3	6,706	
グローリー	16.9	18.1	41,847		ミマキエンジニアリング	6.2	6.8	4,753		マクセル	13.1	14	20,874	
新晃工業	6.3	7.1	11,111		I P E X	3.2	3.7	4,917		古野電気	8.5	9.2	10,460	
大和冷機工業	10.9	9.8	10,819		日新電機	15.8	17.8	24,831		ユニデンホールディングス	1.8	—	—	
セガサミーホールディングス	60.8	68.7	135,545		大崎電気	13.2	12.5	6,762		スミダコーポレーション	6.2	5.8	6,177	
日本ピストンリング	2.7	2.9	3,677		オムロン	55.8	63.6	445,200		アイコム	2.8	2.4	6,295	
リケン	2.9	2.9	7,015		日東工業	9.8	9.7	25,239		リオン	2.9	2.7	5,516	
T P R	8.6	8.6	11,094		I D E C	9.2	9.5	28,737		本多通信工業	4.4	2.8	1,974	
ツバキ・ナカシマ	15	15.8	19,228		正興電機製作所	2.5	2.6	2,649		横河電機	66.6	70.2	163,987	
ホシザキ	19.6	41.2	160,886		不二電機工業	1	1.5	1,663		新電元工業	2.7	2.7	10,530	
大豊工業	6	6.2	4,377		ジーエス・ユアサコーポ	24.4	23	57,178		アズビル	45.6	44.3	175,649	
日本精工	138	130.8	101,631		サクサホールディングス	1.5	1.7	2,145		東亜ディーケーケー	2.8	3.9	3,287	
NTN	154.3	139.7	40,093		メルコホールディングス	2.4	2.1	6,720		日本光電工業	27.8	29.4	87,994	
ジェイテクト	64.7	65.2	67,025		テクノメディカ	1.4	1.7	2,743		チノール	1.8	2.4	3,950	
不二越	6	4.7	17,390		ダイヤモンドエレクトロニクスHD	2	2.1	2,595		共和電業	6.6	7	2,380	
日本トムソン	18.6	17.5	10,080		日本電気	85.9	90.7	441,709		日本電子材料	2.9	3.6	5,364	
T H K	39	37	98,272		富士通	60.5	68.8	1,103,208		掘場製作所	12.3	14.1	85,164	
ユーシン精機	4.3	5.7	4,098		沖電気	27.1	29.1	21,097		アドバンテス	50	56.8	420,888	
前澤給装工業	4.7	4.9	4,444		岩崎通信機	2.9	2.9	2,163		小野測器	2.5	2.7	1,096	
イーグル工業	8.1	8.4	10,088		電気興業	3.1	3.7	8,672		エスベック	5.8	5.7	10,163	
前澤工業	4.9	4.6	2,824		サンケン電気	7.5	6.6	32,076		キーエンス	65.9	69.3	3,547,467	
日本ビラー工業	7.3	6.5	16,354		ナカオ	1.1	1.2	1,273		日置電機	3.3	3.3	21,846	
キッツ	22.6	23.4	19,445		アイホン	4.3	3.4	6,871		シスメックス	52.4	54.7	449,141	
マキタ	87.6	86.4	261,792		ルネサスエレクトロニクス	362.2	417.2	557,379		日本マイクロニクス	11.5	10.5	14,290	
三井E&SHD	21.7	21.7	8,897		セイコーエプソン	83.4	85.4	183,097		メガチップス	6.7	6.8	17,829	
日立造船	51.6	60.7	52,930		ワコム	49.2	58.6	44,653		OBARA GROUP	3.7	3	9,885	
三菱重工業	105.7	112.2	582,430		アルバック	12.5	15.2	86,336		澤藤電機	0.8	1	1,142	
I H I	45.3	47.8	166,105		アクセル	2.8	3	2,832		原田工業	2.7	3.6	2,808	
サノヤスホールディングス	9.8	9.7	1,193		E I Z O	5.8	5.2	19,942		コーセル	8.2	8.5	7,225	
スター精密	10.4	12.4	21,811		ジャパンディスプレイ	61.7	61.7	2,961		イリソ電子工業	5.7	6.4	26,784	
電気機器 (17.0%)					日本信号	15.5	16.3	15,468		オプテックスグループ	11.1	11.7	24,593	
日清紡ホールディングス	40.4	52.2	56,323		京三製作所	13.4	15.1	6,432		千代田インテグレ	2.7	2.6	5,751	
イビデン	32.6	36.8	165,784		能美防災	8.8	8.7	13,902		アイ・オー・データ	2.4	—	—	

日本株式インデックスファンド（FOF s用）（適格機関投資家専用）

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
レーザータック	29.6	31.3	547,280		日野自動車	84.6	95.4	62,868		オリンパス	352.1	366.2	1,089,261	
スタンレー電気	46.9	49.3	126,355		三菱自動車工業	250.8	283.5	173,502		理研計器	5.9	5.1	21,853	
岩崎電気	2.4	2.5	6,297		エフテック	5.3	4.7	2,486		タムロン	5.6	4.8	14,904	
ウシオ電機	35	36.3	58,697		レシップホールディングス	2.9	2.9	1,493		H O Y A	131	147.6	2,137,986	
岡谷電機	4.6	5.3	1,303		GMB	1.6	1.4	984		シード	2.4	3.6	1,990	
ヘリオステクノH	6.2	7.2	2,728		ファルテック	1.4	1.6	950		ノーリツ鋼機	6.2	6	14,946	
エノモト	2.1	2.1	3,126		武蔵精密工業	15.4	17	29,070		A&D ホロンホールディングス	5.8	8.7	7,838	
日本セラミック	6.7	6.4	16,844		日産車体	9.3	11.4	9,120		朝日インテック	72.2	83.9	202,366	
遠藤照明	3.3	3.5	2,698		新明和工業	19.5	20	20,780		シチズン時計	85.2	74.9	46,438	
古河電池	4.9	5.4	6,312		極東開発工業	11.6	12.4	17,136		リズム	1.9	2.5	3,652	
双信電機	3.3	3.8	1,584		トピー工業	5.4	5.9	8,260		大研医器	4.8	6.1	2,891	
山一電機	4.5	5	10,955		ティラド	2.2	2.1	5,709		メニコン	10.5	23.6	71,036	
図研	4.6	5	18,050		タチエス	10.5	12.6	15,561		シンシア	1.4	0.7	315	
日本電子	12.4	14.7	79,527		NOK	32.4	28.9	36,442		松風	3.2	2.6	5,816	
カシオ	54	47.3	63,571		フタバ産業	16.1	17.1	5,899		セイコーHD	9.7	10.9	32,918	
ファナック	58.9	67.1	1,463,115		K Y B	7.7	6.7	22,880		ニプロ	49.8	53	58,459	
日本シイエムケイ	13.9	13.6	6,460		大同メタル工業	13	14.7	7,599		その他製品 (2.5%)				
エンプラス	3.1	1.9	8,474		プレス工業	32.6	34.7	14,955		中本バックス	1.6	2.2	3,451	
大真空	2.5	9.5	9,091		ミクニ	7.9	9.3	3,041		スノーピーク	4.5	10.9	24,132	
ローム	27.9	31.8	338,352		太平洋工業	14.1	14.7	16,067		パラマウントベッドHD	12.5	14.7	38,058	
浜松ホトニクス	48.3	50.9	322,706		河西工業	9.4	9.2	1,950		トランザクション	4.5	4.8	5,097	
三井ハイテック	6.7	6.6	52,602		アイシン	49.2	56	228,480		粧美堂	2.3	1.5	639	
新光電気工業	22.9	22.5	82,237		マツダ	211.9	225.1	271,470		ニホンフラッシュ	5.7	6	5,790	
京セラ	102	107.5	869,997		今仙電機製作所	5.6	5.2	2,953		前田工織	7.6	6.8	22,406	
太陽誘電	30	34	140,930		本田技研	528.2	558.9	1,981,300		永大産業	8.6	7.5	1,830	
村田製作所	197.2	208.5	1,541,440		スズキ	133.1	151.5	755,833		アートネイチャー	6.3	6.4	4,742	
双葉電子工業	10.8	12.7	8,166		SUBARU	192	201	512,349		バンドアイナムCO HLDGS	55.5	63.2	627,449	
北陸電気工業	2.2	2.8	3,052		安永	3.2	3.1	2,250		アイフィニージャパン	1.8	2.2	1,313	
ニチコン	21.8	20.3	29,861		ヤマハ発動機	87.8	99.7	292,121		共立印刷	8.2	10.1	1,343	
日本ケミコン	7	7.2	14,176		T B K	7.4	7.3	2,219		S H O E I	6.5	6.7	35,912	
K O A	9.6	10.6	25,577		エクセディ	9.1	11.6	21,054		フランスベッド HLDGS	9.8	10	9,130	
市光工業	9.8	9.6	3,868		豊田合成	22	21.7	52,080		パイロットコーポレーション	11.1	10	53,900	
小糸製作所	40.1	38.2	178,203		愛三工業	10.6	12.2	8,991		萩原工業	3.8	4.1	4,305	
ミツバ	12.7	11.7	4,925		盟和産業	1.1	1.1	1,084		トッパン・フォームズ	11.9	—	—	
SCREENホールディングス	11.7	12.1	109,021		日本プラス	5.1	5.4	2,484		フジールインターナショナル	13.7	15.8	24,110	
キャノン電子	6.2	7	11,319		ヨロズ	5.5	5.9	5,174		タカラトミー	30.3	31.6	41,585	
キャノン	333.6	348.3	1,157,052		エフ・シー・シー	10.5	12.8	18,764		広済堂ホールディングス	5.2	4.8	6,019	
リコー	171.6	181.9	207,184		シマノ	27.1	26	638,300		エステルホールディングス	4	1.4	877	
象印マホービン	17.9	18.9	30,580		テイ・エス・テック	30.8	32.5	50,472		タカノ	2.1	2.8	2,100	
MUTOHホールディングス	0.9	1	1,930		ジャムコ	4.3	4.6	6,371		プロネクサス	5.3	5.8	5,631	
東京エレクトロン	39.3	48.5	1,990,440		精密機器 (2.8%)				ホクシン	6.9	5.6	817		
輸送用機器 (7.9%)					テルモ	205.8	216.3	933,983		ウッドワン	2.5	2.3	2,684	
トヨタ紡織	19.8	26.8	52,662		クリエートメディック	1.8	2.5	2,262		大建工業	4.5	3.8	7,296	
芦森工業	1.2	1.6	1,635		日機装	21.5	15.8	15,942		凸版印刷	101.3	99.6	224,996	
ユニプレス	10.6	12.7	12,496		日本エム・ディ・エム	4	4.4	5,654		大日本印刷	79	82.8	250,470	
豊田自動織機	54.3	54.1	398,176		島津製作所	86.5	91.3	352,874		共同印刷	2	1.9	4,805	
モリタホールディングス	10.2	12.3	16,063		J M S	5.9	5.9	3,268		N I S S H A	13.8	12.1	22,518	
三桜工業	9.5	10.7	7,811		クボテック	1.8	2	4,672		光村印刷	0.6	0.4	491	
デンソー	147.8	149.6	1,110,780		長野計器	5.1	5.1	5,457		TAKARA & COMPANY	3.3	4.4	9,279	
東海理化電機	17.5	20.3	30,896		フイ・テクノロジー	3.1	3.3	9,352		アシックス	59.7	58.6	153,942	
川崎重工業	52.7	51.9	128,037		東京計器	4.1	4.9	6,041		ツツミ	2.1	1.9	3,784	
名村造船所	21.9	20	13,000		愛知時計	0.7	2.8	4,020		ローランド	—	4.6	19,205	
日本車輛	2.2	2.4	5,044		インターアクション	3.5	3.8	6,410		ヤマウオール工業	2.2	2.3	4,370	
三菱ロジスネクスト	9.1	10.1	7,928		オーバル	6.6	7.4	3,315		小松ハ	39.9	44.4	229,992	
近畿車輛	1	1.2	1,184		東京精密	11.4	11.9	55,632		河合楽器	2	1.9	5,168	
日産自動車	790.6	901.8	484,897		マニー	26.7	28	51,100		クリナップ	6	7.3	4,409	
いすゞ自動車	178.9	221.4	396,084		ニコン	102.7	107.9	160,123		ピジョン	40.8	40.5	85,779	
トヨタ自動車	680.1	3,485.1	7,139,227		トプコン	34	36	65,016		兼松サステック	0.6	0.4	644	

日本株式インデックスファンド (F O F s 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
キングジム	5.6	5.6	5.6	5.129	名古屋鉄道	52.3	70	159,530	内外トランスライン	2.7	2.3	5.152		
リンテック	14	14.6	33,915		山陽電鉄	4.4	5.2	11,481	日本コンセプト	2.2	2	3,450		
イトーキ	12.9	12.7	5,524		アルプス物流	—	5.1	5,727	情報・通信業 (9.1%)					
任天堂	38.5	43.2	2,671,056		日本通運	22	—	—	NEC ネットエスアイ	22.3	24.8	39,928		
三菱鉛筆	10.6	9.3	13,122		ヤマトホールディングス	89.1	99.1	214,551	クロスキャット	1.8	4.1	5,391		
タカラスタンダード	13.2	12.3	16,260		山九	16.2	17.6	74,712	システナ	24	107	44,940		
コクヨ	32.5	30.6	55,967		丸連	4.3	3	660	デジタルアーツ	3.9	4	26,520		
ナカバヤシ	5.8	5.5	2,805		丸全昭和運輸	5.2	4.9	15,239	日鉄ソリューションズ	9.7	13	46,280		
グローブライド	3.4	5.7	14,512		センコグループHLDGS	36.2	33.4	33,233	キューブシステム	3.8	3.9	3,974		
オカムラ	23.6	21.5	29,412		トナミホールディングス	1.5	1.4	5,236	WOW WORLD	1.7	1	866		
美津濃	6.8	6.3	17,318		ニッコンホールディングス	21.3	21.8	52,886	コア	2.6	3.1	4,324		
電気・ガス業 (1.3%)					日石輸送	0.6	0.8	1,902	手間いらす	1	1.1	5,786		
東京電力HD	573.4	572.5	277,090		福山通運	8.1	9.3	31,294	ラークンホールディングス	5	6.4	7,532		
中部電力	204.9	215.8	304,925		セイノーホールディングス	47.6	39.5	45,938	ソリトクシステムズ	3.6	3.3	3,636		
関西電力	253.5	267.2	348,963		エスライン	1.3	2	1,602	ソフトクリエイトHD	2.7	3.3	11,253		
中国電力	97.7	110.2	85,184		神奈川中央交通	1.5	1.8	6,327	T I S	66.3	65.6	268,632		
北陸電力	62.4	64.6	32,106		日立物流	13.4	13.3	116,774	JNS ホールディングス	4.3	3.6	1,404		
東北電力	156.4	167.1	115,800		丸和運輸機関	13.8	12.2	18,702	グリー	42.6	34.3	29,498		
四国電力	55.1	63.7	50,131		C&F ロジホールディングス	6.3	6.1	7,277	GMOペパボ	—	0.9	1,622		
九州電力	148.5	146.6	117,719		九州旅客鉄道	49.5	48.7	153,161	コーエーテックモHD	17.9	23.9	110,896		
北海道電力	64.3	66.1	33,843		SG ホールディングス	120.5	121.5	251,505	三菱総合研究所	2.8	3.1	13,531		
沖縄電力	13	16.1	17,677		NIPPON EXPRESS	—	23.6	170,864	ホルテージ	3.1	2.1	644		
電源開発	53.3	56.5	120,006		海運業 (0.6%)				電算	0.8	0.7	1,302		
エフオン	4.5	4.6	2,957		日本郵船	53.4	60.6	581,760	AGS	3.1	3	2,019		
イーレックス	10.2	9.9	28,353		商船三井	37.9	111.7	366,376	ファインデックス	6.1	5.1	2,978		
レノバ	11.7	15	53,775		川崎汽船	19.8	22.3	164,574	ブレインパッド	1.9	6.4	6,124		
東京瓦斯	128.7	136.1	352,771		NS ユナイテッド海運	3.2	3.4	14,739	K L a b	12	12	5,244		
大阪瓦斯	120.9	128.6	296,551		明治海運	7	6.9	5,078	ポルトクウインホールティン	8.9	10.9	10,267		
東邦瓦斯	33.1	30	90,900		飯野海運	29.3	28.6	20,963	イーブクイニシアティブ	1.3	—	—		
北海道瓦斯	3.5	3.7	6,153		共栄タンカー	1.2	1.3	1,142	ネクソン	148.6	171.3	440,926		
広島ガス	11.7	12.7	4,216		乾汽船	4.5	4.4	7,792	アイスタイル	21.6	19.4	10,088		
西部ガス HLDGS	7.4	7.4	13,253		空運業 (0.5%)				エムアップホールディングス	2	8.7	14,233		
静岡ガス	19.3	14.5	15,210		日本航空	155.4	155.7	420,078	エイチーム	5.1	4.7	3,783		
メタウォーター	7.9	7.8	15,670		ANA ホールディングス	172	172.3	480,458	エニゴモ	6.5	8.1	4,195		
陸運業 (3.2%)					パスコ	1.3	1.4	1,827	テクノスジャパン	5.3	5.8	2,592		
SBS ホールディングス	5.4	5.6	16,626		倉庫・運輸関連業 (0.2%)				e n i s h	3.9	5.6	2,380		
東武鉄道	69.5	69.8	238,367		トランコム	2	2	16,620	コロブラ	21.3	24.8	17,112		
相鉄ホールディングス	22.6	22.9	55,509		日新	4.9	5.3	9,905	オルトプラス	5.1	5.6	1,680		
東急	168.3	178	304,380		三菱倉庫	22	17.5	62,562	ボードリーフ	33.8	37.2	19,232		
京浜急行	86	85.3	127,864		三井倉庫 HOLD	6.9	7.1	23,749	クロス・マーケティングG	3.3	2.9	2,508		
小田急電鉄	107.3	96.2	183,838		住友倉庫	22.5	21.3	45,603	デジタルハーツHLDGS	3.4	3.4	6,572		
京王電鉄	37.4	33.6	183,456		渋沢倉庫	3.4	3.5	7,248	システム情報	5.4	5.6	5,398		
京成電鉄	50.5	46.5	189,720		東陽倉庫	9.6	10.1	2,747	メディアドゥ	2.8	2.5	4,785		
富士急行	9.2	7.8	35,412		日本トランスシティ	13.5	12.8	6,464	じげん	17	21.4	7,340		
新京成電鉄	1.9	—	—		ケイヒン	1.1	1.2	1,726	ブイキューブ	7	7.6	7,850		
東日本旅客鉄道	118.2	116.6	888,958		中央倉庫	3.5	3.6	3,391	エンカレッジ・テクノロジー	1.1	1.7	868		
西日本旅客鉄道	75	81.1	463,486		川西倉庫	1.1	1.3	1,345	サイバーリンクス	2.6	2.3	2,628		
東海旅客鉄道	55.8	53.8	919,980		安田倉庫	5	4.9	4,508	ディー・エル・イー	4.3	4.3	1,419		
西武ホールディングス	81.3	92.4	143,404		ファイズホールディングス	1.4	1.6	1,606	フィックスターズ	7.1	7.3	7,891		
鴻池運輸	10.4	10.7	15,429		東洋埠頭	1.8	1.8	2,192	CARTA HOLDINGS	3	3.1	5,359		
西日本鉄道	18.4	18.3	53,838		宇徳	5.4	—	—	オプティム	5	5.2	4,466		
ハマキョウレックス	5	5	16,225		上組	34.9	34.4	95,563	セレス	2.6	2.5	2,527		
サカイ引越センター	3.2	3.5	17,202		サンリツ	1.9	1.6	1,075	S H I F T	3.4	4.7	93,624		
近鉄グループHLDGS	63.4	68	331,840		キムラユニティ	1.4	3.8	3,055	ティアーガイア	6.7	6.6	11,101		
阪急阪神HLDGS	84	84.4	367,984		キューソー流通システム	1.5	4.2	5,825	セック	1	1.1	2,379		
南海電鉄	29.8	30.3	87,839		近鉄エクスプレス	12	—	—	テックマトリックス	11.1	12.7	20,281		
京阪ホールディングス	28.3	28.3	105,276		東海運	4	4.1	1,098	プロシップ	2.2	2.5	3,615		
神戸電鉄	1.5	1.7	5,788		エーアイティ	4.1	4.5	6,907	ガンホー・オンライン・エンター	17.8	19.5	43,797		

日本株式インデックスファンド（FOF s用）（適格機関投資家専用）

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
				千円					千円					千円
GMOペイメントゲートウェイ	12.9	14.5	152.540		プロトコーポレーション	8.1	8.1	8,764		C I J	4	5.6	4,267	
ザッパラス	4.1	2.4	756		ハイマックス	2.2	2	2,660		ビジネスエンジニアリング	0.8	1.7	3,607	
システムリサーチ	2.1	2.1	3,948		野村総合研究所	114.8	130.4	466,832		日本エンタープライズ	8.4	7.3	1,124	
インターネットイニシアティブ	18	20	95,500		サイバネットシステム	5.3	5.3	5,135		WOWOW	3.3	2.8	3,808	
さくらインターネット	7.8	7.8	4,282		C Eホールディングス	3.8	3.7	1,831		スカラ	6.5	6.2	4,414	
ウィングス	1.9	2.2	3,330		日本システム技術	1.2	1.4	3,490		インテリジェントウェイブ	3.7	4	2,880	
GMOグローバルサインHD	1.6	2	9,630		インテージホールディングス	8.8	8.6	13,940		IMAGICA GROUP	5.4	5.4	5,054	
SRAホールディングス	3.6	3.6	11,088		東邦システムサイエンス	1.4	1.9	1,939		ネットワンシステムズ	27.1	27.7	81,271	
システムインテグレート	1.8	2.4	1,036		ソースネクスト	33.4	32.7	8,829		システムソフト	18.4	22.6	2,327	
朝日ネット	6	6.6	4,065		インフォコム	6.6	8.1	15,681		アルゴグラフィックス	5.3	5.8	22,852	
e B A S E	8.6	8.9	4,859		シンプレクスHD	—	11.9	23,681		マーベラス	10.4	11.8	7,976	
アパント	7.7	8	10,744		H E R O Z	2	2.2	2,457		エイベックス	11.7	13	20,644	
アドソル日進	2.7	2.6	3,837		ラクスル	7.4	8.9	24,457		B I P R O G Y	23.1	23.4	74,529	
ODKソリューションズ	—	1.5	946		メルカリ	—	28.5	61,332		兼松エレクトロニクス	3.6	4.1	16,646	
フリービット	4.7	3.8	3,351		I P S	—	2.1	6,279		都築電気	—	3.4	4,471	
コムチュア	6.2	8.4	19,378		F I G	6.8	8.3	3,311		TBSホールディングス	43.6	36.6	60,024	
サイバーコム	1.1	1.2	1,647		システムサポート	1.9	2.6	3,723		日本テレビHD	55.1	62.8	74,983	
アステリア	5.2	5.5	4,559		イーソル	4	4.1	2,451		朝日放送グループHD	5.3	6.1	3,928	
アイル	3.9	3.6	6,696		アルテリア・ネットワークス	7.8	7	8,939		テレビ朝日HD	20.6	18	25,956	
マークライnz	3.6	3.4	8,262		東海ソフト	1.3	1.2	1,102		スカパー JSATHD	42.6	63.5	34,544	
メディカル・データ・ビジ	8.9	9.5	9,462		ウイングアーク1ST	—	5.7	10,687		テレビ東京HD	4.5	4.6	8,951	
g u m i	9.5	10.5	9,429		ヒト・コミュニケーションズHD	1.9	1.7	2,878		日本BS放送	2	2.4	2,246	
ショーケース	1.9	1.6	620		サーバーワークス	—	1.3	3,139		ビジョン	11.9	8.4	11,928	
モバイルファクトリー	2.1	1.6	1,454		東名	—	0.6	651		スマートフォンバリュー	2.1	1.7	790	
テラスカイ	2.5	2.7	5,332		ウィッツ	—	0.7	732		USEN-NEXT HLDGS	6.8	5.7	11,844	
デジタル・インフォメーション	3.4	3.3	5,016		トビラシステムズ	1.6	1.9	1,852		ワイヤレスゲート	3.1	3.2	905	
PCIホールディングス	3.6	2.8	2,646		S a n s a n	6	23.7	32,540		コネクシオ	4.2	5.3	6,593	
パイブドHD	1.6	—	—		L i n k - U	—	1.3	916		日本通信	60.9	62.6	13,772	
アイビシー	1.4	1.2	541		ギフティ	—	6.8	15,708		クロップス	1.2	1.6	1,440	
ネオジャパン	1.7	2.1	2,093		ペース	—	1.1	7,667		日本電信電話	770.5	840.9	3,292,123	
P R T I M E S	1.8	1.6	3,904		J M D C	—	9.4	50,760		K D D I	528.4	546.9	2,391,046	
ラクス	20.4	34.4	51,909		フォーカスシステムズ	5.6	4.5	4,396		ソフトバンク	599.1	1,135.7	1,706,957	
ランドコンピュータ	1	1.7	1,431		グレスコ	4.7	5.5	9,702		光通信	7.8	8.6	153,682	
ダブルスタンダード	1	2.3	5,352		フジ・メディア・HD	68.5	66.2	73,614		エムティーアイ	7.6	5.9	2,973	
オープンドア	4.3	4.5	10,080		オービック	20.8	23.6	468,932		GMOインターネットグループ	23.7	23.6	62,280	
マイネット	2.6	2.3	1,117		ジャストシステム	9.5	10.7	35,577		ファイバーゲート	2.9	3.4	3,155	
アカツキ	2.9	3.4	7,622		T D Cソフト	5.9	5.9	7,133		アйдマーケティングコミュニ	1.7	1.7	496	
ベネフィットジャパン	0.7	0.6	941		Zホールディングス	869.7	1,081.4	439,048		K A D O K A W A	17.3	40.4	112,675	
UBICOMホールディングス	2	2	4,626		トレンドマイクロ	35.3	36.8	299,552		学研ホールディングス	9.6	10.6	10,154	
カナミックネットワーク	7.5	9.3	4,836		IDホールディングス	3.6	4.5	3,951		ゼンリン	11.7	12.5	11,500	
ムラシステムコーポレーション	3.9	7	896		日本オラクル	13.5	12.2	97,966		昭文社ホールディングス	3.4	3.3	1,029	
チェンジ	12.6	15.6	29,000		アルファシステムズ	1.9	2	8,680		インプレスホールディングス	8.9	6.2	1,289	
シンクロ・フード	5.2	4.1	1,914		フューチャー	7.9	15.9	25,710		アイネット	3	3.5	4,655	
オークネット	3.9	3.3	7,240		CAC HOLDINGS	4.1	4.1	5,899		松竹	4.3	4.3	51,901	
キャピタル・アセット・プラン	—	1.4	998		S Bテクノロジ	2.8	3.2	7,708		東宝	38.9	44.3	232,132	
セグエグループ	2	1.6	1,073		トーセ	1.7	2	1,528		東映	2.2	2.1	37,737	
エイトレッド	1.6	1	1,802		オービックビジネスC	6.5	7.2	33,588		NTTデータ	175.8	199.7	389,015	
マクロミル	13.5	14.4	15,696		伊藤忠テクノソリューション	30.5	34.1	116,451		ピー・シー・イー	1.1	4.4	4,760	
ビーグリー	1.7	1.2	1,638		アイティフォー	8.8	9.2	7,065		ビジネスB太田昭和	2.6	2.5	3,677	
ユー	2.3	1.9	3,041		東計電算	0.9	0.9	5,490		D T S	14	13.9	48,997	
オーザローカル	2.7	2.2	3,500		エックスネット	1.6	1.1	1,103		スクウェア・エニックスHD	28.1	34.9	217,427	
テモナ	2	1.3	414		大塚商会	35.9	36.1	161,186		シーイーシー	7.2	8.1	11,680	
ニーズウェル	1.8	2.3	1,501		サイボウズ	9.2	8.7	12,223		カブコン	56.8	70.7	261,943	
マネーフォワード	—	15.3	51,561		電通国際情報S	9.8	7.7	34,380		アイ・エス・ビー	4.1	3.2	4,012	
サインポスト	1.8	2.5	2,105		A C C E S S	8.4	8.6	6,355		ジャステック	4.1	3.8	4,639	
電算システムHD	2.9	3.1	6,999		デジタルガレージ	10.9	12.4	45,880		S C S K	15.3	51.8	116,394	
ソルクシーズ	3	6	2,184		イーエムシステムズ	11.7	10.7	9,030		N S W	2.1	2.9	6,394	
フェイス	2.5	1.9	1,054		ウェザーニューズ	2.1	2.3	18,170		アイネス	6.8	6.4	9,708	

日本株式会社インデックスファンド (F O F s 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
T K C	11.5	11.4	39,843	千円	小野建	5.5	6.9	10,239	千円	第一実業	3.2	2.9	11,150	千円
富士ソフト	7.2	7.2	58,176		南陽	1.2	1.4	2,639		キャノンマーケティングJPN	16.3	15.5	49,522	
N S D	21.6	23.3	57,690		佐島電機	4	4.8	5,942		西華産業	3.3	3.1	5,099	
コナミグループ	24	27.3	184,002		エコートレーディング	1.9	1	537		佐藤商事	5.1	5	5,810	
福井コンピュータHLDS	3.3	3.4	12,036		伯東	4.4	4.4	15,290		菱洋エレクトロ	5.1	4.4	9,869	
JBCCホールディングス	4.2	5	9,200		コンドーテック	4.8	5.5	5,604		東京証券	6.6	6.3	4,995	
ミロク情報サービス	6.6	6.7	10,110		中山福	4.3	3.3	1,029		アサ商事	6.6	6	21,690	
ソフトバンクグループ	522.9	449.8	2,481,546		ナガイレーベン	8.4	9.1	17,826		神鋼商事	1.5	1.7	7,021	
卸売業 (5.7%)					三菱食品	7	7.3	24,345		トルク	3.9	1.9	419	
ハウスイ	0.5	—	—		松田産業	5.2	5.5	12,391		阪和興業	13.3	13	47,645	
高千穂交易	2.5	2.7	5,880		第一興商	12.9	14.3	59,345		正栄食品	4.2	4.5	19,350	
オルパヘルスケアHLDGS	1.1	1.2	1,705		メディパルHD	66.2	69.7	130,339		カナデン	5.3	6.1	6,581	
伊藤忠食品	1.6	1.5	7,455		S P K	2.9	2.9	4,022		菱電商事	4.7	5.8	9,436	
エレマテック	5.8	5.9	8,035		萩原電気HLDGS	2.4	2.4	5,337		フルサト工業	3.4	—	—	
J A L U X	1.7	—	—		アズワン	4.8	10.8	64,692		岩谷産業	16.1	16.7	91,850	
あらた	5.1	5.5	23,210		スズデン	2.2	2.3	4,620		ナイス	2.5	2.5	3,910	
トーメンデバイス	0.9	1.1	6,292		尾家産業	2	1.7	1,456		ニチモウ	1	0.9	2,407	
東京エレクトロンデバイス	2.2	2.2	12,232		シモジマ	4.2	4.4	4,884		極東貿易	2.1	4.4	5,838	
フィールズ	5.9	6.6	10,282		ドウシヤ	6.2	7.2	10,720		アステナホールディングス	10.8	11.6	5,080	
双日	367.4	77.2	181,342		小津産業	1.7	1.7	2,998		三愛オブリ	16.2	16.8	18,933	
アルフレッサホールディングス	68.6	78.1	134,253		高速	3.5	3.8	5,836		稲畑産業	16	15.1	38,384	
横浜冷凍	17.4	18.7	17,129		たけびし	2.2	2.6	3,900		G S I クレオス	3.6	3.6	5,367	
神栄	1.2	1.1	918		リックス	1.3	1.6	3,420		明和産業	5.9	7	5,565	
ラサ商事	3.3	3	2,952		丸文	5.6	5.9	4,926		クワザホールディングス	2.5	2.6	1,099	
アルコニック	7.2	9.7	13,318		ハビネット	6	5.5	8,910		ヤマエ久野	4.6	—	—	
神戸物産	51.6	51.9	185,283		橋本総業HLDGS	1.6	1.3	2,624		ワキタ	13	13.7	15,467	
ハイパー	1.6	1.5	661		日本ライフライン	21.3	22.4	22,288		東邦ホールディングス	20.8	20.4	39,086	
あいホールディングス	9.3	10.7	23,368		タカショー	5.1	5.9	3,982		サンゲツ	17.5	18.1	29,665	
ディービーエックス	2.1	2.4	2,112		マルカ	2.3	—	—		ミツウロコグループ	9.9	8.4	8,635	
ダイワボウHD	30.3	32	62,528		I DOM	22.7	22.9	20,884		シナモンホールディングス	2.5	2.5	9,362	
マクニカホールディングス	16	17.8	50,285		進和	3.8	4.5	9,868		伊藤忠エネクス	14.9	16.5	17,671	
ラクト・ジャパン	3	2.6	5,688		エスケイジャパン	2.6	1.9	1,026		サンリオ	19.1	21.2	78,864	
グリムス	—	3.3	5,583		ダイトロン	2.8	2.6	5,478		サンワテクノス	4.4	3.8	5,149	
バイタルK S K HD	11.3	11.8	7,788		シークス	9.4	9.6	10,992		リョーサン	6.8	7.7	18,010	
八洲電機	4.6	5.5	5,527		田中商事	1.7	1.9	1,077		新光商事	9.1	9.8	9,349	
メディアスホールディングス	3.9	4.1	2,870		オーハシテクニカ	3.4	3.6	5,115		トーホー	3	2.9	4,405	
レスターホールディングス	6.5	7.1	14,249		白銅	2.3	2.4	6,182		三信電気	4.1	2.8	4,930	
ジュアテックHD	1.4	1.6	1,745		ダイコー通産	0.9	0.9	988		東陽テクニカ	6.9	7.3	9,497	
大光	3	3.3	2,313		伊藤忠	462.5	451.3	1,716,745		モスフードサービス	9	9.9	31,234	
OCHIホールディングス	1.9	1.5	1,864		丸紅	652.2	652.2	922,536		加賀電子	6.2	6.1	25,132	
TOKAIホールディングス	31.5	36.3	32,161		高島	1	1	2,615		ソーダニツカ	6.3	5.8	3,567	
黒谷	2.4	2.1	1,184		長瀬産業	35.8	34.2	70,281		立花エレクトック	4.6	4.8	7,814	
C o m i n i x	1.3	0.8	577		蝶理	4.3	4.2	8,530		フオーバル	2.2	2.7	2,713	
三洋貿易	6.9	7	7,525		豊田通商	66.2	67.1	331,138		P A L T A C	10.7	10.6	45,686	
ビューティガレージ	1.2	1.2	3,423		三共生興	9.2	10.1	4,787		三谷産業	9.4	11.5	3,542	
ウイン・パートナーズ	4.6	5.3	5,040		兼松	26.1	26	38,974		太平洋興発	2.6	2.6	1,770	
ミタチ産業	1.1	2.1	1,738		ツカモトコーポレーション	1.4	1.1	1,158		西本WISMETTAC HD	1.5	1.7	6,825	
シップヘルスケアHD	23.5	21.6	56,829		三井物産	527.9	545.6	1,809,755		ヤマシヘルスケアHLDGS	0.9	0.7	1,050	
明治電機工業	2.1	2.2	2,323		日本紙パルプ	3.3	3.6	16,164		コーア商事HLDGS	—	4.8	3,115	
デリカフーズHLDGS	3.5	2.8	1,450		カメイ	8.1	8	8,912		国際紙パルプ商事	13.6	14.1	9,729	
スターティアホールディングス	1.6	1.7	1,694		東都水産	0.4	0.4	1,980		ヤマタネ	2.9	3.1	4,966	
コマダホールディングス	14.6	16.3	38,891		OUGホールディングス	1	1	2,876		丸紅建材リース	0.5	0.6	1,081	
ピーバンドットコム	1.2	1.1	561		スターゼン	5	5	10,540		日鉄物産	4.6	4.5	24,255	
アセンテック	2	2.5	1,467		山善	25	27.2	25,105		泉州電業	2	1.7	9,690	
富士興産	2.1	1.9	2,287		椿本興業	1.2	1.2	4,440		トラスコ中山	13.8	14.1	27,903	
協栄産業	0.7	0.9	1,322		住友商事	416.2	445.5	878,971		オートバックスセブン	23.4	23.4	33,766	
フルサト・マルカHD	—	6.7	22,076		内田洋行	2.9	3	13,035		モリト	4.5	5	3,600	
ヤマエグループHD	—	4.3	6,888		三菱商事	402.7	493.7	2,156,975		加藤産業	9.3	8.1	27,864	

日本株式インデックスファンド（FOF s 用）（適格機関投資家専用）

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
北恵	1.8	1.5	1,095		トレジャー・ファクトリー	2.1	2.2	4,197		コナカ	7.8	7.9	2,749	
イノテック	3.7	4.4	5,953		物語コーポレーション	3.7	3.7	26,159		ハウス ローゼ	0.6	0.8	1,295	
イエローハット	12	12	22,032		ココカラファイン	5.9	—	—		G-7ホールディングス	3.9	8.3	12,217	
JK ホールディングス	5.8	5.2	5,246		三越伊勢丹HD	116.5	113.2	139,122		イオン北海道	8.9	9.8	11,446	
日伝	5.3	5	8,885		Hamee	1.9	2.7	2,589		コジマ	12.3	12.9	8,230	
北沢産業	4.3	3.6	774		マーケットエンタープライズ	—	0.8	734		ヒマラヤ	2.2	2.4	2,332	
杉本商事	3.2	3.5	6,520		ウエルシアHD	35.2	39.8	120,992		コーナン商事	9.6	10.7	35,791	
因幡電機産業	17.5	18.5	50,597		クリエイトSDH	9.7	11	34,375		エコス	2.5	2.5	4,527	
東テック	2.3	2.2	7,634		丸善CHIHD	5.1	8.2	2,796		ワタミ	8.9	9	8,280	
ミスミグループ本社	82.9	94.5	318,465		ミサワ	1.9	1.4	824		マルシェ	1.5	2.1	955	
アルテック	6.3	4.2	1,373		ティーライフ	1.4	1	1,235		パンパシフィックHD	132.5	150.5	404,845	
タキヒヨー	2.1	1.8	1,474		エー・ピーホールディングス	1.7	1.3	590		西松屋チェーン	14.9	14.9	22,633	
蔵王産業	1	1.3	2,338		チムニー	2.1	2.4	2,964		ゼンショーホールディングス	35.4	36.8	133,768	
スズケン	28	26.9	90,249		シュッピン	4.8	6.2	7,874		幸楽苑ホールディングス	4.1	4.4	4,664	
ジェコス	4.5	5.1	4,105		オイシックス・ラ・大地	9	10.8	18,900		ハーコスレイ	1	3.1	1,546	
グローセル	6.4	8.1	3,377		ネクステージ	13.7	15.3	50,184		サイゼリヤ	10.2	11.2	30,038	
小売業 (4.5%)					ジョイフル本田	18.6	21.5	37,861		V Tホールディングス	25.2	28.8	14,486	
ローソン	16.6	16.7	78,824		鳥貴族ホールディングス	2.6	2.5	6,115		魚力	1.9	2	4,380	
サンエー	4.8	5.1	21,981		ホットランド	4.6	5	6,690		ポプラ	3.1	1.8	261	
カワチ薬品	4.6	5.8	12,209		すかいらーく HD	92.6	91.9	141,434		フジ・コーポレーション	3.4	4.1	5,133	
エービーシー・マート	10.3	11.8	75,520		SFPホールディングス	2.9	3.8	6,532		ユニテッドアローズ	7.7	8	15,664	
ハードオフコーポレーション	2.5	3.2	4,182		綿半ホールディングス	4.9	5.2	7,280		ハイドレイ日高	9.5	11	23,243	
アスクル	11.2	16.2	26,892		ヨシックスホールディングス	1.3	1.5	3,403		YU-WA CREATION H	4.3	3.9	807	
ゲオホールディングス	8.9	9.1	15,542		ユナイテッド・スーパーマケ	19	22	23,320		コロワイド	22	31	59,427	
アダストリア	9.4	8.2	18,007		ゴルフダイジェスト・オン	3.9	3	5,955		ピーシーデポコーポ	7.4	8.4	2,301	
ジーフット	3	4.9	1,484		B E E N O S	3.6	3.8	9,591		壺番屋	4.4	5.3	23,956	
シー・ヴィー・エス・バイエリア	1	0.8	315		あさひ	5	6.2	8,258		トップカルチャー	2.5	1.5	313	
くら寿司	7.1	7.9	24,332		日本調剤	4.2	4.7	6,030		P L A N T	1.6	1.8	1,164	
キャンドウ	3.6	2.4	5,342		コスモス薬品	6.7	7.6	107,312		スギホールディングス	13.3	15	90,150	
アイケイ	—	2.3	959		トール	3.1	3.4	2,492		菓王堂ホールディングス	2.8	3.8	9,192	
パルグループHLDGS	5.9	6.7	16,113		オンリー	1.1	—	—		ウィア・ホールディングス	7.6	9.5	1,320	
エディオン	27.5	34.4	41,039		セブン & アイ・HLDGS	258.8	252.4	1,511,876		スクロール	9.9	11.6	8,595	
サーユーコーポレーション	13.6	14.4	10,843		クリエイト・レストラップ・ホル	36.2	50.6	47,513		ヨンドシーホールディングス	6.2	6.4	11,411	
ワッツ	3.4	3.6	2,484		ツルハホールディングス	14.5	16.4	133,332		木曾路	8.3	10.2	22,021	
ハローズ	2.7	3.4	10,019		サンマルクホールディングス	5.1	6	9,768		SRSホールディングス	8.2	10.9	9,592	
フジオフードG 本社	5.6	5.7	7,660		フェリシモ	1.7	1.6	1,636		千趣会	11.8	12.2	4,794	
あみやき亭	1.3	1.8	5,261		トリドールホールディングス	16.6	18.7	57,970		タカキユー	7.3	3.9	319	
ひらまつ	12.7	15.5	2,914		TOKYO BASE	6.9	7	2,485		リテールパートナーズ	7.9	10	10,880	
大黒天物産	2.2	2.4	13,824		ウイラブラス HLDGS	1.2	1.5	1,660		ケーヨー	11.9	13.7	12,275	
ハニーズホールディングス	5	6.1	7,545		JMホールディングス	4.9	5.6	9,486		上新電機	7.4	7.2	13,917	
ファーマライズHD	1.5	1.3	839		サツドラホールディングス	0.9	3.1	2,018		日本瓦斯	32.6	36	81,180	
アルベン	5.3	5.5	11,715		アレザホールディングス	4.9	4.8	4,713		ヨニヤホールディングス	11.6	12.8	28,044	
ハブ	2.1	2.4	1,425		串カツ田中 HLDGS	1.9	1.8	3,229		東天紅	0.5	0.5	412	
クオールホールディングス	8.8	9.3	11,569		パロックジャパン	4.9	5.2	4,113		いなげや	7.3	7.3	8,789	
ジンスホールディングス	4.6	4	17,980		クスリのアオキHLDGS	6.6	6.7	44,488		チヨダ	6.4	6.6	5,280	
ビックカメラ	38.5	44.5	52,866		カノ源HD	2.3	4.4	3,502		ライフコーポレーション	6.2	5.9	15,882	
DCMホールディングス	40.7	44.5	46,680		FOOD&LIFE COMPAN	38.9	38.5	92,015		リンガーハット	7.9	8.7	19,192	
ペッパーフードサービス	9.2	14.1	3,285		メディカルシステムネットワーク	6.2	6.5	2,665		Mr Ma x HD	8.8	9.3	5,812	
Monotaro	84.2	95.1	214,450		一家ホールディングス	—	1.8	1,398		テナアライド	5.3	7.2	2,080	
東京一番フーズ	1.6	1.1	654		藤久ホールディングス	—	2.4	1,632		AOKIホールディングス	13.3	14.9	10,891	
DDホールディングス	3.4	4.1	2,529		はるやまHLDGS	2.3	3.1	1,264		オークワ	10	10.5	9,912	
きちりホールディングス	1.4	1.8	610		ノジマ	11.7	12.2	33,062		コメリ	10	11.6	30,635	
アークランドサービスHD	5.5	5.5	11,605		カッパ・クリエイト	9.1	10.6	15,348		青山商事	15.3	14.6	13,884	
J. フロントリテイリング	79.4	83.6	100,570		ライトオン	4.6	5.7	3,955		しまむら	7.7	8.8	108,328	
ドトール・日レスHD	10.4	11.9	20,337		良品計画	76.2	86.7	111,322		はせがわ	3.3	3.4	1,244	
マツコココカラ&カンパニー	27.5	44.1	264,159		パルミキホールディングス	7.9	9.1	2,293		高島屋	49.2	50.6	86,121	
ブリックコピリー	3.6	3.5	8,592		アドヴァングループ	6.6	6.3	5,399		広島	14.4	12.7	13,500	
ZOZO	39.2	51.8	158,767		アルビス	1.9	2.1	4,953		エイチ・ツー・オーリテイリング	32.5	32.8	37,457	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			千株	千株	千円			千株	千株	千円	
近鉄百貨店	2.5	2.1	4,956		おきなわ F G	—	6.3	13,815		北洋銀行	101.2	95.3	22,300	
丸井グループ	56.4	54.4	136,489		十六 F G	—	8.8	21,850		愛知銀行	2.3	2.4	13,656	
アクシアル リテイリング	5.3	5	16,700		北國 F H D	—	6.3	30,681		中京銀行	2.6	2.4	4,538	
井筒屋	3.7	3.7	1,369		プロクレアホールディングス	—	7.9	17,380		大光銀行	2.2	2.2	3,014	
イオン	254.2	248.2	669,023		新生銀行	54.7	49.2	96,432		愛媛銀行	8.9	9.9	8,692	
イズミ	13.5	11.9	36,552		あおぞら銀行	39.5	42	115,626		トマト銀行	2.3	2	2,070	
平和堂	12	11.1	22,344		三菱UFJフィナンシャルG	4,527.4	4,412.5	3,237,892		京葉銀行	25.7	32.3	16,505	
フジ	7.9	16.5	31,053		りそなホールディングス	768.7	797.9	441,637		栃木銀行	31.6	34	9,554	
ヤオコー	7.5	8.5	55,760		三井住友トラストHD	125.2	124.7	540,075		北日本銀行	1.9	2.1	3,702	
ゼビオホールディングス	7.4	10.3	10,300		三井住友フィナンシャルG	457.6	489.1	2,130,519		東和銀行	12.2	12.4	6,559	
ケーズホールディングス	56.6	64	78,464		千葉銀行	221.2	213	168,483		福島銀行	7.7	8.2	1,746	
OLYMPIC グループ	3.6	3.5	2,023		群馬銀行	136.6	121.2	49,692		大東銀行	3	3.2	2,028	
日産東京販売HD	8.9	12.5	3,575		武蔵野銀行	9.7	9.5	16,625		トモニホールディングス	48.2	55.5	17,704	
シルバライフ	1.5	1.6	2,014		千葉興業銀行	16.6	16.1	4,572		フィデアホール	66.2	6.8	9,064	
一家ダイニングプロジ	1.3	—	—		筑波銀行	29.1	29.8	5,781		池田泉州HD	74.8	78.8	17,336	
GENKY DRUGSTORES	2.9	3.3	12,078		七七七銀行	20.5	20.1	37,486		証券・商品先物取引業 (0.7%)				
カルミヤ・インターナショナル	1.6	1.7	1,456		青森銀行	5.1	—	—		F P G	22.7	25.5	34,170	
ブックオフGHD	3.7	4.5	4,689		秋田銀行	4	4.4	7,444		ジャパンインベストメントA	—	5.1	7,053	
ギフトホールディングス	—	1.4	5,264		山形銀行	7	7	6,923		マキユリアホールディングス	3.2	4.5	2,866	
アインホールディングス	9.6	9.3	60,264		岩手銀行	4.2	4.7	8,883		SBIホールディングス	81.8	93.1	249,880	
元気寿司	1.8	2.1	6,562		東邦銀行	56.7	55.1	11,460		日本アジア投資	6.1	6.6	1,524	
ヤマダホールディングス	221	267.2	129,324		東北銀行	3.3	3.3	3,210		ジャフコグループ	8.7	26.1	56,793	
アークランズ	10.3	11.9	17,671		みちのく銀行	4.5	—	—		大和証券G本社	495.5	483.6	298,042	
ニトリホールディングス	26.2	29.9	382,570		ふくおかフィナンシャルG	60.1	54.4	145,084		野村ホールディングス	1,013	1,151.1	581,881	
ブルメ軒屋	4.1	6.1	6,240		静岡銀行	161.8	155.4	137,995		岡三証券グループ	53.9	53.9	18,056	
愛眼	4.4	6.9	1,235		十六銀行	8.3	—	—		丸三証券	19.6	22.2	10,189	
ケーユーホールディングス	3.4	4	4,780		スルガ銀行	63	63	24,318		東洋証券	21.5	23	6,118	
吉野家ホールディングス	21.7	26.3	62,068		八十二銀行	148.5	139.4	70,257		東海東京HD	68.8	73.5	27,709	
松屋フーズHLDGS	2.9	3.6	13,824		山梨中央銀行	7.4	7.6	8,854		光世証券	1.8	1.6	665	
サガミホールディングス	8.7	11	13,651		大垣共立銀行	12.9	12.9	22,781		水戸証券	17.8	17.5	4,357	
関西フードマーケット	4.8	6.1	6,954		福井銀行	5.9	5.7	8,253		いちよし証券	13.3	12.6	8,064	
王将フードサービス	4.1	5	32,550		北國銀行	6.2	—	—		松井証券	32.2	36.9	29,667	
ブレナス	7.5	8.4	16,178		清水銀行	2.5	2.5	3,700		マネックスG	60.4	63.5	30,289	
ミニストップ	5.4	5.5	7,881		富山銀行	1.3	1.2	2,101		極東証券	8.5	8.5	5,831	
アークス	12.7	13.3	27,265		滋賀銀行	13.2	12.3	32,718		岩井コスモホールディング	7.7	7	8,750	
パローホールディングス	13.3	15.3	27,769		南都銀行	9.3	10.2	21,593		アイザワ証券グループ	11.9	10	6,510	
藤久	1.7	—	—		百五銀行	59.3	63	20,790		マネーパートナーズGP	9.1	8.5	2,278	
ベルク	3.2	3.3	18,315		京都銀行	23.9	23.4	128,466		スパークス・グループ	31.6	35.7	10,888	
大庄	3.1	3.8	4,396		紀陽銀行	23	22.3	33,717		小林洋行	4.1	2.4	516	
ファーストリテイリング	8.9	10.1	828,099		ほくほくフィナンシャルG	44.2	42.8	37,535		保険業 (2.3%)				
サンドラッグ	25	28.3	99,191		山陰合同銀行	41	41.7	29,648		かんぽ生命保険	82.4	75.8	173,354	
サックスパーホールディング	5	7.4	5,032		中国銀行	56	53.1	50,710		SOMPOホールディングス	116.6	107.3	655,603	
ヤマザワ	1.1	1.2	1,537		鳥取銀行	2.2	2.4	2,700		アニコムホールディングス	19.5	23.2	14,708	
やまや	1.2	1.7	4,409		伊予銀行	88.2	84.8	62,497		M S & A D	160.3	155.1	650,799	
バーレーナ	14.9	16.2	11,728		百十四銀行	6.5	7	11,851		第一生命HLDGS	326.2	367.2	900,558	
銀行業 (5.4%)					四国銀行	9.3	9.5	8,293		東京海上HD	218.1	209.8	1,657,210	
島根銀行	3	2.1	974		阿波銀行	9.9	10	19,300		T&Dホールディングス	198.3	167.7	255,407	
じもとホールディングス	4.3	4.9	2,518		大分銀行	3.7	4	7,604		アドバンスクリエイト	3.4	3.7	4,018	
めびきフィナンシャルG	344.1	311.1	88,974		宮崎銀行	4.1	4.1	9,216		その他金融業 (1.2%)				
東京きらぼしFG	8.8	8.8	20,116		佐賀銀行	3.8	3.7	5,735		全国保証	17.2	18	85,050	
九州フィナンシャルG	134.9	132.1	50,858		沖縄銀行	5.8	—	—		あんしん保証	—	3.4	890	
ゆうちょ銀行	187.2	177.8	186,156		琉球銀行	13.6	15.9	12,576		ジェイリース	2.5	2.6	6,669	
富山第一銀行	14.7	17.2	7,602		セブン銀行	221.9	225	59,625		イントラスト	2.7	3.3	2,059	
コンコルディア・フィナンシャル	402.8	373.2	174,284		みずほフィナンシャルG	898.7	903.8	1,509,346		日本モーゲージサービス	3.7	4.2	3,809	
西日本フィナンシャルHD	43.3	39.7	30,688		高知銀行	2.5	2.4	1,584		C a s a	2.1	2.7	2,241	
33 F G	5.6	5.9	8,767		山口フィナンシャルG	82.6	75.5	60,551		アルヒ	10.1	11.1	15,540	
第四北越フィナンシャルG	10.7	10.6	28,906		長野銀行	2.4	2.3	2,833		プレミアグループ	3.4	11.4	22,184	
ひろぎんHLDGS	98.7	96.5	60,602		名古屋銀行	5.2	4.6	14,352		ネットプロHD	—	22.9	10,534	

日本株式インデックスファンド（FOF s用）（適格機関投資家専用）

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
クレディセゾン	38.9	44.2	78,587		東京建物	65.4	60	127,980		シミックホールディングス	3.6	3.7	5,875	
芙蓉総合リース	6.8	6.5	53,755		ダイビル	16.9	—	—		エプコ	1.5	1.6	1,014	
みずほリース	10.5	9.2	30,176		京阪神ビルディング	10.5	10.2	13,280		N J S	1.6	1.3	2,567	
東京センチュリー	15.3	11.7	57,388		住友不動産	148.9	135.8	479,102		総合警備保障	25.4	26.7	96,921	
日本証券金融	29	29.6	24,272		テーオーシー	12.1	12.2	9,101		カカココム	47.8	53.6	140,003	
アイフル	113.8	126.7	49,793		東京楽天店	1	1.3	5,278		アイロムグループ	2.4	2.7	6,534	
リコーリース	5.2	6.7	24,220		スターツコーポレーション	7.7	10.5	28,707		セントケア・ホールディング	5.2	4.8	3,988	
イオンフィナンシャルサービス	40.4	41.1	62,143		フジ住宅	7.7	9.6	6,268		サイネックス	1.8	1.2	715	
アコム	129.8	149.5	49,036		空港施設	7.2	8.7	4,811		ルネサンス	4.2	5.1	5,069	
ジャックス	7.7	7.5	28,650		明和地所	3.4	4.1	2,542		ディップ	10.4	12.9	50,310	
オリコ	179.6	204.1	24,083		ゴールドクレスト	5.8	6.6	11,754		デジタルホールディングス	4.9	5.1	6,568	
オリックス	401.5	447.8	1,012,923		エスリード	2.5	3.4	5,919		新日本科学	8.1	9	23,157	
三菱HCキャピタル	227	243.2	165,619		日神グループ HLDGS	9.3	13.5	5,899		キャリアデザインセンター	1.6	1.6	2,328	
九州リースサービス	3	3.3	2,006		日本エスコン	13.1	14.7	11,921		ベネフィット・ワン	23.5	26.4	55,466	
日本取引所グループ	178.7	175.5	359,073		タカラレーベン	29.3	32.8	12,923		エムスリー	113.6	128.9	557,879	
イー・キャランティ	8	11.2	26,913		AVANTIA	3.6	4.2	3,372		ツカガ・グローバルHOLD	4.9	4.6	1,692	
アサックス	3.9	3.5	2,089		イオンモール	33.1	38.6	65,041		プラス	1.4	1	910	
NECキャピタルソリューション	2.8	3.1	6,516		毎日コムネット	2.7	3.4	2,135		アウトソーシング	37.4	38.9	49,597	
不動産業 (2.0%)					ファースト住建	2.9	3.4	3,750		ウェルネット	6.3	6.7	3,966	
いちご	74.3	84.4	25,742		ランド	371.2	437.9	4,379		ワールドホールディングス	2.6	2.9	7,972	
日本駐車場開発	73.5	75.8	14,856		カチタス	16.4	18.8	63,544		ディー・エヌ・エー	27.8	27.9	54,042	
スター・マイカ・HLDGS	3.5	3.4	5,355		トーセイ	9.3	10.8	15,627		博報堂D Y HLDGS	89.1	92.4	104,412	
SREホールディングス	—	1.9	5,650		穴吹興産	1.8	1.8	3,724		ぐるなび	11.1	10.6	4,876	
ADワークスグループ	13.1	21.2	3,307		サンフロンティア不動産	8.1	11.3	13,345		タカミヤ	7.5	8.8	3,625	
ヒューリック	139.7	147	161,700		インテリックス	2	2.5	1,415		ジャパンベストレスキューS	5	4.1	2,988	
三栄建築設計	3	3.3	5,471		ランドビジネス	2.9	3.7	854		ファンコミュニケーションズ	16.4	12.8	5,363	
野村不動産 HLDGS	38.3	39.3	141,676		サンネクスタグループ	2.3	3	2,823		ライク	1.9	2.4	5,258	
三重交通グループHD	12.8	15.8	7,757		グランディアハウス	5.2	5.8	3,248		ビジネス・ブレイクスルー	3	2.5	1,007	
サムティ	9.7	10.4	23,899		日本空港ビルデング	23.1	24.4	148,840		エスプール	19.1	18.8	19,232	
地主	4.6	5.1	10,434		サービス業 (5.4%)					WDBホールディングス	3	3.4	8,918	
プレサンスコーポレーション	11	8.4	12,978		明豊ファシリティワークス	3.3	3.4	2,291		ティア	3.6	4.1	1,791	
ハウスコム	1.2	2	1,878		日本工営	3.8	4.6	16,905		C D G	0.5	0.6	754	
J P M C	3.7	3.8	3,826		LI FUL L	22.5	22.5	3,757		アドウェイズ	—	9	6,660	
サンセイランディック	2	3.2	2,640		ミクシィ	16.5	16.7	40,029		パリュールコマース	5.3	4.9	11,260	
エストラスト	1.1	2.8	1,528		ジェイエイシールトメント	5.5	6	12,540		インフォマート	71.5	67.8	29,357	
フージャースHD	10.4	10	8,130		日本M&Aセンターホールデ	105.5	119.8	208,212		JPホールディングス	18.8	17.9	4,976	
オープンハウスグループ	21.2	24	126,480		メンバーズ	2.4	1.9	4,858		エコナックホールディングス	13.5	13.9	1,237	
東急不動産HD	180.4	205.3	163,213		中広	1.1	1.1	441		CLホールディングス	1.7	1.8	1,596	
飯田GHD	55.3	61.8	133,920		U Tグループ	9.4	10.5	27,961		プレステージ・インター	23.6	27.5	18,397	
イーグランド	1.3	1.3	2,174		アイティメディア	2.5	3.4	5,542		アミュージズ	3.5	4	7,304	
ピーロッド	4.7	6	3,342		タケエイ	7.5	—	—		ドリームインキュベータ	2.1	2.3	4,482	
ファーストブラザーズ	1.2	1.5	1,279		E・Jホールディングス	3.5	4.2	5,451		クイック	3.9	4.6	8,454	
AND DOホールディングス	3.3	4.2	3,717		夢真ビーネックスグループ	17.6	23.9	40,104		T A C	4	3.9	803	
シーアールイー	1.9	3	4,473		コシダカホールディングス	18.6	19.5	17,472		電通グループ	66.2	68.4	291,384	
プロパティエージェン	1.4	0.9	1,412		アルトナー	1.6	1.9	1,875		テイクアンドギヴニーズ	3.4	3.5	5,596	
ケイアイスター不動産	2.3	3.4	16,405		パソナグループ	7.3	7.9	15,768		ぴあ	1.9	2.2	7,557	
アグリ都市デザイン	1.7	1.3	1,968		C D S	1.5	1.9	3,212		イオンファンタジー	2.5	2.9	10,904	
ジェイ・エス・ビー	1.4	1.7	6,358		リンクアンドモチベーション	14.5	18.9	13,475		シーティーエス	7.3	8.3	6,067	
ロードスターキャピタル	—	2.8	4,939		G C A	8.2	—	—		ネクシィーズグループ	2.3	2.2	1,553	
テンポイノベーション	2.2	2.6	2,438		エス・エム・エス	22.2	24.9	74,949		H UグループHD	18.1	19.1	51,741	
グローバルリンクマネジメント	1.3	1.6	1,491		サニーサイドアップG	2	2.5	1,495		アルプス技研	5.5	5.7	10,413	
フェイスネットワーク	—	1.2	1,665		パーソルホールディングス	64.2	73.1	203,437		サニックス	10.8	12.8	3,276	
パーク24	35.8	48.7	100,760		リニカル	3.7	4.2	3,045		ダイオーズ	0.8	1.6	2,398	
バラカ	1.6	2	3,850		クックパッド	21.7	17.7	3,717		日本空調サービス	6.3	7.2	5,414	
宮越ホールディングス	2.7	3.1	2,858		エスクリ	3	3.5	1,291		オリエンタルランド	68.1	77.7	1,578,864	
三井不動産	301.5	294.6	863,178		アイ・ケイ・ケイホールディング	3.1	3.7	2,342		ダスキン	14.5	15.7	44,650	
三菱地所	433.9	429.9	841,314		学情	2.8	3	4,167		明光ネットワークジャパン	8.1	8.5	5,159	
平和不動産	11.5	12.1	49,005		スタジオアリス	3.4	3.3	7,203		ファルコホールディングス	2.9	3.3	5,768	

日本株式インデックスファンド (F O F s 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
秀英予備校	2	1.6	713	
田谷	1.5	1.3	713	
ラウンドワン	22.7	20.5	42,394	
リゾートトラスト	29.8	31	74,586	
ビー・エム・エル	8.4	9.3	31,387	
りらいあコミュニケーション	9.9	10.7	10,582	
リソー教育	34.2	33.8	11,018	
早稲田アカデミー	2.8	4.1	4,391	
ユー・エス・エス	71.5	81.8	198,365	
東京個別指導学院	5.7	6.6	3,715	
サイバーエージェント	159.1	155.9	201,422	
楽天グループ	330.2	301.2	193,972	
グリーク・アンド・リバー社	3.5	3.9	9,652	
モーニングスター	—	12.5	5,887	
テー・オー・ダブリュー	10.8	13.1	4,087	
山田コンサルティングGP	3.6	3.9	4,882	
セントラルスポーツ	2.4	2.7	6,863	
フルキャストホールディングス	5.7	6.3	16,474	
エン・ジャパン	11.5	13	31,005	
リソルホールディングス	0.7	0.8	3,668	
テクノプロ・ホールディング	38.6	43.8	130,786	
アトラグループ	1.9	1.9	359	
インテックワークス	1.6	2.5	947	
アイ・アールジャパンHD	2.7	3.4	7,146	
Keeper 技研	4.4	4.7	18,259	
ファーストロジック	2.2	1.1	962	
三機サービス	1.5	1.2	1,100	
Gunosy	4.8	4.1	3,136	
デジインフン・ジャパン	3.5	2.3	397	
イー・ガーディアン	3.2	2.5	7,295	
リブセンス	6.6	3.7	954	
ジャパンマテリアル	19.1	22.5	43,740	
ベクトル	8.3	10.2	11,220	
ウチヤマホールディングス	3	3.7	1,102	
チャムクアコボレーション	5.4	5.5	6,088	
キャリアリンク	2.5	2.7	6,002	
IBJ	5.9	3.9	3,673	
アサンテ	2.6	3.1	4,991	
パリュエーHR	2.7	5.7	8,396	
M&A キャピタルパートナー	5.5	6	23,160	
ライドオンエクスプレスHD	2.6	2.9	3,210	
ERI ホールディングス	1.8	2.1	2,310	
アピスト	1.1	1.1	3,250	
シグマクス・ホールディング	3.8	8.8	10,507	
ウィルグループ	4.7	5.4	7,614	
エスクローA J	10.3	8.1	1,368	
メドピア	—	5.1	7,160	
レアジョブ	—	1.4	1,044	
リクルートホールディングス	459.6	523.3	2,304,089	
エラン	9.7	8.6	9,511	
土木管理総合試験	3.4	3.2	985	
ネットマーケティング	4.6	3.6	3,232	
日本郵政	484.9	797.5	796,383	
ベルシステム24HLDGS	10.9	10.5	14,637	
鎌倉新書	6.9	8.4	7,291	
S MN	2.1	1.7	902	
一蔵	0.9	1	465	
グローバルキッズCOMP	1.7	1.1	739	

銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
エアトリ	4.6	4.2	12,684	
アトラエ	4.9	5.1	7,680	
ストライク	2.6	3.2	13,120	
ソラスト	16.2	18	16,308	
セラク	2.6	2.3	2,502	
インソース	6.7	8.1	23,020	
ベカレントコンサルティング	4.2	5.2	210,340	
ORCHESTRA HLDGS	1.6	1.4	3,591	
アイモパイル	2.6	3.6	4,546	
キャリアインデックス	3.2	2.5	990	
MS - J a p a n	3	3	2,691	
船場	0.9	0.9	653	
グレイステクノロジー	7.2	—	—	
ジャパンエレベーターSHD	19.1	23.1	44,860	
フルテック	0.9	1.1	1,284	
グリーンズ	2.8	2.7	2,278	
ツナググループHLDGS	2.1	2.3	786	
GAMEWITH	2.4	2.2	814	
ソウルドアウト	1.6	—	—	
MS&CONSULTING	1.3	1.2	745	
ウェルビー	—	4.8	3,595	
エル・ティエ・エス	—	0.8	2,560	
ミダックホールディングス	2.9	3.3	11,319	
日総工産	5.3	5.7	3,317	
キュービネットHLDGS	3	3.4	4,919	
RPA ホールディングス	8.8	10.2	3,019	
スプリックス	2.1	2.5	2,450	
マネジメントソリューションズ	3.4	3.6	9,727	
プロレド・パートナーズ	1.7	1.6	905	
AND FACTORY	1.9	1.7	618	
テノ・ホールディングス	—	0.8	435	
フロンティア・マネジメント	—	2.2	2,787	
ピアラ	—	1.2	854	
コプロ・ホールディングス	—	1.5	1,345	
ギークス	1.5	1.3	1,115	
カープスホールディングス	18.2	20	16,640	
フォーラムエンジニアリング	4.7	4.5	4,117	
FAST FITNESS JAP	—	1.3	2,034	
ダイレクトマーケティングミクス	—	7.4	11,773	
ポピンズ	—	0.9	1,572	
LITALICO	2.8	5.9	16,779	
アドバンテジリスクマネ	3.6	3.9	1,856	
リログループ	35.2	40.1	91,267	
東祥	4.3	5.5	6,858	
ビーウィズ	—	2	2,770	
TRE ホールディングス	—	13.7	23,509	
人・夢・技術グループ	—	2.9	7,786	
エイチ・アイ・エス	14.5	17.1	38,286	
ラックランド	1.9	2.1	6,014	
共立メンテナンス	10.7	13	78,390	
イチネンホールディングス	6.2	7.4	9,405	
建設技術研究所	4.1	3.3	9,814	
スペース	3.9	4.7	4,140	
長大	2.6	—	—	
燦ホールディングス	2.7	3.2	5,987	
スバル興業	0.4	0.4	3,660	
東京テアトル	2.3	3	3,645	
タナベ経営	1	2.6	1,684	

銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
ナガワ	2	2.1	15,750	
東京都競馬	5	5.5	23,182	
常磐興産	2.6	2.5	3,145	
カナモト	11	11.9	24,716	
西尾レントオール	5.8	6.1	17,751	
アゴラホスピタリティーG	52.2	42.7	982	
トランス・コスモス	6.4	9.2	34,500	
乃村工藝社	27.7	31.3	29,766	
藤田観光	2.7	2.9	8,375	
KNT-CT ホールディングス	3.8	4.5	8,806	
日本管財	6.7	7.7	20,097	
トーカイ	6.1	5.8	10,909	
白洋舎	0.7	0.6	858	
セコム	63.1	72	609,264	
セントラル警備保障	3	3.6	8,586	
丹青社	11.9	13.7	10,905	
メイテック	7.8	26	61,880	
応用地質	7.1	6.3	11,724	
船井総研ホールディン	13.1	13.7	33,606	
進学会ホールディングス	2.6	2.1	661	
オオバ	4.2	4.5	3,159	
いであ	1.5	1.6	2,676	
学究社	1.9	2.2	3,638	
ベネッセホールディングス	23.6	24.3	52,731	
イオンディライト	7.8	8.3	23,655	
ナック	2.7	4.1	3,817	
ダイセキ	12.9	13.3	59,783	
ステップ	2.3	2.7	4,930	
合計	株数・金額	70,983.9	78,099	190,358,800
	銘柄数<比率>	2,126銘柄	2,156銘柄	<96.6%>

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

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内	百万円	百万円
TOPIX	6,702	—

(注) 単位未満は切捨て。

日本株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

■有価証券の貸付及び借入の状況

項 目	当 期 末	
	貸 付	借 入
株式	4,316,900 (46,600)	株 — (—)

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

■投資信託財産の構成

2022年9月20日現在

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

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年9月20日現在

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

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

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：
 トピックス・インデックスファンド 2,913,315,600円
 ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA 5,057,552,549円
 適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドVA2 919,050円
 ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募） 22,914,284円
 ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募） 306,153,651円

ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）	20,861,610円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）	620,077,228円
日本株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	424,026,190円
D-1's TOPIXインデックス	31,216,024円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	209,861,004円
iFree TOPIXインデックス	6,024,963,119円
iFree 8資産バランス	4,243,393,048円
iFree 年金バランス	754,549,149円
DCダイワ日本株式インデックス	68,855,675,811円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,261,884,393円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,664,787,412円
ダイワ・ライフ・バランス70	4,626,300,873円
年金ダイワ日本株式インデックス	6,602,474,346円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	59,540,051円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	69,149,114円
ダイワつみたてインデックス日本株式	2,398,708,347円
ダイワつみたてインデックスバランス30	12,198,543円
ダイワつみたてインデックスバランス50	10,134,564円
ダイワつみたてインデックスバランス70	25,524,777円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	964,722,382円
ダイワ世界バランスファンド40VA	80,584,476円
ダイワ世界バランスファンド60VA	44,620,861円
ダイワ・バランスファンド35VA	5,365,977,076円
ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	495,127,448円
ダイワ国内バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	70,111,584円
ダイワ国内バランスファンド30VA（適格機関投資家専用）	105,903,266円
ダイワ・ノーロードTOPIXファンド	221,137,687円
ダイワファンドラップTOPIXインデックス	11,537,778,484円
ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）	1,659,502,574円
ダイワファンドラップオンラインTOPIXインデックス	3,228,157,904円
ダイワ・インデックスセレクトTOPIX	1,206,704,313円
ダイワライフスタイル25	134,931,541円
ダイワライフスタイル50	556,481,026円
ダイワライフスタイル75	423,712,951円
DC・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	8,850,002,618円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,480円です。

■損益の状況

当期 自 2021年9月22日 至 2022年9月20日

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

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

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

《お知らせ》

■主要投資対象の変更について

東京証券取引所の市場改革を見据え、主要投資対象を以下の通り変更しました。

変更前：東京証券取引所第一部上場株式

変更後：東京証券取引所上場株式

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

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）

運用報告書（全体版） 第5期

（決算日 2022年11月30日）

（作成対象期間 2021年12月1日～2022年11月30日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（設定日：2018年9月18日）	
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ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）
	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。）
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI 総合指数		公社債 組入比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
1 期末(2018年11月30日)	円 10,028	円 0	% 0.3	10,030	% 0.3	% 98.5	% -	百万円 15
2 期末(2019年12月 2 日)	10,246	0	2.2	10,269	2.4	99.1	-	160
3 期末(2020年11月30日)	10,150	0	△0.9	10,185	△0.8	99.1	-	437
4 期末(2021年11月30日)	10,143	0	△0.1	10,199	0.1	98.8	-	996
5 期末(2022年11月30日)	9,707	0	△4.3	9,770	△4.2	99.0	-	1,871

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

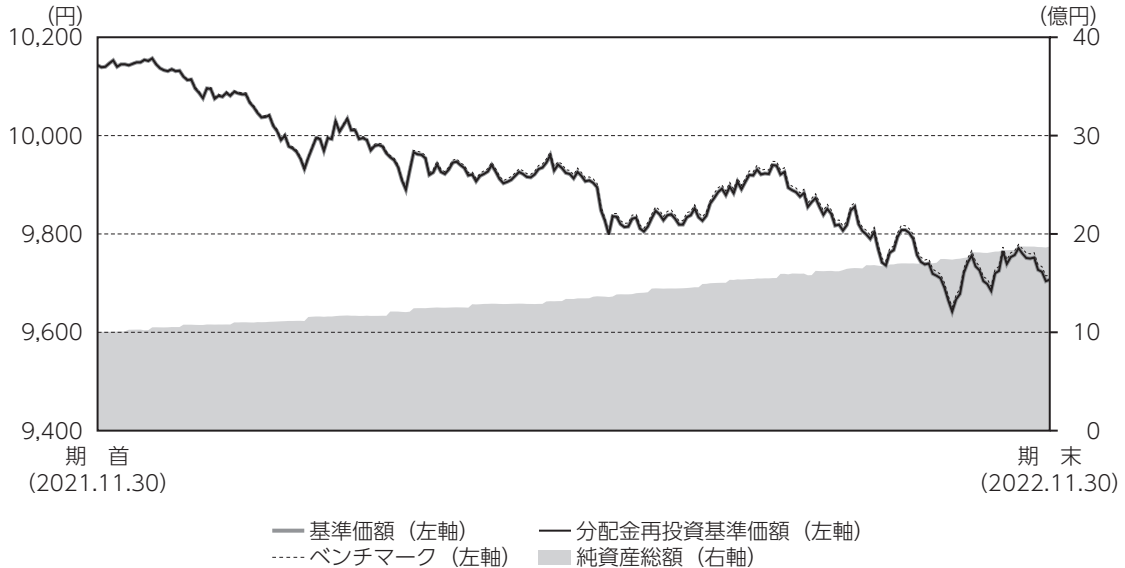
(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

NOMURA-BPI の知的財産権およびその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

*ベンチマークはNOMURA-BPI総合指数です。

■基準価額・騰落率

期首：10,143円

期末：9,707円（分配金0円）

騰落率：△4.3%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

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

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)

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
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2021年11月30日	円 10,143	% -	10,199	% -	% 98.8	% -
12月末	10,120	△0.2	10,178	△0.2	99.3	-
2022年 1 月末	10,046	△1.0	10,104	△0.9	99.0	-
2 月末	9,995	△1.5	10,054	△1.4	99.4	-
3 月末	9,966	△1.7	10,025	△1.7	99.4	-
4 月末	9,940	△2.0	10,001	△1.9	99.4	-
5 月末	9,924	△2.2	9,986	△2.1	99.0	-
6 月末	9,832	△3.1	9,895	△3.0	99.3	-
7 月末	9,896	△2.4	9,960	△2.3	99.4	-
8 月末	9,873	△2.7	9,936	△2.6	99.0	-
9 月末	9,767	△3.7	9,829	△3.6	99.4	-
10月末	9,756	△3.8	9,820	△3.7	99.0	-
(期末) 2022年11月30日	9,707	△4.3	9,770	△4.2	99.0	-

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021.12.1~2022.11.30)

■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、日銀の長短金利操作の下、当作成期首より2021年中はゼロ%をやや上回る狭いレンジで推移しました。2022年に入ると、世界的なインフレ圧力の高まりや各国での金融引き締め加速観測を受け、長期金利は2月に0.2%台まで上昇しました。その後、ロシアによるウクライナ侵攻などで一時0.1%台半ばまで低下しましたが、ロシアに対する経済制裁が追加的なインフレ要因となったため、3月下旬には0.2%台半ばまで上昇しました。その後4月から当作成期末にかけては、世界で予想以上にインフレが進んだため各国の金利が上昇し、日本の金利にも上昇圧力がかけられましたが、日銀が長期金利を0.25%までにとどめる方針を強く示したこともあり、0.2%から0.25%程度のレンジで推移しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■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。

ポートフォリオについて

(2021.12.1~2022.11.30)

■当ファンド

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

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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。

*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

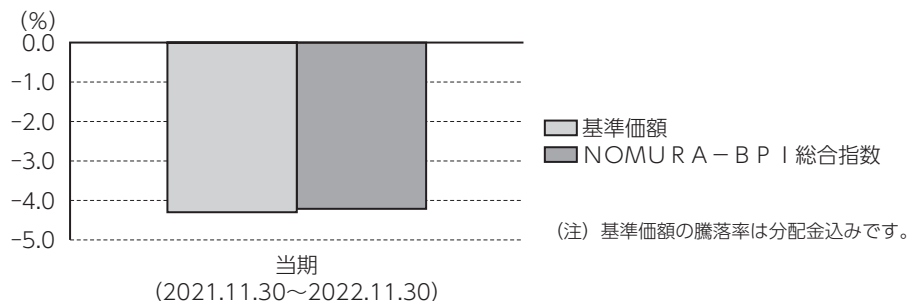
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	NOMURA-BPI総合指数

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は $\Delta 4.2\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 4.3\%$ となりました。

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差異は $\Delta 0.1\%$ でした。差異の内訳は、運用管理費用要因によるベンチマークとの差異が $\Delta 0.1\%$ 程度となっており、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



*ベンチマークはNOMURA-BPI総合指数です。

分配金について

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

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年12月1日 ～2022年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	35

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2021.12.1~2022.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	14円	0.143%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,912円です。
(投 信 会 社)	(11)	(0.110)	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)	(1)	(0.011)	販売会社分は、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	－	－	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	－	－	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	15	0.148	

(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。

■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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (B P I)	759,992	958,352	20,086	25,525

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等			売付額等		
区 分	A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
公社債	百万円 12,207	百万円 -	% -	百万円 4,545	百万円 100	% 2.2
コール・ローン	49,173	-	-	-	-	-

(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。

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

種 類	当 期	
	買	付 額
公社債		百万円 100

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)	770,013	1,509,919	1,870,034	1,870,034

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (B P I)	1,870,034	99.8
コール・ローン等、その他	3,056	0.2
投資信託財産総額	1,873,091	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,873,091,096円
コール・ローン等	3,056,244
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (B P I) (評価額)	1,870,034,852
(B) 負債	1,192,522
未払信託報酬	1,148,441
その他未払費用	44,081
(C) 純資産総額(A - B)	1,871,898,574
元本	1,928,453,597
次期繰越損益金	△ 56,555,023
(D) 受益権総口数	1,928,453,597口
1万口当り基準価額(C / D)	9,707円

* 期首における元本額は982,020,972円、当作成期間中における追加設定元本額は971,863,816円、同解約元本額は25,431,191円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,707円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は56,555,023円です。

■損益の状況

当期 自2021年12月1日 至2022年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 371円
支払利息	△ 371
(B) 有価証券売買損益	△57,553,721
売買益	320,879
売買損	△57,874,600
(C) 信託報酬等	△ 2,053,207
(D) 当期繰越損益金(A + B + C)	△59,607,299
(E) 前期繰越損益金	△ 2,684,485
(F) 追加信託差損益金	5,736,761
(配当等相当額)	(6,835,625)
(売買損益相当額)	(△ 1,098,864)
(G) 合計(D + E + F)	△56,555,023
次期繰越損益金(G)	△56,555,023
追加信託差損益金	5,736,761
(配当等相当額)	(6,835,625)
(売買損益相当額)	(△ 1,098,864)
分配準備積立金	43,065
繰越損益金	△62,334,849

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

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

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

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	6,835,625
(d) 分配準備積立金	43,065
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	6,878,690
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	6,878,690
(h) 受益権総口数	1,928,453,597口

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18期 (決算日 2022年11月30日)

(作成対象期間 2021年12月1日～2022年11月30日)

ダイワ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。

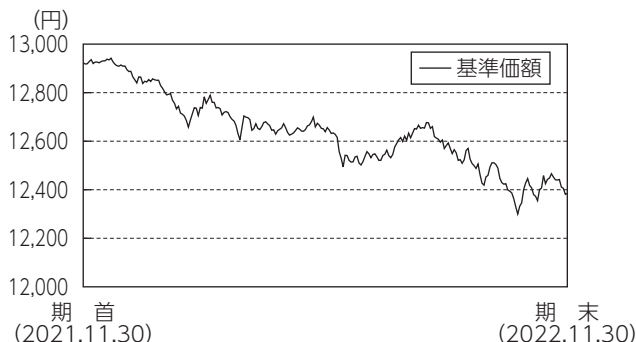
運用方針	投資成果をNOMURA-BPI総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	内外の公社債等 (各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。)
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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)2021年11月30日	12,923	-	12,954	-	98.9	-
12月末	12,895	△0.2	12,927	△0.2	99.4	-
2022年 1 月末	12,803	△0.9	12,834	△0.9	99.1	-
2 月末	12,739	△1.4	12,769	△1.4	99.5	-
3 月末	12,704	△1.7	12,733	△1.7	99.5	-
4 月末	12,672	△1.9	12,702	△1.9	99.5	-
5 月末	12,653	△2.1	12,683	△2.1	99.1	-
6 月末	12,537	△3.0	12,567	△3.0	99.4	-
7 月末	12,621	△2.3	12,650	△2.3	99.5	-
8 月末	12,593	△2.6	12,620	△2.6	99.1	-
9 月末	12,459	△3.6	12,484	△3.6	99.5	-
10 月末	12,446	△3.7	12,473	△3.7	99.1	-
(期末)2022年11月30日	12,385	△4.2	12,408	△4.2	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：12,923円 期末：12,385円 騰落率：△4.2%

【基準価額の主な変動要因】

わが国の公社債に投資した結果、金利が上昇（債券価格は下落）したことが主な要因となり、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、日銀の長短金利操作の下、当作成期首より2021年中はゼロ％をやや上回る狭いレンジで推移しました。2022年に入ると、世界的なインフレ圧力の高まりや各国での金融

引き締め加速観測を受け、長期金利は2月に0.2%台まで上昇しました。その後、ロシアによるウクライナ侵攻などで一時0.1%台半ばまで低下しましたが、ロシアに対する経済制裁が追加的なインフレ要因となったため、3月下旬には0.2%台半ばまで上昇しました。その後4月から当作成期末にかけては、世界で予想以上にインフレが進んだため各国の金利が上昇し、日本の金利にも上昇圧力がかかりましたが、日銀が長期金利を0.25%までにとどめる方針を強く示したこともあり、0.2%から0.25%程度のレンジで推移しました。

◆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。

◆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バース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

◆ベンチマークとの差異について

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

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差は0.0%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。

■ 1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況
公社債

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

国	内	買付額		売付額	
		千円	千円	千円	千円
	国債証券	12,107,241	(-)	4,243,337	(-)
	地方債証券	-	(-)	201,504	(-)
	特殊債券	-	(-)	100,637	(-)
	社債券	100,000	(-)	-	(-)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債券(転換社債券)は含まれておりません。

(注4) 単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄
公社債

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
151 5年国債 0.005% 2027/3/20	449,928	137 5年国債 0.1% 2023/9/20	591,416
439 2年国債 0.005% 2024/8/1	390,705	135 5年国債 0.1% 2023/3/20	420,726
366 10年国債 0.2% 2032/3/20	388,931	136 5年国債 0.1% 2023/6/20	380,733
149 5年国債 0.005% 2026/9/20	381,767	419 2年国債 0.1% 2022/12/1	350,801
153 5年国債 0.005% 2027/6/20	370,170	430 2年国債 0.005% 2023/11/1	250,272
367 10年国債 0.2% 2032/6/20	359,729	422 2年国債 0.1% 2023/3/1	240,405
365 10年国債 0.1% 2031/12/20	332,219	428 2年国債 0.005% 2023/9/1	240,333
364 10年国債 0.1% 2031/9/20	265,603	329 10年国債 0.8% 2023/6/20	201,860
150 5年国債 0.005% 2026/12/20	260,069	429 2年国債 0.005% 2023/10/1	180,223
430 2年国債 0.005% 2023/11/1	250,647	134 5年国債 0.1% 2022/12/20	170,397

(注1) 金額は受渡し代金(経過利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)

区分	当			期			末		
	額面金額	評価額	組入比率	うち8B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	38,553,000	38,457,616	91.0	-	58.9	20.6	11.5		
地方債証券	1,400,000	1,441,583	3.4	-	1.3	2.1	-		
特殊債券(除く金融債券)	700,000	722,617	1.7	-	0.5	1.0	0.2		
普通社債券	1,300,000	1,287,679	3.0	-	0.9	1.9	0.2		
合計	41,953,000	41,909,497	99.1	-	61.6	25.6	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手しています。

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

区分	当			期			末		
	銘柄	年利	額面金額	評価額	償還年月日				
		%	千円	千円					
国債証券	431 2年国債	0.0050	150,000	150,127	2023/12/01				
	138 5年国債	0.1000	560,000	561,086	2023/12/20				
	332 10年国債	0.6000	65,000	65,464	2023/12/20				
	65 20年国債	1.9000	42,000	42,875	2023/12/20				
	66 20年国債	1.8000	30,000	30,593	2023/12/20				
	433 2年国債	0.0050	250,000	250,217	2024/02/01				
	434 2年国債	0.0050	170,000	170,147	2024/03/01				
	139 5年国債	0.1000	640,000	641,324	2024/03/20				
	333 10年国債	0.6000	83,000	83,711	2024/03/20				
	67 20年国債	1.9000	19,000	19,483	2024/03/20				
	68 20年国債	2.2000	25,000	25,734	2024/03/20				
	69 20年国債	2.1000	12,000	12,336	2024/03/20				
	435 2年国債	0.0050	30,000	30,027	2024/04/01				
	436 2年国債	0.0050	200,000	200,198	2024/05/01				
	437 2年国債	0.0050	150,000	150,123	2024/06/01				
	140 5年国債	0.1000	470,000	471,057	2024/06/20				
	334 10年国債	0.6000	320,000	323,200	2024/06/20				
	70 20年国債	2.4000	18,000	18,682	2024/06/20				
	71 20年国債	2.2000	17,000	17,592	2024/06/20				
	438 2年国債	0.0050	20,000	20,015	2024/07/01				
	439 2年国債	0.0050	390,000	390,292	2024/08/01				
	440 2年国債	0.0050	200,000	200,140	2024/09/01				
	141 5年国債	0.1000	620,000	621,506	2024/09/20				
	335 10年国債	0.5000	210,000	212,026	2024/09/20				
	72 20年国債	2.1000	53,000	55,041	2024/09/20				
	441 2年国債	0.0050	80,000	80,065	2024/10/01				
	142 5年国債	0.1000	320,000	320,819	2024/11/20				
	337 10年国債	0.3000	300,000	302,001	2024/12/20				
	143 5年国債	0.1000	580,000	581,531	2025/03/20				
	338 10年国債	0.4000	80,000	80,763	2025/03/20				
	75 20年国債	2.1000	14,000	14,680	2025/03/20				
	76 20年国債	1.9000	25,000	26,100	2025/03/20				
	144 5年国債	0.1000	530,000	531,552	2025/06/20				
	339 10年国債	0.4000	135,000	136,428	2025/06/20				
	78 20年国債	1.9000	17,000	17,830	2025/06/20				
	79 20年国債	2.0000	14,000	14,719	2025/06/20				
	145 5年国債	0.1000	710,000	712,186	2025/09/20				
	340 10年国債	0.4000	190,000	192,183	2025/09/20				
	81 20年国債	2.0000	65,000	68,662	2025/09/20				
	82 20年国債	2.1000	28,000	29,656	2025/09/20				
	146 5年国債	0.1000	360,000	361,152	2025/12/20				
	341 10年国債	0.3000	15,000	15,139	2025/12/20				
	147 5年国債	0.0050	580,000	580,000	2026/03/20				
	342 10年国債	0.1000	140,000	140,438	2026/03/20				

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)

区 分	当 期			未 期		
	銘柄	年利率	額面金額	評 価 額	償還年月日	
		%	千円	千円		
85	20年国債	2.1000	31,000	33,141	2026/03/20	
86	20年国債	2.3000	6,000	6,454	2026/03/20	
87	20年国債	2.2000	35,000	37,533	2026/03/20	
148	5年国債	0.0050	500,000	499,820	2026/06/20	
343	10年国債	0.1000	270,000	270,812	2026/06/20	
88	20年国債	2.3000	33,000	35,675	2026/06/20	
89	20年国債	2.2000	15,000	16,163	2026/06/20	
149	5年国債	0.0050	450,000	449,572	2026/09/20	
344	10年国債	0.1000	90,000	90,238	2026/09/20	
150	5年国債	0.0050	260,000	259,526	2026/12/20	
345	10年国債	0.1000	410,000	410,828	2026/12/20	
92	20年国債	2.1000	60,000	64,973	2026/12/20	
151	5年国債	0.0050	450,000	448,744	2027/03/20	
346	10年国債	0.1000	250,000	250,320	2027/03/20	
93	20年国債	2.0000	18,000	19,488	2027/03/20	
94	20年国債	2.1000	45,000	48,915	2027/03/20	
1	フィリピン共和国	0.7600	100,000	98,662	2027/04/22	
153	5年国債	0.0050	370,000	368,571	2027/06/20	
347	10年国債	0.1000	400,000	400,180	2027/06/20	
95	20年国債	2.3000	30,000	33,012	2027/06/20	
96	20年国債	2.1000	63,000	68,754	2027/06/20	
154	5年国債	0.1000	140,000	139,932	2027/09/20	
348	10年国債	0.1000	430,000	429,793	2027/09/20	
97	20年国債	2.2000	25,000	27,502	2027/09/20	
98	20年国債	2.1000	64,000	70,101	2027/09/20	
349	10年国債	0.1000	380,000	379,521	2027/12/20	
99	20年国債	2.1000	53,000	58,269	2027/12/20	
350	10年国債	0.1000	480,000	479,241	2028/03/20	
100	20年国債	2.2000	35,000	38,822	2028/03/20	
101	20年国債	2.4000	18,000	20,155	2028/03/20	
351	10年国債	0.1000	440,000	439,027	2028/06/20	
102	20年国債	2.4000	10,000	11,247	2028/06/20	
103	20年国債	2.3000	21,000	23,504	2028/06/20	
104	20年国債	2.1000	64,000	70,928	2028/06/20	
352	10年国債	0.1000	500,000	498,705	2028/09/20	
105	20年国債	2.1000	38,000	42,286	2028/09/20	
106	20年国債	2.2000	16,000	17,897	2028/09/20	
353	10年国債	0.1000	440,000	438,548	2028/12/20	
107	20年国債	2.1000	40,000	44,678	2028/12/20	
108	20年国債	1.9000	68,000	75,136	2028/12/20	
354	10年国債	0.1000	410,000	408,335	2029/03/20	
109	20年国債	1.9000	60,000	66,530	2029/03/20	
110	20年国債	2.1000	27,000	30,275	2029/03/20	
355	10年国債	0.1000	350,000	348,187	2029/06/20	
111	20年国債	2.2000	35,000	39,602	2029/06/20	
112	20年国債	2.1000	40,000	45,001	2029/06/20	
356	10年国債	0.1000	390,000	387,511	2029/09/20	
113	20年国債	2.1000	70,000	79,032	2029/09/20	
357	10年国債	0.1000	360,000	357,123	2029/12/20	
114	20年国債	2.1000	45,000	50,945	2029/12/20	
115	20年国債	2.2000	42,000	47,840	2029/12/20	
2	30年国債	2.4000	9,000	10,402	2030/02/20	
358	10年国債	0.1000	480,000	475,516	2030/03/20	
116	20年国債	2.2000	27,000	30,851	2030/03/20	
117	20年国債	2.1000	77,000	87,429	2030/03/20	
3	30年国債	2.3000	4,000	4,609	2030/05/20	
359	10年国債	0.1000	390,000	385,663	2030/06/20	
118	20年国債	2.0000	13,000	14,707	2030/06/20	
119	20年国債	1.8000	23,000	25,679	2030/06/20	
120	20年国債	1.6000	98,000	107,963	2030/06/20	
360	10年国債	0.1000	460,000	454,194	2030/09/20	
4	30年国債	2.9000	8,000	9,656	2030/11/20	
361	10年国債	0.1000	460,000	453,656	2030/12/20	
123	20年国債	2.1000	42,000	48,094	2030/12/20	
124	20年国債	2.0000	100,000	113,723	2030/12/20	
362	10年国債	0.1000	450,000	443,250	2031/03/20	
125	20年国債	2.2000	25,000	28,928	2031/03/20	
126	20年国債	2.0000	21,000	23,958	2031/03/20	

区 分	当 期			未 期		
	銘柄	年利率	額面金額	評 価 額	償還年月日	
		%	千円	千円		
127	20年国債	1.9000	110,000	124,603	2031/03/20	
5	30年国債	2.2000	8,000	9,281	2031/05/20	
363	10年国債	0.1000	380,000	373,973	2031/06/20	
128	20年国債	1.9000	32,000	36,359	2031/06/20	
129	20年国債	1.8000	95,000	107,147	2031/06/20	
364	10年国債	0.1000	380,000	373,638	2031/09/20	
130	20年国債	1.8000	28,000	31,669	2031/09/20	
131	20年国債	1.7000	150,000	168,370	2031/09/20	
6	30年国債	2.4000	9,000	10,678	2031/11/20	
365	10年国債	0.1000	335,000	329,673	2031/12/20	
132	20年国債	1.7000	25,000	28,146	2031/12/20	
133	20年国債	1.8000	150,000	170,203	2031/12/20	
366	10年国債	0.2000	390,000	390,534	2032/03/20	
134	20年国債	1.8000	15,000	17,066	2032/03/20	
135	20年国債	1.7000	20,000	22,573	2032/03/20	
136	20年国債	1.6000	180,000	201,531	2032/03/20	
7	30年国債	2.3000	12,000	14,222	2032/05/20	
367	10年国債	0.2000	360,000	358,822	2032/06/20	
137	20年国債	1.7000	18,000	20,339	2032/06/20	
139	20年国債	1.6000	250,000	280,175	2032/06/20	
368	10年国債	0.2000	130,000	129,377	2032/09/20	
140	20年国債	1.7000	100,000	113,062	2032/09/20	
141	20年国債	1.7000	48,000	54,292	2032/12/20	
142	20年国債	1.8000	185,000	211,048	2032/12/20	
10	30年国債	1.1000	25,000	26,797	2033/03/20	
143	20年国債	1.6000	100,000	112,202	2033/03/20	
144	20年国債	1.5000	130,000	144,573	2033/03/20	
11	30年国債	1.7000	9,000	10,189	2033/06/20	
145	20年国債	1.7000	210,000	237,755	2033/06/20	
12	30年国債	2.1000	11,000	12,916	2033/09/20	
146	20年国債	1.7000	200,000	226,454	2033/09/20	
13	30年国債	2.0000	11,000	12,808	2033/12/20	
147	20年国債	1.6000	220,000	246,765	2033/12/20	
14	30年国債	2.4000	22,000	26,598	2034/03/20	
148	20年国債	1.5000	195,000	216,547	2034/03/20	
15	30年国債	2.5000	21,000	25,656	2034/06/20	
149	20年国債	1.5000	215,000	238,607	2034/06/20	
16	30年国債	2.5000	26,000	31,813	2034/09/20	
150	20年国債	1.4000	225,000	247,016	2034/09/20	
17	30年国債	2.4000	17,000	20,624	2034/12/20	
151	20年国債	1.2000	260,000	279,099	2034/12/20	
18	30年国債	2.3000	20,000	24,059	2035/03/20	
152	20年国債	1.2000	200,000	214,480	2035/03/20	
19	30年国債	2.3000	15,000	18,060	2035/06/20	
153	20年国債	1.3000	275,000	297,987	2035/06/20	
20	30年国債	2.5000	16,000	19,672	2035/09/20	
154	20年国債	1.2000	205,000	219,362	2035/09/20	
21	30年国債	2.3000	16,000	19,292	2035/12/20	
155	20年国債	1.0000	220,000	229,539	2035/12/20	
22	30年国債	2.5000	17,000	20,939	2036/03/20	
156	20年国債	0.4000	200,000	193,052	2036/03/20	
23	30年国債	2.5000	16,000	19,735	2036/06/20	
157	20年国債	0.2000	210,000	196,637	2036/06/20	
24	30年国債	2.5000	15,000	18,503	2036/09/20	
158	20年国債	0.5000	225,000	218,646	2036/09/20	
25	30年国債	2.3000	17,000	20,532	2036/12/20	
159	20年国債	0.6000	220,000	215,941	2036/12/20	
26	30年国債	2.4000	32,000	39,096	2037/03/20	
160	20年国債	0.7000	190,000	188,407	2037/03/20	
161	20年国債	0.6000	200,000	194,912	2037/06/20	
27	30年国債	2.5000	32,000	39,540	2037/09/20	
162	20年国債	0.6000	210,000	203,899	2037/09/20	
163	20年国債	0.6000	160,000	154,764	2037/12/20	
28	30年国債	2.5000	34,000	42,021	2038/03/20	
164	20年国債	0.5000	260,000	246,844	2038/03/20	
165	20年国債	0.5000	155,000	146,541	2038/06/20	
29	30年国債	2.4000	43,000	52,504	2038/09/20	
166	20年国債	0.7000	215,000	208,760	2038/09/20	

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)

区 分	当 期		未		償還年月日	
	銘 柄	年利率	額面金額	評 価 額		
		%	千円	千円		
	167	20年国債	0.5000	160,000	150,075	2038/12/20
	30	30年国債	2.3000	56,000	67,527	2039/03/20
	168	20年国債	0.4000	250,000	229,782	2039/03/20
	169	20年国債	0.3000	155,000	139,492	2039/06/20
	31	30年国債	2.2000	76,000	90,354	2039/09/20
	170	20年国債	0.3000	175,000	156,700	2039/09/20
	171	20年国債	0.3000	140,000	124,814	2039/12/20
	32	30年国債	2.3000	45,000	54,186	2040/03/20
	172	20年国債	0.4000	215,000	194,256	2040/03/20
	173	20年国債	0.4000	200,000	180,066	2040/06/20
	33	30年国債	2.0000	95,000	109,854	2040/09/20
	174	20年国債	0.4000	230,000	206,337	2040/09/20
	175	20年国債	0.5000	165,000	150,201	2040/12/20
	34	30年国債	2.2000	110,000	130,821	2041/03/20
	176	20年国債	0.5000	150,000	136,083	2041/03/20
	177	20年国債	0.4000	180,000	159,724	2041/06/20
	35	30年国債	2.0000	120,000	138,771	2041/09/20
	178	20年国債	0.5000	190,000	171,304	2041/09/20
	179	20年国債	0.5000	190,000	170,832	2041/12/20
	36	30年国債	2.0000	138,000	159,548	2042/03/20
	180	20年国債	0.8000	160,000	151,753	2042/03/20
	181	20年国債	0.9000	160,000	154,353	2042/06/20
	37	30年国債	1.9000	165,000	187,684	2042/03/20
	182	20年国債	1.1000	60,000	59,757	2042/09/20
	38	30年国債	1.8000	95,000	106,210	2043/03/20
	39	30年国債	1.9000	105,000	119,179	2043/06/20
	40	30年国債	1.8000	80,000	89,252	2043/09/20
	41	30年国債	1.7000	80,000	87,680	2043/12/20
	42	30年国債	1.7000	85,000	93,077	2044/03/20
	43	30年国債	1.7000	95,000	103,933	2044/06/20
	44	30年国債	1.7000	85,000	92,905	2044/09/20
	45	30年国債	1.5000	105,000	110,589	2044/12/20
	46	30年国債	1.5000	115,000	120,961	2045/03/20
	47	30年国債	1.6000	105,000	112,354	2045/06/20
	48	30年国債	1.4000	110,000	113,228	2045/09/20
	49	30年国債	1.4000	120,000	123,331	2045/12/20
	50	30年国債	0.8000	110,000	99,629	2046/03/20
	51	30年国債	0.3000	155,000	124,251	2046/06/20
	52	30年国債	0.5000	120,000	100,628	2046/09/20
	53	30年国債	0.6000	95,000	81,251	2046/12/20
	54	30年国債	0.8000	118,000	105,449	2047/03/20
	55	30年国債	0.8000	96,000	85,475	2047/06/20
	56	30年国債	0.8000	100,000	88,708	2047/09/20
	57	30年国債	0.8000	105,000	92,799	2047/12/20
	1	40年国債	2.4000	30,000	36,666	2048/03/20
	58	30年国債	0.8000	150,000	132,075	2048/03/20
	59	30年国債	0.7000	97,000	83,049	2048/06/20
	60	30年国債	0.9000	100,000	89,504	2048/09/20
	61	30年国債	0.7000	95,000	80,612	2048/12/20
	2	40年国債	2.2000	48,000	56,355	2049/03/20
	62	30年国債	0.5000	110,000	88,173	2049/03/20
	63	30年国債	0.4000	110,000	85,401	2049/06/20
	64	30年国債	0.4000	90,000	69,609	2049/09/20
	65	30年国債	0.4000	86,000	66,641	2049/12/20
	3	40年国債	2.2000	19,000	22,400	2050/03/20
	66	30年国債	0.4000	115,000	88,949	2050/03/20
	67	30年国債	0.6000	140,000	113,121	2050/06/20
	68	30年国債	0.6000	106,000	85,355	2050/09/20
	69	30年国債	0.7000	106,000	87,528	2050/12/20
	4	40年国債	2.2000	54,000	63,139	2051/03/20
	70	30年国債	0.7000	166,000	136,498	2051/03/20
	71	30年国債	0.7000	66,000	54,093	2051/06/20
	72	30年国債	0.7000	203,000	165,995	2051/09/20
	73	30年国債	0.7000	120,000	97,996	2051/12/20
	5	40年国債	2.0000	61,000	68,461	2052/03/20
	74	30年国債	1.0000	155,000	137,269	2052/03/20
	75	30年国債	1.3000	160,000	153,134	2052/06/20
	76	30年国債	1.4000	80,000	78,191	2052/09/20

区 分	当 期		未		償還年月日	
	銘 柄	年利率	額面金額	評 価 額		
		%	千円	千円		
	6	40年国債	1.9000	40,000	43,788	2053/03/20
	7	40年国債	1.7000	41,000	42,883	2054/03/20
	8	40年国債	1.4000	40,000	38,750	2055/03/20
	9	40年国債	0.4000	40,000	28,282	2056/03/20
	10	40年国債	0.9000	91,000	75,719	2057/03/20
	11	40年国債	0.8000	85,000	67,973	2058/03/20
	12	40年国債	0.5000	99,000	70,435	2059/03/20
	13	40年国債	0.5000	252,000	177,899	2060/03/20
	14	40年国債	0.7000	273,000	205,852	2061/03/20
	15	40年国債	1.0000	145,000	119,398	2062/03/20
種別	銘柄数	-----	258銘柄	-----	-----	
小計	金額	-----	38,553,000	38,457,616	-----	
地方債証券	3	兵庫県公債12年	0.5600	100,000	101,020	2025/04/16
	401	大阪府公債	0.4770	100,000	100,988	2025/10/29
	22-1	福岡県15年	1.6700	100,000	104,612	2025/11/21
	27-1	滋賀県公債	0.4760	100,000	101,064	2025/11/27
	751	東京都公債	0.3700	100,000	100,760	2025/12/19
	27-15	北海道公債	0.2200	100,000	100,222	2026/02/26
	28-1	静岡県公債	0.0800	100,000	99,832	2026/03/19
	222	神奈川県公債	0.0600	100,000	99,710	2026/06/19
	168	共同発行地方	0.2100	100,000	100,051	2027/03/25
	29-6	千葉県公債	0.2450	100,000	99,989	2028/01/25
	11	名古屋市20年	2.1300	100,000	112,369	2029/12/14
	9	埼玉県20年	2.1500	100,000	112,943	2030/05/24
	11	兵庫県公債20年	1.8400	100,000	110,696	2030/08/16
	3-5	北海道公債	0.1400	100,000	97,322	2031/06/30
種別	銘柄数	-----	14銘柄	-----	-----	
小計	金額	-----	1,400,000	1,441,583	-----	
特殊債券 除く金融債券	65	地方公共団体	0.5350	100,000	100,669	2024/10/28
	241	政保道路機構	0.4500	100,000	100,900	2025/03/31
	261	政保道路機構	0.3810	100,000	100,932	2025/11/28
	127	都市再生	0.0750	100,000	99,315	2026/09/18
	80	住宅支援機構	1.5890	100,000	105,060	2026/09/18
	81	政保道路機構	2.1000	100,000	111,858	2029/05/31
	47	日本政策投資CO	1.0270	100,000	103,878	2029/09/20
種別	銘柄数	-----	7銘柄	-----	-----	
小計	金額	-----	700,000	722,617	-----	
普通社債券	32	東日本旅客鉄道	2.2600	100,000	102,781	2024/03/19
	25	西日本高速道	0.5240	100,000	100,650	2024/12/20
	497	関西電力	1.0020	100,000	101,709	2025/06/20
	14	セブアンドアイ	0.1900	100,000	99,661	2025/12/19
	20	成田国際空港	0.1050	100,000	99,368	2026/08/21
	17	パナソニック	0.4700	100,000	100,154	2026/09/18
	7	三井住友海上	0.1900	100,000	99,403	2026/11/13
	6	楽天カード	0.6200	100,000	95,907	2026/12/17
	80	三菱地所	2.3050	100,000	108,265	2027/03/19
	9	ソフトバンク	0.4800	100,000	98,340	2027/12/03
	65	東京瓦斯	0.2250	100,000	97,144	2030/09/10
	18	楽天グループ	1.0500	100,000	86,407	2031/12/02
	5	NTTファイナンス	0.4890	100,000	97,885	2032/09/17
種別	銘柄数	-----	13銘柄	-----	-----	
小計	金額	-----	1,300,000	1,287,679	-----	
合計	銘柄数	-----	292銘柄	-----	-----	
小計	金額	-----	41,953,000	41,909,497	-----	

(注) 単位未満は切捨て。

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)

■投資信託財産の構成

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	41,909,497	98.8
コール・ローン等、その他	506,960	1.2
投資信託財産総額	42,416,457	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	42,416,457,467円
コール・ローン等	430,711,043
公社債(評価額)	41,909,497,020
未収利息	73,960,289
前払費用	2,289,115
(B) 負債	139,468,714
未払金	135,408,450
未払解約金	4,060,264
(C) 純資産総額(A - B)	42,276,988,753
元本	34,135,552,866
次期繰越損益金	8,141,435,887
(D) 受益権総口数	34,135,552,866口
1万口当り基準価額(C/D)	12,385円

* 期首における元本額は28,295,749,520円、当作成期間中における追加設定元本額は6,672,798,337円、同解約元本額は832,994,991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)	1,509,919,138円
iFree 日本債券インデックス	3,696,009,628円
iFree 8資産バランス	4,700,707,358円
ダイワ・ライフ・バランス30	9,972,029,435円
ダイワ・ライフ・バランス50	6,944,671,544円
ダイワ・ライフ・バランス70	2,311,095,059円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	1,633,964,980円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	1,282,581,388円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	492,975,132円
ダイワつみたてインデックス日本債券	1,253,226,133円
ダイワつみたてインデックスバランス30	36,466,976円
ダイワつみたてインデックスバランス50	15,711,858円
ダイワつみたてインデックスバランス70	13,313,259円
ダイワ世界バランスファンド40VA	216,676,466円
ダイワ世界バランスファンド60VA	56,204,512円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,385円です。

■損益の状況

当期 自2021年12月1日 至2022年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	241,757,056円
受取利息	241,810,807
支払利息	△ 53,751
(B) 有価証券売買損益	△1,906,903,190
売買益	2,392,200
売買損	△1,909,295,390
(C) 当期損益金(A + B)	△1,665,146,134
(D) 前期繰越損益金	8,272,126,456
(E) 解約差損益金	△ 219,663,037
(F) 追加信託差損益金	1,754,118,602
(G) 合計(C + D + E + F)	8,141,435,887
次期繰越損益金(G)	8,141,435,887

(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證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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。

外国株式インデックス ファンド（FOFs用） （適格機関投資家専用）

運用報告書（全体版） 第5期

（決算日 2022年11月30日）

（作成対象期間 2021年12月1日～2022年11月30日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2018年9月18日）		
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国株式インデックスマザーファンドの受益証券	
	外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式（預託証券を含みません。）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	マザーファンドの株式組入上限比率	無制限	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (円ベース)(※配当なし)		株式組入率 比	株式先物率 比	投資信託証券 組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
1期末 (2018年11月30日)	円 9,537	円 0	% △ 4.6	9,507	% △ 4.9	95.1	% 2.3	% 2.6	百万円 1
2期末 (2019年12月2日)	10,653	0	11.7	10,400	9.4	90.5	6.7	2.7	23
3期末 (2020年11月30日)	11,652	0	9.4	11,193	7.6	93.3	4.7	2.3	68
4期末 (2021年11月30日)	15,930	0	36.7	15,078	34.7	91.4	6.5	2.2	150
5期末 (2022年11月30日)	16,705	0	4.9	15,550	3.1	89.7	8.1	2.2	291

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

(注6) 株式組入率は新株予約権証券を含みます。

(注7) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

*ベンチマークはMSCIコクサイ指数（円ベース）（※配当なし）です。

■ 基準価額・騰落率

期首：15,930円

期末：16,705円（分配金0円）

騰落率：4.9%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

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

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

年 月 日	基 準 価 額		M S C I コ ク サ イ 指 数 (円ベース)(※配当なし) (ベンチマーク)	騰 落 率	株 式 組 入 率 株 比	株 式 先 物 率 株 比	投 資 信 託 証 組 入 比	託 券 率 率
	円	%						
(期首) 2021年11月30日	15,930	—	15,078	—	91.4	6.5	2.2	
12月末	16,579	4.1	15,685	4.0	92.8	4.8	2.4	
2022年 1 月末	15,417	△3.2	14,576	△3.3	92.1	5.7	2.3	
2 月末	15,312	△3.9	14,468	△4.0	91.1	6.4	2.2	
3 月末	16,941	6.3	15,966	5.9	93.0	4.5	2.4	
4 月末	16,214	1.8	15,249	1.1	92.3	5.2	2.6	
5 月末	16,169	1.5	15,177	0.7	90.6	7.1	2.4	
6 月末	15,788	△0.9	14,799	△1.9	94.6	2.9	2.5	
7 月末	16,409	3.0	15,345	1.8	93.8	3.8	2.5	
8 月末	16,520	3.7	15,426	2.3	93.0	4.5	2.5	
9 月末	15,708	△1.4	14,629	△3.0	93.3	4.3	2.3	
10月末	17,211	8.0	16,039	6.4	92.1	5.7	2.2	
(期末) 2022年11月30日	16,705	4.9	15,550	3.1	89.7	8.1	2.2	

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021.12.1~2022.11.30)

■海外株式市況

海外株式市況は下落しました。

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

■為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると円安となりました。

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

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021.12.1～2022.11.30)

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

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

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

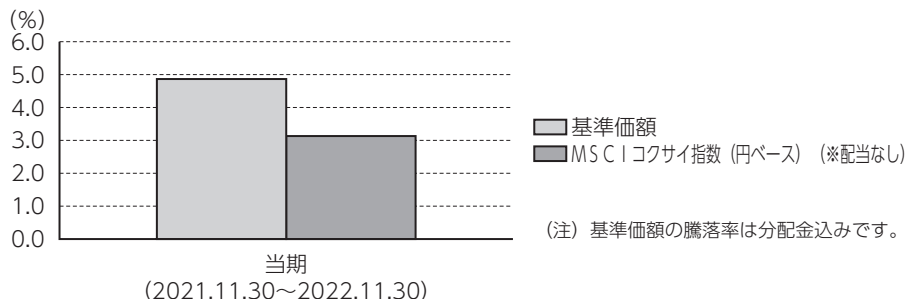
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は3.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.9%となりました。

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

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークはM S C I コクサイ指数（円ベース）（※配当なし）です。

分配金について

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

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年12月1日 ～2022年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	6,705

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2021.12.1~2022.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	23円	0.143%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は16,151円です。
(投 信 会 社)	(18)	(0.110)	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)	(2)	(0.011)	販売会社分は、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(4)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	1	0.003	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.002)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有 価 証 券 取 引 税	1	0.003	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0.003)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
そ の 他 費 用	4	0.025	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)	(0.018)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	28	0.175	

(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。

■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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックス マザーファンド	34,454	140,746	3,628	15,579

(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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

項 目	当 期
	外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	34,595,774千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	251,634,150千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.13

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックスマザーファンド	36,674	67,499	291,322	291,322

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックスマザーファンド	291,322	99.9
コール・ローン等、その他	262	0.1
投資信託財産総額	291,585	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=138.87円、1カナダ・ドル=102.16円、1オーストラリア・ドル=92.79円、1香港ドル=17.78円、1シンガポール・ドル=101.04円、1ニュージーランド・ドル=86.13円、1イギリス・ポンド=166.23円、1イスラエル・シェケル=40.334円、1スイス・フラン=145.67円、1デンマーク・クローネ=19.31円、1ノルウェー・クローネ=13.90円、1スウェーデン・クローネ=13.14円、1ユーロ=143.58円です。

(注3) 外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(281,426,799千円)の投資信託財産総額(299,342,893千円)に対する比率は、94.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	291,585,228円
コール・ローン等	228,629
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	291,322,499
未収入金	34,100
(B) 負債	188,573
未払信託報酬	181,670
その他未払費用	6,903
(C) 純資産総額(A - B)	291,396,655
元本	174,436,451
次期繰越損益金	116,960,204
(D) 受益権総口数	174,436,451口
1万口当り基準価額(C / D)	16,705円

* 期首における元本額は94,620,179円、当作成期間中における追加設定元本額は89,062,423円、同解約元本額は9,246,151円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は16,705円です。

■損益の状況

当期 自2021年12月1日 至2022年11月30日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	14,705,345円
売買益	15,488,320
売買損	△ 782,975
(B) 信託報酬等	△ 323,199
(C) 当期損益金(A + B)	14,382,146
(D) 前期繰越損益金	37,059,265
(E) 追加信託差損益金	65,518,793
(配当等相当額)	(56,380,709)
(売買損益相当額)	(9,138,084)
(F) 合計(C + D + E)	116,960,204
次期繰越損益金(F)	116,960,204
追加信託差損益金	65,518,793
(配当等相当額)	(56,380,709)
(売買損益相当額)	(9,138,084)
分派準備積立金	51,441,411

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	14,382,146
(c) 収益調整金	65,518,793
(d) 分配準備積立金	37,059,265
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	116,960,204
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	116,960,204
(h) 受益権総口数	174,436,451口

外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第23期（決算日 2022年11月30日）

（作成対象期間 2021年12月1日～2022年11月30日）

外国株式インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

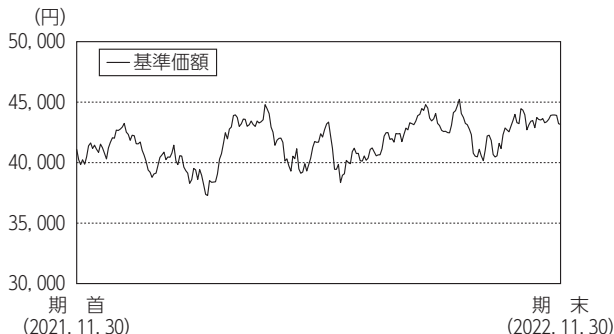
運用方針	投資成果をMSCIコクサイ指数（円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行うことを基本とします。
主要投資対象	外国の株式（預託証券を含みます。）
株式組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■ 当作成期中の基準価額と市況等の推移



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

- (注1) 騰落率は期首比。
 (注2) MSCIコクサイ指数 (円ベース) は、MSCI Inc. (「MSCI」) の承諾を得て、MSCIコクサイ指数 (米ドルベース) をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIコクサイ指数 (米ドルベース) は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。本ファンドは、MSCIによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、MSCIは本ファンドまたは本ファンドが基づいているインデックスに関していかなる責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html]
 (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
 (注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
 (注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。
 (注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆ 基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：41,095円 期末：43,159円 騰落率：5.0%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆ 投資環境について

○ 海外株式市況

海外株式市況は下落しました。

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

○ 為替相場

為替相場は、当作成期を通じて見ると円安となりました。

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

◆ 前作成期末期における「今後の運用方針」

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

◆ ポートフォリオについて

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

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

◆ ベンチマークとの差異について

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

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

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

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

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
外	アメリカ 百株 (18,307.53 9,749.5)	千アメリカ・ドル 195,541 (△ 4,778)	百株 1,458.49	千アメリカ・ドル 5,071
	カナダ 百株 (2,299.5 657.87)	千カナダ・ドル 12,730 (905)	百株 907	千カナダ・ドル 1,126
	オーストラリア 百株 (2,617.26 851.24)	千オーストラリア・ドル 6,224 (1,733)	百株 1,112.63	千オーストラリア・ドル 299
	香港 百株 (2,753 —)	千香港・ドル 12,780 (△ 18)	百株 1,250	千香港・ドル 767
	シンガポール 百株 (1,313 —)	千シンガポール・ドル 939 (△ 2)	百株 —	千シンガポール・ドル —
	ニュージーランド 百株 (215.54 —)	千ニュージーランド・ドル 145 (—)	百株 427	千ニュージーランド・ドル 324
	イギリス 百株 (10,671.3 1,248.66)	千イギリス・ポンド 7,209 (△ 1,865)	百株 639.83	千イギリス・ポンド 201
	イスラエル 百株 (1,255.35 —)	千イスラエル・シェケル 2,644 (—)	百株 —	千イスラエル・シェケル —
	スイス 百株 (789.93 1,101.29)	千スイス・フラン 6,994 (△ 429)	百株 60.4	千スイス・フラン 437
	デンマーク 百株 (203.22 —)	千デンマーク・クローネ 9,647 (—)	百株 63	千デンマーク・クローネ 597
ノルウェー 百株 (424.03 —)	千ノルウェー・クローネ 11,025 (—)	百株 64.5	千ノルウェー・クローネ 1,184	

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
外	スウェーデン 百株 (2,658.82 2,558.7)	千スウェーデン・クローネ 45,330 (△ 2,067)	百株 1,402.4	千スウェーデン・クローネ 4,824
	ユーロ (アイルランド) 百株 (59.02 —)	千ユーロ 369 (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (オランダ) 百株 (1,013.58 75.2)	千ユーロ 4,446 (—)	百株 140.93	千ユーロ 437
	ユーロ (ベルギー) 百株 (137.18 12)	千ユーロ 839 (—)	百株 32	千ユーロ 60
	ユーロ (ルクセンブルグ) 百株 (89.54 —)	千ユーロ 112 (—)	百株 70	千ユーロ 44
	ユーロ (フランス) 百株 (1,154.37 440.54)	千ユーロ 6,383 (△ 18)	百株 554.61	千ユーロ 838
	ユーロ (ドイツ) 百株 (1,331.42 156.75)	千ユーロ 5,861 (△ 100)	百株 105	千ユーロ 252
	ユーロ (ポルトガル) 百株 (165.62 —)	千ユーロ 142 (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (スペイン) 百株 (1,831.51 8,854.93)	千ユーロ 1,629 (185)	百株 8,854.93	千ユーロ 183
	ユーロ (イタリア) 百株 (1,950.08 —)	千ユーロ 1,080 (△ 1)	百株 2,039.5	千ユーロ 87
国	ユーロ (フィンランド) 百株 (396.63 —)	千ユーロ 548 (—)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (オーストリア) 百株 (42.06 —)	千ユーロ 176 (—)	百株 52.5	千ユーロ 64
	ユーロ (ユーロ通貨計) 百株 (8,171.01 9,539.42)	千ユーロ 21,590 (64)	百株 11,849.47	千ユーロ 1,970

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

(2) 投資信託証券

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
外	千口 163.98 (△ 62.048)	千アメリカ・ドル 8,569 (—)	千口 27.9 (—)	千アメリカ・ドル 471 (—)
	千口 0.5 (—)	千カナダ・ドル 24 (—)	千口 — (—)	千カナダ・ドル — (—)
	千口 98.566 (△ 45.8)	千オーストラリア・ドル 771 (△ 377)	千口 — (—)	千オーストラリア・ドル — (—)
	千口 49.3 (—)	千香港・ドル 992 (—)	千口 — (—)	千香港・ドル — (—)
	千口 99.5 2.559	千シンガポール・ドル 208 (△ 5)	千口 2.559 (—)	千シンガポール・ドル 3 (—)
	千口 15.774 (—)	千イギリス・ポンド 131 (—)	千口 — (—)	千イギリス・ポンド — (—)
国	千口 6.192 (—)	千ユーロ 212 (—)	千口 — (—)	千ユーロ — (—)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
外	千口 1.844 (—)	千ユーロ 71 (△ 12)	千口 — (—)	千ユーロ — (—)
国	千口 8.036 (—)	千ユーロ 284 (△ 12)	千口 — (—)	千ユーロ — (—)

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額 百万円	決 済 額 百万円	新規売付額 百万円	決 済 額 百万円
外国 株式先物取引	83,041	76,593	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

銘 柄	当 期			銘 柄	期 付		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
APPLE INC (アメリカ)	64.4	1,313,713	20,399	ORACLE CORP (アメリカ)	6	62,614	10,435
MICROSOFT CORP (アメリカ)	34.5	1,285,473	37,260	CANADIAN NATL RAILWAY CO (カナダ)	3.4	56,181	16,523
AMAZON.COM INC (アメリカ)	9.69	902,160	93,102	AVALARA INC (アメリカ)	3.65	50,471	13,827
TESLA INC (アメリカ)	8.43	768,572	91,171	ORRON ENERGY (スウェーデン)	8.05	43,607	5,417
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	6.29	493,688	78,487	VIFOR PHARMA AG (スイス)	1.75	41,510	23,720
NVIDIA CORP (アメリカ)	13.2	381,021	28,865	CHEVRON CORP (アメリカ)	1.8	41,196	22,886
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	4.15	356,434	85,887	EXOR NV (オランダ)	4.273	39,435	9,228
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	13.4	290,054	21,645	AUTOLIV INC (アメリカ)	2.95	32,702	11,085
UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)	4.55	283,968	62,410	LAMB WESTON HOLDINGS INC (アメリカ)	5.45	32,540	5,970
SEA LTD-ADR (ケイマン諸島)	12.8	251,762	19,668	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD (バミューダ)	1.83	32,435	17,724

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
(アメリカ)					
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	42.5	49	699	97,183	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	35.1	123	2,097	291,248	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	67.5	75	1,298	180,298	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	47.5	54	572	79,541	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	21.5	26	404	56,199	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	211	211	786	109,236	金融
ABBOTT LABORATORIES	643.66	723.66	7,598	1,055,193	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	141.33	155.83	579	80,544	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	56.5	65	1,150	159,706	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	126.5	139	620	86,206	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	216	247	1,911	265,488	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	16.1	18	638	88,725	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	225.62	253	1,708	237,260	情報技術
QORVO INC	40.7	44.2	415	57,685	情報技術
AFLAC INC	236	253	1,793	249,030	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	48	51	739	102,666	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	60.5	71	498	69,225	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	173.2	195.2	6,378	885,816	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	76.5	86	915	127,071	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	45.3	48	1,743	242,180	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	56.5	63	565	78,573	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	79.5	92	2,780	386,066	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	251.5	282	6,111	848,704	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	52.75	86.42	648	90,056	金融
AUTOZONE INC	8.2	8.2	2,095	291,066	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	83.21	92.71	1,358	188,613	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	419	478	414	57,551	ヘルスケア
PINNACLE WEST CAPITAL	41	—	—	—	公益事業
CELANESE CORP	41.5	44.5	469	65,226	素材
DR HORTON INC	125.66	138.16	1,163	161,586	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	79.5	89	268	37,337	ヘルスケア
AUTODESK INC	80.2	90	1,756	243,941	情報技術
MOODY'S CORP	61.6	69	1,997	277,428	金融
DEVON ENERGY CORP	233	259	1,748	242,779	エネルギー
ALBEMARLE CORP	43.1	48	1,296	179,988	素材
ATMOS ENERGY CORP	48.5	58	688	95,558	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	90.5	102	561	78,005	公益事業
CITIGROUP INC	748.73	804.73	3,828	531,608	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	155	174	4,472	621,143	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	183	213	2,016	279,968	公益事業
ALLEGHANY CORP	4.8	—	—	—	金融
DOMINO'S PIZZA INC	14.3	15.3	586	81,389	一般消費財・サービス
HESS CORP	102	116	1,646	228,714	エネルギー
DAVITA INC	27.5	27.5	197	27,362	ヘルスケア
DANAHER CORP	232.5	286.5	7,420	1,030,543	ヘルスケア
FORTIVE CORP	117	141	924	128,449	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	205.5	231	2,433	337,919	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	201.5	233	2,247	312,080	生活必需品
BUNGE LTD	51	63	656	91,127	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	119.25	131.95	1,635	227,106	情報技術

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
APPLE INC	6,056	6,700	94,583	13,134,866	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	110.5	116	1,259	174,862	金融
BOEING CO/THE	201.3	233	4,084	567,277	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	55.65	62.15	672	93,324	金融
BECTON DICKINSON AND CO	106.19	117.99	2,843	394,917	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	76	—	—	—	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	49	54	585	81,363	資本財・サービス
NISOURCE INC	139	165	449	62,393	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	49	53	517	71,834	資本財・サービス
BOSTON BEER COMPANY INC-A	3.2	—	—	—	生活必需品
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	300.71	317.71	1,424	197,835	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,502.04	1,737.04	6,659	924,848	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	488.5	532.5	16,780	2,330,331	金融
ANSYS INC	32	36	866	120,298	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	490.67	551.17	2,530	351,399	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	249.5	290	2,558	355,241	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	810	883	6,978	969,083	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	1,097.7	1,214.7	16,587	2,303,567	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	83	93	1,120	155,624	金融
LKQ CORP	102.5	111	587	81,589	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	18.3	—	—	—	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	114.12	128.12	911	126,536	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	100.5	114	1,864	258,871	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	42.2	45	1,460	202,772	金融
DOLLAR GENERAL CORP	88.5	94	2,376	330,064	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	71.5	83	3,293	457,417	情報技術
CATERPILLAR INC	198.5	221	5,196	721,589	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	85.5	97	556	77,266	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	83	103	484	67,298	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	18	21	502	69,844	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	106.5	120	722	100,319	公益事業
MOSAIC CO/THE	128	149	755	104,968	素材
DELTA AIR LINES INC	57.5	62	214	29,799	資本財・サービス
CORNING INC	294	332	1,109	154,036	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,529.5	1,713.5	8,272	1,148,840	情報技術
MORGAN STANLEY	506.52	541.52	4,932	684,929	金融
ZILLOW GROUP INC - A	21	—	—	—	不動産
MSCI INC	30	34	1,653	229,619	金融
FAIR ISAAC CORP	10	11	649	90,239	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	12	13	339	47,087	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	85	94	485	67,396	情報技術
BROADCOM INC	148.12	167.12	8,713	1,210,039	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	43.5	50	1,023	142,195	ヘルスケア
ARAMARK	85	96	389	54,085	一般消費財・サービス
DTE ENERGY COMPANY	71.7	79	901	125,208	公益事業
CENTENE CORP	213.87	242.07	2,043	283,788	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	39.5	44	542	75,309	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	157	202	844	117,228	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	75	87	1,702	236,414	金融
GARTNER INC	31.5	33.5	1,139	158,210	情報技術
SPLUNK INC	60.1	67	508	70,610	情報技術
DOMINION ENERGY INC	294.41	335.41	2,004	278,399	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	143	164	1,636	227,268	生活必需品

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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	
SMITH (A. O.) CORP	50	53	320	44,521	資本財・サービス
DEERE & CO	108	120	5,291	734,850	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC	—	60	867	120,441	資本財・サービス
POOL CORP	14.8	17	545	75,722	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	106.84	116.84	1,166	161,979	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	74.8	87	1,026	142,600	情報技術
CABLE ONE INC	2	2	143	19,996	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	24	27	519	72,173	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	42	143	945	131,264	金融
VAIL RESORTS INC	14.9	17	435	60,507	一般消費財・サービス
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	184	209	155	21,564	コミュニケーション・サービス
TARGA RESOURCES CORP	—	90	663	92,137	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	26.3	30	419	58,308	金融
WESTLAKE CORP	—	16	171	23,812	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	126	147	1,415	196,585	公益事業
COGNEX CORP	65	69	329	45,754	情報技術
WEBSTER FINANCIAL CORP	—	73	389	54,134	金融
TELEFLEX INC	17.2	19	429	59,670	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	30.5	35	629	87,405	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	27.1	31	692	96,216	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	7.9	9	359	49,936	ヘルスケア
CATALENT INC	62	69	325	45,208	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	50.5	58	1,058	146,945	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	21.2	24	774	107,558	ヘルスケア
CARLISLE COS INC	—	22	562	78,067	資本財・サービス
IDEX CORP	27.6	31	716	99,470	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	293.5	329	2,499	347,093	生活必需品
ROLLINS INC	80.87	92.07	366	50,925	資本財・サービス
AMETEK INC	84.45	96	1,334	185,321	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	89	100	794	110,387	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	55.5	64.5	353	49,076	資本財・サービス
HEICO CORP	16	18	281	39,137	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	23.2	26	261	36,344	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	14	16	718	99,790	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	97	108	916	127,242	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	15	17	551	76,525	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	160.6	182.6	9,658	1,341,318	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	28	32.5	184	25,689	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	20	24	825	114,631	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	46	53	538	74,830	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	10	12	1,863	258,751	一般消費財・サービス
UGI CORP	76.5	85	321	44,666	公益事業
CUMMINS INC	53.5	58	1,429	198,478	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	283.5	323	2,401	333,452	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	51	56	1,030	143,153	情報技術
SIGNATURE BANK	—	26.5	359	49,894	金融
COSTAR GROUP INC	145	164	1,283	178,211	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	20.2	24	525	73,033	金融
AMERCO	3.7	—	—	—	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	36.4	40	1,168	162,239	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	16.1	18.9	1,680	233,399	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	27.6	30	557	77,447	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	100.16	115.16	1,597	221,892	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	14.2	—	—	—	情報技術

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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	
DEXCOM INC	35.4	162	1,788	248,343	ヘルスケア
NORDSON CORP	19.1	20.9	482	66,986	資本財・サービス
COPART INC	78.3	174	1,121	155,708	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	70	1,027	142,644	エネルギー
SEAGEN INC	49.5	57	669	92,905	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	27.1	31	594	82,582	ヘルスケア
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	—	33	791	109,943	金融
TRANSDIGM GROUP INC	18.9	20.9	1,274	177,010	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	14	15.8	516	71,763	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	33.5	39	474	65,933	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	77.5	90	708	98,436	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	733.81	843.81	1,593	221,235	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	98	98	2,310	320,919	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	14	16	409	56,898	金融
COTERRA ENERGY INC	290	330	926	128,636	エネルギー
T-MOBILE US INC	226.77	259.27	3,853	535,103	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	59.5	67.5	238	33,098	不動産
COCA-COLA CO/THE	1,486.5	1,704.5	10,649	1,478,926	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	73.5	88	453	63,021	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	61.5	69.5	789	109,602	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	111.5	124	326	45,288	金融
CSX CORP	821	899	2,892	401,623	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	34.6	38	911	126,533	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	51.75	63.25	647	89,987	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	29.5	—	—	—	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	164.7	3,788	35,008	4,861,657	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	226.9	257	1,923	267,136	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,536.05	1,742.05	19,256	2,674,166	エネルギー
AES CORP	246	271	765	106,353	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	15	16	532	73,945	金融
EOG RESOURCES INC	210	242	3,419	474,826	エネルギー
EQT CORP	—	141	601	83,531	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	60	65	591	82,168	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	—	5	399	55,521	金融
ABIOMED INC	16.1	19	716	99,559	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	56.8	65	1,091	151,555	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	111.7	124	1,871	259,916	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1,433.23	1,634.23	2,247	312,050	一般消費財・サービス
NOVAVAX INC	26	—	—	—	ヘルスケア
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	62.9	—	—	—	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	62.5	71	292	40,612	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	56.37	62.37	122	17,080	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	8.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス
ENTEGRIS INC	—	62	448	62,327	情報技術
DISCOVERY INC-C	113.89	—	—	—	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	—	56	337	46,846	資本財・サービス
FORTINET INC	50.5	282	1,454	202,033	情報技術
MARKEL CORP	5.1	5.5	709	98,574	金融
NEXTERA ENERGY INC	711.8	812.8	6,704	931,093	公益事業
MASIMO CORP	19.2	22	309	42,970	ヘルスケア
FREEMPORT-MCMORAN INC	536.08	599.08	2,247	312,061	素材
INSULET CORP	24.4	29	836	116,209	ヘルスケア
US BANCORP	512	584	2,604	361,625	金融
UNITED RENTALS INC	25.7	30	1,028	142,784	資本財・サービス

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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	
F5 NETWORKS INC	22.5	25	374	52,013	情報技術
FASTENAL CO	210.5	238	1,196	166,147	資本財・サービス
FISERV INC	219.33	254.33	2,581	358,556	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	398.56	455.06	3,898	541,321	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	476.5	573	2,277	316,300	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	43.7	—	—	—	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	87.5	98	2,461	341,891	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	123.5	142.5	5,467	759,322	金融
ALPHABET INC-CL A	109	2,488	23,683	3,288,895	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	105.57	2,333.4	22,269	3,092,630	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	39	39	349	48,542	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	220.5	249	2,062	286,449	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	197.68	224.18	892	123,904	公益事業
GENUINE PARTS CO	51	59.5	1,074	149,184	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	138.84	—	—	—	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	259	284	1,022	141,980	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	75.5	80.5	1,816	252,210	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	326	373	1,386	192,483	エネルギー
HOME DEPOT INC	385.5	425.5	13,444	1,866,981	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	22.5	22.5	284	39,491	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	529	595	910	126,420	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	15.1	17.1	389	54,147	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	53.9	60	1,382	192,048	生活必需品
HUMANA INC	47.2	52	2,772	384,993	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	101	109	1,795	249,288	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	28.2	33.2	116	16,178	情報技術
HENRY SCHEIN INC	51	56	451	62,680	ヘルスケア
HP INC	473	473	1,366	189,699	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	476	538	831	115,504	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	59.78	68.28	292	40,668	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	70	79	467	64,880	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	29.5	29.5	127	17,644	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	144	154	908	126,134	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	243.03	304.03	1,186	164,829	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	46.9	56	1,698	235,937	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	324	372	5,449	756,762	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	137.5	143	519	72,145	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	49	52	341	47,472	資本財・サービス
ZOETIS INC	173	195	2,883	400,372	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	87.79	96.99	1,697	235,694	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	88.5	95	1,640	227,771	エネルギー
ALLEGION PLC	33	36.5	404	56,146	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	129.73	129.73	265	36,859	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	94.87	106.37	1,497	208,013	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	122	134	427	59,305	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	40.5	44	666	92,582	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	955	1,089	19,176	2,662,999	ヘルスケア
PLUG POWER INC	186	211	314	43,659	資本財・サービス
ABBVIE INC	640.72	730.72	11,559	1,605,335	ヘルスケア
HOLOGIC INC	91.5	101	751	104,310	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	122	139	1,850	257,037	生活必需品
KROGER CO	264	286	1,411	196,002	生活必需品
KLA CORP	55.6	62	2,320	322,295	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	90.3	99	4,792	665,546	資本財・サービス

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	29.3	31	589	81,880	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	97	105	417	58,019	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	260	272	5,643	783,668	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	295.35	333.85	12,150	1,687,335	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	52	56.8	2,510	348,680	情報技術
LOEWS CORP	83	86	496	69,005	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	66.49	66.49	253	35,170	金融
MCDONALD'S CORP	270.5	306.5	8,318	1,155,220	一般消費財・サービス
3M CO	210.4	234.9	2,962	411,443	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	869	948	10,376	1,441,027	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	87.7	144.39	5,012	696,065	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	23.1	26	929	129,094	素材
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	19.2	23.2	674	93,705	情報技術
ALCOA CORP	—	77	367	51,005	素材
PHILLIPS 66	157.5	199	2,168	301,140	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	160.5	160.5	575	79,927	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	92	104	871	120,955	生活必需品
METLIFE INC	270	284	2,160	300,013	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	299.5	352	1,510	209,753	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	84.8	102	1,363	189,396	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	48	—	—	—	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	62.28	68.98	1,824	253,332	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	8.5	9	1,270	176,502	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	265.23	408.23	1,169	162,419	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	41.9	48	1,246	173,063	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	918.21	1,046.21	11,386	1,581,305	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	207.51	207.51	1,441	200,162	素材
MASCO CORP	91	98	488	67,869	資本財・サービス
M & T BANK CORP	46.89	73.99	1,264	175,620	金融
MARSH & MCLENNAN COS	185.2	207.7	3,503	486,528	金融
BLACK KNIGHT INC	56	63.5	385	53,570	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	27.2	30.2	369	51,345	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	101.72	115.02	1,854	257,577	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	69	82	1,175	163,180	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	27.1	29	91	12,754	一般消費財・サービス
BLOCK INC CLASS A	142	215.12	1,336	185,545	情報技術
TRANSUNION	69	80	483	67,168	資本財・サービス
VISTRA CORP	156.5	176	426	59,220	公益事業
NOVOCURE LTD	34.5	38.5	287	39,927	ヘルスケア
NETAPP INC	82	92	660	91,719	情報技術
NIKE INC -CL B	462	525	5,578	774,634	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	90.5	99	2,508	348,322	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	201	229	1,699	236,028	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	68.55	81.05	935	129,853	金融
ALLY FINANCIAL INC	136.5	142	376	52,276	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	57.1	61	3,222	447,568	資本財・サービス
APTIV PLC	97.5	112	1,141	158,458	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	293.11	328.11	1,501	208,503	素材
MCKESSON CORP	57.5	61	2,328	323,408	ヘルスケア
XYLEM INC	66.7	73	802	111,390	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	565	641	6,268	870,484	生活必需品
NUCOR CORP	109.5	111	1,631	226,578	素材
SUNRUN INC	61	—	—	—	資本財・サービス
WESTERN UNION CO	152.46	152.46	220	30,636	情報技術

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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	
GODADDY INC - CLASS A	60	68	510	70,889	情報技術
NEWELL BRANDS INC	134.42	164.42	211	29,386	一般消費財・サービス
EVERGY INC	82.5	93.5	542	75,400	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	343.24	388.24	2,683	372,605	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	9	11.5	309	42,997	金融
OKTA INC	45.1	62	317	44,125	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	25.5	29	178	24,751	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	56	56	500	69,547	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	157.55	173.05	211	29,438	ヘルスケア
LINDE PLC	188.46	208.46	6,920	961,014	素材
WIX.COM LTD	21.3	23.1	195	27,122	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	143	158	487	67,667	金融
KKR & CO INC	188	233	1,177	163,563	金融
PAYCHEX INC	117	134	1,610	223,582	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	24.8	27	2,294	318,605	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	667	749	3,431	476,590	生活必需品
P G & E CORP	551	617	935	129,980	公益事業
PFIZER INC	2,031.13	2,321.13	11,487	1,595,237	ヘルスケア
CIGNA CORP	126.2	131	4,201	583,416	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	101.01	118.01	513	71,320	情報技術
ALTICE USA INC- A	109	—	—	—	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	197	225	1,549	215,126	公益事業
STERIS PLC	36	41	731	101,569	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	27	155	841	116,793	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	54.33	60.33	180	25,083	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	121.99	127.99	405	56,379	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	123.3	140.8	3,198	444,241	ヘルスケア
LYFT INC-A	92	125	134	18,678	資本財・サービス
DOW INC	273.68	301.18	1,525	211,842	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	38.5	45	263	36,576	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	77.4	94	663	92,120	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	46.6	53	1,559	216,600	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	445	609	1,690	234,771	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	84.5	95	2,287	317,652	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	886.67	992.67	14,441	2,005,472	生活必需品
EXELON CORP	357.72	405.22	1,620	225,091	公益事業
TELADOC HEALTH INC	51	65	176	24,489	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	147.08	168.08	887	123,288	資本財・サービス
NVR INC	1.2	1.3	592	82,284	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	492.02	535.02	6,647	923,155	エネルギー
TWILIO INC - A	59.5	70	320	44,473	情報技術
DOCUSIGN INC	71	83	369	51,360	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	18.9	21	676	93,898	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	50	57	365	50,746	情報技術
PEPSICO INC	501	572	10,444	1,450,378	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	15	18.2	274	38,136	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	114	121	272	37,874	情報技術
MONGODB INC	20.2	28	398	55,331	情報技術
SNAP INC - A	347.5	458	449	62,457	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	269.18	298.68	1,958	271,969	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	143	155	1,652	229,433	金融
AMCOR PLC	564	614	743	103,257	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	69	84	1,159	160,978	情報技術
ROKU INC	42.2	48	260	36,115	コミュニケーション・サービス

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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		
AMERICAN WATER WORKS CO INC	65.5	75	1,103	153,249	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	230.5	262	7,545	1,047,784	情報技術
10X GENOMICS INC-CLASS A	27.5	—	—	—	ヘルスケア
PENTAIR PLC	59.25	66.75	298	41,416	資本財・サービス
QUALCOMM INC	408.5	463	5,480	761,145	情報技術
INVESCO LTD	141	141	265	36,889	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	23.5	25.5	377	52,384	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	100	106	952	132,246	金融
DATADOG INC - CLASS A	68	100	720	100,069	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	199	238	571	79,322	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	30.5	—	—	—	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	38	45	3,312	459,987	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	82.5	91	1,243	172,686	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	15	17	3,429	476,209	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	131	145	1,693	235,170	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	34.5	38.3	508	70,574	素材
RESMED INC	53.3	61	1,361	189,074	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	47.3	49.3	734	102,016	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	41.5	45	342	47,624	資本財・サービス
MODERNA INC	123.7	139	2,406	334,230	ヘルスケア
HUBSPOT INC	15.9	18.8	531	73,800	情報技術
PERKINELMER INC	41.3	51	681	94,655	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	302.37	350.87	1,526	212,052	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	149.38	175.38	1,348	187,241	資本財・サービス
BILL.COM HOLDINGS INC	—	39	447	62,104	情報技術
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	63	—	—	—	金融
AVANTOR INC	193.5	248	528	73,391	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	57	80	239	33,195	金融
DYNATRACE INC	67	81	294	40,933	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	158.2	183	891	123,736	コミュニケーション・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	351.85	386.85	886	123,076	金融
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	—	110	291	40,526	コミュニケーション・サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	65.5	144	620	86,128	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	28.8	32.3	156	21,795	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	93.7	116	543	75,518	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	701.18	772.18	13,978	1,941,232	エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A	94	—	—	—	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	30	35	471	65,543	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	140	158	1,003	139,350	公益事業
ETSY INC	46.5	52	633	88,012	一般消費財・サービス
TESLA INC	296.2	1,091.5	19,737	2,740,959	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	70	92	1,256	174,469	情報技術
GEN DIGITAL INC	214	236	533	74,133	情報技術
DRAFTKINGS INC - CL A	117	—	—	—	一般消費財・サービス
UNITY SOFTWARE INC	21	79	284	39,516	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	58.52	66.02	531	73,813	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	55.8	63	2,039	283,163	情報技術
CARVANA CO	26.2	—	—	—	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	32.5	39.5	158	22,051	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	85	105	468	65,047	情報技術
PPD INC	44	—	—	—	ヘルスケア
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	47.85	49.05	1,889	262,436	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	433.21	490.21	548	76,108	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	27	78.5	418	58,147	一般消費財・サービス

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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	
ROBLOX CORP -CLASS A	—	146	435	60,480	コミュニケーション・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	46	156	1,487	206,628	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	121.5	136	1,039	144,404	不動産
TWITTER INC	292	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	386.5	440	2,892	401,628	公益事業
SYSCO CORP	187.5	211	1,795	249,327	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	91.03	99.03	1,853	257,456	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	20	25	146	20,309	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	43	46	282	39,209	金融
STEEL DYNAMICS INC	76.5	78.5	805	111,890	素材
SCHLUMBERGER LTD	503.52	584.52	2,983	414,384	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	58.5	62	272	37,883	資本財・サービス
AFFIRM HOLDINGS INC	—	77	98	13,697	情報技術
AT&T INC	2,589.91	2,961.91	5,630	781,920	コミュニケーション・サービス
APA CORP	—	144	670	93,167	エネルギー
SOUTHWEST AIRLINES CO	55.5	60.5	237	32,976	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	155	180	1,272	176,775	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	75	87	425	59,043	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	91.7	102	2,464	342,177	素材
SEMPRA ENERGY	114	130	2,097	291,232	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	65	78	292	40,619	情報技術
CLARIVATE PLC	125	134	122	17,064	資本財・サービス
OAK STREET HEALTH INC	36	—	—	—	ヘルスケア
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	560	685	484	67,349	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	79.5	84.5	434	60,374	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	—	49	211	29,334	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC	335	381	6,590	915,228	情報技術
SALESFORCE.COM INC	352.16	410.66	6,228	865,006	情報技術
WESTROCK CO	98.8	107	392	54,562	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	—	166.09	1,093	151,882	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	259.34	288.34	1,885	261,873	資本財・サービス
TERADYNE INC	60.5	66	588	81,746	情報技術
UNION PACIFIC CORP	240.8	259.8	5,527	767,640	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	—	299	907	126,019	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	234.88	239.88	2,961	411,304	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	549.29	614.79	5,989	831,817	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	262	304	5,620	780,540	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	70.44	78.04	1,658	230,295	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	43.5	—	—	—	金融
AMEREN CORPORATION	92	107	933	129,630	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	342.16	387.66	20,468	2,842,453	ヘルスケア
APPLOVIN CORP CLASS A	—	49	65	9,145	情報技術
VERISIGN INC	37	41	799	111,003	情報技術
LUCID GROUP INC	—	168	163	22,770	一般消費財・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	—	132	380	52,884	一般消費財・サービス
VALERO ENERGY CORP	147.92	169.42	2,290	318,089	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	18.9	22	989	137,444	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	98.88	108.88	430	59,830	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	28.3	28.3	369	51,306	ヘルスケア
ELEVANCE HEALTH INC	89.2	100	5,153	715,680	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	658.62	752.62	7,126	989,665	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,499.22	1,567.22	7,455	1,035,312	金融
WASTE MANAGEMENT INC	152	172	2,839	394,304	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	438	504	1,729	240,207	エネルギー

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	42.5	46	1,007	139,904	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	23.2	24	350	48,653	一般消費財・サービス
WALMART INC	561	626	9,575	1,329,808	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	76.5	87	1,035	143,772	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	37	45	361	50,174	一般消費財・サービス
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	—	559	158	21,968	資本財・サービス
WABTEC CORP	65.11	71.11	701	97,466	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	438	484	3,879	538,780	一般消費財・サービス
WATERS CORP	22.3	25	825	114,623	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	18.9	22	587	81,517	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	265	304	1,248	173,425	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	47.43	48.63	1,159	161,064	金融
WESTERN DIGITAL CORP	112.5	127	457	63,544	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	114.3	130	1,260	175,078	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	182.5	204	1,189	165,132	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	612.5	681.5	14,247	1,978,541	情報技術
PPL CORP	279	304	882	122,512	公益事業
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	—	135.24	1,277	177,346	公益事業
PULTEGROUP INC	94.5	98.5	434	60,309	一般消費財・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	—	954.53	1,063	147,666	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC	85.3	98	1,291	179,410	素材
NORTHERN TRUST CORP	73	82	752	104,490	金融
NVIDIA CORP	903.8	1,035.8	16,198	2,249,537	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	154.63	171.13	2,812	390,622	金融
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	—	35	74	10,411	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	108.5	121	804	111,657	生活必需品
NETFLIX INC	160.7	183.9	5,166	717,521	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	142.4	162	8,743	1,214,272	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	86.5	98.5	412	57,327	公益事業
GLOBE LIFE INC	36.55	38.55	452	62,795	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	64.5	74	899	124,929	金融
TEXTRON INC	83	89	625	86,923	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	141.37	152.87	283	39,401	コミュニケーション・サービス
TEXAS PACIFIC LAND CORP	—	2.5	626	87,015	エネルギー
OMNICOM GROUP	79.5	83	653	90,780	コミュニケーション・サービス
JACOBS SOLUTIONS INC	—	52.2	640	88,996	資本財・サービス
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC CLA	—	209	21	3,047	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	681.33	662.33	5,354	743,640	情報技術
MASTERCARD INC - A	320.5	359	12,318	1,710,651	情報技術
ONEOK INC	164	185	1,200	166,759	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	347.52	373.52	204	28,373	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	38	44	1,871	259,839	情報技術
AMERCO NON VOTING SERIES N	—	36	216	30,085	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	108.5	117	1,474	204,787	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	42.5	66	668	92,891	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	69.5	74	406	56,437	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	2,794.01	2,999.01	11,096	1,540,948	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	17.2	19	776	107,857	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	67.5	77	747	103,850	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	247.5	265	4,092	568,274	金融
ANALOG DEVICES INC	193.91	214.91	3,522	489,122	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	441.5	670.27	4,919	683,117	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	311.72	329.72	2,025	281,322	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	59.5	66	595	82,736	情報技術

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	84.5	93	557	77,399	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	30.3	34.3	646	89,748	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	191.5	216	1,287	178,835	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	215.5	246	2,320	322,182	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	82.4	88	2,664	369,953	金融
AMGEN INC	208.5	226	6,372	885,014	ヘルスケア
EATON CORP PLC	145.86	165.36	2,681	372,353	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	62.5	67	1,699	235,994	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	332.5	360	3,717	516,179	情報技術
CME GROUP INC	131.2	149	2,604	361,710	金融
ECOLAB INC	94	106	1,536	213,310	素材
EQUIFAX INC	44.3	51	963	133,800	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	456.5	519	4,450	618,102	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	255	323	1,230	170,897	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	105.5	124	597	82,982	生活必需品
STATE STREET CORP	124.63	152.13	1,124	156,186	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	525.4	601.4	4,834	671,388	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	182	208	1,151	159,849	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	70	86	452	62,843	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	49.8	49.8	399	55,484	素材
CARDINAL HEALTH INC	104	113	888	123,420	ヘルスケア
FEDEX CORP	92	102	1,813	251,877	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	165.04	167.54	1,710	237,502	金融
FMC CORP	46.5	51.5	657	91,335	素材
CERNER CORP	108.5	—	—	—	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	90.13	105.13	1,076	149,497	素材
CITRIX SYSTEMS INC	46	—	—	—	情報技術
INTEL CORP	1,465	1,692	4,889	679,057	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	142	160	548	76,234	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	131.5	134.5	1,019	141,635	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	115.5	129	2,894	401,941	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	386	386	247	34,360	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	53.3	65	1,355	188,266	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	54	58	301	41,907	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	128.7	149	3,856	535,499	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	43.5	43.5	569	79,153	情報技術
SNAP-ON INC	20.2	22	526	73,072	資本財・サービス
CARMAX INC	58	66	442	61,518	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP	280.28	318.28	3,117	432,890	公益事業
TARGET CORP	179.5	194	3,227	448,213	一般消費財・サービス
DOVER CORP	52	60	836	116,125	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	15.8	19	1,122	155,934	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	47.2	—	—	—	資本財・サービス
CINTAS CORP	34.2	38	1,712	237,831	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	173	199	735	102,139	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	54.5	—	—	—	生活必需品
CLOROX COMPANY	44.3	51	751	104,415	生活必需品
ENTERGY CORP	74.2	84	947	131,593	公益事業
MICROSOFT CORP	2,596	2,941	70,681	9,815,477	情報技術
INCYTE CORP	69.3	76	591	82,111	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	477.69	541.69	5,464	758,864	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	488.98	549.98	4,206	584,121	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	408.5	462	2,546	353,638	情報技術
BLACKROCK INC	55.1	63	4,498	624,665	金融

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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		
CENTERPOINT ENERGY INC	211	260	795	110,412	公益事業	
HASBRO INC	47	54	335	46,621	一般消費財・サービス	
KELLOGG CO	93	104	752	104,563	生活必需品	
KEYCORP	354	386	716	99,542	金融	
KANSAS CITY SOUTHERN	33.5	—	—	—	資本財・サービス	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	510.61	572.11	3,778	524,760	生活必需品	
COOPER COS INC/THE	17.7	20	614	85,388	ヘルスケア	
CHUBB LTD	162.19	175.99	3,813	529,560	金融	
ARROW ELECTRONICS INC	27	27	286	39,830	情報技術	
ALLSTATE CORP	109.5	114	1,520	211,156	金融	
EBAY INC	249	249	1,089	151,350	一般消費財・サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	405	455.5	3,536	491,114	情報技術	
EASTMAN CHEMICAL CO	50.5	52	443	61,561	素材	
XILINX INC	88.5	—	—	—	情報技術	
DISH NETWORK CORP-A	89	96	150	20,903	コミュニケーション・サービス	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	84.7	96	2,063	286,547	生活必需品	
TRIMBLE INC	90.5	102	575	79,874	情報技術	
LENNAR CORP-A	100.5	106	915	127,182	一般消費財・サービス	
LEAR CORP	21.5	25	350	48,656	一般消費財・サービス	
PROGRESSIVE CORP	213.9	242	3,173	440,648	金融	
PACCAR INC	125.37	144.37	1,505	209,027	資本財・サービス	
BIOGEN INC	55.2	61	1,777	246,855	ヘルスケア	
IDEXX LABORATORIES INC	30.9	35	1,431	198,772	ヘルスケア	
STARBUCKS CORP	427.5	474	4,676	649,423	一般消費財・サービス	
PTC INC	40.2	46	566	78,617	情報技術	
EVERSOURCE ENERGY	124.1	143	1,153	160,158	公益事業	
INTUIT INC	98.8	110.8	4,207	584,252	情報技術	
BORGWARNER INC	87.5	97	406	56,481	一般消費財・サービス	
BEST BUY CO INC	82.5	88.5	744	103,432	一般消費財・サービス	
BALL CORP	119.84	130.04	711	98,853	素材	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	517.97	590.97	2,629	365,202	ヘルスケア	
ELECTRONIC ARTS INC	105.7	116	1,480	205,533	コミュニケーション・サービス	
VULCAN MATERIALS CO	49	55	981	136,297	素材	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	93.5	106	3,353	465,644	ヘルスケア	
VF CORP	122.5	134	434	60,403	一般消費財・サービス	
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	220.25	252.25	498	69,184	コミュニケーション・サービス	
MOHAWK INDUSTRIES INC	22	22	222	30,838	一般消費財・サービス	
CARNIVAL CORP	300	409	398	55,377	一般消費財・サービス	
CLEVELAND-CLIFFS INC	—	218	330	45,834	素材	
COMCAST CORP-CLASS A	1,660.9	1,847.9	6,556	910,480	コミュニケーション・サービス	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	83	87	422	58,717	資本財・サービス	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	448	486	193	26,861	不動産	
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	114,614.26 598銘柄	141,212.8 597銘柄	1,414,769	196,469,055 <65.8%>	
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	—	335	2,051	209,619	生活必需品	
IMPERIAL OIL LTD	91	95	740	75,681	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	7	8	1,687	172,366	情報技術	
RESTAURANT BRANDS INTERN	96.87	116.87	1,031	105,413	一般消費財・サービス	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	161	179	917	93,737	素材	
INTACT FINANCIAL CORP	64.5	71.5	1,424	145,577	金融	
BCE INC	49.3	49.3	315	32,238	コミュニケーション・サービス	
FRANCO-NEVADA CORP	69	78	1,503	153,616	素材	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
SUNCOR ENERGY INC	542.3	582.3	2,645	270,252	エネルギー
METRO INC/CN	86	96	747	76,350	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	120	134	1,318	134,731	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	435	482	3,358	343,062	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	159.5	366	2,349	240,010	金融
TORONTO-DOMINION BANK	652	737	6,602	674,540	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	98	114	365	37,314	金融
ROYAL BANK OF CANADA	510.5	575.5	7,698	786,475	金融
TOURMALINE OIL CORP	—	129	1,046	106,878	エネルギー
TC ENERGY CORP	352.5	397.5	2,435	248,768	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	197.29	223.29	1,078	110,224	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	633	721	1,555	158,952	素材
CAE INC	109	126	361	36,943	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	62.12	68.12	1,050	107,309	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	59	65	237	24,290	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	35	35	378	38,684	素材
BALLARD POWER SYSTEMS INC	78	—	—	—	資本財・サービス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	54.5	61.5	395	40,354	素材
HYDRO ONE LTD	113	131	479	48,995	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	59.6	67.6	819	83,742	生活必需品
NORTHLAND POWER INC	79	94	353	36,145	公益事業
WSP GLOBAL INC	43	50	800	81,804	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	28	33	335	34,323	資本財・サービス
PARKLAND CORP	51	58	162	16,590	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	60	60	173	17,732	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	90	104	536	54,801	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC	—	33	468	47,851	資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A	48	48	174	17,810	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	127	144	883	90,296	コミュニケーション・サービス
BRP INC/CA- SUB VOTING	—	16	155	15,873	一般消費財・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	225	246	281	28,800	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	87	185.17	1,254	128,181	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	215	267	264	27,031	公益事業
B2GOLD CORP	347	—	—	—	素材
AIR CANADA	65	65	122	12,563	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	432	530	289	29,617	素材
BANK OF MONTREAL	231	273	3,563	364,071	金融
POWER CORP OF CANADA	201	222	743	75,931	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	41	463	2,335	238,628	情報技術
NUTRIEN LTD	203.19	223.19	2,474	252,795	素材
CANOPY GROWTH CORP	84	—	—	—	ヘルスケア
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	96	—	—	—	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	47	53	225	23,076	公益事業
CAMECO CORP	140	158	500	51,087	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	14	15	254	26,001	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	65	71	271	27,722	資本財・サービス
LIGHTSPEED COMMERCE INC	39	53	110	11,256	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	19	26	100	10,308	情報技術
TELUS CORP	108	108	308	31,511	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	170	194	931	95,151	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	22	22	327	33,465	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	420	466	3,761	384,232	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	10	10	786	80,297	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	102	113	924	94,476	一般消費財・サービス

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	株数	当 株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
WESTON (GEORGE) LTD	27.37	29.37	498	50,965	生活必需品	
PAN AMERICAN SILVER CORP	70	78	161	16,526	素材	
BLACKBERRY LTD	194	224	146	14,988	情報技術	
SUN LIFE FINANCIAL INC	208.5	238	1,491	152,376	金融	
ENBRIDGE INC	727	821	4,558	465,664	エネルギー	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	461.25	571.25	3,488	356,339	金融	
MANULIFE FINANCIAL CORP	691	780	1,868	190,845	金融	
BAUSCH HEALTH COS INC	105	113	104	10,689	ヘルスケア	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	240	377.2	4,108	419,720	資本財・サービス	
IA FINANCIAL CORP INC	37	44	332	33,955	金融	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	70	75	286	29,245	一般消費財・サービス	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	255.5	237.5	4,037	412,446	資本財・サービス	
CGI INC - CLASS A	79	87	1,005	102,771	情報技術	
ONEX CORPORATION	26	29	199	20,394	金融	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	160	190	697	71,274	コミュニケーション・サービス	
IGM FINANCIAL INC	31	31	120	12,290	金融	
TMX GROUP LTD	19	23	317	32,472	金融	
OPEN TEXT CORP	99	110	433	44,287	情報技術	
SAPUTO INC	87	102	329	33,615	生活必需品	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	204	233	729	74,551	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	302	—	—	—	生活必需品	
YAMANA GOLD INC	323	—	—	—	素材	
FORTIS INC	166	193	1,031	105,386	公益事業	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	38	44	318	32,530	資本財・サービス	
LUNDIN MINING CORP	221	246	202	20,708	素材	
CENOVUS ENERGY INC	467	555	1,536	156,942	エネルギー	
DOLLARAMA INC	107	112	912	93,182	一般消費財・サービス	
ATCO LTD -CLASS I	29	—	—	—	公益事業	
ALTAGAS LTD	103	111	248	25,423	公益事業	
KEYERA CORP	74	88	267	27,338	エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	—	286	553	56,594	エネルギー	
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	14,425.79 88銘柄	16,476.16 86銘柄	98,464	10,059,105 <3.4%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
THE LOTTERY CORPORATION LTD	—	849.5	387	35,944	一般消費財・サービス	
TELSTRA GROUP LTD	—	1,563.94	625	58,047	コミュニケーション・サービス	
MEDIBANK PRIVATE LTD	970	1,050.94	305	28,377	金融	
BHP GROUP LTD	1,034	1,973.18	8,843	820,615	素材	
SOUTH32 LTD	1,601	1,770.77	720	66,874	素材	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	335.5	740.59	2,727	253,093	エネルギー	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	591	660.05	1,284	119,184	素材	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,159.5	1,250.31	3,962	367,655	金融	
WESTPAC BANKING CORP	1,289.48	1,362.77	3,247	301,333	金融	
SANTOS LTD	629	1,254.13	919	85,299	エネルギー	
AUSNET SERVICES	650	—	—	—	公益事業	
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,008.5	1,168.89	2,911	270,177	金融	
RIO TINTO LTD	130	144.67	1,559	144,750	素材	
ORIGIN ENERGY LTD	590	688.87	549	50,944	公益事業	
AURIZON HOLDINGS LTD	600	676	252	23,459	資本財・サービス	
XERO LTD	47.5	51.35	356	33,115	情報技術	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	34	79	220	20,444	エネルギー	
COLES GROUP LTD	468.45	520.8	888	82,442	生活必需品	
WISETECH GLOBAL LTD	54	54	300	27,844	情報技術	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
IDP EDUCATION LTD	—	79	232	21,588	一般消費財・サービス	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	370	445.84	469	43,603	素材	
EVOLUTION MINING LTD	595	656	175	16,252	素材	
AFTERPAY LTD	76	—	—	—	情報技術	
REECE LTD	105	105	162	15,101	資本財・サービス	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	473	512.6	360	33,485	生活必需品	
OIL SEARCH LTD	642	—	—	—	エネルギー	
SEEK LTD	117	128.45	285	26,495	コミュニケーション・サービス	
TREASURY WINE ESTATES LTD	256	275.29	376	34,893	生活必需品	
NEWCREST MINING LTD	285	340.97	669	62,106	素材	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	623.5	665.19	7,190	667,163	金融	
AMPOL LTD	79.5	88	250	23,279	エネルギー	
ORICA LTD	131	177.51	265	24,657	素材	
QBE INSURANCE GROUP LTD	519.5	562.69	729	67,666	金融	
WOOLWORTHS GROUP LTD	441	473.31	1,656	153,670	生活必需品	
TABCORP HOLDINGS LTD	782.63	—	—	—	一般消費財・サービス	
CROWN RESORTS LTD	134	—	—	—	一般消費財・サービス	
QANTAS AIRWAYS LTD	305	354.69	219	20,372	資本財・サービス	
TELSTRA CORP LTD	1,435	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	156.5	174.15	512	47,508	素材	
MACQUARIE GROUP LTD	119.84	141.98	2,527	234,502	金融	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	211.3	229.09	812	75,356	一般消費財・サービス	
CSL LTD	160	187.75	5,680	527,134	ヘルスケア	
WESFARMERS LTD	403	442.06	2,137	198,366	一般消費財・サービス	
COCHLEAR LTD	23.2	25.1	530	49,240	ヘルスケア	
BLUESCOPE STEEL LTD	178	178	304	28,259	素材	
SUNCORP GROUP LTD	436.57	480.15	576	53,463	金融	
ASX LTD	67	73.65	510	47,380	金融	
COMPUTERSHARE LTD	182	206.89	572	53,099	情報技術	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	861.36	964.1	462	42,940	金融	
SONIC HEALTHCARE LTD	159.5	173.28	548	50,937	ヘルスケア	
AGL ENERGY LTD	215	—	—	—	公益事業	
BRAMBLES LTD	504	561.58	675	62,635	資本財・サービス	
MINERAL RESOURCES LTD	—	66.66	558	51,814	素材	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	61.5	69.73	456	42,341	ヘルスケア	
REA GROUP LTD	18	20.23	248	23,041	コミュニケーション・サービス	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	44	—	—	—	金融	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	22	22	144	13,391	一般消費財・サービス	
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額	22,384.83	24,740.7	60,365	5,601,355	
	銘柄数 < 比率 >	53 銘柄	49 銘柄		< 1.9% >	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	525	580	2,320	41,249	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	830	940	4,291	76,295	一般消費財・サービス	
MTR CORP	585	665	2,477	44,043	資本財・サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	510	605	5,608	99,716	不動産	
SINO LAND CO	1,260	1,420	1,418	25,222	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,046.69	1,116.69	4,941	87,857	資本財・サービス	
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	185	215	1,294	23,012	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	620	700	3,955	70,319	公益事業	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	555.07	595.07	1,446	25,710	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	4,224.75	4,824.75	3,184	56,617	公益事業	
HANG SENG BANK LTD	288	329	3,928	69,844	金融	
NEW WORLD DEVELOPMENT	585	635	1,176	20,909	不動産	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	株数	当 株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千香港・ドル	千円		
WH GROUP LTD	3,610	3,610	1,624	28,883	生活必需品	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	461	511	15,330	272,567	金融	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	780	870	1,171	20,820	不動産	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	690	780	1,121	19,942	資本財・サービス	
SJM HOLDINGS LTD	710	—	—	—	一般消費財・サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	450	450	791	14,065	不動産	
CK ASSET HOLDINGS LTD	911.69	911.69	4,298	76,429	不動産	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	235	265	1,030	18,328	公益事業	
AIA GROUP LTD	4,614	5,096	38,831	690,424	金融	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	540	540	822	14,632	資本財・サービス	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	630	720	2,595	46,149	不動産	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	679	741	1,578	28,062	生活必需品	
ESR CAYMAN LTD	750	862	1,436	25,533	不動産	
SANDS CHINA LTD	928	1,044	2,075	36,901	一般消費財・サービス	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	820	820	1,108	19,711	一般消費財・サービス	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	530	575	5,111	90,886	資本財・サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,415	1,590	3,967	70,534	金融	
WYNN MACAU LTD	540	—	—	—	一般消費財・サービス	
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	30,508.2 30銘柄	32,011.2 28銘柄	118,935	2,114,674 <0.7%>	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
CAPITALAND INVESTMENT LTD	1,024	1,074	394	39,825	不動産	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	452	508	1,564	158,091	金融	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	699	779	2,722	275,092	金融	
SINGAPORE AIRLINES LTD	484.75	539.75	295	29,831	資本財・サービス	
KEPPEL CORP LTD	563	627	472	47,704	資本財・サービス	
UOL GROUP LTD	171	200	129	13,114	不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	161	161	132	13,436	不動産	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,293	1,457	1,802	182,105	金融	
GENTING SINGAPORE LTD	2,090	2,380	208	21,041	一般消費財・サービス	
VENTURE CORP LTD	99	112	193	19,577	情報技術	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,201.5	3,553.5	970	98,019	コミュニケーション・サービス	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	565	627	218	22,109	資本財・サービス	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	315	357	326	32,969	金融	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	744	800	327	33,060	生活必需品	
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	11,862.25 14銘柄	13,175.25 14銘柄	9,758	985,979 <0.3%>	
(ニュージーランド)		百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	475	525	248	21,433	公益事業	
MERCURY NZ LTD	260	300	157	13,552	公益事業	
A2 MILK CO LTD	262	—	—	—	生活必需品	
SPARK NEW ZEALAND LTD	727.89	805.3	416	35,894	コミュニケーション・サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	483	521.13	407	35,100	資本財・サービス	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	232	242	552	47,543	ヘルスケア	
RYMAN HEALTHCARE LTD	165	—	—	—	ヘルスケア	
ニュージーランド・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,604.89 7銘柄	2,393.43 5銘柄	1,782	153,524 <0.1%>	
(イギリス)		百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
SHELL PLC	—	3,052.97	7,328	1,218,242	エネルギー	
HALEON PLC	—	2,041.62	582	96,841	生活必需品	
BP PLC	7,330	7,881.77	3,878	644,677	エネルギー	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
UNILEVER PLC	948.6	1,041.21	4,294	713,869	生活必需品
BARCLAYS PLC	6,223	6,832.63	1,100	182,861	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	3,005	3,363.9	299	49,834	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	951	1,122.04	1,082	179,951	金融
NATWEST GROUP PLC	2,102.91	2,183.95	568	94,571	金融
EVRAZ PLC	174	—	—	—	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	70.64	70.64	150	25,093	素材
BAE SYSTEMS PLC	1,170	1,288.2	1,043	173,537	資本財・サービス
AVIVA PLC	1,423.66	1,156.48	518	86,239	金融
AVEVA GROUP PLC	44	49.48	157	26,122	情報技術
GSK	1,823	1,659.76	2,353	391,173	ヘルスケア
INFORMA PLC	527	600.95	366	60,976	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,595.4	1,787.92	235	39,067	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	350	380.02	214	35,678	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	34	39.64	177	29,487	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	175	238.27	147	24,437	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	27.5	29	325	54,039	資本財・サービス
HALMA PLC	137	152.6	324	53,980	情報技術
ENTAIN PLC	212	240.59	336	55,890	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	172	997	124	20,625	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	235	301.68	179	29,888	金融
M&G PLC	917	1,045.04	200	33,397	金融
RELX PLC	703.96	785.4	1,798	298,975	資本財・サービス
DIAGEO PLC	847	932.76	3,514	584,238	生活必需品
RIO TINTO PLC	407	458.86	2,552	424,325	素材
STANDARD CHARTERED PLC	970	1,046.59	637	105,950	金融
TESCO PLC	2,806.84	3,063.36	713	118,648	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	319.5	353.11	380	63,275	ヘルスケア
GLENCORE PLC	3,645.25	4,022.88	2,215	368,332	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	124.5	132.5	112	18,734	金融
SMITHS GROUP PLC	143.83	153.83	245	40,811	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	465.83	—	—	—	金融
PEARSON PLC	257.63	283.63	279	46,393	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	595.25	718.64	160	26,651	生活必需品
NEXT PLC	48.5	53.11	304	50,675	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	1,277	1,466.73	149	24,893	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	73.61	81.27	210	34,935	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	119.05	135.62	415	69,120	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	10,141.83	10,810.03	992	165,032	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	50.11	56.01	375	62,492	素材
KINGFISHER PLC	737.11	787.11	189	31,506	一般消費財・サービス
WPP PLC	429	458.47	398	66,182	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	248.27	278.81	286	47,551	公益事業
SEVERN TRENT PLC	90.83	102.32	277	46,161	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	673	747.06	400	66,512	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	260	291.82	1,733	288,144	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	194.5	217.32	250	41,670	金融
SCHRODERS PLC	41.5	273.52	123	20,496	金融
SSE PLC	376	435.75	730	121,400	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	367	395	157	26,139	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	561	632.33	6,993	1,162,541	ヘルスケア
FERGUSON PLC	80.87	87.77	832	138,459	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,152	2,396.89	609	101,361	金融
3I GROUP PLC	350.91	390.73	523	87,066	金融

外国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
ASHTAD GROUP PLC	161.5	178.54	891	148,126	資本財・サービス	
SAGE GROUP PLC/THE	401.14	401.14	315	52,411	情報技術	
NATIONAL GRID PLC	1,296.34	1,488.17	1,500	249,481	公益事業	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	25,754.65	28,500.13	1,320	219,468	金融	
IMPERIAL BRANDS PLC	341	381.61	810	134,672	生活必需品	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	38.32	42.32	160	26,612	一般消費財・サービス	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	790.6	878.5	2,943	489,283	生活必需品	
BHP GROUP PLC	768.27	—	—	—	素材	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	128.5	138	218	36,359	生活必需品	
HSBC HOLDINGS PLC	7,416.5	8,199.21	4,184	695,515	金融	
ANGLO AMERICAN PLC	465.83	518.56	1,705	283,555	素材	
MONDI PLC	176	198.53	308	51,350	素材	
COMPASS GROUP PLC	647.39	728	1,332	221,518	一般消費財・サービス	
PERSIMMON PLC	112	128.32	162	27,089	一般消費財・サービス	
BT GROUP PLC	3,206	3,453	424	70,514	コミュニケーション・サービス	
COCA-COLA HBC AG-DI	71.5	78	157	26,165	生活必需品	
BURBERRY GROUP PLC	142.89	160.61	343	57,134	一般消費財・サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	64.36	75.23	356	59,338	一般消費財・サービス	
INTERTEK GROUP PLC	58.5	64.81	255	42,490	資本財・サービス	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	120.49	134.5	1,081	179,847	金融	
SHELL PLC	1,489	—	—	—	エネルギー	
SHELL CLASS B PLC	1,346.18	—	—	—	エネルギー	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	57	66	98	16,418	ヘルスケア	
ADMIRAL GROUP PLC	70.5	75	152	25,271	金融	
ANTOFAGASTA PLC	141	153	208	34,690	素材	
ABRDN PLC	778.62	843.62	173	28,776	金融	
EXPERIAN PLC	336.54	375.75	1,078	179,200	資本財・サービス	
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	105,587.01 82 銘柄	116,867.14 79 銘柄	74,742	12,424,463 <4.2%>	
		百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
(イスラエル)						
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	443	514.98	1,053	42,477	金融	
AZRIELI GROUP LTD	16.5	18.26	443	17,896	不動産	
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	—	45.41	687	27,748	情報技術	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	—	890	556	22,453	コミュニケーション・サービス	
ICL GROUP LTD	281	304.61	870	35,113	素材	
ELBIT SYSTEMS LTD	9.5	11	636	25,662	資本財・サービス	
BANK HAPOALIM BM	441	546.45	1,802	72,711	金融	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	562	664.26	2,091	84,342	金融	
NICE LTD	24	27.31	1,777	71,698	情報技術	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	54	64.07	813	32,793	金融	
イスラエル・シェケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,831 8 銘柄	3,086.35 10 銘柄	10,732	432,897 <0.1%>	
		百株	百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)						
CS GROUP ANR RIGHTS AG	—	1,040.49	10	1,500	金融	
UBS GROUP AG-REG	1,306	1,404.83	2,437	355,053	金融	
ROCHE HOLDING AG-BR	11	11.8	439	64,080	ヘルスケア	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2.8	2.8	180	26,328	素材	
ADECCO GROUP AG-REG	51.5	63.6	206	30,045	資本財・サービス	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	250	280.61	8,677	1,264,104	ヘルスケア	
SIKA AG-REG	51	58.34	1,358	197,842	素材	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.04	0.04	389	56,753	生活必需品	
ABB LTD-REG	627	656.05	1,930	281,253	資本財・サービス	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	株数	当株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
SWISS RE AG	107	120.47	1,018	148,323	金融	
NESTLE SA-REG	1,027	1,124.33	12,509	1,822,229	生活必需品	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	8	9	817	119,093	金融	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	15	16.01	287	41,815	資本財・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	909.2	1,040.49	301	43,985	金融	
JULIUS BAER GROUP LTD	80	87.08	469	68,422	金融	
SGS SA-REG	2.1	2.52	550	80,208	資本財・サービス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	6.9	9.34	159	23,238	資本財・サービス	
VIFOR PHARMA AG	17.5	—	—	—	ヘルスケア	
TEMENOS AG - REG	23	25	143	20,867	情報技術	
VAT GROUP AG	—	10.5	270	39,431	資本財・サービス	
ALCON INC	178	199.59	1,280	186,540	ヘルスケア	
SIG GROUP N AG	—	130	260	37,987	素材	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	9.7	11.59	284	41,448	一般消費財・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	53.42	60.1	2,716	395,715	金融	
BALOISE HOLDING AG - REG	17	18	256	37,311	金融	
CLARIANT AG-REG	77	86.78	135	19,707	素材	
NOVARTIS AG-REG	791	863.2	7,190	1,047,433	ヘルスケア	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1.2	1.41	270	39,435	生活必需品	
BACHEM HOLDING AG-REG B	—	12.5	109	15,969	ヘルスケア	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	186	208.49	2,500	364,297	一般消費財・サービス	
SWISSCOM AG-REG	9	10.36	522	76,181	コミュニケーション・サービス	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	10.1	—	—	—	金融	
GEBERIT AG-REG	13	14.33	638	93,016	資本財・サービス	
GIVAUDAN-REG	3.3	3.69	1,153	168,029	素材	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	3.6	43.89	463	67,450	ヘルスケア	
SONOVA HOLDING AG-REG	19.92	21.1	510	74,320	ヘルスケア	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	62	69.29	384	55,998	情報技術	
LONZA GROUP AG-REG	26.9	29.74	1,446	210,676	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	19	19	86	12,659	一般消費財・サービス	
HOLCIM LTD	185.4	218.29	1,068	155,589	素材	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	11.1	12.37	622	90,637	金融	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	19.2	21.35	480	70,038	資本財・サービス	
SWISS PRIME SITE-REG	27	30.25	236	34,503	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.34	0.42	409	59,713	生活必需品	
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,218.22 40銘柄	8,049.04 42銘柄	55,188	8,039,238 <2.7%>	
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	648	701.05	61,685	1,191,144	ヘルスケア	
DANSKE BANK A/S	260	296.78	3,773	72,867	金融	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1.2	1.31	1,924	37,159	資本財・サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	386.5	430.42	7,578	146,347	資本財・サービス	
GN STORE NORD A/S	48.5	54.65	919	17,760	ヘルスケア	
CARLSBERG AS-B	39	41.8	3,777	72,950	生活必需品	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	78.5	88	3,607	69,653	素材	
COLOPLAST-B	45	51.12	4,413	85,228	ヘルスケア	
DSV PANALPINA A/S	79.1	82.8	9,161	176,914	資本財・サービス	
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	3	3.7	582	11,252	資本財・サービス	
DEMANT A/S	38.75	42.75	857	16,559	ヘルスケア	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2.3	2.3	3,469	66,997	資本財・サービス	
TRYG A/S	132	149.9	2,466	47,630	金融	
PANDORA A/S	38	40	2,015	38,913	一般消費財・サービス	
CHR HANSEN HOLDING A/S	40.5	43	1,873	36,185	素材	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	株数	当 株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
GENMAB A/S ORSTED A/S AMBU A/S-B	百株 25.2 70.5 63	百株 28.29 81.4 —	千デンマーク・クローネ 8,996 4,918 —	千円 173,717 94,970 —	ヘルスケア 公益事業 ヘルスケア
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,999.05 18銘柄	2,139.27 17銘柄	122,022 <0.8%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
DNB BANK	367.5	400.25	7,636	106,151	金融
NORSK HYDRO ASA	507	578.66	4,228	58,780	素材
ORKLA ASA	290.5	323.17	2,242	31,165	生活必需品
TELENOR ASA	278	291.31	2,852	39,649	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	382.23	420.51	15,853	220,359	エネルギー
SCHIBSTED ASA-CL A	28	—	—	—	コミュニケーション・サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	66.6	71.24	3,314	46,075	素材
MOWI ASA	166	178	2,734	38,016	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	73.5	80.5	1,510	20,991	金融
SCHIBSTED ASA-B SHS	36.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス
AKER BP ASA	—	135.97	4,617	64,183	エネルギー
KONGSBERG GRUPPEN ASA	—	37.23	1,489	20,699	資本財・サービス
SALMAR ASA	—	24.52	816	11,342	生活必需品
ADEVINTA ASA	106	120	915	12,726	コミュニケーション・サービス
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,301.83 11銘柄	2,661.36 12銘柄	48,211 <0.2%>	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
SAGAX CLASS B	—	79.24	1,766	23,208	不動産
INVESTOR CLASS A	—	214.58	4,260	55,982	金融
VOLVO CAR CLASS B	—	248.08	1,233	16,212	一般消費財・サービス
ICA GRUPPEN AB	38.7	—	—	—	生活必需品
ERICSSON LM-B SHS	1,128.3	1,255.88	8,097	106,406	情報技術
VOLVO AB-B SHS	556.5	649.3	12,380	162,684	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES	144	164.95	2,855	37,518	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	86	86	1,251	16,451	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	613	657.78	7,577	99,570	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	188	244.23	2,277	29,928	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS	—	92	2,194	28,831	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	620	700.28	8,371	110,006	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	548.5	627.59	6,545	86,011	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	341	389.66	6,524	85,736	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	282	314.25	3,696	48,568	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSEA AB SCA-B	229	260.69	3,691	48,504	素材
SKANSKA AB-B SHS	128.5	146.38	2,500	32,852	資本財・サービス
SANDVIK AB	431	457	8,774	115,295	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	700	783.94	15,006	197,181	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	254.5	1,155.75	14,904	195,845	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS	80	80	1,611	21,171	資本財・サービス
HOLMEN AB-B SHARES	—	39.06	1,680	22,085	素材
SECURITAS AB-B SHS	119.5	119.5	1,054	13,861	資本財・サービス
TELIA CO AB	1,002	1,106.67	3,192	41,952	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	119	127	3,752	49,312	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	149	671.61	7,817	102,722	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	387.5	431.26	10,281	135,095	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	47.43	52.43	1,389	18,256	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	40	262.68	1,231	16,184	不動産

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
INDUTRADE AB	—	113.71	2,499	32,841	資本財・サービス	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	—	70.32	1,540	20,244	ヘルスケア	
LUNDBERGS AB-B SHS	30	30	1,404	18,448	金融	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	57	57	1,169	15,369	資本財・サービス	
LIFCO AB-B SHS	—	95	1,679	22,069	資本財・サービス	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	543	652.08	6,381	83,849	資本財・サービス	
ORRON ENERGY	75.5	—	—	—	公益事業	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	230	262.04	6,692	87,939	生活必需品	
EMBRACER GROUP AB	200	265.94	1,194	15,698	コミュニケーション・サービス	
BOLIDEN AB	104	113.87	4,332	56,932	素材	
EPIROC AB-A	249.5	274.36	5,417	71,182	資本財・サービス	
EPIROC AB-B	148	167.8	2,852	37,483	資本財・サービス	
HUSQVARNA AB-B SHS	158.5	170.5	1,369	17,994	資本財・サービス	
NORDEA BANK ABP	1,250	1,467.48	16,121	211,839	金融	
EQT AB	91	123.18	2,907	38,198	金融	
EVOLUTION AB	65.5	78.67	8,208	107,858	一般消費財・サービス	
SINCH AB	194	—	—	—	情報技術	
KINNEVIK AB - B	93	104.31	1,654	21,745	金融	
HEXAGON AB-B SHS	764	837.5	9,874	129,746	情報技術	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	62	62	1,634	21,483	金融	
スウェーデン・クロネ通算計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,548.43 41銘柄	16,363.55 46銘柄	222,858 <1.0%>	2,928,365	
ユーロ (アイルランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	86	99.48	345	49,606	素材	
KINGSPAN GROUP PLC	54	60.76	328	47,144	資本財・サービス	
KERRY GROUP PLC-A	56	62.72	569	81,822	生活必需品	
CRH PLC	281	306.32	1,175	168,756	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	60.3	67.04	929	133,458	一般消費財・サービス	
国 小 計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	537.3 5銘柄	596.32 5銘柄	3,348 <0.2%>	480,788	
ユーロ (オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	278.91	291.69	649	93,184	コミュニケーション・サービス	
EXOR NV	—	45	332	47,747	金融	
QIAGEN N. V.	76.98	91.05	429	61,678	ヘルスケア	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	322.6	349	491	70,554	ヘルスケア	
NN GROUP NV	99	112.92	455	65,387	金融	
HEINEKEN NV	92	104.07	923	132,538	生活必需品	
AEGON NV	642.44	720.59	336	48,316	金融	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	373.83	419.83	1,173	168,420	生活必需品	
AKZO NOBEL N. V.	67.68	71	484	69,605	素材	
KONINKLIJKE DSM NV	62	70.17	841	120,849	素材	
WOLTERS KLUWER	96	105.4	1,099	157,840	資本財・サービス	
ING GROEP NV	1,396	1,568.62	1,829	262,654	金融	
KONINKLIJKE KPN NV	1,211.5	1,327.81	386	55,497	コミュニケーション・サービス	
ASML HOLDING NV	150.1	163.2	9,135	1,311,737	情報技術	
ABN AMRO BANK NV-CVA	151.5	167	205	29,444	金融	
IMCD NV	—	22.46	312	44,873	資本財・サービス	
ADYEN NV	7	8.7	1,241	178,253	情報技術	
JUST EAT TAKEAWAY	64.5	72.2	151	21,707	一般消費財・サービス	
PROSUS NV	333.8	354.8	2,138	307,028	一般消費財・サービス	

外国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

銘柄	株数	当 株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
JDE PEET'S NV	百株 26	百株 37	千ユーロ 108	千円 15,512	生活必需品	
ASM INTERNATIONAL NV	17	18.83	482	69,253	情報技術	
VOPAK	23	—	—	—	エネルギー	
RANDSTAD NV	43	47.2	263	37,774	資本財・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	39.5	42.5	308	44,240	生活必需品	
OCI NV	—	43.86	175	25,151	素材	
EURONEXT NV	—	33	236	34,010	金融	
STMICROELECTRONICS NV	244	274.39	980	140,843	情報技術	
AIRBUS SE	211	237.36	2,591	372,087	資本財・サービス	
ARGENX SE	16.4	22.29	812	116,590	ヘルスケア	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	195	210.64	211	30,349	生活必需品	
EXOR NV	37.8	—	—	—	金融	
CNH INDUSTRIAL NV	366	402.65	612	87,874	資本財・サービス	
STELLANTIS NV	732	883.5	1,299	186,600	一般消費財・サービス	
FERRARI NV	44.95	50.61	1,055	151,508	一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	7,421.49 30銘柄	8,369.34 32銘柄	31,753	4,559,118 <1.5%>	
ユーロ（ベルギー）		百株	百株	千ユーロ	千円	
UCB SA	45.3	49.76	383	55,112	ヘルスケア	
KBC GROUP NV	89	98.43	516	74,224	金融	
COLRUYT SA	16	—	—	—	生活必需品	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	40	42	323	46,469	金融	
SOLVAY SA	26	29.84	280	40,333	素材	
UMICORE	70	82.69	282	40,628	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	272	348.72	1,959	281,389	生活必需品	
AGEAS	62.9	62.9	237	34,146	金融	
DIETEREN GROUP	—	10.36	184	26,477	一般消費財・サービス	
PROXIMUS	49.5	60.35	61	8,799	コミュニケーション・サービス	
ELIA GROUP SA/NV	10.5	13.33	178	25,684	公益事業	
SOFINA	6	6	126	18,177	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	687.2 11銘柄	804.38 11銘柄	4,537	651,443 <0.2%>	
ユーロ（ルクセンブルグ）		百株	百株	千ユーロ	千円	
AROUNDTOWN SA	325	380	88	12,745	不動産	
ARCELORMITTAL	257	257	666	95,718	素材	
INPOST SA	70	—	—	—	資本財・サービス	
EUROFINS SCIENTIFIC	47.5	52.96	355	50,977	ヘルスケア	
TENARIS SA	157	186.08	304	43,763	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	856.5 5銘柄	876.04 4銘柄	1,415	203,204 <0.1%>	
ユーロ（フランス）		百株	百株	千ユーロ	千円	
TOTALENERGIES SE	893.5	995.42	5,867	842,384	エネルギー	
MICHELIN (CGDE)	60.5	267.4	707	101,511	一般消費財・サービス	
AIR LIQUIDE SA	169.77	209.95	2,913	418,286	素材	
KERING	27	30.04	1,660	238,344	一般消費財・サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	193.5	217.87	3,025	434,441	資本財・サービス	
BOUYGUES SA	82	90.62	269	38,669	資本財・サービス	
BNP PARIBAS	403	446.02	2,389	343,059	金融	
THALES SA	38.5	42.91	522	75,072	資本財・サービス	
DANONE	234	257.08	1,293	185,665	生活必需品	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
CARREFOUR SA	212	244.54	403	57,968	生活必需品
SUEZ	126.25	—	—	—	公益事業
VIVENDI	278.91	295.91	253	36,326	コミュニケーション・サービス
L'OREAL	90.4	96.88	3,366	483,373	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	179	199.87	883	126,784	資本財・サービス
LEGRAND SA	94.67	107.37	838	120,338	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA	74.87	84.11	1,572	225,770	生活必需品
EURAZEO SE	12.54	17.24	104	14,975	金融
SOCIETE GENERALE SA	290	319.64	769	110,489	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	99.1	111.46	7,824	1,123,440	一般消費財・サービス
ACCOR SA	61.5	67.17	167	23,994	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	57.2	65.74	1,135	163,057	情報技術
VALEO SA	77	84	148	21,263	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	80	91.79	578	83,029	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA	106	116.05	292	41,939	資本財・サービス
EIFFAGE	30.4	32.85	310	44,543	資本財・サービス
SODEXO SA	29.5	34.91	317	45,632	一般消費財・サービス
IPSEN	11.5	14	152	21,870	ヘルスケア
ORPEA	18	—	—	—	ヘルスケア
AMUNDI SA	22.5	22.5	118	16,992	金融
TELEPERFORMANCE	21	23.15	495	71,130	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	30	36	94	13,542	コミュニケーション・サービス
FAURECIA	38.57	—	—	—	一般消費財・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	10	11	347	49,861	ヘルスケア
SEB SA	9.97	9.97	76	10,993	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA	101.5	115.49	2,026	291,015	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA	10	10	151	21,709	資本財・サービス
WORLDLINE SA	85.14	96.06	430	61,803	情報技術
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	35	41.63	155	22,360	一般消費財・サービス
AXA SA	694	762.06	2,084	299,309	金融
EDENRED	88.5	100.44	528	75,884	情報技術
RENAULT SA	64	77.55	261	37,612	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	11.3	12.72	1,887	271,028	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	7.5	9	145	20,908	生活必需品
ATOS SE	32	—	—	—	情報技術
DASSAULT SYSTEMES SE	234.5	267.58	929	133,525	情報技術
WENDEL	9.3	9.3	80	11,623	金融
ORANGE	714	800.96	788	113,207	コミュニケーション・サービス
ALSTOM	114	125.25	307	44,167	資本財・サービス
CNP ASSURANCES	58.5	—	—	—	金融
SANOFI	407.25	457.21	4,032	578,933	ヘルスケア
VINCI SA	188.5	214.23	2,069	297,102	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	197	261.79	636	91,413	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	416	491.28	471	67,758	金融
BIOMERIEUX	13.4	16.91	162	23,322	ヘルスケア
ENGIE	646.23	733.28	1,052	151,188	公益事業
EDF	202.5	221.2	265	38,111	公益事業
SAFRAN SA	122	137.22	1,598	229,528	資本財・サービス
ARKEMA	22.2	23.95	201	28,864	素材
ADP	9.1	11.1	161	23,220	資本財・サービス
SCOR SE	55.5	—	—	—	金融
GETLINK SE	142	173.45	275	39,609	資本財・サービス

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	株数	金額	期首		期末		業種等
			株数	株数	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
BOLLORE	286	百株	356.75	百株	千ユーロ	千円	コミュニケーション・サービス
国小計	9,129.57	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	10,169.87	62銘柄	59,790	8,584,781	<2.9%>
ユーロ (ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円		
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	—		179.02		554	79,578	資本財・サービス
DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	—		46		489	70,306	一般消費財・サービス
BAYER AG-REG	352.2		394.42		2,207	316,906	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	70		80		148	21,290	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	739		813.28		830	119,222	金融
COMMERZBANK AG	329.35		420.31		336	48,350	金融
VOLKSWAGEN AG	11.1		12		218	31,306	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	65.5		74.51		1,027	147,463	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	273.5		307.42		4,091	587,406	資本財・サービス
E.ON SE	793		901.36		818	117,588	公益事業
UNIPER SE	66.5		66.5		31	4,571	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	117.5		132.93		1,126	161,754	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	50.5		58		225	32,394	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	39.6		43.42		251	36,083	一般消費財・サービス
BASF SE	328.7		368.75		1,809	259,748	素材
ALLIANZ SE-REG	147.4		164.11		3,374	484,453	金融
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	64		71.68		490	70,375	生活必需品
RHEINMETALL AG	—		18.13		350	50,357	資本財・サービス
RWE AG	227		257.91		1,076	154,566	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	96.5		219.5		166	23,926	資本財・サービス
BRENNTAG SE	53.5		60.9		368	52,971	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	148		164.83		433	62,171	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	33.2		38.39		73	10,550	コミュニケーション・サービス
SAP SE	373.92		419.6		4,325	621,017	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	50.4		56.25		1,695	243,502	金融
ZALANDO SE	76.5		87.83		256	36,886	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	53.5		57.08		299	43,010	素材
KION GROUP AG	24		27		73	10,509	資本財・サービス
COVESTRO AG	67		73		279	40,070	素材
RATIONAL AG	1.9		1.9		110	15,890	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	12.1		12.1		427	61,396	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	53		60.35		350	50,257	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	58		64.43		253	36,429	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	14		15.92		202	29,006	ヘルスケア
BECHTLE AG	28.5		32.38		110	15,811	情報技術
NEMETSCHKE SE	20		22.84		104	14,970	情報技術
SCOUT24 AG	36		36		183	26,412	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	101		110.97		559	80,366	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	25		28		151	21,709	資本財・サービス
HELLOFRESH SE	57		65.16		147	21,199	生活必需品
TEAMVIEWER AG	53.5		—		—	—	情報技術
SIEMENS ENERGY AG	143.25		172.9		270	38,900	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	36.1		39.8		409	58,830	生活必需品
FUCHS PETROLUB PREF	23.5		—		—	—	素材
MERCK KGAA	46		51.89		893	128,220	ヘルスケア
ADIDAS AG	68.1		72		870	125,024	一般消費財・サービス
PUMA SE	38.6		41.63		199	28,601	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	37.5		41.01		264	37,978	生活必需品

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	株数	当 株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,192	1,301.22	2,532	363,644	コミュニケーション・サービス	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	72.2	80.7	239	34,366	ヘルスケア	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	306.5	325	2,032	291,833	一般消費財・サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	467	524.3	1,604	230,353	情報技術	
HANNOVER RUECK SE	22	23.78	430	61,867	金融	
DEUTSCHE POST AG-REG	354.5	397.96	1,505	216,214	資本財・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	67.1	76.28	1,315	188,926	金融	
LANXESS AG	28	—	—	—	素材	
MTU AERO ENGINES AG	17.9	21.04	415	59,633	資本財・サービス	
SYMRISE AG	44	52.28	562	80,805	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	338	413.12	93	13,452	コミュニケーション・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	19.5	22	176	25,317	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	195	287.7	684	98,312	不動産	
LEG IMMOBILIEN SE	25.5	28	172	24,748	不動産	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,653.62 59銘柄	10,036.79 59銘柄	44,705	6,418,828 <2.2%>	
ユーロ (ポルトガル)		百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	85	114.16	243	34,978	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	992	1,094	483	69,427	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	167.5	201.96	234	33,608	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,244.5 3銘柄	1,410.12 3銘柄	961	138,014 <0.0%>	
ユーロ (スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELEFONICA SA	1,867.27	2,104.78	755	108,491	コミュニケーション・サービス	
ENDESA SA	103.5	121	212	30,481	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,367	2,677	1,505	216,166	金融	
IBERDROLA SA	2,119.34	2,395.38	2,552	366,455	公益事業	
REPSOL SA	534	572.01	837	120,196	エネルギー	
GRIFOLS SA	98	118.3	117	16,890	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	6,199.5	6,823.35	1,934	277,792	金融	
AMADEUS IT GROUP SA	160.5	180.86	919	132,072	情報技術	
NATURGY ENERGY GROUP SA	103	103	270	38,776	公益事業	
CAIXABANK SA	1,605	1,749.27	620	89,111	金融	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	88.76	88.76	238	34,192	資本財・サービス	
AENA SME SA	26	29	351	50,527	資本財・サービス	
CELLNEX TELECOM SA	180.05	214.6	699	100,478	コミュニケーション・サービス	
ACCIONA SA	—	10.28	186	26,759	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	390	437.94	1,091	156,695	一般消費財・サービス	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	85	94.14	169	24,343	資本財・サービス	
ENAGAS SA	79.5	98.84	170	24,551	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	157	157	266	38,287	公益事業	
FERROVIAL SA	176.7	190.18	485	69,712	資本財・サービス	
EDP RENOVAVEIS SA	110	115.94	251	36,173	公益事業	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	16,450.12 19銘柄	18,281.63 20銘柄	13,638	1,958,157 <0.7%>	
ユーロ (イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA	88.5	100.4	338	48,608	資本財・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI	394.43	446	755	108,478	金融	
MEDIOBANCA SPA	223.65	244.07	225	32,436	金融	
UNICREDIT SPA	763.56	832.17	1,078	154,849	金融	

外国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

銘柄	株数	当 株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
TELECOM ITALIA SPA	3,439.82	3,787.82	82	11,834	コミュニケーション・サービス	
TELECOM ITALIA-RSP	2,039.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
INTESA SANPAOLO	5,945.37	6,630.75	1,415	203,213	金融	
ATLANTIA SPA	172.57	195.31	447	64,301	資本財・サービス	
POSTE ITALIANE SPA	177	210.74	198	28,509	金融	
MONCLER SPA	74	82.61	396	56,933	一般消費財・サービス	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	38.5	42.17	168	24,225	ヘルスケア	
ENI SPA	904	1,013.29	1,438	206,535	エネルギー	
DIASORIN SPA	8.5	10	128	18,507	ヘルスケア	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	112	128	120	17,249	コミュニケーション・サービス	
NEXI SPA	158.5	199	165	23,829	情報技術	
AMPLIFON SPA	43	47	127	18,294	ヘルスケア	
ENEL SPA	2,911.34	3,265.35	1,667	239,389	公益事業	
SNAM SPA	701	793.5	380	54,652	公益事業	
TERNA SPA	490	554.64	399	57,321	公益事業	
FINECOBANK SPA	219	232	350	50,365	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	18,904.24 20銘柄	18,814.82 19銘柄	9,886	1,419,535 <0.5%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（フィンランド）						
UPM-KYMMENE OYJ	191.5	214.28	742	106,636	素材	
NOKIA OYJ	1,913	2,172.54	993	142,584	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP	170	191.24	156	22,433	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS	197	214	300	43,139	素材	
ELISA OYJ	51	57.25	283	40,738	コミュニケーション・サービス	
SAMPO OYJ-A SHS	178	196.22	948	136,161	金融	
FORTUM OYJ	159	169	253	36,446	公益事業	
KESKO OYJ-B SHS	98	104	213	30,656	生活必需品	
KONE OYJ-B	121	133.75	648	93,138	資本財・サービス	
NESTE OYJ	151	169.85	793	113,863	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B	36	40	201	28,957	ヘルスケア	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	3,265.5 11銘柄	3,662.13 11銘柄	5,535	794,754 <0.3%>	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ（オーストリア）						
VERBUND AG	24.3	27.4	234	33,715	公益事業	
OMV AG	53	56.5	280	40,220	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	100	135.46	398	57,219	金融	
VOESTALPINE AG	42.5	42.5	111	15,987	素材	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	52.5	—	—	—	金融	
国小計	株数、金額 銘柄数<比率>	272.3 5銘柄	261.86 4銘柄	1,024	147,143 <0.0%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数<比率>	67,422.34 230銘柄	73,283.3 224銘柄	176,596	25,355,769 <8.5%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数<比率>	394,308.1 1,220銘柄	452,459.55 1,209銘柄	—	267,590,825 <89.7%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘 柄	期 首		期 末	
	□ 数	□ 数	評 価	額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)				
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5.087	5.837	996	138,439
SIMON PROPERTY GROUP INC	11.857	13.607	1,598	221,952
BOSTON PROPERTIES INC	5.47	6.2	438	60,863
VORNADO REALTY TRUST	5.897	6.297	159	22,132
SBA COMMUNICATIONS CORP	4.04	4.5	1,325	184,068
EQUITY RESIDENTIAL	13.05	14.8	940	130,674
EQUINIX INC	3.288	3.808	2,555	354,815
AMERICAN TOWER CORP	16.45	18.9	4,105	570,124
HOST HOTELS & RESORTS INC	24.943	29.043	541	75,259
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	—	13	422	58,690
KIMCO REALTY CORP	—	25	568	78,878
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	—	15.5	308	42,899
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	—	11	567	78,776
INVITATION HOMES INC	20.85	25.2	804	111,704
VICI PROPERTIES INC	19.8	39.8	1,340	186,094
VENTAS INC	13.8	16.5	749	104,027
WEYERHAEUSER CO	27.564	30.814	978	135,905
AGNC INVESTMENT CORP	19.6	—	—	—
CROWN CASTLE INTL CORP	15.75	17.9	2,490	345,795
IRON MOUNTAIN INC	10.26	11.8	635	88,258
SUN COMMUNITIES INC	4.1	5	724	100,548
PROLOGIS INC	26.952	38.154	4,342	603,016
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5.1	6.4	976	135,554
CAMDEN PROPERTY TRUST	3.45	4.2	494	68,678
DUKE REALTY CORP	13.8	—	—	—
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2.4	2.7	579	80,422
WELLTOWER INC	15.3	18.8	1,300	180,664
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	19.8	21.9	561	77,977
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4.25	4.8	777	107,931
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6.15	7.2	471	65,421
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	50.8	17.9	379	52,723
REALTY INCOME CORP	19.445	24.895	1,550	215,381
PUBLIC STORAGE	5.67	6.5	1,888	262,311
REGENCY CENTERS CORP	5.7	6.3	414	57,584
UDR INC	10.55	12.9	525	73,000
WP CAREY INC	6.4	8	625	86,899
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	8.3	—	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	10.3	11.8	1,283	178,204
EXTRA SPACE STORAGE INC	4.9	5.6	859	119,388
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	21.65	24.2	314	43,621
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	462.723 36 銘柄	536.755 37 銘柄	39,595 <1.8%>
(カナダ)				
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2.9	3.4	147	15,039
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5.8	5.8	123	12,603
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	8.7 2 銘柄	9.2 2 銘柄	270 <0.0%>

外国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

銘柄	期首 □ 数	当 □ 数	期末 評 価 額	
			外貨建金額 千オーストラリア・ドル	邦貨換算金額 千円
(オーストラリア)				
DEXUS/AU	36.15	40.978	322	29,886
LENDLEASE GROUP	23.5	25.3	192	17,888
TRANSURBAN GROUP	95.4	119.689	1,698	157,593
SYDNEY AIRPORT	45.8	—	—	—
APA GROUP	41.4	45.041	505	46,934
SCENTRE GROUP	181.922	203.007	596	55,380
GPT GROUP	68.16	73.031	319	29,613
MIRVAC GROUP	136.1	144.9	321	29,848
STOCKLAND	83.8	91.123	346	32,130
GOODMAN GROUP	58.2	65.537	1,224	113,657
VICINITY CENTRES	137.273	151.865	308	28,605
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比率 >	907.705 11銘柄	960.471 10銘柄	5,836 <0.2%>
(香港)				
LINK REIT	81.5	90.8	4,776	84,918
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	92	107	594	10,577
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	138	163	1,527	27,155
香港・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比率 >	311.5 3銘柄	360.8 3銘柄	6,898 <0.0%>
(シンガポール)				
CAPITALAND ASCENDAS REIT	124.5	144.5	398	40,296
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	190.87	220.07	457	46,250
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	114.3	140.8	226	22,904
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	77.5	101.3	175	17,707
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比率 >	507.17 4銘柄	606.67 4銘柄	1,258 <0.0%>
(イギリス)				
LAND SECURITIES GROUP PLC	23.562	28.317	175	29,212
SEGRO PLC	43.1	48.274	390	64,870
BRITISH LAND CO PLC	29.55	35.395	143	23,811
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比率 >	96.212 3銘柄	111.986 3銘柄	709 <0.0%>
ユーロ (ベルギー)				
WAREHOUSES DE PAUW SCA	—	6.192	159	22,866
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比率 >	—	6.192 1銘柄	159 <0.0%>
ユーロ (フランス)				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4.6	4.6	239	34,331
GECINA SA	1.6	1.817	172	24,718
KLEPIERRE	7.15	8.527	189	27,277
COVIVIO	1.75	2	112	16,181
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比率 >	15.1 4銘柄	16.944 4銘柄	713 <0.0%>
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比率 >	15.1 4銘柄	23.136 5銘柄	873 <0.0%>
合 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比率 >	2,309.11 63銘柄	2,609.018 64銘柄	— <2.2%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

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

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	267,590,825	89.4
投資信託証券	6,560,957	2.2
コール・ローン等、その他	25,191,110	8.4
投資信託財産総額	299,342,893	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=138.87円、1カナダ・ドル=102.16円、1オーストラリア・ドル=92.79円、1香港・ドル=17.78円、1シンガポール・ドル=101.04円、1ニュージーランド・ドル=86.13円、1イギリス・ポンド=166.23円、1イスラエル・シェケル=40.334円、1スイス・フラン=145.67円、1デンマーク・クローネ=19.31円、1ノルウェー・クローネ=13.90円、1スウェーデン・クローネ=13.14円、1ユーロ=143.58円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (281,426,799千円) の投資信託財産総額 (299,342,893千円) に対する比率は、94.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	316,046,707,918円
コール・ローン等	19,697,892,356
株式 (評価額)	267,590,825,704
投資信託証券 (評価額)	6,560,957,279
未収入金	17,359,297,553
未収配当金	373,891,289
差入委託証拠金	4,463,843,737
(B) 負債	17,673,443,530
未払金	17,579,182,430
未払解約金	94,261,100
(C) 純資産総額 (A - B)	298,373,264,388
元本	69,133,888,947
次期繰越増益金	229,239,375,441
(D) 受益権総口数	69,133,888,947口
1万円当り基準価額 (C / D)	43,159円

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

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額:

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

* 当期末の計算口数当りの純資産額は43,159円です。

■損益の状況

当期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

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

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

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

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)

運用報告書 (全体版) 第5期

(決算日 2022年11月30日)

(作成対象期間 2021年12月1日~2022年11月30日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型	
信託期間	無期限 (設定日: 2018年9月18日)	
運用方針	投資成果をF T S E 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の30%以下
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債 組入比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
1 期末(2018年11月30日)	円 9,979	円 0	% △0.2	9,997	% △0.0	% 98.2	% -	百万円 6
2 期末(2019年12月 2 日)	10,401	0	4.2	10,442	4.5	98.3	-	90
3 期末(2020年11月30日)	10,853	0	4.3	10,929	4.7	98.4	-	272
4 期末(2021年11月30日)	11,291	0	4.0	11,363	4.0	98.5	-	663
5 期末(2022年11月30日)	11,362	0	0.6	11,440	0.7	98.0	-	1,100

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

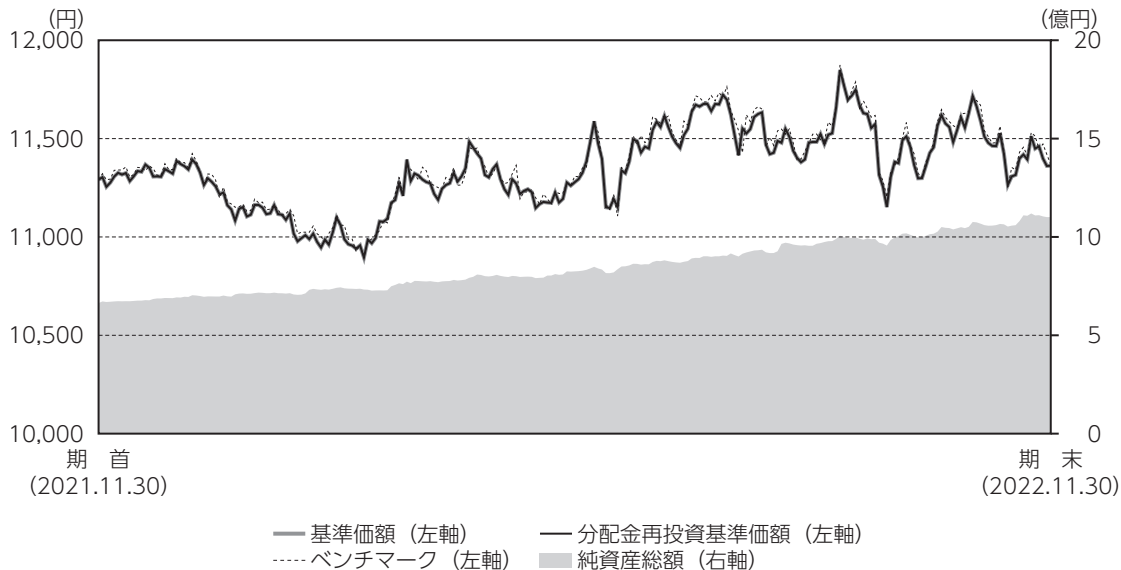
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注7) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：11,291円

期末：11,362円（分配金0円）

騰落率：0.6%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

日本を除く先進国国債に主に投資した結果、債券市場で金利は上昇（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。

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)

年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2021年11月30日	円 11,291	% -	11,363	% -	% 98.5	% -
12月末	11,360	0.6	11,450	0.8	98.6	-
2022年 1 月末	11,163	△1.1	11,245	△1.0	98.5	-
2 月末	10,961	△2.9	11,088	△2.4	98.7	-
3 月末	11,322	0.3	11,390	0.2	98.6	-
4 月末	11,345	0.5	11,394	0.3	98.5	-
5 月末	11,277	△0.1	11,346	△0.1	98.2	-
6 月末	11,545	2.2	11,685	2.8	98.4	-
7 月末	11,622	2.9	11,714	3.1	98.1	-
8 月末	11,483	1.7	11,596	2.1	97.7	-
9 月末	11,382	0.8	11,435	0.6	98.0	-
10月末	11,717	3.8	11,769	3.6	98.2	-
(期末) 2022年11月30日	11,362	0.6	11,440	0.7	98.0	-

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021.12.1～2022.11.30)

■海外債券市況

主要国の国債金利は、上昇しました。

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

■為替相場

為替相場は、大きく円安が進みました。

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

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021.12.1～2022.11.30)

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れました。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

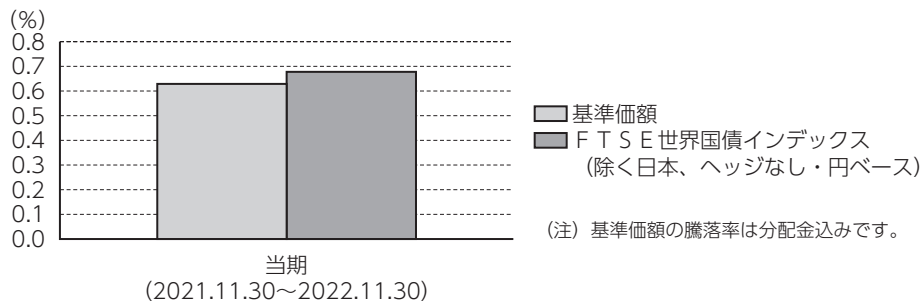
組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックスマザーファンド	F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は0.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は0.6%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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

分配金について

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

■分配原資の内訳 (1万口当り)

項 目	当 期	
	2021年12月1日 ～2022年11月30日	
当期分配金 (税込み) (円)		—
対基準価額比率 (%)		—
当期の収益 (円)		—
当期の収益以外 (円)		—
翌期繰越分配対象額 (円)		1,362

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

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

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



今後の運用方針

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れます。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2021.12.1~2022.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	16円	0.143%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は11,350円です。
（投 信 会 社）	(12)	(0.110)	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）	(1)	(0.011)	販売会社分は、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受 託 会 社）	(2)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	－	－	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	－	－	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	2	0.021	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保 管 費 用）	(1)	(0.013)	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）	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（そ の 他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	19	0.164	

(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。

■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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	148,943	470,745	12,483	38,954

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国債券インデックスマザーファンド	211,430	347,889	1,099,852

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックスマザーファンド	1,099,852	99.8
コール・ローン等、その他	1,778	0.2
投資信託財産総額	1,101,630	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝138.87円、1カナダ・ドル＝102.16円、1オーストラリア・ドル＝92.79円、1シンガポール・ドル＝101.04円、1ニューージーランド・ドル＝86.13円、1イギリス・ポンド＝166.23円、1イスラエル・シケル＝40.334円、1デンマーク・クローネ＝19.31円、1ノルウェー・クローネ＝13.90円、1スウェーデン・クローネ＝13.14円、1メキシコ・ペソ＝7.222円、1オフショア人民元＝19.415円、1マレーシア・リングギット＝30.789円、1ポーランド・ズロチ＝30.711円、1ユーロ＝143.58円です。

(注3) 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(239,018,141千円)の投資信託財産総額(241,503,298千円)に対する比率は、99.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,101,630,701円
コール・ローン等	1,778,604
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	1,099,852,097
(B) 負債	727,408
未払信託報酬	687,813
その他未払費用	39,595
(C) 純資産総額(A - B)	1,100,903,293
元本	968,932,462
次期繰越損益金	131,970,831
(D) 受益権総口数	968,932,462口
1万口当り基準価額(C / D)	11,362円

* 期首における元本額は587,988,324円、当作成期間中における追加設定元本額は418,305,359円、同解約元本額は37,361,221円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,362円です。

■損益の状況

当期 自2021年12月1日 至2022年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,312円
その他収益金	2,504
支払利息	△ 192
(B) 有価証券売買損益	5,059,722
売買益	5,816,308
売買損	△ 756,586
(C) 信託報酬等	△ 1,283,872
(D) 当期損益金(A + B + C)	3,778,162
(E) 前期繰越損益金	24,052,814
(F) 追加信託差損益金	104,139,855
(配当等相当額)	(51,805,666)
(売買損益相当額)	(52,334,189)
(G) 合計(D + E + F)	131,970,831
次期繰越損益金(G)	131,970,831
追加信託差損益金	104,139,855
(配当等相当額)	(51,805,666)
(売買損益相当額)	(52,334,189)
分配準備積立金	27,830,976

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

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

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,670円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	3,776,492
(c) 収益調整金	104,139,855
(d) 分配準備積立金	24,052,814
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	131,970,831
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	131,970,831
(h) 受益権総口数	968,932,462口

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第23期 (決算日 2022年11月30日)

(作成対象期間 2021年12月1日～2022年11月30日)

外国債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

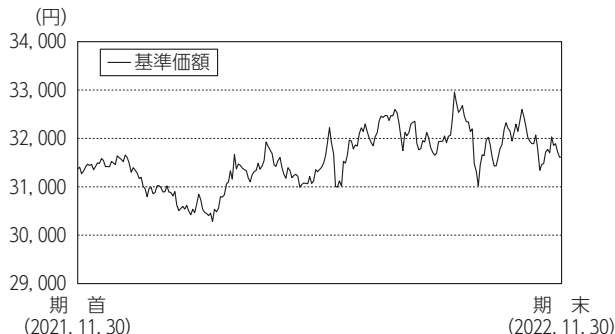
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：31,370円 期末：31,615円 騰落率：0.8%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外債券市況

主要国の国債金利は、上昇しました。

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

○為替相場

為替相場は、大きく円安が進みました。

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

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

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

《今後の運用方針》

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

年 月 日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) 2021年11月30日	31,370	—	31,642	—	98.6	—
12月末	31,565	0.6	31,887	0.8	98.7	—
2022年1月末	31,023	△ 1.1	31,315	△ 1.0	98.6	—
2月末	30,464	△ 2.9	30,877	△ 2.4	98.8	—
3月末	31,472	0.3	31,719	0.2	98.7	—
4月末	31,539	0.5	31,729	0.3	98.6	—
5月末	31,559	△ 0.0	31,595	△ 0.1	98.3	—
6月末	32,104	2.3	32,541	2.8	98.5	—
7月末	32,322	3.0	32,621	3.1	98.1	—
8月末	31,939	1.8	32,293	2.1	97.8	—
9月末	31,662	0.9	31,843	0.6	98.1	—
10月末	32,600	3.9	32,773	3.6	98.3	—
(期末) 2022年11月30日	31,615	0.8	31,857	0.7	98.1	—

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	4 (4)
(その他)	(0)
合 計	4

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

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

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

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

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）

■主要な売買銘柄

公 社 債

（2021年12月1日から2022年11月30日まで）

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

（注1）金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

（注2）単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	当 期			組入比率	うちBB格 以下組入 比	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 973,856	千アメリカ・ドル 864,609	千円 120,068,309	49.7	—	21.7	17.4	10.7		
カナダ	千カナダ・ドル 49,798	千カナダ・ドル 46,591	4,759,828	2.0	—	1.1	0.4	0.5		
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 42,234	千オーストラリア・ドル 38,584	3,580,216	1.5	—	1.0	0.4	0.1		
シンガポール	千シンガポール・ドル 10,749	千シンガポール・ドル 10,365	1,047,303	0.4	—	0.3	0.1	0.1		
ニュージーランド	千ニュージーランド・ドル 6,030	千ニュージーランド・ドル 5,308	457,242	0.2	—	0.1	0.1	0.0		
イギリス	千イギリス・ポンド 72,730	千イギリス・ポンド 67,102	11,154,519	4.6	—	3.6	0.7	0.3		
イスラエル	千イスラエル・シェケル 21,700	千イスラエル・シェケル 21,202	855,180	0.4	—	0.2	0.1	0.1		
デンマーク	千デンマーク・クローネ 43,211	千デンマーク・クローネ 45,111	871,107	0.4	—	0.2	0.1	0.0		
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 37,630	千ノルウェー・クローネ 34,949	485,804	0.2	—	0.1	0.1	0.0		
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 47,205	千スウェーデン・クローネ 46,624	612,648	0.3	—	0.1	0.1	0.0		
メキシコ	千メキシコ・ペソ 292,735	千メキシコ・ペソ 273,185	1,972,998	0.8	—	0.4	0.3	0.2		
中国	千オフショア・人民元 381,000	千オフショア・人民元 388,062	7,534,316	3.1	—	1.5	1.1	0.5		
マレーシア	千マレーシア・リンギット 39,353	千マレーシア・リンギット 38,885	1,197,267	0.5	—	0.3	0.1	0.0		
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 38,225	千ポーランド・ズロチ 31,959	981,527	0.4	—	0.1	0.2	0.1		

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)

作成期		当 期				末			
区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 比	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
	千ユーロ	千ユーロ	千円	%	%	%	%	%	
ユ ー ロ	アイルランド	11,953	10,959	1,573,613	0.7	—	0.5	0.2	0.0
	オランダ	27,863	26,921	3,865,379	1.6	—	1.0	0.4	0.2
	ベルギー	32,548	31,167	4,474,981	1.9	—	1.3	0.4	0.2
	フランス	150,364	143,593	20,617,203	8.5	—	5.0	2.6	0.9
	ドイツ	113,416	111,332	15,985,058	6.6	—	3.8	1.8	1.0
	スペイン	87,203	84,565	12,141,857	5.0	—	3.0	1.5	0.6
	イタリア	135,077	128,493	18,449,036	7.6	—	4.3	2.4	0.9
	フィンランド	9,706	8,576	1,231,438	0.5	—	0.3	0.2	0.0
	オーストリア	20,870	19,419	2,788,191	1.2	—	0.7	0.4	0.1
	小計	589,000	565,028	81,126,760	33.6	—	20.0	9.8	3.9
合 計	—	—	236,705,030	98.1	—	50.6	31.0	16.5	

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

		当 期				末			
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円			
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	4,926	684,164	2023/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,106	709,072	2024/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	4,758	660,860	2024/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	900	125,017	2026/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	775	107,639	2027/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	786	109,158	2028/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	822	114,211	2030/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	2,650	368,034	2031/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,274	176,932	2036/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	960	133,423	2037/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	583	81,073	2038/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	560	77,827	2038/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	1,002	139,224	2039/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,173	162,896	2039/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,142	158,658	2039/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,282	178,084	2039/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,103	153,224	2040/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	1,775	246,508	2040/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,080	150,045	2040/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,526	211,947	2040/11/15		

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）

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末				償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		千円	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル			
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,386	192,610	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,439	199,903	2041/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,466	203,587	2041/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,273	176,898	2041/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,424	197,870	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,159	161,041	2042/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,231	4,281	594,560	2042/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	1,330	184,755	2042/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	2,278	316,408	2043/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	1,909	265,194	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	3,012	418,325	2043/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	1,984	275,648	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	3,090	429,208	2044/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	2,981	414,030	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	5,933	823,986	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	1,656	230,010	2044/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	5,671	787,624	2024/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,746	2,304	320,082	2044/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,451	757,087	2025/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	1,963	272,726	2045/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,488	762,175	2025/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,835	1,536	213,406	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,408	751,074	2025/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,873	1,532	212,866	2045/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,518	766,395	2025/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	659	551	76,575	2045/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,866	4,490	623,526	2026/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,148	2,396	332,855	2046/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,729	7,101	986,150	2026/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,823	2,146	298,138	2046/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	4,914	682,519	2026/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,780	2,007	278,772	2046/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	4,894	679,684	2026/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,430	337,586	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,000	817	113,590	2046/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,427	337,075	2023/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,434	338,019	2023/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,640	3,385	470,198	2027/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,409	334,668	2024/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,345	1,960	272,246	2047/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,226	309,244	2024/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,550	4,396	610,508	2024/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	5,969	828,980	2027/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	1,672	232,323	2047/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	2,887	400,999	2024/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,093	707,358	2024/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,303	319,883	2024/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,462	758,579	2027/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,878	399,778	2024/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,450	1,157	160,765	2047/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,907	264,913	2024/08/31	

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)

区 分	銘 柄	種 類	当 期		未			償還年月日
			年利率	額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,500	2,394	332,506	2024/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,072	704,469	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	1,995	277,181	2047/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,355	465,956	2024/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,056	424,400	2024/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	2,677	371,793	2024/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,350	5,984	831,049	2028/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,495	346,576	2025/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,605	361,765	2025/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,000	2,513	349,085	2048/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	2,791	387,665	2025/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,800	3,266	453,558	2048/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	6,152	854,381	2028/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	1,834	254,792	2025/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,426	475,847	2025/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	2,888	401,116	2025/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	6,328	878,883	2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,220	2,707	376,049	2048/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,411	334,940	2025/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,457	480,184	2025/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,417	335,659	2025/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,415	335,416	2025/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	3,934	546,431	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,700	3,537	491,318	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,020	2,727	378,757	2048/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	2,887	400,920	2025/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	1,964	272,749	2023/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	1,500	1,432	198,864	2025/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,444	339,401	2023/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	6,127	850,945	2029/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	3,898	541,354	2024/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,383	330,968	2026/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	3,969	551,189	2049/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,371	329,288	2026/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,205	445,201	2024/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,352	326,736	2026/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	3,836	532,740	2049/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	3,560	494,496	2029/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,381	469,524	2024/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,641	366,781	2026/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,802	389,122	2026/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,346	464,663	2024/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	2,591	359,929	2026/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,500	5,245	728,398	2024/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,309	320,727	2026/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,092	568,270	2029/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	3,326	461,956	2049/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,534	351,939	2026/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,775	524,250	2024/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,283	317,067	2026/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,839	394,346	2024/09/30	

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)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期		未		償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額	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	1,000	945	131,232	2024/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	2,733	379,552	2026/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,850	2,504	347,791	2029/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	3,347	464,899	2049/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	1,819	252,715	2026/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,829	392,929	2024/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,284	317,276	2026/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,367	328,743	2024/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,700	1,593	221,324	2025/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,000	4,285	595,127	2030/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	6,500	5,864	814,357	2027/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	3,668	509,488	2050/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	266	36,970	2027/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	4,837	671,828	2025/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,500	1,373	190,765	2025/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,384	192,282	2027/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,800	5,421	752,827	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,457	341,214	2025/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,400	2,061	286,301	2027/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	3,104	431,149	2050/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	3,176	441,141	2040/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	2,997	416,219	2027/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,711	376,557	2025/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	5,871	815,413	2025/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	2,990	415,262	2027/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,059	424,809	2025/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	8,000	6,344	880,991	2030/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,238	588,635	2027/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	6,700	3,838	533,033	2050/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	3,151	437,614	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	2,975	413,191	2027/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,583	497,598	2025/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,371	468,247	2027/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,136	435,632	2025/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,915	266,044	2023/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	9,800	7,908	1,098,253	2030/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,568	495,599	2025/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,000	3,383	469,930	2027/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,800	4,172	579,385	2050/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,100	3,358	466,338	2040/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,100	4,551	632,002	2025/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,247	589,815	2027/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,859	397,116	2023/12/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,237	588,419	2027/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	1,000	890	123,726	2025/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,000	3,797	527,422	2024/01/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	7,000	5,956	827,199	2028/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,900	3,865	536,753	2051/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	10,700	8,796	1,221,625	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,000	4,729	656,806	2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,436	616,110	2026/01/31	

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)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,334	601,897	2028/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,700	3,370	468,082	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,000	2,665	370,120	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,888	262,244	2024/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,483	483,795	2028/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,577	496,837	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	3,000	2,827	392,621	2024/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	8,700	7,378	1,024,672	2031/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,100	4,781	663,993	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,500	4,013	557,317	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,215	724,259	2028/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	4,730	656,923	2051/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,800	2,899	402,650	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,470	481,951	2028/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,400	3,913	543,478	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,868	259,523	2024/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	4,328	601,126	2028/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	5,000	4,458	619,110	2026/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	5,500	5,136	713,314	2024/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	3,000	2,792	387,826	2024/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	10,300	8,410	1,167,975	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	6,900	4,659	647,084	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	3,700	2,562	355,809	2041/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	6,000	5,287	734,300	2026/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	5,000	4,257	591,280	2028/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	5,000	4,281	594,585	2028/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	5,000	4,417	613,437	2026/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	7,500	6,964	967,149	2024/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	5,000	4,305	597,842	2028/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,500	3,100	430,582	2026/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	2,000	1,861	258,459	2024/10/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	4,500	4,184	581,145	2024/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	9,000	7,384	1,025,535	2031/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	6,600	4,312	598,896	2051/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	4,000	2,892	401,656	2041/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	4,000	3,843	533,805	2023/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	6,000	5,193	721,285	2028/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	7,000	6,250	868,037	2026/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,583	497,648	2026/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.5000	5,000	4,793	665,631	2023/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	5,600	4,877	677,297	2028/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	2,200	2,052	284,974	2024/12/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	2,500	2,394	332,565	2023/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	4,000	3,458	480,334	2028/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,577	496,782	2026/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	1,000	932	129,539	2025/01/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,000	2,868	398,316	2024/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	10,400	8,885	1,233,864	2032/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	3,700	3,471	482,126	2025/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	4,300	3,791	526,463	2029/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	3,900	2,799	388,760	2052/02/15

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)

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	2,500	1,931	268,192	2042/02/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,000	4,441	616,853	2029/02/28
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	4,000	3,843	533,777	2024/02/29
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	1,000	915	127,146	2027/02/28
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	5,000	4,714	654,695	2025/03/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	3,000	2,741	380,660	2029/03/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	5,000	4,695	652,008	2027/03/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	2,000	1,935	268,841	2024/03/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	2,000	1,920	266,716	2025/04/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	9,300	8,647	1,200,879	2032/05/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,888	401,082	2025/05/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	5,000	4,133	574,026	2025/05/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	1,500	1,337	185,716	2042/05/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	4,500	4,362	605,798	2024/04/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	3,000	2,823	392,034	2029/04/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,845	395,175	2027/04/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	4,500	4,356	605,017	2024/05/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	6,000	5,602	777,985	2029/05/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	2,000	1,887	262,067	2027/05/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	2,000	1,931	268,202	2025/06/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	4,000	3,847	534,355	2029/06/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	3,000	2,905	403,482	2027/06/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	3,000	2,902	403,116	2025/07/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	4,070	3,855	535,403	2027/07/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	1,000	974	135,321	2024/06/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	2,500	2,426	336,905	2025/08/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	7,500	6,888	956,567	2032/08/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	3,700	3,150	437,547	2052/08/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.3750	1,000	908	126,175	2042/08/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.0000	3,970	3,867	537,139	2024/07/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	3,360	3,111	432,135	2029/07/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	3,890	3,802	528,098	2024/08/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	2,500	2,409	334,607	2027/08/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.1250	3,500	3,342	464,187	2029/08/31
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.5000	2,300	2,254	313,012	2025/09/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,500	3,481	483,517	2024/09/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.8750	2,500	2,499	347,063	2029/09/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.1250	1,500	1,509	209,646	2027/09/30
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.2500	3,400	3,398	471,969	2025/10/15
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.3750	1,000	997	138,511	2024/10/31
通貨小計	銘柄数 金 額	264銘柄			973,856	864,609	120,068,309	
カナダ				千カナダ・ドル	千カナダ・ドル			
		Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	605	563	57,596	2064/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,140	116,519	2029/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,386	141,641	2033/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,235	126,169	2037/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	913	1,026	104,833	2041/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	961	1,026	104,833	2045/12/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,374	140,405	2024/06/01
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,265	129,285	2048/12/01

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)

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		
					千カナダ・ドル	千円	
			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,116	114,010	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	907	92,751	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,128	115,238	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	650	616	62,947	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,710	2,968	303,214	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,167	119,283	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,173	119,841	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,342	137,177	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	3,050	311,627	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	700	661	67,548	2025/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,649	270,625	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,000	1,648	168,427	2030/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,100	1,887	192,859	2026/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,141	116,605	2024/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	300	274	28,033	2026/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,400	3,020	308,611	2031/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,000	944	96,462	2024/10/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,450	1,079	110,273	2053/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	966	98,709	2023/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	200	183	18,764	2027/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,000	2,884	294,695	2024/02/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,100	1,852	189,293	2031/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	200	189	19,373	2025/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	400	385	39,423	2024/05/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,500	1,376	140,634	2032/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	100	95	9,757	2029/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	391	40,005	2027/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	200	195	20,016	2024/08/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,000	980	100,211	2025/10/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	770	736	75,246	2032/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	360	353	36,135	2024/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	200	202	20,738	2028/03/01
通貨小計	銘柄数	40銘柄		49,798	46,591	4,759,828	
	金額						
				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,989	2,104	195,291	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	573	569	52,875	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,354	1,339	124,256	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,798	1,801	167,120	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,258	1,354	125,713	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,748	1,803	167,309	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,099	102,051	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,307	1,176	109,148	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	725	67,327	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,672	1,626	150,948	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,178	1,111	103,149	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	1,054	97,838	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,500	1,446	134,196	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,900	1,814	168,378	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,870	2,680	248,762	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,390	1,163	107,981	2041/05/21

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）

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	2,410	223,663	2031/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,700	1,383	128,375	2032/05/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,266	210,320	2024/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,000	1,645	152,669	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,400	870	80,819	2051/06/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,465	135,991	2025/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,008	186,408	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,081	100,324	2026/09/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,600	1,353	125,585	2032/11/21
		AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.0000	1,300	1,225	113,707	2033/11/21
通貨小計	銘柄数 金 額	26銘柄			42,234	38,584	3,580,216	
					千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル		
シンガポール		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	788	79,640	2027/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	923	921	93,142	2024/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	809	797	80,556	2030/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	393	39,714	2042/04/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	585	59,198	2033/09/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	617	62,436	2029/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	516	52,224	2025/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	679	68,611	2046/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	437	44,231	2026/06/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	750	687	69,422	2036/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	540	54,632	2028/05/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	490	482	48,766	2024/02/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	320	32,393	2039/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	540	443	44,767	2050/03/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	750	699	70,649	2025/11/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	600	535	54,122	2031/07/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	200	165	16,717	2051/10/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	200	187	18,940	2026/11/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	240	231	23,440	2032/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	220	233	23,606	2072/08/01
		SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	100	99	10,085	2027/09/01
通貨小計	銘柄数 金 額	21銘柄			10,749	10,365	1,047,303	
					千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル		
ニュージーランド		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	600	603	51,974	2027/04/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	400	380	32,768	2033/04/14
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	490	412	35,550	2037/04/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	600	560	48,255	2029/04/20
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	530	430	37,117	2031/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	350	235	20,326	2041/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	700	658	56,757	2024/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	400	322	27,785	2028/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	500	436	37,631	2026/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	440	368	31,715	2032/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	380	284	24,546	2051/05/15
		NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	640	613	52,812	2025/04/15
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄			6,030	5,308	457,242	

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)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額			
					千円	千円		
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	921	千円	893	148,512	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,282	千円	1,116	185,532	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	千円	1,382	229,794	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,760	千円	1,200	199,520	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,450	千円	1,170	194,550	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,810	千円	1,272	211,591	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,410	千円	1,292	214,782	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,500	千円	1,378	229,182	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,040	千円	694	115,507	2027/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	1,800	千円	1,745	290,207	2024/04/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,210	千円	869	144,588	2049/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	千円	574	95,580	2054/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	1,500	千円	1,291	214,768	2029/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,900	千円	1,785	296,750	2025/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,190	千円	835	138,819	2041/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	1,300	千円	1,051	174,817	2030/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	1,700	千円	737	122,672	2061/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	千円	1,367	227,360	2026/01/30
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,600	千円	1,368	227,402	2028/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	千円	564	93,829	2050/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,700	千円	1,226	203,878	2035/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,300	千円	1,253	208,354	2024/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	2,500	千円	1,955	325,129	2031/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	500	千円	297	49,387	2046/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	500	千円	448	74,594	2026/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	800	千円	492	81,906	2051/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.2500	100	千円	93	15,535	2025/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	900	千円	643	106,898	2039/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.5000	700	千円	594	98,764	2029/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.8750	300	千円	236	39,270	2033/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	300	千円	195	32,529	2053/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.0000	2,100	千円	1,738	288,908	2032/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	820	千円	441	73,419	2073/10/22
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.1250	2,000	千円	2,052	341,137	2027/01/29
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	千円	1,088	180,943	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,240	千円	2,454	407,985	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	千円	1,528	254,071	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,362	千円	1,491	247,952	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,357	千円	1,574	261,740	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	千円	2,035	338,348	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,366	千円	1,541	256,319	2046/12/07
United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	千円	1,287	213,959	2027/12/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,116	千円	2,437	405,119	2042/12/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,600	千円	1,789	297,533	2030/12/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	千円	1,536	255,412	2049/12/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	千円	1,586	263,806	2039/09/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,560	千円	1,751	291,074	2034/09/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,174	千円	1,384	230,156	2060/01/22	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	千円	1,740	289,284	2040/12/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	千円	1,666	276,987	2052/07/22	
United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,866	千円	1,799	299,114	2044/01/22	

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)

区 分		当 期				未		
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,386	1,534	255,081	2068/07/22
		United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,092	1,081	179,742	2024/09/07
		United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,524	1,530	254,395	2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	54銘柄			72,730	67,102	11,154,519	
					千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル		
イスラエル		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	1,800	1,989	80,230	2026/10/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,600	2,051	82,743	2042/01/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,000	2,009	81,051	2024/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,204	88,903	2025/08/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,704	68,754	2027/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,400	2,479	100,012	2047/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,200	1,132	45,659	2028/09/28
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,500	1,475	59,528	2023/11/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	2,400	2,045	82,492	2030/03/31
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.5000	1,600	1,494	60,266	2025/04/30
		Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,700	1,330	53,681	2037/05/31
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.5000	200	182	7,358	2026/02/27
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.4000	900	850	34,313	2024/10/31
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	1.3000	300	252	10,182	2032/04/30
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄			21,700	21,202	855,180	
					千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		
デンマーク		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	13,662	18,287	353,135	2039/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	4,821	93,098	2023/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	5,954	114,984	2025/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	5,100	4,729	91,335	2027/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	8,590	7,706	148,821	2029/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,500	2,239	43,246	2052/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	414	7,998	2031/11/15
		DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	957	18,488	2024/11/15
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄			43,211	45,111	871,107	
					千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
ノルウェー		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,072	56,608	2024/03/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	5,395	5,200	72,284	2025/03/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,340	4,099	56,987	2026/02/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,450	4,188	58,218	2027/02/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,299	45,856	2028/04/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	3,530	49,068	2029/09/06
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	6,800	5,992	83,301	2030/08/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,500	3,003	41,750	2031/09/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1250	1,700	1,563	21,728	2032/05/18
通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄			37,630	34,949	485,804	
					千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ		
スウェーデン		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,655	5,812	76,369	2039/03/30
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	8,025	7,951	104,478	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,595	7,612	100,025	2025/05/12
		SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	6,867	90,242	2026/11/12

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)

		当 期			未			
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ	千円		
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,050	4,728	62,130	2028/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,300	3,421	44,952	2032/06/01	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	6,400	5,906	77,616	2029/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	5,000	4,325	56,832	2031/05/12	
通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄		47,205	46,624	612,648		
メキシコ				千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ			
	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	37,290	33,350	240,865	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	21,300	18,817	135,906	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	23,800	22,992	166,057	2024/09/05	
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	7,000	6,065	43,808	2027/03/04	
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	1,000	898	6,486	2025/03/06	
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	3,000	2,636	19,039	2053/07/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	28,033	27,286	197,068	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	23,919	23,833	172,131	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	27,968	26,130	188,719	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	9,413	67,983	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,544	28,513	205,928	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	18,894	17,700	127,833	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	32,515	29,769	214,998	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	21,654	18,672	134,859	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,944	7,104	51,311	2034/11/23	
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		292,735	273,185	1,972,998		
中国				千オフショア・人民元	千オフショア・人民元			
	China Government Bond	国債証券	3.2200	5,200	5,313	103,162	2025/12/06	
	China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,155	100,100	2028/11/22	
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,000	5,171	100,408	2029/05/23	
	China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,132	99,656	2026/06/06	
	China Government Bond	国債証券	3.1200	12,000	12,285	238,532	2026/12/05	
	China Government Bond	国債証券	3.1300	8,000	8,191	159,047	2029/11/21	
	China Government Bond	国債証券	2.8500	13,000	13,116	254,661	2027/06/04	
	China Government Bond	国債証券	2.6800	6,500	6,405	124,358	2030/05/21	
	China Government Bond	国債証券	2.8800	37,000	37,276	723,735	2023/11/05	
	China Government Bond	国債証券	3.0200	18,000	18,336	356,001	2025/10/22	
	China Government Bond	国債証券	3.2800	9,000	9,257	179,741	2027/12/03	
	China Government Bond	国債証券	3.2700	12,500	12,986	252,130	2030/11/19	
	China Government Bond	国債証券	3.0300	7,000	7,125	138,335	2026/03/11	
	China Government Bond	国債証券	3.8100	7,300	7,983	154,999	2050/09/14	
	China Government Bond	国債証券	3.0100	7,000	7,089	137,644	2028/05/13	
	China Government Bond	国債証券	3.7200	8,000	8,618	167,320	2051/04/12	
	China Government Bond	国債証券	3.0200	5,800	5,868	113,936	2031/05/27	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,513	87,620	2026/08/12	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7400	5,000	5,037	97,803	2026/08/04	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5700	11,000	11,249	218,402	2024/06/22	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5900	5,500	5,751	111,661	2027/08/03	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	15,000	15,413	299,248	2024/09/21	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	5,000	5,297	102,851	2028/05/17	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6100	17,000	17,537	340,488	2025/06/07	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5400	4,500	4,722	91,690	2028/08/16	

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)

区 分		当 期				未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額			
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円			
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0800	4,500	5,070	98,444	2048/10/22	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8600	6,300	6,931	134,575	2049/07/22	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7700	11,000	11,372	220,804	2025/03/08	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	12,000	12,187	236,619	2050/03/16	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	5,500	5,543	107,635	2028/10/14	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	3,500	3,632	70,524	2051/10/18	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	6,000	6,011	116,709	2031/11/18	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	17,000	16,825	326,662	2027/01/20	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	7,200	7,116	138,165	2032/02/17	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2600	10,000	9,963	193,451	2025/02/24	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	15,000	14,962	290,508	2029/03/24	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	5,500	5,547	107,703	2052/04/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	5,000	4,931	95,740	2032/05/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	4,000	3,977	77,230	2029/06/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,000	3,924	76,196	2032/08/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	12,000	11,715	227,456	2032/09/01	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9900	2,000	1,988	38,602	2024/09/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	9,500	9,349	181,528	2029/09/25	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	2,200	2,174	42,217	2027/10/15	
通貨小計	銘柄数 金額	44銘柄			381,000	388,062	7,534,316		
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット			
マレーシア		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,325	71,598	2027/05/31	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,197	36,857	2030/04/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,535	47,288	2026/04/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,298	39,969	2031/06/30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	728	22,427	2027/03/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,371	42,220	2033/04/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,853	57,061	2028/06/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	1,300	1,368	42,127	2043/09/30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,067	32,864	2024/07/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,740	53,583	2025/09/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,206	37,133	2035/05/31	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	949	29,233	2046/03/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,550	1,546	47,601	2026/11/30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,550	1,563	48,140	2024/09/30	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,184	36,474	2027/11/16	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,950	2,036	62,688	2037/04/07	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,201	36,991	2025/03/14	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,231	37,917	2033/11/07	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	600	632	19,462	2038/06/08	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	649	19,987	2026/07/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,310	2,266	69,782	2029/08/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,254	38,626	2048/07/06	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400	400	12,316	2024/06/14	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,237	38,086	2034/07/05	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,604	49,396	2040/05/22	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	2,650	2,439	75,111	2050/06/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,800	1,596	49,161	2031/04/15	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	500	478	14,735	2032/07/15	

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)

区 分		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	400	412	12,687	2042/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5040	500	510	15,733	2029/04/30
通貨小計	銘柄数	30銘柄						
	金 額				39,353	38,885	1,197,267	
					千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,377	3,742	114,954	2026/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	2,624	80,601	2027/07/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,870	2,712	83,292	2024/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840	3,811	117,058	2029/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,400	3,122	95,909	2024/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.7500	2,000	1,742	53,509	2025/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,000	2,019	62,022	2030/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.2500	2,200	1,703	52,332	2026/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	891	27,392	2024/07/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	1,192	36,612	2032/04/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	500	436	13,416	2027/05/25
		Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	785	24,137	2029/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,650	2,996	92,013	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,591	4,176	128,273	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金 額				38,225	31,959	981,527	
					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	1,105	158,770	2025/03/13
		IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	617	88,676	2024/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	961	973	139,774	2030/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	931	832	119,510	2045/02/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,035	148,700	2026/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	491	70,602	2037/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	746	107,202	2028/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	750	671	96,369	2033/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	750	700	100,569	2031/03/18
		IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	950	884	127,024	2029/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	600	475	68,280	2050/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	350	270	38,879	2035/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	500	458	65,857	2027/05/15
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	681	97,851	2030/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	—	800	653	93,791	2031/10/18
		IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	400	277	39,905	2041/04/22
		IRISH TREASURY	国債証券	0.3500	100	82	11,849	2032/10/18
国小計	銘柄数	17銘柄						
	金 額				11,953	10,959	1,573,613	
					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	1,327	190,588	2028/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,755	2,127	305,453	2037/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,729	2,158	309,937	2042/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,468	1,508	216,597	2033/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,929	2,193	314,923	2047/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,512	217,232	2024/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,711	245,690	2025/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,938	1,836	263,735	2026/07/15

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）

区 分		当 期				未		償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,078	298,458	2027/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,367	196,404	2024/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,258	180,698	2028/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,064	152,892	2029/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	687	98,719	2040/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,198	172,016	2030/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	736	105,758	2027/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,250	720	103,458	2052/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,087	156,158	2031/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	646	92,812	2038/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	792	113,801	2029/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	93	13,471	2026/01/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	600	513	73,684	2032/07/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	298	42,884	2054/01/15
国 小 計	銘柄数 金 額	22銘柄			27,863	26,921	3,865,379	
					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	1,646	236,460	2025/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	1,594	228,883	2031/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	950	136,508	2038/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,463	1,408	202,171	2026/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	999	143,439	2047/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	740	665	95,480	2066/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,100	1,035	148,616	2027/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,019	146,371	2024/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	580	533	76,568	2057/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	600	510	73,329	2037/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,490	1,384	198,813	2028/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	650	580	83,277	2033/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,377	197,752	2029/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	700	565	81,205	2050/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,037	149,016	2030/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	860	583	83,840	2040/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,079	154,933	2027/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,600	1,298	186,456	2031/10/22
		Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	530	265	38,076	2071/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	400	328	47,112	2032/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	800	588	84,552	2053/06/22
		BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	400	57,556	2039/04/22
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	1,994	286,336	2028/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,904	2,372	340,706	2035/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	1,946	279,416	2041/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,078	154,876	2026/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	879	126,347	2032/03/28
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	643	750	107,812	2045/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,515	217,635	2024/06/22
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	776	111,424	2034/06/22
国 小 計	銘柄数 金 額	30銘柄			32,548	31,167	4,474,981	

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)

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	
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	3,350	481,028	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	3,967	569,715	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,227	4,190	601,600	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	3,264	468,649	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,764	2,273	326,393	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	2,785	399,960	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,164	3,996	573,760	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,217	1,599	229,611	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,646	3,803	546,138	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	5,899	6,062	870,422	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	3,088	3,404	488,750	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	6,086	6,091	874,684	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,087	5,200	746,737	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,899	4,856	697,314	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,352	481,356	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	4,934	708,437	2025/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,120	4,839	694,815	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,387	4,145	595,159	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	4,169	3,533	507,360	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,387	1,113	159,901	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,050	3,761	540,078	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	2,294	329,495	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,233	464,300	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,550	2,254	323,636	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,400	5,000	717,996	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	3,449	495,306	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	4,550	653,408	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,305	474,674	2024/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,850	2,244	322,263	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,350	3,904	560,641	2029/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,330	4,116	591,039	2025/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	3,604	517,597	2029/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,770	1,752	251,555	2052/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,798	401,802	2026/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	1,550	222,683	2040/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	3,350	481,004	2030/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,480	689	99,047	2072/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	97	13,985	2024/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	991	142,307	2044/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,600	3,756	539,311	2031/11/25
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,100	2,831	406,592	2027/02/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,500	930	133,574	2053/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,687	242,242	2032/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,999	287,075	2025/02/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	200	164	23,684	2038/05/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	300	278	40,003	2028/02/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,300	1,256	180,354	2032/11/25	
FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,000	973	139,740	2043/05/25	
国 小 計	銘柄数 金 額	48銘柄		150,364	143,593	20,617,203	

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）

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	
ユーロ（ドイツ）	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,020	146,464	2024/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,397	200,596	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	2,544	365,364	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,090	156,531	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	2,512	360,744	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,048	3,856	553,669	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,305	2,978	427,616	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,271	4,089	587,184	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	1,744	250,423	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,739	2,448	351,552	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,974	2,395	343,938	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	3,123	448,521	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,556	223,523	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	3,024	434,255	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,582	227,200	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,042	3,977	571,029	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,125	305,157	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,134	2,080	298,773	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,368	2,264	325,091	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,257	324,141	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,200	3,926	563,742	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,300	3,099	445,096	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,770	2,474	355,284	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,772	254,453	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,100	3,744	537,610	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	1,994	286,385	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,651	380,722	2029/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,850	1,770	254,262	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,531	219,934	2030/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,646	236,402	2035/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,825	262,044	2027/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,562	224,362	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,041	149,571	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	773	111,026	2031/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,077	154,666	2036/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,791	257,281	2028/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	684	98,333	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,600	3,065	440,202	2031/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	596	85,618	2031/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,515	217,609	2032/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	400	348	49,967	2038/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	2,700	2,650	380,517	2032/08/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,200	1,197	171,963	2053/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	200	202	29,114	2029/11/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	721	103,610	2052/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	4,116	591,047	2023/12/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	97	13,997	2024/03/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2000	100	97	13,965	2024/06/14	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4000	530	515	73,947	2024/09/13	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,869	268,442	2024/04/05	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,637	235,086	2024/10/18	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,291	329,009	2025/04/11	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,177	312,635	2025/10/10	

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)

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	94	13,635	2025/10/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,065	296,506	2026/04/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,207	173,308	2026/10/09	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	92	13,218	2027/04/16	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	3,000	2,915	418,631	2027/10/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	430	418	60,058	2027/10/15	
国 小 計	銘柄数 金 額	59銘柄		113,416	111,332	15,985,058		
ユーロ (スペイン)				千ユーロ	千ユーロ			
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	3,177	456,296	2029/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	2,015	289,384	2025/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	1,951	280,224	2030/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,187	314,107	2025/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	2,700	387,750	2026/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	1,872	268,869	2046/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	1,603	230,249	2066/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,630	2,530	363,315	2026/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	1,828	262,599	2027/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,750	1,663	238,812	2033/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	1,954	280,649	2027/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,400	2,264	325,194	2028/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,200	1,098	157,749	2048/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,900	2,728	391,786	2028/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,496	214,834	2029/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,250	1,974	283,477	2035/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,226	319,742	2024/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,452	352,140	2029/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,360	1,166	167,542	2030/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,383	342,190	2025/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	844	121,300	2050/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,226	319,667	2027/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,400	2,157	309,839	2030/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,300	944	135,615	2040/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	464	66,684	2026/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	2,200	1,770	254,188	2031/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	289	41,626	2024/05/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	650	365	52,450	2071/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	439	63,106	2028/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	1,900	1,384	198,779	2037/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,562	224,316	2031/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	600	412	59,176	2042/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	813	116,794	2027/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	2,100	1,736	249,261	2032/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9000	600	444	63,775	2052/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	94	13,548	2025/05/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	100	88	12,752	2029/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	1,000	970	139,282	2032/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,000	1,022	146,832	2043/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,179	2,733	392,465	2032/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	1,754	1,980	284,429	2037/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	1,158	1,434	205,974	2040/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	1,732	248,799	2024/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,973	2,406	345,478	2041/07/30	

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)

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	4.6500	2,789	2,961	425,260	2025/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,214	317,906	2026/07/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	1,937	278,117	2023/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,018	289,774	2028/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	1,705	244,854	2044/10/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,012	288,965	2024/04/30
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,116	303,911	2024/10/31
国 小 計	銘柄数	51銘柄						
	金 額				87,203	84,565	12,141,857	
					千ユーロ	千ユーロ		
ユーロ (イタリア)		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	906	958	137,686	2023/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,287	184,838	2026/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	2,759	396,158	2027/11/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,809	259,802	2024/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	1,377	197,760	2046/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,407	345,681	2025/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	1,745	250,625	2032/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,891	2,814	404,064	2025/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	1,338	192,191	2047/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,386	2,275	326,689	2026/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	1,941	278,829	2036/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	997	143,281	2026/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	756	108,569	2067/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,312	188,422	2033/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,454	208,898	2027/06/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,285	184,597	2024/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,250	1,175	168,744	2048/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,700	2,574	369,643	2027/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,566	224,933	2024/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,152	165,524	2038/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	1,978	284,108	2028/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,260	180,953	2025/05/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,550	2,481	356,349	2028/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,533	220,136	2025/11/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,198	172,016	2035/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,650	1,650	237,015	2049/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	1,855	266,464	2029/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,200	2,170	311,668	2024/07/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	2,100	2,034	292,092	2026/07/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	1,250	1,119	160,673	2040/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	1,638	235,313	2030/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,300	1,236	177,552	2025/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,152	309,019	2027/01/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,550	1,196	171,741	2050/09/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,135	162,968	2036/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,500	1,460	209,688	2025/07/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	1,652	237,323	2030/08/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,100	1,823	261,811	2030/12/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,200	1,987	285,362	2027/09/15
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,571	225,706	2026/02/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,500	1,096	157,431	2041/03/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,900	1,536	220,669	2031/04/01
		ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,069	153,533	2024/01/15

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)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額		
					千 円	千 円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	1,200	784	112,647	2051/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	700	484	69,572	2037/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,620	232,664	2028/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,800	1,399	200,999	2031/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	700	459	66,022	2045/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	993	142,709	2026/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,448	207,978	2024/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	460	302	43,387	2072/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	684	98,331	2028/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,509	216,683	2031/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	956	137,377	2024/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,165	167,359	2024/01/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,100	2,776	398,705	2026/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,700	1,331	191,243	2032/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	900	753	108,121	2029/02/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	285	40,952	2024/12/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	800	569	81,787	2052/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	195	28,029	2023/11/29
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1000	300	275	39,581	2027/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	500	477	68,555	2025/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	800	769	110,476	2029/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,300	2,950	423,675	2032/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	300	275	39,541	2038/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	100	98	14,157	2024/05/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6500	200	194	27,884	2027/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	500	504	72,484	2035/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	300	303	43,568	2026/01/15
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	3,254	3,638	522,447	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	3,361	482,669	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,096	301,055	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	2,529	363,198	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	2,785	399,959	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	2,304	330,851	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,223	319,225	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	2,543	365,265	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,167	311,221	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	2,591	372,090	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	2,027	291,120	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,245	322,385	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,242	322,023	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,318	2,329	334,472	2030/03/01
国 小 計	銘柄数 金 額	84銘柄		135,077	128,493	18,449,036	
ユーロ (フィンランド)	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	364	318	45,696	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	269	38,765	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	768	110,313	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	297	42,672	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	736	105,721	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	470	405	58,202	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	451	64,832	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	442	63,535	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	192	27,691	2024/09/15

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）

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	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	225	32,404	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	269	38,764	2040/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	500	416	59,801	2030/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	219	31,568	2052/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	493	70,830	2031/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	183	26,407	2026/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	450	308	44,354	2043/04/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	300	275	39,491	2032/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	270	259	37,306	2027/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	700	100,523	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	398	57,262	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	413	59,392	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	528	75,897	2024/04/15
国 小 計	銘柄数 金 額	22銘柄		9,706	8,576	1,231,438	
ユーロ（オーストリア）				千ユーロ	千ユーロ		
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	1,373	1,340	192,406	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,070	153,750	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	645	92,621	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	170	24,516	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,191	171,119	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	465	66,812	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	1,115	160,188	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,148	164,924	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	800	773	111,020	2024/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	—	980	826	118,690	2030/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	464	66,622	2051/03/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	255	36,677	2040/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.8500	350	177	25,537	2120/06/30
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,200	984	141,336	2031/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	480	456	65,493	2025/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	438	62,987	2036/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	300	157	22,561	2071/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	262	37,690	2028/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	500	434	62,439	2032/02/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	264	37,954	2049/05/23
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	298	42,875	2026/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	974	139,886	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,373	1,623	233,065	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	951	136,652	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	441	63,427	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	723	800	114,895	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	762	109,419	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	923	132,618	2024/10/21
国 小 計	銘柄数 金 額	28銘柄		20,870	19,419	2,788,191	
通貨小計	銘柄数 金 額	361銘柄		589,000	565,028	81,126,760	
合 計	銘柄数 金 額	920銘柄				236,705,030	

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年11月30日現在

項目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 236,705,030	% 98.0
コール・ローン等、その他	4,798,267	2.0
投資信託財産総額	241,503,298	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=138.87円、1カナダ・ドル=102.16円、1オーストラリア・ドル=92.79円、1シンガポール・ドル=101.04円、1ニュージーランド・ドル=86.13円、1イギリス・ポンド=166.23円、1イスラエル・シケル=40.334円、1デンマーク・クローネ=19.31円、1ノルウェー・クローネ=13.90円、1スウェーデン・クローネ=13.14円、1メキシコ・ペソ=7.222円、1オフショア・人民元=19.415円、1マレーシア・リンギット=30.789円、1ポーランド・ズロチ=30.711円、1ユーロ=143.58円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (239,018,141千円) の投資信託財産総額 (241,503,298千円) に対する比率は、99.0%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年11月30日現在

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

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

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワ外国債券インデックスVA	447,343,827円
ダイワ国内重視バランスファンド3 0 VA (一般投資家私募)	9,071,985円
ダイワ国内重視バランスファンド5 0 VA (一般投資家私募)	51,739,813円
ダイワ国際分散バランスファンド3 0 VA (一般投資家私募)	19,793,735円
ダイワ国際分散バランスファンド5 0 VA (一般投資家私募)	243,846,488円
外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	347,889,324円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし)	589,471,225円
ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)	2,679,395,542円
ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス エマージングプラス (為替ヘッジなし)	612,758,959円
D-1's 外国債券インデックス	992,049円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	12,619,026円

iFree 外国債券インデックス	2,022,055,185円
iFree 8資産バランス	1,843,024,587円
iFree 年金バランス	342,801,665円
DCダイワ外国債券インデックス	50,603,926,450円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	1,059,415,494円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	676,505,626円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	451,133,774円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	638,338,066円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	501,969,526円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	192,677,874円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	31,943,484円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	13,831,284円
ダイワつみたてインデックス外国債券	1,384,617,622円
ダイワつみたてインデックスバランス3 0	3,873,500円
ダイワつみたてインデックスバランス5 0	1,528,422円
ダイワつみたてインデックスバランス7 0	2,590,775円
ダイワ先進国債券インデックス (為替ヘッジなし) (ラップ専用)	159,668,286円
ダイワ世界バランスファンド4 0 VA	115,798,326円
ダイワ世界バランスファンド6 0 VA	36,264,152円
ダイワ・バランスファンド3 5 VA	3,287,759,159円
ダイワ・バランスファンド2 5 VA (適格機関投資家専用)	199,611,808円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	150,551,922円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	49,437,293円
ダイワ外国債券インデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用)	1,733,569,277円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,720,730,269円
ダイワライフスタイル2 5	28,448,488円
ダイワライフスタイル5 0	58,536,147円
ダイワライフスタイル7 5	14,977,183円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は31,615円です。

■損益の状況

当期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

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

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

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

新興国株式インデックス ファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

運用報告書 (全体版) 第 5 期

(決算日 2023年 7月 5日)

(作成対象期間 2022年 7月 6日～2023年 7月 5日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信託期間	無期限 (設定日：2018年 9月18日)	
運用方針	投資成果を FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	1. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式 (上場予定および店頭登録予定を含みます。) 2. 新興国の企業の DR (預託証券) 3. FTSE RAFI エマージング インデックスとの連動をめざす E T F (上場投資信託証券)
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、新興国の株式に投資し、投資成果を FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算) の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			FTSE RAFI エマーヅング インデックス (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 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
1 期末 (2019年 7月 5日)	10,564	0	5.6	10,644	6.4	87.3	1.3	10.7	14
2 期末 (2020年 7月 6日)	9,097	0	△ 13.9	9,155	△ 14.0	82.6	3.0	13.7	28
3 期末 (2021年 7月 5日)	12,539	0	37.8	12,600	37.6	88.1	8.7	2.9	57
4 期末 (2022年 7月 5日)	12,633	0	0.7	12,750	1.2	81.5	7.5	10.5	103
5 期末 (2023年 7月 5日)	14,744	0	16.7	15,101	18.4	82.9	7.5	8.9	188

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注 2) FTSE RAFI エマーヅング インデックス (税引後配当込み、円換算) は、FTSE International Limited の承諾を得て、FTSE RAFI エマーヅング インデックス (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。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE International Limited と Research Affiliates LLC に帰属します。また、FTSE International Limited は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

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

(注 6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

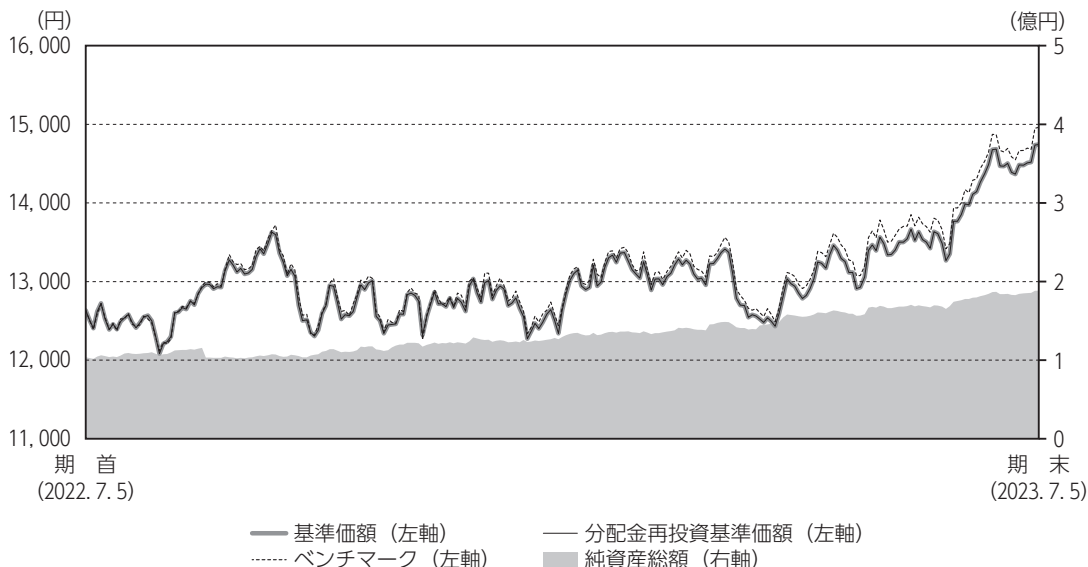
(注 7) 株式先物比率は買建比率 - 売建比率です。

※ベンチマークを「FTSE RAFI エマーヅング インデックス (配当込み、円換算)」から「FTSE RAFI エマーヅング インデックス (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



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

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

基準価額・騰落率

期首：12,633円

期末：14,744円（分配金0円）

騰落率：16.7%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

ベンチマークへの連動をめざした運用を行いました。米国の金融引き締めや世界的なインフレ率の高止まりはありましたが、世界的な株高を背景に新興国株式市況は上昇しました。また、新興国為替相場についても対円で上昇（円安）したことがプラス要因となり、基準価額は上昇して当作成期末を迎えました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

年 月 日	基 準 価 額		FTSE RAFI エマージング インデックス (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 組入比率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
		%		%	%	%	%
(期首) 2022年 7月 5日	12,633	—	12,750	—	81.5	7.5	10.5
7月末	12,499	△ 1.1	12,588	△ 1.3	83.5	5.9	10.1
8月末	13,121	3.9	13,339	4.6	81.0	8.7	9.8
9月末	12,305	△ 2.6	12,432	△ 2.5	81.5	8.5	9.5
10月末	12,453	△ 1.4	12,596	△ 1.2	79.5	8.2	9.3
11月末	12,946	2.5	13,125	2.9	82.2	8.1	9.1
12月末	12,507	△ 1.0	12,700	△ 0.4	83.2	8.0	8.9
2023年 1月末	13,260	5.0	13,489	5.8	82.2	7.9	8.7
2月末	13,044	3.3	13,258	4.0	83.4	7.6	8.6
3月末	13,034	3.2	13,236	3.8	86.9	5.6	7.4
4月末	13,058	3.4	13,322	4.5	86.0	5.5	8.3
5月末	13,484	6.7	13,786	8.1	85.2	5.4	9.1
6月末	14,509	14.8	14,835	16.3	83.5	7.5	8.9
(期末) 2023年 7月 5日	14,744	16.7	15,101	18.4	82.9	7.5	8.9

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2022. 7. 6 ~ 2023. 7. 5)

■新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

新興国株式市況は、当作成期首より、米国の金融引き締め加速懸念から一進一退で推移しました。2022年9月には、世界的なインフレ率の高止まりや主要中央銀行の積極的な利上げによる景気悪化懸念などを背景に下落しました。10月には、中国共産党大会を受けて習近平国家主席への権力集中に対する懸念が高まったことなどを背景に、中国株を中心に大幅な下落となりました。その後は、ゼロコロナ政策の緩和が好感された中国を中心に反発して推移しました。2023年2月以降は、米国の金融引き締め長期化への警戒感から下落しました。その後は欧米金融機関の信用不安を受けた投資家心理の悪化を背景に一時的に下落しましたが、米国当局が必要に応じて支援を拡充する構えを示したことなどを受け、金融システムへの警戒感が後退する中、反発して当作成期末を迎えました。

■為替相場

新興国為替相場は対円で上昇しました。

新興国為替相場は、当作成期首より、新興国の多くがインフレ対策や通貨防衛などのために金融引き締めを行っており、利上げ傾向にありました。また、堅調な米国経済指標や複数のF R B（米国連邦準備制度理事会）高官による金融引き締めを継続する発言から米国金利が上昇し、日米金利差の拡大を背景に、米ドル円相場が円安米ドル高方向に進行したことから、新興国通貨も対円で上昇して推移しました。2022年11月以降は、F R Bの金融引き締め観測の後退から米国金利が低下する中、日米金利差の縮小により円高が進行したことなどから、多くの通貨が対円で下落（円高）しました。12月には日銀がイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の長期金利の上限引き上げを実施したことで、円高が進行したことから、多くの通貨が対円で下落しました。2023年1月には、日銀が金融緩和政策の維持を決定したことで一時的に円安米ドル高が進行する局面もありましたが、日米金利差の縮小などにより円高米ドル安基調が継続しました。その後、日銀が金融緩和政策の維持姿勢を表明したことなどから、新興国通貨は上昇基調で推移して当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、主として「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2022.7.6～2023.7.5)

■当ファンド

「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の受益証券組入比率をおおむね100%程度に維持しました。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオ構築にあたっては、FTSE RAFI エマージング インデックスの組入比率上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、DR（預託証券）等の組み入れを行いました。また、効率性の観点からETF（上場投資信託証券）および株価指数先物を利用し、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	FTSE RAFI エマージング インデックス（税引後配当込み、円換算）

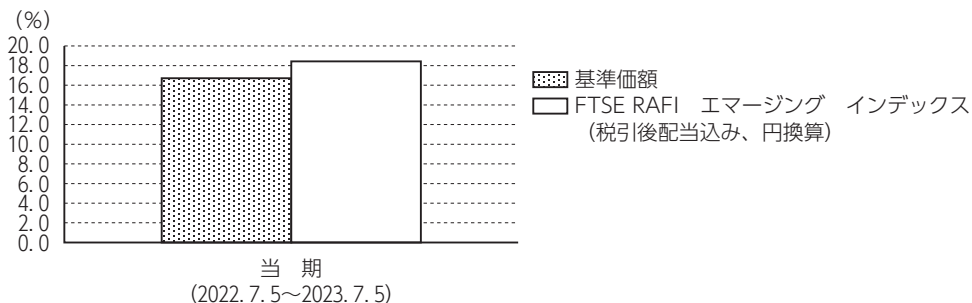
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は18.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は16.7%となりました。

売買手数料・保管費用等のコスト負担が、マイナス要因となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



*ベンチマークは FTSE RAFI エマージング インデックス (税引後配当込み、円換算) です。

分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2022年7月6日 ～2023年7月5日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	5,066

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



今後の運用方針

■当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、主として「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2022. 7. 6~2023. 7. 5)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	19円	0. 143%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は13, 047円です。
(投 信 会 社)	(14)	(0. 110)	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)	(1)	(0. 011)	販売会社分は、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	9	0. 068	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)	(8)	(0. 059)	
(先 物・オ プ シ ョ ン)	(1)	(0. 007)	
(投 資 証 券)	(0)	(0. 002)	
有 価 証 券 取 引 税	5	0. 039	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)	(5)	(0. 039)	
(投 資 証 券)	(0)	(0. 000)	
そ の 他 費 用	27	0. 210	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)	(19)	(0. 148)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0. 005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(7)	(0. 057)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	60	0. 460	

(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。

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年7月6日から2023年7月5日まで)

項目	設定		解約	
	□数 千口	金額 千円	□数 千口	金額 千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	39,615	77,264	9,700	19,069

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2022年7月6日から2023年7月5日まで)

項目	当期
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	11,745,377千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	20,191,877千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.58

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■投信会社(自社)による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首保有額	当作成期中設定額	当作成期中解約額	当作成期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
10	—	10	—	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	期末		
	□数 千口	□数 千口	評価額 千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	53,866	83,781	188,375

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年7月5日現在

項目	当期末	
	評価額 千円	比率 %
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	188,375	99.9
コール・ローン等、その他	166	0.1
投資信託財産総額	188,541	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=144.56円、1香港・ドル=18.46円、1台湾・ドル=4.644円、1トルコ・リラ=5.562円、1メキシコ・ペソ=8.478円、100チリ・ペソ=18.091円、1サウジアラビア・リアル=38.61円、1インド・ルピー=1.77円、100インドネシア・ルピア=0.97円、1ブラジル・レアル=29.85円、1オフショア・人民元=19.993円、1マレーシア・リンギット=31.102円、1南アフリカ・ランド=7.75円、1タイ・バーツ=4.14円です。

(注3) ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(29,284,962千円)の投資信託財産総額(29,841,709千円)に対する比率は、98.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年7月5日現在

項目	当期末
(A) 資産	188,541,790円
コール・ローン等	164,560
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド(評価額)	188,375,232
未収入金	1,998
(B) 負債	113,955
未払信託報酬	109,819
その他未払費用	4,136
(C) 純資産総額(A-B)	188,427,835
元本	127,800,995
次期繰越損益金	60,626,840
(D) 受益権総口数	127,800,995口
1万口当り基準価額(C/D)	14,744円

* 期首における元本額は81,957,324円、当作成期間中における追加設定元本額は60,556,951円、同解約元本額は14,713,280円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,744円です。

■損益の状況

当期 自 2022年7月6日 至 2023年7月5日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	26,247,705円
売買益	26,660,668
売買損	△ 412,963
(B) 信託報酬等	△ 198,760
(C) 当期損益金 (A + B)	26,048,945
(D) 前期繰越損益金	10,584,828
(E) 追加信託差損益金	23,993,067
(配当等相当額)	(28,120,614)
(売買損益相当額)	(△ 4,127,547)
(F) 合計 (C + D + E)	60,626,840
次期繰越損益金 (F)	60,626,840
追加信託差損益金	23,993,067
(配当等相当額)	(28,120,614)
(売買損益相当額)	(△ 4,127,547)
分配準備積立金	36,633,773

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

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	26,048,945
(c) 収益調整金	28,120,614
(d) 分配準備積立金	10,584,828
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	64,754,387
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	64,754,387
(h) 受益権総口数	127,800,995口

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

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

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

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・ インデックス・マザーファンド

運用報告書 第13期 (決算日 2023年7月5日)

(作成対象期間 2022年7月6日~2023年7月5日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

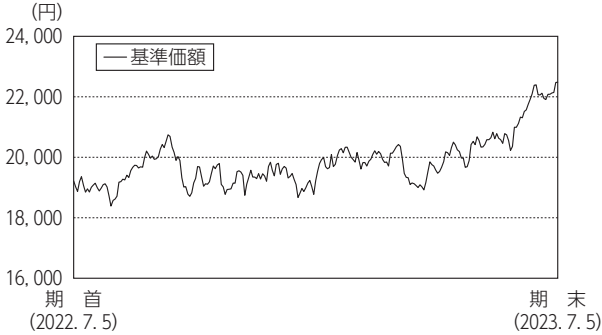
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：19,215円 期末：22,484円 騰落率：17.0%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークへの運動をめざした運用を行いました。米国の金融引き締めや世界的なインフレ率の高止まりはありましたが、世界的な株高を背景に新興国株式市況は上昇しました。また、新興国為替相場についても対円で上昇（円安）したことがプラス要因となり、基準価額は上昇して当作成期末を迎えました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○新興国株式市況

新興国株式市況は上昇しました。

新興国株式市況は、当作成期首より、米国の金融引き締め加速懸念から一進一退で推移しました。2022年9月には、世界的なインフレ率の高止まりや主要中央銀行の積極的な利上げによる景気悪化懸念などを背景に下落しました。10月には、中国共産党大会を受けて習近平国家主席への権力集中に対する懸念が高まったことなどを背景に、中国株を中心に大幅な下落となりました。その後は、ゼロコロナ政策の緩和が好感された中国を中心に反発して推移しました。2023年2月以降は、米国の金融引き締め長期化への警戒感から下落しました。その後は欧米金融機関の信用不安を受けた投資家心理の悪化を背景に一時的に下落しましたが、米国当局が必要に応じて支援を拡充する構えを示したことを受け、金融システムへの警戒感が後退する中、反発して当作成期末を迎えました。

○為替相場

新興国為替相場は対円で上昇しました。

新興国為替相場は、当作成期首より、新興国の多くがインフレ対策や通貨防衛などのために金融引き締めを行っており、利上げ傾向にありました。また、堅調な米国経済指標や複数のF R B（米国連邦準備制度理事会）高官による金融引き締めを継続する発言から米金利が上昇し、日米金利差の拡大を背景に、米ドル円相場が円安米ドル高方向に進行したこと、新興国通貨も対円で上昇して推移しました。2022年11月以降は、F R Bの金融引き締め観測の後退から米金利が低下する中、日米金利差の縮小により円高が進行したことなどから、多くの通貨が対円で下落（円高）しました。12月には日銀がイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の長期金利の上限引き上げを実施したこと、円高が進行したこと、多くの通貨が対円で下落しました。2023年1月には、日銀が金融緩和政策の維持を決定したこと、日銀が金融緩和政策の維持姿勢を表明したことなどから、新興国通貨は上昇基調で推移して当作成期末を迎えました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

ポートフォリオ構築にあたっては、FTSE RAFI エマーシング インデックスの組入比率上位銘柄を中心に投資し、一部の国では、D R（預託証券）等の組み入れを行いました。また、効率性の観点からE T F（上場投資信託証券）および株価指数先物を利用し、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

年月日	基準価額		FTSE RAFI エマーシング インデックス (税引後配当込み、円換算)		株組比	式入率	株先比	式物率	投証組比	資券入率
	騰落率	(円)	(円)	(%)						
(期首) 2022年7月5日	円	—	20,899	—	81.5	7.5	10.5			
7月末	△ 1.0	19,018	△ 1.3	20,633	83.5	5.9	10.1			
8月末	1.9	19,969	4.6	21,865	81.0	8.7	9.8			
9月末	△ 2.6	18,707	△ 2.5	20,377	81.5	8.5	9.5			
10月末	△ 1.4	18,944	△ 1.2	20,646	79.6	8.2	9.3			
11月末	2.5	19,697	2.9	21,514	82.2	8.1	9.1			
12月末	△ 1.0	19,024	△ 0.4	20,816	83.3	8.0	8.9			
2023年1月末	5.0	20,170	5.8	22,109	82.3	7.9	8.7			
2月末	3.3	19,844	4.0	21,730	83.4	7.6	8.6			
3月末	3.3	19,851	3.8	21,695	87.0	5.6	7.4			
4月末	3.5	19,889	4.5	21,835	86.0	5.5	8.3			
5月末	7.0	20,555	8.1	22,597	85.2	5.4	9.1			
6月末	15.1	22,126	16.3	24,315	83.5	7.5	8.9			
(期末) 2023年7月5日	17.0	22,484	18.4	24,752	82.9	7.5	8.9			

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) FTSE RAFI エマーシング インデックス (税引後配当込み、円換算) は、FTSE International Limited の承諾を得て、FTSE RAFI エマーシング インデックス (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。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、FTSE International Limited と Research Affiliates LLC に帰属します。また、FTSE International Limited は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

(注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

※ベンチマークを「FTSE RAFI エマーシング インデックス (配当込み、円換算)」から「FTSE RAFI エマーシング インデックス (税引後配当込み、円換算)」に変更しました。

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

◆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18.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は17.0%となりました。

売買手数料・保管費用等のコスト負担が、マイナス要因となりました。

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

*ベンチマークは FTSE RAFI エマージング インデックス (税引後配当込み、円換算) です。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

項目	当 期
売買委託手数料 (株式)	13円 (11)
(先物・オプション)	(1)
(投資証券)	(0)
有価証券取引税 (株式)	7 (7)
(投資証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	41 (29)
(その他)	(11)
合 計	61

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株 式

(2022年7月6日から2023年7月5日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	アメリカ	百株 1,754 (8,239.13)	千アメリカ・ドル 1,448 (—)	百株 992	千アメリカ・ドル 1,814
	香港	百株 228,891 (358.9)	千香港・ドル 162,014 (△ 56)	百株 56,912	千香港・ドル 32,224
	シンガポール	百株 480 (—)	千シンガポール・ドル 54 (—)	百株 3,000	千シンガポール・ドル 258
	台湾	百株 48,880 (△1,631.89)	千台湾・ドル 333,734 (△ 791)	百株 22,187.9	千台湾・ドル 58,394
	トルコ	百株 7,490 (496.68)	千トルコ・リラ 20,586 (—)	百株 24,317.23	千トルコ・リラ 74,153
	メキシコ	百株 10,918.15 (582.1)	千メキシコ・ペソ 37,437 (—)	百株 4,487.1	千メキシコ・ペソ 15,954
	チリ	百株 22,247 (—)	千チリ・ペソ 257,959 (—)	百株 33,267.8	千チリ・ペソ 394,827
	サウジアラビア	百株 1,346.44 (602.68)	千サウジアラビア・リアル 6,470 (—)	百株 1,342.96	千サウジアラビア・リアル 3,523
	インド	百株 23,539.6 (5,265.84)	千インド・ルピー 474,732 (—)	百株 17,224.56	千インド・ルピー 282,523
	インドネシア	百株 285,192 (6,890)	千インドネシア・ルピア 21,069,007 (—)	百株 5,045	千インドネシア・ルピア 2,453,296
国	ブラジル	百株 25,810 (97.59)	千ブラジル・リアル 45,723 (—)	百株 12,242.95	千ブラジル・リアル 16,957
	中国	百株 25,481 (—)	千オフショア・人民元 19,940 (—)	百株 11,208	千オフショア・人民元 6,137
	マレーシア	百株 12,512 (—)	千マレーシア・リンギット 3,104 (—)	百株 93	千マレーシア・リンギット 67
	南アフリカ	百株 7,015.43 (—)	千南アフリカ・ランド 57,735 (△ 42)	百株 12,230.75	千南アフリカ・ランド 16,873
	タイ	百株 37,532 (—)	千タイ・バーツ 76,547 (△ 60)	百株 18,741	千タイ・バーツ 30,115

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資証券

(2022年7月6日から2023年7月5日まで)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	千口 200 (—)	千アメリカ・ドル 3,641 (—)	千口 100 (—)	千アメリカ・ドル 1,758 (—)
	香港	千口 — (5.89)	千香港・ドル — (13)	千口 5.89 (—)	千香港・ドル 9 (—)

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2022年7月6日から2023年7月5日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 株式先物取引	百万円 9,190	百万円 8,527	百万円 —	百万円 —

- (注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 株 式

(2022年7月6日から2023年7月5日まで)

銘 柄	当 期			銘 柄	当 期		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	千株 161	千円 359,981	円 2,235	TRIP.COM GROUP LTD-ADR (ケイマン諸島)	千株 20.8	千円 101,485	円 4,879
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル)	289.1	189,099	654	TURK HAVA YOLLARI AO (トルコ)	111.349	97,970	879
ALIBABA GROUP HOLDING LTD (ケイマン諸島)	123	186,854	1,519	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	156.5	95,485	610
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	2,478	174,063	70	TURKIYE GARANTI BANKASI (トルコ)	426.852	75,885	177
JD.COM INC - CL A (ケイマン諸島)	62.65	173,626	2,771	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE (トルコ)	17.529	67,702	3,862
PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	223.4	159,690	714	TURKIYE IS BANKASI-C (トルコ)	654.758	67,035	102
TENCENT HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)	26.3	148,435	5,643	NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC (ケイマン諸島)	136.3	65,751	482
VALE SA (ブラジル)	69.7	142,785	2,048	BANCO DO BRASIL S. A. (ブラジル)	67.4	65,718	975
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	1,442	120,843	83	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H (中国)	736	61,229	83
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO (ケイマン諸島)	3,155	119,790	37	NASPERS LTD-N SHS (南アフリカ)	2.508	56,017	22,335

- (注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資証券

(2022年7月6日から2023年7月5日まで)

銘 柄	当 期			銘 柄	当 期		
	口 数	金 額	平均単価		口 数	金 額	平均単価
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	千口 200	千円 498,692	円 2,493	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	千口 100	千円 234,781	円 2,347
				YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN (香港)	5.89	182	30

- (注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

■組入資産明細表

(1)外国株式

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等	
			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	百株	千アメリカ・ドル	千円		
JOYY INC-ADR	34	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	137	—	—	—	一般消費財・サービス	
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	290	290	—	—	エネルギー	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	309	259	433	62,638	一般消費財・サービス	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	469	172	104	15,142	一般消費財・サービス	
CANADIAN SOLAR INC	44	43	164	23,820	情報技術	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	353.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	—	156	117	16,958	コミュニケーション・サービス	
NIO INC - ADR	—	153	153	22,184	一般消費財・サービス	
PINDUODUO INC-ADR	—	15	106	15,458	一般消費財・サービス	
KE HOLDINGS INC-ADR	—	118	177	25,587	不動産	
LUFAX HOLDING LTD-ADR	293	1,215	183	26,521	金融	
SBERBANK ROSSII	6,987.08	6,987.08	—	—	金融	
JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	30	35	156	22,596	情報技術	
BANK VTB	3,824,340	3,824,340	—	—	金融	
NK LUKOIL	—	230.88	—	—	エネルギー	
MOBILNYE TELESISTEMY	—	707	—	—	コミュニケーション・サービス	
NK ROSNEFT	—	974.99	—	—	エネルギー	
MAGNIT	—	46.78	—	—	生活必需品	
SURGUTNEFTEGAZ	—	3,607.5	—	—	エネルギー	
TATNEFT	—	576.48	—	—	エネルギー	
GAZPROM	—	8,534.78	—	—	エネルギー	
GMK NORILSKIY NIKEL	—	18.29	—	—	素材	
NOVATEK	—	269.8	—	—	エネルギー	
360 DIGITECH ADR INC	—	79	142	20,556	金融	
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	167	—	—	—	一般消費財・サービス	
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	72.9	72.9	—	—	素材	
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	96.08	—	—	—	エネルギー	
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	360.75	—	—	—	エネルギー	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	182.93	0.03	—	—	素材	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	233.94	0.04	—	—	生活必需品	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	26.98	—	—	—	エネルギー	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	230.88	—	—	—	エネルギー	
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	974.99	—	—	—	エネルギー	
GAZPROM PJSC-SPON ADR	4,267.39	—	—	—	エネルギー	
SEVERSTAL - GDR REG S	134.6	134.6	—	—	素材	
TATNEFT PJSC - PREF	210.09	210.09	—	—	エネルギー	
SISTEMA PJSC	3,192	3,192	—	—	コミュニケーション・サービス	
INTER RAO UES PJSC	27,261	27,261	—	—	公益事業	
ALROSA PJSC	1,803.1	1,803.1	—	—	素材	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	566.19	566.19	—	—	金融	
AEROFLOT PJSC	1,649.1	1,649.1	—	—	資本財・サービス	
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	3,874,716.5	3,883,717.63	1,739	251,463	
	銘柄数 < 比率 >	28銘柄	32銘柄		<0.8%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
TRIP.COM GROUP LTD	—	137.5	3,905	72,086	一般消費財・サービス	
YUM CHINA HOLDINGS INC	—	79.5	3,623	66,891	一般消費財・サービス	
CHINA CONCH ENVIRONMENT PROTECTION	290	—	—	—	資本財・サービス	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	5,690	7,650	3,970	73,292	資本財・サービス	

新興国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港・ドル	千円	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	1,930	2,980	3,021	55,780	一般消費財・サービス
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	2,170	—	—	—	資本財・サービス
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	—	180	942	17,394	生活必需品
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	—	1,160	1,382	25,525	生活必需品
JIANGXI COPPER CO LTD-H	1,060	1,470	1,805	33,323	素材
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,368	1,500	1,369	25,280	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	31,958	35,218	16,376	302,307	エネルギー
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	385	655	665	12,284	資本財・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD	614	877	29,747	549,145	コミュニケーション・サービス
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	5,440	5,440	1,202	22,193	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	1,760	1,580	2,802	51,741	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	22,280	28,740	16,324	301,346	エネルギー
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	200	375	1,203	22,221	一般消費財・サービス
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	2,371.2	15,931.2	1,210	22,350	不動産
HUANENG POWER INTL INC-H	4,280	3,560	1,751	32,333	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	695	1,200	2,502	46,186	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	620	900	741	13,689	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	41,470	55,000	27,995	516,787	金融
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	—	1,140	957	17,677	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	5,920	8,160	3,002	55,433	金融
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	755	1,075	836	15,439	不動産
GF SECURITIES CO LTD-H	500	—	—	—	金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	666	996	977	18,036	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	255	375	1,209	22,325	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	6,060	9,220	4,490	82,887	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,355	2,400	5,796	106,994	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1,431.2	2,111.2	1,469	27,125	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H	520	696	1,670	30,835	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	1,660	1,900	6,479	119,602	不動産
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	960	1,180	2,643	48,793	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,885	2,955	1,057	19,528	ヘルスケア
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	320	403	1,096	20,235	公益事業
BYD CO LTD-H	60	70	1,853	34,217	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	34,450	42,240	13,094	241,722	金融
CHINA RESOURCES CEMENT	1,420	—	—	—	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	670	936	1,984	36,630	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	7,110	7,330	2,125	39,240	金融
CITIC LTD	1,600	1,840	1,744	32,200	資本財・サービス
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,450	2,415	1,615	29,824	素材
IND & COMM BK OF CHINA-H	44,780	69,560	29,145	538,028	金融
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	—	240	945	17,455	ヘルスケア
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	—	1,705	1,140	21,056	ヘルスケア
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	—	620	637	11,765	不動産
CHINA TOWER CORP LTD-H	15,700	20,480	1,802	33,269	コミュニケーション・サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	3,328	5,904	6,565	121,194	情報技術
MEITUAN-CLASS B	177	311.9	3,979	73,467	一般消費財・サービス
SEAZEN GROUP LTD	—	5,460	846	15,622	不動産
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	3,332	4,562	38,320	707,401	一般消費財・サービス
CHINA FEIHE LTD	—	1,870	841	15,534	生活必需品
CHINA ENERGY ENGINEERING C-H	—	5,180	507	9,371	資本財・サービス
GUANGDONG INVESTMENT LTD	—	1,340	913	16,870	公益事業
JD.COM INC - CL A	285.95	912.45	12,975	239,519	一般消費財・サービス
NETEASE INC	256	384	6,044	111,575	コミュニケーション・サービス

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首 株数	当 株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千香港・ドル	千円		
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	—	69.5	1,363	25,171	資本財・サービス	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	—	351	1,144	21,123	一般消費財・サービス	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	2,870	4,200	827	15,273	資本財・サービス	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	672	732	1,734	32,025	一般消費財・サービス	
KUAISHOU TECHNOLOGY	—	188	1,048	19,347	コミュニケーション・サービス	
BAIDU INC-CLASS A	646.5	761.5	10,744	198,348	コミュニケーション・サービス	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	3,000	3,370	5,782	106,752	不動産	
CRRC CORP LTD - H	2,860	2,990	1,297	23,954	資本財・サービス	
CGN POWER CO LTD-H	5,570	7,100	1,356	25,033	公益事業	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	4,040	5,415	27,941	515,798	金融	
CHINA COAL ENERGY CO-H	1,520	1,630	963	17,783	エネルギー	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	7,460	—	—	—	不動産	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	655.5	2,400.5	1,848	34,121	資本財・サービス	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	—	950	843	15,572	不動産	
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	11,165.8	9,130.8	2,675	49,386	金融	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	4,290	35,840	5,877	108,503	不動産	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	100	156	1,310	24,189	一般消費財・サービス	
CHINA VANKE CO LTD-H	1,874	2,480	2,623	48,436	不動産	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,140	—	—	—	一般消費財・サービス	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	104	185	1,437	26,535	一般消費財・サービス	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	480	790	2,437	44,989	生活必需品	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2,420	5,000	4,370	80,670	金融	
LI NING CO LTD	—	165	726	13,401	一般消費財・サービス	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	570	—	—	—	一般消費財・サービス	
WEICHAI POWER CO LTD-H	980	1,590	1,936	35,750	資本財・サービス	
CHINA POWER INTERNATIONAL	3,970	4,180	1,228	22,685	公益事業	
SUNNY OPTICAL TECH	60	134	1,074	19,838	情報技術	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	2,640	2,700	939	17,345	素材	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	1,902	2,116	4,422	81,638	金融	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	845	696	1,069	19,734	ヘルスケア	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	3,330	3,270	4,375	80,767	金融	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	199	252	2,493	46,030	公益事業	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	—	2,050	1,031	19,035	素材	
KUNLUN ENERGY CO LTD	1,780	—	—	—	公益事業	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,040	1,360	1,629	30,076	素材	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	—	1,100	987	18,234	資本財・サービス	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,560	3,180	1,551	28,646	素材	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	9,681	11,091	5,234	96,637	金融	
CHINA EVERGRANDE GROUP	1,420	1,420	117	2,162	不動産	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	—	5,180	647	11,952	不動産	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	3,040	3,570	999	18,452	金融	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	—	9,170	1,604	29,623	情報技術	
SINOTRUK HONG KONG LTD	—	700	1,099	20,287	資本財・サービス	
CHINA MERCHANTS BANK-H	1,330	2,210	8,232	151,967	金融	
BANK OF CHINA LTD-H	45,220	53,100	16,779	309,751	金融	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	700	765	1,075	19,855	金融	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	4,240	4,990	1,127	20,818	金融	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	1,720	2,312	1,121	20,699	金融	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	940	—	—	—	一般消費財・サービス	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	835	1,810	3,482	64,285	不動産	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	—	1,240	1,171	21,631	情報技術	
香港・ドル通貨計	株数、金額	402,357.15	574,695.05	425,101	7,847,376	
	銘柄数 < 比率 >	85銘柄	99銘柄		<26.3%>	

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

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	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)					
YANGZIJIANG FINANCIAL HOLDING	1,260	—	—	—	金融
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,260	—	—	—	資本財・サービス
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,520 2銘柄	—	—	
	百株	百株	千台湾・ドル	千円	
(台湾)					
TAISHIN FINANCIAL HOLDING LTD	45.99	—	—	—	金融
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	260	470	8,413	39,075	情報技術
GLOBALWAFERS CO LTD	—	90	4,527	21,026	情報技術
SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	180	270	4,360	20,252	情報技術
TAIWAN CEMENT	1,471.45	3,812.47	14,506	67,376	素材
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	1,630	2,390	26,529	123,216	情報技術
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	—	740	3,415	15,861	金融
WALSIN TECHNOLOGY CORP	250	—	—	—	情報技術
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	651.12	1,171.12	9,005	41,828	生活必需品
FORMOSA PLASTICS CORP	1,136	1,176	9,960	46,263	素材
NAN YA PLASTICS CORP	921.4	1,311.4	9,297	43,184	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	413.9	—	—	—	素材
WALSIN LIHWA CORP	—	1,330	5,572	25,882	資本財・サービス
CHINA STEEL CORP	4,666.86	4,526.86	13,376	62,130	素材
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	546.16	1,176.16	13,996	65,007	情報技術
DELTA ELECTRONICS INC	520	550	20,185	93,751	情報技術
YAGEO CORPORATION	140	167.34	8,325	38,667	情報技術
WINBOND ELECTRONICS CORP	—	1,730	4,757	22,096	情報技術
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	570	740	4,329	20,106	情報技術
ACER INC	1,770	—	—	—	情報技術
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	630	—	—	—	情報技術
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	80	170	6,689	31,070	情報技術
QUANTA COMPUTER INC	1,060	1,100	18,755	87,109	情報技術
AUO CORP	6,670	6,516	12,217	56,745	情報技術
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	974	1,624	18,757	87,119	コミュニケーション・サービス
MEDIATEK INC	210.03	410.03	28,702	133,309	情報技術
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	290	400	7,040	32,697	情報技術
EVERGREEN MARINE CORP LTD	270	1,078	11,372	52,822	資本財・サービス
YANG MING MARINE TRANSPORT	—	1,880	10,189	47,326	資本財・サービス
CHINA AIRLINES LTD	—	1,710	4,522	21,007	資本財・サービス
WAN HAI LINES LTD	—	580	3,323	15,435	資本財・サービス
EVA AIRWAYS CORP	—	1,200	4,824	22,405	資本財・サービス
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	2,194.34	2,261.55	13,772	63,969	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	2,718.38	4,198.38	18,074	83,946	金融
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	5,820	5,190	6,331	29,408	金融
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,001.24	3,836.1	9,993	46,413	金融
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	2,133.81	2,616.82	6,031	28,015	金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,039.93	2,865.17	11,030	51,234	金融
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,340	2,415.83	4,565	21,206	金融
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	10,402.31	4,332.31	3,825	17,767	金融
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	2,180	3,841.8	6,799	31,583	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	4,230.28	5,790.28	14,388	66,830	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,722.14	2,166.58	6,023	27,974	金融
LARGAN PRECISION CO LTD	40	40	8,960	41,615	情報技術
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	110	260	11,453	53,194	情報技術
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	140	370	6,660	30,933	情報技術

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	株数	首数	当期		業種等		
			株数	株数		期末	
						外貨建金額	評価額
		百株	百株	千台湾・ドル	千円		
TAIWAN MOBILE CO LTD	—	—	490	4,630	21,506	コミュニケーション・サービス	
WISTRON CORP	1,381.1	—	2,021.1	21,221	98,565	情報技術	
INNOLUX CORP	7,230	—	6,713.75	10,439	48,489	情報技術	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	—	—	770	5,905	27,430	コミュニケーション・サービス	
PEGATRON CORP	640	—	650	4,693	21,797	情報技術	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	—	—	430	4,558	21,170	情報技術	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	260.33	—	340.33	7,146	33,194	金融	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,520	—	1,685.6	4,753	22,077	金融	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	484	—	—	—	—	情報技術	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	360	—	—	—	—	エネルギー	
POU CHEN	—	—	1,300	4,088	18,989	一般消費財・サービス	
COMPAL ELECTRONICS	1,740	—	1,720	5,203	24,165	情報技術	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,030	—	4,640	271,440	1,260,730	情報技術	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,889.02	—	5,419.02	59,609	276,860	情報技術	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	140	—	200	5,720	26,567	生活必需品	
ASUSTEK COMPUTER INC	277.6	—	397.6	11,669	54,200	情報技術	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	—	—	1,520	5,038	23,403	資本財・サービス	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	3,100	—	4,740	23,131	107,435	情報技術	
台湾・ドル通貨計	株数、金額	86,481.39	111,541.6	864,112	4,013,455		
	銘柄数 < 比率 >	51銘柄	57銘柄		<13.5%>		
(トルコ)		百株	百株	千トルコ・リラ	千円		
TURKIYE GARANTI BANKASI	4,268.52	—	—	—	—	金融	
AKBANK T. A. S.	5,781.32	—	3,857.43	8,139	45,270	金融	
TURKIYE IS BANKASI-C	8,102.36	—	3,679.78	5,295	29,451	金融	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	1,956.33	—	1,260.32	4,716	26,231	コミュニケーション・サービス	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	204.07	—	579.46	4,867	27,072	エネルギー	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	1,162.93	—	1,121.8	4,280	23,809	素材	
HACI OMER SABANCI HOLDING	2,082.02	—	1,006.94	4,742	26,378	金融	
TURKIYE HALK BANKASI	3,356.45	—	—	—	—	金融	
YAPI VE KREDI BANKASI	4,210.52	—	4,529.61	6,074	33,784	金融	
KOC HOLDING AS	1,226.98	—	827.1	8,684	48,303	資本財・サービス	
TURK HAVA YOLLARI AO	1,219.46	—	416.97	8,677	48,262	資本財・サービス	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	356.99	—	317.99	5,609	31,199	生活必需品	
トルコ・リラ通貨計	株数、金額	33,927.95	17,597.4	61,086	339,764		
	銘柄数 < 比率 >	12銘柄	10銘柄		<1.1%>		
(メキシコ)		百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円		
AMERICA MOVIL L	—	—	13,821	25,720	218,074	コミュニケーション・サービス	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	—	—	216.15	3,045	25,823	生活必需品	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	10,736	—	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	1,113	—	2,816	5,035	42,689	コミュニケーション・サービス	
CEMEX SAB-CPO	11,105.19	—	12,061.19	14,606	123,837	素材	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	881	—	808	15,227	129,106	生活必需品	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	197	—	157	2,793	23,684	生活必需品	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	—	—	374	3,450	29,252	生活必需品	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	688	—	1,274	10,755	91,187	素材	
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	1,603	—	1,536	10,570	89,624	生活必需品	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	820	—	1,093	15,416	130,711	金融	
メキシコ・ペソ通貨計	株数、金額	27,143.19	34,156.34	106,621	903,991		
	銘柄数 < 比率 >	8銘柄	10銘柄		<3.0%>		

新興国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首 株数	当 株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額 千ドル・ペソ	邦貨換算金額 千円		
(チリ)	百株	百株				
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE	2.41	—	—	—	素材	
CENCOSUD SA	671.12	—	—	—	生活必需品	
BANCO SANTANDER CHILE	42,682.55	43,014.81	164,746	29,804	金融	
ENEL AMERICAS SA	13,632.94	—	—	—	公益事業	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	18.72	24.72	154,203	27,896	素材	
FALABELLA SA	558.41	652.41	130,612	23,629	一般消費財・サービス	
BANCO DE CHILE	20,598.72	23,452.13	196,997	35,638	金融	
チリ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	78,164.87 7 銘柄	67,144.07 4 銘柄	646,560 < 0.4% >	116,969	
(サウジアラビア)	百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円		
SAUDI ARABIAN MINING	128.08	184.18	780	30,115	素材	
SABIC AGRI-NUTRIENTS	—	45.65	597	23,054	素材	
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	233.24	305.37	2,726	105,287	素材	
SAUDI TELECOM CO	164.45	500.96	2,239	86,459	コミュニケーション・サービス	
AL RAJHI BANK	254.22	376.78	2,746	106,051	金融	
RIYAD BANK	231.11	211.55	719	27,771	金融	
ETIHAD ETISALAT CO	144.62	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	72.59	—	—	—	素材	
ALINMA BANK	188.42	260.79	884	34,134	金融	
THE SAUDI NATIONAL BANK	270.87	798.03	2,972	114,774	金融	
SAUDI ARABIAN OIL CO	561.61	812.99	2,625	101,388	エネルギー	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	275.76	—	—	—	素材	
SAUDI ELECTRICITY CO	365.17	—	—	—	公益事業	
サウジアラビア・リアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,890.14 12 銘柄	3,496.3 9 銘柄	16,292 < 2.1% >	629,035	
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円		
BHARTI AIRTEL PARTLY PAID LTD	—	86.18	4,050	7,170	コミュニケーション・サービス	
TATA STEEL LTD	425.77	6,648.91	74,733	132,278	素材	
AXIS BANK LTD	526.55	580.79	56,377	99,787	金融	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	23.5	26.3	25,372	44,909	一般消費財・サービス	
TATA POWER CO LTD	556.46	532.41	11,747	20,793	公益事業	
BANK OF BARODA	873.29	802.31	16,234	28,735	金融	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	91.66	110.45	29,821	52,784	生活必需品	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	524.85	632.16	17,643	31,229	エネルギー	
STATE BANK OF INDIA	751.56	871.1	51,329	90,853	金融	
NTPC LTD	1,829.05	1,791.61	34,766	61,536	公益事業	
POWER FINANCE CORPORATION	—	1,371.08	30,335	53,693	金融	
JSW STEEL LTD	300.41	377.61	30,082	53,245	素材	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,332.5	1,589.91	39,684	70,240	公益事業	
INDIAN OIL CORP LTD	2,186.92	2,051.09	19,413	34,362	エネルギー	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	715.4	490.66	18,480	32,710	エネルギー	
STEEL AUTHORITY OF INDIA	—	1,723.76	15,039	26,620	素材	
JINDAL STEEL & POWER LTD	260.88	167.22	10,185	18,028	素材	
ULTRATECH CEMENT LTD	15.97	16.94	14,249	25,221	素材	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	46.17	—	—	—	金融	
SHRIRAM FINANCE LTD	90.2	87.66	15,583	27,582	金融	
TECH MAHINDRA LTD	117.02	202.08	23,198	41,061	情報技術	
YES BANK LTD	176.4	—	—	—	金融	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	281.75	291.97	8,959	15,857	一般消費財・サービス	

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千インド・ルピー	千円		
REC LTD	725.16	1,677	27,611	48,872	金融	
COAL INDIA LTD	1,657.98	1,244.08	28,837	51,042	エネルギー	
BAJAJ FINANCE LTD	—	20.52	16,129	28,549	金融	
INDUS TOWERS LTD	411.72	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	787.03	1,016.11	12,823	22,697	金融	
GAIL INDIA LTD	1,294.03	2,125.51	22,647	40,085	公益事業	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	659.18	1,009.66	42,991	76,094	素材	
GRASIM INDUSTRIES LTD	137.11	89.16	15,777	27,925	素材	
WIPRO LTD	155.83	315.77	12,502	22,130	情報技術	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	135.39	169.75	56,167	99,416	情報技術	
INFOSYS LTD	502.75	672.87	90,511	160,204	情報技術	
LARSEN & TOUBRO LTD	189.47	190.69	46,945	83,092	資本財・サービス	
TATA MOTORS LTD	1,289.11	1,506.26	89,087	157,685	一般消費財・サービス	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	350.93	396.74	114,453	202,582	金融	
ICICI BANK LTD	267.64	291.01	27,491	48,660	金融	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	700.02	874.77	226,456	400,827	エネルギー	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	2,316.58	2,139.69	34,491	61,050	エネルギー	
ITC LTD	909.71	650.64	30,342	53,706	生活必需品	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	363.7	278.1	40,726	72,085	一般消費財・サービス	
HERO MOTOCORP LTD	58.06	63.97	19,381	34,305	一般消費財・サービス	
BHARTI AIRTEL LTD	413.67	407.59	35,262	62,414	コミュニケーション・サービス	
UPL LTD	171.76	198.76	13,455	23,815	素材	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	154.16	163.62	17,160	30,374	ヘルスケア	
HCL TECHNOLOGIES LTD	180.04	162.58	19,356	34,261	情報技術	
VEDANTA LTD	794.58	1,215.75	33,743	59,725	素材	
インド・ルピー通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	25,751.92 44銘柄	37,332.8 45銘柄	1,621,644	2,870,310 <9.6%>	
(インドネシア)		百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
GOTO GOJEK TOKOPEDIA	—	254,670	2,775,903	26,926	一般消費財・サービス	
UNITED TRACTORS TBK PT	—	833	1,924,230	18,665	エネルギー	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	4,829	7,610	5,155,775	50,011	資本財・サービス	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	12,563	20,746	8,236,162	79,890	コミュニケーション・サービス	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	3,155	3,311	3,013,010	29,226	金融	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	7,016	8,487	7,680,735	74,503	金融	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	4,441	13,780	7,234,500	70,174	金融	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	15,072	23,682	12,906,690	125,194	金融	
ADARO ENERGY TBK PT	8,504	9,498	2,222,532	21,558	エネルギー	
インドネシア・ルピア通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	55,580 7銘柄	342,617 9銘柄	51,149,537	496,150 <1.7%>	
(ブラジル)		百株	百株	千ブラジル・リアル	千円	
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	265	310	251	7,504	公益事業	
ENERGISA SA-UNITS	147	190	957	28,590	公益事業	
RUMO SA	509	—	—	—	資本財・サービス	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	—	353	1,528	45,636	金融	
VIBRA ENERGIA SA	1,134	1,724	3,068	91,601	一般消費財・サービス	
VIA SA	2,265	4,040	876	26,169	一般消費財・サービス	
NATURA & CO HOLDING SA	412	710	1,199	35,796	生活必需品	
TIM SA	526.26	567.26	820	24,501	コミュニケーション・サービス	
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	—	358	487	14,544	生活必需品	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	555	—	—	—	ヘルスケア	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	3,763	6,654	20,061	598,849	エネルギー	

新興国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首 株数	当 株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ブラジル・リアル	千円		
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	312	787	576	17,196	素材	
BANCO BRADESCO SA-PREF	4,701.59	5,699.59	9,427	281,401	金融	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	4,159.36	3,683.36	10,600	316,433	金融	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	307	658	810	24,198	素材	
VALE SA	1,785.9	2,482.9	16,362	488,418	素材	
GERDAU SA-PREF	634	873.6	2,264	67,591	素材	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	2,491	4,725	15,946	476,017	エネルギー	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	991.73	914.73	1,163	34,731	公益事業	
ITAUSA SA	1,323.2	1,523.42	1,471	43,928	金融	
BRASKEM SA-PREF A	166	484	1,400	41,811	素材	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	245	134	588	17,567	公益事業	
BANCO DO BRASIL S. A.	1,277	1,014	5,077	151,552	金融	
COSAN SA	392	660	1,208	36,072	エネルギー	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	559	710	2,796	83,481	公益事業	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	1,084	1,460	1,192	35,605	公益事業	
EMBRAER SA	489	462	845	25,237	資本財・サービス	
METALURGICA GERDAU SA-PREF	1,192	1,390	1,698	50,702	素材	
CCR SA	786	779	1,095	32,694	資本財・サービス	
BRF SA	797	2,069	1,851	55,275	生活必需品	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	266	205	1,138	33,986	公益事業	
LOJAS RENNER S. A.	277.75	435.75	883	26,378	一般消費財・サービス	
JBS SA	801	1,466	2,571	76,755	生活必需品	
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	115	282	209	6,245	素材	
SUZANO SA	158.45	249.45	1,115	33,306	素材	
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	—	1,434	1,021	30,477	生活必需品	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,380	1,972	2,906	86,766	金融	
CIELO SA	2,931.28	1,769.28	785	23,449	金融	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	411	375	1,222	36,491	公益事業	
SUL AMERICA SA - UNITS	343.18	—	—	—	金融	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	276.3	318.3	588	17,567	公益事業	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	407	450	1,384	41,332	金融	
TELEFONICA BRASIL S. A.	340	406	1,739	51,930	コミュニケーション・サービス	
KLABIN SA - UNIT	325	396	872	26,052	素材	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	1,106	1,304	2,441	72,866	エネルギー	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	393	597	1,482	44,248	金融	
COGNA EDUCACAO	4,014	3,091	1,020	30,448	一般消費財・サービス	
BANCO BRADESCO S. A.	1,381.21	1,540.21	2,259	67,446	金融	
AMBEV SA	1,910	2,063	3,123	93,233	生活必需品	
ブラジル・リアル通貨計	株数、金額	50,105.21	63,769.85	132,397	3,952.096	
	銘柄数 < 比率 >	46銘柄	46銘柄		< 13.3% >	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円		
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	—	2,281	538	10,763	資本財・サービス	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	1,044	1,676	2,627	52,543	金融	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	1,860	2,163	1,003	20,066	金融	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	518	718	3,442	68,835	金融	
IND & COMM BK OF CHINA-A	3,012	4,746	2,292	45,832	金融	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	130	160	343	6,858	ヘルスケア	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	29	—	—	—	一般消費財・サービス	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	6	8	1,384	27,681	生活必需品	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	159	318	760	15,202	素材	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	564	681	866	17,319	不動産	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	2,719	3,429	2,496	49,911	金融	

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	株数	当株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千オフショア・人民元	千円		
CITIC SECURITIES CO-A	215	296	600	12,002	金融	
CHINA MERCHANTS BANK-A	512	895	2,999	59,964	金融	
PING AN BANK CO LTD-A	786	1,146	1,306	26,120	金融	
GF SECURITIES CO LTD-A	148	—	—	—	金融	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	4,804	5,832	3,341	66,814	資本財・サービス	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	101	222	512	10,239	一般消費財・サービス	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	871	1,082	1,563	31,260	一般消費財・サービス	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	439	439	160	3,212	金融	
CHINA COAL ENERGY CO-A	262	481	419	8,395	エネルギー	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	171.6	616.6	624	12,488	資本財・サービス	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,079	1,557	625	12,514	資本財・サービス	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	704	622	349	6,989	素材	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	135	178	342	6,843	素材	
YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	41	50	153	3,066	エネルギー	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	306	306	192	3,842	金融	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	10,813	9,186	3,270	65,384	金融	
BANK OF CHINA LTD-A	3,144	2,832	1,110	22,196	金融	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	2,849	3,493	2,270	45,395	エネルギー	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	—	581	1,281	25,614	公益事業	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	3,699	3,786	2,199	43,979	金融	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	344	421	1,309	26,186	エネルギー	
CHINA VANKE CO LTD -A	674	989	1,386	27,723	不動産	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	333	434	1,186	23,715	金融	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	487	932	555	11,106	金融	
CHINA MINSHENG BANKING-A	4,294	3,547	1,337	26,736	金融	
PICC HOLDING CO-A	—	677	402	8,053	金融	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	3,928	5,132	1,575	31,500	金融	
CRRC CORP LTD-A	1,187	1,541	1,024	20,489	資本財・サービス	
CHINA UNITED NETWORK-A	2,495	2,303	1,128	22,562	コミュニケーション・サービス	
CGN POWER CO LTD-A	189	189	58	1,179	公益事業	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	213	305	429	8,586	金融	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	335	463	432	8,655	金融	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	2,064	2,913	2,251	45,021	資本財・サービス	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	1,231	1,880	1,075	21,500	素材	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	102	142	563	11,257	金融	
HUAXIA BANK CO LTD-A	1,583	1,943	1,049	20,977	金融	
BYD CO LTD -A	10	20	543	10,856	一般消費財・サービス	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	71	—	—	—	一般消費財・サービス	
WEICHAI POWER CO LTD-A	237	335	429	8,586	資本財・サービス	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269	475	560	11,206	素材	
HUANENG POWER INTL INC-A	456	625	586	11,721	公益事業	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	953	1,802	897	17,942	金融	
オフショア・人民元通貨計	株数、金額	62,575.6	76,848.6	57,862	1,156,902	
	銘柄数 < 比率 >	50 銘柄	50 銘柄		< 3.9% >	
(マレーシア)		百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYAN BANKING BHD	763	1,338	1,164	36,205	金融	
PUBLIC BANK BERHAD	1,686	3,096	1,210	37,650	金融	
TOP GLOVE CORP BHD	—	8,244	696	21,666	ヘルスケア	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	807	1,104	665	20,705	素材	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	1,104	2,997	1,558	48,471	金融	
マレーシア・リンギット通貨計	株数、金額	4,360	16,779	5,295	164,699	
	銘柄数 < 比率 >	4 銘柄	5 銘柄		< 0.6% >	

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当	期末		業種等
	株数	株数	評価額	価額	
	百株	百株	外貨建金額 千南アフリカ・ランド	邦貨換算金額 千円	
(南アフリカ)					
GOLD FIELDS LTD	237.82	321.82	8,338	64,627	素材
CAPIPEC BANK HOLDINGS LTD	11.13	20.41	3,203	24,829	金融
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	9,718.7	—	—	—	一般消費財・サービス
OLD MUTUAL LTD	1,535.77	1,817.77	2,215	17,172	金融
VODACOM GROUP LTD	153.79	262.91	3,052	23,655	コミュニケーション・サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD	154.54	234.99	5,329	41,300	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD	162.94	196.67	4,503	34,899	金融
BIDVEST GROUP LTD	89.12	116.04	3,051	23,651	資本財・サービス
BID CORP LTD	86.49	141.23	5,857	45,397	生活必需品
STANDARD BANK GROUP LTD	308.84	528.79	9,455	73,282	金融
SASOL LTD	306.1	375.33	8,807	68,255	素材
REMGRO LTD	135.67	—	—	—	金融
DISCOVERY LTD	130.47	207.81	3,049	23,632	金融
EXXARO RESOURCES LTD	101.92	137.92	2,278	17,662	エネルギー
KUMBA IRON ORE LTD	26.67	62	2,753	21,336	素材
SANLAM LTD	452.73	764.9	4,535	35,146	金融
FIRSTRAND LTD	1,179.95	1,834.84	12,697	98,402	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	454.23	439.25	3,235	25,071	一般消費財・サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	143.47	226.27	2,138	16,571	一般消費財・サービス
ABSA GROUP LTD	237	420.12	7,146	55,386	金融
NASPERS LTD-N SHS	35.59	21.51	7,161	55,499	一般消費財・サービス
MTN GROUP LTD	511.77	784.02	10,682	82,787	コミュニケーション・サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	112.5	333.74	4,262	33,031	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	137.42	—	—	—	ヘルスクエア
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	139.52	171.38	6,800	52,704	素材
SPAR GROUP LIMITED/THE	—	234.78	2,503	19,403	生活必需品
MR PRICE GROUP LTD	81.72	—	—	—	一般消費財・サービス
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	—	35.72	3,078	23,857	素材
SIBANYE STILLWATER LTD	798.07	2,538.4	7,511	58,211	素材
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	17,443.94 27銘柄	12,228.62 25銘柄	133,648 1,035,779 < 3.5% >	
(タイ)					
SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	1,653	1,569	17,180	71,127	金融
TRUE CORPORATION NON-VOTING DR PCL	—	6,849	4,554	18,855	コミュニケーション・サービス
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	271	271	4,349	18,007	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR	503	605	19,723	81,653	素材
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	385	385	5,139	21,278	金融
KASIKORNBANK PCL-NVDR	675	979	13,069	54,108	金融
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	31,683	31,551	4,953	20,507	金融
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	983	1,327	4,578	18,953	素材
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	389	465	9,951	41,197	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	6,963	5,817	11,343	46,960	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	4,964	5,773	5,224	21,629	エネルギー
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	2,061	1,587	4,364	18,067	ヘルスクエア
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	772	711	10,736	44,447	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	11,202	14,741	3,449	14,280	エネルギー
BANGCHAK CORP PCL-NVDR	—	1,200	4,350	18,009	エネルギー
PTT PCL-NVDR	9,340	15,115	51,013	211,194	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	1,242	1,127	5,071	20,996	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	1,718	2,206	14,063	58,221	生活必需品
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	474	711	11,411	47,243	金融

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	株数	当株数	期末評価額		業種等
			外貨建金額	邦貨換算金額	
LAND & HOUSES PUB - NVDR CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	百株 4,672 3,746 1,966	百株 4,447 4,599 2,418	千タイ・パーツ 3,757 9,152 9,248	千円 15,556 37,889 38,290	不動産 生活必需品 素材
タイ・パーツ通貨計	株数、金額 20銘柄	85,662 22銘柄	226,685	938,476	<3.1%>
ファンド合計	株数、金額 403銘柄	4,809,679.86 423銘柄	—	24,716,471	<82.9%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資証券

銘柄	□数	当□数	期末評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	千口 871.6	千口 971.6	千アメリカ・ドル 18,324	千円 2,648,971	
合計	□数、金額 1銘柄	871.6 1銘柄	971.6 1銘柄	18,324 2,648,971	<8.9%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
外国 MSCI EMGMKT (アメリカ)	百万円 2,224	百万円 —

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

(注2) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年7月5日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 24,716,471	% 82.8
投資証券	2,648,971	8.9
コール・ローン等、その他	2,476,266	8.3
投資信託財産総額	29,841,709	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=144.56円、1香港・ドル=18.46円、1台湾・ドル=4.644円、1トルコ・リラ=5.562円、1メキシコ・ペソ=8.478円、100チリ・ペソ=18.091円、1サウジアラビア・リアル=38.61円、1インド・ルピー=1.77円、100インドネシア・ルピア=0.97円、1ブラジル・リアル=29.85円、1オフショア・人民元=19.993円、1マレーシア・リンギット=31.102円、1南アフリカ・ランド=7.75円、1タイ・パーツ=4.14円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (29,284,962千円) の投資信託財産総額 (29,841,709千円) に対する比率は、98.1%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	29,829,986,091円
コール・ローン等	1,712,195,062
株式（評価額）	24,716,471,352
投資証券（評価額）	2,648,971,795
未収入金	4,784,792
未収配当金	301,310,827
差入委託証拠金	446,252,263
(B) 負債	21,823,030
未払金	863,746
未払解約金	20,953,298
その他未払費用	5,986
(C) 純資産総額（A－B）	29,808,163,061
元本	13,257,532,975
次期繰越損益金	16,550,630,086
(D) 受益権総口数	13,257,532,975口
1万口当り基準価額（C/D）	22,484円

* 期首における元本額は10,636,828,515円、当作成期間中における追加設定元本額は3,118,089,783円、同解約元本額は497,385,323円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

新興国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	83,781,904円
ダイワファンドラップ外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	366,277,083円
ダイワファンドラップオンライン外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし）	329,662,404円
D－I's 新興国株式インデックス	129,979,524円
i Free 新興国株式インデックス	5,403,032,026円
i Free 8 資産バランス	3,250,035,322円
ダイワ新興国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	6,331,011円
新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド（為替ヘッジなし/適格機関投資家専用）	1,730,287,372円
DCダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックスファンド	1,486,839,854円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式	357,019,808円
ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド	114,286,667円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は22,484円です。

■損益の状況

当期 自 2022年7月6日 至 2023年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,322,030,501円
受取配当金	1,286,273,839
受取利息	10,487,342
その他収益金	25,556,025
支払利息	△ 286,705
(B) 有価証券売買損益	2,987,974,573
売買益	5,044,982,095
売買損	△ 2,057,007,522
(C) 先物取引等損益	△ 29,817,170
取引益	139,882,328
取引損	△ 169,699,498
(D) その他費用	△ 49,652,663
(E) 当期損益金（A＋B＋C＋D）	4,230,535,241
(F) 前期繰越損益金	9,802,337,897
(G) 解約差損益金	△ 497,212,060
(H) 追加信託差損益金	3,014,969,008
(I) 合計（E＋F＋G＋H）	16,550,630,086
次期繰越損益金（I）	16,550,630,086

（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。

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

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

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

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

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

新興国債券インデックス ファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

運用報告書 (全体版)

第 5 期

(決算日 2023年 7月 5日)

(作成対象期間 2022年 7月 6日~2023年 7月 5日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型		
信託期間	無期限 (設定日: 2018年 9月 18日)		
運用方針	投資成果を J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの受益証券	
	ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	新興国通貨建ての債券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益 (評価益を含みます。) 等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果を J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーシング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)		公社債組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期騰落率	(ベンチマーク)	期騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
1 期末 (2019年 7月 5日)	11,007	0	10.1	11,075	10.8	96.7	15
2 期末 (2020年 7月 6日)	10,595	0	△ 3.7	10,698	△ 3.4	95.4	75
3 期末 (2021年 7月 5日)	11,502	0	8.6	11,659	9.0	97.0	203
4 期末 (2022年 7月 5日)	11,335	0	△ 1.5	11,563	△ 0.8	96.6	341
5 期末 (2023年 7月 5日)	13,417	0	18.4	13,767	19.1	96.7	640

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

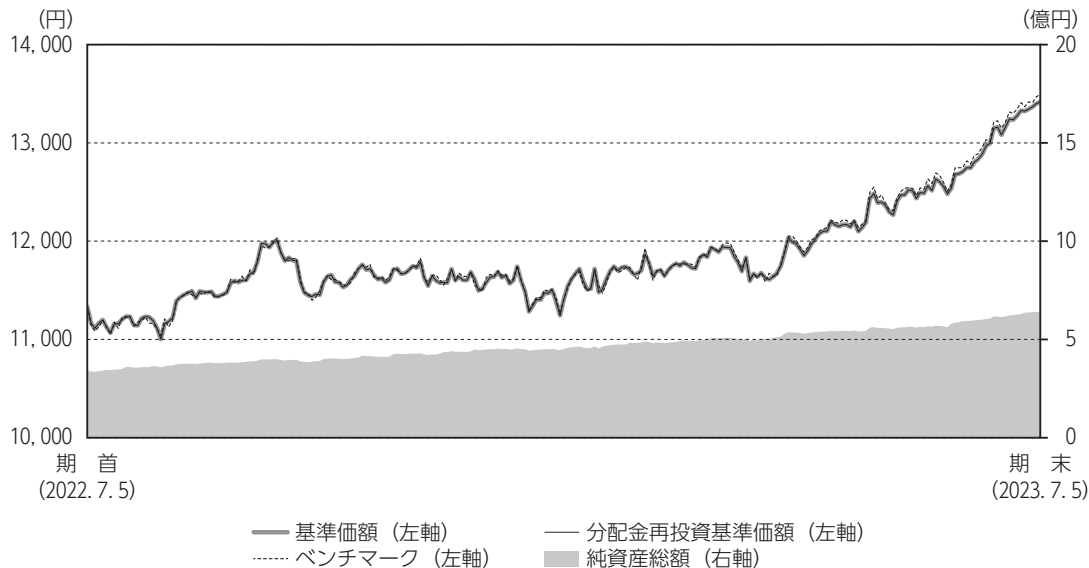
(注 5) 公社債組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注 6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) 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およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

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

* ベンチマークは、J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）です。

基準価額・騰落率

期首：11,335円

期末：13,417円（分配金0円）

騰落率：18.4%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

投資している債券からの利息収入や、多くの投資対象国通貨の対円為替レートが上昇（円安）したことから、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。

新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

年 月 日	基 準 価 額		J Pモルガン ガバメント・ボンド・イン デックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)		公 社 債 組入比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率	
	円	%		%	%
(期首)2022年7月5日	11,335	—	11,563	—	96.6
7月末	11,189	△ 1.3	11,387	△ 1.5	97.0
8月末	11,583	2.2	11,824	2.3	96.8
9月末	11,460	1.1	11,657	0.8	96.7
10月末	11,711	3.3	11,956	3.4	96.6
11月末	11,685	3.1	11,918	3.1	96.1
12月末	11,391	0.5	11,652	0.8	95.6
2023年1月末	11,711	3.3	11,972	3.5	96.5
2月末	11,861	4.6	12,102	4.7	96.4
3月末	12,037	6.2	12,292	6.3	96.4
4月末	12,191	7.6	12,457	7.7	96.5
5月末	12,559	10.8	12,857	11.2	96.3
6月末	13,343	17.7	13,688	18.4	95.4
(期末)2023年7月5日	13,417	18.4	13,767	19.1	96.7

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2022.7.6～2023.7.5)

新興国債券市況

新興国債券市場は、多くの国で金利が低下（債券価格は上昇）しました。

新興国債券の金利は、当作成期首より、米国の金融引き締めによる景気悪化が意識され、低下しました。F R B（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め観測から米国金利が上昇したことや、英国の財政政策の発表を受けて、金利が上昇する場面もありましたが、2022年11月には、インフレ期待の低下などを受けてF R Bによる利上げペース減速の可能性が意識されたことなどから、金利は低下に転じました。その後、F R Bが2023年末の政策金利見通しを上方修正したことなどから、世界的な金融引き締めが意識され、金利は再び上昇しましたが、2023年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、金利は再び低下しました。

為替相場

新興国為替市場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

新興国通貨は、当作成期首より、米ドル円相場が円高米ドル安方向に進行したことから、多くの通貨は対円で下落しましたが、堅調な米国経済指標や複数のF R B（米国連邦準備制度理事会）高官による金融引き締めを継続する発言から米国金利が上昇し、日米金利差の拡大を背景に米ドル円相場が円安米ドル高方向に進行したことから、多くの通貨は対円で上昇しました。2022年12月には、日銀がイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の長期金利の上限引き上げを実施したことで、市場では事実上の金融引き締めと受け止められ円高が進行したことから、多くの通貨が対円で下落しました。しかしその後は、F R Bの金融引き締め観測から米国金利が上昇する中、日米金利差の拡大により円安が進行したことなどから、多くの通貨が対円で上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

当ファンドの商品性格に鑑み、引き続き、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の受益証券を高位で組み入れ、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2022. 7. 6 ~ 2023. 7. 5)

当ファンド

当作成期を通じて「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の受益証券を高位で組み入れ、ベンチマークに連動する投資成果をめざしました。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

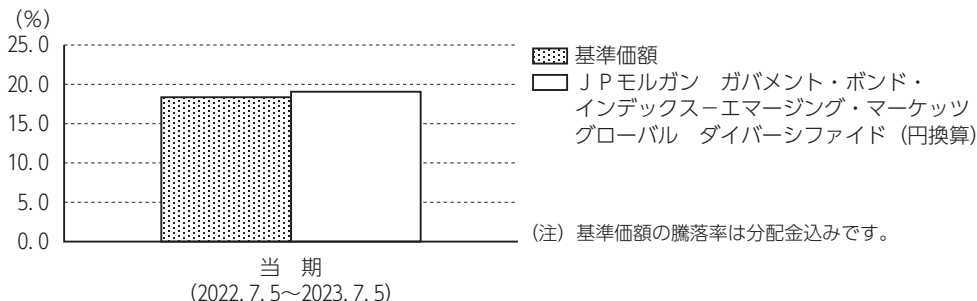
* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)

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19.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は18.4%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、運用管理費用や税金、売買に伴う費用などが主な要因です。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークは J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) です。

分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2022年7月6日 ～2023年7月5日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	3,416

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



今後の運用方針

■当ファンド

当ファンドの商品性格に鑑み、引き続き、「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の受益証券を高位で組み入れ、ベンチマークに連動する投資成果をめざします。

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2022. 7. 6~2023. 7. 5)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	17円	0. 143%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は11, 846円です。
(投 信 会 社)	(13)	(0. 110)	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)	(1)	(0. 011)	販売会社分は、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0. 022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	10	0. 086	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)	(9)	(0. 076)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(1)	(0. 008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0. 002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	27	0. 229	

(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。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年7月6日から2023年7月5日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	140,177	210,338	2,987	4,478

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	236,473	373,663	639,936			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	639,936	99.8
コール・ローン等、その他	1,006	0.2
投資信託財産総額	640,942	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル＝144.56円、1エジプト・ポンド＝4.675円、1トルコ・リラ＝5.562円、1メキシコ・ペソ＝8.478円、1フィリピン・ペソ＝2.616円、1アルゼンチン・ペソ＝0.557円、100チリ・ペソ＝18.091円、100コロンビア・ペソ＝3.494円、100インドネシア・ルピア＝0.97円、1ブラジル・レアル＝29.85円、1チエコ・コルナ＝6.63円、1ルーマニア・レイ＝31.778円、1オアフ・人民元＝19.993円、1マレーシア・リンギット＝31.102円、1南アフリカ・ランド＝7.75円、1タイ・バーツ＝4.14円、1ペルー・ソル＝39.838円、1ポーランド・ズロチ＝35.492円、100ハンガリー・フォリント＝41.909円、1ウルグアイ・ペソ＝3.851円、1ドミニカ・ペソ＝2.601円、1ユーロ＝157.37円です。

(注3) ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（36,549,324千円）の投資信託財産総額（38,579,159千円）に対する比率は、94.72%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	640,942,633円
コール・ローン等	1,006,623
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（評価額）	639,936,010
(B) 負債	398,320
未払信託報酬	376,675
その他未払費用	21,645
(C) 純資産総額（A－B）	640,544,313
元本	477,423,131
次期繰越損益金	163,121,182
(D) 受益権総口数	477,423,131口
1万口当り基準価額（C/D）	13,417円

*期首における元本額は301,644,227円、当作成期間中における追加設定元本額は179,522,394円、同解約元本額は3,743,490円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は13,417円です。

■損益の状況

当期 自 2022年7月6日 至 2023年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 130円
支払利息	△ 130
(B) 有価証券売買損益	92,337,728
売買益	92,488,632
売買損	△ 150,904
(C) 信託報酬等	△ 705,499
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	91,632,099
(E) 前期繰越損益金	10,222,709
(F) 追加信託差損益金	61,266,374
(配当等相当額)	(35,507,802)
(売買損益相当額)	(25,758,572)
(G) 合計（D＋E＋F）	163,121,182
次期繰越損益金（G）	163,121,182
追加信託差損益金	61,266,374
(配当等相当額)	(35,507,802)
(売買損益相当額)	(25,758,572)
分配準備積立金	101,854,938
繰越損益金	△ 130

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

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

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

新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

■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	90,871,697
(c) 収益調整金	61,266,374
(d) 分配準備積立金	10,983,241
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	163,121,312
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	163,121,312
(h) 受益権総口数	477,423,131口

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

運用報告書 第13期（決算日 2023年7月5日）

（作成対象期間 2022年7月6日～2023年7月5日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

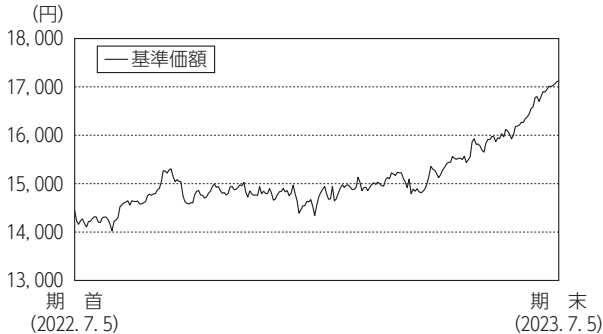
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



【運用経過】

【基準価額・騰落率】

期首：14,445円 期末：17,126円 騰落率：18.6%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券からの利息収入や、多くの投資対象国通貨の対円為替レートが上昇（円安）したことなどから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○新興国債券市況

新興国債券市場は、多くの国で金利が低下（債券価格は上昇）しました。

新興国債券の金利は、当作成期首より、米国の金融引き締めによる景気悪化が意識され、低下しました。F R B（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め観測から米国金利が上昇したことや、英国の財政政策の発表を受けて、金利が上昇する場面もありましたが、2022年11月には、インフレ期待の低下などを受けてF R Bによる利上げペース減速の可能性が意識されたことなどから、金利は低下に転じました。その後、F R Bが2023年末の政策金利見通しを上方修正したことなどから、世界的な金融引き締めが意識され、金利は再び上昇しましたが、2023年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、金利は再び低下しました。

○為替相場

新興国為替市場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

新興国通貨は、当作成期首より、米ドル円相場が円高米ドル安方向に進行したことから、多くの通貨は対円で下落しましたが、堅調な米国経済指標や複数のF R B（米国連邦準備制度理事会）高官による金融引き締めを継続する発言から米国金利が上昇し、日米金利差の拡大を背景に米ドル円相場が円安米ドル高方向に進行したことから、多くの通貨は対円で上昇しました。2022年12月には、日銀がイールドカーブ・コントロール（長短金利操作）の長期金利の上限引き上げを実施したことで、市場では事実上の金融引き締めと受け止められ円高が進行したことから、多くの通貨が対円で下落しました。しかしその後は、F R Bの金融引き締め観測から米国金利が上昇する中、日米金利差の拡大により円安が進行したことなどから、多くの通貨が対円で上昇しました。

◆前作成期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は19.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は18.6%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、税金、売買に伴う費用などが主な要因です。

*ベンチマークはJ P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）です。

年 月 日	基準 価 額		J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算) (ベンチマーク)		公 社 債 組 入 率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2022年 7月 5日	円	%	円	%	%
	14,445	—	15,584	—	96.7
7月末	14,260	△ 1.3	15,346	△ 1.5	97.1
8月末	14,764	2.2	15,935	2.3	96.9
9月末	14,609	1.1	15,710	0.8	96.8
10月末	14,932	3.4	16,113	3.4	96.7
11月末	14,900	3.1	16,062	3.1	96.2
12月末	14,527	0.6	15,704	0.8	95.7
2023年 1月末	14,937	3.4	16,135	3.5	96.6
2月末	15,130	4.7	16,310	4.7	96.5
3月末	15,357	6.3	16,566	6.3	96.5
4月末	15,555	7.7	16,789	7.7	96.6
5月末	16,028	11.0	17,327	11.2	96.4
6月末	17,031	17.9	18,448	18.4	95.5
(期末) 2023年 7月 5日	17,126	18.6	18,554	19.1	96.8

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

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

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	12 (12)
(その他)	(0)
合 計	12

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2022年7月6日から2023年7月5日まで)

		買付額	売付額
外	エジプト	千エジプト・ポンド 12,654	千エジプト・ポンド (—)
	トルコ	千トルコ・リラ 33,621	千トルコ・リラ (12,823)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 95,238	千メキシコ・ペソ (60,537)
	チリ	千チリ・ペソ 1,372,843	千チリ・ペソ (445,454)
	コロンビア	千コロンビア・ペソ 11,993,880	千コロンビア・ペソ (796,042)
	インドネシア	千インドネシア・ルピア 80,304,651	千インドネシア・ルピア (10,356,147)
国	ブラジル	千ブラジル・リアル 90,319	千ブラジル・リアル (75,928)
	チェコ	千チェコ・コルナ 67,175	千チェコ・コルナ (11,521)
	ルーマニア	千ルーマニア・レイ 18,191	千ルーマニア・レイ (6,833)

		買付額	売付額
外	中国	千オフショア・人民元 68,406	千オフショア・人民元 (13,810)
	ロシア	千ロシア・ルーブル —	千ロシア・ルーブル (—)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 41,595	千マレーシア・リンギット (9,451)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 149,562	千南アフリカ・ランド (45,392)
	タイ	千タイ・バーツ 278,287	千タイ・バーツ (68,165)
	ペルー	千ペルー・ソル 4,593	千ペルー・ソル (—)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 21,519	千ポーランド・ズロチ (5,721)
	ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 556,970	千ハンガリー・フォリント (230,074)
	ドミニカ	千ドミニカ・ペソ 12,888	千ドミニカ・ペソ (—)

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2022年7月6日から2023年7月5日まで)

当 期		期 末	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL (ブラジル) 2026/7/1	676,008	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	1,134,115
BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL (ブラジル) 2026/1/1	500,857	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2023/7/1	574,758
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	307,598	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	273,253
BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL (ブラジル) 2025/7/1	279,340	Mexican Bonos (メキシコ) 8% 2023/12/7	220,703
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8% 2030/1/31	178,396	Thailand Government Bond (タイ) 2.4% 2023/12/17	151,324
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 10.5% 2026/12/21	173,994	Poland Government Bond (ポーランド) 4% 2023/10/25	144,004
THAILAND GOVERNMENT BOND (タイ) 2.65% 2028/6/17	172,584	Mexican Bonos (メキシコ) 6.75% 2023/3/9	123,892
MEXICAN BONOS (メキシコ) 5% 2025/3/6	164,381	China Government Bond (中国) 2.36% 2023/7/2	120,500
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2029/1/1	158,146	China Government Bond (中国) 2.88% 2023/11/5	96,933
POLAND GOVERNMENT BOND (ポーランド) 7.5% 2028/7/25	148,138	Thailand Government Bond (タイ) 3.625% 2023/6/16	90,555

(注1) 金額は受渡し代金 (経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国 (外貨建) 公社債 (通貨別)

区 分	額 面 金 額	当 期				末		
		評 価 額		組入比率	うちBB格以下組入率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
エジプト	千エジプト・ポンド 66,600	千エジプト・ポンド 54,706	千円 255,756	% 0.7	% 0.7	% 0.1	% 0.5	% 0.1
トルコ	千トルコ・リラ 52,860	千トルコ・リラ 50,818	282,653	0.8	0.8	0.1	0.6	0.1
メキシコ	千メキシコ・ペソ 440,900	千メキシコ・ペソ 416,395	3,530,405	9.6	—	5.0	2.4	2.1
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 9,659	25,274	0.1	—	0.1	—	—
チリ	千チリ・ペソ 4,705,000	千チリ・ペソ 4,692,466	848,914	2.3	—	1.6	0.2	0.5
コロンビア	千コロンビア・ペソ 53,780,000	千コロンビア・ペソ 47,197,658	1,649,133	4.5	—	2.6	1.5	0.4
インドネシア	千インドネシア・ルピア 340,819,000	千インドネシア・ルピア 361,127,831	3,502,939	9.5	—	6.6	1.8	1.1
ブラジル	千ブラジル・レアル 139,540	千ブラジル・レアル 120,836	3,607,004	9.8	—	1.9	4.8	3.1
チェコ	千チェコ・コルナ 321,900	千チェコ・コルナ 286,859	1,902,136	5.1	—	3.2	1.4	0.6
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 45,250	千ルーマニア・レイ 42,438	1,348,624	3.6	—	1.7	1.2	0.7
中国	千オフショア・人民元 177,700	千オフショア・人民元 181,587	3,630,636	9.8	—	4.9	3.7	1.2
ロシア	千ロシア・ルーブル 1,116,020	千ロシア・ルーブル —	—	—	—	—	—	—
マレーシア	千マレーシア・リンギット 115,930	千マレーシア・リンギット 117,037	3,640,163	9.8	—	5.4	3.4	1.0
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 477,710	千南アフリカ・ランド 389,080	3,015,377	8.2	—	6.7	1.4	—
タイ	千タイ・バーツ 888,560	千タイ・バーツ 895,597	3,707,774	10.0	—	5.8	2.5	1.8

新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

区 分	額 面 金 額	当 期			末			
		評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ペルー	千ペルー・ソル 23,010	千ペルー・ソル 22,637	901,825	2.4	—	2.1	0.2	0.1
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 86,030	千ポーランド・ズロチ 76,817	2,726,412	7.4	—	2.3	3.5	1.6
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 3,237,000	千ハンガリー・フォリント 2,630,825	1,102,573	3.0	—	1.4	1.0	0.6
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 9,800	千ウルグアイ・ペソ 9,134	35,180	0.1	—	0.1	0.0	—
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 22,400	千ドミニカ・ペソ 25,391	66,066	0.2	0.2	0.1	0.1	—
合計	—	—	35,778,854	96.8	1.6	51.4	30.3	15.1

(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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2) 外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期			末		
				額 面 金 額	評 価 額		償還年月日		
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			
エジプト	ARAB REP EGYPT	国債証券	16.1000	千エジプト・ポンド	千エジプト・ポンド	千円			
			1.500	1,162	5,434				
			14.3500	1,000	909				4,254
			14.4000	4,000	2,858				13,365
			13.5360	1,500	1,341				6,270
			14.6640	4,500	3,170				14,822
			14.5560	2,000	1,527				7,141
			14.3690	9,000	7,670				35,860
			14.2920	6,000	4,561				21,325
			14.0600	18,800	15,673				73,274
			14.4830	9,000	7,424				34,711
			14.5630	1,000	816				3,818
			14.5310	8,300	7,588				35,477
通貨小計	銘柄数 金 額	12銘柄		66,600	54,706	255,756			
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	千トルコ・リラ	千トルコ・リラ				
			8.0000	1,630	1,549				8,615
			10.6000	2,690	2,461				13,688
			11.0000	5,570	5,195				28,895
			10.5000	2,970	2,696				14,995
			12.4000	9,000	8,234				45,800
			12.6000	5,000	4,443				24,716
			11.7000	9,100	9,142				50,851
			16.9000	8,400	7,972				44,345
				8,500	9,123				50,745
			通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄				
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				
			8.0000	52,400	47,910				406,212
			8.0000	29,300	26,825				227,443
			8.0000	39,000	37,773				320,262
			5.5000	23,000	20,475				173,599

新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

区 分		銘 柄		種 類		年 利 率		額 面 金 額		当 期		未		償還年月日
										評 価 額		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
										千円	千円			
		MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	%	千メキシコ・ペソ	25,700	千メキシコ・ペソ	23,734	201,237	2025/03/06			
		MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000			16,000		14,546	123,330	2053/07/31			
		MEXICAN BONOS	国債証券	7.5000			15,300		14,123	119,744	2033/05/26			
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000			30,550		30,323	257,098	2024/12/05			
		Mexican Bonos	国債証券	7.5000			40,030		38,084	322,899	2027/06/03			
		Mexican Bonos	国債証券	10.0000			9,390		10,408	88,251	2036/11/20			
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000			35,230		34,874	295,686	2029/05/31			
		Mexican Bonos	国債証券	8.5000			25,100		24,502	207,741	2038/11/18			
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500			55,350		52,436	444,581	2031/05/29			
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500			34,120		30,628	259,683	2042/11/13			
		Mexican Bonos	国債証券	7.7500			10,430		9,746	82,632	2034/11/23			
通貨小計	銘柄数	15銘柄												
	金額						440,900		416,395	3,530,405				
フィリピン		Philippine Government International Bond	国債証券	6.2500		千フィリピン・ペソ	10,000	千フィリピン・ペソ	9,659	25,274	2036/01/14			
通貨小計	銘柄数	1銘柄												
	金額						10,000		9,659	25,274				
チリ		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000		千チリ・ペソ	500,000	千チリ・ペソ	486,720	88,052	2026/03/01			
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000			720,000		711,943	128,797	2035/03/01			
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000			630,000		697,126	126,117	2043/01/01			
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000			685,000		663,648	120,060	2030/09/01			
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000			1,000,000		937,740	169,646	2025/03/01			
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.3000			250,000		216,385	39,146	2028/10/01			
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000			200,000		197,026	35,643	2028/10/01			
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	7.0000			220,000		252,412	45,663	2034/05/01			
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000			500,000		529,465	95,785	2033/04/01			
通貨小計	銘柄数	9銘柄												
	金額						4,705,000		4,692,466	848,914				
コロンビア		Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500		千コロンビア・ペソ	90,000	千コロンビア・ペソ	86,933	3,037	2027/06/28			
		Colombian TES	国債証券	10.0000			3,850,000		3,855,390	134,711	2024/07/24			
		Colombian TES	国債証券	6.0000			5,570,000		4,788,918	167,329	2028/04/28			
		Colombian TES	国債証券	7.5000			5,410,000		5,081,558	177,554	2026/08/26			
		Colombian TES	国債証券	7.7500			3,600,000		3,220,416	112,524	2030/09/18			
		Colombian TES	国債証券	7.0000			4,650,000		3,830,484	133,840	2032/06/30			
		Colombian TES	国債証券	6.2500			3,700,000		3,424,720	119,663	2025/11/26			
		Colombian TES	国債証券	7.2500			4,900,000		3,951,850	138,081	2034/10/18			
		Colombian TES	国債証券	5.7500			3,200,000		2,761,600	96,493	2027/11/03			
		Colombian TES	国債証券	7.2500			4,510,000		3,224,334	112,661	2050/10/26			
		Colombian TES	国債証券	6.2500			1,900,000		1,388,482	48,514	2036/07/09			
		COLOMBIAN TES	国債証券	7.0000			5,400,000		4,575,096	159,858	2031/03/26			
		COLOMBIAN TES	国債証券	9.2500			4,500,000		4,051,350	141,558	2042/05/28			
		COLOMBIAN TES	国債証券	13.2500			2,500,000		2,956,525	103,303	2033/02/09			
通貨小計	銘柄数	14銘柄												
	金額						53,780,000		47,197,658	1,649,133				
インドネシア		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500		千インドネシア・ルピア	11,250,000	千インドネシア・ルピア	13,028,062	126,372	2036/05/15			
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500			8,000,000		9,216,880	89,403	2031/05/15			
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000			5,500,000		5,958,205	57,794	2032/08/15			
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000			7,300,000		7,923,128	76,854	2038/05/15			
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250			10,000,000		10,191,500	98,857	2024/05/15			

新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

		当 期			未		
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	6,000,000	7,036,620	68,255	2039/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	12,000,000	13,242,960	128,456	2029/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	17,300,000	18,040,613	174,993	2030/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	16,700,000	16,902,237	163,951	2025/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	13,300,000	14,478,114	140,437	2035/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	13,500,000	14,704,470	142,633	2040/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	14,400,000	14,320,656	138,910	2026/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	20,800,000	21,082,464	204,499	2031/02/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	7,300,000	7,251,455	70,339	2036/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	20,600,000	20,752,646	201,300	2032/04/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	5.1250	12,000,000	11,788,200	114,345	2027/04/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	11,700,000	12,356,253	119,855	2042/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	2,700,000	2,696,976	26,160	2037/07/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.0000	11,300,000	11,956,417	115,977	2033/02/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	7,600,000	7,767,732	75,347	2028/08/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	4,600,000	4,943,666	47,953	2043/06/15
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	4,700,000	5,030,645	48,797	2038/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	3,600,000	3,985,308	38,657	2025/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	3,480,000	4,308,588	41,793	2030/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,587,344	34,797	2031/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,824,000	13,756,433	133,437	2026/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,345,032	51,846	2032/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	12,530,000	12,999,875	126,098	2027/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	11,450,000	11,554,538	112,079	2028/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	10,575,000	10,824,993	105,002	2033/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	14,320,000	16,555,065	160,584	2034/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	15,150,000	15,424,821	149,620	2024/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	10,620,000	12,115,933	117,524	2029/03/15
通貨小計	銘柄数	33銘柄					
	金 額			340,819,000	361,127,831	3,502,939	
ブラジル				千ブラジル・レアル	千ブラジル・レアル		
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	12,890	12,750	380,602	2025/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	14,850	14,776	441,094	2027/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	14,100	13,816	412,419	2029/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	4,600	4,469	133,412	2031/01/01
	BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F	国債証券	10.0000	4,800	4,625	138,064	2033/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	14,600	13,109	391,320	2024/07/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	15,500	12,758	380,844	2025/07/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	27,200	21,335	636,858	2026/01/01
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	31,000	23,195	692,388	2026/07/01
通貨小計	銘柄数	9銘柄					
	金 額			139,540	120,836	3,607,004	
チェコ				千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ		
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	19,600	17,827	118,214	2028/08/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	12,100	12,093	80,193	2024/05/25
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	21,100	19,889	131,886	2025/09/17
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	23,900	21,377	141,752	2026/06/26
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	22,000	17,673	117,191	2030/05/15
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	22,500	19,237	127,560	2027/02/10
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	24,500	22,368	148,323	2029/07/23
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	22,000	17,930	118,892	2033/10/13
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	22,700	18,160	120,417	2031/03/13
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	10,000	7,626	50,567	2029/11/29
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	13,500	13,361	88,596	2036/12/04

新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千	千	千	千円	
		CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	20,500	16,779	111,261	2032/06/23
		CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	17,500	16,409	108,810	2025/02/14
		CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	10,000	6,590	43,697	2040/04/24
		CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,000	4,617	30,618	2024/12/12
		CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	6,000	5,590	37,070	2035/05/30
		CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	15,500	15,965	105,862	2026/02/26
		CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	15,500	16,145	107,057	2030/09/30
		CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	12,000	12,651	83,887	2028/12/12
		CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	6,000	4,566	30,276	2037/07/30
通貨小計	銘柄数	20銘柄						
	金 額				321,900	286,859	1,902,136	
					千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ		
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	2,450	2,389	75,937	2025/02/24	
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,800	2,720	86,448	2027/07/26	
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,600	1,561	49,636	2024/04/29	
	Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,400	76,275	2029/02/12	
	Romania Government Bond	国債証券	4.8500	2,500	2,399	76,267	2026/04/22	
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,900	2,367	75,228	2031/09/24	
	Romania Government Bond	国債証券	4.5000	2,500	2,459	78,149	2024/06/17	
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,300	2,189	69,564	2025/07/28	
	Romania Government Bond	国債証券	4.1500	1,600	1,446	45,965	2028/01/26	
	Romania Government Bond	国債証券	3.7000	2,200	2,128	67,650	2024/11/25	
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	2,100	1,926	61,214	2026/06/24	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1500	2,500	2,136	67,887	2030/10/24	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,700	2,284	72,596	2034/10/11	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,300	1,953	62,092	2027/10/25	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	2,300	2,092	66,499	2029/07/25	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.7000	2,000	1,998	63,514	2032/02/25	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,100	861	27,372	2036/04/28	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,000	1,877	59,657	2025/11/25	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.2500	2,100	2,314	73,536	2032/09/29	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.7500	700	762	24,224	2028/10/30	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	500	531	16,887	2030/04/29	
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.9000	1,500	1,636	52,015	2038/02/24	
通貨小計	銘柄数	22銘柄						
	金 額				45,250	42,438	1,348,624	
					千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		
中国	China Government Bond	国債証券	3.2200	3,700	3,790	75,779	2025/12/06	
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	5,006	100,101	2028/11/22	
	China Government Bond	国債証券	3.1900	4,000	4,042	80,824	2024/04/11	
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,900	6,167	123,308	2029/05/23	
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,940	98,777	2026/06/06	
	China Government Bond	国債証券	3.1200	4,200	4,315	86,292	2026/12/05	
	China Government Bond	国債証券	3.1300	5,700	5,890	117,769	2029/11/21	
	China Government Bond	国債証券	2.9400	4,500	4,554	91,061	2024/10/17	
	China Government Bond	国債証券	2.8500	4,800	4,883	97,631	2027/06/04	
	China Government Bond	国債証券	2.6800	8,000	8,025	160,466	2030/05/21	
	China Government Bond	国債証券	1.9900	6,500	6,479	129,549	2025/04/09	
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,133	142,623	2025/10/22	
	China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,198	103,946	2027/12/03	
	China Government Bond	国債証券	3.2700	6,300	6,608	132,127	2030/11/19	
	China Government Bond	国債証券	3.0300	3,900	3,987	79,718	2026/03/11	
	China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	6,559	131,149	2050/09/14	
	China Government Bond	国債証券	2.8400	4,000	4,030	80,583	2024/04/08	

新興国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

区 分		銘 柄		当 期		未		償還年月日	
				種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
							外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額
			%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円			
		China Government Bond	国債証券	3.0100	5,000	5,133	102,644	2028/05/13	
		China Government Bond	国債証券	3.7200	2,000	2,230	44,604	2051/04/12	
		China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,195	143,860	2031/05/27	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	2,500	2,529	50,565	2026/08/12	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4700	3,900	3,920	78,380	2024/09/02	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	1,800	1,837	36,732	2028/10/14	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	1,000	1,080	21,605	2051/10/18	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	3,500	3,561	71,217	2031/11/18	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	2,800	2,800	55,994	2027/01/20	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,000	3,013	60,243	2032/02/17	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,500	3,550	70,978	2029/03/24	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	2,200	2,209	44,177	2027/04/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	1,000	1,042	20,847	2052/04/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	2,500	2,512	50,238	2032/05/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,600	3,633	72,654	2029/06/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,700	3,712	74,226	2027/07/25	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	3,000	2,998	59,943	2032/08/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	3,900	3,897	77,923	2025/08/25	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	1,600	1,587	31,737	2032/09/01	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,300	3,303	66,048	2029/09/25	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	3,200	3,203	64,057	2027/10/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	1,200	1,213	24,258	2052/10/25	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,700	3,720	74,396	2032/11/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	3,000	3,004	60,063	2025/11/25	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	1,200	1,212	24,233	2029/12/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6400	1,200	1,210	24,203	2028/01/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4600	2,600	2,614	52,265	2026/02/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8800	2,500	2,543	50,849	2033/02/25	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,700	1,717	34,345	2030/03/25	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,300	3,331	66,615	2028/04/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	1,200	1,240	24,803	2053/04/15	
		CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	3,200	3,211	64,207	2033/05/25	
通貨小計	銘柄数 金 額	49銘柄			177,700	181,587	3,630,636		
ロシア					千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル			
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	46,760	—	—	2027/02/03	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	46,160	—	—	2028/01/19	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	33,800	—	—	2023/08/16	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	43,000	—	—	2031/09/17	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	45,600	—	—	2026/09/16	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	46,100	—	—	2033/03/23	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	48,600	—	—	2024/10/16	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	48,000	—	—	2024/02/28	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.2500	55,000	—	—	2034/05/10	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.9000	49,000	—	—	2029/05/23	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.9500	46,000	—	—	2026/10/07	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	55,000	—	—	2024/07/17	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1500	59,000	—	—	2025/11/12	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6500	65,000	—	—	2030/04/10	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	38,000	—	—	2039/03/16	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.0000	68,000	—	—	2027/10/06	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	4.5000	71,000	—	—	2025/07/16	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.1000	63,000	—	—	2035/07/18	
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	5.7000	65,000	—	—	2028/05/17	
		RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ	国債証券	6.9000	74,000	—	—	2031/07/23	

新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

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	
		RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ	国債証券	6.7000	千ロシア・ルーブル 50,000	千ロシア・ルーブル —	千円 —	2029/03/14
通貨小計	銘柄数 金 額	21銘柄			1,116,020	—	—	
					千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0700	2,800	2,843	88,442	2026/09/30
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,838	57,190	2027/07/26
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	3,500	3,601	112,017	2028/10/31
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1280	1,900	1,929	60,003	2025/08/15
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	2,900	2,949	91,736	2029/07/09
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.6550	2,700	2,705	84,154	2024/10/15
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	4,200	4,219	131,223	2026/03/31
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	5,100	4,967	154,487	2030/10/15
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4220	3,500	3,462	107,693	2027/09/30
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4470	3,100	2,924	90,946	2036/07/15
		MALAYSIA T-BILL	国債証券	4.4170	3,300	3,423	106,490	2041/09/30
		MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE	国債証券	3.9900	3,800	3,840	119,435	2025/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,450	2,435	75,761	2027/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	3,850	3,857	119,972	2028/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,752	54,511	2024/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	4,350	4,390	136,551	2025/09/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	2,300	2,335	72,640	2035/05/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	3,800	3,838	119,389	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,720	1,731	53,864	2024/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	3,820	3,856	119,945	2027/11/16
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	4,300	4,595	142,944	2037/04/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	2,800	2,822	87,788	2025/03/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	3,300	3,609	112,255	2038/06/08
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	3,000	3,032	94,332	2026/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,950	2,959	92,044	2029/08/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	2,100	2,318	72,119	2048/07/06
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	3,300	3,304	102,775	2024/06/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	3,000	2,945	91,598	2034/07/05
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	3,500	3,334	103,708	2040/05/22
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	4,300	4,212	131,019	2050/06/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	2,900	2,652	82,486	2031/04/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	2,400	2,344	72,908	2032/07/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1930	3,400	3,470	107,947	2032/10/07
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	3,500	3,756	116,837	2042/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5990	600	596	18,549	2028/07/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2910	2,100	2,140	66,560	2043/08/14
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6620	1,400	1,500	46,676	2038/03/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2450	2,400	2,462	76,598	2030/09/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4570	750	782	24,338	2053/03/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5190	1,300	1,293	40,218	2028/04/20
通貨小計	銘柄数 金 額	40銘柄			115,930	117,037	3,640,163	
					千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド		
南アフリカ		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	65,650	68,142	528,106	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	17,720	11,284	87,458	2036/03/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	16,280	9,630	74,635	2041/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	29,540	23,611	182,987	2031/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	63,020	45,692	354,118	2048/02/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	45,800	34,947	270,844	2037/01/31

新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千南アフリカ・ランド	千南アフリカ・ランド	千円		
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	62,200	54,905	425,515	2030/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	42,700	31,301	242,584	2044/01/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	52,200	43,798	339,437	2032/03/31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	46,200	37,789	292,866	2035/02/28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	36,400	27,977	216,822	2040/01/31	
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金 額			477,710	389,080	3,015,377		
				千タイ・バーツ	千タイ・バーツ			
タイ	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	36,050	41,019	169,822	2029/06/22	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	31,610	32,891	136,170	2025/12/12	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	32,700	35,593	147,356	2031/06/20	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	29,600	31,682	131,164	2036/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	48,400	48,308	199,997	2026/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	48,500	53,644	222,087	2032/06/25	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	34,900	33,783	139,862	2046/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	34,500	35,437	146,710	2028/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	40,500	42,804	177,212	2038/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.4500	42,000	41,599	172,221	2024/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	36,500	34,848	144,272	2029/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	15,500	13,838	57,290	2035/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	0.9500	43,000	42,043	174,059	2025/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	0.7500	32,900	32,494	134,527	2024/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.5850	32,900	29,171	120,771	2035/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	64,000	62,002	256,690	2031/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	23,000	19,774	81,865	2042/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	61,000	58,104	240,551	2027/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	43,000	42,316	175,189	2024/09/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6500	43,000	43,699	180,916	2028/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	24,500	26,157	108,291	2037/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	36,500	36,694	151,915	2026/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	20,000	21,249	87,970	2043/06/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	34,000	36,438	150,856	2033/06/17	
通貨小計	銘柄数	24銘柄						
	金 額			888,560	895,597	3,707,774		
				千ペルー・ソル	千ペルー・ソル			
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	5.7000	1,230	1,223	48,756	2024/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	2,870	2,922	116,438	2028/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.1500	3,350	3,227	128,594	2032/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.9400	3,400	3,355	133,669	2029/02/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.4000	2,050	1,830	72,911	2034/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.3500	1,500	1,267	50,510	2040/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	2,075	2,205	87,851	2026/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	3,465	3,460	137,841	2037/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	3,070	3,144	125,252	2031/08/12	
通貨小計	銘柄数	9銘柄						
	金 額			23,010	22,637	901,825		
				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	8,190	7,494	265,984	2026/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,240	4,660	165,418	2027/07/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,600	5,448	193,371	2024/04/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	8,250	7,060	250,577	2029/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	6,700	6,398	227,084	2024/10/25	
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	5,550	5,089	180,641	2025/04/25	

新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

区 分		当 期			未			償還年月日
		銘 柄	種 類	年利率	評 価 額			
					額 面 金 額	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	6,900	5,160	183,174	2030/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	0.2500	6,300	5,301	188,152	2026/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,950	5,095	180,846	2032/04/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	6,150	5,759	204,426	2027/05/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	4,200	4,545	161,338	2028/07/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,150	40,833	2025/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,600	1,639	58,201	2033/10/25
		Poland Government Bond	国債証券	2.7500	6,950	6,151	218,320	2028/04/25
		Poland Government Bond	国債証券	3.2500	6,150	5,861	208,041	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	15銘柄						
	金 額				86,030	76,817	2,726,412	
ハンガリー		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	千ハンガリー・フォリント	千ハンガリー・フォリント		
		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	98,500	91,682	38,424	2024/06/26
		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	270,000	225,909	94,678	2027/10/27
		Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000	108,260	45,371	2026/12/22
		Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	153,000	147,291	61,729	2028/10/22
		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	225,000	176,625	74,023	2030/08/21
		Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	220,000	198,880	83,350	2024/10/24
		Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	272,000	212,350	88,995	2031/10/22
		Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	270,000	226,260	94,825	2025/11/26
		Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	202,000	131,219	54,993	2038/10/27
		Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	169,000	139,458	58,446	2026/04/22
		Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	135,000	102,964	43,152	2029/05/23
		Hungary Government Bond	国債証券	2.2500	215,000	149,113	62,493	2033/04/20
		Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	100,000	81,290	34,068	2026/08/26
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	150,000	93,828	39,323	2041/04/25
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	75,000	49,935	20,927	2034/06/22
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	100,000	87,846	36,816	2028/03/23
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	170,000	145,540	60,995	2032/11/24
		Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	282,500	262,371	109,959	2025/06/24
通貨小計	銘柄数	18銘柄						
	金 額				3,237,000	2,630,825	1,102,573	
ウルグアイ		Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	千ウルグアイ・ペソ	千ウルグアイ・ペソ		
		Uruguay Government International Bond	国債証券	8.2500	2,800	2,669	10,283	2028/03/15
					7,000	6,464	24,897	2031/05/21
通貨小計	銘柄数	2銘柄						
	金 額				9,800	9,134	35,180	
ドミニカ共和国		Dominican Republic International Bond	国債証券	9.7500	千ドミニカ・ペソ	千ドミニカ・ペソ		
		DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND	国債証券	13.6250	11,000	11,231	29,221	2026/06/05
					11,400	14,160	36,844	2033/02/03
通貨小計	銘柄数	2銘柄						
	金 額				22,400	25,391	66,066	
合 計	銘柄数	335銘柄						
	金 額						35,778,854	

(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。

新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

■投資信託財産の構成

2023年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	35,778,854	92.7
コール・ローン等、その他	2,800,304	7.3
投資信託財産総額	38,579,159	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、7月5日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=144.56円、1エジプト・ポンド=4.675円、1トルコ・リラ=5.562円、1メキシコ・ペソ=8.478円、1フィリピン・ペソ=2.616円、1アルゼンチン・ペソ=0.557円、100チリ・ペソ=18.091円、100コロンビア・ペソ=3.494円、100インドネシア・ルピア=0.97円、1ブラジル・レアル=29.85円、1チェコ・コルナ=6.63円、1ルーマニア・レイ=31.778円、1オフショア・人民元=19.993円、1マレーシア・リンギット=31.102円、1南アフリカ・ランド=7.75円、1タイ・バーツ=4.14円、1ペルー・ソル=39.838円、1ポーランド・ズロチ=35.492円、100ハンガリー・フォリント=41.909円、1ウルグアイ・ペソ=3.851円、1ドミニカ・ペソ=2.601円、1ユーロ=157.37円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産 (36,549,324千円) の投資信託財産総額 (38,579,159千円) に対する比率は、94.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	38,738,464,707円
コール・ローン等	2,190,313,164
公社債 (評価額)	35,778,854,757
未収入金	164,114,282
未収利息	547,210,845
前払費用	57,971,659
(B) 負債	1,772,830,742
未払金	1,758,563,803
未払解約金	14,260,999
その他未払費用	5,940
(C) 純資産総額 (A - B)	36,965,633,965
元本	21,584,689,967
次期繰越損益金	15,380,943,998
(D) 受益権総口数	21,584,689,967口
1万口当り基準価額 (C / D)	17,126円

* 期首における元本額は17,708,826,793円、当作成期間中における追加設定元本額は4,565,040,079円、同解約元本額は689,176,905円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額:

新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)	373,663,442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)	372,728,172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)	414,298,460円
D-1's 新興国債券インデックス	65,003,129円
iFree 新興国債券インデックス	6,956,174,244円
iFree 8 資産バランス	4,233,399,046円
ダイワ新興国債券インデックス (為替ヘッジなし) (投資一任専用)	2,485,607円
DCダイワ新興国債券インデックスファンド	8,989,541,355円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	139,571,080円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	37,825,432円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は17,126円です。

■損益の状況

当期 自 2022年7月6日 至 2023年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,860,703,320円
受取利息	1,860,805,623
その他収益金	9,515
支払利息	△ 111,818
(B) 有価証券売買損益	3,634,060,911
売買益	4,346,147,599
売買損	△ 712,086,688
(C) その他費用	△ 23,077,157
(D) 当期損益金 (A + B + C)	5,471,687,074
(E) 前期繰越損益金	7,871,124,665
(F) 解約差損益金	△ 348,814,676
(G) 追加信託差損益金	2,386,946,935
(H) 合計 (D + E + F + G)	15,380,943,998
次期繰越損益金 (H)	15,380,943,998

(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。