

ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ

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

運用報告書 (全体版)

第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日~2022年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワファンドラップ インデックス・シリーズ」は、このたび、第6期の決算を行ないました。

ここに、当作成期の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

ダイワファンドラップ TOPIXインデックス

運用報告書(全体版)

第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）		
運用方針	投資成果を東証株価指数（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	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の株式に投資し、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/>

<4641>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			TOPIX		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
2期末(2018年6月15日)	円	円	%		%	%	%	百万円
2期末(2018年6月15日)	13,726	0	14.7	1,789.04	12.7	98.7	1.2	8,562
3期末(2019年6月17日)	12,045	0	△ 12.2	1,539.74	△ 13.9	98.5	1.5	8,839
4期末(2020年6月15日)	12,246	0	1.7	1,530.78	△ 0.6	98.2	1.6	11,171
5期末(2021年6月15日)	16,103	0	31.5	1,975.48	29.1	97.4	2.6	13,378
6期末(2022年6月15日)	15,446	0	△ 4.1	1,855.93	△ 6.1	98.2	1.8	14,582

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

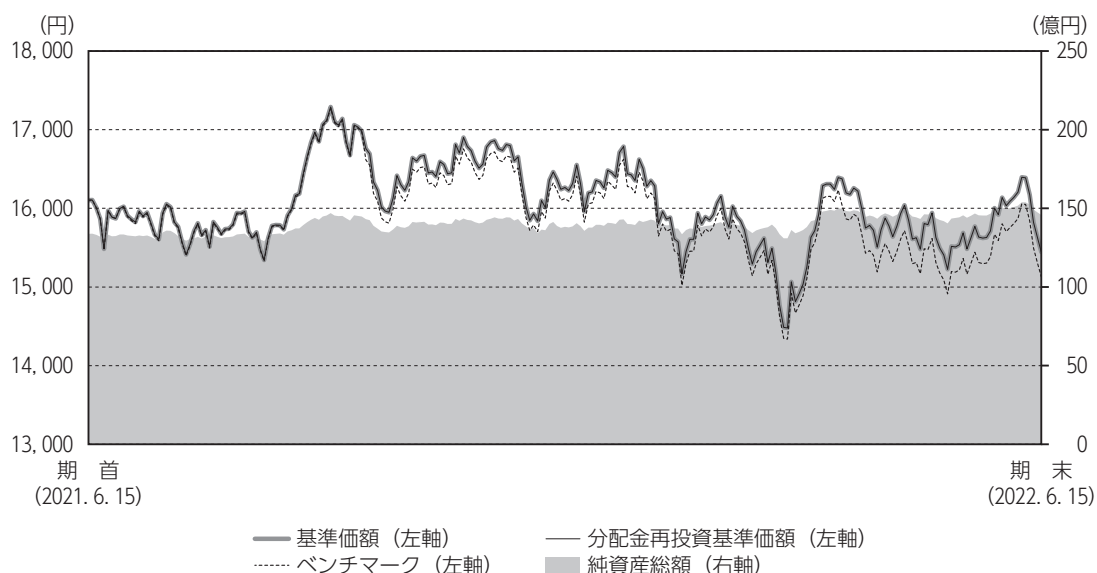
(注3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

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

* ベンチマークはTOPIXです。

■ 基準価額・騰落率

期首：16,103円

期末：15,446円(分配金0円)

騰落率：△4.1%(分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組入比率	株 式 先物比率
	円	騰 落 率 %	(ベンチマーク)	騰 落 率 %		
(期首)2021年 6月15日	16,103	—	1,975.48	—	97.4	2.6
6月末	15,859	△ 1.5	1,943.57	△ 1.6	98.0	2.0
7月末	15,511	△ 3.7	1,901.08	△ 3.8	97.0	3.0
8月末	15,996	△ 0.7	1,960.70	△ 0.7	98.3	1.6
9月末	16,693	3.7	2,030.16	2.8	98.1	1.8
10月末	16,452	2.2	2,001.18	1.3	97.5	2.5
11月末	15,847	△ 1.6	1,928.35	△ 2.4	97.2	3.0
12月末	16,398	1.8	1,992.33	0.9	98.2	1.8
2022年 1月末	15,607	△ 3.1	1,895.93	△ 4.0	97.7	2.4
2月末	15,536	△ 3.5	1,886.93	△ 4.5	97.5	2.7
3月末	16,196	0.6	1,946.40	△ 1.5	97.3	2.6
4月末	15,805	△ 1.9	1,899.62	△ 3.8	96.8	3.3
5月末	15,919	△ 1.1	1,912.67	△ 3.2	96.0	4.0
(期末)2022年 6月15日	15,446	△ 4.1	1,855.93	△ 6.1	98.2	1.8

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

国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大による行動制限措置の適用が続いたことや、内閣支持率の低下を受けて政局不透明感が増したことから、上値の重い展開となりました。しかし、2021年8月下旬からは感染状況の改善により株価が上昇すると、9月初めには菅首相の自民党総裁選挙への不出馬表明などが好感されて急騰しました。その後は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株価は反落しましたが、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て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、2022年に入ると、F R B（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め懸念による金利上昇を受けて世界的に株価は下落しました。さらに2月下旬からは、ロシアによるウクライナ侵攻という地政学リスクの顕在化を受け、株価下落が加速しました。3月後半は、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市場で円安が進行したことなどから、株価は一時的に反発しましたが、その後はF R Bの利上げペースが一層加速するとの懸念などから、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

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

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

■トピックス・インデックス・マザーファンド

株式を中心に、一部TOPIX先物取引も利用し、株式組入比率（株式先物を含む。）につきましても、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、株数を決定するシステム的手法）を用いて構築しています。

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

* 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

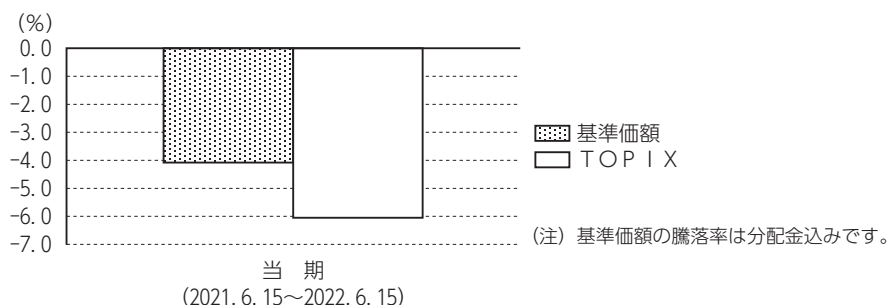
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△6.1%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△4.1%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、ベンチマークとかがい離しました。

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が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です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、収益分配を見送らせていただきました。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	5,446

- (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

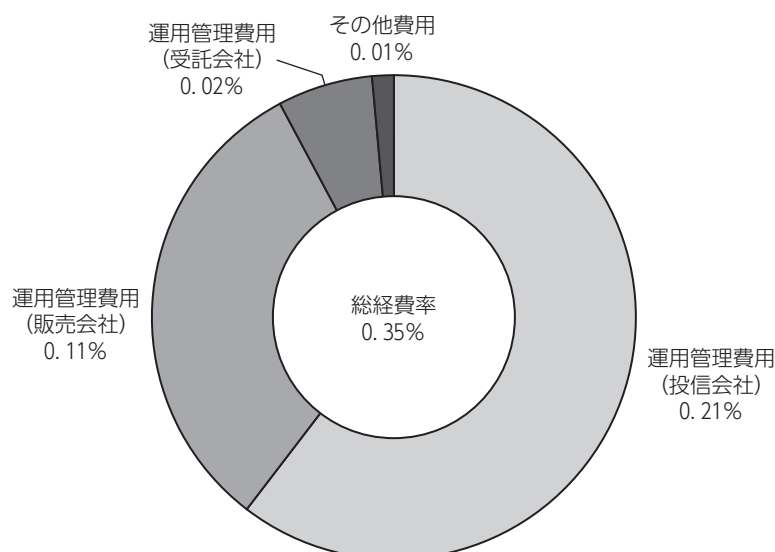
項目	当期 (2021. 6. 16~2022. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	55円	0.341%	信託報酬＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は16,040円です。
(投信会社)	(34)	(0.209)	投信会社は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(18)	(0.110)	販売会社は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(4)	(0.022)	受託会社は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0.004	売買委託手数料＝当期中の売買委託手数料／当期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(1)	(0.003)	
(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	0.005	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)	(0.005)	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	56	0.351	

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

参考情報

■ 総経費率

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



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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	2,676,911	3,554,000	1,347,545	1,791,900

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	33,978,631千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	180,818,819千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.18

(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6月16日から2022年6月15日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A		B/A	売付額等 C		D/C
区 分	百万円	うち利害関係人との取引状況 B 百万円		%	百万円	
株式	25,021	7,696	30.8	8,957	25	0.3
株式先物取引	37,760	11,043	29.2	38,793	10,311	26.6
コール・ローン	2,560,168	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合7.5%

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

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

種 類	当 期		
	トピックス・インデックス・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	33	2	345

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

種 類	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
	買 付 額
	百万円
株式	75

(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6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	610千円
うち利害関係人への支払額 (B)	46千円
(B) / (A)	7.5%

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

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

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	10,040,729	11,370,096	14,581,011

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
トピックス・インデックス・マザーファンド	14,581,011	99.8
コール・ローン等、その他	28,597	0.2
投資信託財産総額	14,609,608	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6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	14,609,608,778円
コール・ローン等	28,597,197
トピックス・インデックス・マザーファンド (評価額)	14,581,011,581
(B) 負債	27,546,656
未払解約金	2,915,623
未払信託報酬	24,240,159
その他未払費用	390,874
(C) 純資産総額 (A - B)	14,582,062,122
元本	9,440,492,072
次期繰越損益金	5,141,570,050
(D) 受益権総口数	9,440,492,072口
1万口当り基準価額 (C / D)	15,446円

* 期首における元本額は8,307,899,565円、当作成期間中における追加設定元本額は2,926,939,275円、同解約元本額は1,794,346,768円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は15,446円です。

■損益の状況

当期 自 2021年 6月16日 至 2022年 6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 4,534円
受取利息	475
支払利息	△ 5,009
(B) 有価証券売買損益	△ 551,563,327
売買益	53,891,059
売買損	△ 605,454,386
(C) 信託報酬等	△ 48,475,840
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 600,043,701
(E) 前期繰越損益金	2,093,539,027
(F) 追加信託差損益金	3,648,074,724
(配当等相当額)	(2,075,440,097)
(売買損益相当額)	(1,572,634,627)
(G) 合計 (D + E + F)	5,141,570,050
次期繰越損益金 (G)	5,141,570,050
追加信託差損益金	3,648,074,724
(配当等相当額)	(2,075,440,097)
(売買損益相当額)	(1,572,634,627)
分配準備積立金	2,093,542,475
繰越損益金	△ 600,047,149

- (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	3,048,035,557
(d) 分配準備積立金	2,093,542,475
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	5,141,578,032
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	5,141,578,032
(h) 受益権総口数	9,440,492,072口

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 J P X 総研または株式会社 J P X 総研の関連会社 (以下「J P X」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 J P X が有します。J P X 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、J P X 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 J P X は責任を負いません。

《お知らせ》

■マザーファンドにおける主要投資対象について

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（ダイワファンドラップ TOPIXインデックス）が投資対象としている「トピックス・インデックス・マザーファンド」の決算日（2021年9月21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6月15日）現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

トピックス・インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
ソフトバンク	526.3	806,304	1,532	ソフトバンクグループ	126.8	774,874	6,111
ソニーグループ	58.6	696,146	11,879	キーエンス	4.9	319,597	65,224
トヨタ自動車	249.4	668,951	2,682	日本電信電話	85.1	265,837	3,123
リクルートホールディングス	82.4	518,902	6,297	三菱UFJフィナンシャルG	398.6	252,598	633
三菱商事	138.2	501,089	3,625	トヨタ自動車	105.6	226,485	2,144
東京エレクトロン	9.1	498,988	54,833	信越化学	10	200,798	20,079
日本電信電話	138.6	493,471	3,560	KDDI	46.8	168,246	3,595
キーエンス	8.4	477,566	56,853	東京海上HD	17.6	124,273	7,060
日本郵政	424.3	379,922	895	新生銀行	54.7	108,089	1,976
日本電産	28.8	338,298	11,746	ダイキン工業	5.3	107,355	20,255

(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6月15日現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンド（144,235,597千円）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
水産・農林業 (0.1%)			大木建設	2.4	3,691	トーエネック	2.3	7,394	亀田製菓	4	17,940
極洋	3.4	11,203	鉄建建設	4.6	8,280	住友電設	5.7	14,147	寿スピリッツ	6.7	47,704
日本水産	96.4	51,188	西松建設	14.2	59,853	日本電設工業	10.9	17,276	カルビー	34	81,294
マルハニチロ	14.2	32,944	三井住友建設	52.5	23,835	エクシオグループ	33.6	70,257	森永乳業	13	56,355
雪国まいたけ	7.4	6,393	大豊建設	3.4	15,113	新日本空調	5.4	9,828	六甲バター	5.2	7,228
カネコ種苗	2.9	4,721	佐田建設	4.7	2,100	九電工	15.9	42,421	ヤクルト	50.1	368,736
サカタのタネ	11.3	51,584	ナカノフード建設	5.1	1,530	三機工業	15.2	22,404	明治ホールディングス	43.5	270,135
ホクト	7.9	15,010	奥村組	12.2	35,538	日揮ホールディングス	68.1	127,551	雪印メグミルク	16.8	28,308
ホクリヨウ	1.5	951	東鉄工業	9.8	22,236	中外炉工業	2.1	3,559	プリマハム	9.4	19,740
鉱業 (0.4%)			イチケン	1.6	2,902	ヤマト	5.7	4,235	日本ハム	27	108,810
住石ホールディングス	17.5	3,255	富士ビー・エス	2.7	1,255	太平電業	4.5	12,244	林兼産業	2.7	1,312
日鉄鉱業	2.1	11,655	浅沼組	2.6	13,728	高砂熱学	19	30,305	丸大食品	7	10,367
三井松島 HLDGS	4.2	11,424	戸田建設	92.2	65,001	三晃金属	0.8	2,056	S Foods	6.7	20,167
INPEX	363.9	604,801	熊谷組	11.6	31,262	朝日工業社	3	4,725	柿安本店	2.4	5,632
石油資源開発	11.9	41,055	北野建設	1.4	2,871	明星工業	12.4	9,039	伊藤ハム米久 HLDGS	47.9	31,709
K&O エナジーグループ	4.2	6,552	植木組	1.8	2,604	大気社	10.3	31,672	サッポロホールディングス	23.1	63,848
建設業 (2.2%)			矢作建設	9.4	7,050	ダイダ	4.7	9,635	アサヒグループホールディング	160.4	677,369
ショーボンドHD	12.7	77,216	ピーエス三菱	7.5	4,447	日比谷総合設備	6.6	12,447	キリンHD	275	559,075
ミライト・ホールディングス	32.7	52,908	日本ハウス HLDGS	15.7	6,123	フィル・カンパニー	1.3	1,450	宝ホールディングス	44.7	42,465
タマホーム	6.2	14,687	大東建託	24	264,480	テスホールディングス	6.5	7,774	オエノンホールディングス	20.8	6,052
サンヨーホームズ	0.8	578	新日本建設	9.7	6,984	インフロンニアHD	90.7	82,537	養命酒	2.3	3,979
日本アーク	4.1	2,439	東亜道路	1.2	6,480	東洋エンジニア	9.8	6,076	カカ・コーポラズJHD	49.2	70,011
ファーストコーポレーション	2.1	1,518	日本道路	2	13,000	レイズネクスト	10.4	11,648	サントリー食品インター	50	233,000
ベステラ	2	2,256	東亜建設	5.4	12,873	食料品 (3.3%)			グアイルグループHD	3.8	18,506
キャンディル	1	530	日本国土開発	19.4	9,874	ニッポン	19.4	30,244	伊藤園	22.7	117,132
ダイセキ環境ソリューション	1.9	1,767	若築建設	3.6	7,671	日清製粉G本社	75.1	112,574	キーコーヒー	6.9	14,200
第一カッター興業	2.3	2,973	東洋建設	24.2	19,239	日東富士製粉	1.2	5,058	ユニカフェ	2.4	2,176
安藤・間	47.6	39,127	五洋建設	88.6	55,818	昭和産業	6.4	15,443	ジャパンフーズ	1.1	1,284
東急建設	27.9	17,074	世紀東急	11.1	8,868	鳥越製粉	6.1	3,843	日清オイログループ	8.8	26,215
コムシスホールディングス	32.7	80,343	福田組	2.5	11,050	中部飼料	8.1	8,010	不二製油グループ	16.1	30,058
ビアーホールディングス	12.8	3,942	住友林業	54.2	105,961	フィード・ワン	9.4	6,110	かどや製油	0.8	2,760
高松コンストラクションGP	6.1	12,486	日本基礎技術	5.8	3,300	東洋精糖	1.5	1,425	J-オイルミルズ	7.2	10,821
東建コーポレーション	2.8	21,420	巴コーポレーション	8.7	3,497	日本甜菜糖	4	6,544	キッコーマン	47.9	318,535
ソネック	1	1,016	大和ハウス	195.5	594,515	DM三井製糖ホールディ	6.3	11,718	味の素	153.3	466,645
ヤマウラ	4.1	3,763	ライト工業	13.3	23,793	塩水港精糖	9.3	1,934	ブルドックソース	2.8	5,056
オリエンタル白石	33.6	8,030	積水ハウス	232.7	542,889	日新製糖	3.8	6,551	キューピー	34.8	74,576
大成建設	63.5	254,000	日特建設	4.6	3,592	森永製菓	15.8	60,593	ハウス食品G本社	24.8	67,034
大林組	223	212,073	北陸電気工事	4.2	3,120	中村屋	1.6	4,880	カゴメ	28.3	91,267
清水建設	207.1	148,283	ユアテック	13.2	9,266	江崎グリコ	18.4	65,596	焼津水産化工	3.4	3,066
飛鳥建設	5.9	5,894	日本リーテック	4.5	4,639	名糖産業	3	4,824	アリアケジャパン	6.8	35,360
長谷工コーポレーション	65.2	101,646	四電工	2.2	3,700	井村屋グループ	3.9	8,595	ピエトロ	1.1	1,983
松井建設	8.1	5,386	中電工	9.8	20,354	不二家	4.4	9,966	エバラ食品工業	1.7	5,015
銭高組	0.9	2,988	関電工	38	30,970	山崎製パン	49.2	72,914	やまみ	0.7	1,083
鹿島建設	163.3	234,825	きんでん	49.2	74,095	第一屋製パン	1.6	808	ニチレイ	30	66,450
不動テトラ	5	7,780	東京エネシス	7.1	6,766	モロゾフ	2.3	7,785	東洋水産	34.2	165,015

トピックス・インデックス・マザーファンド

運用報告書 第33期 (決算日 2021年9月21日)

(作成対象期間 2020年9月24日～2021年9月21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。

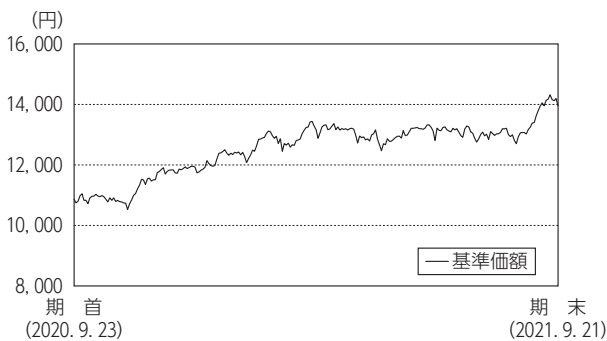
運用方針	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、東証株価指数をモデルとして運用を行いません。
主要投資対象	東京証券取引所第1部上場株式(上場予定を含みます。)
株式組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		TOPIX		株式組入比率	株式先物比率
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首)2020年9月23日	10,865	—	1,644.25	—	99.4	0.6
9月末	10,829	△ 0.3	1,625.49	△ 1.1	98.5	1.4
10月末	10,523	△ 3.1	1,579.33	△ 3.9	97.9	2.0
11月末	11,698	7.7	1,754.92	6.7	97.9	1.8
12月末	12,046	10.9	1,804.68	9.8	98.8	1.1
2021年1月末	12,074	11.1	1,808.78	10.0	99.1	0.8
2月末	12,452	14.6	1,864.49	13.4	99.3	0.7
3月末	13,165	21.2	1,954.00	18.8	98.1	2.8
4月末	12,793	17.7	1,898.24	15.4	98.2	1.8
5月末	12,969	19.4	1,922.98	17.0	97.2	2.8
6月末	13,123	20.8	1,943.57	18.2	98.0	2.0
7月末	12,839	18.2	1,901.08	15.6	97.0	3.0
8月末	13,244	21.9	1,960.70	19.2	98.3	1.6
(期末)2021年9月21日	13,951	28.4	2,064.55	25.6	98.7	0.9

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。
上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
(注3) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。
(注4) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,865円 期末：13,951円 騰落率：28.4%

【基準価額の主な変動要因】

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。

◆投資環境について

○国内株式市場

国内株式市場は上昇しました。

国内株式市場は、当作成期首より、国内外の新型コロナウイルスの感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、横ばい圏で推移しました。2020年11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が当選確実となって選挙結果に対する不確実性が後退したことや、それによって大型経済対策への期待が高まったこと、欧米において複数のワクチンの接種が始まったことなどが好感され、株価は上昇しました。2021年に入っても、1月に行われた米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利して大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、3月には実際に米国で追加経済対策が発表されたこと、国内のウイルスの感染状況が改善したことなどが好感され、株価は上昇しました。その後は、国内で感染が再拡大して再び行動制限措置がとられたことや、内閣支持率の低下で政局の行方に不透明感が増したことで、また世界的にインフレ懸念が台頭して米国の金融緩和縮小の早期化観測が高まったことなどから、上値の重い展開となりました。当作成期末にかけては、菅首相の自民党総裁選挙への不出馬表明が、支持率の低迷していた政権に有利に働くことを受け止められたことから、上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

当作成期中、資金変動への対応、新規上場等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25.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は28.4%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TOPIX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)	0円 (0) (0)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	0

(注1) 費用の項目および算出法については前掲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

(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 (△ 6,069.7 7,114.63)	千円 (14,873,822 —)	千株 7,752.67004	千円 19,217,399

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2020年9月24日から2021年9月21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
	百万円	百万円	百万円	百万円
国内 株式先物取引	32,229	31,927	—	—

(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

(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

銘 柄	買 付			売 付			
	株 数	金 額	平均単価	株 数	金 額	平均単価	
	千株	千円	円	千株	千円	円	
キーエンス	9.2	523,226	56,872	NTTドコモ	474.3	1,849,770	3,900
東芝	133.5	508,139	3,806	トヨタ自動車	110.3	845,300	7,663
トヨタ自動車	36.1	338,024	9,363	エムスリー	61.9	562,795	9,092
信越化学	16.2	301,724	18,624	日本電信電話	157	415,890	2,648
ソニーグループ	27.5	300,228	10,917	ソフトバンクグループ	38	312,703	8,229
ソフトバンクグループ	34.3	272,972	7,958	任天堂	5	311,643	62,328
KDDI	80.2	263,160	3,281	ソニーグループ	30.5	304,967	9,998
エムスリー	32.9	246,981	7,507	第一三共	90.5	266,891	2,949
ANAホールディングス	71	164,518	2,317	キーエンス	4.6	240,319	52,243
リクルートホールディングス	29.8	158,633	5,323	東京エレクトロン	5.6	220,717	39,413

(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%)				スペースバリューHD	11.1	11.5	9,740	大豊建設	4.8	5	19,100	極洋	3.3	3.1	9,455	ダイセキ環境ソリューション	1.8	1.8	2,982	前田建設	53.5	53.4	46,618
日本水産	92.4	84.3	54,120	第一カッター興業	1.1	2.3	3,045	佐田建設	4.5	5.1	2,468	マルハニチロ	13.4	14	37,156	安藤・間	54.9	58.4	47,420	ナカノフドー建設	5.7	5	1,790
カナコ種苗	2.8	2.7	4,163	東急建設	27.1	29	23,200	奥村組	10	11.5	35,937	サカタのタネ	11	10.8	39,096	コムシスホールディングス	32.6	32.6	97,343	東鉄工業	9	8.5	21,505
ホクト	7.1	7.9	15,626	コムシスホールディングス	32.6	32.6	97,343	ピーアールホールディングス	9.9	12.5	6,050	信越化学	16.2	16.2	301,724	ピアールホールディングス	9.9	12.5	6,050	イチケン	1.5	1.5	2,904
ホクリョウ	1.6	2.3	1,741	高松コンストラクションGP	5.7	5.7	11,747	高松コンストラクションGP	5.7	5.7	11,747	エムスリー	32.9	32.9	246,981	富士ピー・エス	3	2.4	1,420	浅沼組	2.4	2.6	12,012
鉱業 (0.2%)				東建コーポレーション	2.8	2.8	29,064	東建コーポレーション	2.8	2.8	29,064	ANAホールディングス	71	71	164,518	戸田建設	87.6	86.1	71,032	熊谷組	9.9	9.9	27,383
住石ホールディングス	18.4	21.6	3,002	ソネック	0.9	1	1,130	ソネック	0.9	1	1,130	リクルートホールディングス	29.8	29.8	158,633	熊谷組	9.9	9.9	27,383	北野建設	1.3	1.2	2,628
日鉄鉱業	2.1	2.1	13,818	ヤマウラ	4	4.1	3,825	ヤマウラ	4	4.1	3,825	エムスリー	32.9	32.9	246,981	植木組	0.9	1.8	2,766	矢作建設	9.3	9.3	7,746
三井松島 HLDGS	3.4	3.6	5,058	オリエンタル白石	—	32.3	8,656	オリエンタル白石	—	32.3	8,656	キーエンス	4.6	4.6	240,319	ビーエス三菱	7	6.8	4,488	日本ハウス HLDGS	14.2	14.7	6,438
INPEX	339.1	367.2	289,353	大成建設	70.8	65.4	235,440	大成建設	70.8	65.4	235,440	ソニーグループ	27.5	27.5	300,228	大東建託	23.1	23	300,380	新日本建設	9	8.4	7,660
石油資源開発	12.1	12.4	24,366	大林組	212.7	209	195,624	大林組	212.7	209	195,624	ソフトバンクグループ	34.3	34.3	272,972	NIPPPO	17.4	17.7	70,623	東亜道路	1.3	1.3	5,999
K&O エナジーグループ	4.5	4.3	5,925	清水建設	215.5	197.8	167,338	清水建設	215.5	197.8	167,338	トヨタ自動車	36.1	36.1	338,024	前田道路	18.8	13.2	26,334	日本道路	2	2.1	17,850
建設業 (2.3%)				飛島建設	5.9	5.7	6,418	飛島建設	5.9	5.7	6,418	東芝	133.5	133.5	508,139	東亜建設	6.7	6	14,622	日本国土開発	20.8	20	12,140
ヒノキヤグループ	2.3	2.3	5,451	長谷工コーポレーション	81.8	68.6	102,900	長谷工コーポレーション	81.8	68.6	102,900	信越化学	16.2	16.2	301,724	若築建設	3.7	3.6	7,660				
ショーボンドHD	14.3	13.2	66,792	松井建設	8.3	7.8	6,208	松井建設	8.3	7.8	6,208	キーエンス	4.6	4.6	240,319								
ミライト・ホールディングス	27.4	31.9	73,497	銭高組	0.9	0.9	3,960	銭高組	0.9	0.9	3,960	ソニーグループ	80.2	80.2	263,160								
タマホーム	5	5.9	16,543	鹿島建設	166.7	153.9	225,617	鹿島建設	166.7	153.9	225,617	ANAホールディングス	71	71	164,518								
サンヨーホームズ	0.5	1.5	1,113	不動テトラ	5.5	5.1	9,149	不動テトラ	5.5	5.1	9,149	リクルートホールディングス	29.8	29.8	158,633								
日本アーク	3.8	4.4	2,578	大末建設	2.3	2.5	2,462	大末建設	2.3	2.5	2,462	エムスリー	32.9	32.9	246,981								
ファーストコーポレーション	3	3.2	2,576	鉄建建設	4.6	3.9	7,133	鉄建建設	4.6	3.9	7,133	キーエンス	4.6	4.6	240,319								
ベストセラ	1.6	1.9	2,755	西松建設	16.4	15.5	55,257	西松建設	16.4	15.5	55,257	トヨタ自動車	36.1	36.1	338,024								
キャンディル	1.4	1.7	1,057	三井住友建設	51.7	51.7	25,126	三井住友建設	51.7	51.7	25,126	キーエンス	4.6	4.6	240,319								

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
中国電力	97.1	97.7	104,343	三菱倉庫	20.4	22	72,380	ザッパラス	2.9	4.1	2,140									
北陸電力	62.2	62.4	38,438	三井倉庫 HOLD	7.4	6.9	18,719	システムリサーチ	1.8	2.1	4,380									
東北電力	168.3	156.4	134,660	住友倉庫	23	22.5	43,897	インターネットアジアティ	9.9	18	71,460									
四国電力	61.1	55.1	45,567	渋沢倉庫	3.5	3.4	8,255	さくらインターネット	7	7.8	4,898									
九州電力	139.3	148.5	130,531	東陽倉庫	11.3	9.6	3,398	ヴァンクス	1.9	1.9	1,873									
北海道電力	63.7	64.3	35,300	日本トランスシティ	13.8	13.5	9,045	GMOグローバルサインHD	1.2	1.6	7,408									
沖縄電力	13.2	13	19,487	ケイヒン	0.9	1.1	1,577	SRA ホールディングス	3.6	3.6	10,659									
電源開発	54	53.3	88,904	中央倉庫	3.9	3.5	3,661	システムインテグレート	2.3	1.8	1,137									
エフオン	3.7	4.5	4,090	川西倉庫	1.1	1.1	1,468	朝日ネット	4.7	6	4,530									
イーレックス	9.7	10.2	28,968	安田倉庫	5.1	5	5,005	e B A S E	8	8.6	7,172									
レノバ	11.3	11.7	64,233	ファイズホールディングス	1.4	1.4	1,073	アバント	6.3	7.7	11,958									
東京瓦斯	130.1	128.7	277,798	東洋埠頭	2	1.8	2,818	アドソル日進	2.4	2.7	6,166									
大阪瓦斯	131.5	120.9	257,396	宇徳	5.5	5.4	3,099	フリービット	3.7	4.7	5,480									
東邦瓦斯	33.3	33.1	179,733	上組	35.7	34.9	83,829	コムチュア	7.5	6.2	19,902									
北海道瓦斯	3.6	3.5	5,607	サンリツ	1.5	1.9	1,569	サイバーコム	1.2	1.1	1,465									
広島ガス	13	11.7	4,680	キムラユニティ	1.6	1.4	2,146	アステリア	4.4	5.2	3,666									
西部ガス HLDGS	7.6	7.4	18,973	キューソー流通システム	1.6	1.5	2,802	アイル	3.7	3.9	7,538									
静岡ガス	19.3	19.3	24,993	近鉄エクスプレス	13.7	12	37,680	マークラインズ	3.2	3.6	10,998									
メタウォーター	3.3	7.9	15,215	東海運	3.6	4	1,404	メディカル・データ・ビジ	5	8.9	14,151									
陸運業 (3.1%)				エーアイティー	4.5	4.1	5,079	g u m i	8.6	9.5	7,780									
SBS ホールディングス	5.1	5.4	22,923	内外トランスライン	2.1	2.7	6,642	ショーケース	1.6	1.9	1,238									
東武鉄道	70.4	69.5	206,971	日本コンセプト	2	2.2	4,952	モバイルファクトリー	1.6	2.1	2,188									
相鉄ホールディングス	21.6	22.6	50,488	情報・通信業 (8.5%)				テラスカイ	2.4	2.5	5,400									
東急	170.5	168.3	270,626	NEC ネットズエスアイ	18.9	22.3	49,082	デジタル・インフォメーション	2.9	3.4	6,953									
京浜急行	87.1	86	116,444	クロスキャット	1.8	1.8	2,545	PCI ホールディングス	2.8	3.6	4,060									
小田急電鉄	100.5	107.3	276,297	システナ	23.7	24	57,360	パイブドHD	0.9	1.6	4,038									
京王電鉄	35.1	37.4	224,026	デジタルアーツ	3.3	3.9	36,114	アイビーシー	1.4	1.4	1,239									
京成電鉄	47.1	50.5	179,527	日鉄ソリューションズ	9.9	9.7	38,751	ネオジャパン	1.2	1.7	2,888									
富士急行	9.3	9.2	42,136	キューブシステム	3.5	3.8	4,187	P R T I M E S	1.2	1.8	5,490									
新京成電鉄	1.7	1.9	4,142	WOW WORLD	1.4	1.7	2,981	ラクス	—	20.4	94,758									
東日本旅客鉄道	119	118.2	837,801	コア	2.8	2.6	4,053	ランドコンピュータ	1	1	1,309									
西日本旅客鉄道	60.4	75	389,400	ラクーンホールディングス	3.2	5	7,595	ダブルスタンダード	0.9	1	7,830									
東海旅客鉄道	56.2	55.8	913,167	ソリトンシステムズ	3.1	3.6	5,569	オープンドア	3.4	4.3	10,074									
西武ホールディングス	88.9	81.3	108,372	ソフトクリエイトHD	2.9	2.7	9,396	マイネット	2.1	2.6	1,682									
鴻池運輸	10.9	10.4	14,227	T I S	66.3	66.3	210,171	アカツキ	2.4	2.9	9,367									
西日本鉄道	18.8	18.4	52,826	JNS ホールディングス	2.8	4.3	2,201	ベネフィットジャパン	0.5	0.7	1,640									
ハマキョウレックス	5.2	5	17,275	電算システム	2.5	—	—	UBICOMホールディングス	1.6	2	5,786									
サカイ引越センター	3.6	3.2	15,808	グリー	40.9	42.6	27,349	LINE	20.4	—	—									
近鉄グループHLDGS	64.1	63.4	236,482	コーエーテックモHD	13.6	17.9	105,252	カナミックネットワーク	6	7.5	4,740									
阪急阪神 HLDGS	85.4	84	295,680	三菱総合研究所	2.9	2.8	12,418	ノムラシステムコーポレーション	3.6	3.9	1,119									
南海電鉄	30.5	29.8	71,132	ボルテージュ	1.9	3.1	1,398	チェンジ	4.6	12.6	28,350									
京阪ホールディングス	28.5	28.3	88,296	電算	0.7	0.8	2,064	シンクロ・フード	2.7	5.2	2,069									
神戸電鉄	1.5	1.5	5,422	A G S	3.7	3.1	3,081	オークネット	3.6	3.9	8,872									
名古屋鉄道	52.4	52.3	106,901	ファインデックス	5.7	6.1	6,423	セブエグループ	1.3	2	1,644									
山陽電鉄	4.7	4.4	9,081	ブレインパッド	1.7	1.9	11,552	エイトレッド	1.1	1.6	4,096									
日本通運	22.2	22	178,640	K L a b	12.6	12	7,296	AOI TYO HOLDINGS	6.7	—	—									
ヤマトホールディングス	112.3	89.1	259,637	ポルトウウィン・ビットクル	8	8.9	9,095	マクロミル	13.5	13.5	10,840									
山九	17.8	16.2	86,670	イーブックイニシアティブ	0.9	1.3	5,297	ビーグリー	1.3	1.7	2,415									
丸運	3.5	4.3	1,186	ネクソン	167.2	148.6	259,752	オロ	1.7	2.3	9,165									
丸全昭和運輸	5.2	5.2	19,136	アイスタイル	18.4	21.6	9,763	ユーザーローカル	0.6	2.7	5,429									
センコーグループHLDGS	34.9	36.2	38,010	エムアップホールディングス	1.9	2	6,730	テモナ	1.3	2	1,618									
トナミホールディングス	1.5	1.5	7,875	エイチーム	4.5	5.1	7,435	ニーズウェル	1	1.8	1,405									
ニッコンホールディングス	22.9	21.3	52,376	エニグモ	6.3	6.5	8,417	サインポスト	1.3	1.8	2,484									
日石輸送	0.6	0.6	1,602	テクノスジャパン	5.3	5.3	3,296	電算システムHD	—	2.9	8,569									
福山通運	8.2	8.1	40,743	e n i s h	3.5	3.9	1,770	ソルクシーズ	3	3	3,309									
セイノーホールディングス	47.9	47.6	65,640	コプロ	21.9	21.3	17,657	フェイス	2.3	2.5	1,760									
エスライン	1.7	1.3	1,231	オルトプラス	4.6	5.1	2,142	プロトコーポレーション	6	8.1	12,708									
神奈川中央交通	1.5	1.5	5,415	ブロードリーフ	32.9	33.8	19,435	ハイマックス	0.8	2.2	2,448									
日立物流	11.7	13.4	66,866	クロス・マーケティングG	3.2	3.3	2,930	野村総合研究所	94	114.8	516,026									
丸和運輸機関	6.8	13.8	23,156	デジタルハーツ HLDGS	3.7	3.4	7,650	サイバネットシステム	5.1	5.3	3,439									
C&F ロジホールディングス	6.5	6.3	12,196	システム情報	4.9	5.4	5,529	C E ホールディングス	4	3.8	2,382									
九州旅客鉄道	56.3	49.5	123,255	メディアドゥ	2.1	2.8	14,000	日本システム技術	1.2	1.2	2,175									
SG ホールディングス	67.2	120.5	407,892	じげん	16.5	17	6,987	インテジホールディングス	8.4	8.8	14,440									
海運業 (0.6%)				ブイキューブ	3.7	7	11,571	東邦システムサイエンス	1.7	1.4	1,491									
日本郵船	53.7	53.4	537,204	エンカレッジ・テクノロジー	1.3	1.1	674	ソースネクスト	31.6	33.4	8,183									
商船三井	40.7	37.9	348,301	サイパーリンクス	1.2	2.6	3,746	インフォコム	7.3	6.6	16,691									
川崎汽船	19.8	19.8	144,738	ディー・エル・イー	4.3	4.3	1,259	H E R O Z	0.9	2	4,066									
NS ユナイテッド海運	3.6	3.2	16,096	フィックスターズ	7.1	7.1	5,687	ラクスル	5.3	7.4	47,952									
明治海運	6.6	7	6,251	CARTA HOLDINGS	3.1	3	7,605	F I G	7.7	6.8	1,972									
飯野海運	30.2	29.3	16,818	オブティム	3.5	5	9,810	システムサポート	1.4	1.9	2,540									
共栄タンカー	1.2	1.2	1,300	セレス	2.3	2.6	7,033	イーソル	3.1	4	4,068									
乾汽船	3.7	4.5	12,060	S H I F T	2.7	3.4	92,922	アルテリア・ネットワークス	7.4	7.8	13,751									
空運業 (0.5%)				ティーガイア	5.9	6.7	13,567	東海ソフト	0.4	1.3	1,718									
日本航空	113.5	155.4	388,344	セック	1	1	2,442	ヒト・コミュニケーションズHD	1.6	1.9	3,718									
ANA ホールディングス	117.3	172	466,120	日本アジアグループ	7.3	—	—	トビラシステムズ	0.8	1.6	2,140									
パスコ	1.3	1.3	1,913	テクマトリックス	9.4	11.1	22,422	S a n s a n	—	6	75,540									
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				プロシップ	1.9	2.2	3,680	フォーカスシステムズ	4.2	5.6	5,796									
トランコム	1.8	2	17,400	ガソホー・オンライン・エンター	16.1	17.8	37,967	クレスコ	4	4.7	10,133									
日新	5.6	4.9	8,467	GMOペイメントゲートウェイ	14.1	12.9	196,983	フジ・メディア・HD	64.4	68.5	81,583									

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																												
	株数	千株	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																										
オービック	23	20.8	484,016	23	20.8	484,016	ジャステック	4.2	4.1	5,198	高速	4	3.5	5,656	たけびし	2.4	2.2	3,823	リックス	1.5	1.3	1,989	丸文	5.6	5.6	4,390	ハピネット	5.5	6	8,988	橋本総業HLDGS	1.3	1.6	3,652	日本ライフライン	19.9	21.3	29,394	タカショー	3.9	5.1	4,758	マルカ	2.3	2.3	6,713	IDホールディングス	2.5	3.6	3,459	富士ソフト	7.1	7.2	43,704	NSD	21.3	21.6	45,403	コナミホールディングス	24.2	24	164,160	福井コンピュータHLDS	2.6	3.3	14,520	JBCCホールディングス	4.5	4.2	6,997	ミロク情報サービス	5.9	6.6	11,338	ソフトバンクグループ	526.6	522.9	3,309,434	卸売業 (4.8%)				ハウスイ	0.5	0.5	471	高千穂交野	2.5	2.5	3,092	オルパルスケアHLDGS	0.7	1.1	1,755	伊藤忠食品	1.7	1.6	8,736	エレマテック	6.3	5.8	6,849	JALUX	1.8	1.7	3,054	あらた	5.3	5.1	23,358	トーメンデバイス	1	0.9	4,941	東京エレクtronデバイス	2.4	2.2	18,876	フィールズ	4.9	5.9	3,097	双日	368.1	367.4	130,059	アルフレッサホールディングス	73.9	68.6	119,981	横浜冷凍	17.5	17.4	16,077	神栄	1	1.2	1,296	ラサ商事	3.4	3.3	3,184	アルコニックス	7.1	7.2	12,139	神戸物産	23	51.6	208,980	ハイパー	0.9	1.6	870	あいホールディングス	9.5	9.3	22,329	ディーブイエックス	2.3	2.1	2,370	ダイワボウHD	5.7	30.3	59,812	マクニカ・富士エレHLDGS	15.9	16	44,624	ラクト・ジャパン	2.5	3	8,532	パイタルKSKHD	11.5	11.3	9,446	八洲電機	5.1	4.6	4,968	メディアスホールディングス	3.7	3.9	3,662	レスターホールディングス	7	6.5	12,629	ジューテックHD	1.3	1.4	1,569	大光	2.8	3	2,124	OCHIホールディングス	1.9	1.9	2,492	TOKAIホールディングス	34.9	31.5	29,295	黒谷	1.6	2.4	1,910	Cominix	1.1	1.3	939	三洋貿易	6.7	6.9	8,438	ビューティガレージ	1.1	1.2	4,362	ウイン・パートナーズ	4.8	4.6	4,558	ミタチ産業	2	1.1	963	シップヘルスケアHD	10.7	23.5	68,385	明治電機工業	2	2.1	2,908	デリカフーズHLDGS	2.2	3.5	2,359	スターティアホールディングス	1.7	1.6	2,924	コメダホールディングス	14.6	14.6	31,375	ピーバンドットコム	0.6	1.2	858	アセンテック	1.4	2	2,500	富士興産	2.2	2.1	2,221	協栄産業	0.7	0.7	1,027	小野建	5.5	5.5	9,581	南陽	1.4	1.2	2,490	佐島電機	4.5	4	3,668	エコートレーディング	1.5	1.9	1,274	伯東	4.1	4.4	8,676	コンドーテック	5.2	4.8	4,968	中山福	3.7	4.3	1,840	ナガイレベ	8.9	8.4	23,007	三菱食品	7.4	7	20,517	松田産業	4.9	5.2	15,782	第一興商	10	12.9	49,213	メディアバルHD	71.5	66.2	145,706	SPK	2.8	2.9	4,065	萩原電気HLDGS	2.5	2.4	5,551	アズワン	4.4	4.8	84,720	スズデン	2.3	2.2	3,568	尾家産業	1.9	2	2,302	シモジマ	4.1	4.2	5,481	ドウシシャ	6.3	6.2	11,042	小津産業	1.5	1.7	3,394	アイ・エス・ビー	1.4	4.1	5,231

トピックス・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																					
	株数	千株	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円		株数	千株	千円	株数	千株	千円																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																			
じもとホールディングス	45	4.3	3,048	トモニホールディングス	51.8	48.2	16,147	エストラスト	1.4	1.1	729	じもとホールディングス	45	4.3	3,048	フィデアホール	64.4	66.2	8,473	フージャースHD	13.3	10.4	7,238	めぶきフィナンシャルG	346	344.1	86,369	池田泉州HD	76.9	74.8	12,641	オープンハウス	19.5	21.2	139,072	東京きらぼしFG	9	8.8	13,860	証券・商品先物取引業 (0.7%)				東急不動産HD	181.9	180.4	119,785	九州フィナンシャルG	146.2	134.9	56,658	FPG	20.6	22.7	16,048	飯田GHD	55.5	55.3	160,093	ゆうちょ銀行	187.6	187.2	179,337	マーキュリアインベストメント	2.8	—	—	イーグランド	1	1.3	2,139	富山第一銀行	15.7	14.7	4,410	マーキュリアホールディングス	—	3.2	2,422	ビーロット	3.4	4.7	2,547	コンコルディア・フィナンシャル	380.6	402.8	178,843	SBIホールディングス	74.6	81.8	227,240	ファーストブラザーズ	1.5	1.2	1,238	西日本フィナンシャルHD	44.6	43.3	30,959	日本アジア投資	6.3	6.1	1,518	ハウスドゥ	3.5	3.3	3,286	関西みらいFG	39.5	—	—	ジャフコグループ	10.3	8.7	63,423	シーアールイー	1.8	1.9	4,582	33FG	6.2	5.6	8,366	大和証券G本社	534.4	495.5	330,845	プロパティエージェント	1.1	1.4	4,494	第四北越フィナンシャルG	11.7	10.7	27,841	野村ホールディングス	1,174.1	1,013	558,264	ケイアイスター不動産	2.2	2.3	12,788	ひろぎんHLDGS	—	98.7	64,352	岡三証券グループ	57.3	53.9	22,476	アグレ都市デザイン	1.7	1.7	2,007	新生銀行	49.1	54.7	103,164	丸三証券	19.7	19.6	12,759	ジェイ・エス・ビー	1.3	1.4	4,298	あおぞら銀行	40	39.5	107,993	東洋証券	24.3	21.5	3,612	テンポイノベーション	1.7	2.2	2,010	三菱UFJフィナンシャルG	4,562.2	4,527.4	2,863,580	東海東京HD	76.9	68.8	29,240	グローバルリンクマネジメント	1.4	1.3	1,223	りそなホールディングス	725.8	768.7	341,225	光世証券	1.8	1.8	1,089	パーク24	36	35.8	64,547	三井住友トラストHD	126	125.2	479,516	水戸証券	19.1	17.8	5,571	バラカ	1.7	1.6	2,944	三井住友フィナンシャルG	461	457.6	1,797,910	いちよし証券	12.2	13.3	9,522	三井不動産	329	301.5	760,533	千葉銀行	222.5	221.2	157,715	松井証券	37.7	32.2	26,822	三菱地所	467.2	433.9	750,863	群馬銀行	128	136.6	49,449	マネックスG	50	60.4	34,428	平和不動産	12.2	11.5	47,092	武蔵野銀行	10	9.7	18,284	極東証券	8.7	8.5	7,403	東京建物	66.1	65.4	111,114	千葉興業銀行	18	16.6	4,648	岩井コスモホールディング	6.3	7.7	11,118	ダイビル	17	16.9	26,296	筑波銀行	28.1	29.1	5,267	藍澤證券	12	11.9	13,768	京阪神ビルディング	10.5	10.5	15,456	七十七銀行	22.7	20.5	26,076	マネーパートナーズGP	6.6	9.1	1,992	住友不動産	149.9	148.9	578,923	青森銀行	5.2	5.1	11,123	スパークス・グループ	30.8	31.6	9,290	テーオーシー	12.9	12.1	8,022	秋田銀行	4.3	4	5,980	小林洋行	2.8	4.1	1,123	東京築天地	1.2	1	4,125	山形銀行	7.5	7	6,244	保険業 (2.0%)				スターツコーポレーション	9	7.7	21,937	岩手銀行	4.4	4.2	7,413	かんぽ生命保険	23.5	82.4	171,227	フジ住宅	7.7	7.7	5,528	東邦銀行	59.7	56.7	12,247	SOMPOホールディングス	125.4	116.6	592,094	空港施設	6.8	7.2	4,305	東北銀行	3.1	3.3	3,418	アニコムホールディングス	5.5	19.5	17,667	明和地所	4.2	3.4	2,077	みちのく銀行	4.4	4.5	3,996	MS&AD	174.3	160.3	615,071	ゴールドクレスト	5	5.8	9,987	ぶくおかフィナンシャルG	56.3	60.1	121,161	第一生命HLDGS	377.8	326.2	769,342	エスリード	2.7	2.5	4,175	静岡銀行	162.2	161.8	150,150	東京海上HD	235.9	218.1	1,308,600	日神グループHLDGS	10.3	9.3	4,752	十六銀行	8.4	8.3	18,284	T&Dホールディングス	199.7	198.3	305,382	日本エスコ	12.2	13.1	10,427	スルガ銀行	63	63	24,129	アドバンスクリエイト	1.6	3.4	3,787	タカラレーベン	30.2	29.3	9,434	八十二銀行	161	148.5	58,954	その他金融業 (1.1%)				AVANTIA	3.8	3.6	3,178	山梨中央銀行	7.8	7.4	6,349	全国保証	18.9	17.2	94,944	イオンモール	33.4	33.1	55,674	大垣共立銀行	13.2	12.9	25,038	ジェイリース	2.5	2.5	5,120	毎日コムネット	2	2.7	2,073	福井銀行	5.7	5.9	9,971	イントラスト	2.5	2.7	1,917	ファースト住建	2.9	2.9	3,862	北國銀行	6.7	6.2	13,106	日本モーゲージサービス	2.8	3.7	3,870	ランド	378.1	371.2	4,454	清水銀行	2.7	2.5	4,232	Casa	2.3	2.1	2,034	カチタス	16.6	16.4	66,502	富山銀行	1.3	1.3	2,996	アルヒ	10.7	10.1	13,180	トーセイ	9.4	9.3	10,648	滋賀銀行	13.4	13.2	24,987	プレミアグループ	3.6	3.4	11,798	穴吹興産	1.5	1.8	3,668	南都銀行	11.2	9.3	18,972	クレディセゾン	47	38.9	52,787	サンフロンティア不動産	9.5	8.1	9,185	百五銀行	59.5	59.3	19,924	芙蓉総合リース	7	6.8	53,924	インテリックス	2.8	2	1,542	京都銀行	23.9	23.9	119,978	みずほリース	10.2	10.5	38,377	ランドビジネス	2.6	2.9	783	紀陽銀行	23.7	23	36,593	東京センチュリー	13.4	15.3	99,450	サンネクスタグループ	1.9	2.3	2,339	ほくほくフィナンシャルG	44.5	44.2	37,083	日本証券金融	29.5	29	27,318	グランディアハウス	5.3	5.2	2,527	広島銀行	99	—	—	アイフル	102	113.8	40,968	日本空港ビルデング	21.4	23.1	115,962	山陰合同銀行	39.9	41	23,124	リコーリース	5.2	5.2	19,578	サービス業 (6.0%)				中国銀行	57.5	56	49,840	イオンフィナンシャルサービス	41.1	40.4	52,802	明豊ファシリティーワークス	2.7	3.3	3,012	鳥取銀行	2.2	2.2	2,530	アコム	133.9	129.8	54,645	日本工営	4.4	3.8	13,148	伊予銀行	95.1	88.2	51,597	ジャックス	7.4	7.7	23,485	LIFULL	22.6	22.5	8,212	百十四銀行	7.1	6.5	10,400	オリコ	181.6	179.6	27,478	ミクシィ	12.4	16.5	43,560	四国銀行	10.2	9.3	6,937	日立キャピタル	15.8	—	—	ジェイエイシールートメント	4.3	5.5	11,698	阿波銀行	10.9	9.9	21,968	アプラスフィナンシャル	34.1	—	—	日本M&Aセンター	49.2	105.5	378,745	大分銀行	3.9	3.7	6,889	オリックス	413.9	401.5	850,577	メンバーズ	1.9	2.4	8,280	宮崎銀行	4.5	4.1	8,745	三菱HCキャピタル	168.4	227	134,838	中広	0.6	1.1	442	佐賀銀行	4	3.8	5,719	九州リースサービス	2.9	3	1,842	UTグループ	10.2	9.4	29,046	沖縄銀行	6.1	5.8	16,634	日本取引所グループ	191.3	178.7	519,659	アイティメディア	2.6	2.5	5,910	琉球銀行	15.5	13.6	10,812	イー・ギャランティ	7.2	8	20,144	タケエイ	6.2	7.5	14,175	セブン銀行	223	221.9	56,806	アサックス	3.5	3.9	2,780	E・Jホールディングス	1.2	3.5	4,753	みずほフィナンシャルG	9,059.1	898.7	1,439,717	NECキャピタルソリューション	2.7	2.8	6,014	夢真ピーネックスグループ	8.1	17.6	23,496	高知銀行	2.5	2.5	2,102	不動産業 (1.9%)				コシダカホールディングス	15.5	18.6	10,843	山口フィナンシャルG	83.5	82.6	54,929	いちご	85.5	74.3	26,153	アルトナー	1.8	1.6	1,385	長野銀行	2.1	2.4	2,812	日本駐車場開発	69.7	73.5	11,907	パソナグループ	7	7.3	24,345	名古屋銀行	5.1	5.2	14,414	スター・マイカ・HLDGS	3.3	3.5	5,281	CDS	1.6	1.5	2,446	北洋銀行	101.3	101.2	26,716	ADワークスグループ	14.9	13.1	2,096	リンクアンドモチベーション	13.7	14.5	16,037	愛知銀行	2.4	2.3	8,418	ヒューリック	141.5	139.7	186,359	GCA	7.8	8.2	11,439	中京銀行	2.7	2.6	3,653	三栄建築設計	2.7	3	5,907	エス・エム・エス	20.2	22.2	94,128	大光銀行	2.2	2.2	3,498	野村不動産HLDGS	40.5	38.3	110,074	サニーサイドアップG	2.1	2	1,566	愛媛銀行	9	8.9	7,120	三重交通グループHD	13.3	12.8	6,758	パーソルホールディングス	65.1	64.2	175,009	トマト銀行	2.5	2.3	2,566	サムティ	9.5	9.7	22,765	リニカル	3.2	3.7	2,963	京葉銀行	28.5	25.7	11,693	日本商業開発	4.5	4.6	8,050	クックパッド	22.4	21.7	5,099	栃木銀行	31.6	31.6	5,846	プレサンスコーポレーション	11.1	11	20,614	エスクリ	2	3	1,671	北日本銀行	2	1.9	3,060	ハウスコム	0.9	1.2	1,536	アイ・ケイ・ケイ	3.1	3.1	2,135	東和銀行	11.7	12.2	6,771	日本管理センター	3.9	3.7	4,643	学情	2.4	2.8	3,533	福島銀行	7.3	7.7	1,940	サンセイランディック	2.5	2	1,656	大東銀行	3.3	3	2,055	スタジオアリス	3.2	3.4	8,027

■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	3,837,400 (16,100)	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作成期中の利害関係人のうち、大和証券へ16,100株を貸付けています。

■投資信託財産の構成

2021年9月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 189,973,468	% 94.3
コール・ローン等、その他	11,462,381	5.7
投資信託財産総額	201,435,849	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

2021年9月21日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	202,168,697,086円
コール・ローン等	11,388,192,763
株式(評価額)	189,973,468,640
未収配当金	69,858,959
未収利息	581,660
その他未収収益	3,470,064
差入委託証拠金	733,125,000
(B) 負債	9,685,976,375
未払金	82,698,850
未払解約金	229,583,550
差入委託証拠金代用有価証券	767,800,000
受入担保金	8,605,893,975
(C) 純資産総額 (A - B)	192,482,720,711
元本	137,972,449,571
次期繰越損益金	54,510,271,140
(D) 受益権総口数	137,972,449,571口
1万口当り基準価額 (C / D)	13,951円

* 期首における元本額は144,273,817,223円、当作成期間中における追加設定元本額は20,154,777,070円、同解約元本額は26,456,144,722円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、トピックス・インデックスファンド2,989,191,828円、ダイワ・トピックス・インデックスファンドV A5,882,696,138円、適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドV A2 925,539円、ダイワ国内重視バランスファンド30 V A (一般投資家私募) 25,469,299円、ダイワ国内重視バランスファンド50 V A (一般投資家私募) 429,078,400円、ダイワ国際分散バランスファンド30 V A (一般投資家私募) 23,164,900円、ダイワ国際分散バランスファンド50 V A (一般投資家私募) 721,398,709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) 212,609,568円、D - I's T O P I Xインデックス50,045,732円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2050 112,275,070円、iFree T O P I Xインデックス4,271,085,355円、iFree 8資産バランス3,194,833,049円、iFree 年金バランス442,601,861円、D Cダイワ日本株式インデックス65,726,059,110円、ダイワ・ライフ・バランス30 2,904,866,842円、ダイワ・ライフ・バランス50 3,951,974,309円、ダイワ・ライフ・バランス70 3,760,977,295円、年金ダイワ日本株式インデックス5,858,241,088円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2030 50,696,932円、D Cダイワ・ターゲットイヤー2040 51,725,840円、ダイワつみたてインデックス日本株式1,353,026,496円、ダイワつみたてインデックスバランス30 9,628,593円、ダイワつみたてインデックスバランス50 8,568,294円、ダイワつみたてインデックスバランス70 17,409,216円、ダイワ世界バランスファンド40 V A113,101,715円、ダイワ世界バランスファンド60 V A130,262,046円、ダイワ・バランスファンド35 V A 6,161,189,519円、ダイワ・バランスファンド25 V A (適格機関投資家専用) 559,246,637円、ダイワ国内バランスファンド25 V A (適格機関投資家専用) 80,610,399円、ダイワ国内バランスファンド30 V A (適格機関投資家専用) 146,638,577円、ダイワ・ノーロード T O P I Xファンド178,771,082円、ダイワファンドラップ T O P I Xインデックス10,294,148,277円、ダイワT O P I Xインデックス(ダイワSMA専用) 2,512,120,167円、ダイワファンドラップオンライン T O P I Xインデックス2,644,643,973円、ダイワ・インデックスセレクト T O P I X1,211,577,472円、ダイワライフスタイル25 153,686,797円、ダイワライフスタイル50 617,422,037円、ダイワライフスタイル75 487,367,793円、D C・ダイワ・トピックス・インデックス(確定拠出年金専用ファンド) 10,633,113,617円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,951円です。

■損益の状況

当期 自 2020年9月24日 至 2021年9月21日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,637,373,520円
受取配当金	3,444,555,096
受取利息	10,228,943
その他収益金	185,636,976
支払利息	△ 3,047,495
(B) 有価証券売買損益	38,506,139,309
売買益	42,610,806,704
売買損	△ 4,104,667,395
(C) 先物取引等損益	573,547,310
取引益	744,881,500
取引損	△ 171,334,190
(D) その他費用	△ 7,799
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	42,717,052,340
(F) 前期繰越損益金	12,474,802,077
(G) 解約差損益金	5,947,540,027
(H) 追加信託差損益金	5,265,956,750
(I) 合計 (E + F + G + H)	54,510,271,140
次期繰越損益金 (I)	54,510,271,140

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

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

ダイワファンドラップ 日経225インデックス

運用報告書(全体版)

第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の株式に投資し、投資成果を日経平均株価（日経225）の動きに連動させることをめざして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：2016年9月26日）	
運用方針	投資成果を日経平均株価（日経225）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券
	ストックインデックス225・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	
	マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、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。	

<4642>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
2期末(2018年6月15日)	円 14,057	円 0	% 17.1	円 22,851.75	% 15.2	% 98.3	% 1.7	百万円 6,623
3期末(2019年6月17日)	13,227	0	△ 5.9	21,124.00	△ 7.6	97.7	2.3	8,152
4期末(2020年6月15日)	13,749	0	3.9	21,530.95	1.9	98.1	1.9	11,210
5期末(2021年6月15日)	19,054	0	38.6	29,441.30	36.7	97.9	2.1	14,516
6期末(2022年6月15日)	17,300	0	△ 9.2	26,326.16	△ 10.6	97.6	2.4	14,452

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

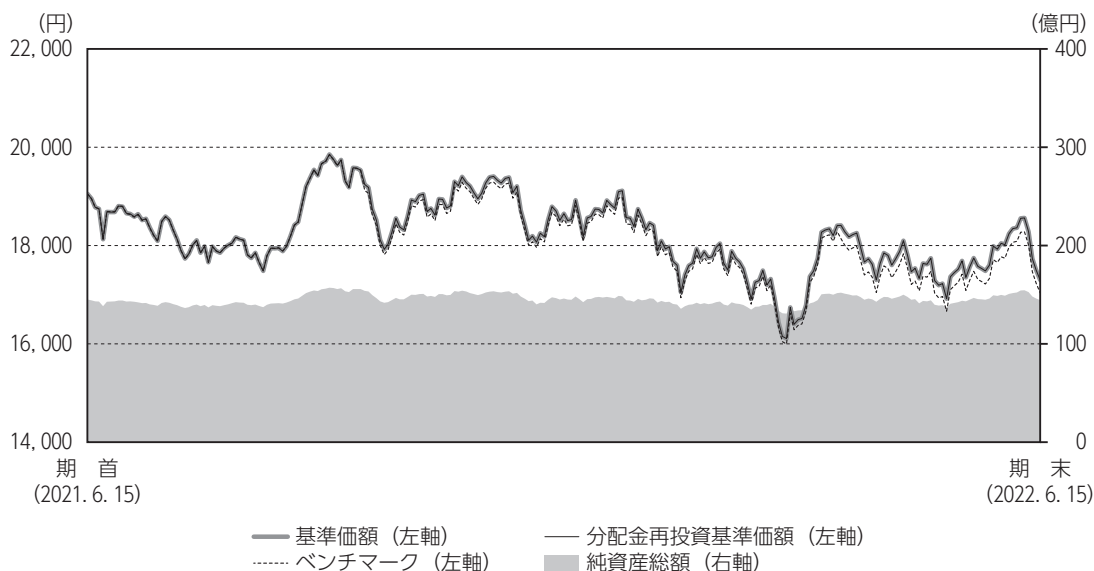
(注3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

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

* ベンチマークは日経平均株価です。

■ 基準価額・騰落率

期首：19,054円

期末：17,300円(分配金0円)

騰落率：△9.2%(分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 組入比率	株 式 先物比率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク) 円	騰 落 率		
(期首)2021年6月15日	19,054	—	29,441.30	—	97.9	2.1
6月末	18,644	△ 2.2	28,791.53	△ 2.2	98.3	1.7
7月末	17,662	△ 7.3	27,283.59	△ 7.3	98.2	1.8
8月末	18,185	△ 4.6	28,089.54	△ 4.6	98.4	1.6
9月末	19,181	0.7	29,452.66	0.0	96.4	3.6
10月末	18,808	△ 1.3	28,892.69	△ 1.9	97.6	2.4
11月末	18,107	△ 5.0	27,821.76	△ 5.5	97.1	2.9
12月末	18,764	△ 1.5	28,791.71	△ 2.2	98.6	1.4
2022年1月末	17,590	△ 7.7	27,001.98	△ 8.3	97.7	2.3
2月末	17,286	△ 9.3	26,526.82	△ 9.9	97.6	2.4
3月末	18,278	△ 4.1	27,821.43	△ 5.5	98.1	1.9
4月末	17,636	△ 7.4	26,847.90	△ 8.8	96.6	3.4
5月末	17,927	△ 5.9	27,279.80	△ 7.3	98.3	1.6
(期末)2022年6月15日	17,300	△ 9.2	26,326.16	△ 10.6	97.6	2.4

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021.6.16 ~ 2022.6.15)

国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大による行動制限措置の適用が続いたことや、内閣支持率の低下を受けて政局不透明感が増したことから、上値の重い展開となりました。しかし、2021年8月下旬からは感染状況の改善により株価が上昇すると、9月初めには菅首相の自民党総裁選挙への不出馬表明などが好感されて急騰しました。その後は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株価は反落しましたが、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て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、2022年に入ると、F R B（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め懸念による金利上昇を受けて世界的に株価は下落しました。さらに2月下旬からは、ロシアによるウクライナ侵攻という地政学リスクの顕在化を受け、株価下落が加速しました。3月後半は、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市場で円安が進行したことなどから、株価は一時的に反発しましたが、その後はF R Bの利上げペースが一層加速するとの懸念などから、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

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

■ストックインデックス225・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021.6.16～2022.6.15)

■当ファンド

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

■ストックインデックス225・マザーファンド

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

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

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

*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
ストックインデックス225・マザーファンド	日経平均株価

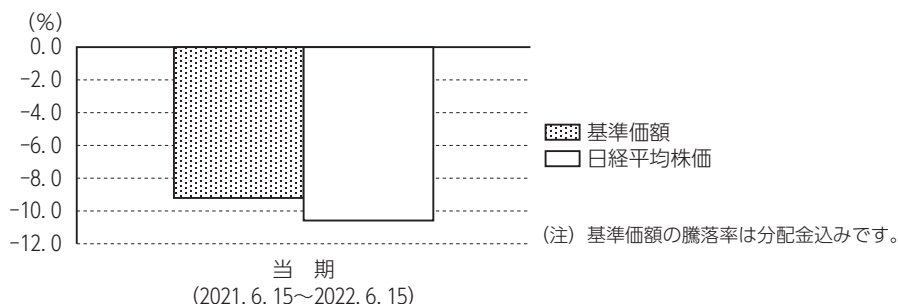
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△10.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△9.2%となりました。

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

また、ファンドから運用管理費用が控除されたことがマイナス要因となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



*ベンチマークは日経平均株価です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、収益分配を見送らせていただきました。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	7,300

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■ストックインデックス225・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

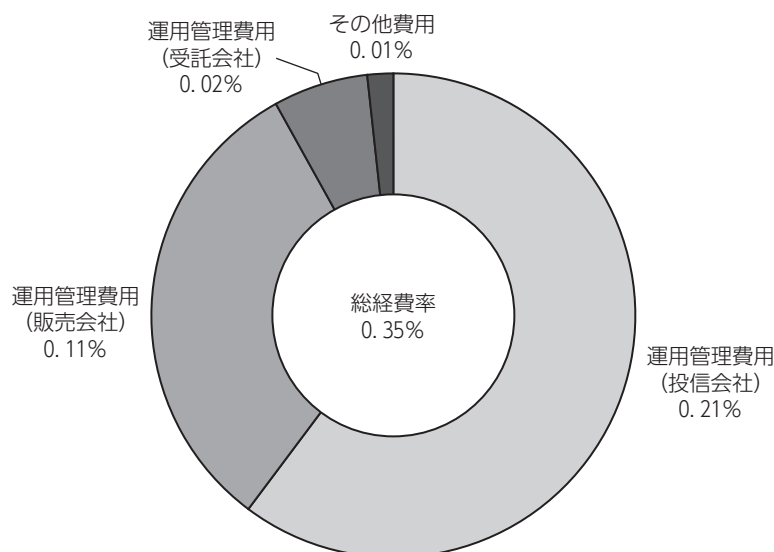
項目	当期 (2021.6.16~2022.6.15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	62円	0.341%	信託報酬＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は18,222円です。
(投信会社)	(38)	(0.209)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(20)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(4)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0.002	売買委託手数料＝当期中の売買委託手数料／当期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
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	0.005	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)	(0.005)	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	63	0.348	

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

参考情報

■総経費率

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



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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ストックインデックス225・マザーファンド	885,734	3,235,300	533,857	1,961,400

(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6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期	
	ストックインデックス225・マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	69,849,839千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	197,138,675千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.35	

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

決 算 期	当 期						
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況 B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況 D	D/C	
株式	53,465	32,765	61.3	16,383	5,768	35.2	
株式先物取引	93,074	37,737	40.5	91,973	33,075	36.0	
コール・ローン	2,439,492	—	—	—	—	—	

(注) 平均保有割合7.2%

※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6月16日から2022年6月15日まで)

種 類	当 期		
	ストックインデックス225・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
株式	39	12	168

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

種 類	当 期	
	ストックインデックス225・マザーファンド	
	買 付 額	
株式	1	

(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6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	267千円
うち利害関係人への支払額 (B)	99千円
(B) / (A)	37.1%

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

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

■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	口 数	口 数	評 価 額
ストックインデックス225・マザーファンド	3,793,099	4,144,976	14,450,216			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ストックインデックス225・マザーファンド	14,450,216	99.7
コール・ローン等、その他	47,390	0.3
投資信託財産総額	14,497,607	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6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	14,497,607,368円
コール・ローン等	42,390,413
ストックインデックス225・マザーファンド (評価額)	14,450,216,955
未収入金	5,000,000
(B) 負債	44,929,768
未払解約金	20,047,989
未払信託報酬	24,486,912
その他未払費用	394,867
(C) 純資産総額 (A - B)	14,452,677,600
元本	8,353,925,182
次期繰越損益金	6,098,752,418
(D) 受益権総口数	8,353,925,182口
1万口当り基準価額 (C / D)	17,300円

* 期首における元本額は7,618,451,322円、当作成期間中における追加設定元本額は2,488,303,056円、同解約元本額は1,752,829,196円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は17,300円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 7,601円
受取利息	1,196
支払利息	△ 8,797
(B) 有価証券売買損益	△ 1,218,952,995
売買益	125,508,264
売買損	△ 1,344,461,259
(C) 信託報酬等	△ 50,249,432
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 1,269,210,028
(E) 前期繰越損益金	3,054,593,116
(F) 追加信託差損益金	4,313,369,330
(配当等相当額)	(2,434,641,027)
(売買損益相当額)	(1,878,728,303)
(G) 合計 (D + E + F)	6,098,752,418
次期繰越損益金 (G)	6,098,752,418
追加信託差損益金	4,313,369,330
(配当等相当額)	(2,434,641,027)
(売買損益相当額)	(1,878,728,303)
分配準備積立金	3,054,599,616
繰越損益金	△ 1,269,216,528

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

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

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

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	3,044,166,903
(d) 分配準備積立金	3,054,599,616
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	6,098,766,519
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	6,098,766,519
(h) 受益権総口数	8,353,925,182口

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

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 日経 225インデックス）が投資対象としている「ストックインデックス 225・マザーファンド」の決算日（2021年9月21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6月15日）現在におけるストックインデックス 225・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

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

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ファーストリテイリング	62	4,286,740	69,140	ファーストリテイリング	19	1,431,372	75,335
東京エレクトロン	62	3,257,220	52,535	東京エレクトロン	19	1,025,214	53,958
ソフトバンクグループ	372	2,193,636	5,896	ソフトバンクグループ	114	746,984	6,552
村田製作所	220.8	2,138,543	9,685	ダイキン工業	19	511,862	26,940
キーエンス	27.6	1,816,904	65,829	ファナック	19	480,387	25,283
任天堂	27.6	1,501,634	54,407	KDDI	114	440,283	3,862
ファナック	62	1,418,750	22,883	アドバンテスト	38	396,197	10,426
ダイキン工業	62	1,409,300	22,730	テルモ	76	384,017	5,052
KDDI	372	1,368,144	3,677	信越化学	19	379,782	19,988
アドバンテスト	124	1,153,600	9,303	リクルートホールディングス	57	370,866	6,506

(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6月15日現在におけるストックインデックス 2 2 5 ・ マザーファンド（60,104,604千円）の内容です。

(1) 国内株式

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			旭化成	273	288,561	太平洋セメント	27.3	56,210
日本水産	273	144,963	昭和電工	27.3	70,352	東海カーボン	273	317,499
マルハニチロ	27.3	63,336	住友化学	273	151,515	TOTO	136.5	582,172
鉱業 (0.1%)			日産化学	273	1,831,830	日本碍子	273	517,062
I N P E X	109.2	181,490	東ソー	136.5	243,925	鉄鋼 (0.1%)		
建設業 (1.8%)			トクヤマ	54.6	98,989	日本製鉄	27.3	55,009
コムシスホールディングス	273	670,761	デンカ	54.6	181,272	神戸製鋼所	27.3	17,963
大成建設	54.6	218,400	信越化学	273	4,722,900	J F E ホールディングス	27.3	41,277
大林組	273	259,623	三井化学	54.6	171,990	大洋金属	27.3	72,017
清水建設	273	195,468	三菱ケミカル HLDGS	136.5	109,445	非鉄金属 (0.9%)		
長谷工コーポレーション	54.6	85,121	U B E	27.3	57,002	日本軽金属HD	27.3	41,659
鹿島建設	136.5	196,287	花王	273	1,392,300	三井金属	27.3	89,271
大和ハウス	273	830,193	D I C	27.3	68,386	東邦亜鉛	27.3	62,489
積水ハウス	273	636,909	富士フイルム HLDGS	273	1,888,887	三菱マテリアル	27.3	53,972
日揮ホールディングス	273	511,329	資生堂	273	1,389,843	住友鉱山	136.5	667,894
食料品 (3.4%)			日東電工	273	2,566,200	DOWA ホールディングス	54.6	248,703
日清製粉G本社	273	409,227	医薬品 (7.0%)			古河電工	27.3	60,933
明治ホールディングス	54.6	339,066	協和キリン	273	770,406	住友電工	273	396,805
日本ハム	136.5	550,095	武田薬品	273	965,055	フジクラ	273	219,765
サッポロホールディングス	54.6	150,914	アステラス製薬	1,365	2,723,175	金属製品 (0.0%)		
アサヒグループホールディン	273	1,152,879	住友ファーマ	273	284,466	S U M C O	27.3	55,173
キリンHD	273	555,009	塩野義製薬	273	1,772,589	機械 (4.9%)		
宝ホールディングス	273	259,350	中外製薬	819	2,768,220	日本製鋼所	54.6	168,441
キッコーマン	273	1,815,450	エーザイ	273	1,387,932	オークマ	54.6	293,748
味の素	273	831,012	第一三共	819	2,523,339	アマダ	273	283,647
ニチレイ	136.5	302,347	大塚ホールディングス	273	1,176,903	小松製作所	273	901,446
日本たばこ産業	273	649,740	石油・石炭製品 (0.3%)			住友重機械	54.6	171,990
繊維製品 (0.1%)			出光興産	109.2	387,660	日立建機	273	904,995
東洋紡	27.3	27,846	ENEOS ホールディングス	273	147,065	クボタ	273	602,920
ユニチカ	27.3	6,279	ゴム製品 (0.8%)			荏原製作所	54.6	298,116
帝人	54.6	75,566	横浜ゴム	136.5	235,053	ダイキン工業	273	5,428,605
東レ	273	192,246	ブリヂストン	273	1,382,745	日本精工	273	208,299
パルプ・紙 (0.1%)			ガラス・土石製品 (1.0%)			N T N	273	76,440
王子ホールディングス	273	153,699	A G C	54.6	274,638	ジェイテクト	273	288,834
日本製紙	27.3	25,825	日本板硝子	27.3	10,565	三井 E&SHD	27.3	9,773
化学 (7.6%)			日本電気硝子	81.9	226,617	日立造船	54.6	46,355
クラレ	273	306,306	住友大阪セメント	27.3	97,870	三菱重工業	27.3	142,642

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
IH I	27.3	107,016	東日本旅客鉄道	27.3	184,821	三井不動産	273	788,424
電気機器 (24.2%)			西日本旅客鉄道	27.3	130,248	三菱地所	273	528,664
コニカミノルタ	273	125,580	東海旅客鉄道	27.3	420,693	東京建物	136.5	233,005
ミネベアミツミ	273	631,722	ヤマトホールディングス	273	567,567	住友不動産	273	951,405
日立	54.6	364,455	NIPPON EXPRESS	27.3	207,753	サービス業 (4.8%)		
三菱電機	273	383,701	海運業 (0.4%)			エムスリー	655.2	2,336,443
富士電機	54.6	315,588	日本郵船	27.3	264,264	ディー・エヌ・エー	81.9	141,523
安川電機	273	1,171,170	商船三井	81.9	262,489	電通グループ	273	1,147,965
オムロン	273	1,828,827	川崎汽船	27.3	251,160	サイバーエージェント	218.4	273,000
ジーエス・ユアサコーポ	54.6	115,369	空運業 (0.0%)			楽天グループ	273	177,177
日本電気	27.3	139,503	ANA ホールディングス	27.3	66,407	リクルートホールディングス	819	3,289,923
富士通	27.3	466,830	倉庫・運輸関連業 (0.2%)			日本郵政	273	263,390
沖電気	27.3	21,621	三菱倉庫	136.5	434,070	セコム	273	2,212,938
セイコーエプソン	546	1,183,728	情報・通信業 (11.9%)					
パナソニックホールディング	273	301,801	ネクソン	546	1,600,872			
シャープ	273	280,098	Z ホールディングス	109.2	43,297	株数、金額	51,324	204,507,294
ソニーグループ	273	3,034,395	トレンドマイクロ	273	1,793,610	銘柄数<比率>	225銘柄	<97.6%>
TDK	819	3,591,315	日本電信電話	109.2	417,580			
アルプスアルパイン	273	397,761	KDDI	1,638	7,130,214			
横河電機	273	616,161	ソフトバンク	273	398,170			
アドバンテスト	546	4,220,580	東宝	27.3	131,313			
キーエンス	27.3	1,262,625	NTTデータ	1,365	2,537,535			
カシオ	273	341,250	コナミホールディングス	273	2,140,320			
ファナック	273	5,470,920	ソフトバンクグループ	1,638	8,235,864			
京セラ	546	3,929,016	卸売業 (2.6%)					
太陽誘電	273	1,408,680	双日	27.3	55,364			
村田製作所	218.4	1,758,120	伊藤忠	273	1,010,646			
SCREEN ホールディングス	54.6	570,024	丸紅	273	363,909			
キヤノン	409.5	1,331,284	豊田通商	273	1,306,305			
リコー	273	301,392	三井物産	273	877,149			
東京エレクトロン	273	13,923,000	住友商事	273	504,777			
輸送用機器 (4.8%)			三菱商事	273	1,196,559			
デンソー	273	2,060,604	小売業 (10.5%)					
川崎重工業	27.3	77,286	J. フロントリテイリング	136.5	151,924			
日産自動車	273	145,672	三越伊勢丹HD	273	283,920			
いすゞ自動車	136.5	214,441	セブン&アイ・HLDGS	273	1,421,238			
トヨタ自動車	1,365	2,839,200	高島屋	136.5	174,447			
日野自動車	273	188,916	丸井グループ	273	619,983			
三菱自動車工業	27.3	11,984	イオン	273	592,956			
マツダ	54.6	60,442	ファーストリテイリング	273	18,329,220			
本田技研	546	1,804,530	銀行業 (0.6%)					
スズキ	273	1,101,555	コンコルディア・フィナンシャル	273	127,491			
SUBARU	273	668,167	あおぞら銀行	27.3	72,317			
ヤマハ発動機	273	704,340	三菱UFJフィナンシャルG	273	202,074			
精密機器 (3.8%)			りそなホールディングス	27.3	13,928			
テルモ	1,092	4,179,084	三井住友トラストHD	27.3	112,203			
ニコン	273	455,637	三井住友フィナンシャルG	27.3	109,636			
オリンパス	1,092	2,953,860	千葉銀行	273	203,658			
シチズン時計	273	152,880	ふくおかフィナンシャルG	54.6	134,971			
その他製品 (3.1%)			静岡銀行	273	220,857			
バンダイナムコHLDGS	273	2,540,538	みずほフィナンシャルG	27.3	41,195			
凸版印刷	136.5	318,864	証券・商品先物取引業 (0.3%)					
大日本印刷	136.5	392,847	大和証券G本社	273	168,058			
ヤマハ	273	1,452,360	野村ホールディングス	273	133,770			
任天堂	27.3	1,534,533	松井証券	273	220,857			
電気・ガス業 (0.2%)			保険業 (0.9%)					
東京電力HD	27.3	13,431	SOMPOホールディングス	54.6	322,904			
中部電力	27.3	34,261	MS&AD	81.9	332,432			
関西電力	27.3	34,234	第一生命HLDGS	27.3	72,208			
東京瓦斯	54.6	142,779	東京海上HD	136.5	1,014,877			
大阪瓦斯	54.6	132,132	T&Dホールディングス	54.6	87,687			
陸運業 (1.4%)			その他金融業 (0.8%)					
東武鉄道	54.6	161,889	クレディセゾン	273	416,325			
東急	136.5	202,020	オリックス	273	631,858			
小田急電鉄	136.5	232,732	日本取引所グループ	273	566,884			
京王電鉄	54.6	242,151	不動産業 (1.3%)					
京成電鉄	136.5	473,655	東急不動産HD	273	183,456			

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

(2) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2022年6月15日現在	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
日経平均	4,993	—

(注) 単位未満は切捨て。

■ 有価証券の貸付及び借入状況

区分	2022年6月15日現在	
	貸付	借入
株式	株 1,287,000 (—)	株 — (—)

(注) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

ストックインデックス225・マザーファンド

運用報告書 第20期 (決算日 2021年9月21日)

(作成対象期間 2020年9月24日～2021年9月21日)

ストックインデックス225・マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

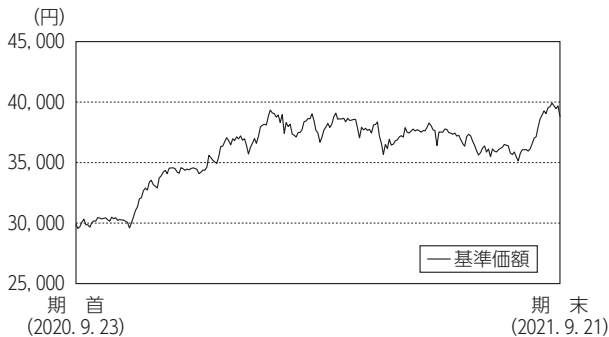
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		日経平均株価 (ベンチマーク)		株式 組入 比率	株式 先物 比率
	円	%	円	%		
(期首)2020年9月23日	29,884	—	23,346.49	—	98.4	0.6
9月末	29,859	△ 0.1	23,185.12	△ 0.7	98.0	2.0
10月末	29,594	△ 1.0	22,977.13	△ 1.6	98.1	1.9
11月末	34,080	14.0	26,433.62	13.2	98.5	1.4
12月末	35,428	18.6	27,444.17	17.6	98.7	1.3
2021年1月末	35,709	19.5	27,663.39	18.5	97.9	2.1
2月末	37,413	25.2	28,966.01	24.1	99.0	1.0
3月末	37,903	26.8	29,178.80	25.0	96.8	3.2
4月末	37,435	25.3	28,812.63	23.4	97.4	2.5
5月末	37,511	25.5	28,860.08	23.6	98.2	1.8
6月末	37,446	25.3	28,791.53	23.3	98.3	1.7
7月末	35,482	18.7	27,283.59	16.9	98.2	1.8
8月末	36,545	22.3	28,089.54	20.3	98.4	1.6
(期末)2021年9月21日	38,825	29.9	29,839.71	27.8	97.8	1.5

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：29,884円 期末：38,825円 騰落率：29.9%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、国内外の新型コロナウイルスの感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、横ばい圏で推移しました。2020年11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が当選確実となって選挙結果に対する不確実性が後退したことや、それによって大型経済対策への期待が高まったこと、欧米において複数のワクチンの接種が始まったことなどが好感され、株価は上昇しました。2021年に入っても、1月に行われた米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利し、大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、3月には実際に米国で追加経済対策が発表されたことや、国内のウイルスの感染状況が改善したことなどが好感され、株価は上昇しました。その後は、国内で感染が再拡大して再び行動制限措置がとられたことや、内閣支持率の低下で政局の行方に対する不透明感が増したことから、また世界的にインフレ懸念が台頭して米国の金融緩和縮小の早期化観測が高まったことなどから、上値の重い展開となりました。9月に入ると、菅首相が自民党総裁選挙への不出馬を表明したことを受けて、来たる衆議院選挙での自民党大敗リスクが後退したことや新たな経済対策による景気回復期待などを背景に上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は27.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は29.9%となりました。

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

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

(注1) 費用の項目および算出法については前掲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
(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
国内	千株 5,707.3 (182)	千円 22,448,831 (—)	千株 8,877.1	千円 33,973,327

(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

(2020年9月24日から2021年9月21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 70,102	百万円 69,189	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

(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

銘柄	当 期 買 付			当 期 売 付		
	株数	金額	平均単価	株数	金額	平均単価
ファーストリテイリング	千株 26	千円 2,113,040	円 81,270	千株 42	千円 3,369,114	円 80,217
ネクソン	548	1,589,333	2,900	1,000	2,284,914	2,284
ソフトバンクグループ	156	1,215,576	7,792	252	1,742,913	6,916
東京エレクトロン	26	1,203,820	46,300	42	1,615,012	38,452
ファナック	26	663,190	25,507	42	1,038,393	24,723
ダイキン工業	26	581,080	22,349	42	1,035,004	24,642
KDDI	156	545,064	3,494	100.8	834,106	8,274
アドバンテスト	52	493,560	9,491	252	818,323	3,247
信越化学	26	471,800	18,146	168	757,926	4,511
エムスリー	62.4	460,982	7,387	42	723,096	17,216

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
水産・農林業 (0.1%)	千株	千株	千円	味の素	千株	千株	千円	日本化薬	千株	千株	千円	日本化薬	千株	千株	千円	日本化薬	千株	千株	千円	
日本水産	250	234	150,228	ニチレイ	250	234	810,576	花王	250	234	1,563,822	花王	250	234	1,563,822	花王	250	234	1,563,822	
マルハニチロ	25	23.4	62,103	日本たばこ産業	250	234	506,376	DIC	25	23.4	76,986	DIC	25	23.4	76,986	DIC	25	23.4	76,986	
鉱業 (0.0%)				繊維製品 (0.1%)				富士フィルム HLDGS	250	234	2,268,396	富士フィルム HLDGS	250	234	2,268,396	富士フィルム HLDGS	250	234	2,268,396	
INPEX	100	93.6	73,756	東洋紡	25	23.4	32,666	資生堂	250	234	1,787,292	資生堂	250	234	1,787,292	資生堂	250	234	1,787,292	
建設業 (1.7%)				ユニチカ	25	23.4	9,032	日東電工	250	234	1,944,540	日東電工	250	234	1,944,540	日東電工	250	234	1,944,540	
コムシスホールディングス	250	234	698,724	帝人	50	46.8	76,003	医薬品 (7.4%)				協和キリン	250	234	966,420	協和キリン	250	234	966,420	
大成建設	50	46.8	168,480	東レ	250	234	170,188	武田薬品	250	234	879,606	武田薬品	250	234	879,606	武田薬品	250	234	879,606	
大林組	250	234	219,024	王子ホールディングス	250	234	136,188	アステラス製薬	1,250	1,170	2,194,920	アステラス製薬	1,250	1,170	2,194,920	アステラス製薬	1,250	1,170	2,194,920	
清水建設	250	234	197,964	日本製紙	25	23.4	28,711	大日本住友製薬	250	234	481,338	大日本住友製薬	250	234	481,338	大日本住友製薬	250	234	481,338	
長谷工コーポレーション	50	46.8	70,200	化学 (8.2%)				塩野義製薬	250	234	1,724,814	塩野義製薬	250	234	1,724,814	塩野義製薬	250	234	1,724,814	
鹿島建設	125	117	171,522	クラレ	250	234	247,338	中外製薬	750	702	2,898,558	中外製薬	750	702	2,898,558	中外製薬	750	702	2,898,558	
大和ハウス	250	234	889,200	旭化成	250	234	290,979	エーザイ	250	234	1,960,686	エーザイ	250	234	1,960,686	エーザイ	250	234	1,960,686	
積水ハウス	250	234	555,867	昭和電工	25	23.4	63,671	第一三共	250	702	2,120,040	第一三共	250	702	2,120,040	第一三共	250	702	2,120,040	
日揮ホールディングス	250	234	229,320	住友化学	250	234	138,294	大塚ホールディングス	250	234	1,136,538	大塚ホールディングス	250	234	1,136,538	大塚ホールディングス	250	234	1,136,538	
食料品 (3.8%)				日産化学	250	234	1,619,280	石油・石炭製品 (0.2%)				出光興産	100	93.6	270,597	出光興産	100	93.6	270,597	
日清製粉G本社	250	234	450,684	東ソー	125	117	243,477	ENEOSホールディングス	250	234	107,663	ENEOSホールディングス	250	234	107,663	ENEOSホールディングス	250	234	107,663	
明治ホールディングス	50	46.8	343,044	トクヤマ	50	46.8	103,615	ゴム製品 (0.8%)				横浜ゴム	125	117	232,128	横浜ゴム	125	117	232,128	
日本ハム	125	117	512,460	デンカ	50	46.8	189,306	ブリヂストン	250	234	1,240,902	ブリヂストン	250	234	1,240,902	ブリヂストン	250	234	1,240,902	
サッポロホールディングス	50	46.8	117,889	信越化学	250	234	4,949,100	ガラス・土石製品 (1.0%)				AGC	50	46.8	266,760	AGC	50	46.8	266,760	
アサヒグループホールディング	250	234	1,283,490	三井化学	50	46.8	184,392	AGC	50	46.8	266,760	AGC	50	46.8	266,760	AGC	50	46.8	266,760	
キリンHD	250	234	479,466	三菱ケミカル HLDGS	125	117	120,744													
宝ホールディングス	250	234	366,210	宇部興産	25	23.4	53,539													
キッコーマン	250	234	2,227,680																	

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末			
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株	株数	千株
日本板硝子	25	23.4	13,455	千円	日産自動車	250	234	130,174	千円	ファーストリテイリング	250	234	17,463,420	千円		
日本電気硝子	75	70.2	169,041		いすゞ自動車	125	117	173,043		銀行業 (0.6%)						
住友大阪セメント	25	23.4	73,827		トヨタ自動車	250	234	2,323,386		コンソルディア・フィナンシャル	250	234	103,896			
太平洋セメント	25	23.4	57,330		日野自動車	250	234	237,042		新生銀行	25	23.4	44,132			
東海カーボン	250	234	358,956		三菱自動車工業	25	23.4	6,528		あおぞら銀行	25	23.4	63,975			
TOTO	125	117	652,860		マツダ	50	46.8	43,758		三菱UFJフィナンシャルG	250	234	148,005			
日本碍子	250	234	440,856		本田技研	500	468	1,562,184		りそなホールディングス	25	23.4	10,387			
鉄鋼 (0.1%)					スズキ	250	234	1,190,124		三井住友トラストHD	25	23.4	89,622			
日本製鉄	25	23.4	48,122		SUBARU	250	234	481,338		三井住友フィナンシャルG	25	23.4	91,938			
神戸製鋼所	25	23.4	16,029		ヤマハ発動機	250	234	721,890		千葉銀行	250	234	166,842			
JFEホールディングス	25	23.4	41,230		精密機器 (3.9%)					ふくおかフィナンシャルG	50	46.8	94,348			
大平洋金属	25	23.4	44,319		テルモ	1,000	936	4,975,776		静岡銀行	250	234	217,152			
非鉄金属 (0.8%)					ニコン	250	234	307,476		みずほフィナンシャルG	250	23.4	37,486			
日本軽金属HD	250	23.4	47,174		オリンパス	1,000	936	2,177,136		証券・商品先物取引業 (0.2%)						
三井金属	25	23.4	76,752		シチズン時計	250	234	122,850		大和証券G本社	250	234	156,241			
東邦亜鉛	25	23.4	67,134		その他製品 (2.2%)					野村ホールディングス	250	234	128,957			
三菱マテリアル	25	23.4	52,392		バンダイナムコHLDGS	250	234	2,078,622		松井証券	250	234	194,922			
住友鉱山	125	117	484,497		凸版印刷	125	117	233,064		保険業 (0.7%)						
DOWAホールディングス	50	46.8	214,110		大日本印刷	125	117	322,803		SOMPOホールディングス	62.5	58.5	297,063			
古河電工	25	23.4	56,277		ヤマハ	250	234	1,701,180		MS&AD	75	70.2	269,357			
住友電工	250	234	349,245		電気・ガス業 (0.1%)					第一生命HLDGS	25	23.4	55,188			
フジクラ	250	234	160,758		東京電力HD	25	23.4	7,230		東京海上HD	125	117	702,000			
金属製品 (0.2%)					中部電力	25	23.4	31,917		T&Dホールディングス	50	46.8	72,072			
SUMCO	25	23.4	55,809		関西電力	25	23.4	26,945		その他金融業 (0.5%)						
東洋製罐グループHD	250	234	314,730		東京瓦斯	50	46.8	101,017		クレディセゾン	250	234	317,538			
機械 (5.1%)					大阪瓦斯	50	46.8	99,637		日本取引所グループ	250	234	680,472			
日本製鋼所	50	46.8	138,387		陸運業 (1.5%)					不動産業 (1.2%)						
オークマ	50	46.8	263,952		東武鉄道	50	46.8	139,370		東急不動産HD	250	234	155,376			
アマダ	250	234	281,034		東急	125	117	188,136		三井不動産	250	234	590,265			
小松製作所	250	234	635,193		小田急電鉄	125	117	301,275		三菱地所	250	234	404,937			
住友重機械	50	46.8	141,570		京王電鉄	50	46.8	280,332		東京建物	125	117	198,783			
日立建機	250	234	746,460		京成電鉄	125	117	415,935		住友不動産	250	234	909,792			
クボタ	250	234	566,046		東日本旅客鉄道	25	23.4	165,859		サービス業 (7.1%)						
荏原製作所	50	46.8	272,376		西日本旅客鉄道	25	23.4	121,492		エムスリー	600	561.6	4,823,020			
ダイキン工業	250	234	6,243,120		東海旅客鉄道	25	23.4	382,941		ディー・エヌ・エー	75	70.2	139,276			
日本精工	250	234	177,138		日本通運	25	23.4	190,008		電通グループ	250	234	982,800			
NTN	250	234	58,500		ヤマトホールディングス	250	234	681,876		サイバーエージェント	50	187.2	410,529			
ジェイテクト	250	234	224,874		海運業 (0.3%)					楽天グループ	250	234	259,740			
日立造船	50	46.8	43,056		日本郵船	25	23.4	235,404		リクルートホールディングス	750	702	4,902,066			
三菱重工業	25	23.4	70,036		商船三井	25	23.4	215,046		日本郵政	250	234	226,231			
IHI	25	23.4	60,114		川崎汽船	25	23.4	171,054		セコム	250	234	1,965,600			
電気機器 (23.7%)					空運業 (0.0%)					合計	株数、金額	45,587.5	42,599.7	193,896,831		
日清紡ホールディングス	250	234	195,858		ANAホールディングス	25	23.4	63,414		銘柄数<比率>	225銘柄	225銘柄	<97.8%>			
コニカミノルタ	250	234	140,634		倉庫・運輸関連業 (0.2%)					(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。						
ミネベアミツミ	250	234	688,662		三菱倉庫	125	117	384,930		(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。						
日立	50	46.8	301,532		情報・通信業 (11.1%)					(注3) 評価額の単位未満は切捨て。						
三菱電機	250	234	368,901		ネクスン	—	468	818,064		(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)						
富士電機	50	46.8	240,084		Zホールディングス	100	93.6	68,749		銘柄別		当	期	末		
安川電機	250	234	1,373,580		トレンドマイクロ	250	234	1,453,140		買		建	額	売	建	額
オムロン	250	234	2,686,320		スカパーJSATHD	25	23.4	9,968		百万円		百万円				
ジーエス・ユアサコーポ	50	46.8	120,931		日本電信電話	100	93.6	301,953		国内		日経平均	2,886	—		
日本電気	25	23.4	145,548		KDDI	1,500	1,404	5,315,544		(注) 単位未満は切捨て。						
富士通	25	23.4	492,102		ソフトバンク	—	234	364,104								
沖電気	25	23.4	23,002		NTTドコモ	25	—	—								
セイコーエプソン	500	468	1,066,572		東宝	25	23.4	123,084								
パナソニック	250	234	323,973		NTTデータ	1,250	1,170	2,544,750								
シャープ	—	234	324,324		コナミホールディングス	250	234	1,600,560								
ソニーグループ	250	234	2,887,560		ソフトバンクグループ	1,500	1,404	8,885,916								
TDK	250	234	2,915,640		卸売業 (2.0%)											
アルプスアルパイン	250	234	283,842		双日	25	23.4	8,283								
横河電機	250	234	460,512		伊藤忠	250	234	808,470								
アドバンテスト	500	468	5,194,800		丸紅	250	234	216,309								
カシオ	250	234	424,242		豊田通商	250	234	1,117,350								
ファナック	250	234	5,984,550		三井物産	250	234	572,130								
京セラ	500	468	3,274,128		住友商事	250	234	374,400								
太陽誘電	250	234	1,729,260		三菱商事	250	234	826,488								
SCREENホールディングス	50	46.8	477,828		小売業 (10.5%)											
キャノン	375	351	943,488		J.フロントリテイリング	125	117	118,638								
リコー	250	234	257,634		三越伊勢丹HD	250	234	186,966								
東京エレクトロン	250	234	12,652,380		セブン&アイ・HLDGS	250	234	1,199,016								
輸送用機器 (4.5%)					ファミリーマート	1,000	—	—								
デンソー	250	234	1,811,160		高島屋	125	117	135,486								
三井E&SHD	25	23.4	11,349		丸井グループ	250	234	489,762								
川崎重工業	25	23.4	57,236		イオン	250	234	706,212								

■有価証券の貸付及び借入の状況

区 分	当 期 末	
	貸 付	借 入
株式	1,461,700 (株)	— (株)

(注) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

■投資信託財産の構成

2021年9月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	193,896,831 千円	93.6 %
コール・ローン等、その他	13,352,544	6.4
投資信託財産総額	207,249,376	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

2021年9月21日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	209,030,267,077円
コール・ローン等	11,594,808,498
株式(評価額)	193,896,831,960
未収入金	1,657,155,991
未収配当金	96,876,500
未収利息	515,646
その他未収収益	360,722
差入委託証拠金	1,783,717,760
(B) 負債	10,801,260,975
未払金	30,879,510
未払解約金	589,590,000
差入委託証拠金代用有価証券	1,810,860,000
受入担保金	8,369,931,465
(C) 純資産総額 (A - B)	198,229,006,102
元本	51,056,738,772
次期繰越損益金	147,172,267,330
(D) 受益権総口数	51,056,738,772口
1万口当り基準価額 (C / D)	38,825円

* 期首における元本額は55,323,152,743円、当作成期間中における追加設定元本額は12,733,160,542円、同解約元本額は16,999,574,513円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ストックインデックス ファンド225 20,583,545,296円、適格機関投資家専用・ダイワ・ストックインデックスファンド225 V A333,474,643円、大和 ストックインデックス 225 ファンド7,295,860,497円、D-1's 日経225インデックス113,106,768円、iFree 日経225インデックス6,285,660,509円、DC・ダイワ・ストックインデックス225(確定拠出年金専用ファンド)5,483,055,624円、ダイワ・ノーロード 日経225ファンド307,165,744円、ダイワファンドラップ 日経225インデックス3,954,737,892円、ダイワ日経225インデックス(ダイワSMA専用)169,533,410円、ダイワ・インデックスセレクト 日経225 6,530,598,389円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は38,825円です。

■損益の状況

当期 自 2020年9月24日 至 2021年9月21日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,842,355,761円
受取配当金	2,804,132,530
受取利息	5,995,539
その他収益金	36,011,662
支払利息	△ 3,783,970
(B) 有価証券売買損益	42,818,862,667
売買益	46,108,931,694
売買損	△ 3,290,069,027
(C) 先物取引等損益	999,915,770
取引益	1,395,396,780
取引損	△ 395,481,010
(D) その他費用	△ 38,717
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	46,661,095,481
(F) 前期繰越損益金	110,002,206,988
(G) 解約差損益金	△ 42,547,538,597
(H) 追加信託差損益金	33,056,503,458
(I) 合計 (E + F + G + H)	147,172,267,330
次期繰越損益金 (I)	147,172,267,330

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

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

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジあり)

運用報告書(全体版)

第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2731>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率					
2 期末 (2018年 6 月15日)	円 12,400	円 0	% 10.8	12,054	% 8.9	% 95.8	% 3.4	% —	% 2.3	百万円 31,820
3 期末 (2019年 6 月17日)	12,648	0	2.0	12,074	0.2	91.6	6.0	—	2.8	36,065
4 期末 (2020年 6 月15日)	12,825	0	1.4	12,067	△ 0.1	95.0	1.9	—	2.7	42,369
5 期末 (2021年 6 月15日)	17,819	0	38.9	16,570	37.3	94.2	3.7	—	2.4	56,165
6 期末 (2022年 6 月15日)	15,540	0	△ 12.8	14,276	△ 13.8	95.9	6.0	—	2.5	53,716

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

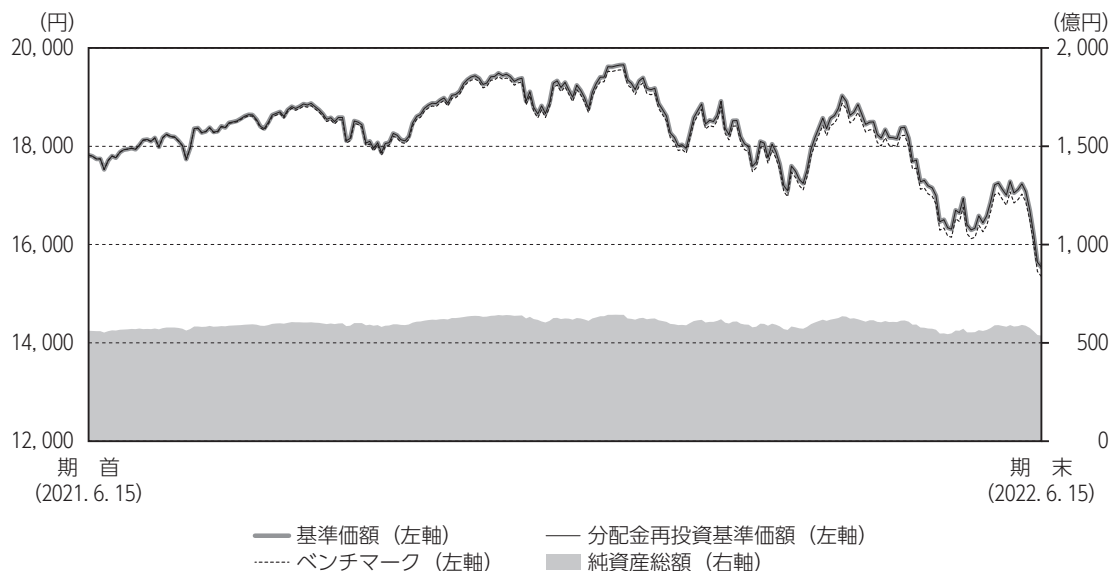
(注6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注7) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

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

* ベンチマークはMSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース) です。

■ 基準価額・騰落率

期首：17,819円

期末：15,540円 (分配金 0円)

騰落率：△12.8% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ指数 (円ヘッジ・ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
	円	%		%	%	%	%	%
(期首) 2021年 6月15日	17,819	—	16,570	—	94.2	3.7	—	2.4
6月末	17,960	0.8	16,699	0.8	93.7	4.3	—	2.3
7月末	18,382	3.2	17,086	3.1	92.0	4.4	—	2.3
8月末	18,807	5.5	17,457	5.4	91.2	6.5	—	2.2
9月末	18,101	1.6	16,784	1.3	94.3	4.9	—	2.3
10月末	19,037	6.8	17,646	6.5	94.0	5.8	—	2.3
11月末	19,109	7.2	17,696	6.8	93.0	3.7	—	2.3
12月末	19,636	10.2	18,170	9.7	93.4	5.7	—	2.4
2022年 1月末	18,263	2.5	16,891	1.9	93.0	4.4	—	2.3
2月末	18,099	1.6	16,717	0.9	92.5	5.4	—	2.3
3月末	18,915	6.2	17,442	5.3	96.8	6.6	—	2.5
4月末	17,307	△ 2.9	15,950	△ 3.7	95.8	6.9	—	2.7
5月末	17,253	△ 3.2	15,856	△ 4.3	88.8	8.1	—	2.3
(期末) 2022年 6月15日	15,540	△ 12.8	14,276	△ 13.8	95.9	6.0	—	2.5

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■ 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、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展により経済活動の正常化が順次進んだことや、好調な経済指標の発表などから上昇しました。2021年9月には、中国の大手不動産会社の資金繰り問題や米国の債務上限問題、米国金利上昇に対する警戒感など複数のリスク要因が嫌気され、軟調な推移となりました。2022年に入ると、2021年12月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）議事録を受け、米国の金融引き締めに対する懸念が高まり下落しました。2月以降は、欧米中央銀行高官の金融政策に対する発言やロシアのウクライナへの侵攻、ロシアとウクライナの散発的な停戦協定による状況改善期待などから、一進一退の展開となりました。その後は、FRB（米国連邦準備制度理事会）の利上げペースが一層加速するとの懸念などから下落し、当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

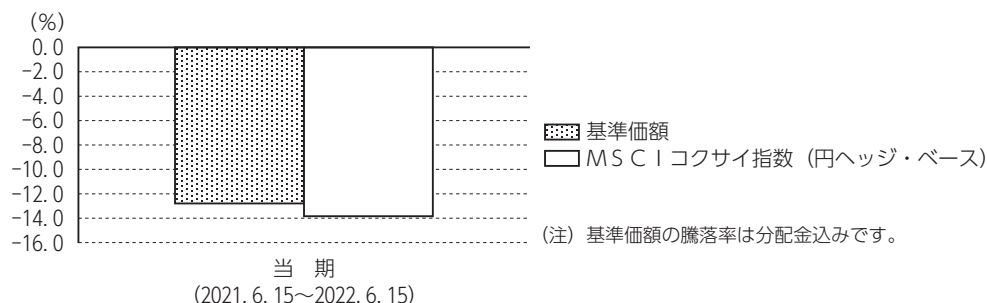
組入ファンド	ベンチマーク
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	M S C I コクサイ指数（円ヘッジ・ベース）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△13.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△12.8%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



*ベンチマークはM S C I コクサイ指数（円ヘッジ・ベース）です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、収益分配を見送らせていただきました。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	6,426

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

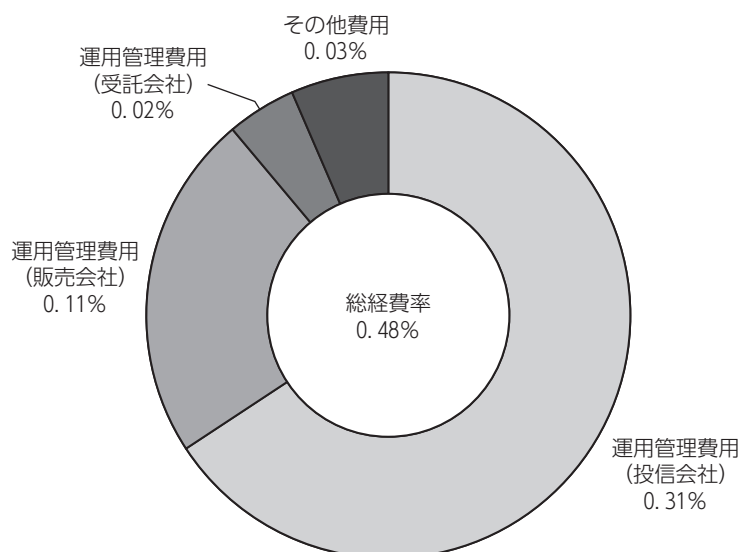
項目	当期 (2021.6.16~2022.6.15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	82円	0.445%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は18,299円です。
（投信会社）	(57)	(0.313)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販売会社）	(20)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(4)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0.006	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(1)	(0.003)	
（先物・オプション）	(0)	(0.002)	
（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	6	0.031	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保管費用）	(3)	(0.014)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(1)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（その他）	(2)	(0.013)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	89	0.485	

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

参考情報

■総経費率

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



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

■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6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	4,278,294	12,023,869	2,410,717	6,952,646

(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6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期	
	外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	17,819,330千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	74,812,154千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.23	

(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	当 期 末		
	期 首	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	20,363,112	22,230,689	53,707,123

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	53,707,123	99.7
コール・ローン等、その他	158,781	0.3
投資信託財産総額	53,865,905	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.01円、1カナダ・ドル=104.20円、1オーストラリア・ドル=93.10円、1香港・ドル=17.20円、1シンガポール・ドル=96.95円、1ニュージーランド・ドル=83.95円、1イギリス・ポンド=162.21円、1イスラエル・シェケル=38.942円、1スイス・フラン=135.01円、1デンマーク・クローネ=18.93円、1ノルウェー・クローネ=13.49円、1スウェーデン・クローネ=13.25円、1ユーロ=140.80円です。

(注3) 外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(72,926,239千円)の投資信託財産総額(76,386,708千円)に対する比率は、95.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	53,865,905,713円
コール・ローン等	150,841,916
外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)	53,707,123,797
未収入金	7,940,000
(B) 負債	149,795,757
未払解約金	15,602,369
未払信託報酬	133,096,197
その他未払費用	1,097,191
(C) 純資産総額(A-B)	53,716,109,956
元本	34,566,355,532
次期繰越損益金	19,149,754,424
(D) 受益権総口数	34,566,355,532口
1万口当り基準価額(C/D)	15,540円

* 期首における元本額は31,520,778,793円、当作成期間中における追加設定元本額は10,317,685,523円、同解約元本額は7,272,108,784円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は15,540円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 27,894円
受取利息	3,513
支払利息	△ 31,407
(B) 有価証券売買損益	△ 7,906,147,741
売買益	393,355,650
売買損	△ 8,299,503,391
(C) 信託報酬等	△ 268,994,813
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 8,175,170,448
(E) 前期繰越損益金	12,812,293,209
(F) 追加信託差損益金	14,512,631,663
(配当等相当額)	(9,401,109,949)
(売買損益相当額)	(5,111,521,714)
(G) 合計(D+E+F)	19,149,754,424
次期繰越損益金(G)	19,149,754,424
追加信託差損益金	14,512,631,663
(配当等相当額)	(9,401,109,949)
(売買損益相当額)	(5,111,521,714)
分配準備積立金	12,812,314,874
繰越損益金	△ 8,175,192,113

(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	9,401,109,949
(d) 分配準備積立金	12,812,314,874
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	22,213,424,823
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	22,213,424,823
(h) 受益権総口数	34,566,355,532口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」の決算日（2022年1月11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6月15日）現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

（2021年6月16日から2022年6月15日まで）

買 付				売 付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.832	315,115	378,744	APPLE INC (アメリカ)	27.233	560,521	20,582
APPLE INC (アメリカ)	14.364	281,276	19,582	MICROSOFT CORP (アメリカ)	10.8	412,091	38,156
MICROSOFT CORP (アメリカ)	7.1	254,077	35,785	AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.677	255,389	377,236
TESLA INC (アメリカ)	2.37	239,795	101,179	TESLA INC (アメリカ)	1.335	169,258	126,785
SEA LTD-ADR (ケイマン諸島)	6.1	124,734	20,448	ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.452	151,433	335,029
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.336	107,964	321,321	ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.436	147,070	337,316
SNOWFLAKE INC-CLASS A (アメリカ)	2.409	80,014	33,214	NVIDIA CORP (アメリカ)	3.556	111,656	31,399
NVIDIA CORP (アメリカ)	2.667	69,792	26,168	META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)	3.674	110,658	30,119
AIRBNB INC-CLASS A (アメリカ)	3.796	69,074	18,196	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	2.4	100,169	41,737
ASTRAZENECA PLC (イギリス)	4.872	68,765	14,114	JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	5.19	90,457	17,429

(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6月15日現在における外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド（30,012,407千口）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	12.95	174	23,501	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	11.66	561	75,818	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	20.63	278	37,648	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	15.94	130	17,651	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7.46	106	14,408	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	63.3	186	25,219	金融
ABBOTT LABORATORIES	204.45	2,104	284,143	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	39.5	127	17,171	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	21.4	338	45,716	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	38.8	125	16,904	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	69.05	452	61,089	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	5	203	27,485	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	69.34	660	89,169	情報技術
QORVO INC	12.83	124	16,743	情報技術
AFLAC INC	73.4	394	53,225	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	15.06	171	23,185	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	18.35	155	21,043	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	55.15	2,045	276,105	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	24.29	226	30,580	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	14.07	394	53,283	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	17.24	166	22,512	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24.66	589	79,644	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	81.05	1,485	200,555	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	26.56	177	23,932	金融
AUTOZONE INC	2.32	471	63,696	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	25.66	400	54,050	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	123.65	97	13,104	ヘルスケア
CELANESE CORP	12.11	164	22,269	素材
DR HORTON INC	37.92	249	33,645	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	24.5	87	11,772	ヘルスケア
AUTODESK INC	25.07	430	58,078	情報技術
MOODY'S CORP	18.84	485	65,543	金融
DEVON ENERGY CORP	72.76	513	69,342	エネルギー
ALBEMARLE CORP	13.24	295	39,920	素材
ATMOS ENERGY CORP	19.85	209	28,284	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	28.7	159	21,547	公益事業
CITIGROUP INC	235.48	1,082	146,116	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	50.58	1,032	139,396	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	56.49	510	68,976	公益事業
ALLEGHANY CORP	1.46	121	16,399	金融
DOMINO'S PIZZA INC	4.07	153	20,722	一般消費財・サービス

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
HESS CORP	32.31	387	52,376	エネルギー
DAVITA INC	7.09	63	8,612	ヘルスケア
DANAHER CORP	78.26	1,897	256,138	ヘルスケア
FORTIVE CORP	37.94	212	28,720	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	63.76	599	80,960	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	63.03	521	70,349	生活必需品
BUNGE LTD	16.93	176	23,851	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	37.5	443	59,939	情報技術
APPLE INC	1,882.24	24,988	3,373,713	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	33.87	311	41,996	金融
BOEING CO/THE	62.67	765	103,360	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17.41	202	27,364	金融
BECTON DICKINSON AND CO	34.52	815	110,138	ヘルスケア
LEIDOS HOLDINGS INC	14	137	18,506	資本財・サービス
NISOURCE INC	62.99	173	23,471	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	14.04	149	20,159	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	89.05	361	48,811	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	478.95	2,354	317,883	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	148.59	4,125	556,977	金融
ANSYS INC	9.93	228	30,802	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	149.34	690	93,230	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	88.22	841	113,650	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	247.85	1,806	243,839	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	336.97	3,843	518,908	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	29.88	321	43,439	金融
LKQ CORP	33	160	21,617	一般消費財・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	36.65	238	32,241	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	31.49	451	60,961	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12.69	308	41,644	金融
DOLLAR GENERAL CORP	26.46	608	82,171	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	24.12	1,072	144,830	情報技術
CATERPILLAR INC	60.68	1,254	169,328	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	27.52	150	20,308	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	27.67	115	15,630	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	5.74	120	16,235	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	33.84	211	28,563	公益事業
MOSAIC CO/THE	42.85	225	30,505	素材
DELTA AIR LINES INC	13.58	42	5,753	資本財・サービス
CORNING INC	91.15	292	39,502	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	473.34	2,031	274,219	情報技術
MORGAN STANLEY	150.47	1,127	152,280	金融
MSCI INC	9.38	366	49,515	金融
FAIR ISAAC CORP	3.25	123	16,647	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	3.22	62	8,498	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	27.8	158	21,416	情報技術
BROADCOM INC	47.46	2,468	333,302	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	14.16	189	25,525	ヘルスケア
ARAMARK	31.73	96	12,992	一般消費財・サービス
DTE ENERGY COMPANY	21.62	257	34,767	公益事業
CENTENE CORP	65.39	498	67,298	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12.31	132	17,869	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	66.82	238	32,170	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	23.34	357	48,284	金融
GARTNER INC	9.35	219	29,614	情報技術
SPLUNK INC	19.21	166	22,426	情報技術
DOMINION ENERGY INC	91.9	685	92,559	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	43.42	382	51,621	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	14	77	10,516	資本財・サービス
DEERE & CO	33.11	1,081	145,987	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC	16.57	204	27,639	資本財・サービス
POOL CORP	4.38	153	20,663	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	32.97	369	49,921	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	24.85	301	40,702	情報技術
CABLE ONE INC	0.6	73	9,913	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	7.66	121	16,384	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	13.28	193	26,153	金融
VAIL RESORTS INC	4.92	113	15,334	一般消費財・サービス
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	63.6	75	10,235	コミュニケーション・サービス
TARGA RESOURCES CORP	28.16	186	25,206	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8.74	115	15,577	金融
WESTLAKE CORP	5.72	65	8,832	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	39.99	355	47,932	公益事業
COGNEX CORP	19.94	85	11,581	情報技術
WEBSTER FINANCIAL CORP	22	99	13,383	金融
TELEFLEX INC	5.63	142	19,193	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	9.79	158	21,335	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	8.52	239	32,278	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	2.41	113	15,291	ヘルスケア

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
CATALENT INC	18.63	194	26,231	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	16.6	297	40,188	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	6.9	180	24,378	ヘルスケア
IDEX CORP	8.69	155	21,049	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	88.91	660	89,151	生活必需品
ROLLINS INC	26.85	88	11,882	資本財・サービス
AMETEK INC	25.97	289	39,038	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	27.07	221	29,968	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	16.44	74	10,025	資本財・サービス
HEICO CORP	5.35	71	9,634	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	7.16	171	23,214	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3.99	139	18,892	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	30.45	296	40,074	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	4.67	145	19,581	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	51.11	2,324	313,828	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	11.28	80	10,847	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	6.24	173	23,450	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	15.87	123	16,656	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3.18	382	51,691	一般消費財・サービス
UGI CORP	20.85	82	11,178	公益事業
CUMMINS INC	16.04	315	42,577	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	88.74	662	89,424	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	15.67	254	34,378	情報技術
SIGNATURE BANK	6.92	123	16,635	金融
COSTAR GROUP INC	46.91	258	34,940	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	6.77	275	37,144	金融
AMERCO	1.19	55	7,460	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	10.77	257	34,820	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	5.36	330	44,606	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8.37	148	20,014	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	31.86	379	51,247	一般消費財・サービス
DEXCOM INC	44.16	306	41,322	ヘルスケア
NORDSON CORP	5.95	119	16,132	資本財・サービス
COPART INC	23.84	246	33,341	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	19.52	292	39,433	エネルギー
SEAGEN INC	15.45	223	30,170	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	8.31	197	26,710	ヘルスケア
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	9.71	183	24,715	金融
TRANSDIGM GROUP INC	5.87	309	41,816	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	4.3	139	18,820	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	12.03	109	14,815	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	25.6	208	28,088	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	231.08	413	55,813	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	28.39	508	68,716	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	4.2	112	15,223	金融
COTERRA ENERGY INC	105.27	327	44,215	エネルギー
T-MOBILE US INC	75.5	942	127,313	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	17.86	53	7,279	不動産
COCA-COLA CO/THE	472.06	2,796	377,489	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	25.75	130	17,618	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	19.25	189	25,625	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	38.51	88	11,999	金融
CSX CORP	252.87	741	100,166	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	10.44	223	30,143	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	15.63	159	21,509	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	1,057.4	10,818	1,460,573	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	70.32	608	82,122	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	486.82	4,678	631,622	エネルギー
AES CORP	74.55	140	19,032	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	4.33	118	15,940	金融
EOG RESOURCES INC	65.93	865	116,837	エネルギー
EQT CORP	45.84	187	25,269	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	19.14	170	23,075	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	1.57	97	13,200	金融
ABIOMED INC	5.12	117	15,875	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	17.73	250	33,801	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	34.22	396	53,597	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	446.66	544	73,570	一般消費財・サービス
EXACT SCIENCES CORP	22.19	82	11,126	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24.16	51	6,996	コミュニケーション・サービス
ENTEGRIS INC	17	167	22,667	情報技術
AERCAP HOLDINGS NV	17	67	9,095	資本財・サービス
FORTINET INC	15.95	429	57,976	情報技術
MARKEL CORP	1.59	206	27,834	金融
NEXTERA ENERGY INC	229.73	1,642	221,701	公益事業
MASIMO CORP	6.93	85	11,513	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	165.2	608	82,122	素材
INSULET CORP	7.69	158	21,340	ヘルスケア

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
US BANCORP	159.18	727	98,256	金融
UNITED RENTALS INC	8.26	214	29,008	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	6.59	99	13,416	情報技術
FASTENAL CO	65.3	320	43,313	資本財・サービス
FISERV INC	74.14	666	89,976	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	132.41	901	121,650	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	167.52	556	75,088	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	13.05	74	10,044	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	27.38	591	79,809	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	39.92	1,127	152,277	金融
ALPHABET INC-CL A	34.84	7,435	1,003,925	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	32.64	6,997	944,749	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	11.93	98	13,313	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	69.11	459	62,001	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	58.4	224	30,268	公益事業
GENUINE PARTS CO	16.26	215	29,074	一般消費財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	81	280	37,816	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21.91	497	67,124	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	102.3	375	50,646	エネルギー
HOME DEPOT INC	119.83	3,339	450,839	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	5.93	104	14,091	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	169.2	207	27,960	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5	102	13,825	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	16.16	334	45,116	生活必需品
HUMANA INC	14.51	615	83,047	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	29.85	502	67,821	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	9.17	44	6,028	情報技術
HENRY SCHEIN INC	14.91	111	15,097	ヘルスケア
HP INC	132.53	447	60,388	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	141.15	192	26,050	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6.81	24	3,330	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22.62	131	17,749	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	20.28	73	9,933	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	42.74	190	25,706	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	93.36	337	45,552	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	13.86	248	33,592	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	105.97	1,438	194,174	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	40.47	176	23,833	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	15	91	12,418	資本財・サービス
ZOETIS INC	53.61	845	114,213	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	26.87	340	45,955	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	28.36	370	49,974	エネルギー
ALLEGION PLC	11.1	112	15,176	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	33.41	75	10,153	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	28.95	339	45,870	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	40	113	15,293	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	12.25	153	20,732	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	299.74	5,041	680,629	ヘルスケア
PLUG POWER INC	62.51	88	11,984	資本財・サービス
ABBVIE INC	203.59	2,801	378,271	ヘルスケア
HOLOGIC INC	28.01	190	25,665	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	37.65	464	62,680	生活必需品
KROGER CO	80.9	407	55,037	生活必需品
KLA CORP	17.19	544	73,447	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	28.02	1,166	157,436	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	8.4	190	25,748	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	28.72	94	12,718	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	79.29	1,410	190,483	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	93.67	2,723	367,744	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	16	719	97,157	情報技術
LOEWS CORP	23.65	138	18,691	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	19.81	95	12,923	金融
MCDONALD'S CORP	86.68	2,069	279,412	一般消費財・サービス
3M CO	64.77	876	118,270	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	265.49	4,346	586,870	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	41.71	1,324	178,753	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	6.82	215	29,139	素材
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	5.75	152	20,543	情報技術
ALCOA CORP	24.04	117	15,877	素材
PHILLIPS 66	54.02	562	75,944	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	45.19	132	17,937	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VGT SHRS	28.21	236	31,916	生活必需品
METLIFE INC	81.54	504	68,099	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	110.88	537	72,633	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	25.99	238	32,257	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	19.04	387	52,262	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2.6	300	40,635	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	116.87	384	51,958	エネルギー

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
ROCKWELL AUTOMATION INC	13.4	268	36,258	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	291.04	2,459	332,028	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	59.74	360	48,691	素材
MASCO CORP	27.31	139	18,881	資本財・サービス
M & T BANK CORP	18.48	304	41,142	金融
MARSH & MCLENNAN COS	61.19	901	121,655	金融
BLACK KNIGHT INC	16.44	105	14,298	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	7.54	81	11,000	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	31.57	480	64,880	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	22.75	317	42,810	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	8.8	41	5,600	一般消費財・サービス
BLOCK INC CLASS A	59.91	361	48,773	情報技術
TRANSUNION	22.93	177	23,939	資本財・サービス
VISTRA CORP	42.85	98	13,282	公益事業
NOVOCURE LTD	10.54	63	8,519	ヘルスケア
NETAPP INC	27.03	173	23,472	情報技術
NIKE INC -CL B	149.92	1,659	224,105	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	27.46	611	82,604	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	62.14	378	51,134	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	21.46	186	25,142	金融
ALLY FINANCIAL INC	43.51	148	20,019	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	16.91	768	103,754	資本財・サービス
APTIV PLC	30.63	290	39,252	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	99.13	625	84,436	素材
MCKESSON CORP	17.02	521	70,434	ヘルスケア
XYLEM INC	19.72	150	20,367	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	181.38	1,795	242,358	生活必需品
NUCOR CORP	32.07	364	49,238	素材
WESTERN UNION CO	43.5	71	9,666	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	19.3	128	17,291	情報技術
NEWELL BRANDS INC	40.58	74	10,119	一般消費財・サービス
EVERGY INC	26.54	162	21,971	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	104.88	651	87,918	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2.69	46	6,284	金融
OKTA INC	16.34	133	17,972	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	8.8	47	6,345	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	16.14	183	24,751	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	48.77	101	13,761	ヘルスケア
LINDE PLC	52.88	1,563	211,052	素材
WIX.COM LTD	7.85	43	5,891	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	42.93	112	15,191	金融
KKR & CO INC	75.84	357	48,226	金融
PAYCHEX INC	36.57	429	57,998	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7.56	451	60,902	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	206.46	955	129,029	生活必需品
P G & E CORP	173.68	172	23,354	公益事業
PFIZER INC	649.11	3,110	419,953	ヘルスケア
CIGNA CORP	37.11	911	123,106	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	32.76	155	20,942	情報技術
XCEL ENERGY INC	69.88	460	62,154	公益事業
STERIS PLC	11.73	238	32,254	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	51	361	48,852	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	15.3	45	6,124	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	38.31	122	16,566	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	38.15	765	103,311	ヘルスケア
LYFT INC-A	31.91	45	6,100	資本財・サービス
DOW INC	82.99	485	65,613	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	11.3	73	9,876	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	25.74	275	37,135	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	14.23	359	48,535	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	172.53	363	49,125	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	25.89	684	92,471	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	275.98	3,693	498,688	生活必需品
EXELON CORP	111.5	471	63,691	公益事業
TELADOC HEALTH INC	16.18	47	6,393	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	58.97	258	34,847	資本財・サービス
NVR INC	0.37	144	19,507	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	148.09	1,651	222,908	エネルギー
TWILIO INC - A	20.53	168	22,689	情報技術
DOCUSIGN INC	23.33	133	18,041	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	6.01	162	21,944	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	14.7	66	8,962	情報技術
PEPSICO INC	158.88	2,480	334,883	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	4.09	48	6,597	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	37.43	76	10,384	情報技術
MONGODB INC	7.12	171	23,166	情報技術
SNAP INC - A	129.1	153	20,758	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	81.98	462	62,413	素材

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	42.85	403	54,461	金融
AMCOR PLC	174.57	211	28,494	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	23.36	372	50,227	情報技術
ROKU INC	14.17	105	14,212	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20.92	279	37,697	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	73.42	2,019	272,710	情報技術
KORNIT DIGITAL LTD	6	20	2,750	資本財・サービス
PENTAIR PLC	15.75	72	9,751	資本財・サービス
QUALCOMM INC	130.95	1,705	230,293	情報技術
INVESCO LTD	37	60	8,112	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	6.64	113	15,372	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	31.93	204	27,563	金融
DATADOG INC - CLASS A	25.87	225	30,424	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	67.63	116	15,695	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	10.47	73	9,860	情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	12.77	700	94,539	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	24.68	303	41,004	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	4.61	899	121,461	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	41.1	304	41,061	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	9.98	146	19,837	素材
RESMED INC	16.6	335	45,273	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	13.27	168	22,765	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	12.09	98	13,291	資本財・サービス
MODERNA INC	39.1	475	64,170	ヘルスケア
HUBSPOT INC	5.64	166	22,527	情報技術
PERKINELMER INC	17.6	243	32,824	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	111.61	401	54,156	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	45.2	312	42,235	資本財・サービス
BILL. COM HOLDINGS INC	9	95	12,876	情報技術
AVANTOR INC	66.86	198	26,827	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	18.36	60	8,227	金融
DYNATRACE INC	23.39	90	12,258	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	51.91	235	31,817	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	108.25	209	28,279	金融
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	33.64	104	14,111	コミュニケーション・サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	41.76	159	21,537	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	10.21	80	10,867	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	31.62	231	31,193	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	224.04	3,753	506,799	エネルギー
PELTON INTERACTIVE INC-A	31.74	30	4,105	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	9.85	139	18,898	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	43.65	266	35,936	公益事業
ETSY INC	14.09	100	13,622	一般消費財・サービス
TESLA INC	101.52	6,727	908,269	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	25.02	284	38,464	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	67.67	148	20,090	情報技術
UNITY SOFTWARE INC	29.86	100	13,610	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	18.95	202	27,316	資本財・サービス
SYNOPLYS INC	17.16	506	68,381	情報技術
CARVANA CO	9.64	20	2,722	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	8.56	23	3,126	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	31.13	126	17,143	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	14.27	644	87,076	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	137.45	141	19,150	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	26.83	156	21,176	一般消費財・サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	49.45	129	17,438	コミュニケーション・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	43.29	428	57,785	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	38.49	271	36,677	不動産
TWITTER INC	90.07	335	45,260	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	118.75	793	107,064	公益事業
SYSCO CORP	57.47	460	62,180	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	27.8	462	62,420	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	6	26	3,550	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	9.56	50	6,822	金融
STEEL DYNAMICS INC	23	163	22,053	素材
SCHLUMBERGER LTD	157.94	682	92,160	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	20.26	88	11,909	資本財・サービス
AFFIRM HOLDINGS INC	20.35	36	4,862	情報技術
AT&T INC	836.15	1,626	219,568	コミュニケーション・サービス
APA CORP	43.54	200	27,040	エネルギー
SOUTHWEST AIRLINES CO	10.08	37	5,065	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	51.37	291	39,289	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	23.88	94	12,699	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	28.3	649	87,679	素材
SEMPRA ENERGY	36.02	521	70,426	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	22.64	69	9,423	情報技術
CLARIVATE PLC	47.21	62	8,419	資本財・サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	197.7	154	20,872	情報技術

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	22.4	169	22,872	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	16.57	85	11,539	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC	107.78	1,660	224,207	情報技術
SALESFORCE.COM INC	115.1	1,892	255,549	情報技術
WESTROCK CO	29.71	127	17,155	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	55.49	273	36,979	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	79.32	393	53,116	資本財・サービス
TERADYNE INC	18.27	166	22,424	情報技術
UNION PACIFIC CORP	72.2	1,505	203,230	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	93.23	268	36,237	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	68.55	703	95,020	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	175.23	1,600	216,043	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	85.8	1,494	201,744	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	21.41	430	58,065	ヘルスケア
AMEREN CORPORATION	28.61	238	32,175	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	107.72	4,973	671,535	ヘルスケア
APPLOVIN CORP CLASS A	21.44	69	9,364	情報技術
VERISIGN INC	12.1	195	26,330	情報技術
LUCID GROUP INC	51	84	11,429	一般消費財・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	22	60	8,108	一般消費財・サービス
VALERO ENERGY CORP	45.84	613	82,775	エネルギー
UPSTART HOLDINGS INC	2	6	925	金融
ULTA BEAUTY INC	5.5	215	29,157	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	30.08	112	15,180	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	7.67	80	10,859	ヘルスケア
ANTHEM INC	27.19	1,251	169,009	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	211.9	1,996	269,550	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	447.85	1,676	226,317	金融
WASTE MANAGEMENT INC	46.7	680	91,812	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	136.22	440	59,476	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	12.49	240	32,405	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	6.86	106	14,388	一般消費財・サービス
WALMART INC	178.41	2,131	287,744	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	23.48	247	33,370	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	11.45	66	8,967	一般消費財・サービス
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	139	34	4,597	資本財・サービス
WABTEC CORP	18.98	163	22,119	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	135.04	774	104,522	一般消費財・サービス
WATERS CORP	6.99	224	30,339	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	5.71	171	23,184	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	79.88	321	43,354	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14	272	36,833	金融
WESTERN DIGITAL CORP	35.31	173	23,473	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	36.5	335	45,360	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	58.55	356	48,195	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	190.79	3,692	498,479	情報技術
PPL CORP	83.6	217	29,379	公益事業
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	36.96	201	27,165	公益事業
PULTEGROUP INC	27.95	111	15,048	一般消費財・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	250.13	349	47,210	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC	26.8	298	40,347	素材
NORTHERN TRUST CORP	22.6	211	28,559	金融
NVIDIA CORP	288.63	4,570	617,096	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	48.69	757	102,325	金融
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	11.77	58	7,937	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	33.22	278	37,638	生活必需品
NETFLIX INC	49.77	833	112,577	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	45.47	2,307	311,518	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	30	118	15,966	公益事業
GLOBE LIFE INC	12.15	108	14,673	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	20.67	283	38,220	金融
TEXTRON INC	23.88	143	19,405	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	37.49	58	7,870	コミュニケーション・サービス
OMNICOM GROUP	25.46	165	22,325	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	184.58	1,305	176,235	情報技術
MASTERCARD INC - A	100.48	3,236	437,008	情報技術
ONEOK INC	50.33	303	41,035	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	110.62	117	15,815	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	11.95	454	61,414	情報技術
YUM! BRANDS INC	32.75	361	48,739	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	20.69	251	33,914	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	22.06	113	15,296	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	847.45	2,666	359,947	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5.23	190	25,760	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	22.63	161	21,839	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	74.47	1,076	145,383	金融
ANALOG DEVICES INC	60.05	883	119,315	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	190.8	1,659	224,085	情報技術

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	92.09	479	64,676	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	19.4	179	24,295	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	26.09	103	13,910	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	9.29	149	20,204	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	59.54	404	54,557	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	67.86	574	77,600	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	25	627	84,762	金融
AMGEN INC	66.17	1,559	210,565	ヘルスケア
EATON CORP PLC	50.05	653	88,195	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	18.59	430	58,102	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	101.47	980	132,364	情報技術
CME GROUP INC	40.78	799	107,972	金融
ECOLAB INC	29.18	438	59,204	素材
EQUIFAX INC	13.57	233	31,515	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	143.13	827	111,673	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	99.75	343	46,327	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	33.15	149	20,193	生活必需品
STATE STREET CORP	41.52	258	34,855	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	173.13	1,057	142,840	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	56.65	382	51,610	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	21.66	98	13,288	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	15.97	150	20,271	素材
CARDINAL HEALTH INC	33.19	169	22,902	ヘルスケア
FEDEX CORP	28.31	650	87,889	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	48.73	519	70,119	金融
FMC CORP	13.6	146	19,815	素材
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	27.48	321	43,470	素材
CITRIX SYSTEMS INC	14.12	130	17,616	情報技術
INTEL CORP	472.82	1,793	242,127	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	43.18	119	16,194	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	39.7	264	35,696	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	35.67	663	89,540	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	102.27	60	8,187	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	16.89	319	43,191	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	14.5	84	11,467	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	43.34	828	111,818	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	13.3	161	21,807	情報技術
SNAP-ON INC	6.23	128	17,290	資本財・サービス
CARMAX INC	18.34	164	22,232	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP	86.25	870	117,540	公益事業
TARGET CORP	53.73	766	103,515	一般消費財・サービス
DOVER CORP	17.13	210	28,446	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	4.75	223	30,134	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14.62	181	24,538	資本財・サービス
CINTAS CORP	10.4	366	49,486	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	55.67	177	23,900	生活必需品
CLOROX COMPANY	13.84	172	23,289	生活必需品
ENTERGY CORP	22.43	240	32,490	公益事業
MICROSOFT CORP	821.66	20,088	2,712,184	情報技術
INCYTE CORP	20.06	132	17,923	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	155.28	1,407	190,020	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	157.69	1,395	188,371	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	124.93	733	99,008	情報技術
BLACKROCK INC	17.18	1,015	137,134	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	69.14	190	25,763	公益事業
HASBRO INC	14.49	117	15,797	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	29.14	199	26,886	生活必需品
KEYCORP	103.89	182	24,601	金融
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	166.95	976	131,790	生活必需品
COOPER COS INC/THE	5.47	172	23,256	ヘルスケア
CHUBB LTD	48.39	957	129,316	金融
ARROW ELECTRONICS INC	7.37	84	11,347	情報技術
ALLSTATE CORP	32.42	395	53,395	金融
EBAY INC	70.68	300	40,631	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	124.99	905	122,275	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	14.92	143	19,386	素材
DISH NETWORK CORP-A	29.84	52	7,102	コミュニケーション・サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	26.15	629	85,007	生活必需品
TRIMBLE INC	29.38	173	23,466	情報技術
LENNAR CORP-A	29.92	206	27,929	一般消費財・サービス
LEAR CORP	6	75	10,234	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	66.01	742	100,179	金融
PACCAR INC	39.19	329	44,529	資本財・サービス
BIOGEN INC	16.99	329	44,541	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	9.62	316	42,729	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	131.72	952	128,592	一般消費財・サービス
PTC INC	12	119	16,183	情報技術
EVERSOURCE ENERGY	39.06	315	42,578	公益事業

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
INTUIT INC	32.06	1,169	157,892	情報技術
BORGWARNER INC	27.41	96	12,974	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	25.7	181	24,493	一般消費財・サービス
BALL CORP	36.3	241	32,590	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	161.99	570	77,070	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	32.21	410	55,389	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	14.25	215	29,058	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	28.56	711	96,042	ヘルスケア
VF CORP	36.36	165	22,296	一般消費財・サービス
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	67.79	172	23,256	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	6.28	77	10,480	一般消費財・サービス
CARNIVAL CORP	99.86	95	12,834	一般消費財・サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC	63.61	112	15,149	素材
COMCAST CORP-CLASS A	528.64	2,106	284,344	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	28	150	20,292	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	131	63	8,595	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	38,087.49 603銘柄	374,164 50,515,991	<69.7%>
(カナダ)	百株	千カナダ・ドル	千円	
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	96.62	525	54,718	生活必需品
IMPERIAL OIL LTD	23	158	16,536	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2.29	425	44,370	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	31.36	194	20,266	一般消費財・サービス
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	52.7	265	27,676	素材
INTACT FINANCIAL CORP	19.97	350	36,542	金融
BCE INC	9	57	5,950	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	22	394	41,134	素材
SUNCOR ENERGY INC	163.65	834	86,966	エネルギー
METRO INC/CN	27.76	188	19,640	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	39.41	351	36,589	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	149.98	1,209	126,054	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	102.3	664	69,266	金融
TORONTO-DOMINION BANK	214.88	1,919	200,059	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	39	124	12,943	金融
ROYAL BANK OF CANADA	167.46	2,110	219,879	金融
TOURMALINE OIL CORP	36.56	257	26,804	エネルギー
TC ENERGY CORP	123.64	867	90,427	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	63.75	317	33,094	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	203.69	513	53,506	素材
CAE INC	37.52	115	12,033	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	19.68	247	25,791	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	18	71	7,459	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	10.34	109	11,389	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	15.6	90	9,379	素材
HYDRO ONE LTD	39.86	134	14,038	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	20.86	234	24,457	生活必需品
NORTHLAND POWER INC	30.03	111	11,621	公益事業
WSP GLOBAL INC	14.44	200	20,890	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	9.74	102	10,651	資本財・サービス
PARKLAND CORP	16.21	60	6,286	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	23	63	6,585	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	27.31	162	16,897	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC	11	107	11,202	資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A	10	38	4,005	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	43.06	255	26,647	コミュニケーション・サービス
BRP INC/CA- SUB VOTING	10.17	82	8,603	一般消費財・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	88.5	81	8,474	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	52.12	327	34,154	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	118.88	203	21,182	公益事業
AIR CANADA	17	30	3,183	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	147.57	77	8,088	素材
BANK OF MONTREAL	80.79	1,037	108,091	金融
POWER CORP OF CANADA	63	213	22,267	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	13.05	512	53,447	情報技術
NUTRIEN LTD	65.33	738	76,923	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	15.32	68	7,172	公益事業
CAMECO CORP	50.21	144	15,099	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	4.22	64	6,727	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	18.65	63	6,634	資本財・サービス
LIGHTSPEED COMMERCE INC	15.6	41	4,276	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VOTG	10	52	5,493	情報技術
TELUS CORP	6	17	1,831	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	53.74	274	28,648	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	7.43	121	12,663	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	132.69	1,041	108,508	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3	197	20,606	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	31.67	234	24,469	一般消費財・サービス

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千カナダ・ドル	千円	
WESTON (GEORGE) LTD	9.01	131	13,726	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	26.15	70	7,370	素材
BLACKBERRY LTD	64	42	4,454	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	66.71	395	41,234	金融
ENBRIDGE INC	244.33	1,359	141,654	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	173.41	1,009	105,199	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	221.84	486	50,646	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	35.14	33	3,511	ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	106.07	941	98,079	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	11	68	7,125	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	23.64	86	8,991	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	69.45	975	101,689	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	23.84	231	24,155	情報技術
ONEX CORPORATION	11.04	75	7,904	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	51.72	176	18,361	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	27.84	98	10,277	金融
TMX GROUP LTD	7.94	105	11,025	金融
OPEN TEXT CORP	32.1	154	16,148	情報技術
SAPUTO INC	29	78	8,213	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	63	201	20,954	素材
FORTIS INC	54.74	324	33,846	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	13.55	106	11,087	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	66	65	6,856	素材
CENOVUS ENERGY INC	173.9	499	52,059	エネルギー
DOLLARAMA INC	35.29	255	26,578	一般消費財・サービス
ALTAGAS LTD	32.01	88	9,235	公益事業
KEYERA CORP	22	73	7,672	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	92.53	182	18,994	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,727.86 86銘柄	27,786 2,895,374	<4.0%>
(オーストラリア)	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
THE LOTTERY CORPORATION LTD	265.51	121	11,346	一般消費財・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	539.23	165	15,412	金融
BHP GROUP LTD	605.7	2,680	249,585	素材
SOUTH32 LTD	563.87	253	23,570	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	211.41	697	64,931	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	196.91	386	35,986	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	376.85	1,011	94,167	金融
WESTPAC BANKING CORP	424.01	850	79,226	金融
SANTOS LTD	370.03	299	27,904	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	328.92	723	67,369	金融
RIO TINTO LTD	41.69	462	43,102	素材
ORIGIN ENERGY LTD	209.68	124	11,556	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD	234.38	94	8,771	資本財・サービス
XERO LTD	14.26	116	10,873	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	27.48	65	6,096	エネルギー
COLES GROUP LTD	155.7	266	24,845	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	16.45	60	5,611	情報技術
IDP EDUCATION LTD	26.19	58	5,400	一般消費財・サービス
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	107.16	86	8,041	素材
EVOLUTION MINING LTD	170.17	56	5,275	素材
REECE LTD	37.62	52	4,861	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	139.06	99	9,256	生活必需品
SEEK LTD	26	56	5,255	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	86.16	93	8,703	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	103.31	239	22,333	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	206.53	1,883	175,358	金融
AMPOL LTD	20	68	6,412	エネルギー
ORICA LTD	47.83	74	6,977	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	153.48	176	16,432	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD	138.36	468	43,577	生活必需品
CROWN RESORTS LTD	30	39	3,644	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	63.73	30	2,871	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	507.1	190	17,704	コミュニケーション・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	47.96	155	14,498	素材
MACQUARIE GROUP LTD	45.02	735	68,465	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	64.62	221	20,605	一般消費財・サービス
CSL LTD	59.05	1,559	145,162	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	129.17	542	50,508	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	8.05	165	15,411	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	50.24	82	7,703	素材
SUNCORP GROUP LTD	145.04	152	14,151	金融
ASX LTD	22.6	175	16,310	金融
COMPUTERSHARE LTD	60.54	142	13,262	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	270.97	112	10,519	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	52.23	174	16,202	ヘルスケア
BRAMBLES LTD	183.37	192	17,925	資本財・サービス

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
MINERAL RESOURCES LTD	18.81	104	9,729	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20.64	154	14,369	ヘルスケア
REA GROUP LTD	6.08	62	5,855	コミュニケーション・サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	7.6	48	4,505	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	7,636.77 50銘柄	16,838 <2.2%>	
	百株	千香港・ドル	千円	
(香港)				
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	175	895	15,396	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	290	1,196	20,575	一般消費財・サービス
MTR CORP	165	684	11,777	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	190	1,772	30,490	不動産
SINO LAND CO	340	380	6,549	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	325.52	1,725	29,674	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	80	382	6,577	不動産
CLP HOLDINGS LTD	190	1,434	24,673	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	205.65	604	10,399	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	1,450.27	1,237	21,277	公益事業
HANG SENG BANK LTD	100	1,370	23,564	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT	175	511	8,789	不動産
WH GROUP LTD	1,135	634	10,912	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	154	5,260	90,483	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	200	287	4,946	不動産
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	260	455	7,834	資本財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	80	152	2,625	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	235.52	1,223	21,044	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	55	282	4,857	公益事業
AIA GROUP LTD	1,530	12,025	206,843	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	120	310	5,335	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	200	692	11,902	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	192	395	6,802	生活必需品
ESR CAYMAN LTD	280	590	10,161	不動産
SANDS CHINA LTD	290	436	7,501	一般消費財・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	260	352	6,064	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	160	1,491	25,648	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	450	1,374	23,645	金融
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,287.96 28銘柄	656,356 <0.9%>	
	百株	千シンガポール・ドル	千円	
(シンガポール)				
CAPITALAND INVESTMENT LTD	334	121	11,819	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD	149	403	39,132	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	223	664	64,470	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	177.5	91	8,828	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	173	115	11,220	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	30	21	2,094	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	52	41	3,992	不動産
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	407	465	45,101	金融
GENTING SINGAPORE LTD	450	33	3,272	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	32	54	5,286	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,034	260	25,262	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	141	56	5,440	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	118	113	11,028	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD	158	64	6,219	生活必需品
シンガポール・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,478.5 14銘柄	2,508 <0.3%>	
	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
(ニュージーランド)				
MERIDIAN ENERGY LTD	150	66	5,578	公益事業
MERCURY NZ LTD	32.94	17	1,482	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD	275.03	124	10,459	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	132.89	96	8,110	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	72.38	141	11,848	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 >	663.24 5銘柄	37,479 <0.1%>	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)				
SHELL PLC	892.51	2,059	334,138	エネルギー
BP PLC	2,230.25	970	157,351	エネルギー
UNILEVER PLC	305.42	1,102	178,822	生活必需品
BARCLAYS PLC	1,838.69	288	46,754	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	912.45	80	13,012	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	314.21	305	49,622	金融
NATWEST GROUP PLC	662.75	146	23,801	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	17.58	34	5,670	素材
BAE SYSTEMS PLC	364.45	282	45,804	資本財・サービス
AVIVA PLC	340.02	137	22,287	金融
AVEVA GROUP PLC	11.4	26	4,373	情報技術

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
GSK	601.83	1,030	167,149	ヘルスケア
INFORMA PLC	162	81	13,186	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	494.22	74	12,109	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	105.87	54	8,816	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	9.38	48	7,914	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	51.49	40	6,553	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	7.4	68	11,144	資本財・サービス
HALMA PLC	39.78	77	12,495	情報技術
ENTAIN PLC	58.23	78	12,671	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	320.55	35	5,810	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	68.57	41	6,751	金融
M&G PLC	259.64	52	8,499	金融
RELX PLC	220.83	459	74,543	資本財・サービス
DIAGEO PLC	278.48	960	155,753	生活必需品
RIO TINTO PLC	138	766	124,348	素材
STANDARD CHARTERED PLC	295.93	177	28,782	金融
TESCO PLC	847.03	208	33,895	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	92.37	107	17,440	ヘルスケア
GLENCORE PLC	1,209.36	584	94,809	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	32	24	4,006	金融
SMITHS GROUP PLC	40.8	60	9,758	資本財・サービス
PEARSON PLC	82.71	61	9,906	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	176.31	35	5,814	生活必需品
NEXT PLC	16.85	100	16,229	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	322.36	40	6,520	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	17.85	45	7,429	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	39.54	103	16,823	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	3,150.36	395	64,163	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	14.09	84	13,635	素材
KINGFISHER PLC	247.03	58	9,408	一般消費財・サービス
WPP PLC	130.21	106	17,277	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82.44	84	13,747	公益事業
SEVERN TRENT PLC	29.71	83	13,527	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	222.42	100	16,322	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	89.64	536	87,068	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	48.83	53	8,740	金融
SCHRODERS PLC	12.27	32	5,226	金融
SSE PLC	119.27	195	31,757	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	123.68	60	9,774	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	182.85	1,782	289,185	ヘルスケア
FERGUSON PLC	24.79	227	36,938	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	682.32	164	26,729	金融
3i GROUP PLC	111.52	123	19,980	金融
ASHTREAD GROUP PLC	51.39	187	30,434	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	115.48	69	11,209	情報技術
NATIONAL GRID PLC	414.25	435	70,588	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,100.12	351	56,984	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	108.06	194	31,568	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	11.55	46	7,540	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	246.58	864	140,172	生活必需品
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	34.83	54	8,861	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	2,398.77	1,248	202,489	金融
ANGLO AMERICAN PLC	144.24	498	80,837	素材
MONDI PLC	59.21	84	13,671	素材
COMPASS GROUP PLC	201.76	336	54,654	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	39.69	85	13,841	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	1,027.57	184	29,944	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	25.74	43	6,989	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	45.08	71	11,648	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	20.78	90	14,666	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	18.97	80	13,025	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	36.24	244	39,609	金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	20.39	30	4,992	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	15.7	33	5,424	金融
ANTOFAGASTA PLC	34.6	48	7,818	素材
ABRDN PLC	277.75	47	7,632	金融
EXPERIAN PLC	104.96	243	39,550	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 >	32,704.25 78銘柄	20,519 3,328,445	<4.6%>
(イスラエル)	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	120	216	8,425	金融
AZRIELI GROUP LTD	5.3	122	4,778	不動産
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	18.59	299	11,669	情報技術
ICL GROUP LTD	82.94	295	11,491	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	3	203	7,920	資本財・サービス
BANK HAPOLIM BM	151.6	456	17,764	金融

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イスラエル・シケル	千円	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	190.43	592	23,063	金融
NICE LTD	8	525	20,468	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	18.83	208	8,102	金融
イスラエル・シケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	598.69 9銘柄	113,684 <0.2%>	
	百株	千スイス・フラン	千円	
(スイス)				
UBS GROUP AG-REG	389.06	622	83,990	金融
ROCHE HOLDING AG-BR	4.28	149	20,224	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.89	63	8,615	素材
ADECCO GROUP AG-REG	17.54	58	7,933	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	80.79	2,470	333,495	ヘルスケア
SIKA AG-REG	18.12	411	55,581	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	96	13,055	生活必需品
ABB LTD-REG	181.74	499	67,402	資本財・サービス
SWISS RE AG	33.1	251	33,963	金融
NESTLE SA-REG	325.98	3,540	478,042	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2.43	207	27,951	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2.61	45	6,184	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	301.22	177	24,010	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	26.84	123	16,690	金融
SGS SA-REG	0.94	199	26,942	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	4.67	79	10,781	資本財・サービス
TEMENOS AG - REG	7.93	57	7,714	情報技術
VAT GROUP AG	3.39	81	11,030	資本財・サービス
ALCON INC	55.13	365	49,362	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	3.77	86	11,655	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	16.79	703	95,002	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	6.11	93	12,687	金融
CLARIANT AG-REG	25.52	47	6,415	素材
NOVARTIS AG-REG	242.42	1,956	264,189	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.41	85	11,491	生活必需品
BACHEM HOLDING AG-REG B	3.9	26	3,609	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	58.09	574	77,517	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	2.76	146	19,756	コミュニケーション・サービス
GEBERIT AG-REG	3.89	183	24,788	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	1.04	324	43,864	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	17.09	174	23,603	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	6.37	200	27,038	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	17.3	89	12,108	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	8.29	416	56,207	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	4.5	19	2,627	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD	58.05	264	35,761	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	3.49	179	24,171	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	6.4	149	20,193	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	9.46	83	11,309	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.14	130	17,672	生活必需品
スイス・フラン通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,952.46 40銘柄	2,084,647 <2.9%>	
	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
(デンマーク)				
NOVO NORDISK A/S-B	211.87	16,004	302,968	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	92.36	1,012	19,162	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0.39	715	13,539	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	120.49	1,931	36,557	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S	21.59	511	9,690	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B	12.32	1,044	19,767	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	24.64	987	18,694	素材
COLOPLAST-B	15.19	1,138	21,554	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	24.04	2,391	45,261	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	0.98	176	3,339	資本財・サービス
DEMANT A/S	13.14	359	6,798	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.66	1,224	23,182	資本財・サービス
TRYG A/S	40.74	633	11,988	金融
PANDORA A/S	13.25	639	12,102	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	12.62	600	11,369	素材
GENMAB A/S	7.78	1,531	28,991	ヘルスケア
ORSTED A/S	22.46	1,558	29,493	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	634.52 17銘柄	614,461 <0.8%>	
	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
(ノルウェー)				
DNB BANK	116.96	2,142	28,897	金融
NORSK HYDRO ASA	166.15	1,064	14,353	素材
ORKLA ASA	74.83	547	7,383	生活必需品
TELENOR ASA	87.46	1,115	15,054	コミュニケーション・サービス

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
EQUINOR ASA	117.89	4,169	56,250	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	21.12	996	13,447	素材
MOWI ASA	46.77	1,119	15,098	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	20	388	5,234	金融
AKER BP ASA	13.55	561	7,576	エネルギー
KONGSBERG GRUPPEN ASA	19.73	653	8,815	資本財・サービス
SALMAR ASA	9.43	641	8,656	生活必需品
ADEVINTA ASA	45.82	301	4,070	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 >	739.71 12銘柄	13,701 <0.3%>	184,837
	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)				
SAGAX CLASS B	20.2	413	5,476	不動産
INVESTOR CLASS A	62.56	1,183	15,674	金融
VOLVO CAR CLASS B	85.56	634	8,408	一般消費財・サービス
ERICSSON LM-B SHS	348.35	2,621	34,732	情報技術
VOLVO AB-B SHS	193.33	3,181	42,148	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES	40	667	8,837	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	26	348	4,617	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	205.45	2,075	27,494	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	70.26	808	10,715	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS	28.69	717	9,503	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	196.1	2,129	28,217	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	174.28	1,650	21,868	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	108.21	1,616	21,420	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	88.36	1,177	15,599	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	73.2	1,181	15,654	素材
SKANSKA AB-B SHS	37.09	601	7,968	資本財・サービス
SANDVIK AB	135.38	2,560	33,920	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS	234.46	4,006	53,085	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	317.12	3,182	42,169	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS	39.23	671	8,898	資本財・サービス
HOLMEN AB-B SHARES	13.42	604	8,008	素材
SECURITAS AB-B SHS	39.3	345	4,574	資本財・サービス
TELIA CO AB	332.69	1,299	17,213	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB	38.03	927	12,295	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	192.52	1,688	22,371	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	119.97	2,646	35,066	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	16.38	387	5,139	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	64.2	351	4,658	不動産
INDUTRADE AB	36	741	9,826	資本財・サービス
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	32.95	715	9,473	ヘルスケア
LUNDBERGS AB-B SHS	9.48	405	5,377	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	20.48	428	5,674	資本財・サービス
LIFCO AB-B SHS	29.24	505	6,692	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	167.16	1,200	15,911	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB	29	1,393	18,459	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	72.6	1,828	24,231	生活必需品
EMBRACER GROUP AB	70.9	572	7,585	コミュニケーション・サービス
BOLIDEN AB	31.71	1,132	15,003	素材
EPIROC AB-A	86.6	1,534	20,332	資本財・サービス
EPIROC AB-B	40.15	608	8,056	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS	54	419	5,558	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP	426.56	4,186	55,467	金融
EQT AB	33.65	735	9,742	金融
EVOLUTION AB	20.64	1,868	24,763	一般消費財・サービス
SINCH AB	64	240	3,182	情報技術
KINNEVIK AB - B	30.03	504	6,684	金融
HEXAGON AB-B SHS	235.58	2,571	34,070	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13	305	4,044	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,804.07 48銘柄	61,575 <1.1%>	815,880
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (アイルランド)				
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	30.55	98	13,897	素材
KINGSPAN GROUP PLC	17.44	122	17,188	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A	18.22	166	23,457	生活必需品
CRH PLC	83.4	283	39,925	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	17.85	166	23,494	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	167.46 5銘柄	837 <0.2%>	117,964
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オランダ)				
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	89.3	176	24,802	コミュニケーション・サービス
QIAGEN N. V.	25.21	102	14,492	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	103.01	215	30,327	ヘルスケア
NN GROUP NV	31	138	19,458	金融
HEINEKEN NV	31.23	277	39,134	生活必需品

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
AEGON NV	179.67	78	11,022	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	110.69	278	39,274	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.	23.19	164	23,097	素材
KONINKLIJKE DSM NV	21.12	299	42,181	素材
WOLTERS KLUWER	31.58	268	37,777	資本財・サービス
ING GROEP NV	426.86	410	57,842	金融
KONINKLIJKE KPN NV	376.07	124	17,558	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV	44.67	2,104	296,362	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA	40.3	41	5,776	金融
IMCD NV	7.15	94	13,313	資本財・サービス
ADYEN NV	2.56	295	41,646	情報技術
JUST EAT TAKEAWAY	23.81	40	5,735	一般消費財・サービス
PROSUS NV	100.88	480	67,674	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV	14.76	38	5,432	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV	6.02	154	21,703	情報技術
RANDSTAD NV	14.9	70	9,902	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	12.85	89	12,646	生活必需品
OCI NV	18.79	62	8,809	素材
EURONEXT NV	10.95	80	11,375	金融
STMICROELECTRONICS NV	81.18	263	37,147	情報技術
AIRBUS SE	63.5	611	86,153	資本財・サービス
ARGENX SE	5.16	161	22,805	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	55.46	50	7,048	生活必需品
EXOR NV	10.88	65	9,252	金融
CNH INDUSTRIAL NV	116.91	145	20,518	資本財・サービス
STELLANTIS NV	264.95	330	46,549	一般消費財・サービス
FERRARI NV	14.99	243	34,328	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,359.6 32銘柄	7,962 <1.5%>	1,121,153
ユーロ (ベルギー)	百株	千ユーロ	千円	
UCB SA	15.5	122	17,245	ヘルスケア
KBC GROUP NV	30.11	162	22,901	金融
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11.39	90	12,787	金融
SOLVAY SA	8.73	75	10,661	素材
UMICORE	22.7	87	12,250	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	93.95	458	64,579	生活必需品
AGEAS	21.72	87	12,388	金融
D'IETTEREN GROUP	4.42	62	8,737	一般消費財・サービス
PROXIMUS	22.69	34	4,838	コミュニケーション・サービス
ELIA GROUP SA/NV	4.32	61	8,698	公益事業
SOFINA	1.46	28	4,080	金融
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	236.99 11銘柄	1,272 <0.2%>	179,171
ユーロ (ルクセンブルグ)	百株	千ユーロ	千円	
AROUNDTOWN SA	104.12	37	5,289	不動産
ARCELORMITTAL	74.77	193	27,303	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	14.8	115	16,220	ヘルスケア
TENARIS SA	47	67	9,559	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	240.69 4銘柄	414 <0.1%>	58,372
ユーロ (フランス)	百株	千ユーロ	千円	
TOTALENERGIES SE	281.13	1,520	214,065	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	21.46	233	32,814	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	60.69	819	115,342	素材
KERING	8.26	405	57,138	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	58.24	681	95,925	資本財・サービス
BOUYGUES SA	27.21	82	11,600	資本財・サービス
BNP PARIBAS	122.39	579	81,570	金融
THALES SA	13.06	148	20,870	資本財・サービス
DANONE	69.56	359	50,674	生活必需品
CARREFOUR SA	72.48	136	19,150	生活必需品
VIVENDI	89.3	97	13,717	コミュニケーション・サービス
L'OREAL	27.26	822	115,779	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	60.93	293	41,384	資本財・サービス
LEGRAND SA	39.4	284	40,053	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA	23.02	389	54,873	生活必需品
EURAZEO SE	4	25	3,624	金融
SOCIETE GENERALE SA	97.9	219	30,897	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	31.39	1,707	240,432	一般消費財・サービス
ACCOR SA	18.5	50	7,095	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	19.19	318	44,784	情報技術
VALEO SA	28.67	54	7,621	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	29.18	134	18,936	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA	32.27	80	11,381	資本財・サービス
EIFFAGE	9.45	82	11,676	資本財・サービス

銘 柄	2022年6月15日現在			業 種 等
	株 数	評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	百株	千ユーロ	千円	
SODEXO SA	10.85	71	10,049	一般消費財・サービス
IPSEN	2.76	23	3,283	ヘルスケア
AMUNDI SA	10.05	47	6,732	金融
TELEPERFORMANCE	7.01	195	27,567	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	9.77	43	6,060	コミュニケーション・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	3.14	93	13,099	ヘルスケア
SEB SA	2.16	19	2,724	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA	30.3	407	57,380	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA	2.2	34	4,804	資本財・サービス
WORLDLINE SA	31.35	102	14,363	情報技術
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	8.78	28	3,968	一般消費財・サービス
AXA SA	216.72	485	68,321	金融
EDENRED	30.07	128	18,087	情報技術
RENAULT SA	20.44	49	6,979	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	3.39	332	46,814	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	2.53	38	5,439	生活必需品
DASSAULT SYSTEMES SE	81.65	273	38,506	情報技術
WENDEL	3.31	28	4,008	金融
ORANGE	241.19	261	36,886	コミュニケーション・サービス
ALSTOM	36.68	91	12,916	資本財・サービス
SANOFI	130.43	1,227	172,902	ヘルスケア
VINCI SA	58.02	485	68,368	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT	78.49	184	25,970	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA	146.09	129	18,169	金融
BIOMERIEUX	4.57	39	5,506	ヘルスケア
ENGIE	217.58	260	36,633	公益事業
EDF	67.6	55	7,766	公益事業
SAFRAN SA	36.41	322	45,472	資本財・サービス
ARKEMA	7.31	71	10,018	素材
ADP	3.5	42	6,031	資本財・サービス
GETLINK SE	49.73	84	11,847	資本財・サービス
BOLLORE	73	34	4,882	コミュニケーション・サービス
小 計	2,872.02	15,220	2,142,977	
国 別	56銘柄		<3.0%>	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ドイツ)				
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	50.55	138	19,473	資本財・サービス
BAYER AG-REG	106.07	674	94,999	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG	44.31	109	15,428	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	243.43	225	31,724	金融
COMMERZBANK AG	96.89	72	10,261	金融
VOLKSWAGEN AG	4.2	80	11,321	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF	19.7	283	39,986	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG	88.86	970	136,650	資本財・サービス
E. ON SE	271.11	246	34,698	公益事業
UNIPER SE	11.92	24	3,460	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	35.27	273	38,541	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG	19.08	66	9,332	資本財・サービス
CONTINENTAL AG	14.74	104	14,656	一般消費財・サービス
BASF SE	99.78	482	67,983	素材
ALLIANZ SE-REG	44.59	811	114,302	金融
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	21.41	125	17,719	生活必需品
RHEINMETALL AG	6.25	129	18,189	資本財・サービス
RWE AG	75.26	287	40,447	公益事業
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	66.13	37	5,318	資本財・サービス
BRENTAG SE	18.93	133	18,865	資本財・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	48.35	143	20,171	ヘルスケア
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9.59	27	3,860	コミュニケーション・サービス
SAP SE	119.87	1,042	146,852	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	15.44	338	47,696	金融
ZALANDO SE	28.56	79	11,126	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	17.72	88	12,395	素材
KION GROUP AG	6	23	3,320	資本財・サービス
COVESTRO AG	19.45	77	10,844	素材
RATIONAL AG	0.74	42	6,043	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	3.1	97	13,744	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	17.4	119	16,772	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	21.48	68	9,626	一般消費財・サービス
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	5.6	63	8,890	ヘルスケア
BECHTLE AG	8.19	29	4,215	情報技術
NEMETSCHKE SE	7.89	45	6,383	情報技術
SCOUT24 AG	10.83	57	8,026	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	34.61	172	24,248	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	9.26	53	7,585	資本財・サービス
HELLOFRESH SE	18.14	52	7,386	生活必需品
SIEMENS ENERGY AG	47.32	73	10,397	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	12.75	118	16,702	生活必需品
MERCK KGAA	15.64	255	35,993	ヘルスケア

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	20.45	336	47,376	一般消費財・サービス
PUMA SE	12.95	85	12,052	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	13.11	76	10,789	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	349.87	623	87,774	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	25.61	129	18,195	ヘルスケア
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	93.01	579	81,573	一般消費財・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	140.76	341	48,100	情報技術
HANNOVER RUECK SE	6.44	89	12,626	金融
DEUTSCHE POST AG-REG	108.78	376	52,963	資本財・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	20.99	318	44,877	金融
MTU AERO ENGINES AG	6.66	112	15,824	資本財・サービス
SYMRISE AG	16.56	158	22,318	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	62.4	17	2,442	コミュニケーション・サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	7.33	52	7,420	一般消費財・サービス
VONOVIA SE	80.41	254	35,799	不動産
LEG IMMOBILIEN SE	8.69	72	10,175	不動産
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,790.43 58銘柄	11,974 <2.3%>	
		百株	千ユーロ	千円
ユーロ (ポルトガル)				
JERONIMO MARTINS	29	54	7,684	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	359.64	161	22,726	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	61.35	77	10,901	エネルギー
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	449.99 3銘柄	293 <0.1%>	
		百株	千ユーロ	千円
ユーロ (スペイン)				
TELEFONICA SA	644.91	284	40,035	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA	37.6	71	10,103	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	722.68	303	42,675	金融
IBERDROLA SA	638.68	630	88,775	公益事業
REPSOL SA	172.83	265	37,341	エネルギー
GRIFOLS SA	27.95	49	6,932	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	1,859.13	487	68,661	金融
AMADEUS IT GROUP SA	54	273	38,533	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA	27.21	73	10,370	公益事業
CAIXABANK SA	670.15	215	30,354	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	29.53	70	9,987	資本財・サービス
AENA SME SA	8.66	113	15,991	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA	74.19	263	37,062	コミュニケーション・サービス
ACCIONA SA	3.53	62	8,807	公益事業
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	118.36	266	37,513	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	32.93	58	8,306	資本財・サービス
ENAGAS SA	32.18	67	9,478	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	51.47	92	13,019	公益事業
FERROVIAL SA	60.55	140	19,838	資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA	30.29	65	9,229	公益事業
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,296.83 20銘柄	3,856 <0.7%>	
		百株	千ユーロ	千円
ユーロ (イタリア)				
PRYSMIAN SPA	29.49	81	11,493	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	129.44	200	28,276	金融
MEDIOBANCA SPA	83.45	74	10,525	金融
UNICREDIT SPA	255.29	248	34,920	金融
TELECOM ITALIA SPA	1,085.03	26	3,790	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO	1,761.98	311	43,911	金融
ATLANTIA SPA	60.27	133	18,864	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	77.27	70	9,920	金融
MONCLER SPA	24.35	93	13,158	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	12.85	48	6,799	ヘルスケア
ENI SPA	272.08	358	50,452	エネルギー
DIASORIN SPA	2.77	30	4,348	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	24.14	22	3,141	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA	65.11	47	6,701	情報技術
AMPLIFON SPA	14.4	37	5,346	ヘルスケア
ENEL SPA	887.93	473	66,673	公益事業
SNAM SPA	243	123	17,394	公益事業
TERNA SPA	158.15	114	16,094	公益事業
FINECOBANK SPA	80.77	83	11,753	金融
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	5,267.77 19銘柄	2,582 <0.5%>	
		百株	千ユーロ	千円
ユーロ (フィンランド)				
UPM-KYMMENE OYJ	65.25	199	28,122	素材
NOKIA OYJ	627.53	283	39,937	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	41.16	29	4,186	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	69.84	108	15,325	素材
ELISA OYJ	17.34	91	12,822	コミュニケーション・サービス

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
SAMPO OYJ-A SHS	58.26	236	33,304	金融
FORTUM OYJ	44	72	10,268	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	34.7	75	10,699	生活必需品
KONE OYJ-B	37.96	169	23,912	資本財・サービス
NESTE OYJ	49.41	207	29,170	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	17.63	64	9,067	ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,063.08 11銘柄	1,539 <0.3%>	
ユーロ (オーストリア)	株数	千ユーロ	千円	
VERBUND AG	8.76	82	11,624	公益事業
OMV AG	20.56	100	14,095	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	34.89	92	12,983	金融
VOESTALPINE AG	13.23	33	4,761	素材
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	77.44 4銘柄	308 <0.1%>	
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	20,822.3 223銘柄	46,262 <9.0%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	126,137.82 1,213銘柄	— <95.9%>	

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	口数	2022年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.606	297	40,154
SIMON PROPERTY GROUP INC	3.755	362	48,926
BOSTON PROPERTIES INC	1.658	150	20,289
VORNADO REALTY TRUST	2.128	61	8,320
SBA COMMUNICATIONS CORP	1.216	361	48,768
EQUITY RESIDENTIAL	4.032	277	37,441
EQUINIX INC	1.021	631	85,258
AMERICAN TOWER CORP	5.381	1,261	170,354
HOST HOTELS & RESORTS INC	10.529	180	24,421
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	4.335	142	19,278
KIMCO REALTY CORP	7.054	135	18,285
INVITATION HOMES INC	6.976	234	31,673
VICI PROPERTIES INC	12.524	352	47,564
VENTAS INC	4.401	213	28,776
WEYERHAEUSER CO	8.683	298	40,350
CROWN CASTLE INTL CORP	4.914	776	104,770
IRON MOUNTAIN INC	3.474	164	22,175
SUN COMMUNITIES INC	1.35	203	27,529
PROLOGIS INC	8.288	917	123,824
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2.091	283	38,215
CAMDEN PROPERTY TRUST	1.177	148	20,022
DUKE REALTY CORP	4.262	218	29,461
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.771	197	26,669
WELLTOWER INC	4.901	379	51,247
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6.434	150	20,361
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1.326	212	28,649
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1.95	133	18,078
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15.632	92	12,494
REALTY INCOME CORP	7.325	459	62,096
PUBLIC STORAGE	1.784	531	71,737
REGENCY CENTERS CORP	1.939	109	14,816
UDR INC	3.7	156	21,140
WP CAREY INC	2.131	172	23,295
DIGITAL REALTY TRUST INC	3.174	395	53,380
EXTRA SPACE STORAGE INC	1.575	250	33,754
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	6.944	103	14,006
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	160.441 36銘柄	11,018 <2.1%>
(カナダ)	千口	千カナダ・ドル	千円
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.831	36	3,825
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1.4	28	2,933
カナダ・ドル通貨計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	2.231 2銘柄	64 <0.0%>

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘 柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千円	千オーストラリア・ドル	千円
(オーストラリア)			
DEXUS/AU	13,949	126	11,778
LENDLEASE GROUP	8,477	81	7,607
TRANSURBAN GROUP	40,411	564	52,558
APA GROUP	14,243	163	15,249
SCENTRE GROUP	64,017	163	15,197
GPT GROUP	21,774	90	8,432
MIRVAC GROUP	43,513	89	8,304
STOCKLAND	18,729	67	6,277
GOODMAN GROUP	20,198	361	33,678
VICINITY CENTRES	50,371	87	8,183
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	295,682 10 銘柄	1,796 <0.2%>
(香港)			
LINK REIT	26	1,778	30,588
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	33	252	4,336
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	54	578	9,956
香港・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	113 3 銘柄	2,609 <0.1%>
(シンガポール)			
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	30.5	83	8,131
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	56,826	120	11,679
MAPLE TREE LOGISTICS TRUST	46	74	7,224
MAPLE TREE COMMERCIAL TRUST	37.6	66	6,415
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	170,926 4 銘柄	345 <0.0%>
(イギリス)			
LAND SECURITIES GROUP PLC	8,969	65	10,643
SEGRO PLC	11,371	108	17,611
BRITISH LAND CO PLC	9,799	49	8,052
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	30,139 3 銘柄	223 <0.1%>
ユーロ (ベルギー)			
WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,198	67	9,519
国 小 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,198 1 銘柄	67 <0.0%>
ユーロ (フランス)			
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,507	80	11,351
GECINA SA	0,578	55	7,788
KLEPIERRE	2,394	45	6,343
COVIVIO	0,353	20	2,818
国 小 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	4,832 4 銘柄	201 <0.0%>
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	7.03 5 銘柄	268 <0.1%>
合 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	779,449 63 銘柄	— <2.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘 柄 別	2022年6月15日現在	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
外		
S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	3,307	—
S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	122	—
SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	91	—
FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	196	—
国		
SWISS MKT IX FUTR (ドイツ)	158	—
EURO STOXX 50 (ドイツ)	477	—

(注1) 外貨建の評価額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

運用報告書 第14期 (決算日 2022年1月11日)

(作成対象期間 2021年1月13日～2022年1月11日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント

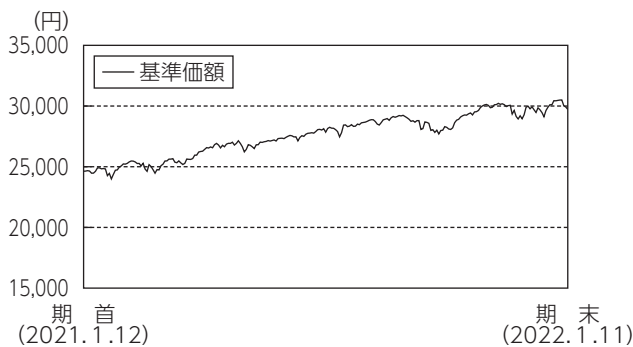
Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		MSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)		株式組入率	株式先比率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率			
(期首)2021年1月12日	24,628	—	18,522	—	91.1	7.9	2.0
2021年1月末	24,448	△ 0.7	18,380	△ 0.8	91.1	6.3	2.2
2月末	24,805	0.7	18,622	0.5	94.5	4.9	2.2
3月末	25,602	4.0	19,179	3.5	97.5	3.3	2.3
4月末	27,019	9.7	20,212	9.1	94.2	2.9	2.3
5月末	27,153	10.3	20,267	9.4	94.8	3.7	2.3
6月末	27,802	12.9	20,733	11.9	93.7	4.3	2.3
7月末	28,466	15.6	21,213	14.5	92.1	4.4	2.3
8月末	29,136	18.3	21,674	17.0	91.2	6.5	2.2
9月末	28,052	13.9	20,838	12.5	94.3	4.9	2.3
10月末	29,513	19.8	21,908	18.3	94.0	5.8	2.3
11月末	29,636	20.3	21,970	18.6	93.0	3.7	2.3
12月末	30,465	23.7	22,559	21.8	93.4	5.7	2.4
(期末)2022年1月11日	29,723	20.7	21,997	18.8	94.4	3.3	2.4

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：24,628円 期末：29,723円 騰落率：20.7%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行った結果、新型コロナウイルスのワクチン接種の進捗などを好感して海外株式市況が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○先進国株式市況

先進国株式市況は上昇しました。

先進国株式市況は、当作成期首より、米国や英国における新型コロナウイルスのワクチン接種の開始などを受け、上昇しました。2021年2月以降は、米国において新規感染者数の減少傾向が鮮明となったことに加え、ワクチン接種が着実に進んでいることが投資家心理を改善させ、上昇基調となりました。9月に入ると、米国や中国における経済指標の悪化をきっかけに軟調となり、その後も中国の大手不動産会社の資金繰り問題や米国の債務上限問題、米国金利の上昇に対する警戒感など複数のリスク要因が嫌気され、株価は下落しました。10月中旬以降は、米国の債務上限の一時引き上げが決定されたことなどが好感されて反発し、堅調に推移しました。11月下旬には南アフリカでウイルスの新変異株であるオミクロン株が確認されたことが嫌気され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、リスクモデルを利用して外国株式(投資信託証券、株式先物を含む。)等のポートフォリオを構築し、また保有実質外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、基準価額とベンチマークとの連動性を維持・向上させるよう運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は18.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は20.7%となりました。

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

*ベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ヘッジ・ベース)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	1円
(株式)	(1)
(先物・オプション)	(0)
(投資信託証券)	(0)
有価証券取引税	0
(株式)	(0)
(投資信託証券)	(0)
その他費用	8
(保管費用)	(4)
(その他)	(4)
合計	9

(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1月13日から2022年1月11日まで)

	買		付		売		付	
	株数	金額	株数	金額	株数	金額	株数	金額
外	アメリカ	百株 2,529.02 (△ 260.83)	千アメリカ・ドル 27,716 (△ 702)	百株 3,244.57	千アメリカ・ドル 36,904	百株	千アメリカ・ドル	
	カナダ	百株 483.49 (99.36)	千カナダ・ドル 2,316 (212)	百株 702.42	千カナダ・ドル 2,409	百株	千カナダ・ドル	
	オーストラリア	百株 320.69 (58.3)	千オーストラリア・ドル 841 (△ 48)	百株 617.54	千オーストラリア・ドル 663	百株	千オーストラリア・ドル	
	香港	百株 1,090 (81.91)	千香港ドル 2,190 (△ 22)	百株 1,388	千香港ドル 2,829	百株	千香港ドル	
	シンガポール	百株 50 (370.97)	千シンガポール・ドル 128 (△ 34)	百株 510.97	千シンガポール・ドル 295	百株	千シンガポール・ドル	
	ニュージーランド	百株 - (-)	千ニュージーランド・ドル - (-)	百株 70	千ニュージーランド・ドル 42	百株	千ニュージーランド・ドル	
	イギリス	百株 1,632.56 (△ 595.44)	千イギリス・ポンド 977 (△ 206)	百株 2,255.52	千イギリス・ポンド 1,419	百株	千イギリス・ポンド	
	イスラエル	百株 - (-)	千イスラエル・シケル - (-)	百株 20	千イスラエル・シケル 196	百株	千イスラエル・シケル	
	スイス	百株 32.88 (-)	千スイス・フラン 807 (△ 30)	百株 121.39	千スイス・フラン 1,104	百株	千スイス・フラン	
	デンマーク	百株 45.94 (102.28)	千デンマーク・クローネ 716 (-)	百株 56.48	千デンマーク・クローネ 2,648	百株	千デンマーク・クローネ	
	ノルウェー	百株 30.67 (-)	千ノルウェー・クローネ 1,182 (-)	百株 27.83	千ノルウェー・クローネ 775	百株	千ノルウェー・クローネ	
	スウェーデン	百株 338.93 (1,035.13)	千スウェーデン・クローネ 8,970 (-)	百株 679.14	千スウェーデン・クローネ 8,392	百株	千スウェーデン・クローネ	
	ユーロ (アイルランド)	百株 8.28 (-)	千ユーロ 80 (-)	百株 20.76	千ユーロ 162	百株	千ユーロ	
	ユーロ (オランダ)	百株 240.31 (112.9)	千ユーロ 1,378 (△ 62)	百株 481.66	千ユーロ 1,036	百株	千ユーロ	
	ユーロ (ベルギー)	百株 - (-)	千ユーロ - (-)	百株 15.07	千ユーロ 85	百株	千ユーロ	
ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 57.91 (-)	千ユーロ 87 (-)	百株 70.11	千ユーロ 66	百株	千ユーロ		
ユーロ (フランス)	百株 49.15 (1.91)	千ユーロ 582 (△ 58)	百株 221.3	千ユーロ 1,414	百株	千ユーロ		
ユーロ (ドイツ)	百株 108.81 (153.04)	千ユーロ 616 (△ 32)	百株 328.33	千ユーロ 1,307	百株	千ユーロ		
ユーロ (ポルトガル)	百株 169.85 (-)	千ユーロ 79 (-)	百株 85.97	千ユーロ 41	百株	千ユーロ		
ユーロ (スペイン)	百株 269.49 (3,614.69)	千ユーロ 342 (61)	百株 3,168.18	千ユーロ 304	百株	千ユーロ		
ユーロ (イタリア)	百株 45.25 (-)	千ユーロ 79 (△ 0)	百株 817.2	千ユーロ 207	百株	千ユーロ		
ユーロ (フィンランド)	百株 22.35 (-)	千ユーロ 78 (-)	百株 38.62	千ユーロ 133	百株	千ユーロ		
ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 971.4 (3,882.54)	千ユーロ 3,325 (△ 92)	百株 5,247.2	千ユーロ 4,758	百株	千ユーロ		

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

(2) 投資信託証券

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

		買		付		売		付	
		□ 数	金 額	□ 数	金 額	□ 数	金 額	□ 数	金 額
外	アメリカ	千口 6.081 (△ 0.155)	千アメリカ・ドル 382 (-)	千口 15.238 (-)	千アメリカ・ドル 876 (-)	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
	オーストラリア	千口 27.011 (3.711)	千オーストラリア・ドル 256 (-)	千口 10.674 (-)	千オーストラリア・ドル 61 (-)	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
	香港	千口 - (-)	千香港ドル - (-)	千口 6 (-)	千香港ドル 421 (-)	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
国	シンガポール	千口 - (5.166)	千シンガポール・ドル - (6)	千口 26 (-)	千シンガポール・ドル 36 (-)	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル

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

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2021年1月13日から2022年1月11日まで)

種 類 別	買		建		売		建	
	新規買付額	決 済 額	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国 株式先物取引	百万円 25,850	百万円 -	百万円 29,410	百万円 -	百万円 -	百万円 -	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1月13日から2022年1月11日まで)

銘 柄	当				期			
	買	付	株数	金額	買	付	株数	金額
AMAZON.COM INC (アメリカ)	0.523	203,757	389,593	円	21.313	315,537	14,804	円
TESLA INC (アメリカ)	1.477	135,224	91,553	円	7.183	214,856	29,911	円
APPLE INC (アメリカ)	5.422	92,141	16,993	円	0.55	141,838	257,888	円
MICROSOFT CORP (アメリカ)	2.5	84,468	33,787	円	0.37	135,438	366,050	円
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	0.281	75,780	269,679	円	2.255	77,877	34,535	円
SNOWFLAKE INC-CLASS A (アメリカ)	2.091	71,227	34,063	円	0.287	74,208	258,565	円
SEA LTD-ADR (ケイマン諸島)	1.7	59,641	35,082	円	0.668	60,233	90,170	円
AIRBNB INC-CLASS A (アメリカ)	2.931	57,800	19,720	円	3.155	55,500	17,591	円
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A (アメリカ)	19.77	55,009	2,782	円	2.652	52,988	19,980	円
PROSUS NV (オランダ)	5.3	49,511	9,341	円	5.72	52,828	9,235	円

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

外国株式インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
SAP SE	130.66	122.83	1,483	193,834	情報技術
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	17.04	17.04	464	60,655	金融
ZALANDO SE	20.25	28.56	184	24,076	一般消費財・サービス
HEIDELBERGCEMENT AG	21.28	21.28	132	17,316	素材
KION GROUP AG	6	6	55	7,289	資本財・サービス
COVESTRO AG	19.45	19.45	109	14,301	素材
RATIONAL AG	-	0.74	59	7,791	資本財・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	5.13	3.88	191	25,092	ヘルスケア
PORSCHE AUTOMOBIL HDG-PRF	21.02	21.02	187	24,456	一般消費財・サービス
DELIVERY HERO SE	19.79	21.48	176	23,004	一般消費財・サービス
CARI ZEISS MEDITEC AG - BR	5.6	5.6	89	11,674	ヘルスケア
BECHTLE AG	2.73	8.19	46	6,092	情報技術
NEMETSCHKE SE	11.39	11.39	101	13,243	情報技術
SCOUT24 AG	14.6	14.6	87	11,449	コミュニケーション・サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG	40.38	28.94	176	23,065	ヘルスケア
KNORR-BREMSE AG	5.49	13.57	119	15,565	資本財・サービス
HELLOFRESH SE	18.14	18.14	102	13,433	生活必需品
TEAMVIEWER AG	14.61	-	-	-	情報技術
SIEMENS ENERGY AG	47.32	47.32	104	13,637	資本財・サービス
BEIERSDORF AG	12.75	12.75	113	14,801	生活必需品
FUCHS PETROLUB PREF	7	7	27	3,615	素材
MERCK KGAA	16.92	16.92	335	43,819	ヘルスケア
ADIDAS AG	23.85	21.88	534	69,848	一般消費財・サービス
PUMA SE	12.95	12.95	125	16,444	一般消費財・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	13.11	13.11	93	12,268	生活必需品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	418.6	411.35	638	83,483	コミュニケーション・サービス
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	25.61	25.61	147	19,300	ヘルスケア
INFINEON TECHNOLOGIES AG	110.27	101.1	738	96,526	一般消費財・サービス
HANNOVER RUECK SE	164.97	155.1	597	78,126	情報技術
DEUTSCHE POST AG-REG	6.44	6.44	112	14,675	金融
DEUTSCHE BOERSE AG	131.16	116.91	625	81,764	資本財・サービス
LANXESS AG	24.04	24.04	352	46,124	金融
MTU AERO ENGINES AG	15.29	15.29	87	11,470	素材
DEUTSCHE WOHNEN SE	6.66	6.66	128	16,756	資本財・サービス
SYMRISE AG	47.96	-	-	-	不動産
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	16.56	16.56	199	26,113	素材
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	62.4	62.4	15	2,012	コミュニケーション・サービス
VONOVIA SE	9	9	73	9,586	一般消費財・サービス
LEG IMMOBILIEN SE	71.86	80.41	375	49,121	不動産
国小計	2,998.98	2,932.5	16,069	2,100,220	
ユーロ (ポルトガル)	株数、金額 60銘柄数<比率>	299.25 59銘柄	16,069	2,100,220	< 2.5%>
JERONIMO MARTINS	29	29	59	7,732	生活必需品
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	275.76	359.64	161	21,091	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA	71.83	71.83	67	8,856	エネルギー
国小計	株数、金額 3銘柄数<比率>	376.59 3銘柄	288	37,680	< 0.0%>
ユーロ (スペイン)	株数、金額 18銘柄数<比率>	5,543.3 20銘柄	4,296	561,610	< 0.7%>
IBERDROLA RIGHTS SA	-	720.39	11	1,562	公益事業
TELEFONICA SA	570.39	644.91	259	33,918	コミュニケーション・サービス
ENDESA SA	37.6	37.6	72	9,496	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	951.66	835.83	466	60,924	金融
IBERDROLA SA	720.39	720.39	721	94,343	公益事業
REPSOL SA	176.85	176.85	190	24,917	エネルギー
GRIFOLS SA	51.14	27.95	46	6,045	ヘルスケア
BANCO SANTANDER SA	2,073.7	2,073.7	646	84,440	金融
AMADEUS IT GROUP SA	54	54	335	43,814	情報技術
NATURGY ENERGY GROUP SA	39.78	39.78	114	14,932	公益事業
CAIXABANK SA	468.59	468.59	126	16,487	金融
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	35.83	35.83	86	11,323	資本財・サービス
AENA SME SA	8.66	8.66	126	16,479	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA	45.46	65.12	273	35,746	コミュニケーション・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	142.55	124.17	343	44,921	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	17.93	32.93	64	8,373	資本財・サービス
ENAGAS SA	36.75	36.75	73	9,544	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA	51.47	51.47	91	12,011	公益事業
FERRIVAL SA	60.55	60.55	162	21,240	資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA	-	43.83	84	11,084	公益事業
国小計	株数、金額 18銘柄数<比率>	5,543.3 20銘柄	4,296	561,610	< 0.7%>
ユーロ (イタリア)	株数、金額 18銘柄数<比率>	5,543.3 20銘柄	4,296	561,610	< 0.7%>
PRYSMIAN SPA	41.45	41.45	136	17,796	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	159.85	129.44	238	31,230	金融
MEDIOBANCA SPA	99.71	99.71	103	13,520	金融
UNICREDIT SPA	294.71	294.71	419	54,781	金融
TELECOM ITALIA SPA	1,085.03	1,085.03	48	6,374	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP	483.81	-	-	-	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO	2,135.25	1,910.98	470	61,517	金融
ATLANTIA SPA	60.27	60.27	99	13,009	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	77.27	77.27	90	11,780	金融
MONCLER SPA	24.35	24.35	147	19,292	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	12.85	12.85	69	9,082	ヘルスケア
ENI SPA	360.61	281.9	357	46,733	エネルギー
DIASORIN SPA	2.77	2.77	41	5,361	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	24.14	24.14	23	3,103	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA	35.53	80.78	108	14,115	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
AMPLIFON SPA	17.5	17.5	72	9,528	ヘルスケア
ENEL SPA	983.37	983.37	681	89,068	公益事業
SNAM SPA	243	243	125	16,400	公益事業
TERNA SPA	199	199	136	17,837	公益事業
FINECOBANK SPA	59.72	59.72	90	11,864	金融
国小計	株数、金額 20銘柄数<比率>	6,400.19 19銘柄	3,461	452,400	< 0.5%>
ユーロ (フィンランド)	株数、金額 5銘柄数<比率>	65.25 5銘柄	1,132.8	254,548	< 0.3%>
UPM-KYMMENE OYJ	65.25	65.25	221	29,004	素材
NOKIA OYJ	652.61	652.61	355	46,486	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	41.16	41.16	51	6,708	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	88.53	88.53	146	19,149	素材
ELISA OYJ	17.34	17.34	91	11,979	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS	68.09	68.09	300	39,290	金融
FORTUM OYJ	44	44	111	14,509	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	51.25	42.45	118	15,435	生活必需品
KONE OYJ-B	45.43	37.96	233	30,581	資本財・サービス
NESTE OYJ	57.78	57.78	254	33,296	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	17.63	17.63	62	8,106	ヘルスケア
国小計	株数、金額 11銘柄数<比率>	1,149.07 5銘柄	1,132.8	254,548	< 0.3%>
ユーロ (オーストリア)	株数、金額 5銘柄数<比率>	12.16 5銘柄	415	54,321	< 0.1%>
VERBUND AG	12.16	12.16	112	14,701	公益事業
OMV AG	12.09	12.09	65	8,542	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	34.89	34.89	148	19,407	金融
VOESTALPINE AG	18	18	61	7,975	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	11	11	28	3,694	金融
国小計	株数、金額 5銘柄数<比率>	88.14 5銘柄	415	54,321	< 0.1%>
ユーロ通貨計	株数、金額 232銘柄数<比率>	23,170.73 229銘柄	22,777.47	7,859,935	< 9.5%>
ファンド合計	株数、金額 1,208銘柄数<比率>	134,609.2 1,227銘柄	131,967.94	78,078,463	< 9.4%>

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

ダイワファンドラップ 外国株式インデックス (為替ヘッジなし)

運用報告書(全体版)

第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日~2022年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、外国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、投資成果をMSCIコクサイ指数(円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。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。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2732>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (円ベース)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
2 期末 (2018年 6月15日)	円 13,931	円 0	% 13.9	13,533	% 12.0	% 96.1	% 1.5	% 2.4	百万円 3,307
3 期末 (2019年 6月17日)	14,011	0	0.6	13,342	△ 1.4	95.8	1.3	2.9	4,523
4 期末 (2020年 6月15日)	14,231	0	1.6	13,353	0.1	96.5	0.6	2.7	5,717
5 期末 (2021年 6月15日)	20,848	0	46.5	19,329	44.8	91.8	5.9	2.3	9,292
6 期末 (2022年 6月15日)	21,770	0	4.4	19,916	3.0	94.1	3.4	2.4	10,844

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

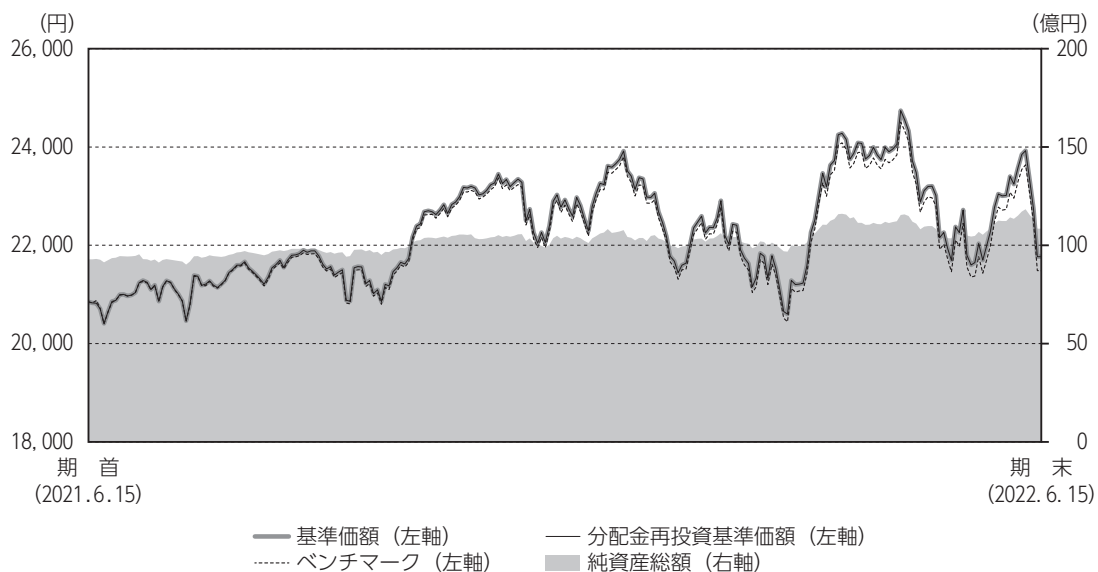
(注6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注7) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

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

* ベンチマークはMSCIコクサイ指数 (円ベース) です。

■ 基準価額・騰落率

期首：20,848円

期末：21,770円 (分配金0円)

騰落率：4.4% (分配金込み)

■基準価額の主な変動要因

「外国株式インデックスマザーファンド」の受益証券を通じて、ベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行った結果、海外株式市況は下落した一方、為替相場が円安となったことにより、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		M S C I コクサイ指数 (円ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期首) 2021年 6月15日	20,848	—	19,329	—	91.8	5.9	2.3
6月末	20,990	0.7	19,456	0.7	91.0	6.7	2.2
7月末	21,278	2.1	19,719	2.0	92.0	5.7	2.2
8月末	21,797	4.6	20,171	4.4	91.2	6.8	2.2
9月末	21,283	2.1	19,677	1.8	92.2	5.6	2.2
10月末	22,832	9.5	21,100	9.2	92.0	5.8	2.3
11月末	22,737	9.1	20,978	8.5	91.4	6.5	2.2
12月末	23,658	13.5	21,823	12.9	92.8	4.8	2.4
2022年 1月末	21,995	5.5	20,280	4.9	92.1	5.7	2.3
2月末	21,839	4.8	20,129	4.1	91.1	6.4	2.2
3月末	24,156	15.9	22,214	14.9	93.0	4.5	2.4
4月末	23,115	10.9	21,216	9.8	92.3	5.2	2.6
5月末	23,044	10.5	21,115	9.2	90.6	7.1	2.4
(期末) 2022年 6月15日	21,770	4.4	19,916	3.0	94.1	3.4	2.4

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■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、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展により経済活動の正常化が順次進んだことや、好調な経済指標の発表などから上昇しました。2021年9月には、中国の大手不動産会社の資金繰り問題や米国の債務上限問題、米国金利上昇に対する警戒感など複数のリスク要因が嫌気され、軟調な推移となりました。2022年に入ると、2021年12月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）議事録を受け、米国の金融引き締めに対する懸念が高まり下落しました。2月以降は、欧米中央銀行高官の金融政策に対する発言やロシアのウクライナへの侵攻、ロシアとウクライナの断片的な停戦協定による状況改善期待などから、一進一退の展開となりました。その後は、FRB（米国連邦準備制度理事会）の利上げペースが一層加速するとの懸念などから下落し、当作成期末を迎えました。

■為替相場

為替相場は円安となりました。

当作成期首より、米ドル円は比較的狭いレンジでの推移となりましたが、2021年9月以降は米国金利が上がったことにより上昇（円安）しました。その後2022年に入ってから、期待インフレ率の上昇などにより米国金利がさらに上がったため、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、その他の通貨も対円で上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに円安が進みました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

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

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

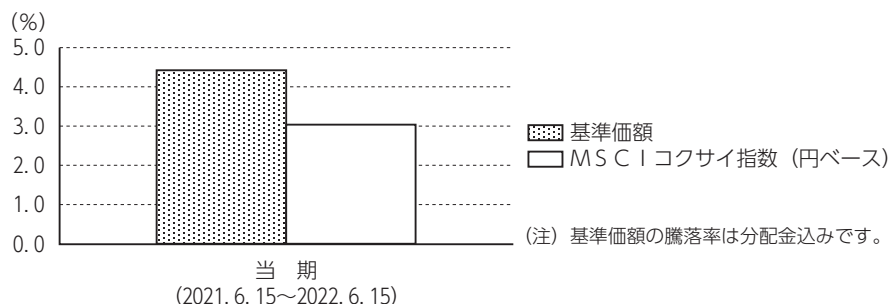
組入ファンド	ベンチマーク
外国株式インデックスマザーファンド	M S C I コクサイ指数 (円ベース)

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4.4%となりました。

マザーファンドにおいて保有している株式等の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークには配当分が含まれていないことが、かい離要因となりました。その他、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) です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、収益分配を見送らせていただきました。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	11,769

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

1万口当りの費用の明細

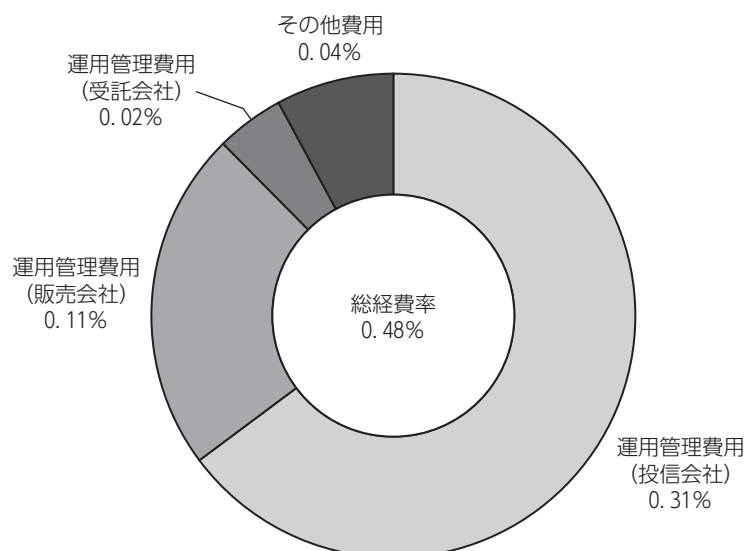
項目	当期 (2021. 6. 16~2022. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	99円	0.445%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は22,270円です。
(投信会社)	(70)	(0.313)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(24)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(5)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0.004	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(1)	(0.002)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.005	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.005)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	8	0.038	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保管費用)	(4)	(0.019)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(3)	(0.013)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	110	0.492	

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

参考情報

■総経費率

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



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

■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6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式 インデックス マザーファンド	805, 143	3, 266, 507	526, 709	2, 157, 905

(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6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期	
	外国株式インデックスマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	39, 447, 732千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	229, 720, 983千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0. 17	

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
外国株式インデックス マザーファンド	2, 470, 931	2, 749, 365	10, 844, 049	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国株式インデックス マザーファンド	10, 844, 049	99. 8
コール・ローン等、その他	24, 676	0. 2
投資信託財産総額	10, 868, 725	100. 0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.01円、1カナダ・ドル=104.20円、1オーストラリア・ドル=93.10円、1香港・ドル=17.20円、1シンガポール・ドル=96.95円、1ニュージーランド・ドル=83.95円、1イギリス・ポンド=162.21円、1イスラエル・シケル=38.942円、1スイス・フラン=135.01円、1デンマーク・クローネ=18.93円、1ノルウェー・クローネ=13.49円、1スウェーデン・クローネ=13.25円、1ユーロ=140.80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(254,328,525千円)の投資信託財産総額(257,632,004千円)に対する比率は、98.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	10, 868, 725, 245円
コール・ローン等	24, 571, 481
外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	10, 844, 049, 164
未収入金	104, 600
(B) 負債	23, 943, 803
未払信託報酬	23, 651, 883
その他未払費用	291, 920
(C) 純資産総額(A-B)	10, 844, 781, 442
元本	4, 981, 572, 692
次期繰越損益金	5, 863, 208, 750
(D) 受益権総口数	4, 981, 572, 692口
1万口当り基準価額(C/D)	21, 770円

* 期首における元本額は4,456,971,386円、当作成期間中における追加設定元本額は1,798,628,403円、同解約元本額は1,274,027,097円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は21,770円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3, 562円
受取利息	499
支払利息	△ 4, 061
(B) 有価証券売買損益	246, 323, 933
売買益	434, 311, 455
売買損	△ 187, 987, 522
(C) 信託報酬等	△ 46, 116, 734
(D) 当期損益金(A+B+C)	200, 203, 637
(E) 前期繰越損益金	1, 995, 014, 885
(F) 追加信託差損益金	3, 667, 990, 228
(配当等相当額)	(1, 667, 270, 995)
(売買損益相当額)	(2, 000, 719, 233)
(G) 合計(D+E+F)	5, 863, 208, 750
次期繰越損益金(G)	5, 863, 208, 750
追加信託差損益金	3, 667, 990, 228
(配当等相当額)	(1, 667, 270, 995)
(売買損益相当額)	(2, 000, 719, 233)
分配準備積立金	2, 195, 222, 084
繰越損益金	△ 3, 562

(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	200, 204, 820
(c) 収益調整金	3, 667, 990, 228
(d) 分配準備積立金	1, 995, 017, 264
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	5, 863, 212, 312
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	5, 863, 212, 312
(h) 受益権総口数	4, 981, 572, 692口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「外国株式インデックスマザーファンド」の決算日（2021年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在における外国株式インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を併せて掲載いたしました。

■外国株式インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
株 式

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
APPLE INC (アメリカ)	76.4	1,445,332	18,917	ALEXION PHARMACEUTICALS INC (アメリカ)	7.98	159,446	19,980
MICROSOFT CORP (アメリカ)	39.1	1,394,438	35,663	DEUTSCHE WOHNEN SE (ドイツ)	12.05	73,268	6,080
AMAZON.COM INC (アメリカ)	3.66	1,374,537	375,556	ORACLE CORP (アメリカ)	6	62,614	10,435
TESLA INC (アメリカ)	8.88	902,720	101,657	XPO LOGISTICS INC (アメリカ)	3.1	47,864	15,440
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	1.74	547,466	314,635	VIFOR PHARMA AG (スイス)	1.75	41,510	23,720
NVIDIA CORP (アメリカ)	13.85	437,993	31,624	AUTOLIV INC (アメリカ)	2.95	32,702	11,085
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	1.27	398,057	313,430	LAMB WESTON HOLDINGS INC (アメリカ)	5.45	32,540	5,970
META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)	10	328,517	32,851	RENAISSANCERE HOLDINGS LTD (バミューダ)	1.83	32,435	17,724
SEA LTD-ADR (ケイマン諸島)	14.3	325,630	22,771	SUEZ (フランス)	12.625	32,200	2,550
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	15.4	316,356	20,542	REINSURANCE GROUP OF AMERICA (アメリカ)	2.45	31,755	12,961

(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6月15日現在における外国株式インデックスマザーファンド（65,283,819千円）の内容です。

(1)外国株式

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業 種 等
		評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	47	631	85,295	情報技術
PALO ALTO NETWORKS INC	40	1,926	260,099	情報技術
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	74	1,000	135,044	情報技術
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	54	442	59,797	資本財・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	24	343	46,354	ヘルスケア
SYNCHRONY FINANCIAL	211	622	84,065	金融
ABBOTT LABORATORIES	714.66	7,356	993,229	ヘルスケア
HOWMET AEROSPACE INC	149.83	482	65,135	資本財・サービス
VERISK ANALYTICS INC	65	1,028	138,857	資本財・サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	139	448	60,559	一般消費財・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	243	1,592	214,987	情報技術
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	18	732	98,947	情報技術
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	247	2,352	317,634	情報技術
QORVO INC	44.2	427	57,681	情報技術
AFLAC INC	250	1,342	181,284	金融
DARDEN RESTAURANTS INC	51	581	78,515	一般消費財・サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	68	577	77,980	コミュニケーション・サービス
ADOBE INC	191.2	7,090	957,231	情報技術
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	84	783	105,753	素材
LULULEMON ATHLETICA INC	48	1,346	181,777	一般消費財・サービス
GARMIN LTD	63	609	82,266	一般消費財・サービス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	90	2,152	290,673	素材
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	278	5,095	687,900	資本財・サービス
WR BERKLEY CORP	86.42	576	77,869	金融
AUTOZONE INC	8.2	1,667	225,133	一般消費財・サービス
DOLLAR TREE INC	90.71	1,415	191,073	一般消費財・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	459	360	48,646	ヘルスケア
CELANESE CORP	44.5	606	81,834	素材
DR HORTON INC	136.16	894	120,812	一般消費財・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	89	316	42,764	ヘルスケア
AUTODESK INC	89	1,527	206,180	情報技術
MOODY'S CORP	68	1,752	236,567	金融
DEVON ENERGY CORP	256	1,807	243,977	エネルギー
ALBEMARLE CORP	47	1,049	141,713	素材
ATMOS ENERGY CORP	55	580	78,369	公益事業
ALLIANT ENERGY CORP	102	567	76,580	公益事業
CITIGROUP INC	804.73	3,698	499,339	金融
AUTOMATIC DATA PROCESSING	170	3,470	468,513	情報技術
AMERICAN ELECTRIC POWER	204	1,844	249,090	公益事業
ALLEGHANY CORP	5.2	432	58,410	金融
DOMINO'S PIZZA INC	15.3	577	77,901	一般消費財・サービス
HESS CORP	113	1,356	183,180	エネルギー
DAVITA INC	27.5	247	33,403	ヘルスケア
DANAHER CORP	276.5	6,702	904,960	ヘルスケア

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
FORTIVE CORP	138	773	104,466	資本財・サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	228	2,144	289,507	金融
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	228	1,884	254,477	生活必需品
BUNGE LTD	57	594	80,303	生活必需品
TE CONNECTIVITY LTD	131.95	1,562	210,906	情報技術
APPLE INC	6,611	87,767	11,849,508	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	114	1,046	141,352	金融
BOEING CO/THE	225	2,748	371,088	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	62.15	723	97,686	金融
BECTON DICKINSON AND CO	114.99	2,717	366,882	ヘルスケア
LEIDOS HOLDINGS INC	54	528	71,381	資本財・サービス
NISOURCE INC	165	455	61,483	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	51	542	73,227	資本財・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	307.71	1,249	168,668	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,703.04	8,372	1,130,323	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	523.5	14,534	1,962,296	金融
ANSYS INC	35	804	108,569	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	538.17	2,488	335,972	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	284	2,709	365,867	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	883	6,434	868,711	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	1,196.7	13,649	1,842,827	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	93	1,001	135,202	金融
LKQ CORP	108	524	70,747	一般消費財・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	126.12	821	110,950	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	112	1,605	216,821	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	45	1,093	147,675	金融
DOLLAR GENERAL CORP	94	2,162	291,917	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	81	3,602	486,370	情報技術
CATERPILLAR INC	217	4,485	605,543	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	97	530	71,582	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	94	393	53,098	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	20	419	56,569	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	117	731	98,757	公益事業
MOSAIC CO/THE	149	785	106,074	素材
DELTA AIR LINES INC	62	194	26,267	資本財・サービス
CORNING INC	326	1,046	141,282	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,684.5	7,228	975,877	情報技術
MORGAN STANLEY	541.52	4,059	548,037	金融
MSCI INC	33	1,290	174,203	金融
FAIR ISAAC CORP	11	417	56,346	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	13	254	34,311	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	94	536	72,414	情報技術
BROADCOM INC	166.12	8,641	1,166,630	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	49	654	88,330	ヘルスケア
ARAMARK	90	272	36,853	一般消費財・サービス
DTE ENERGY COMPANY	79	940	127,040	公益事業
CENTENE CORP	236.07	1,799	242,958	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	42	451	60,968	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	202	720	97,252	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	85	1,302	175,844	金融
GARTNER INC	33.5	785	106,105	情報技術
SPLUNK INC	63	544	73,548	情報技術
DOMINION ENERGY INC	329.41	2,457	331,773	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	161	1,417	191,412	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	53	294	39,813	資本財・サービス
DEERE & CO	118	3,853	520,280	資本財・サービス
QUANTA SERVICES INC	60	741	100,082	資本財・サービス
POOL CORP	16	559	75,484	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	112.84	1,265	170,855	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	85	1,031	139,225	情報技術
CABLE ONE INC	2	244	33,046	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	27	427	57,752	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	46	671	90,591	金融
VAIL RESORTS INC	16	369	49,869	一般消費財・サービス
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	209	249	33,634	コミュニケーション・サービス
TARGA RESOURCES CORP	90	596	80,560	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	28	369	49,903	金融
WESTLAKE CORP	16	182	24,705	素材
CONSOLIDATED EDISON INC	144	1,278	172,601	公益事業
COGNEX CORP	69	296	40,076	情報技術
WEBSTER FINANCIAL CORP	73	328	44,409	金融
TELEFLEX INC	19	479	64,773	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	34	548	74,097	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	30	841	113,655	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	9	422	57,104	ヘルスケア
CATALENT INC	69	719	97,153	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	56	1,004	135,575	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	24	628	84,793	ヘルスケア
IDEX CORP	31	556	75,088	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	324	2,406	324,881	生活必需品
ROLLINS INC	86.07	282	38,091	資本財・サービス

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
AMETEK INC	94	1,046	141,300	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	98	803	108,494	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	64.5	291	39,334	資本財・サービス
HEICO CORP	18	240	32,416	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	26	624	84,298	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	15	526	71,026	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	106	1,033	139,504	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	17	527	71,283	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	179.6	8,168	1,102,789	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	32.5	231	31,254	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	23	640	86,437	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	53	412	55,627	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	11	1,324	178,808	一般消費財・サービス
UGI CORP	85	337	45,570	公益事業
CUMMINS INC	58	1,140	153,957	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	316	2,358	318,437	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	55	893	120,665	情報技術
SIGNATURE BANK	25.5	454	61,301	金融
COSTAR GROUP INC	160	882	119,176	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	24	975	131,680	金融
AMERCO	4	185	25,078	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	40	957	129,323	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	17.9	1,103	148,964	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	30	531	71,734	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	113.16	1,348	182,018	一般消費財・サービス
DEXCOM INC	156	1,081	145,977	ヘルスケア
NORDSON CORP	20.9	419	56,665	資本財・サービス
COPART INC	87	901	121,675	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	68	1,017	137,370	エネルギー
SEAGEN INC	56	809	109,355	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	30	714	96,429	ヘルスケア
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	33	622	83,996	金融
TRANSDIGM GROUP INC	20.9	1,102	148,887	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	15.8	512	69,152	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	39	355	48,030	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	87	707	95,458	ヘルスケア
KINDER MORGAN INC	826.81	1,479	199,701	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	98	1,756	237,205	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	15	402	54,371	金融
COTERRA ENERGY INC	330	1,026	138,605	エネルギー
T-MOBILE US INC	253.27	3,163	427,082	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	67.5	203	27,512	不動産
COCA-COLA CO/THE	1,670.5	9,894	1,335,839	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	85	430	58,159	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	69.5	685	92,518	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	117	270	36,457	金融
CSX CORP	889	2,608	352,150	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	38	812	109,718	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	61.25	624	84,289	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	3,712	37,977	5,127,338	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	253	2,188	295,462	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,717.05	16,500	2,227,779	エネルギー
AES CORP	271	512	69,187	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	16	436	58,901	金融
EOG RESOURCES INC	237	3,110	419,997	エネルギー
EQT CORP	141	575	77,725	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	65	580	78,366	情報技術
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	5	311	42,038	金融
ABIOMED INC	18	413	55,811	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	64	903	122,014	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	122	1,415	191,082	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1,595.23	1,946	262,753	一般消費財・サービス
EXACT SCIENCES CORP	71	263	35,601	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	62.37	133	18,062	コミュニケーション・サービス
ENTEGRIS INC	55	543	73,334	情報技術
AERCAP HOLDINGS NV	56	221	29,962	資本財・サービス
FORTINET INC	55	1,480	199,918	情報技術
MARKEL CORP	5.5	713	96,283	金融
NEXTERA ENERGY INC	795.8	5,688	767,987	公益事業
MASIMO CORP	20	246	33,228	ヘルスケア
FREEPORT-MCMORAN INC	590.08	2,172	293,332	素材
INSULET CORP	28	575	77,703	ヘルスケア
US BANCORP	572	2,615	353,075	金融
UNITED RENTALS INC	29	754	101,844	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	25	376	50,895	情報技術
FASTENAL CO	233	1,144	154,549	資本財・サービス
FISERV INC	251.33	2,259	305,015	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	446.06	3,035	409,814	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	560	1,859	251,010	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	49	279	37,714	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	96	2,072	279,827	資本財・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
GOLDMAN SACHS GROUP INC	137.5	3,884	524,503	金融
ALPHABET INC-CL A	121.9	26,017	3,512,587	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	115.07	24,669	3,330,646	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	39	322	43,523	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	245	1,628	219,799	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	220.18	845	114,120	公益事業
GENUINE PARTS CO	58.5	774	104,602	一般消費財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	277	957	129,321	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	78.5	1,781	240,496	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	364	1,334	180,209	エネルギー
HOME DEPOT INC	423.5	11,801	1,593,344	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	22.5	396	53,466	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	583	713	96,342	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	16.1	329	44,518	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	59	1,220	164,720	生活必需品
HUMANA INC	51	2,162	291,897	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	109	1,834	247,657	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	33.2	161	21,824	情報技術
HENRY SCHEIN INC	56	420	56,704	ヘルスケア
HP INC	473	1,596	215,526	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	527	720	97,262	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	68.28	247	33,389	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	79	459	61,989	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	29.5	107	14,449	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	154	686	92,626	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	298.03	1,077	145,416	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	54	969	130,879	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	365	4,953	668,809	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	143	623	84,214	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	52	318	43,049	資本財・サービス
ZOETIS INC	191	3,013	406,917	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	94.99	1,203	162,462	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	94	1,226	165,642	エネルギー
ALLEGION PLC	36.5	369	49,904	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	129.73	292	39,425	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	104.37	1,224	165,371	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	127	359	48,558	情報技術
JM SMUCKER CO/THE	44	551	74,469	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	1,066	17,929	2,420,601	ヘルスケア
PLUG POWER INC	211	299	40,451	資本財・サービス
ABBVIE INC	716.72	9,863	1,331,671	ヘルスケア
HOLOGIC INC	101	685	92,547	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	137	1,689	228,078	生活必需品
KROGER CO	283	1,426	192,529	生活必需品
KLA CORP	61	1,930	260,632	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	99	4,120	556,252	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	31	703	95,023	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	105	344	46,497	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	272	4,839	653,444	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	327.85	9,533	1,287,124	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	56.8	2,554	344,909	情報技術
LOEWS CORP	86	503	67,969	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	66.49	321	43,375	金融
MCDONALD'S CORP	301.5	7,198	971,884	一般消費財・サービス
3M CO	231.9	3,136	423,451	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	936	15,325	2,069,045	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	144.39	4,583	618,801	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	25	791	106,816	素材
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	21.2	561	75,742	情報技術
ALCOA CORP	77	376	50,856	素材
PHILLIPS 66	195	2,030	274,142	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	160.5	471	63,707	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VGT SHRS	101	846	114,269	生活必需品
METLIFE INC	284	1,756	237,188	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	342	1,659	224,033	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	100	919	124,114	情報技術
MOTOROLA SOLUTIONS INC	67.98	1,382	186,597	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	9	1,041	140,662	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	388.23	1,278	172,602	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	47	941	127,175	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	1,025.21	8,663	1,169,594	ヘルスケア
DUPONT DE NEMOURS INC	207.51	1,252	169,132	素材
MASCO CORP	95	486	65,681	資本財・サービス
M & T BANK CORP	72.99	1,203	162,498	金融
MARSH & MCLENNAN COS	203.7	2,999	404,987	金融
BLACK KNIGHT INC	63.5	409	55,228	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	30.2	326	44,059	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	112.02	1,705	230,214	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	80	1,115	150,541	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	29	136	18,456	一般消費財・サービス
BLOCK INC CLASS A	210.12	1,267	171,060	情報技術

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
TRANSUNION	78	603	81,434	資本財・サービス
VISTRA CORP	176	404	54,557	公益事業
NOVOCURE LTD	38.5	230	31,119	ヘルスケア
NETAPP INC	90	578	78,154	情報技術
NIKE INC -CL B	517	5,724	772,827	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	97	2,161	291,791	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	225	1,371	185,149	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	76.05	659	89,101	金融
ALLY FINANCIAL INC	142	483	65,336	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	60	2,726	368,139	資本財・サービス
APTIV PLC	110	1,044	140,966	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	323.11	2,038	275,218	素材
MCKESSON CORP	61	1,869	252,437	ヘルスケア
XYLEM INC	73	558	75,396	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	628	6,215	839,129	生活必需品
NUCOR CORP	111	1,262	170,422	素材
WESTERN UNION CO	152.46	250	33,880	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	68	451	60,922	情報技術
NEWELL BRANDS INC	164.42	303	41,000	一般消費財・サービス
EVERGY INC	93.5	573	77,406	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	379.24	2,354	317,908	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	10.5	181	24,530	金融
OKTA INC	60	488	65,995	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	29	154	20,911	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	56	636	85,880	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	173.05	361	48,829	ヘルスケア
LINDE PLC	208.46	6,162	831,998	素材
WIX.COM LTD	23.1	128	17,337	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	158	414	55,910	金融
KKR & CO INC	226	1,064	143,712	金融
PAYCHEX INC	132	1,550	209,347	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	27	1,611	217,509	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	737	3,411	460,596	生活必需品
P G & E CORP	604	601	81,219	公益事業
PFIZER INC	2,280.13	10,926	1,475,170	ヘルスケア
CIGNA CORP	130	3,194	431,252	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	118.01	558	75,440	情報技術
XCEL ENERGY INC	221	1,455	196,567	公益事業
STERIS PLC	41	835	112,739	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	149	1,057	142,726	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	60.33	178	24,150	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	127.99	409	55,347	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	137.8	2,763	373,166	ヘルスケア
LYFT INC-A	125	177	23,896	資本財・サービス
DOW INC	298.18	1,746	235,746	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	41	265	35,836	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	88	940	126,959	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	52	1,313	177,359	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	594	1,252	169,133	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	94	2,486	335,738	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	971.67	13,004	1,755,782	生活必需品
EXELON CORP	397.22	1,680	226,902	公益事業
TELADOC HEALTH INC	65	190	25,686	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	165.08	722	97,552	資本財・サービス
NVR INC	1.3	507	68,539	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	527.02	5,875	793,284	エネルギー
TWILIO INC - A	70	573	77,363	情報技術
DOCUSIGN INC	80	458	61,866	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	21	567	76,678	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	53	239	32,314	情報技術
PEPSICO INC	561	8,758	1,182,462	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	16.2	193	26,130	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	114	234	31,628	情報技術
MONGODB INC	27	650	87,851	情報技術
SNAP INC - A	444	528	71,393	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	294.68	1,661	224,346	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	152	1,430	193,189	金融
AMCOR PLC	614	742	100,221	素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	80	1,274	172,013	情報技術
ROKU INC	48	356	48,143	コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	74	987	133,346	公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	256	7,043	950,885	情報技術
KORNIT DIGITAL LTD	19	64	8,708	資本財・サービス
PENTAIR PLC	66.75	306	41,328	資本財・サービス
QUALCOMM INC	457	5,952	803,698	情報技術
INVESCO LTD	141	228	30,915	金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	25.5	437	59,036	一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	106	677	91,504	金融
DATADOG INC - CLASS A	91	792	107,022	情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	231	397	53,610	コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	36.5	254	34,376	情報技術

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
REGENERON PHARMACEUTICALS	43	2,357	318,340	ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	90	1,107	149,528	資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	17	3,317	447,904	一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	143	1,058	142,867	一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	38.3	563	76,130	素材
RESMED INC	59	1,191	160,912	ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	47.3	601	81,146	ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	45	366	49,472	資本財・サービス
MODERNA INC	139	1,689	228,124	ヘルスケア
HUBSPOT INC	17.8	526	71,098	情報技術
PERKINELMER INC	51	704	95,116	ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	346.87	1,246	168,310	資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	173.38	1,199	162,007	資本財・サービス
BILL. COM HOLDINGS INC	38	402	54,366	情報技術
AVANTOR INC	248	737	99,509	ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	80	265	35,847	金融
DYNATRACE INC	81	314	42,452	情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	179	812	109,717	情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	379.85	735	99,233	金融
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	110	341	46,142	コミュニケーション・サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	140	534	72,203	ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	32.3	254	34,380	コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	116	847	114,436	コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	790.18	13,239	1,787,460	エネルギー
PELTON INTERACTIVE INC-A	117	112	15,132	一般消費財・サービス
ZSCALER INC	34	483	65,233	情報技術
EDISON INTERNATIONAL	154	939	126,786	公益事業
ETSY INC	52	372	50,273	一般消費財・サービス
TESLA INC	355.5	23,557	3,180,554	一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	87	990	133,750	情報技術
NORTONLIFELOCK INC	236	518	70,065	情報技術
UNITY SOFTWARE INC	79	266	36,007	情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	66.02	704	95,167	資本財・サービス
SYNOPSIS INC	62	1,829	247,067	情報技術
CARVANA CO	39	81	11,015	一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	32.5	87	11,869	一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	101	411	55,621	情報技術
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	49.05	2,216	299,305	コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	490.21	505	68,301	ヘルスケア
DOORDASH INC - A	78.5	458	61,957	一般消費財・サービス
ROBLOX CORP -CLASS A	146	381	51,486	コミュニケーション・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	136	1,344	181,538	一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	136	959	129,594	不動産
TWITTER INC	325	1,209	163,314	コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	430	2,871	387,686	公益事業
SYSCO CORP	206	1,650	222,885	生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	98.03	1,630	220,111	金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	25	109	14,793	金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	46	243	32,828	金融
STEEL DYNAMICS INC	78.5	557	75,269	素材
SCHLUMBERGER LTD	572.52	2,474	334,072	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	62	269	36,445	資本財・サービス
AFFIRM HOLDINGS INC	77	136	18,400	情報技術
AT&T INC	2,895.91	5,632	760,449	コミュニケーション・サービス
APA CORP	144	662	89,430	エネルギー
SOUTHWEST AIRLINES CO	60.5	225	30,401	資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	175	991	133,845	情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	87	342	46,266	一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	100	2,294	309,820	素材
SEMPRA ENERGY	128	1,853	250,267	公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	78	240	32,466	情報技術
CLARIVATE PLC	134	177	23,898	資本財・サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	665	520	70,209	情報技術
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	84.5	639	86,281	情報技術
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	49	252	34,122	金融
TEXAS INSTRUMENTS INC	374	5,762	778,007	情報技術
SALESFORCE. COM INC	398.66	6,555	885,120	情報技術
WESTROCK CO	107	457	61,785	素材
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	162.09	800	108,018	金融
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	285.34	1,415	191,077	資本財・サービス
TERADYNE INC	66	600	81,006	情報技術
UNION PACIFIC CORP	257.8	5,374	725,661	資本財・サービス
MARATHON OIL CORP	299	860	116,219	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	239.88	2,462	332,509	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	604.79	5,522	745,652	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	297	5,172	698,346	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	77.04	1,547	208,938	ヘルスケア
AMEREN CORPORATION	105	874	118,086	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	380.66	17,576	2,373,067	ヘルスケア
APPROVIN CORP CLASS A	49	158	21,401	情報技術
VERISIGN INC	40	644	87,043	情報技術

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
LUCID GROUP INC	168	278	37,651	一般消費財・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	70	191	25,800	一般消費財・サービス
VALERO ENERGY CORP	166.42	2,225	300,514	エネルギー
UPSTART HOLDINGS INC	28	95	12,955	金融
ULTA BEAUTY INC	22	863	116,631	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	108.88	406	54,948	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	28.3	296	40,068	ヘルスケア
ANTHEM INC	98	4,511	609,154	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	737.62	6,949	938,300	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,550.22	5,802	783,391	金融
WASTE MANAGEMENT INC	168	2,446	330,290	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	493	1,594	215,254	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	46	883	119,346	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	24	372	50,340	一般消費財・サービス
WALMART INC	619	7,394	998,341	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	85	894	120,806	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	45	261	35,243	一般消費財・サービス
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	455	111	15,050	資本財・サービス
WABTEC CORP	71.11	613	82,872	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	484	2,774	374,621	一般消費財・サービス
WATERS CORP	25	803	108,510	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	22	661	89,326	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	297	1,193	161,193	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	48.63	947	127,942	金融
WESTERN DIGITAL CORP	127	625	84,428	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	128	1,178	159,074	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	204	1,243	167,923	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	672.5	13,014	1,757,049	情報技術
PPL CORP	298	775	104,726	公益事業
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	132.24	719	97,195	公益事業
PULTEGROUP INC	98.5	392	53,034	一般消費財・サービス
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	902.53	1,261	170,347	コミュニケーション・サービス
PPG INDUSTRIES INC	96	1,070	144,527	素材
NORTHERN TRUST CORP	80	748	101,095	金融
NVIDIA CORP	1,013.8	16,054	2,167,523	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	170.13	2,648	357,539	金融
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	35	174	23,603	資本財・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	119	998	134,827	生活必需品
NETFLIX INC	179.9	3,014	406,926	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	159	8,068	1,089,322	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	98.5	388	52,422	公益事業
GLOBE LIFE INC	36.55	326	44,140	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	72	986	133,134	金融
TEXTRON INC	86	517	69,885	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	152.87	237	32,093	コミュニケーション・サービス
OMNICOM GROUP	83	539	72,781	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	649.33	4,592	619,974	情報技術
MASTERCARD INC - A	354	11,403	1,539,621	情報技術
ONEOK INC	181	1,093	147,573	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	373.52	395	53,404	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	43	1,636	220,989	情報技術
YUM! BRANDS INC	117	1,289	174,121	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	66	801	108,184	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	74	380	51,312	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	2,944.01	9,261	1,250,443	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	19	693	93,585	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	75	536	72,378	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	262	3,788	511,488	金融
ANALOG DEVICES INC	211.91	3,118	421,052	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	663.27	5,769	778,978	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	329.72	1,715	231,569	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	66	612	82,655	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	93	367	49,583	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	33.3	536	72,423	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	213	1,445	195,174	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	241	2,041	275,591	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	87	2,184	294,974	金融
AMGEN INC	226	5,326	719,173	ヘルスケア
EATON CORP PLC	162.36	2,119	286,102	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	67	1,551	209,407	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	358	3,458	466,999	情報技術
CME GROUP INC	146	2,863	386,561	金融
ECOLAB INC	105	1,577	213,037	素材
EQUIFAX INC	49	842	113,799	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	508	2,935	396,353	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	317	1,090	147,225	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	121	545	73,708	生活必需品
STATE STREET CORP	148.13	921	124,353	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	588.4	3,595	485,457	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	204	1,376	185,853	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	86	390	52,759	生活必需品

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千アメリカ・ドル	千円		
CROWN HOLDINGS INC	49.8	468	63,214	素材
CARDINAL HEALTH INC	110	562	75,903	ヘルスケア
FEDEX CORP	102	2,345	316,664	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	167.54	1,785	241,079	金融
FMC CORP	51.5	555	75,036	素材
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	103.13	1,208	163,142	素材
CITRIX SYSTEMS INC	51	471	63,628	情報技術
INTEL CORP	1,651	6,262	845,465	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	160	444	60,009	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	134.5	895	120,937	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	127	2,361	318,800	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	386	228	30,903	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	64	1,212	163,662	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	58	339	45,871	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	145	2,770	374,105	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	43.5	528	71,326	情報技術
SNAP-ON INC	22	452	61,058	資本財・サービス
CARMAX INC	66	592	80,008	一般消費財・サービス
DUKE ENERGY CORP	312.28	3,152	425,572	公益事業
TARGET CORP	194	2,768	373,758	一般消費財・サービス
DOVER CORP	58	713	96,316	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	19	892	120,538	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	52.2	648	87,614	資本財・サービス
CINTAS CORP	38	1,339	180,815	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	194	616	83,290	生活必需品
CLOROX COMPANY	50	623	84,138	生活必需品
ENTERGY CORP	82	879	118,778	公益事業
MICROSOFT CORP	2,886	70,559	9,526,280	情報技術
INCYTE CORP	76	502	67,905	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	531.69	4,819	650,645	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	543.98	4,813	649,821	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	454	2,664	359,798	情報技術
BLACKROCK INC	62	3,665	494,896	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	255	703	95,020	公益事業
HASBRO INC	54	436	58,871	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	104	710	95,956	生活必需品
KEYCORP	376	659	89,039	金融
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	563.11	3,292	444,520	生活必需品
COOPER COS INC/THE	20	629	85,034	ヘルスケア
CHUBB LTD	172.99	3,424	462,296	金融
ARROW ELECTRONICS INC	27	307	41,570	情報技術
ALLSTATE CORP	112	1,366	184,462	金融
EBAY INC	249	1,060	143,143	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	449.5	3,257	439,737	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	52	500	67,565	素材
DISH NETWORK CORP-A	96	169	22,850	コミュニケーション・サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	94	2,263	305,572	生活必需品
TRIMBLE INC	102	603	81,469	情報技術
LENNAR CORP-A	106	732	98,946	一般消費財・サービス
LEAR CORP	23	290	39,231	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	237	2,664	359,682	金融
PACCAR INC	141.37	1,189	160,630	資本財・サービス
BIOGEN INC	60	1,165	157,297	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	34	1,118	151,017	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	466	3,369	454,935	一般消費財・サービス
PTC INC	44	439	59,339	情報技術
EVERSOURCE ENERGY	140	1,130	152,609	公益事業
INTUIT INC	108.8	3,968	535,828	情報技術
BORGWARNER INC	97	340	45,914	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	88.5	624	84,343	一般消費財・サービス
BALL CORP	130.04	864	116,752	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	578.97	2,040	275,459	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	114	1,452	196,036	コミュニケーション・サービス
VULCAN MATERIALS CO	54	815	110,116	素材
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	103	2,565	346,371	ヘルスケア
VF CORP	134	608	82,170	一般消費財・サービス
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	246.25	625	84,478	コミュニケーション・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	22	271	36,714	一般消費財・サービス
CARNIVAL CORP	340	323	43,700	一般消費財・サービス
CLEVELAND-CLIFFS INC	218	384	51,918	素材
COMCAST CORP-CLASS A	1,833.9	7,306	986,417	コミュニケーション・サービス
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	87	467	63,051	資本財・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	448	217	29,395	不動産
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	133,369.57 603銘柄	1,314,532 177,475,066 <68.9%>	
(カナダ)		百株	千カナダ・ドル 千円	
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	335	1,820	189,719	生活必需品
IMPERIAL OIL LTD	91	627	65,427	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	8	1,487	155,005	情報技術
RESTAURANT BRANDS INTERN	116.87	724	75,527	一般消費財・サービス

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	千カナダ・ドル	千円		
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	179	902	94,005	素材
INTACT FINANCIAL CORP	70.5	1,238	129,004	金融
BCE INC	49.3	312	32,594	コミュニケーション・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	76	1,363	142,102	素材
SUNCOR ENERGY INC	567.3	2,893	301,474	エネルギー
METRO INC/CN	96	651	67,921	生活必需品
NATIONAL BANK OF CANADA	134	1,193	124,408	金融
BANK OF NOVA SCOTIA	482	3,887	405,110	金融
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	357	2,319	241,721	金融
TORONTO-DOMINION BANK	722	6,451	672,201	金融
GREAT-WEST LIFECO INC	107	340	35,510	金融
ROYAL BANK OF CANADA	561.5	7,075	737,263	金融
TOURMALINE OIL CORP	125	879	91,643	エネルギー
TC ENERGY CORP	389.5	2,733	284,872	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	218.29	1,087	113,319	エネルギー
BARRICK GOLD CORP	705	1,777	185,195	素材
CAE INC	126	387	40,411	資本財・サービス
THOMSON REUTERS CORP	68.12	856	89,272	資本財・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	65	258	26,936	生活必需品
WEST FRASER TIMBER CO LTD	35	369	38,552	素材
CCL INDUSTRIES INC - CL B	58.5	337	35,172	素材
HYDRO ONE LTD	131	442	46,137	公益事業
LOBLAW COMPANIES LTD	65.6	738	76,913	生活必需品
NORTHLAND POWER INC	87	323	33,668	公益事業
WSP GLOBAL INC	47	652	67,995	資本財・サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	33	346	36,088	資本財・サービス
PARKLAND CORP	58	215	22,494	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	60	164	17,180	コミュニケーション・サービス
EMERA INC	104	617	64,348	公益事業
TFI INTERNATIONAL INC	33	322	33,608	資本財・サービス
CANADIAN UTILITIES LTD-A	48	184	19,226	公益事業
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	140	831	86,638	コミュニケーション・サービス
BRP INC/CA- SUB VOTING	16	129	13,535	一般消費財・サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	225	206	21,545	素材
AGNICO EAGLE MINES LTD	181.17	1,139	118,723	素材
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	267	456	47,574	公益事業
AIR CANADA	65	116	12,171	資本財・サービス
KINROSS GOLD CORP	465	244	25,486	素材
BANK OF MONTREAL	257	3,299	343,847	金融
POWER CORP OF CANADA	222	753	78,465	金融
SHOPIFY INC - CLASS A	45	1,768	184,301	情報技術
NUTRIEN LTD	220.19	2,488	259,264	素材
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	47	211	22,004	公益事業
CAMECO CORP	158	455	47,513	エネルギー
FIRSTSERVICE CORP	15	229	23,913	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	71	242	25,257	資本財・サービス
LIGHTSPEED COMMERCE INC	53	139	14,529	情報技術
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	26	137	14,282	情報技術
TELUS CORP	108	316	32,973	コミュニケーション・サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	188	961	100,220	素材
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	22	359	37,496	一般消費財・サービス
CANADIAN NATURAL RESOURCES	466	3,657	381,076	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	10	659	68,689	金融
MAGNA INTERNATIONAL INC	113	837	87,308	一般消費財・サービス
WESTON (GEORGE) LTD	29.37	429	44,745	生活必需品
PAN AMERICAN SILVER CORP	78	210	21,985	素材
BLACKBERRY LTD	194	129	13,503	情報技術
SUN LIFE FINANCIAL INC	232	1,376	143,402	金融
ENBRIDGE INC	803	4,467	465,554	エネルギー
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	559.25	3,255	339,270	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	770	1,687	175,792	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	113	108	11,291	ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	368.2	3,267	340,463	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	41	254	26,560	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	75	273	28,524	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	271.5	3,815	397,535	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	87	845	88,151	情報技術
ONEX CORPORATION	29	199	20,762	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	190	647	67,451	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	31	109	11,444	金融
TMX GROUP LTD	21	279	29,159	金融
OPEN TEXT CORP	104	502	52,320	情報技術
SAPUTO INC	95	258	26,905	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	233	743	77,497	素材
FORTIS INC	187	1,109	115,626	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	44	345	36,004	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	246	245	25,556	素材
CENOVUS ENERGY INC	555	1,594	166,148	エネルギー
DOLLARAMA INC	112	809	84,353	一般消費財・サービス
ALTAGAS LTD	111	307	32,026	公益事業
KEYERA CORP	88	294	30,690	エネルギー

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
ARC RESOURCES LTD	百株 286	千カナダ・ドル 563	千円 58,708	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	15,743.16 86銘柄	93,764 9,770,297 <3.8%>	
(オーストラリア)	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
THE LOTTERY CORPORATION LTD	849.5	389	36,301	一般消費財・サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,050.94	322	30,037	金融
BHP GROUP LTD	1,924.1	8,516	792,845	素材
SOUTH32 LTD	1,770.77	795	74,021	素材
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	717.02	2,365	220,223	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	643.7	1,263	117,639	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,227.82	3,295	306,808	金融
WESTPAC BANKING CORP	1,348.48	2,706	251,965	金融
SANTOS LTD	1,223.04	990	92,230	エネルギー
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,065.11	2,343	218,155	金融
RIO TINTO LTD	141.34	1,569	146,127	素材
ORIGIN ENERGY LTD	647	383	35,659	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD	676	271	25,300	資本財・サービス
XERO LTD	51.35	420	39,153	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	79	188	17,526	エネルギー
COLES GROUP LTD	507.94	870	81,053	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	54	197	18,420	情報技術
IDP EDUCATION LTD	79	174	16,291	一般消費財・サービス
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	445.84	359	33,455	素材
EVOLUTION MINING LTD	656	218	20,337	素材
REECE LTD	105	145	13,568	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	512.6	366	34,121	生活必需品
SEEK LTD	128.45	278	25,962	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	275.29	298	27,808	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	340.97	791	73,710	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	647.87	5,908	550,088	金融
AMPOL LTD	88	303	28,216	エネルギー
ORICA LTD	149	233	21,737	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	562.69	647	60,244	金融
WOOLWORTHS GROUP LTD	459.92	1,555	144,855	生活必需品
CROWN RESORTS LTD	134	174	16,280	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	354.69	171	15,982	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	1,563.94	586	54,601	コミュニケーション・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	164	532	49,576	素材
MACQUARIE GROUP LTD	139.28	2,275	211,815	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	229.09	784	73,049	一般消費財・サービス
CSL LTD	183.15	4,836	450,238	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	431.07	1,810	168,556	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	25.1	516	48,054	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	178	293	27,293	素材
SUNCORP GROUP LTD	480.15	503	46,847	金融
ASX LTD	73.65	570	53,154	金融
COMPUTERSHARE LTD	206.89	486	45,322	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	906.36	377	35,187	金融
SONIC HEALTHCARE LTD	173.28	577	53,753	ヘルスケア
BRAMBLES LTD	527	553	51,516	資本財・サービス
MINERAL RESOURCES LTD	62	344	32,070	素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD	69.73	521	48,546	ヘルスケア
REA GROUP LTD	20.23	209	19,482	コミュニケーション・サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	22	140	13,042	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	24,371.35 50銘柄	54,438 5,068,239 <2.0%>	
(香港)	百株	千香港・ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	580	2,966	51,027	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	880	3,630	62,436	一般消費財・サービス
MTR CORP	620	2,573	44,255	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	605	5,644	97,087	不動産
SINO LAND CO	1,420	1,590	27,354	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,116.69	5,918	101,797	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	185	884	15,209	不動産
CLP HOLDINGS LTD	670	5,058	87,006	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	595.07	1,749	30,091	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	4,534.75	3,868	66,532	公益事業
HANG SENG BANK LTD	310	4,247	73,048	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT	635	1,854	31,892	不動産
WH GROUP LTD	3,610	2,017	34,709	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	501	17,114	294,363	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	780	1,121	19,292	不動産
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	690	1,208	20,792	資本財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	450	858	14,767	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	911.69	4,736	81,463	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	265	1,360	23,405	公益事業
AIA GROUP LTD	5,036	39,582	680,826	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	540	1,395	24,009	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	670	2,318	39,873	不動産

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千香港・ドル	千円	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	679	1,398	24,058	生活必需品
ESR CAYMAN LTD	800	1,688	29,033	不動産
SANDS CHINA LTD	928	1,395	24,006	一般消費財・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	820	1,111	19,125	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	575	5,359	92,174	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,540	4,704	80,920	金融
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	30,947.2 28銘柄	127,358 <0.9%>	
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円	
CAPITALAND INVESTMENT LTD	1,074	392	38,005	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD	491	1,330	128,955	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	754	2,248	217,985	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	539.75	276	26,844	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	593	396	38,461	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	171	123	11,936	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	161	127	12,362	不動産
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,410	1,611	156,247	金融
GENTING SINGAPORE LTD	2,380	178	17,305	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	112	190	18,502	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,438.5	866	84,007	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	627	249	24,193	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	357	344	33,365	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD	800	324	31,489	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 >	12,908.25 14銘柄	8,660 <0.3%>	
(ニュージーランド)	百株	千ニュージーランド・ドル	千円	
MERIDIAN ENERGY LTD	525	232	19,524	公益事業
MERCURY NZ LTD	300	160	13,499	公益事業
SPARK NEW ZEALAND LTD	727.89	329	27,681	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	521.13	378	31,805	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	242	471	39,616	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 >	2,316.02 5銘柄	1,573 <0.1%>	
(イギリス)	百株	千イギリス・ポンド	千円	
SHELL PLC	3,052.97	7,046	1,142,972	エネルギー
BP PLC	7,812.94	3,398	551,228	エネルギー
UNILEVER PLC	1,027.96	3,710	601,867	生活必需品
BARCLAYS PLC	6,726.97	1,054	171,053	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	3,363.9	295	47,974	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	1,102.58	1,073	174,127	金融
NATWEST GROUP PLC	2,255.36	499	80,997	金融
JOHNSON MATTHEY PLC	70.64	140	22,785	素材
BAE SYSTEMS PLC	1,262.79	978	158,707	資本財・サービス
AVIVA PLC	1,156.48	467	75,806	金融
AVEVA GROUP PLC	44	104	16,879	情報技術
GSK	2,041.62	3,495	567,031	ヘルスケア
INFORMA PLC	600.95	301	48,915	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,691	255	41,432	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	380.02	195	31,647	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	39.64	206	33,448	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	183	143	23,290	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	29	269	43,672	資本財・サービス
HALMA PLC	152.6	295	47,934	情報技術
ENTAIN PLC	227	304	49,396	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	997	111	18,072	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	301.68	183	29,703	金融
M&G PLC	1,045.04	210	34,208	金融
RELX PLC	776.24	1,615	262,026	資本財・サービス
DIAGEO PLC	929.3	3,204	519,757	生活必需品
RIO TINTO PLC	451.02	2,505	406,403	素材
STANDARD CHARTERED PLC	1,046.59	627	101,792	金融
TESCO PLC	3,063.36	755	122,587	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	353.11	411	66,671	ヘルスケア
GLENCORE PLC	3,969.5	1,918	311,193	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	132.5	102	16,588	金融
SMITHS GROUP PLC	153.83	226	36,792	資本財・サービス
PEARSON PLC	283.63	209	33,972	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	653.25	132	21,542	生活必需品
NEXT PLC	53.11	315	51,155	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	1,466.73	182	29,668	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	81.27	208	33,827	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	135.62	355	57,703	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	10,810.03	1,357	220,168	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	56.01	334	54,203	素材
KINGFISHER PLC	787.11	184	29,978	一般消費財・サービス
WPP PLC	458.47	375	60,833	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	264	271	44,022	公益事業
SEVERN TRENT PLC	97.33	273	44,316	公益事業

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千イギリス・ポンド	千円	
RENTOKIL INITIAL PLC	747.06	337	54,822	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	286.99	1,718	278,757	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	217.32	239	38,900	金融
SCHROEDERS PLC	46.5	122	19,807	金融
SSE PLC	427.91	702	113,938	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	395	192	31,216	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	622.04	6,064	983,785	ヘルスケア
FERGUSON PLC	87.77	806	130,782	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,396.89	578	93,895	金融
3I GROUP PLC	390.73	431	70,003	金融
ASHTREAD GROUP PLC	178.54	651	105,736	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	401.14	240	38,937	情報技術
NATIONAL GRID PLC	1,463.68	1,537	249,413	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	28,500.13	1,236	200,499	金融
IMPERIAL BRANDS PLC	381.61	687	111,483	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	42.32	170	27,630	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	873.95	3,062	496,809	生活必需品
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	138	216	35,110	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	8,128.75	4,230	686,180	金融
ANGLO AMERICAN PLC	510.15	1,762	285,906	素材
MONDI PLC	188	267	43,410	素材
COMPASS GROUP PLC	716.29	1,196	194,036	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	128.32	275	44,751	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	3,453	620	100,623	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	78	130	21,180	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	160.61	255	41,501	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	71.36	310	50,364	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	64.81	274	44,500	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	132.11	890	144,392	金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	66	99	16,160	ヘルスケア
ADMIRAL GROUP PLC	75	159	25,913	金融
ANTOFAGASTA PLC	153	213	34,571	素材
ABRDN PLC	843.62	142	23,181	金融
EXPERIAN PLC	370.16	859	139,481	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 >	114,323.91 78銘柄	70,994 <4.5%>	11,516,048
(イスラエル)	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	514.98	928	36,158	金融
AZRIELI GROUP LTD	16.5	381	14,874	不動産
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	45.41	732	28,506	情報技術
ICL GROUP LTD	281	999	38,934	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	11	745	29,043	資本財・サービス
BANK HAPOLIM BM	528.58	1,590	61,937	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	604.86	1,881	73,254	金融
NICE LTD	26.28	1,726	67,237	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	64.07	707	27,570	金融
イスラエル・シェケル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,092.68 9銘柄	9,694 <0.1%>	377,517
(スイス)	百株	千スイス・フラン	千円	
VIFOR N. LINIE AG	18	312	42,212	ヘルスケア
UBS GROUP AG-REG	1,380.62	2,207	298,049	金融
ROCHE HOLDING AG-BR	11.8	413	55,759	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2.8	200	27,104	素材
ADECCO GROUP AG-REG	63.6	213	28,765	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	275.8	8,432	1,138,483	ヘルスケア
SIKA AG-REG	57.17	1,298	175,364	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.04	386	52,221	生活必需品
ABB LTD-REG	644.47	1,770	239,016	資本財・サービス
SWISS RE AG	118.42	899	121,507	金融
NESTLE SA-REG	1,104.93	12,001	1,620,356	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	9	766	103,525	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	16.01	280	37,934	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,040.49	614	82,937	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	87.08	401	54,151	金融
SGS SA-REG	2.52	534	72,229	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	9.34	159	21,562	資本財・サービス
TEMENOS AG - REG	25	180	24,322	情報技術
VAT GROUP AG	10.5	253	34,164	資本財・サービス
ALCON INC	196.11	1,300	175,594	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	10.9	249	33,699	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	59.05	2,474	334,120	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	18	276	37,376	金融
CLARIANT AG-REG	77	143	19,356	素材
NOVARTIS AG-REG	860.01	6,942	937,239	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1.41	292	39,519	生活必需品
BACHEM HOLDING AG-REG B	12.5	85	11,568	ヘルスケア
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	204.9	2,025	273,426	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	10	530	71,582	コミュニケーション・サービス
GEBERIT AG-REG	14	660	89,214	資本財・サービス

銘柄		2022年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千スイス・フラン	千円	
GIVAUDAN-REG		3.6	1,124	151,837	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG		43.89	448	60,618	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG		21.1	663	89,563	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		66	342	46,192	情報技術
LONZA GROUP AG-REG		29.25	1,468	198,320	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG		19	82	11,091	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD		218.29	996	134,477	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		12.37	634	85,674	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG		21.35	498	67,363	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG		30.25	267	36,164	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.42	392	53,018	生活必需品
スイス・フラン通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	6,806.99 41銘柄	53,230 7,186,692	<2.8%>
		百株	千デンマーク・クローネ	千円	
(デンマーク)					
NOVO NORDISK A/S-B		701.05	52,957	1,002,482	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S		279	3,057	57,884	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A		1.31	2,402	45,480	資本財・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		420.42	6,738	127,559	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S		54.65	1,295	24,528	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B		41.8	3,542	67,068	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES		83	3,326	62,973	素材
COLOPLAST-B		48.5	3,635	68,821	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S		82.8	8,235	155,894	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS		3.7	666	12,607	資本財・サービス
DEMANT A/S		42.75	1,168	22,117	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		2.3	4,267	80,786	資本財・サービス
TRYG A/S		149.9	2,330	44,110	金融
PANDORA A/S		40	1,930	36,534	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S		43	2,046	38,737	素材
GENMAB A/S		27.37	5,387	101,990	ヘルスケア
ORSTED A/S		78.75	5,462	103,412	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計		株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,100.3 17銘柄	108,451 2,052,989	<0.8%>
		百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
(ノルウェー)					
DNB BANK		380.5	6,968	94,009	金融
NORSK HYDRO ASA		542	3,470	46,823	素材
ORKLA ASA		303.5	2,219	29,945	生活必需品
TELENOR ASA		291.31	3,717	50,143	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA		406.87	14,390	194,134	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		66.6	3,143	42,406	素材
MOWI ASA		178	4,259	57,461	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		80.5	1,561	21,067	金融
AKER BP ASA		49	2,031	27,398	エネルギー
KONGSBERG GRUPPEN ASA		37.23	1,233	16,633	資本財・サービス
SALMAR ASA		24.52	1,668	22,509	生活必需品
ADEVINTA ASA		120	790	10,659	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 >	2,480.03 12銘柄	45,455 613,193	<0.2%>
		百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
(スウェーデン)					
SAGAX CLASS B		79.24	1,621	21,481	不動産
INVESTOR CLASS A		200	3,782	50,111	金融
VOLVO CAR CLASS B		248.08	1,840	24,380	一般消費財・サービス
ERICSSON LM-B SHS		1,215.13	9,143	121,156	情報技術
VOLVO AB-B SHS		628.23	10,336	136,963	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES		154	2,567	34,025	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B		86	1,152	15,273	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB		657.78	6,643	88,027	生活必需品
TELE2 AB-B SHS		202	2,325	30,806	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS		92	2,300	30,475	ヘルスケア
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		677.56	7,358	97,497	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		607.23	5,750	76,193	金融
SWEDBANK AB - A SHARES		377.02	5,632	74,632	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		293	3,903	51,727	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B		244	3,938	52,180	素材
SKANSKA AB-B SHS		136.5	2,213	29,326	資本財・サービス
SANDVIK AB		457	8,641	114,504	資本財・サービス
INVESTOR AB-B SHS		758.5	12,961	171,736	金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		1,118.24	11,222	148,700	資本財・サービス
VOLVO AB-A SHS		80	1,369	18,147	資本財・サービス
HOLMEN AB-B SHARES		39.06	1,759	23,310	素材
SECURITAS AB-B SHS		119.5	1,049	13,908	資本財・サービス
TELIA CO AB		1,106.67	4,321	57,260	コミュニケーション・サービス
ALFA LAVAL AB		127	3,098	41,059	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS		649.81	5,698	75,509	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B		417.27	9,204	121,965	資本財・サービス
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		52.43	1,241	16,450	金融
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		262.68	1,438	19,059	不動産
INDUTRADE AB		113.71	2,342	31,037	資本財・サービス

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	70.32	1,525	20,218	ヘルスケア
LUNDBERGS AB-B SHS	30	1,284	17,016	金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	57	1,191	15,792	資本財・サービス
LIFCO AB-B SHS	95	1,641	21,744	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	630.92	4,532	60,056	資本財・サービス
LUNDIN ENERGY AB	80.5	3,867	51,240	エネルギー
ESSITY AKTIEBOLAG-B	253.54	6,386	84,623	生活必需品
EMBRACER GROUP AB	265.94	2,147	28,453	コミュニケーション・サービス
BOLIDEN AB	113.87	4,066	53,878	素材
EPIROC AB-A	274.36	4,861	64,416	資本財・サービス
EPIROC AB-B	157	2,377	31,505	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS	170.5	1,324	17,548	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP	1,377.6	13,519	179,136	金融
EQT AB	123.18	2,691	35,662	金融
EVOLUTION AB	76.12	6,892	91,327	一般消費財・サービス
SINCH AB	213	799	10,590	情報技術
KINNEVIK AB - B	93	1,562	20,701	金融
HEXAGON AB-B SHS	810.32	8,844	117,191	情報技術
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	62	1,455	19,288	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	16,153.81 48銘柄	205,834 <1.1%>	2,727,305
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (アイルランド)				
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	94	303	42,762	素材
KINGSPAN GROUP PLC	60.76	425	59,885	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A	62.72	573	80,750	生活必需品
CRH PLC	301.26	1,024	144,219	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	65.69	614	86,461	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	584.43 5銘柄	2,940 <0.2%>	414,078
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (オランダ)				
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	278.91	550	77,465	コミュニケーション・サービス
QIAGEN N. V.	91.05	371	52,343	ヘルスケア
KONINKLIJKE PHILIPS NV	349	729	102,750	ヘルスケア
NN GROUP NV	112.92	503	70,878	金融
HEINEKEN NV	101.96	907	127,768	生活必需品
AEGON NV	679.94	296	41,711	金融
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	411.49	1,036	146,003	生活必需品
AKZO NOBEL N. V.	71	502	70,717	素材
KONINKLIJKE DSM NV	68.8	975	137,410	素材
WOLTERS KLUWER	103.28	877	123,547	資本財・サービス
ING GROEP NV	1,536.19	1,478	208,162	金融
KONINKLIJKE KPN NV	1,278	423	59,668	コミュニケーション・サービス
ASML HOLDING NV	159.79	7,529	1,060,126	情報技術
ABN AMRO BANK NV-CVA	167	170	23,936	金融
IMCD NV	22.46	297	41,822	資本財・サービス
ADYEN NV	8.57	990	139,417	情報技術
JUST EAT TAKEAWAY	72.2	123	17,391	一般消費財・サービス
PROSUS NV	354.8	1,690	238,014	一般消費財・サービス
JDE PEET'S NV	37	96	13,617	生活必需品
ASM INTERNATIONAL NV	18	460	64,893	情報技術
RANDSTAD NV	47.2	222	31,367	資本財・サービス
HEINEKEN HOLDING NV	42.5	297	41,828	生活必需品
OCI NV	43.86	146	20,564	素材
EURONEXT NV	33	243	34,281	金融
STMICROELECTRONICS NV	268.92	873	123,057	情報技術
AIRBUS SE	231.99	2,235	314,752	資本財・サービス
ARGENX SE	19.12	600	84,504	ヘルスケア
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	195	176	24,781	生活必需品
EXOR NV	42.73	258	36,338	金融
CNH INDUSTRIAL NV	402.65	501	70,667	資本財・サービス
STELLANTIS NV	866.43	1,081	152,223	一般消費財・サービス
FERRARI NV	49.6	806	113,589	一般消費財・サービス
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,165.36 32銘柄	27,454 <1.5%>	3,865,605
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ベルギー)				
UCB SA	49.76	393	55,363	ヘルスケア
KBC GROUP NV	98.43	531	74,866	金融
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	42	334	47,155	金融
SOLVAY SA	28	242	34,196	素材
UMICORE	82.69	316	44,626	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	341.79	1,668	234,941	生活必需品
AGEAS	62.9	254	35,876	金融
D'IETEREN GROUP	10.36	145	20,479	一般消費財・サービス
PROXIMUS	60.35	91	12,869	コミュニケーション・サービス
ELIA GROUP SA/NV	12	171	24,161	公益事業
SOFINA	6	119	16,769	金融
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	794.28 11銘柄	4,270 <0.2%>	601,305

銘柄		2022年6月15日現在			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ルクセンブルグ)					
AROUNDTOWN SA		380	137	19,304	不動産
ARCELORMITTAL		257	666	93,847	素材
EUROFINS SCIENTIFIC		52.96	412	58,043	ヘルスケア
TENARIS SA		186.08	268	37,845	エネルギー
国小計		876.04	1,484	209,041	
		4銘柄		<0.1%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (フランス)					
TOTALENERGIES SE		974.92	5,272	742,349	エネルギー
MICHELIN (CGDE)		66.85	725	102,219	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA		205.76	2,777	391,050	素材
KERING		29.42	1,445	203,512	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE		212.74	2,488	350,399	資本財・サービス
BOUYGUES SA		90.62	274	38,635	資本財・サービス
BNP PARIBAS		436.84	2,067	291,143	金融
THALES SA		41	465	65,521	資本財・サービス
DANONE		257.08	1,330	187,282	生活必需品
CARREFOUR SA		244.54	458	64,610	生活必需品
VIVENDI		295.91	322	45,455	コミュニケーション・サービス
L'OREAL		95	2,865	403,487	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		195.72	944	132,936	資本財・サービス
LEGRAND SA		105.24	759	106,984	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA		82.41	1,395	196,444	生活必需品
EURAZEO SE		17.24	110	15,620	金融
SOCIETE GENERALE SA		308	690	97,205	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		109.21	5,941	836,496	一般消費財・サービス
ACCOR SA		67.17	182	25,762	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE		64.52	1,069	150,574	情報技術
VALEO SA		84	158	22,329	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE		87	400	56,458	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA		116.05	290	40,931	資本財・サービス
EIFFAGE		32.85	288	40,591	資本財・サービス
SODEXO SA		34.91	229	32,333	一般消費財・サービス
IPSEN		14	118	16,656	ヘルスケア
AMUNDI SA		22.5	107	15,073	金融
TELEPERFORMANCE		23.15	646	91,038	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT		36	158	22,333	コミュニケーション・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		11	325	45,890	ヘルスケア
SEB SA		9.97	89	12,577	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA		113.17	1,522	214,316	一般消費財・サービス
DASSAULT AVIATION SA		10	155	21,838	資本財・サービス
WORLDLINE SA		91.14	296	41,756	情報技術
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		41.63	133	18,815	一般消費財・サービス
AXA SA		762.06	1,706	240,240	金融
EDENRED		95	405	57,142	情報技術
RENAULT SA		70.5	170	24,071	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL		12.46	1,222	172,068	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU		9	137	19,350	生活必需品
DASSAULT SYSTEMES SE		262.47	879	123,783	情報技術
WENDEL		9.3	79	11,261	金融
ORANGE		785.04	852	120,061	コミュニケーション・サービス
ALSTOM		125.25	313	44,105	資本財・サービス
SANOFI		447.47	4,212	593,180	ヘルスケア
VINCI SA		209.83	1,756	247,254	資本財・サービス
VEOLIA ENVIRONNEMENT		261.79	615	86,621	公益事業
CREDIT AGRICOLE SA		491.28	433	61,099	金融
BIOMERIEUX		15.2	130	18,315	ヘルスケア
ENGIE		718.69	859	121,004	公益事業
EDF		221.2	180	25,414	公益事業
SAFRAN SA		134.49	1,192	167,964	資本財・サービス
ARKEMA		22.2	216	30,426	素材
ADP		11.1	135	19,129	資本財・サービス
GETLINK SE		173.45	293	41,321	資本財・サービス
BOLLORE		324	153	21,669	コミュニケーション・サービス
国小計		9,789.34	52,458	7,386,118	
		56銘柄		<2.9%>	
		百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (ドイツ)					
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		179.02	489	68,963	資本財・サービス
BAYER AG-REG		386.59	2,459	346,241	ヘルスケア
EVONIK INDUSTRIES AG		80	197	27,855	素材
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED		813.28	752	105,990	金融
COMMERZBANK AG		420.31	316	44,514	金融
VOLKSWAGEN AG		12	229	32,347	一般消費財・サービス
VOLKSWAGEN AG-PREF		73	1,052	148,173	一般消費財・サービス
SIEMENS AG-REG		297	3,243	456,731	資本財・サービス
E.ON SE		883.44	803	113,069	公益事業
UNIPER SE		66.5	137	19,306	公益事業
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		130.27	1,011	142,352	一般消費財・サービス
GEA GROUP AG		58	201	28,370	資本財・サービス

銘柄	2022年6月15日現在			業種等	
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	千ユーロ	千円		
CONTINENTAL AG	43.42	306	43,173	一般消費財・サービス	
BASF SE	361.41	1,748	246,239	素材	
ALLIANZ SE-REG	159	2,894	407,581	金融	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	68	399	56,278	生活必需品	
RHEINMETALL AG	18.13	374	52,764	資本財・サービス	
RWE AG	252.79	964	135,857	公益事業	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	219.5	125	17,653	資本財・サービス	
BRENNTAG SE	60.9	431	60,691	資本財・サービス	
FRESENIUS SE & CO KGAA	164.83	488	68,765	ヘルスケア	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	38.39	109	15,453	コミュニケーション・サービス	
SAP SE	405.92	3,531	497,292	情報技術	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	55.14	1,209	170,335	金融	
ZALANDO SE	87.83	243	34,218	一般消費財・サービス	
HEIDELBERGCEMENT AG	57.08	283	39,927	素材	
KION GROUP AG	27	106	14,944	資本財・サービス	
COVESTRO AG	73	289	40,702	素材	
RATIONAL AG	1.9	110	15,516	資本財・サービス	
SARTORIUS AG-VORZUG	12.1	381	53,648	ヘルスケア	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	60.35	413	58,172	一般消費財・サービス	
DELIVERY HERO SE	64.43	205	28,875	一般消費財・サービス	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	15.92	179	25,273	ヘルスケア	
BECHTLE AG	32.38	118	16,668	情報技術	
NEMETSCHKE SE	22.84	131	18,478	情報技術	
SCOUT24 AG	36	189	26,682	コミュニケーション・サービス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	110.97	552	77,747	ヘルスケア	
KNORR-BREMSE AG	28	162	22,936	資本財・サービス	
HELLOFRESH SE	65.16	188	26,532	生活必需品	
SIEMENS ENERGY AG	172.9	269	37,989	資本財・サービス	
BEIERSDORF AG	39.8	370	52,138	生活必需品	
MERCK KGAA	50.86	831	117,047	ヘルスケア	
ADIDAS AG	72	1,184	166,804	一般消費財・サービス	
PUMA SE	41.63	275	38,744	一般消費財・サービス	
HENKEL AG & CO KGAA	41.01	239	33,750	生活必需品	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,275.96	2,273	320,109	コミュニケーション・サービス	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	80.7	407	57,335	ヘルスケア	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	325	2,024	285,039	一般消費財・サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	513.88	1,247	175,603	情報技術	
HANNOVER RUECK SE	23.78	331	46,624	金融	
DEUTSCHE POST AG-REG	390.03	1,348	189,900	資本財・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	74.78	1,135	159,883	金融	
MTU AERO ENGINES AG	21.04	355	49,991	資本財・サービス	
SYMRISE AG	52.28	500	70,459	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	413.12	114	16,170	コミュニケーション・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	22	158	22,271	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	280	885	124,658	不動産	
LEG IMMOBILIEN SE	28	232	32,784	不動産	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	9,860.57 58 銘柄	41,219	5,803,636 <2.3%>	
百株 千ユーロ 千円					
ユーロ (ポルトガル)					
JERONIMO MARTINS	105	197	27,823	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,094	490	69,130	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	187.5	236	33,316	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,386.5 3 銘柄	925	130,271 <0.1%>	
百株 千ユーロ 千円					
ユーロ (スペイン)					
TELEFONICA SA	2,044.87	901	126,942	コミュニケーション・サービス	
ENDESA SA	121	230	32,514	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,623.74	1,100	154,935	金融	
IBERDROLA SA	2,279.05	2,249	316,782	公益事業	
REPSOL SA	572.01	877	123,587	エネルギー	
GRIFOLS SA	118.3	208	29,340	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	6,823.35	1,789	251,998	金融	
AMADEUS IT GROUP SA	177.28	898	126,502	情報技術	
NATURGY ENERGY GROUP SA	103	278	39,257	公益事業	
CAIXABANK SA	1,749.27	562	79,233	金融	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	88.76	213	30,018	資本財・サービス	
AENA SME SA	29	380	53,551	資本財・サービス	
CELLNEX TELECOM SA	214.6	761	107,205	コミュニケーション・サービス	
ACCIONA SA	10.28	182	25,648	公益事業	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	429.2	966	136,030	一般消費財・サービス	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	94.14	168	23,746	資本財・サービス	
ENAGAS SA	98.84	206	29,113	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	157	282	39,712	公益事業	
FERROVIAL SA	190.18	442	62,310	資本財・サービス	
EDP RENOVAVEIS SA	110	238	33,516	公益事業	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	18,033.87 20 銘柄	12,939	1,821,951 <0.7%>	

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千ユーロ	千円	
ユーロ (イタリア)				
PRYSMIAN SPA	100.4	277	39,129	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI	435.47	675	95,128	金融
MEDIOBANCA SPA	223.65	200	28,208	金融
UNICREDIT SPA	832.17	808	113,830	金融
TELECOM ITALIA SPA	3,787.82	93	13,231	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO	6,498.77	1,150	161,959	金融
ATLANTIA SPA	195.31	434	61,131	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA	192	175	24,649	金融
MONCLER SPA	78	299	42,150	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA	38.5	144	20,371	ヘルスケア
ENI SPA	993.14	1,307	184,161	エネルギー
DIASORIN SPA	10	111	15,699	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	128	118	16,656	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA	199	145	20,482	情報技術
AMPLIFON SPA	47	123	17,450	ヘルスケア
ENEL SPA	3,200.36	1,706	240,310	公益事業
SNAM SPA	793.5	403	56,800	公益事業
TERNA SPA	554.64	400	56,445	公益事業
FINECOBANK SPA	232	239	33,759	金融
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	18,539.73 19 銘柄	8,817 <0.5%>	1,241,558
ユーロ (フィンランド)				
UPM-KYMMENE OYJ	210.01	642	90,511	素材
NOKIA OYJ	2,129.8	962	135,543	情報技術
WARTSILA OYJ ABP	170	122	17,291	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS	214	333	46,959	素材
ELISA OYJ	54	283	39,932	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS	196.22	796	112,168	金融
FORTUM OYJ	169	280	39,440	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	104	227	32,068	生活必需品
KONE OYJ-B	133.75	598	84,254	資本財・サービス
NESTE OYJ	166.46	697	98,273	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B	40	146	20,573	ヘルスケア
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,587.24 11 銘柄	5,092 <0.3%>	717,018
ユーロ (オーストリア)				
VERBUND AG	26	245	34,503	公益事業
OMV AG	56.5	275	38,733	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	135.46	358	50,409	金融
VOESTALPINE AG	42.5	108	15,295	素材
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	260.46 4 銘柄	986 <0.1%>	138,941
ユーロ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	71,877.82 223 銘柄	158,590 <0.7%>	22,329,525
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	435,491.09 1,214 銘柄	— <94.1%>	242,279,225

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)			
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5.737	1,062	143,439
SIMON PROPERTY GROUP INC	13.307	1,284	173,387
BOSTON PROPERTIES INC	6	543	73,423
VORNADO REALTY TRUST	6.297	182	24,620
SBA COMMUNICATIONS CORP	4.4	1,307	176,466
EQUITY RESIDENTIAL	14.5	997	134,646
EQUINIX INC	3.708	2,293	309,636
AMERICAN TOWER CORP	18.5	4,338	585,682
HOST HOTELS & RESORTS INC	29.043	498	67,364
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	13	428	57,813
KIMCO REALTY CORP	25	480	64,804
INVITATION HOMES INC	24.7	830	112,147
VICI PROPERTIES INC	39	1,097	148,115
VENTAS INC	16.2	784	105,924
WEYERHAEUSER CO	30.314	1,043	140,870
CROWN CASTLE INTL CORP	17.5	2,763	373,113
IRON MOUNTAIN INC	11.8	557	75,322
SUN COMMUNITIES INC	4.7	709	95,841
PROLOGIS INC	30.002	3,320	448,236
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6.2	839	113,313
CAMDEN PROPERTY TRUST	4	504	68,045
DUKE REALTY CORP	15.5	793	107,143
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2.6	666	89,936
WELLTOWER INC	18.1	1,401	189,263
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	21.9	513	69,305
MID-AMERICA APARTMENT COMM	4.7	752	101,546
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	7.2	494	66,752
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	63.4	375	50,673
REALTY INCOME CORP	23.995	1,506	203,412
PUBLIC STORAGE	6.4	1,906	257,352
REGENCY CENTERS CORP	6.3	356	48,141
UDR INC	12.9	545	73,705
WP CAREY INC	7.7	623	84,174
DIGITAL REALTY TRUST INC	11.5	1,432	193,409
EXTRA SPACE STORAGE INC	5.4	857	115,730
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	24.2	361	48,812
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	555.703 36銘柄	38,453 <2.0%>
		千口	千カナダ・ドル
(カナダ)			
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3.4	150	15,652
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5.8	116	12,153
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	9.2 2銘柄	266 <0.0%>
		千口	千オーストラリア・ドル
(オーストラリア)			
DEXUS/AU	40.978	371	34,602
LENLEASE GROUP	25.3	243	22,706
TRANSURBAN GROUP	116.72	1,630	151,806
APA GROUP	45.041	517	48,223
SCENTRE GROUP	190.722	486	45,278
GPT GROUP	73.031	303	28,284
MIRVAC GROUP	144.9	297	27,654
STOCKLAND	91.123	328	30,540
GOODMAN GROUP	63.909	1,144	106,563
VICINITY CENTRES	137.273	239	22,301
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	928.997 10銘柄	5,563 <0.2%>
		千口	千香港・ドル
(香港)			
LINK REIT	87.9	6,012	103,412
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	107	817	14,060
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	152	1,629	28,026
香港・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	346.9 3銘柄	8,459 <0.1%>
		千口	千シンガポール・ドル
(シンガポール)			
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	134.5	369	35,859
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	220.07	466	45,231
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	125.3	202	19,679
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	87.5	154	14,930
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	567.37 4銘柄	1,193 <0.0%>

銘 柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC	28,317	207	33,604
SEGRO PLC	48,274	460	74,765
BRITISH LAND CO PLC	35,395	179	29,086
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	111,986 3 銘柄	847 <0.1%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千ユーロ	千円
WAREHOUSES DE PAUW SCA	6,192	190	26,817
国 小 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	6,192 1 銘柄	190 <0.0%>
ユーロ (フランス)	千口	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4.6	246	34,650
GECINA SA	1,817	173	24,483
KLEPIERRE	8,527	160	22,595
COVIVIO	2	113	15,966
国 小 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	16,944 4 銘柄	693 <0.0%>
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	23,136 5 銘柄	884 <0.0%>
フ ァ ン ド 合 計	□ 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,543,292 63 銘柄	— <2.4%>

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘 柄 別	2022年6月15日現在		
	買 建 額	売 建 額	
外	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	百万円 5,352	百万円 —
	S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	516	—
	SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	550	—
	FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	463	—
国	SWISS MKT IX FUTR (ドイツ)	447	—
	EURO STOXX 50 (ドイツ)	1,344	—

(注1) 外貨建の評価額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書 第22期 (決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日)

外国株式インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

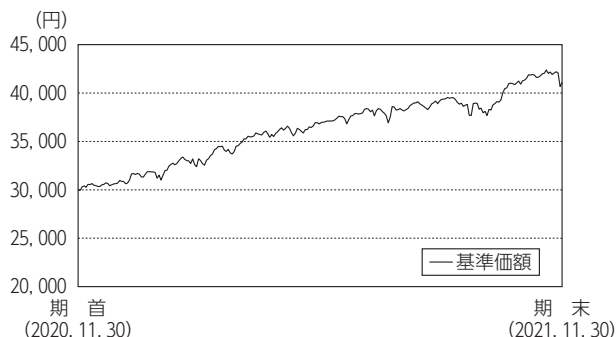
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		MSCIコクサイ指数(円ベース)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	%	%	%	%
(期首) 2020年11月30日	30,015	—	19,635	—	93.3	4.7	2.3	
12月末	30,882	2.9	20,178	2.8	94.5	3.3	2.2	
2021年1月末	31,520	5.0	20,593	4.9	93.8	4.2	2.2	
2月末	32,597	8.6	21,302	8.5	92.6	5.2	2.2	
3月末	34,778	15.9	22,626	15.2	92.5	5.3	2.2	
4月末	36,409	21.3	23,655	20.5	93.7	4.3	2.2	
5月末	36,946	23.1	23,953	22.0	92.8	5.1	2.2	
6月末	37,865	26.2	24,531	24.9	91.0	6.7	2.2	
7月末	38,400	27.9	24,862	26.6	92.0	5.7	2.2	
8月末	39,351	31.1	25,432	29.5	91.2	6.8	2.2	
9月末	38,438	28.1	24,810	26.4	92.2	5.6	2.2	
10月末	41,250	37.4	26,603	35.5	92.1	5.8	2.3	
(期末) 2021年11月30日	41,095	36.9	26,449	34.7	91.4	6.5	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.の承諾を得て、MSCIコクサイ指数(米ドルベース)をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。MSCIコクサイ指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
 (注3) 海外の指数は、基準価額への反映を考慮して、現地前営業日の終値を採用しています。
 (注4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
 (注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。
 (注6) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：30,015円 期末：41,095円 騰落率：36.9%

【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

海外株式市況は上昇しました。

海外株式市況は、当作成期首より、米国大統領選挙の不透明感が解消されたことや新型コロナウイルスのワクチン開発への期待を受け、上昇しました。2021年2月以降は、米国においてウイルスの新規感染者数の減少傾向が鮮明となったことに加え、ワクチン接種が着実に進んでいることが投資家心理を改善させ、上昇基調となりました。9月に入ると、米国や中国における経済指標の悪化をきっかけに軟調となり、その後も中国の大手不動産会社の資金繰り問題や米国の債務上限問題、米国金利の上昇に対する警戒感など複数のリスク要因が嫌気され、株価は下落しました。10月中旬以降は、米国の債務上限の一時引き上げが決定されたことなどが好感されて反発し、堅調に推移しました。11月下旬には、南アフリカでウイルスの新変異株であるオミクロン株が確認されたことが嫌気されて調整し、当作成期末を迎えました。

○為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると円安が進みました。

為替相場は、当作成期首より、米国において民主党が大統領府・議会上下両院を制したことから、株価が上昇するなど市場のリスク選好姿勢が強まり、円安となりました。2021年3月には、米国での追加経済対策の成立や、経済指標の改善により米国金利が上昇したことなどから米ドルが買い進められ、全般的に円安が進行しました。7月以降は、新型コロナウイルスの新規感染者数の増加を受けた景気への懸念などを受け、円高が進みました。9月以降は、日本以外の各国で利上げ観測が強まり、金融政策の方向性の違いを要因として、円安となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

外国株式を中心に組み入れ、S & 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34.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は36.9%となりました。

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

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

*ベンチマークはMSCIコクサイ指数(円ベース)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) (新株予約権証券) (先物・オプション) (投資信託証券)	1円 (1) (0) (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)	12 (6) (5)
合 計	14

(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

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	アメリカ	百株 15,282.5 (△ 828.54)	千アメリカ・ドル 166,102 (△ 1,904)	百株 1,904.86	千アメリカ・ドル 9,623
	カナダ	百株 1,880 (214.08)	千カナダ・ドル 10,122 (△ 32)	百株 356.08	千カナダ・ドル 732
	オーストラリア	百株 1,960.2 (301.86)	千オーストラリア・ドル 5,090 (△ 238)	百株 1,186.06	千オーストラリア・ドル 243
	香港	百株 5,643 (201.17)	千香港・ドル 21,457 (△ 19)	百株 2,647.4	千香港・ドル 5,196
	シンガポール	百株 1,052 (1,013.12)	千シンガポール・ドル 801 (△ 98)	百株 1,953.12	千シンガポール・ドル 132
	ニュージーランド	百株 344 (292)	千ニュージーランド・ドル 292 ()	百株 —	千ニュージーランド・ドル —
	イギリス	百株 11,569.5 (△ 1,546.66)	千イギリス・ポンド 7,107 (1,666)	百株 107.38	千イギリス・ポンド 63
	イスラエル	百株 294.5 ()	千イスラエル・シケル 944 ()	百株 —	千イスラエル・シケル —
	スイス	百株 548.91 ()	千スイス・フラン 4,917 (△ 90)	百株 36	千スイス・フラン 364
	デンマーク	百株 290.45 (650.6)	千デンマーク・クローネ 11,548 ()	百株 411	千デンマーク・クローネ 1,511
	ノルウェー	百株 333.5 ()	千ノルウェー・クローネ 5,172 ()	百株 —	千ノルウェー・クローネ —
	スウェーデン	百株 1,523 (2,840.43)	千スウェーデン・クローネ 32,328 ()	百株 663.5	千スウェーデン・クローネ 2,486
	ユーロ (アイルランド)	百株 57.2 ()	千ユーロ 414 ()	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (オランダ)	百株 1,074.8 (△ 72)	千ユーロ 4,391 (△ 98)	百株 335.09	千ユーロ 482
	ユーロ (ベルギー)	百株 51 ()	千ユーロ 327 ()	百株 28.4	千ユーロ 138
	ユーロ (ルクセンブルグ)	百株 143.5 ()	千ユーロ 242 ()	百株 177	千ユーロ 111
	ユーロ (フランス)	百株 748 (△ 93.56)	千ユーロ 4,645 (△ 164)	百株 230	千ユーロ 137
	ユーロ (ドイツ)	百株 804.1 (354.42)	千ユーロ 4,935 (△ 88)	百株 663.32	千ユーロ 919
	ユーロ (ポルトガル)	百株 134 ()	千ユーロ 78 ()	百株 —	千ユーロ —
ユーロ (スペイン)	百株 2,106.38 (8,378.69)	千ユーロ 1,626 (156)	百株 8,900.19	千ユーロ 346	

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	ユーロ (イタリア)	百株 2,231 ()	千ユーロ 972 (△ 1)	百株 241.75	千ユーロ 129
	ユーロ (フィンランド)	百株 269.5 ()	千ユーロ 642 ()	百株 —	千ユーロ —
国	ユーロ (オーストリア)	百株 26.8 ()	千ユーロ 104 ()	百株 21	千ユーロ 74
	ユーロ (その他)	百株 — ()	千ユーロ — (△ 2,409)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (ユーロ通貨計)	百株 7,646.28 (8,567.55)	千ユーロ 18,379 (△ 2,606)	百株 10,596.75	千ユーロ 2,340

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

(2) 新株予約権証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	買 付		売 付	
	証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	—	—	34,320	6
ス イ ス	—	—	()	()

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) ()内は、割当、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 単位未満は切捨て。

(3) 投資信託証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	買 付		売 付		
	口 数	金 額	口 数	金 額	
外 国	アメリカ	千口 56.01 (△ 27.261)	千アメリカ・ドル 4,314 ()	千口 9,654 ()	千アメリカ・ドル 441 ()
	カナダ	千口 1.6 ()	千カナダ・ドル 50 ()	千口 6.9 ()	千カナダ・ドル 125 ()
	オーストラリア	千口 79.6 (10.6)	千オーストラリア・ドル 461 ()	千口 10.6 ()	千オーストラリア・ドル 9 ()
	香港	千口 27 ()	千香港・ドル 985 ()	千口 — ()	千香港・ドル — ()
国	シンガポール	千口 75 (12.101)	千シンガポール・ドル 173 (19)	千口 63 ()	千シンガポール・ドル 89 ()
	イギリス	千口 6.55 ()	千イギリス・ポンド 63 ()	千口 — ()	千イギリス・ポンド — ()
	ユーロ (フランス)	千口 1.75 ()	千ユーロ 87 ()	千口 0.95 ()	千ユーロ 58 ()

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

(4) 先物取引の種類別取引状況

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	74,080	68,520	—	—

(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

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当 期				期 末			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
AMAZON.COM INC (アメリカ)	2.59	974,179	376,130	ALEXION PHARMACEUTICALS INC (アメリカ)	7.98	159,446	19,980
MICROSOFT CORP (アメリカ)	24.9	721,062	28,958	APPLE INC (アメリカ)	9.4	115,811	12,320
APPLE INC (アメリカ)	47.2	704,361	14,922	DEUTSCHE WOHNEN SE (ドイツ)	12.05	73,268	6,080
TESLA INC (アメリカ)	5.35	410,777	76,780	STELLANTIS NV (オランダ)	33.359	54,116	1,622
META PLATFORMS INC CLASS A (アメリカ)	8.45	304,247	36,005	XPO LOGISTICS INC (アメリカ)	3.1	47,864	15,440
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	1.08	288,548	267,174	NESTLE SA-REG (スイス)	3.6	42,658	11,849
SNOWFLAKE INC-CLASS A (アメリカ)	6	204,383	34,063	ORACLE CORP (アメリカ)	6.6	39,420	5,972
ALPHABET INC-CL C (アメリカ)	0.75	201,444	268,592	BEIGENE LTD-ADR (ケイマン諸島)	1.45	38,370	26,462
NVIDIA CORP (アメリカ)	4.22	193,934	45,956	REINSURANCE GROUP OF AMERICA (アメリカ)	2.45	31,755	12,961
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	10	172,381	17,238	ORGANON & CO (アメリカ)	8.782	27,472	3,128

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表
(1) 外国株式

銘 柄	期 首		当 期		期 末		業 種 等
	株 数	株 数	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 SOLUTIO	37.5	42.5	745	84,863	情報技術		
PALO ALTO NETWORKS INC	32.3	35.1	1,934	220,104	情報技術		
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	61	67.5	1,334	151,853	情報技術		
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	44	47.5	408	46,518	資本財・サービス		
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	17.8	21.5	263	29,942	ヘルスケア		
SYNCHRONY FINANCIAL	173	211	994	113,113	金融		
ABBOTT LABORATORIES	579.16	643.66	8,240	937,553	ヘルスケア		
HOWMET AEROSPACE INC	132.33	141.33	402	45,825	資本財・サービス		
VERISK ANALYTICS INC	51.5	56.5	1,294	147,304	資本財・サービス		
LAS VEGAS SANDS CORP	111	126.5	471	53,624	一般消費財・サービス		
AMPHENOL CORP-CL A	96.5	216	1,791	203,794	情報技術		
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	16.1	908	103,366	情報技術		
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	202.62	225.62	2,377	270,523	情報技術		
QORVO INC	38.5	40.7	613	69,845	情報技術		
AFLAC INC	225.5	236	1,314	149,552	金融		
DARDEN RESTAURANTS INC	43.5	48	680	77,409	一般消費財・サービス		
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	50.5	60.5	652	74,234	コミュニケーション・サービス		
ADOBE INC	157.7	173.2	11,907	1,354,696	情報技術		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	70.5	76.5	481	54,796	素材		
LULULEMON ATHLETICA INC	41	45.3	2,098	238,754	一般消費財・サービス		
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	144	—	—	—	金融		
GARMIN LTD	46.5	56.5	786	89,503	一般消費財・サービス		
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	73.1	79.5	2,316	263,517	素材		
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	227.5	251.5	5,222	594,180	資本財・サービス		
WR BERKLEY CORP	45.75	52.75	419	47,692	金融		
AUTOZONE INC	7.7	8.2	1,507	171,533	一般消費財・サービス		
DOLLAR TREE INC	77.21	83.21	1,176	133,813	一般消費財・サービス		
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	366.5	419	359	40,948	ヘルスケア		
PINNACLE WEST CAPITAL	38	41	271	30,921	公益事業		
CELANESE CORP	39.5	41.5	663	75,444	素材		
DR HORTON INC	113.16	125.66	1,241	141,190	一般消費財・サービス		
DENTSPLY SIRONA INC	70	79.5	387	44,038	ヘルスケア		
AUTODESK INC	72.3	80.2	2,094	238,282	情報技術		
MOODY'S CORP	55.7	61.6	2,447	278,416	金融		
DEVON ENERGY CORP	—	233	1,023	116,424	エネルギー		
ALBEMARLE CORP	35.5	43.1	1,189	135,282	素材		
ATMOS ENERGY CORP	40	48.5	454	51,757	公益事業		
ALLIANT ENERGY CORP	80.5	90.5	518	58,976	公益事業		
CITIGROUP INC	681.73	748.73	4,869	554,030	金融		
AUTOMATIC DATA PROCESSING	141.5	155	3,656	415,994	情報技術		
AMERICAN ELECTRIC POWER	164	183	1,524	173,450	公益事業		
ALLEGHANY CORP	4.8	4.8	319	36,300	金融		
DOMINO'S PIZZA INC	12.7	14.3	763	86,868	一般消費財・サービス		
HESS CORP	90	102	775	88,275	エネルギー		
DAVITA INC	27.5	27.5	266	30,319	ヘルスケア		
DANAHER CORP	208.5	232.5	7,591	863,695	ヘルスケア		
FORTIVE CORP	98.5	117	891	101,470	資本財・サービス		
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	180.5	205.5	2,710	308,378	金融		
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	184	201.5	1,305	148,574	生活必需品		
BUNGE LTD	44.5	51	461	52,556	生活必需品		

銘柄	期首		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
TE CONNECTIVITY LTD	106.75	119.25	1,900	216,245	情報技術
APPLE INC	5,678	6,056	97,041	11,040,393	情報技術
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	102	110.5	1,252	142,461	金融
BOEING CO/THE	175.6	201.3	3,995	454,602	資本財・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	51.65	55.65	659	75,000	金融
BECTON DICKINSON AND CO	94.19	106.19	2,586	294,310	ヘルスケア
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	67	76	76	8,750	一般消費財・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	43.5	49	443	50,479	資本財・サービス
CDK GLOBAL INC	40	—	—	—	情報技術
NISOURCE INC	126	139	350	39,930	公益事業
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	44.5	49	468	53,305	資本財・サービス
BOSTON BEER COMPANY INC-A	—	3.2	141	16,105	生活必需品
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	260.21	300.71	1,714	195,041	金融
VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,355.04	1,502.04	7,759	882,802	コミュニケーション・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	455.5	488.5	13,781	1,567,928	金融
ANSYS INC	27.8	32	1,272	144,795	情報技術
TRUIST FINANCIAL CORP	444.17	490.67	2,996	340,858	金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE	222	249.5	3,714	422,605	金融
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	740	810	4,425	503,527	ヘルスケア
JPMORGAN CHASE & CO	997.7	1,097.7	17,698	2,013,526	金融
T ROWE PRICE GROUP INC	77	83	1,718	195,487	金融
LKQ CORP	91.5	102.5	590	67,169	一般消費財・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	16.6	18.3	283	32,291	金融
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	100.62	114.12	846	96,324	生活必需品
CADENCE DESIGN SYS INC	93	100.5	1,876	213,459	情報技術
AMERIPRISE FINANCIAL INC	40.1	42.2	1,239	141,012	金融
DOLLAR GENERAL CORP	83.5	88.5	1,991	226,614	一般消費財・サービス
SERVICENOW INC	62.6	71.5	4,810	547,309	情報技術
CATERPILLAR INC	176.5	198.5	3,889	442,452	資本財・サービス
BROWN & BROWN INC	79.5	85.5	559	63,626	金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	73	83	402	45,741	公益事業
CHARLES RIVER LABORATORIES	—	18	675	76,858	ヘルスケア
CMS ENERGY CORP	93	106.5	651	74,068	公益事業
MOSAIC CO/THE	120.5	128	461	52,468	素材
DELTA AIR LINES INC	51.5	57.5	208	23,707	資本財・サービス
CORNING INC	246	294	1,130	128,642	情報技術
CISCO SYSTEMS INC	1,382.5	1,529.5	8,528	970,286	情報技術
IONIS PHARMACEUTICALS INC	42	—	—	—	ヘルスケア
MORGAN STANLEY	459.02	506.52	4,924	560,305	金融
ZILLOW GROUP INC - A	—	21	113	12,939	不動産
MSCI INC	28.2	30	1,936	220,312	金融
FAIR ISAAC CORP	10	10	350	39,894	情報技術
LENNOX INTERNATIONAL INC	11	12	386	43,977	資本財・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	75	85	667	75,893	情報技術
BROADCOM INC	130.52	148.12	8,359	951,003	情報技術
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	37.8	43.5	786	89,448	ヘルスケア
ARAMARK	72	85	292	33,247	一般消費財・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	72.5	—	—	—	素材
DTE ENERGY COMPANY	62.5	71.7	799	90,945	公益事業
CENTENE CORP	189.87	213.87	1,577	179,497	ヘルスケア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	35	39.5	512	58,286	金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	143	157	765	87,130	金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	61.5	75	1,236	140,628	金融
GARTNER INC	29.2	31.5	1,023	116,472	情報技術
SPLUNK INC	51.8	60.1	751	85,469	情報技術
DOMINION ENERGY INC	276.41	294.41	2,190	249,269	公益事業
MONSTER BEVERAGE CORP	128.5	143	1,241	141,297	生活必需品
SMITH (A. O.) CORP	42.5	50	404	45,997	資本財・サービス
DEERE & CO	96.5	108	3,759	427,703	資本財・サービス
POOL CORP	—	14.8	828	94,309	一般消費財・サービス
GLOBAL PAYMENTS INC	98.84	106.84	1,284	146,178	情報技術
VMWARE INC-CLASS A	28.3	74.8	900	102,443	情報技術
CABLE ONE INC	1.7	2	365	41,548	コミュニケーション・サービス
BURLINGTON STORES INC	21.9	24	704	80,104	一般消費財・サービス
NASDAQ INC	37	42	878	99,905	金融
VAIL RESORTS INC	13.6	14.9	496	56,525	一般消費財・サービス
EAST WEST BANCORP INC	46	—	—	—	金融
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	—	184	677	77,119	コミュニケーション・サービス
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	22.5	—	—	—	金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	24.3	26.3	363	41,333	金融
CONSOLIDATED EDISON INC	109	126	1,012	115,181	公益事業
COGNEX CORP	55	65	511	58,169	情報技術
TELEFLEX INC	15	17.2	531	60,456	ヘルスケア
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	28	30.5	597	67,966	資本財・サービス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	24	27.1	1,212	137,934	ヘルスケア
BIO-RAD LABORATORIES-A	7.1	7.9	592	67,369	ヘルスケア
CATALENT INC	51.5	62	830	94,491	ヘルスケア
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	44.8	50.5	1,485	168,966	ヘルスケア
MOLINA HEALTHCARE INC	20	21.2	630	71,761	ヘルスケア
IDEX CORP	25.2	27.6	646	73,609	資本財・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	268	293.5	2,280	259,485	生活必需品

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ROLLINS INC	49.25	80.87	285	32,505	資本財・サービス
AMETEK INC	74.25	84.45	1,182	134,519	資本財・サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	82	89	834	94,926	生活必需品
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	43.5	55.5	320	36,515	資本財・サービス
HEICO CORP	14	16	224	25,517	資本財・サービス
XPO LOGISTICS INC	31	—	—	—	資本財・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	—	23.2	985	112,066	資本財・サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	12.4	14	657	74,769	金融
LYONDELLBASELL INDU-CL A	88.5	97	864	98,405	素材
TYLER TECHNOLOGIES INC	13	15	781	88,959	情報技術
COSTCO WHOLESALE CORP	144.4	160.6	8,911	1,013,846	生活必需品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	26	28	331	37,739	情報技術
EPAM SYSTEMS INC	18	20	1,268	144,299	情報技術
RPM INTERNATIONAL INC	43.5	46	427	48,681	素材
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	8.8	10	1,678	190,917	一般消費財・サービス
UGI CORP	70.5	76.5	332	37,772	公益事業
CUMMINS INC	48.5	53.5	1,162	132,245	資本財・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	253	283.5	1,709	194,522	コミュニケーション・サービス
CDW CORP/DE	46.5	51	993	113,028	情報技術
SIGNATURE BANK	16.5	—	—	—	金融
COSTAR GROUP INC	13.1	145	1,159	131,956	資本財・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	17.1	20.2	1,463	166,501	金融
AMERCO	2.9	3.7	265	30,191	資本財・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	31.5	36.4	1,300	147,932	資本財・サービス
MERCADOLIBRE INC	14.8	16.1	1,986	226,049	一般消費財・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	25	27.6	420	47,826	情報技術
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	90.16	100.16	1,382	157,333	一般消費財・サービス
IPG PHOTONICS CORP	11.7	14.2	231	26,362	情報技術
DEXCOM INC	30	35.4	2,021	229,971	ヘルスケア
NORDSON CORP	17.3	19.1	500	56,965	資本財・サービス
COPART INC	68.5	78.3	1,158	131,850	資本財・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	51.5	—	—	—	エネルギー
SEAGEN INC	39.5	49.5	818	93,096	ヘルスケア
ALIGN TECHNOLOGY INC	25.1	27.1	1,719	195,617	ヘルスケア
TRANSDIGM GROUP INC	17.1	18.9	1,104	125,622	資本財・サービス
BIO-TECHNE CORP	—	14	671	76,404	ヘルスケア
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	28	33.5	283	32,296	ヘルスケア
HORIZON THERAPEUTICS PLC	—	77.5	791	90,005	ヘルスケア
NIELSEN HOLDINGS PLC	111	—	—	—	資本財・サービス
KINDER MORGAN INC	673.81	733.81	1,174	133,660	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	90	98	2,253	256,348	ヘルスケア
MARKETAXESS HOLDINGS INC	12.2	14	494	56,218	金融
COTERRA ENERGY INC	124	290	604	68,758	エネルギー
T-MOBILE US INC	183.27	226.77	2,571	292,567	コミュニケーション・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	45.5	59.5	322	36,730	不動産
COCA-COLA CO/THE	1,336	1,486.5	8,113	923,052	生活必需品
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	65	73.5	380	43,332	生活必需品
EXPEDITORS INTL WASH INC	55.5	61.5	779	88,692	資本財・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	95	111.5	376	42,813	金融
CSX CORP	252.5	821	2,924	332,709	資本財・サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	31.3	34.6	1,010	114,912	ヘルスケア
EXPEDIA GROUP INC	43.75	51.75	861	98,028	一般消費財・サービス
AUTOLIV INC	27.5	29.5	282	32,196	一般消費財・サービス
AMAZON.COM INC	138.8	164.7	58,659	6,673,641	一般消費財・サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	202.4	226.9	2,512	285,791	ヘルスケア
EXXON MOBIL CORP	1,384.05	1,536.05	9,460	1,076,324	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	42	—	—	—	その他
AES CORP	219	246	581	66,106	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	13.5	15	396	45,116	金融
EOG RESOURCES INC	193	210	1,856	211,178	エネルギー
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	52	60	685	77,996	情報技術
ABIOMED INC	15.2	16.1	513	58,453	ヘルスケア
AMERISOURCEBERGEN CORP	49.5	56.8	682	77,694	ヘルスケア
AGILENT TECHNOLOGIES INC	101.4	111.7	1,713	194,967	ヘルスケア
FORD MOTOR CO	1,263.23	1,433.23	2,819	320,736	一般消費財・サービス
NOVAVAX INC	—	26	504	57,373	ヘルスケア
DISCOVERY INC - A	46.9	62.9	154	17,596	コミュニケーション・サービス
EXACT SCIENCES CORP	48.5	62.5	541	61,556	ヘルスケア
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48.87	56.37	155	17,726	コミュニケーション・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	8.5	8.5	132	15,118	コミュニケーション・サービス
DISCOVERY INC-C	103.89	113.89	273	31,162	コミュニケーション・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	40	—	—	—	資本財・サービス
FORTINET INC	48	50.5	1,733	197,239	情報技術
MARKEL CORP	4.6	5.1	634	72,165	金融
NEXTERA ENERGY INC	640.8	711.8	6,310	717,981	公益事業
MASIMO CORP	17	19.2	553	62,973	ヘルスケア
FREEMPORT-MCMORAN INC	472.08	536.08	2,036	231,639	素材
INSULET CORP	22.2	24.4	721	82,133	ヘルスケア
US BANCORP	441.5	512	2,938	334,356	金融
UNITED RENTALS INC	23.5	25.7	917	104,388	資本財・サービス
F5 NETWORKS INC	19	22.5	519	59,149	情報技術

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
FASTENAL CO	186	210.5	1,282	145,942	資本財・サービス
FISERV INC	185.83	219.33	2,137	243,218	情報技術
GENERAL ELECTRIC CO	2,880.5	398.56	3,921	446,186	資本財・サービス
GENERAL MOTORS CO	426	476.5	2,852	324,509	一般消費財・サービス
ZENDESK INC	—	43.7	415	47,286	情報技術
GENERAL DYNAMICS CORP	79.5	87.5	1,701	193,562	資本財・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	107.6	123.5	4,773	543,111	金融
ALPHABET INC-CL A	98.2	109	31,725	3,609,427	コミュニケーション・サービス
ALPHABET INC-CL C	98.87	105.57	30,850	3,509,862	コミュニケーション・サービス
OWENS CORNING	33.5	39	339	38,659	資本財・サービス
GENERAL MILLS INC	200.5	220.5	1,400	159,348	生活必需品
FIRSTENERGY CORP	180.68	197.68	771	87,823	公益事業
GENUINE PARTS CO	48.5	51	677	77,117	一般消費財・サービス
IHS MARKIT LTD	125.84	138.84	1,806	205,551	資本財・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	230	259	1,113	126,676	金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	71.6	75.5	1,620	184,402	資本財・サービス
HALLIBURTON CO	276	326	725	82,523	エネルギー
HOME DEPOT INC	352	385.5	15,682	1,784,244	一般消費財・サービス
ASSURANT INC	19	22.5	351	39,943	金融
HUNTINGTON BANCSHARES INC	318	529	813	92,503	金融
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	12.9	15.1	274	31,218	資本財・サービス
HERSHEY CO/THE	47.4	53.9	965	109,864	生活必需品
HUMANA INC	43.5	47.2	2,020	229,871	ヘルスケア
NXP SEMICONDUCTORS NV	93	101	2,261	257,324	情報技術
RINGCENTRAL INC-CLASS A	23.6	28.2	626	71,250	情報技術
HENRY SCHEIN INC	45	51	376	42,803	ヘルスケア
HP INC	473	473	1,699	193,350	情報技術
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	419	476	695	79,119	情報技術
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	59.78	59.78	297	33,822	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	65	70	420	47,823	コミュニケーション・サービス
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	29.5	29.5	147	16,744	コミュニケーション・サービス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	132	144	600	68,365	金融
KRAFT HEINZ CO/THE	217.53	243.03	845	96,165	生活必需品
ENPHASE ENERGY INC	—	46.9	1,203	136,975	情報技術
INTL BUSINESS MACHINES CORP	291.5	324	3,839	436,808	情報技術
INTERNATIONAL PAPER CO	122	137.5	649	73,868	素材
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	43.5	49	504	57,397	資本財・サービス
ZOETIS INC	156	173	3,867	439,995	ヘルスケア
TRANE TECHNOLOGIES PLC	79.79	87.79	1,693	192,695	資本財・サービス
CHENIERE ENERGY INC	76.5	88.5	943	107,331	エネルギー
ALLEGION PLC	29	33	424	48,311	資本財・サービス
LIBERTY GLOBAL PLC- C	129.73	129.73	362	41,208	コミュニケーション・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	85.07	94.87	1,301	148,074	資本財・サービス
JUNIPER NETWORKS INC	105	122	388	44,193	情報技術
SAREPTA THERAPEUTICS INC	24	—	—	—	ヘルスケア
JM SMUCKER CO/THE	36.7	40.5	523	59,609	生活必需品
JOHNSON & JOHNSON	862	955	15,256	1,735,689	ヘルスケア
PLUG POWER INC	—	186	774	88,072	資本財・サービス
ABBVIE INC	577.72	640.72	7,489	852,066	ヘルスケア
HOLOGIC INC	83.5	91.5	695	79,084	ヘルスケア
KIMBERLY-CLARK CORP	112.5	122	1,647	187,434	生活必需品
KROGER CO	255	264	1,118	127,199	生活必需品
KLA CORP	50.3	55.6	2,300	261,779	情報技術
LOCKHEED MARTIN CORP	82.6	90.3	3,081	350,560	資本財・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	27.8	29.3	624	70,996	情報技術
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	—	97	735	83,727	一般消費財・サービス
LOWE'S COS INC	244.5	260	6,463	735,304	一般消費財・サービス
ELI LILLY & CO	281.85	295.35	7,526	856,278	ヘルスケア
LAM RESEARCH CORP	48.2	52	3,538	402,610	情報技術
JONES LANG LASALLE INC	16.5	—	—	—	不動産
LOEWS CORP	83	83	457	52,039	金融
LINCOLN NATIONAL CORP	62.49	66.49	454	51,696	金融
MCDONALD'S CORP	243	270.5	6,770	770,292	一般消費財・サービス
3M CO	188.5	210.4	3,707	421,845	資本財・サービス
META PLATFORMS INC CLASS A	787.5	869	29,374	3,341,971	コミュニケーション・サービス
S&P GLOBAL INC	79	87.7	4,077	463,889	金融
MARTIN MARIETTA MATERIALS	21.1	23.1	966	109,943	素材
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	—	19.2	666	75,843	情報技術
CONCHO RESOURCES INC	62	—	—	—	その他
PHILLIPS 66	141.5	157.5	1,100	125,180	エネルギー
MGM RESORTS INTERNATIONAL	152.5	160.5	660	75,103	一般消費財・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	40.5	92	800	91,051	生活必需品
METLIFE INC	255.5	270	1,617	183,969	金融
MARVELL TECHNOLOGY INC	217	299.5	2,246	255,624	情報技術
ARISTA NETWORKS INC	18.7	84.8	1,073	122,139	情報技術
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	48	48	404	46,008	金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	56.58	62.28	1,616	183,871	情報技術
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	8	8.5	1,305	148,559	ヘルスケア
BAKER HUGHES CO	213.73	265.23	624	71,002	エネルギー
ROCKWELL AUTOMATION INC	37.6	41.9	1,427	162,353	資本財・サービス
MERCK & CO. INC.	826.21	918.21	6,876	782,336	ヘルスケア

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
DUPONT DE NEMOURS INC	242.18	207.51	1,598	181,879	素材
MASCO CORP	87	91	612	69,717	資本財・サービス
M & T BANK CORP	42.89	46.89	713	81,172	金融
MARSH & MCLENNAN COS	168.5	185.2	3,093	351,935	金融
BLACK KNIGHT INC	50	56	409	46,598	情報技術
HEICO CORP-CLASS A	25	27.2	345	39,300	資本財・サービス
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	91.22	101.72	1,533	174,481	一般消費財・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	56.8	69	1,942	221,051	情報技術
WAYFAIR INC- CLASS A	21	27.1	724	82,477	一般消費財・サービス
SQUARE INC - A	118	142	3,022	343,898	情報技術
TRANSUNION	61.5	69	787	89,593	資本財・サービス
VISTRA CORP	142.5	156.5	314	35,770	公益事業
BEIGENE LTD-ADR	14.5	—	—	—	ヘルスケア
NOVOCLURE LTD	—	34.5	322	36,640	ヘルスケア
NETAPP INC	74.5	82	750	85,380	情報技術
NIKE INC -CL B	406	462	7,847	892,866	一般消費財・サービス
NORFOLK SOUTHERN CORP	84.5	90.5	2,432	276,699	資本財・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	80	201	1,696	193,003	情報技術
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	41.5	68.55	689	78,433	金融
ALLY FINANCIAL INC	125.5	136.5	651	74,091	金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	52.2	57.1	2,034	231,520	資本財・サービス
APTIV PLC	87	97.5	1,613	183,571	一般消費財・サービス
NEWMONT CORP	264.61	293.11	1,623	184,743	素材
MCKESSON CORP	52.5	57.5	1,283	146,058	ヘルスケア
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	87	—	—	—	情報技術
XYLEM INC	58.7	66.7	825	93,945	資本財・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	510	565	4,935	561,486	生活必需品
NUCOR CORP	99	109.5	1,227	139,614	素材
SUNRUN INC	39	61	291	33,214	資本財・サービス
WESTERN UNION CO	129.46	152.46	246	28,030	情報技術
GODADDY INC - CLASS A	57	60	414	47,162	情報技術
NEWELL BRANDS INC	125.42	134.42	300	34,179	一般消費財・サービス
EVERGY INC	74	82.5	538	61,253	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	302.24	343.24	1,031	117,385	エネルギー
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	8.2	9	183	20,907	金融
OKTA INC	38.6	45.1	1,008	114,734	情報技術
COUPA SOFTWARE INC	21.8	25.5	516	58,794	情報技術
LIBERTY BROADBAND-C	36	56	895	101,899	コミュニケーション・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	133.55	157.55	475	54,113	ヘルスケア
LINDE PLC	171.96	188.46	6,044	687,701	素材
WIX.COM LTD	17.8	21.3	339	38,620	情報技術
EQUITABLE HOLDINGS INC	133	143	461	52,451	金融
KKR & CO INC	163	188	1,434	163,217	金融
PAYCHEX INC	107	117	1,447	164,698	情報技術
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	24.1	24.8	1,597	181,746	一般消費財・サービス
ALTRIA GROUP INC	611.5	667	2,900	329,946	生活必需品
P G & E CORP	355	551	682	77,606	公益事業
PFIZER INC	1,819.13	2,031.13	10,643	1,210,867	ヘルスケア
CIGNA CORP	121.6	126.2	2,519	286,595	ヘルスケア
DELL TECHNOLOGIES -C	78.51	101.01	581	66,158	情報技術
ALTICE USA INC- A	109	109	174	19,829	コミュニケーション・サービス
XCEL ENERGY INC	174.5	197	1,292	147,004	公益事業
STERIS PLC	28.5	36	816	92,845	ヘルスケア
SEA LTD-ADR	—	27	804	91,527	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS B	54.33	54.33	187	21,318	コミュニケーション・サービス
FOX CORP - CLASS A	108.49	121.99	450	51,240	コミュニケーション・サービス
STRYKER CORP	111.2	123.3	3,002	341,577	ヘルスケア
LYFT INC-A	—	92	384	43,772	資本財・サービス
DOW INC	240.68	273.68	1,556	177,042	素材
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	28	38.5	374	42,618	金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	51.8	77.4	1,694	192,829	情報技術
PARKER HANNIFIN CORP	41.7	46.6	1,440	163,896	資本財・サービス
UBER TECHNOLOGIES INC	315	445	1,766	200,991	資本財・サービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	53.5	84.5	1,549	176,274	エネルギー
PROCTER & GAMBLE CO/THE	809.17	886.67	13,213	1,503,260	生活必需品
EXELON CORP	322.72	357.72	1,937	220,460	公益事業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	73.5	—	—	—	その他
TELADOC HEALTH INC	23	51	542	61,741	ヘルスケア
INGERSOLL-RAND INC	113.58	147.08	879	100,065	資本財・サービス
NVR INC	1.1	1.2	633	72,108	一般消費財・サービス
CONOCOPHILLIPS	355	492.02	3,549	403,874	エネルギー
TWILIO INC - A	40.5	59.5	1,744	198,496	情報技術
DOCUSIGN INC	57.5	71	1,785	203,153	情報技術
PAYCOM SOFTWARE INC	16.1	18.9	845	96,208	情報技術
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	50	564	64,262	情報技術
PEPSICO INC	454	501	8,223	935,577	生活必需品
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	13	15	265	30,199	情報技術
DROPBOX INC-CLASS A	80	114	284	32,359	情報技術
MONGODB INC	16.2	20.2	1,062	120,878	情報技術
SNAP INC - A	295	347.5	1,697	193,128	コミュニケーション・サービス
CORTEVA INC	248.18	269.18	1,254	142,680	素材

銘柄	期首		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千アメリカ・ドル	千円			
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	128	143	1,501	170,874			金融
AMCOR PLC	522	564	653	74,304			素材
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	46.5	69	1,549	176,290			情報技術
ROKU INC	33.5	42.2	976	111,039			コミュニケーション・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	60	65.5	1,135	129,156			公益事業
ACCENTURE PLC-CL A	208.5	230.5	8,432	959,325			情報技術
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	126	—	—	—			情報技術
10X GENOMICS INC-CLASS A	—	27.5	397	45,193			ヘルスケア
PENTAIR PLC	55.05	59.25	455	51,769			資本財・サービス
QUALCOMM INC	364.5	408.5	7,505	853,932			情報技術
INVESCO LTD	120	141	327	37,280			金融
ADVANCE AUTO PARTS INC	23.5	23.5	534	60,762			一般消費財・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	92	100	709	80,685			金融
DATADOG INC - CLASS A	43.5	68	1,244	141,567			情報技術
PINTEREST INC- CLASS A	131	199	806	91,783			コミュニケーション・サービス
AVALARA INC	25	30.5	435	49,516			情報技術
REGENERON PHARMACEUTICALS	33.2	38	2,486	282,914			ヘルスケア
REPUBLIC SERVICES INC	74	82.5	1,140	129,743			資本財・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	13.5	15	3,273	372,370			一般消費財・サービス
ROSS STORES INC	118	131	1,462	166,416			一般消費財・サービス
PACKAGING CORP OF AMERICA	31	34.5	461	52,478			素材
RESMED INC	48.5	53.3	1,369	155,794			ヘルスケア
QUEST DIAGNOSTICS INC	43.5	47.3	741	84,325			ヘルスケア
ROBERT HALF INTL INC	36	41.5	476	54,183			資本財・サービス
MODERNA INC	88	123.7	4,558	518,616			ヘルスケア
RALPH LAUREN CORP	14.5	—	—	—			一般消費財・サービス
HUBSPOT INC	—	15.9	1,354	154,105			情報技術
PERKINELMER INC	37.3	41.3	764	87,029			ヘルスケア
CARRIER GLOBAL CORP	266.37	302.37	1,692	192,574			資本財・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	137.18	149.38	1,248	142,043			資本財・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	58	63	462	52,573			金融
AVANTOR INC	155	193.5	769	87,573			ヘルスケア
CARLYLE GROUP INC/THE	47	57	323	36,834			金融
DYNATRACE INC	61	67	431	49,142			情報技術
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	13.3	158.2	1,693	192,691			情報技術
REGIONS FINANCIAL CORP	321.35	351.85	828	94,230			金融
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	—	65.5	270	30,806			ヘルスケア
IAC/INTERACTIVECORP	25.3	28.8	376	42,860			コミュニケーション・サービス
MATCH GROUP INC	81.7	93.7	1,256	142,932			コミュニケーション・サービス
CHEVRON CORP	610.18	701.18	8,053	916,195			エネルギー
PELOTON INTERACTIVE INC-A	65	94	417	47,472			一般消費財・サービス
ZSCALER INC	24	30	1,067	121,479			情報技術
EDISON INTERNATIONAL	123.5	140	924	105,234			公益事業
ETSY INC	—	46.5	1,308	148,911			一般消費財・サービス
TESLA INC	242.7	296.2	33,677	3,831,505			一般消費財・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	10	70	2,553	290,507			情報技術
NORTONLIFELOCK INC	178.5	214	541	61,621			情報技術
DRAFTKINGS INC - CL A	—	117	411	46,855			一般消費財・サービス
UNITY SOFTWARE INC	—	21	357	40,694			情報技術
STANLEY BLACK & DECKER INC	50.22	58.52	1,077	122,603			資本財・サービス
SYNOPSYS INC	50.4	55.8	1,985	225,919			情報技術
CARVANA CO	—	26.2	764	87,029			一般消費財・サービス
CHEWY INC - CLASS A	—	32.5	223	25,387			一般消費財・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	—	85	1,624	184,792			情報技術
PPD INC	—	44	207	23,627			ヘルスケア
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	46.85	47.85	3,197	363,755			コミュニケーション・サービス
VIATRIS INC	386.21	433.21	542	61,706			ヘルスケア
DOORDASH INC - A	—	27	494	56,216			一般消費財・サービス
AIRBNB INC-CLASS A	—	46	828	94,243			一般消費財・サービス
CBRE GROUP INC - A	108.5	121.5	1,190	135,410			不動産
TWITTER INC	259.5	292	1,336	152,085			コミュニケーション・サービス
SOUTHERN CO/THE	347.5	386.5	2,427	276,232			公益事業
SYSCO CORP	160	187.5	1,372	156,149			生活必需品
TRAVELERS COS INC/THE	84.03	91.03	1,387	157,832			金融
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	—	20	100	11,488			金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	43	43	264	30,096			金融
STEEL DYNAMICS INC	66	76.5	469	53,438			素材
SCHLUMBERGER LTD	460.02	503.52	1,492	169,851			エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	50.5	58.5	338	38,535			資本財・サービス
AT&T INC	2,332.91	2,589.91	6,187	703,928			コミュニケーション・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	47	55.5	247	28,123			資本財・サービス
ON SEMICONDUCTOR CORP	129	155	976	111,131			情報技術
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	75	701	79,764			一般消費財・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	26.9	91.7	3,065	348,744			素材
SEMPRA ENERGY	96.7	114	1,415	161,084			公益事業
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	—	65	325	37,019			情報技術
CLARIVATE PLC	—	125	285	32,467			資本財・サービス
OAK STREET HEALTH INC	—	36	110	12,561			ヘルスケア
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	—	560	1,179	134,239			情報技術
TIFFANY & CO	36.5	—	—	—			その他
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	76.5	79.5	827	94,119			情報技術

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
TEXAS INSTRUMENTS INC	297.5	335	6,511	740,839	情報技術
SALESFORCE.COM INC	294.21	352.16	10,449	1,188,896	情報技術
WESTROCK CO	85.3	98.8	455	51,841	素材
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	244.84	259.34	2,032	231,202	資本財・サービス
TERADYNE INC	55	60.5	934	106,309	情報技術
UNION PACIFIC CORP	219.8	240.8	5,766	656,020	資本財・サービス
MARATHON PETROLEUM CORP	215.88	234.88	1,451	165,090	エネルギー
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	494.79	549.29	4,555	518,314	資本財・サービス
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	230.5	262	5,361	609,985	資本財・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	62.44	70.44	1,878	213,724	ヘルスケア
VOYA FINANCIAL INC	43.5	43.5	270	30,807	金融
AMEREN CORPORATION	80.5	92	782	89,062	公益事業
UNITEDHEALTH GROUP INC	310.16	342.16	15,465	1,759,524	ヘルスケア
VERISIGN INC	33.7	37	904	102,905	情報技術
VALERO ENERGY CORP	131.42	147.92	1,008	114,722	エネルギー
ULTA BEAUTY INC	17.6	18.9	758	86,315	一般消費財・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	86.88	98.88	493	56,191	金融
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	25	28.3	343	39,045	ヘルスケア
ANTHEM INC	83	89.2	3,712	422,391	ヘルスケア
WALT DISNEY CO/THE	591.62	658.62	9,735	1,107,558	コミュニケーション・サービス
WELLS FARGO & CO	1,274.22	1,499.22	7,370	838,503	金融
WASTE MANAGEMENT INC	140	152	2,535	288,499	資本財・サービス
WILLIAMS COS INC	402	438	1,226	139,577	エネルギー
TRACTOR SUPPLY COMPANY	37	42.5	963	109,614	一般消費財・サービス
WHIRLPOOL CORP	19.5	23.2	516	58,801	一般消費財・サービス
WALMART INC	464	561	8,001	910,335	生活必需品
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	67.5	76.5	944	107,487	ヘルスケア
WYNN RESORTS LTD	30.5	37	307	34,938	一般消費財・サービス
WABTEC CORP	58.61	65.11	602	68,497	資本財・サービス
TJX COMPANIES INC	394	438	3,095	352,157	一般消費財・サービス
WATERS CORP	20.5	22.3	760	86,569	ヘルスケア
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	17.6	18.9	1,147	130,563	情報技術
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	247	265	1,221	138,926	生活必需品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	41.73	47.43	1,092	124,321	金融
WESTERN DIGITAL CORP	97.5	112.5	663	75,502	情報技術
WEC ENERGY GROUP INC	104.8	114.3	1,034	117,672	公益事業
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	168	182.5	1,172	133,402	公益事業
VISA INC-CLASS A SHARES	552	612.5	12,022	1,367,829	情報技術
PPL CORP	248	279	793	90,273	公益事業
PULTEGROUP INC	89	94.5	486	55,379	一般消費財・サービス
PPG INDUSTRIES INC	78.5	85.3	1,342	152,711	素材
NORTHERN TRUST CORP	64	73	875	99,612	金融
NVIDIA CORP	201	903.8	30,165	3,431,898	情報技術
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	138.43	154.63	3,106	353,393	金融
HD SUPPLY HOLDINGS INC	53	—	—	—	その他
TYSON FOODS INC-CL A	98	108.5	888	101,073	生活必需品
NETFLIX INC	144	160.7	10,667	1,213,687	コミュニケーション・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	129.2	142.4	9,238	1,051,062	ヘルスケア
NRG ENERGY INC	79.5	86.5	316	36,047	公益事業
GLOBE LIFE INC	32.25	36.55	323	36,788	金融
FIRST REPUBLIC BANK/CA	57	64.5	1,383	157,366	金融
TEXTRON INC	71.5	83	604	68,734	資本財・サービス
NEWS CORP - CLASS A	131.37	141.37	308	35,094	コミュニケーション・サービス
OGE ENERGY CORP	67.5	—	—	—	公益事業
OMNICOM GROUP	71.5	79.5	536	61,024	コミュニケーション・サービス
ORACLE CORP	720.33	681.33	6,332	720,423	情報技術
MASTERCARD INC - A	292	320.5	10,352	1,177,800	情報技術
ONEOK INC	144	164	1,024	116,539	エネルギー
LUMEN TECHNOLOGIES INC	311.52	347.52	450	51,200	コミュニケーション・サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	34.2	38	1,829	208,156	資本財・サービス
YUM! BRANDS INC	98	108.5	1,358	154,609	一般消費財・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	37	42.5	720	82,005	コミュニケーション・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	60.5	69.5	315	35,842	生活必需品
BANK OF AMERICA CORP	2,556.01	2,794.01	12,737	1,449,189	金融
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	12.1	17.2	742	84,512	情報技術
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	58.5	67.5	589	67,118	ヘルスケア
AMERICAN EXPRESS CO	226	247.5	3,907	444,503	金融
ANALOG DEVICES INC	121.99	193.91	3,552	404,160	情報技術
ADVANCED MICRO DEVICES	383	441.5	7,148	813,265	情報技術
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	283.22	311.72	1,712	194,876	金融
SKYWORKS SOLUTIONS INC	55	59.5	921	104,870	情報技術
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	59	84.5	590	67,189	一般消費財・サービス
AVERY DENNISON CORP	27.5	30.3	653	74,298	素材
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	179	191.5	1,526	173,663	情報技術
EMERSON ELECTRIC CO	197	215.5	1,958	222,765	資本財・サービス
AON PLC-CLASS A	76.2	82.4	2,444	278,136	金融
AMGEN INC	192.5	208.5	4,242	482,652	ヘルスケア
EATON CORP PLC	130.86	145.86	2,441	277,758	資本財・サービス
CONSTELLATION BRANDS INC-A	55.8	62.5	1,418	161,389	生活必需品
APPLIED MATERIALS INC	302	332.5	5,028	572,042	情報技術
CME GROUP INC	118	131.2	2,956	336,341	金融

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
NOV INC	116.94	—	—	—	エネルギー
ECOLAB INC	84.5	94	2,135	242,922	素材
EQUIFAX INC	40.5	44.3	1,258	143,166	資本財・サービス
GILEAD SCIENCES INC	411.5	456.5	3,225	366,927	ヘルスケア
KEURIG DR PEPPER INC	115	255	896	102,032	生活必需品
HORMEL FOODS CORP	96	105.5	448	50,999	生活必需品
STATE STREET CORP	117.43	124.63	1,161	132,135	金融
SCHWAB (CHARLES) CORP	502.9	525.4	4,208	478,795	金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	169	182	1,383	157,428	ヘルスケア
CAMPBELL SOUP CO	60	70	288	32,811	生活必需品
CROWN HOLDINGS INC	45.5	49.8	539	61,416	素材
CARDINAL HEALTH INC	94.5	104	493	56,166	ヘルスケア
FEDEX CORP	82	92	2,213	251,800	資本財・サービス
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	151.04	165.04	2,426	276,053	金融
FMC CORP	42	46.5	481	54,775	素材
CERNER CORP	100.5	108.5	790	89,938	ヘルスケア
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	28.24	90.13	1,326	150,929	素材
CITRIX SYSTEMS INC	38	46	378	43,107	情報技術
INTEL CORP	1,386	1,465	7,325	833,365	情報技術
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	124	142	483	54,960	コミュニケーション・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	116.5	131.5	902	102,645	金融
ILLINOIS TOOL WORKS	103	115.5	2,750	312,886	資本財・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	346	386	242	27,534	コミュニケーション・サービス
ILLUMINA INC	48.5	53.3	1,976	224,856	ヘルスケア
SEALED AIR CORP	50	54	346	39,441	素材
INTUITIVE SURGICAL INC	38.2	128.7	4,308	490,132	ヘルスケア
CHECK POINT SOFTWARE TECH	40.5	43.5	483	54,988	情報技術
SNAP-ON INC	16.3	20.2	429	48,909	資本財・サービス
CARMAX INC	53.5	58	849	96,657	一般消費財・サービス
COMERICA INC	45	—	—	—	金融
INGREDION INC	21.5	—	—	—	生活必需品
DUKE ENERGY CORP	241.78	280.28	2,808	319,576	公益事業
TARGET CORP	162.8	179.5	4,472	508,827	一般消費財・サービス
DOVER CORP	48	52	893	101,637	資本財・サービス
WW GRAINGER INC	14.9	15.8	783	89,083	資本財・サービス
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	42.5	47.2	689	78,449	資本財・サービス
CINTAS CORP	29.4	34.2	1,486	169,150	資本財・サービス
CONAGRA BRANDS INC	158	173	545	62,018	生活必需品
LAMB WESTON HOLDINGS INC	47.5	54.5	290	33,042	生活必需品
CLOROX COMPANY	40.5	44.3	749	85,256	生活必需品
ENTERGY CORP	66.5	74.2	779	88,697	公益事業
MICROSOFT CORP	2,359	2,596	87,389	9,942,263	情報技術
INCYTE CORP	60	69.3	487	55,481	ヘルスケア
CVS HEALTH CORP	429.69	477.69	4,395	500,099	ヘルスケア
MEDTRONIC PLC	438.98	488.98	5,392	613,501	ヘルスケア
MICRON TECHNOLOGY INC	366.5	408.5	3,518	400,336	情報技術
BLACKROCK INC	50	55.1	5,113	581,737	金融
CENTERPOINT ENERGY INC	158	211	561	63,830	公益事業
HASBRO INC	44	47	465	53,006	一般消費財・サービス
KELLOGG CO	84	93	593	67,578	生活必需品
KEYCORP	326	354	808	91,946	金融
KANSAS CITY SOUTHERN	31.5	33.5	992	112,886	資本財・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	468.11	510.61	3,096	352,270	生活必需品
COOPER COS INC/THE	17.7	17.7	674	76,761	ヘルスケア
CHUBB LTD	148.69	162.19	3,001	341,442	金融
ARROW ELECTRONICS INC	27	27	335	38,219	情報技術
ALLSTATE CORP	102.5	109.5	1,238	140,947	金融
EBAY INC	256.5	249	1,756	199,859	一般消費財・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	365	405	7,583	862,742	情報技術
EASTMAN CHEMICAL CO	45.5	50.5	556	63,302	素材
XILINX INC	80	88.5	2,062	234,679	情報技術
DISH NETWORK CORP-A	82	89	294	33,545	コミュニケーション・サービス
ZIONS BANCORP NA	52	—	—	—	金融
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	74.5	84.7	2,880	327,683	生活必需品
TRIMBLE INC	82.5	90.5	783	89,092	情報技術
LENNAR CORP-A	90	100.5	1,077	122,628	一般消費財・サービス
LEAR CORP	18	21.5	363	41,338	一般消費財・サービス
PROGRESSIVE CORP	193	213.9	2,031	231,113	金融
PACCAR INC	114.87	125.37	1,079	122,835	資本財・サービス
BIOGEN INC	56.2	55.2	1,303	148,279	ヘルスケア
IDEXX LABORATORIES INC	27.7	30.9	1,950	221,933	ヘルスケア
STARBUCKS CORP	383.5	427.5	4,733	538,553	一般消費財・サービス
PTC INC	37	40.2	443	50,455	情報技術
PERRIGO CO PLC	42	—	—	—	ヘルスケア
EVERSOURCE ENERGY	109.8	124.1	1,058	120,391	公益事業
INTUIT INC	85.7	98.8	6,863	780,830	情報技術
BORGWARNER INC	82	87.5	392	44,607	一般消費財・サービス
BEST BUY CO INC	76	82.5	915	104,137	一般消費財・サービス
BALL CORP	105.84	119.84	1,136	129,265	素材
BOSTON SCIENTIFIC CORP	470.97	517.97	1,998	227,408	ヘルスケア
ELECTRONIC ARTS INC	95.7	105.7	1,319	150,174	コミュニケーション・サービス

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
VULCAN MATERIALS CO	43.5	49	976	111,132	素材	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	85.5	93.5	1,777	202,229	ヘルスケア	
VF CORP	109	122.5	903	102,756	一般消費財・サービス	
VIACOMCBS INC - CLASS B	183.75	220.25	710	80,886	コミュニケーション・サービス	
MOHAWK INDUSTRIES INC	19	22	383	43,646	一般消費財・サービス	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	30.7	—	—	—	その他	
CARNIVAL CORP	153	300	544	61,981	一般消費財・サービス	
COMCAST CORP-CLASS A	1,490.9	1,660.9	8,558	973,713	コミュニケーション・サービス	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	72	—	—	—	その他	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	75	83	484	55,118	資本財・サービス	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	90	—	—	—	生活必需品	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	403	448	249	28,338	不動産	
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	102,065.16	114,614.26	1,496,632	170,271,878	
	銘柄数 < 比率 >	591銘柄	598銘柄		<67.9%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
IMPERIAL OIL LTD	83	91	389	34,805	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	7	7	1,543	137,792	情報技術	
RESTAURANT BRANDS INTERN	92.87	96.87	706	63,085	一般消費財・サービス	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	149	161	868	77,530	素材	
INTACT FINANCIAL CORP	46.5	64.5	1,040	92,899	金融	
BCE INC	49.3	49.3	319	28,541	コミュニケーション・サービス	
FRANCO-NEVADA CORP	62	69	1,241	110,836	素材	
SUNCOR ENERGY INC	501.3	542.3	1,732	154,656	エネルギー	
METRO INC/CN	82	86	534	47,708	生活必需品	
NATIONAL BANK OF CANADA	110	120	1,222	109,114	金融	
BANK OF NOVA SCOTIA	399	435	3,542	316,177	金融	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	146.5	159.5	2,322	207,276	金融	
TORONTO-DOMINION BANK	594	652	6,102	544,670	金融	
GREAT-WEST LIFECO INC	91	98	367	32,759	金融	
ROYAL BANK OF CANADA	467.5	510.5	6,622	591,143	金融	
TC ENERGY CORP	310.5	352.5	2,150	191,994	エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	178.29	197.29	760	67,886	エネルギー	
BARRICK GOLD CORP	586	633	1,546	138,033	素材	
CAE INC	79	109	343	30,686	資本財・サービス	
THOMSON REUTERS CORP	57.12	62.12	969	86,499	資本財・サービス	
EMPIRE CO LTD 'A'	53	59	218	19,543	生活必需品	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	35	373	33,343	素材	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	—	78	152	13,625	資本財・サービス	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	46.5	54.5	345	30,871	素材	
HYDRO ONE LTD	105	113	351	31,388	公益事業	
LOBLAW COMPANIES LTD	59.6	59.6	577	51,528	生活必需品	
NORTHLAND POWER INC	—	79	306	27,388	公益事業	
WSP GLOBAL INC	37	43	781	69,793	資本財・サービス	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	—	28	310	27,727	資本財・サービス	
PARKLAND CORP	44	51	174	15,555	エネルギー	
QUEBECOR INC -CL B	53	60	174	15,531	コミュニケーション・サービス	
EMERA INC	77	90	534	47,678	公益事業	
SSR MINING INC	72	—	—	—	素材	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	40	48	169	15,124	公益事業	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	116	127	733	65,431	コミュニケーション・サービス	
IVANHOE MINES LTD-CL A	—	225	232	20,746	素材	
AGNICO EAGLE MINES LTD	78	87	562	50,165	素材	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	189	215	377	33,660	公益事業	
B2GOLD CORP	347	347	177	15,858	素材	
AIR CANADA	41	65	138	12,358	資本財・サービス	
KINROSS GOLD CORP	403	432	332	29,691	素材	
BANK OF MONTREAL	211	231	3,164	282,501	金融	
POWER CORP OF CANADA	181	201	840	75,048	金融	
SHOPIFY INC - CLASS A	35	41	8,200	731,932	情報技術	
NUTRIEN LTD	188.19	203.19	1,773	158,261	素材	
CANOPY GROWTH CORP	74	84	118	10,564	ヘルスケア	
CRONOS GROUP INC	55	—	—	—	ヘルスケア	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	88	96	488	43,633	素材	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	—	47	224	20,019	公益事業	
CAMECO CORP	128	140	445	39,776	エネルギー	
FIRSTSERVICE CORP	—	14	354	31,625	不動産	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	—	65	332	29,694	資本財・サービス	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	—	39	265	23,727	情報技術	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	—	19	233	20,831	情報技術	
TELVUS CORP	108	108	318	28,428	コミュニケーション・サービス	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	151	170	576	51,425	素材	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	18	22	382	34,178	一般消費財・サービス	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	389	420	2,244	200,304	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	9	10	566	50,587	金融	
MAGNA INTERNATIONAL INC	92	102	1,023	91,382	一般消費財・サービス	
WESTON (GEORGE) LTD	25.37	27.37	373	33,342	生活必需品	
PAN AMERICAN SILVER CORP	70	70	228	20,381	素材	
BLACKBERRY LTD	160	194	243	21,749	情報技術	
SUN LIFE FINANCIAL INC	192.5	208.5	1,431	127,799	金融	
ENBRIDGE INC	665	727	3,543	316,283	エネルギー	

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	434.25	461.25	3,407	304,131	金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	638	691	1,652	147,535	金融
BAUSCH HEALTH COS INC	105	105	333	29,794	ヘルスケア
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	45	240	2,194	195,886	資本財・サービス
IA FINANCIAL CORP INC	33	37	258	23,078	金融
GILDAN ACTIVEWEAR INC	63	70	372	33,290	一般消費財・サービス
CANADIAN NATL RAILWAY CO	233.5	255.5	4,184	373,469	資本財・サービス
CGI INC - CLASS A	79	79	848	75,754	情報技術
ONEX CORPORATION	26	26	248	22,188	金融
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	151	160	595	53,184	コミュニケーション・サービス
IGM FINANCIAL INC	24	31	151	13,522	金融
TMX GROUP LTD	19	19	244	21,811	金融
OPEN TEXT CORP	87	99	614	54,823	情報技術
CI FINANCIAL CORP	70	—	—	—	金融
SAPUTO INC	80	87	252	22,504	生活必需品
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	193	204	572	51,112	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	283	302	1,434	128,070	生活必需品
YAMANA GOLD INC	323	323	166	14,876	素材
FORTIS INC	150	166	928	82,916	公益事業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	38	38	336	30,072	資本財・サービス
LUNDIN MINING CORP	194	221	230	20,554	素材
CENOVUS ENERGY INC	314	467	740	66,111	エネルギー
DOLLARAMA INC	97	107	603	53,876	一般消費財・サービス
ATCO LTD -CLASS I	22	29	123	11,011	公益事業
ALTAGAS LTD	91	103	256	22,929	公益事業
KEYERA CORP	74	74	213	19,016	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	128	—	—	—	エネルギー
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	12,687.79 82銘柄	14,425.79 88銘柄	89,694 8,006,114	<3.2%>
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円
MEDIBANK PRIVATE LTD	888	970	325	26,494	金融
BHP GROUP LTD	957.5	1,034	3,988	324,195	素材
SOUTH32 LTD	1,516	1,601	571	46,461	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	305.5	335.5	712	57,927	エネルギー
FORTESCUE METALS GROUP LTD	565	591	1,040	84,554	素材
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,024.5	1,159.5	3,153	256,375	金融
WESTPAC BANKING CORP	1,173.48	1,289.48	2,697	219,287	金融
SANTOS LTD	531	629	401	32,672	エネルギー
AUSNET SERVICES	650	650	163	13,315	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	924.5	1,008.5	2,684	218,233	金融
RIO TINTO LTD	122.5	130	1,240	100,805	素材
ORIGIN ENERGY LTD	535	590	290	23,596	公益事業
AURIZON HOLDINGS LTD	600	600	204	16,631	資本財・サービス
XERO LTD	—	47.5	670	54,525	情報技術
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	34	34	105	8,598	エネルギー
COLES GROUP LTD	430.45	468.45	844	68,658	生活必需品
WISETECH GLOBAL LTD	45	54	279	22,742	情報技術
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	250	370	357	29,054	素材
EVOLUTION MINING LTD	530	595	245	19,927	素材
AFTERPAY LTD	70	76	840	68,298	情報技術
TPG TELECOM LTD	120	—	—	—	コミュニケーション・サービス
REECE LTD	—	105	246	20,024	資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	—	473	324	26,338	生活必需品
OIL SEARCH LTD	642	642	251	20,405	エネルギー
SEEK LTD	107	117	401	32,622	コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	235	256	305	24,805	生活必需品
NEWCREST MINING LTD	260	285	689	56,019	素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	574.5	623.5	5,847	475,317	金融
AMPOL LTD	79.5	79.5	229	18,696	エネルギー
ORICA LTD	131	131	188	15,313	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	464.5	519.5	602	48,986	金融
CIMIC GROUP LTD	28	—	—	—	資本財・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	413	441	1,768	143,754	生活必需品
COCA-COLA AMATIL LTD	157	—	—	—	その他
TABCORP HOLDINGS LTD	727.63	782.63	390	31,746	一般消費財・サービス
CROWN RESORTS LTD	116	134	148	12,091	一般消費財・サービス
QANTAS AIRWAYS LTD	305	305	149	12,148	資本財・サービス
TELSTRA CORP LTD	1,345	1,435	574	46,660	コミュニケーション・サービス
AMP LTD	1,020	—	—	—	金融
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	142.5	156.5	859	69,881	素材
MACQUARIE GROUP LTD	110.84	119.84	2,325	189,000	金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	184.5	211.3	942	76,590	一般消費財・サービス
CSL LTD	147.5	160	4,912	399,296	ヘルスケア
WESFARMERS LTD	370	403	2,345	190,695	一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	20.5	23.2	525	42,748	ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	163	178	361	29,416	素材
SUNCORP GROUP LTD	412.57	436.57	464	37,795	金融
ASX LTD	62.5	67	609	49,573	金融
COMPUTERSHARE LTD	159	182	348	28,317	情報技術
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	709.36	861.36	376	30,598	金融

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	金額	
	株数	株数	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	
SONIC HEALTHCARE LTD	143.5	159.5	681	55,363	ヘルスケア
AGL ENERGY LTD	190	215	114	9,315	公益事業
BRAMBLES LTD	504	504	509	41,379	資本財・サービス
RAMSAY HEALTH CARE LTD	57.5	61.5	407	33,095	ヘルスケア
REA GROUP LTD	16	18	289	23,557	コミュニケーション・サービス
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	38	44	143	11,670	金融
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	22	286	23,279	一般消費財・サービス
オーストラリア・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	21,308.83 22,384.83	49,438	4,018,864	
	53銘柄	53銘柄		<1.6%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	475	525	2,509	36,613	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	770	830	3,622	52,858	一般消費財・サービス
MTR CORP	525	585	2,457	35,847	資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	445	510	4,934	71,990	不動産
SINO LAND CO	1,040	1,260	1,215	17,739	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	956.69	1,046.69	5,285	77,119	資本財・サービス
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	155	185	814	11,889	不動産
CLP HOLDINGS LTD	560	620	4,761	69,471	公益事業
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	485.07	555.07	1,834	26,765	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	3,773.58	4,224.75	5,002	72,980	公益事業
HANG SENG BANK LTD	261	288	4,057	59,205	金融
NEW WORLD DEVELOPMENT	525	585	1,848	26,971	不動産
WH GROUP LTD	3,210	3,610	1,841	26,861	生活必需品
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	419	461	20,514	299,306	金融
HANG LUNG PROPERTIES LTD	660	780	1,248	18,208	不動産
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	108	—	—	—	情報技術
KERRY PROPERTIES LTD	225	—	—	—	不動産
BANK OF EAST ASIA LTD	452.4	—	—	—	金融
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	260	—	—	—	ヘルスケア
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	—	690	1,337	19,510	資本財・サービス
SJM HOLDINGS LTD	580	710	396	5,780	一般消費財・サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	382	450	873	12,737	不動産
CK ASSET HOLDINGS LTD	911.69	911.69	4,129	60,256	不動産
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	200	235	1,092	15,943	公益事業
PCCW LTD	1,470	—	—	—	コミュニケーション・サービス
AIA GROUP LTD	4,194	4,614	38,711	564,800	金融
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	—	540	1,555	22,690	資本財・サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	570	630	2,535	36,996	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	609	679	1,371	20,011	生活必需品
ESR CAYMAN LTD	—	750	1,938	28,286	不動産
SANDS CHINA LTD	824	928	1,733	25,291	一般消費財・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	—	820	1,193	17,419	一般消費財・サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	470	530	8,729	127,357	資本財・サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	1,255	1,415	3,396	49,547	金融
WYNN MACAU LTD	540	540	388	5,664	一般消費財・サービス
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	27,311.43 30,508.2	131,331	1,916,123	
	31銘柄	30銘柄		<0.8%>	
(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	345	28,714	不動産
UNITED OVERSEAS BANK LTD	420	452	1,199	99,781	金融
DBS GROUP HOLDINGS LTD	629	699	2,152	179,086	金融
SINGAPORE AIRLINES LTD	436.75	484.75	238	19,804	資本財・サービス
KEPPEL CORP LTD	513	563	293	24,407	資本財・サービス
UOL GROUP LTD	140	171	117	9,775	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	161	161	112	9,377	不動産
CAPITALAND LTD	829	—	—	—	不動産
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	913	—	—	—	資本財・サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	27	—	—	—	一般消費財・サービス
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,164	1,293	1,466	122,007	金融
GENTING SINGAPORE LTD	2,090	2,090	165	13,738	一般消費財・サービス
VENTURE CORP LTD	86	99	186	15,495	情報技術
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,909.5	3,201.5	771	64,201	コミュニケーション・サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	500	565	216	18,053	資本財・サービス
SINGAPORE EXCHANGE LTD	273	315	290	24,192	金融
WILMAR INTERNATIONAL LTD	659	744	311	25,939	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 >	11,750.25 11,862.25	7,866	654,577	
	16銘柄	14銘柄		<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	415	475	213	16,535	公益事業
MERCURY NZ LTD	230	260	152	11,792	公益事業
A2 MILK CO LTD	262	262	162	12,593	生活必需品
SPARK NEW ZEALAND LTD	620.89	727.89	316	24,576	コミュニケーション・サービス
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	389	483	376	29,152	資本財・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	204	232	765	59,356	ヘルスケア
RYMAN HEALTHCARE LTD	140	165	199	15,478	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 >	2,260.89 2,604.89	2,186	169,486	
	7銘柄	7銘柄		<0.1%>	

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
(イギリス)					
BP PLC	6,665	7,330	2,402	364,053	エネルギー
UNILEVER PLC	384.1	948.6	3,719	563,721	生活必需品
BARCLAYS PLC	5,688	6,223	1,140	172,861	金融
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,795	3,005	368	55,791	資本財・サービス
PRUDENTIAL PLC	849	951	1,231	186,580	金融
NATWEST GROUP PLC	1,597.91	2,102.91	442	67,058	金融
EVRAZ PLC	150	174	99	15,084	素材
JOHNSON MATTHEY PLC	60.64	70.64	150	22,836	素材
BAE SYSTEMS PLC	1,065	1,170	643	97,493	資本財・サービス
AVIVA PLC	1,289.66	1,423.66	538	81,604	金融
AVEVA GROUP PLC	20	44	141	21,473	情報技術
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,651	1,823	2,780	421,348	ヘルスケア
INFORMA PLC	499	527	249	37,859	コミュニケーション・サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,565	1,595.4	233	35,314	資本財・サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	319	350	256	38,850	コミュニケーション・サービス
DCC PLC	31.5	34	191	29,032	資本財・サービス
OCADO GROUP PLC	152	175	320	48,643	生活必需品
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	24.5	27.5	435	66,019	資本財・サービス
HALMA PLC	122.5	137	414	62,893	情報技術
ENTAIN PLC	191	212	370	56,100	一般消費財・サービス
JD SPORTS FASHION PLC	146	172	196	29,756	一般消費財・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	235	151	22,937	金融
M&G PLC	837	917	174	26,454	金融
RELX PLC	631.46	703.96	1,649	249,979	資本財・サービス
DIAGEO PLC	769	847	3,238	490,827	生活必需品
RIO TINTO PLC	370	407	1,880	285,076	素材
STANDARD CHARTERED PLC	868	970	401	60,892	金融
TESCO PLC	3,207	2,806.84	783	118,687	生活必需品
SMITH & NEPHEW PLC	290.5	319.5	396	60,045	ヘルスケア
GLENCORE PLC	3,307.25	3,645.25	1,301	197,316	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	102.5	124.5	167	25,313	金融
SMITHS GROUP PLC	123.83	143.83	209	31,739	資本財・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	419.83	465.83	124	18,864	金融
PEARSON PLC	235.63	257.63	158	23,997	コミュニケーション・サービス
SAINSBURY (J) PLC	542.25	595.25	172	26,135	生活必需品
NEXT PLC	44.5	48.5	386	58,525	一般消費財・サービス
TAYLOR WIMPEY PLC	1,177	1,277	198	30,095	一般消費財・サービス
WHITBREAD PLC	68.61	73.61	211	32,074	一般消費財・サービス
BUNZL PLC	112.05	119.05	341	51,729	資本財・サービス
VODAFONE GROUP PLC	8,701.83	10,141.83	1,116	169,264	コミュニケーション・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	42.61	50.11	504	76,440	素材
KINGFISHER PLC	682.11	737.11	240	36,419	一般消費財・サービス
WPP PLC	409	429	454	68,952	コミュニケーション・サービス
UNITED UTILITIES GROUP PLC	228.27	248.27	270	40,957	公益事業
SEVERN TRENT PLC	78.33	90.83	264	40,018	公益事業
RENTOKIL INITIAL PLC	612	673	416	63,097	資本財・サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	234.5	260	1,602	242,896	生活必需品
ST JAMES'S PLACE PLC	165.5	194.5	303	46,060	金融
SCHRODERS PLC	41.5	41.5	145	22,121	金融
SSE PLC	339	376	585	88,785	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	340	367	254	38,535	一般消費財・サービス
ASTRAZENECA PLC	431.5	561	4,693	711,405	ヘルスケア
FERGUSON PLC	74.87	80.87	934	141,625	資本財・サービス
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,955	2,152	613	92,922	金融
3I GROUP PLC	313.91	350.91	487	73,819	金融
ASHTREAD GROUP PLC	146.5	161.5	989	150,043	資本財・サービス
SAGE GROUP PLC/THE	351.14	401.14	311	47,239	情報技術
NATIONAL GRID PLC	1,144.34	1,296.34	1,297	196,709	公益事業
LLOYDS BANKING GROUP PLC	22,964.65	25,754.65	1,205	182,677	金融
RSA INSURANCE GROUP LTD	317.6	—	—	—	その他
IMPERIAL BRANDS PLC	304	341	532	80,778	生活必需品
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	41.5	38.32	165	25,118	一般消費財・サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	753.6	790.6	2,020	306,268	生活必需品
BHP GROUP PLC	687.27	768.27	1,551	235,090	素材
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	115	128.5	245	37,139	生活必需品
HSBC HOLDINGS PLC	6,696.5	7,416.5	3,088	468,108	金融
ANGLO AMERICAN PLC	403.83	465.83	1,250	189,458	素材
MONDI PLC	156.5	176	307	46,627	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	734	—	—	—	生活必需品
COMPASS GROUP PLC	589.39	647.39	985	149,336	一般消費財・サービス
PERSIMMON PLC	106	112	309	46,833	一般消費財・サービス
BT GROUP PLC	2,901	3,206	523	79,396	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA HBC AG-DI	65.5	71.5	168	25,498	生活必需品
BURBERRY GROUP PLC	132.89	142.89	256	38,873	一般消費財・サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	56.36	64.36	296	44,870	一般消費財・サービス
INTERTEK GROUP PLC	52	58.5	320	48,587	資本財・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	104.99	120.49	827	125,456	金融
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	1,350	1,489	2,374	359,903	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,223.18	1,346.18	2,145	325,219	エネルギー
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	57	57	127	19,264	ヘルスケア

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	額	
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額	
ADMIRAL GROUP PLC	61.5	70.5	212	32,193	金融
ANTOFAGASTA PLC	128	141	197	29,875	素材
ABRDN PLC	708.62	778.62	183	27,826	金融
EXPERIAN PLC	296.54	336.54	1,138	172,553	資本財・サービス
イギリス・債券通貨計	95,671.55	105,587.01	64,194	9,729,339	
	83銘柄	82銘柄		<3.9%>	
(イスラエル)	株数	株数	千イスラエル・シケル	千円	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	345	443	874	31,507	金融
AZRIELI GROUP LTD	14	16.5	479	17,284	不動産
ICL GROUP LTD	236	281	801	28,859	素材
ELBIT SYSTEMS LTD	9.5	9.5	447	16,113	資本財・サービス
BANK HAPOALIM BM	357	441	1,355	48,818	金融
BANK LEUMI LE-ISRAEL	512	562	1,744	62,819	金融
NICE LTD	22	24	2,123	76,461	情報技術
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	41	54	632	22,771	金融
イスラエル・シケル通貨計	1,536.5	1,831	8,459	304,635	
	8銘柄	8銘柄		<0.1%>	
(スイス)	株数	株数	千スイス・フラン	千円	
UBS GROUP AG-REG	1,200	1,306	2,057	253,599	金融
ROCHE HOLDING AG-BR	—	11	421	51,925	ヘルスケア
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2.8	2.8	249	30,713	素材
ADECCO GROUP AG-REG	51.5	51.5	225	27,763	資本財・サービス
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	229.8	250	8,937	1,101,546	ヘルスケア
SIKA AG-REG	47.1	51	1,854	228,612	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.03	0.04	449	55,363	生活必需品
ABB LTD-REG	601	627	2,002	246,825	資本財・サービス
SWISS RE AG	97.5	107	927	114,285	金融
NESTLE SA-REG	972	1,027	12,334	1,520,198	生活必需品
PARTNERS GROUP HOLDING AG	5.9	8	1,260	155,295	金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	12.6	15	360	44,425	資本財・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	799.7	909.2	806	99,351	金融
JULIUS BAER GROUP LTD	74	80	457	56,379	金融
SGS SA-REG	2	2.1	597	73,661	資本財・サービス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	6.9	6.9	161	19,899	資本財・サービス
VIFOR PHARMA AG	14.5	17.5	184	22,690	ヘルスケア
TEMENOS AG - REG	21.2	23	278	34,385	情報技術
ALCON INC	161.3	178	1,300	160,326	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-BR	9.7	9.7	265	32,661	一般消費財・サービス
ZURICH INSURANCE GROUP AG	48.62	53.42	2,039	251,377	金融
BALOISE HOLDING AG - REG	15.7	17	235	28,977	金融
CLARIANT AG-REG	57	77	139	17,186	素材
NOVARTIS AG-REG	726	791	5,872	723,771	ヘルスケア
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1.2	265	32,685	生活必需品
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	171.6	186	2,583	318,421	一般消費財・サービス
SWISSCOM AG-REG	8.3	9	462	56,948	コミュニケーション・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	10.1	10.1	71	8,813	金融
GEBERIT AG-REG	11.9	13	907	111,837	資本財・サービス
GIVAUDAN-REG	3	3.3	1,492	184,002	素材
STRAUMANN HOLDING AG-REG	3.4	3.6	700	86,299	ヘルスケア
SONOVA HOLDING AG-REG	18.22	19.92	685	84,505	ヘルスケア
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	55	62	467	57,647	情報技術
LONZA GROUP AG-REG	24	26.9	1,964	242,158	ヘルスケア
SWATCH GROUP AG/THE-REG	15.2	19	100	12,422	一般消費財・サービス
HOLCIM LTD	172.9	185.4	843	103,924	素材
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	10.4	11.1	582	71,769	金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	18	19.2	510	62,969	資本財・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	25.1	27	239	29,483	不動産
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.34	0.34	385	47,478	生活必需品
スイス・フラン通貨計	5,705.31	6,218.22	55,680	6,862,594	
	39銘柄	40銘柄		<2.7%>	
(デンマーク)	株数	株数	千デンマーク・クローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	595	648	46,377	800,937	ヘルスケア
DANSKE BANK A/S	227	260	2,852	49,257	金融
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	1.05	1.2	2,222	38,380	資本財・サービス
H LUNDBECK A/S	23	—	—	—	ヘルスケア
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	68	386.5	8,560	147,848	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S	43	48.5	1,870	32,297	ヘルスケア
CARLSBERG AS-B	36.5	39	4,145	71,596	生活必需品
NOVOZYMES A/S-B SHARES	72.5	78.5	3,835	66,239	素材
COLOPLAST-B	40.5	45	4,835	83,504	ヘルスケア
DSV PANALPINA A/S	71.6	79.1	11,291	195,004	資本財・サービス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	—	3	822	14,211	資本財・サービス
DEMANT A/S	34.25	38.75	1,219	21,053	ヘルスケア
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	2.2	2.3	4,521	78,091	資本財・サービス
TRYG A/S	40	132	2,088	36,075	金融
PANDORA A/S	35	38	3,203	55,322	一般消費財・サービス
CHR HANSEN HOLDING A/S	34.5	40.5	1,993	34,419	素材
GENMAB A/S	22.9	25.2	6,426	110,977	ヘルスケア

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	
ORSTED A/S	66	70.5	千デンマーク・クローネ	5,965	103,027	公益事業	
AMBU A/S-B	56	63		1,203	20,780	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 >	1,469 18銘柄	1,999.05 18銘柄	113,435	1,959,025 <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		7,416	93,517	金融	
NORSK HYDRO ASA	417	507		3,067	38,679	素材	
DNB	331	—		—	—	金融	
ORKLA ASA	244.5	290.5		2,443	30,807	生活必需品	
TELENOR ASA	254	278		3,833	48,341	コミュニケーション・サービス	
EQUINOR ASA	338.23	382.23		8,682	109,484	エネルギー	
SCHIBSTED ASA-CL A	—	28		1,149	14,490	コミュニケーション・サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	57.1	66.6		2,966	37,405	素材	
MOWI ASA	141	166		3,492	44,042	生活必需品	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	73.5	73.5		1,523	19,213	金融	
SCHIBSTED ASA-B SHS	31	36.5		1,306	16,477	コミュニケーション・サービス	
ADEVINTA ASA	81	106		1,398	17,637	コミュニケーション・サービス	
ノルウェー・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,968.33 10銘柄	2,301.83 11銘柄	37,279	470,097 <0.2%>		
(スウェーデン)			百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
ICA GRUPPEN AB	35.2	38.7		2,067	25,903	生活必需品	
ERICSSON LM-B SHS	996.3	1,128.3		10,585	132,638	情報技術	
VOLVO AB-B SHS	508.5	556.5		11,036	138,287	資本財・サービス	
SKF AB-B SHARES	133	144		3,028	37,944	資本財・サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	76	86		1,751	21,950	一般消費財・サービス	
SWEDISH MATCH AB	56.5	613		4,105	51,446	生活必需品	
TELE2 AB-B SHS	168	188		2,465	30,894	コミュニケーション・サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	574	620		8,153	102,157	金融	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	528.5	548.5		5,284	66,211	金融	
SWEDBANK AB - A SHARES	318	341		6,259	78,430	金融	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	282	282		4,585	57,461	一般消費財・サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	207	229		3,451	43,241	素材	
SKANSKA AB-B SHS	115.5	128.5		2,702	33,860	資本財・サービス	
SANDVIK AB	384.5	431		9,887	123,885	資本財・サービス	
INVESTOR AB-B SHS	156	700		14,829	185,813	金融	
ATLAS COPCO AB-A SHS	229.5	254.5		14,190	177,812	資本財・サービス	
VOLVO AB-A SHS	—	80		1,616	20,248	資本財・サービス	
SECURITAS AB-B SHS	109.5	119.5		1,588	19,907	資本財・サービス	
TELIA CO AB	862	1,002		3,544	44,413	コミュニケーション・サービス	
ALFA LAVAL AB	110	119		4,303	53,917	資本財・サービス	
ATLAS COPCO AB-B SHS	132.5	149		7,081	88,737	資本財・サービス	
ASSA ABLOY AB-B	341.5	387.5		10,036	125,754	資本財・サービス	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	—	47.43		1,304	16,343	金融	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	—	40		2,739	34,322	不動産	
LUNDBERGS AB-B SHS	26	30		1,523	19,088	金融	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	52	57		1,948	24,418	資本財・サービス	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	104	543		6,901	86,476	資本財・サービス	
LUNDIN ENERGY AB	63.5	75.5		2,557	32,041	エネルギー	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	212	230		6,725	84,266	生活必需品	
EMBRACER GROUP AB	—	200		1,901	23,827	コミュニケーション・サービス	
BOLIDEN AB	93	104		3,186	39,927	素材	
EPIROC AB-A	222.5	249.5		5,444	68,214	資本財・サービス	
EPIROC AB-B	135	148		2,671	33,472	資本財・サービス	
HUSQVARNA AB-B SHS	141.5	158.5		2,083	26,106	資本財・サービス	
NORDEA BANK ABP	1,111	1,250		13,405	167,964	金融	
EQT AB	81	91		4,835	60,591	金融	
EVOLUTION AB	44	65.5		6,572	82,350	一般消費財・サービス	
SINCH AB	—	194		2,396	30,032	情報技術	
KINNEVIK AB - B	83	93		3,055	38,285	金融	
HEXAGON AB-B SHS	99	764		10,199	127,798	情報技術	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	57	62		1,683	21,091	金融	
スウェーデン・クローネ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,848.5 36銘柄	12,548.43 41銘柄	213,690	2,677,537 <1.1%>		
(ユーロ (アイルランド))			百株	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	75.5	86		394	50,655	素材	
KINGSPAN GROUP PLC	50	54		539	69,327	資本財・サービス	
KERRY GROUP PLC-A	51.5	56		606	77,914	生活必需品	
CRH PLC	253.5	281		1,219	156,601	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	49.6	60.3		735	94,504	一般消費財・サービス	
国 小 計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	480.1 5銘柄	537.3 5銘柄	3,496	449,002 <0.2%>		

銘 柄	期 首		期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
ユーロ (オランダ)						
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	—	278.91	697	89,572	コミュニケーション・サービス	
QIAGEN N. V.	72.98	76.98	378	48,663	ヘルスケア	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	302.1	322.6	1,024	131,503	ヘルスケア	
NN GROUP NV	90.5	99	434	55,795	金融	
HEINEKEN NV	85.5	92	859	110,387	生活必需品	
AEGON NV	582.44	642.44	253	32,495	金融	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	362.33	373.83	1,131	145,234	生活必需品	
AKZO NOBEL N. V.	65.38	67.68	639	82,093	素材	
KONINKLIJKE DSM NV	57	62	1,189	152,700	素材	
WOLTERS KLUWER	89	96	962	123,643	資本財・サービス	
ING GROEP NV	1,262.5	1,396	1,697	217,944	金融	
KONINKLIJKE KPN NV	1,146.5	1,211.5	317	40,743	コミュニケーション・サービス	
ASML HOLDING NV	139.3	150.1	10,579	1,358,455	情報技術	
ABN AMRO BANK NV-CVA	130.5	151.5	191	24,652	金融	
ADYEN NV	6	7	1,722	221,166	情報技術	
UNILEVER NV	479.5	—	—	—	その他	
JUST EAT TAKEAWAY	40	64.5	375	48,162	一般消費財・サービス	
PROSUS NV	161	333.8	2,359	302,957	一般消費財・サービス	
JDE PEET'S NV	—	26	65	8,363	生活必需品	
ASM INTERNATIONAL NV	—	17	673	86,532	情報技術	
VOPAK	23	23	76	9,799	エネルギー	
RANDSTAD NV	37	43	241	30,976	資本財・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	37.5	39.5	305	39,208	生活必需品	
ALTICE EUROPE NV	205	—	—	—	その他	
STMICROELECTRONICS NV	210.5	244	1,049	134,806	情報技術	
AIRBUS SE	194	211	2,103	270,105	資本財・サービス	
ARGENX SE	14.5	16.4	411	52,837	ヘルスケア	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	195	195	255	32,764	生活必需品	
EXOR NV	35.3	37.8	298	38,287	金融	
CNH INDUSTRIAL NV	328	366	546	70,238	資本財・サービス	
STELLANTIS NV	360	732	1,139	146,333	一般消費財・サービス	
FERRARI NV	41.45	44.95	1,059	136,104	一般消費財・サービス	
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	6,753.78 29 銘柄	7,421.49 30 銘柄	33,038 <1.7%>	4,242,530	
ユーロ (ベルギー)						
GALAPAGOS NV	13.9	—	—	—	ヘルスケア	
UCB SA	41.3	45.3	439	56,447	ヘルスケア	
KBC GROUP NV	82.5	89	645	82,947	金融	
COLRUYT SA	16	16	66	8,495	生活必需品	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	36	40	387	49,730	金融	
SOLVAY SA	24.5	26	257	33,126	素材	
UMICORE	63.5	70	301	38,714	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	249	272	1,382	177,571	生活必需品	
AGEAS	57.9	62.9	291	37,404	金融	
PROXIMUS	49.5	49.5	79	10,189	コミュニケーション・サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	14.5	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
ELIA GROUP SA/NV	10.5	10.5	114	14,710	公益事業	
SOFINA	5.5	6	244	31,342	金融	
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	664.6 13 銘柄	687.2 11 銘柄	4,210 <0.2%>	540,680	
ユーロ (ルクセンブルグ)						
AROUNDTOWN SA	370	325	179	23,036	不動産	
ARCELORMITTAL	233	257	628	80,655	素材	
INPOST SA	—	70	72	9,269	資本財・サービス	
EUROFINS SCIENTIFIC	44	47.5	536	68,911	ヘルスケア	
SES	110	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
TENARIS SA	133	157	140	17,987	エネルギー	
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	890 5 銘柄	856.5 5 銘柄	1,556 <0.1%>	199,860	
ユーロ (フランス)						
JCDECAUX SA	27	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
TOTALENERGIES SE	810.5	893.5	3,681	472,705	エネルギー	
MICHELIN (CGDE)	57	60.5	776	99,712	一般消費財・サービス	
AIR LIQUIDE SA	155.77	169.77	2,501	321,247	素材	
KERING	25	27	1,846	237,078	一般消費財・サービス	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	182	193.5	2,926	375,791	資本財・サービス	
BOUYGUES SA	74	82	245	31,494	資本財・サービス	
BNP PARIBAS	364.5	403	2,231	286,587	金融	
PEUGEOT SA	191.5	—	—	—	その他	
NATIXIS	295.5	—	—	—	金融	
THALES SA	35	38.5	284	36,524	資本財・サービス	
DANONE	200	234	1,271	163,250	生活必需品	

銘柄	株数	当株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
CARREFOUR SA	198	212	321	41,297	生活必需品	
SUEZ	112.25	126.25	249	32,050	公益事業	
VIVENDI	268.91	278.91	312	40,112	コミュニケーション・サービス	
L'OREAL	82.3	90.4	3,632	466,420	生活必需品	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	168.5	179	1,024	131,568	資本財・サービス	
LEGRAND SA	88.17	94.67	906	116,435	資本財・サービス	
PERNOD RICARD SA	69.37	74.87	1,546	198,626	生活必需品	
EURAZEO SE	12.54	12.54	92	11,827	金融	
SOCIETE GENERALE SA	269.5	290	797	102,351	金融	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	91	99.1	6,909	887,217	一般消費財・サービス	
ACCOR SA	61.5	61.5	164	21,061	一般消費財・サービス	
CAPGEMINI SE	53.2	57.2	1,154	148,296	情報技術	
VALEO SA	77	77	189	24,293	一般消費財・サービス	
PUBLICIS GROUPE	70.5	80	463	59,541	コミュニケーション・サービス	
BUREAU VERITAS SA	97	106	300	38,534	資本財・サービス	
EFFAGE	27.4	30.4	250	32,134	資本財・サービス	
SODEXO SA	27	29.5	221	28,463	一般消費財・サービス	
IPSEN	11.5	11.5	99	12,814	ヘルスケア	
ORPEA	18	18	150	19,323	ヘルスケア	
AMUNDI SA	19.5	22.5	168	21,683	金融	
TELEPERFORMANCE	19.2	21	750	96,376	資本財・サービス	
UBISOFT ENTERTAINMENT	30	30	134	17,292	コミュニケーション・サービス	
FAURECIA	22.5	38.57	143	18,394	一般消費財・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	9	10	513	65,900	ヘルスケア	
SEB SA	6.5	9.97	132	17,065	一般消費財・サービス	
ESSILORLUXOTTICA	92.5	101.5	1,830	235,100	一般消費財・サービス	
DASSAULT AVIATION SA	1	10	84	10,844	資本財・サービス	
WORLDLINE SA	78.14	85.14	404	51,898	情報技術	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	30	35	146	18,799	一般消費財・サービス	
AXA SA	638.5	694	1,681	215,973	金融	
EDENRED	79.5	88.5	358	46,025	情報技術	
RENAULT SA	58	64	186	23,952	一般消費財・サービス	
HERMES INTERNATIONAL	10.2	11.3	1,853	237,969	一般消費財・サービス	
REMY COINTREAU	7.5	7.5	160	20,552	生活必需品	
ATOS SE	32	32	119	15,351	情報技術	
DASSAULT SYSTEMES SE	43.6	234.5	1,252	160,889	情報技術	
WENDEL	7.8	9.3	96	12,360	金融	
ORANGE	659	714	685	88,054	コミュニケーション・サービス	
ALSTOM	63	114	369	47,385	資本財・サービス	
CNP ASSURANCES	48.5	58.5	126	16,210	金融	
SANOFI	370.75	407.25	3,486	447,697	ヘルスケア	
VINCI SA	170	188.5	1,586	203,711	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	175	197	556	71,438	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA	376	416	504	64,807	金融	
BIOMERIEUX	13.4	13.4	170	21,913	ヘルスケア	
ENGIE	602.23	646.23	833	106,997	公益事業	
EDF	202.5	202.5	249	32,100	公益事業	
SAFRAN SA	104.2	122	1,239	159,166	資本財・サービス	
ILIAD SA	4.9	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
ARKEMA	22.2	22.2	257	33,068	素材	
ADP	9.1	9.1	95	12,199	資本財・サービス	
SCOR SE	49.5	55.5	148	19,028	金融	
GETLINK SE	142	142	183	23,513	資本財・サービス	
BOLLORE	286	286	136	17,503	コミュニケーション・サービス	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,705.13 66銘柄	9,129.57 62銘柄	55,198	7,087,987 <2.8%>	
ユーロ (ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
BAYER AG-REG	322.7	352.2	1,596	204,964	ヘルスケア	
EVONIK INDUSTRIES AG	65	70	186	23,999	素材	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	639.5	739	789	101,328	金融	
COMMERZBANK AG	329.35	329.35	205	26,368	金融	
VOLKSWAGEN AG	10.1	11.1	283	36,403	一般消費財・サービス	
VOLKSWAGEN AG-PREF	61.2	65.5	1,077	138,375	一般消費財・サービス	
SIEMENS AG-REG	250.5	273.5	3,953	507,696	資本財・サービス	
E. ON SE	742	793	871	111,930	公益事業	
UNIPER SE	66.5	66.5	257	33,029	公益事業	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	110	117.5	1,007	129,426	一般消費財・サービス	
GEA GROUP AG	50.5	50.5	225	28,902	資本財・サービス	
CONTINENTAL AG	35.9	39.6	369	47,417	一般消費財・サービス	
BASF SE	301.2	328.7	1,905	244,724	素材	
ALLIANZ SE-REG	134.7	147.4	2,831	363,561	金融	
THYSSENKRUPP AG	114.5	—	—	—	素材	

外国株式インデックスマザーファンド

銘柄	株数	当株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千ユーロ	千円		
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	58	64	455	58,431	生活必需品	
RWE AG	212	227	794	102,080	公益事業	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	96.5	96.5	53	6,816	資本財・サービス	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	11.8	—	—	—	資本財・サービス	
BRENTAG SE	50	53.5	408	52,445	資本財・サービス	
FRESENIUS SE & CO KGAA	135.5	148	499	64,197	ヘルスケア	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	33.2	33.2	109	14,077	コミュニケーション・サービス	
HOCHTIEF AG	7.1	—	—	—	資本財・サービス	
SAP SE	341.92	373.92	4,367	560,815	情報技術	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	46.1	50.4	1,205	154,742	金融	
ZALANDO SE	49.5	76.5	623	80,060	一般消費財・サービス	
HEIDELBERGCEMENT AG	49	53.5	318	40,958	素材	
KION GROUP AG	21	24	225	28,938	資本財・サービス	
COVESTRO AG	56	67	339	43,602	素材	
RATIONAL AG	—	1.9	154	19,801	資本財・サービス	
SARTORIUS AG-VORZUG	12.1	12.1	701	90,118	ヘルスケア	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	50	53	397	51,042	一般消費財・サービス	
DELIVERY HERO SE	41.5	58	691	88,852	一般消費財・サービス	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	12.5	14	248	31,909	ヘルスケア	
METRO AG	50	—	—	—	生活必需品	
BECHTLE AG	—	28.5	180	23,143	情報技術	
NEMETSCHKE SE	20	20	215	27,620	情報技術	
SCOUT24 AG	36	36	215	27,625	コミュニケーション・サービス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	86	101	651	83,600	ヘルスケア	
KNORR-BREMSE AG	23	25	226	29,033	資本財・サービス	
HELLOFRESH SE	—	57	538	69,168	生活必需品	
TEAMVIEWER AG	44.5	53.5	66	8,484	情報技術	
SIEMENS ENERGY AG	131.25	143.25	345	44,312	資本財・サービス	
KION GROUP AG-RTS	21	—	—	—	資本財・サービス	
BEIERSDORF AG	32.9	36.1	322	41,377	生活必需品	
FUCHS PETROLUB PREF	23.5	23.5	93	12,010	素材	
MERCK KGAA	42.5	46	1,010	129,714	ヘルスケア	
ADIDAS AG	61.7	68.1	1,731	222,378	一般消費財・サービス	
PUMA SE	27.1	38.6	410	52,713	一般消費財・サービス	
HENKEL AG & CO KGAA	34	37.5	250	32,166	生活必需品	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,092.5	1,192	1,911	245,515	コミュニケーション・サービス	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	69.2	72.2	386	49,619	ヘルスケア	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	281	306.5	2,537	325,881	一般消費財・サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	413	467	1,878	241,189	情報技術	
HANNOVER RUECK SE	20	22	342	43,929	金融	
DEUTSCHE POST AG-REG	324	354.5	1,899	243,903	資本財・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	62.6	67.1	954	122,523	金融	
LANXESS AG	25	28	143	18,423	素材	
MTU AERO ENGINES AG	17.1	17.9	300	38,535	資本財・サービス	
DEUTSCHE WOHNEN SE	110	—	—	—	不動産	
SYMRISE AG	42.2	44	553	71,134	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	338	338	79	10,229	コミュニケーション・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	19.5	19.5	137	17,653	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	170.5	195	958	123,121	不動産	
LEG IMMOBILIEN SE	23	25.5	316	40,652	不動産	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,158.42 62銘柄	8,653.62 59銘柄	45,811	5,882,683 <2.3%>	
ユーロ (ポルトガル)						
JERONIMO MARTINS	77	85	165	21,283	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	883	992	482	61,984	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	150.5	167.5	140	18,045	エネルギー	
国小計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,110.5 3銘柄	1,244.5 3銘柄	788	101,314 <0.0%>	
ユーロ (スペイン)						
TELEFONICA SA	1,572.27	1,867.27	739	94,987	コミュニケーション・サービス	
ENDESA SA	103.5	103.5	208	26,780	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	2,205.12	2,367	1,136	145,970	金融	
IBERDROLA SA	1,944.34	2,119.34	2,101	269,858	公益事業	
BANKINTER SA	215	—	—	—	金融	
REPSOL SA	494	534	529	67,967	エネルギー	
GRIFOLS SA	98	98	163	21,053	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	5,477.5	6,199.5	1,725	221,588	金融	
AMADEUS IT GROUP SA	146	160.5	932	119,701	情報技術	
NATURGY ENERGY GROUP SA	94	103	253	32,576	公益事業	
MAPFRE SA	306.5	—	—	—	金融	
CAIXABANK SA	1,175	1,605	367	47,134	金融	

銘	柄	期 首		期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		88.76	88.76	191	24,550	資本財・サービス
AENA SME SA		22.5	26	336	43,185	資本財・サービス
CELLNEX TELECOM SA		104.55	180.05	958	123,092	コミュニケーション・サービス
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		360	390	1,157	148,587	一般消費財・サービス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		77	85	199	25,628	資本財・サービス
ENAGAS SA		79.5	79.5	159	20,539	公益事業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		139	157	290	37,337	公益事業
FERROVIAL SA		162.7	176.7	443	56,952	資本財・サービス
EDP RENOVAVEIS SA		—	110	247	31,724	公益事業
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	14,865.24 20 銘柄	16,450.12 19 銘柄	12,142	1,559,214 <0.6%>	
ユーロ (イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
PRYSMIAN SPA		78.5	88.5	294	37,831	資本財・サービス
ASSICURAZIONI GENERALI		372.43	394.43	702	90,154	金融
MEDIOBANCA SPA		188.65	223.65	217	27,926	金融
UNICREDIT SPA		696.56	763.56	807	103,637	金融
TELECOM ITALIA SPA		2,629.82	3,439.82	162	20,808	コミュニケーション・サービス
TELECOM ITALIA-RSP		1,719.5	2,039.5	90	11,667	コミュニケーション・サービス
INTESA SANPAOLO		5,507.37	5,945.37	1,274	163,606	金融
ATLANTIA SPA		172.57	172.57	278	35,810	資本財・サービス
POSTE ITALIANE SPA		160	177	198	25,444	金融
MONCLER SPA		63	74	478	61,385	一般消費財・サービス
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		34.5	38.5	211	27,171	ヘルスケア
ENI SPA		841	904	1,066	136,977	エネルギー
PIRELLI & C SPA		110	—	—	—	一般消費財・サービス
DIASORIN SPA		8.5	8.5	157	20,203	ヘルスケア
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		83	112	115	14,777	コミュニケーション・サービス
NEXI SPA		120.5	158.5	218	28,076	情報技術
AMPLIFON SPA		—	43	183	23,610	ヘルスケア
LEONARDO SPA		131.75	—	—	—	資本財・サービス
ENEL SPA		2,671.34	2,911.34	1,976	253,803	公益事業
SNAM SPA		666	701	350	44,980	公益事業
TERNA SPA		463	490	318	40,873	公益事業
FINCOBANK SPA		197	219	340	43,743	金融
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	16,914.99 21 銘柄	18,904.24 20 銘柄	9,442	1,212,490 <0.5%>	
ユーロ (フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UPM-KYMMENE OYJ		175.5	191.5	626	80,410	素材
NOKIA OYJ		1,864	1,913	960	123,290	情報技術
WARTSILA OYJ ABP		147	170	209	26,926	資本財・サービス
STORA ENSO OYJ-R SHS		188.5	197	304	39,058	素材
ELISA OYJ		46	51	271	34,892	コミュニケーション・サービス
SAMPO OYJ-A SHS		153	178	766	98,422	金融
FORTUM OYJ		138.5	159	406	52,186	公益事業
KESKO OYJ-B SHS		—	98	274	35,197	生活必需品
KONE OYJ-B		112.5	121	715	91,920	資本財・サービス
NESTE OYJ		139	151	648	83,337	エネルギー
ORION OYJ-CLASS B		32	36	132	17,071	ヘルスケア
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,996 10 銘柄	3,265.5 11 銘柄	5,316	682,716 <0.3%>	
ユーロ (オーストリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
VERBUND AG		20	24.3	218	28,005	公益事業
OMV AG		44.5	53	250	32,157	エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG		94.5	100	387	49,771	金融
VOESTALPINE AG		42.5	42.5	125	16,088	素材
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		44	52.5	134	17,217	金融
ANDRITZ AG		21	—	—	—	資本財・サービス
国 小 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	266.5 6 銘柄	272.3 5 銘柄	1,115	143,240 <0.1%>	
ユ ー ロ 通 貨 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	61,805.26 240 銘柄	67,422.34 230 銘柄	172,118	22,101,720 <8.8%>	
フ ァ ン ド 合 計	株 数、金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	354,388.8 1,214 銘柄	394,308.1 1,220 銘柄	—	229,141,995 <91.4%>	

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首 □ 数	当 □ 数	期末 評価額	
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円
(アメリカ)	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4.587	5.087	1,224	139,350
SIMON PROPERTY GROUP INC	10.137	11.857	1,896	215,754
BOSTON PROPERTIES INC	4.95	5.47	603	68,666
VORNADO REALTY TRUST	5.397	5.897	245	27,896
SBA COMMUNICATIONS CORP	3.65	4.04	1,436	163,430
EQUITY RESIDENTIAL	12.35	13.05	1,125	128,010
EQUINIX INC	2.918	3.288	2,696	306,742
AMERICAN TOWER CORP	14.5	16.45	4,391	499,582
HOST HOTELS & RESORTS INC	22.243	24.943	409	46,596
INVITATION HOMES INC	17.7	20.85	860	97,896
VICI PROPERTIES INC	15.4	19.8	556	63,366
VENTAS INC	12.2	13.8	677	77,119
WEYERHAEUSER CO	24.114	27.564	1,068	121,518
AGNC INVESTMENT CORP	18.1	19.6	310	35,299
CROWN CASTLE INTL CORP	13.75	15.75	2,926	332,984
IRON MOUNTAIN INC	9.71	10.26	480	54,698
VEREIT INC	33.5	—	—	—
SUN COMMUNITIES INC	3.25	4.1	806	91,775
PROLOGIS INC	24.402	26.952	4,131	470,006
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4.12	5.1	1,046	119,097
CAMDEN PROPERTY TRUST	3.2	3.45	582	66,274
DUKE REALTY CORP	12.15	13.8	820	93,338
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2.17	2.4	831	94,611
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2.36	—	—	—
WELLTOWER INC	13.85	15.3	1,255	142,805
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	17.65	19.8	674	76,725
MID-AMERICA APARTMENT COMM	3.75	4.25	892	101,539
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	5.8	6.15	521	59,347
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	45.1	50.8	424	48,258
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	5.35	—	—	—
REALTY INCOME CORP	11.2	19.445	1,357	154,415
PUBLIC STORAGE	5.22	5.67	1,881	214,094
REGENCY CENTERS CORP	5.3	5.7	403	45,887
UDR INC	9.75	10.55	606	68,979
WP CAREY INC	5.8	6.4	504	57,340
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	7.6	8.3	230	26,213
DIGITAL REALTY TRUST INC	8.9	10.3	1,738	197,793
EXTRA SPACE STORAGE INC	4.25	4.9	994	113,194
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	17.25	21.65	465	52,932
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	443.628 39銘柄	462.723 36銘柄	41,078 <1.9%>
(カナダ)	千□	千□	千カナダ・ドル	千円
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	4.8	—	—	—
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	2.1	—	—	—
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2.4	2.9	169	15,132
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	4.7	5.8	128	11,451
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	14 4銘柄	8.7 2銘柄	297 <0.0%>
(オーストラリア)	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU	—	36.15	392	31,884
LENDLEASE GROUP	21.5	23.5	249	20,249
TRANSURBAN GROUP	89.5	95.4	1,306	106,166
SYDNEY AIRPORT	42.5	45.8	377	30,678
APA GROUP	38.1	41.4	401	32,644
SCENTRE GROUP	159.922	181.922	553	44,956
DEXUS	33.15	—	—	—
GPT GROUP	63.16	68.16	353	28,756
MIRVAC GROUP	126.1	136.1	394	32,084
STOCKLAND	78	83.8	364	29,632
GOODMAN GROUP	52.9	58.2	1,428	116,147
VICINITY CENTRES	123.273	137.273	232	18,914
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	828.105 11銘柄	907.705 11銘柄	6,053 <0.2%>

銘柄	柄	期首		当 期 末	
		□ 数	□ 数	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
		千口	千口	千香港・ドル	千円
(香港)					
LINK REIT		70.5	81.5	5,599	81,690
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		92	92	703	10,268
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		122	138	1,465	21,382
香港・ドル通貨計		□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	284.5 3銘柄	311.5 3銘柄	7,768 <0.0%>
(シンガポール)				千シンガポール・ドル	千円
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		101	124.5	372	30,975
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		158.032	190.87	408	33,988
SUNTEC REIT		63	—	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		91.8	114.3	218	18,165
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST (非上場)		65.5	77.5	161	13,477
ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS		3.737	—	—	—
シンガポール・ドル通貨計		□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	483.069 6銘柄	507.17 4銘柄	1,161 <0.0%>
(イギリス)				千イギリス・ポンド	千円
LAND SECURITIES GROUP PLC		21.662	23.562	176	26,818
SEGRO PLC		38.45	43.1	610	92,594
BRITISH LAND CO PLC		29.55	29.55	154	23,351
イギリス・ポンド通貨計		□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	89.662 3銘柄	96.212 3銘柄	941 <0.1%>
ユーロ (フランス)				千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		4.2	4.6	276	35,441
ICADE		0.95	—	—	—
GECINA SA		1.4	1.6	190	24,521
KLEPIERRE		6.25	7.15	136	17,494
COVIVIO		1.5	1.75	128	16,485
ユ ー ロ 通 貨 計		□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	14.3 5銘柄	15.1 4銘柄	731 <0.0%>
合 計		□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,157.264 71銘柄	2,309.11 63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 国	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	11,720	—
	S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	683	—
	SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	527	—
	FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	722	—
	SWISS MKT IX FUTR (スイス)	633	—
	EURO STOXX 50 (ドイツ)	2,024	—

(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

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 229,141,995	% 91.3
投資信託証券	5,638,901	2.2
コール・ローン等、その他	16,197,265	6.5
投資信託財産総額	250,978,162	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=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1香港・ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.21円、1ニュージーランド・ドル=77.53円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シケル=36.011円、1スイス・フラン=123.25円、1デンマーク・クローネ=17.27円、1ノルウェー・クローネ=12.61円、1スウェーデン・クローネ=12.53円、1ユーロ=128.41円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産 (241,345,626千円) の投資信託財産総額 (250,978,162千円) に対する比率は、96.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	260,709,876,829円
コール・ローン等	10,822,639,735
株式(評価額)	229,141,995,652
投資信託証券(評価額)	5,638,901,532
未収入金	10,204,922,167
未収配当金	248,294,417
差入委託証拠金	4,653,123,326
(B) 負債	9,932,665,466
未払金	9,867,283,466
未払解約金	65,382,000
(C) 純資産総額 (A - B)	250,777,211,363
元本	61,024,141,090
次期繰越損益金	189,753,070,273
(D) 受益権総口数	61,024,141,090口
1万口当り基準価額 (C / D)	41,095円

* 期首における元本額は54,067,455,177円、当作成期間中における追加設定元本額は13,499,704,777円、同解約元本額は6,543,018,864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	372,377,534円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA (一般投資家私募)	4,453,234円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA (一般投資家私募)	59,956,664円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA (一般投資家私募)	7,408,815円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA (一般投資家私募)	236,485,519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)	36,674,409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)	508,352,729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)	2,520,260,966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)	513,644,174円
D-1's 外国株式インデックス	15,304,858円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	32,174,123円
iFree 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	4,063,382,462円
iFree 8資産バランス	1,116,648,157円
iFree 年金バランス	171,426,649円
DCダイワ外国株式インデックス	38,249,671,210円
ダイワ・ライフ・バランス30	500,854,698円
ダイワ・ライフ・バランス50	919,288,192円
ダイワ・ライフ・バランス70	740,101,154円
大和DC海外株式インデックスファンド	1,732,619,609円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	12,075,244円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	10,707,802円
ダイワつみたてインデックス外国株式	811,486,824円
ダイワつみたてインデックスバランス30	1,690,959円
ダイワつみたてインデックスバランス50	2,170,527円
ダイワつみたてインデックスバランス70	3,559,196円
ダイワ世界バランスファンド40VA	107,882,488円
ダイワ世界バランスファンド60VA	208,152,302円
ダイワ・バランスファンド35VA	1,461,676,506円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	73,896,117円
ダイワバランスファンド2020-07(適格機関投資家専用)	211,630,253円
ダイワバランスファンド2021-02(適格機関投資家専用)	212,845,169円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	927,057,365円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	324,437,993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)	1,929,148,713円
ダイワ投信倶楽部外国株式インデックス	2,822,903,027円
ダイワライフスタイル25	12,346,386円
ダイワライフスタイル50	49,688,514円
ダイワライフスタイル75	39,700,549円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は41,095円です。

■損益の状況

当期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,297,226,954円
受取配当金	3,289,764,908
受取利息	1,845
その他収益金	10,303,967
支払利息	△ 2,843,766
(B) 有価証券売買損益	57,314,244,756
売買益	62,568,866,991
売買損	△ 5,254,622,235
(C) 先物取引等損益	2,472,470,870
取引益	2,561,237,007
取引損	△ 88,766,137
(D) その他費用	△ 66,438,634
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	63,017,503,946
(F) 前期繰越損益金	108,215,788,993
(G) 解約差損益金	△ 17,149,000,589
(H) 追加信託差損益金	35,668,777,923
(I) 合計 (E + F + G + H)	189,753,070,273
次期繰越損益金 (I)	189,753,070,273

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

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

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式	
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）	
運用方針	海外の株式市場の動きを反映した投資成果をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	イ. 外国株式インデックスマザーファンドの受益証券 ロ. ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券
	外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式（預託証券を含みます。）
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	1. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。） 2. 新興国の企業のDR（預託証券） 3. FTSE RAFI エマーシングインデックスとの連動をめざすETF（上場投資信託証券）
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	外国株式インデックスマザーファンドの株式組入上限比率	
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2022年6月15日)
(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2730>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率				
2期末(2018年6月15日)	円 13,778	円 0	% 13.3	% 93.2	% 1.3	% 4.3	百万円 1,697
3期末(2019年6月17日)	13,793	0	0.1	93.8	1.3	4.0	1,747
4期末(2020年6月15日)	13,573	0	△ 1.6	93.5	0.7	4.8	1,800
5期末(2021年6月15日)	19,822	0	46.0	90.7	5.1	3.4	2,402
6期末(2022年6月15日)	20,510	0	3.5	91.2	3.9	3.9	2,605

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

(注3) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

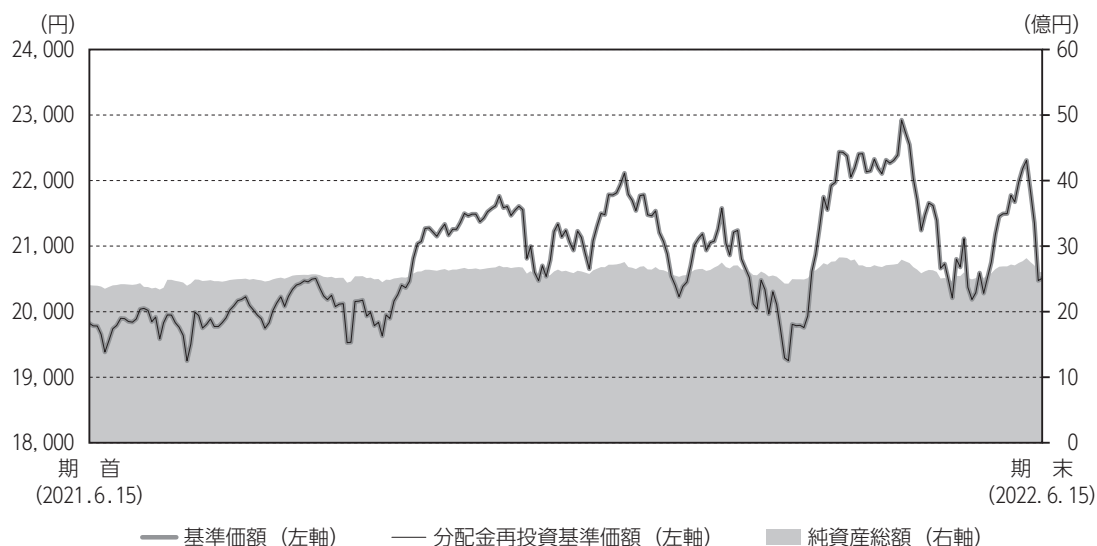
(注4) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

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



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：19,822円

期末：20,510円(分配金0円)

騰落率：3.5%(分配金込み)

■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国株式インデックスマザーファンド	4.9%	78.7%
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	△0.4%	20.5%

■ 基準価額の主な変動要因

マザーファンドを通じて、主に海外の株式に投資した結果、海外の株式市場は下落した一方、為替相場が円安となったことにより、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証 券 組入比率
	円	騰 落 率 %			
(期首)2021年 6月15日	19,822	—	90.7	5.1	3.4
6月末	19,841	0.1	89.8	6.4	3.0
7月末	19,889	0.3	91.5	5.5	2.2
8月末	20,341	2.6	90.3	6.3	2.9
9月末	19,989	0.8	90.6	5.6	3.0
10月末	21,257	7.2	90.2	5.9	3.2
11月末	20,997	5.9	89.2	6.8	3.3
12月末	21,814	10.0	90.8	4.9	3.6
2022年 1月末	20,705	4.5	89.7	5.7	3.8
2月末	20,481	3.3	89.3	5.8	4.0
3月末	22,376	12.9	91.8	4.7	2.7
4月末	21,477	8.3	90.7	5.2	3.3
5月末	21,455	8.2	88.7	6.8	3.7
(期末)2022年 6月15日	20,510	3.5	91.2	3.9	3.9

(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

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■先進国株式市況

先進国株式市況は下落しました。

先進国株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展により経済活動の正常化が順次進んだことや、好調な経済指標の発表などから上昇しました。2021年9月には、中国の大手不動産会社の資金繰り問題や米国の債務上限問題、米国金利上昇に対する警戒感など複数のリスク要因が嫌気され、軟調な推移となりました。2022年に入ると、2021年12月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）議事録を受け、米国の金融引き締めに対する懸念が高まり下落しました。2月以降は、欧米中央銀行高官の金融政策に対する発言やロシアのウクライナへの侵攻、ロシアとウクライナの散発的な停戦協定による状況改善期待などから、一進一退の展開となりました。その後は、FRB（米国連邦準備制度理事会）の利上げペースが一層加速するとの懸念などから下落し、当作成期末を迎えました。

■先進国為替相場

為替相場は円安となりました。

当作成期首より、米ドル円は比較的狭いレンジでの推移となりましたが、2021年9月以降は米国金利が上がったことにより上昇（円安）しました。その後2022年に入ってから、期待インフレ率の上昇などにより米国金利がさらに上がったため、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、その他の通貨も対円で上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに円安が進みました。

■新興国株式市況

新興国株式市況は下落しました。

新興国株式市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスの影響が続く中で緩やかな下落基調で推移しました。中国のテクノロジー業界における規制強化や、米国と中国の対立も下落の要因となりました。その後、2022年2月末にはロシアのウクライナ侵攻の影響で株価は大きく下落しました。3月半ばから反発する局面もありましたが、ウクライナ情勢の混乱長期化や世界的なインフレ懸念と米国の金利引き上げが織り込まれていく形で、株価は下落して当作成期末を迎えました。

■新興国為替相場

新興国為替相場は対円で上昇しました。

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

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

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

■外国株式インデックスマザーファンド

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

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

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	10,510

(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

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

■外国株式インデックスマザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2021. 6. 16~2022. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	95円	0.456%	信託報酬＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は20,801円です。
(投信会社)	(67)	(0.324)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(23)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(5)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	4	0.018	売買委託手数料＝当期中の売買委託手数料／当期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(2)	(0.012)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.003)	
(投資信託証券)	(1)	(0.003)	
有価証券取引税	3	0.012	有価証券取引税＝当期中の有価証券取引税／当期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(3)	(0.012)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	13	0.064	その他費用＝当期中のその他費用／当期中の平均受益権口数
(保管費用)	(8)	(0.036)	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)	(5)	(0.022)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	115	0.551	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

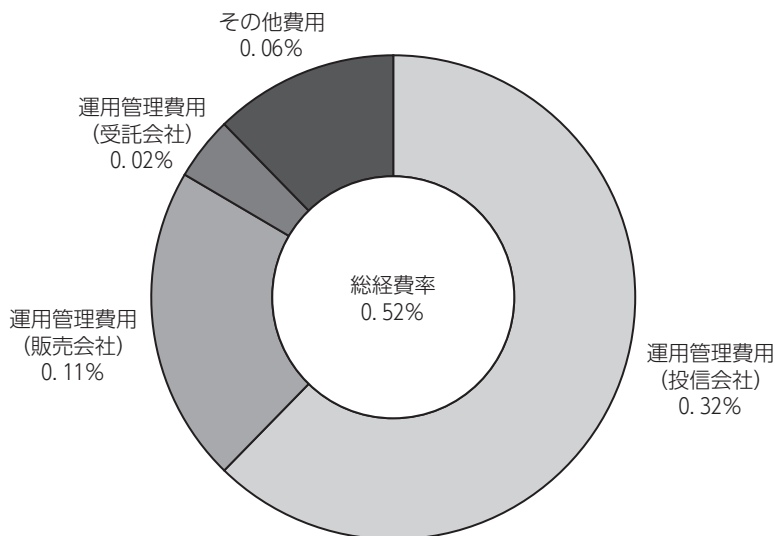
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

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



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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	79,928	150,806	50,941	98,360
外国株式インデックスマザーファンド	101,730	406,490	88,229	359,331

(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6月16日から2022年6月15日まで)

項 目	当 期
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	8,347,123千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,032,951千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.55
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	39,447,732千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	229,720,983千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.17

(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	評 価 額
	口 数	口 数	
	千口	千口	千円
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	245,435	274,421	533,311
外国株式インデックスマザーファンド	506,476	519,977	2,050,895

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	533,311	20.4
外国株式インデックスマザーファンド	2,050,895	78.5
コール・ローン等、その他	27,920	1.1
投資信託財産総額	2,612,127	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.01円、1カナダ・ドル=104.20円、1オーストラリア・ドル=93.10円、1香港・ドル=17.20円、1シンガポール・ドル=96.95円、1ニュージーランド・ドル=83.95円、1台湾・ドル=4.548円、1イギリス・ポンド=162.21円、1イスラエル・シユケル=38.942円、1スイス・フラン=135.01円、1トルコ・リラ=7.825円、1デンマーク・クローネ=18.93円、1ノルウェー・クローネ=13.49円、1スウェーデン・クローネ=13.25円、1メキシコ・ペソ=6.565円、100チリ・ペソ=15.542円、1サウジアラビア・リアル=36.04円、1インド・ルピー=1.74円、100インドネシア・ルピア=0.92円、1ブラジル・レアル=26.374円、1オフショア・人民元=20.014円、1マレーシア・リンギット=30.536円、1南アフリカ・ランド=8.42円、1タイ・バーツ=3.85円、1ユーロ=140.80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(19,984,797千円)の投資信託財産総額(20,300,596千円)に対する比率は、98.4%です。外国株式インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(254,328,525千円)の投資信託財産総額(257,632,004千円)に対する比率は、98.7%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,612,127,648円
コール・ローン等	27,920,770
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)	533,311,296
外国株式インデックスマザーファンド (評価額)	2,050,895,582
(B) 負債	6,251,510
未払解約金	164,756
未払信託報酬	6,014,386
その他未払費用	72,368
(C) 純資産総額 (A - B)	2,605,876,138
元本	1,270,536,081
次期繰越損益金	1,335,340,057
(D) 受益権総口数	1,270,536,081口
1万口当り基準価額 (C / D)	20,510円

* 期首における元本額は1,212,032,415円、当作成期間中における追加設定元本額は295,982,191円、同解約元本額は237,478,525円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は20,510円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 5,214円
受取利息	598
支払利息	△ 5,812
(B) 有価証券売買損益	75,360,540
売買益	102,236,016
売買損	△ 26,875,476
(C) 信託報酬等	△ 11,939,360
(D) 当期損益金 (A + B + C)	63,415,966
(E) 前期繰越損益金	623,844,481
(F) 追加信託差損益金	648,079,610
(配当等相当額)	(305,170,100)
(売買損益相当額)	(342,909,510)
(G) 合計 (D + E + F)	1,335,340,057
次期繰越損益金 (G)	1,335,340,057
追加信託差損益金	648,079,610
(配当等相当額)	(305,170,100)
(売買損益相当額)	(342,909,510)
分配準備積立金	687,265,661
繰越損益金	△ 5,214

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

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

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

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	63,417,139
(c) 収益調整金	648,079,610
(d) 分配準備積立金	623,848,522
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,335,345,271
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,335,345,271
(h) 受益権総口数	1,270,536,081口

★「外国株式インデックスマザーファンド」の第22期にかかる運用状況については105～127ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「外国株式インデックスマザーファンド」の決算日（2021年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在における外国株式インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。86～104ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国株式インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の決算日（2021年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

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

(1) 株式

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	1,263	3,224,876	2,553	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	978.6	2,436,704	2,489

(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6月15日現在におけるダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド（10,444,109千口）の内容です。

(1) 外国株式

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千アメリカ・ドル	千円	
(アメリカ)				
JOYY INC-ADR	34	105	14,266	コミュニケーション・サービス
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	137	291	39,341	一般消費財・サービス
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF	290	—	—	エネルギー
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	309	333	45,055	一般消費財・サービス
TAL EDUCATION GROUP- ADR	469	208	28,113	一般消費財・サービス
CANADIAN SOLAR INC	44	129	17,447	情報技術
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	353.5	—	—	コミュニケーション・サービス
LUFAX HOLDING LTD-ADR	293	179	24,169	金融
JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	30	172	23,301	情報技術
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	167	370	50,008	一般消費財・サービス
VTB BANK JSC -GDR-REG S	1,912.17	—	—	金融
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	72.9	—	—	素材
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	96.08	—	—	エネルギー
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	360.75	—	—	エネルギー
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	182.93	—	—	素材
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	233.94	—	—	生活必需品
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	1,746.77	—	—	金融
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	—	—	素材
TATNEFT PJSC - PREF	210.09	—	—	エネルギー
SISTEMA PJSC	3,192	—	—	コミュニケーション・サービス
INTER RAO UES PJSC	27,261	—	—	公益事業
ALROSA PJSC	1,803.1	—	—	素材

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ AEROFLOT PJSC	百株 566.19 1,649.1	千アメリカ・ドル — —	千円 — —	金融 資本財・サービス
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	1,790	241,704	<1.2%>
(香港)	百株	千香港・ドル	千円	
CHINA CONCH ENVIRONMENT PROTECTION	290	157	2,703	資本財・サービス
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	5,690	2,827	48,640	資本財・サービス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	1,930	2,821	48,532	一般消費財・サービス
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	2,170	969	16,683	資本財・サービス
JIANGXI COPPER CO LTD-H	1,060	1,291	22,206	素材
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,368	1,644	28,282	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	31,958	11,600	199,532	エネルギー
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	385	656	11,297	資本財・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD	614	23,086	397,086	コミュニケーション・サービス
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	5,440	2,404	41,357	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	1,760	2,569	44,197	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	22,280	9,624	165,549	エネルギー
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	200	1,172	20,158	一般消費財・サービス
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	2,280	745	12,823	不動産
HUANENG POWER INTL INC-H	4,280	1,506	25,912	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	695	2,276	39,149	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	620	985	16,955	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	41,470	22,974	395,159	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	5,920	2,255	38,794	金融
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	755	1,001	17,219	不動産
GF SECURITIES CO LTD-H	500	508	8,737	金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	666	771	13,265	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	255	935	16,096	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	6,060	3,514	60,454	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	2,355	6,299	108,353	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	1,431.2	1,023	17,600	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H	520	954	16,421	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	1,660	5,378	92,508	不動産
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	960	2,745	47,224	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,885	774	13,325	ヘルスケア
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	320	1,124	19,346	公益事業
BYD CO LTD-H	60	1,822	31,352	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	34,450	10,024	172,429	金融
CHINA RESOURCES CEMENT	1,420	728	12,529	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	670	1,403	24,142	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	7,110	1,791	30,817	金融
CITIC LTD	1,600	1,361	23,419	資本財・サービス
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,450	1,345	23,144	素材
IND & COMM BK OF CHINA-H	44,780	20,240	348,137	金融
CHINA TOWER CORP LTD-H	15,700	1,491	25,653	コミュニケーション・サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	3,328	3,840	66,056	情報技術
MEITUAN-CLASS B	177	3,440	59,183	一般消費財・サービス
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	3,332	33,719	579,981	一般消費財・サービス
JD.COM INC - CL A	285.95	6,897	118,630	一般消費財・サービス
NETEASE INC	256	4,175	71,816	コミュニケーション・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	2,870	548	9,428	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-H	672	1,696	29,184	一般消費財・サービス
BAIDU INC-CLASS A	646.5	8,805	151,451	コミュニケーション・サービス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	3,000	6,465	111,198	不動産
CRRC CORP LTD - H	2,860	875	15,052	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-H	5,570	1,069	18,394	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	4,040	18,907	325,203	金融
CHINA COAL ENERGY CO-H	1,520	1,190	20,470	エネルギー
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	7,460	3,416	58,766	不動産
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	655.5	819	14,093	資本財・サービス
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	11,165.8	3,494	60,112	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	4,290	1,797	30,917	不動産
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	100	872	14,998	一般消費財・サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	1,874	3,122	53,699	不動産
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	1,140	878	15,117	一般消費財・サービス
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	104	1,020	17,548	一般消費財・サービス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	480	1,761	30,299	生活必需品
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2,420	1,967	33,840	金融
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	570	930	16,000	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	980	1,266	21,777	資本財・サービス
CHINA POWER INTERNATIONAL	3,970	1,846	31,752	公益事業
SUNNY OPTICAL TECH	60	688	11,837	情報技術
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	2,640	852	14,666	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	1,902	3,225	55,483	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	845	1,046	17,993	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	3,330	3,996	68,731	金融
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	199	2,421	41,655	公益事業
KUNLUN ENERGY CO LTD	1,780	1,142	19,655	公益事業
ZUIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,040	1,083	18,639	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,560	2,109	36,282	素材

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千香港・ドル	千円	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	9,681	5,024	86,420	金融
CHINA EVERGRANDE GROUP	1,420	234	4,029	不動産
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	3,040	857	14,745	金融
CHINA MERCHANTS BANK-H	1,330	6,244	107,402	金融
BANK OF CHINA LTD-H	45,220	13,837	238,001	金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	700	1,202	20,684	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	4,240	1,081	18,596	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	1,720	983	16,922	金融
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	940	514	8,851	一般消費財・サービス
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	835	2,709	46,604	不動産
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	402,265.95 85銘柄	320,894 <27.2%>	
(シンガポール)	百株	千シンガポール・ドル	千円	
YANGZIJANG FINANCIAL HOLDING	1,260	61	5,924	金融
YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,260	121	11,788	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	182 <0.1%>	
(台湾)	百株	千台湾・ドル	千円	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	260	3,367	15,316	情報技術
SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	180	2,889	13,141	情報技術
TAIWAN CEMENT	1,471.45	5,900	26,840	素材
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	1,630	16,626	75,630	情報技術
WALSIN TECHNOLOGY CORP	250	2,687	12,225	情報技術
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	651.12	4,167	18,956	生活必需品
FORMOSA PLASTICS CORP	1,136	12,098	55,034	素材
NAN YA PLASTICS CORP	921.4	7,638	34,746	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	413.9	3,369	15,325	素材
CHINA STEEL CORP	4,666.86	15,867	72,178	素材
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	546.16	3,326	15,130	情報技術
DELTA ELECTRONICS INC	520	11,882	54,050	情報技術
YAGEO CORPORATION	140	5,278	24,009	情報技術
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	570	3,306	15,038	情報技術
ACER INC	1,770	4,840	22,020	情報技術
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	630	3,553	16,163	情報技術
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	80	3,428	15,593	情報技術
QUANTA COMPUTER INC	1,060	8,469	38,526	情報技術
AU OPTRONICS CORP	6,670	11,339	51,579	情報技術
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	974	12,126	55,161	コミュニケーション・サービス
MEDIATEK INC	210.03	18,482	84,075	情報技術
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	290	4,872	22,162	情報技術
EVERGREEN MARINE CORP LTD	270	3,550	16,150	資本財・サービス
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	2,194.34	13,604	61,887	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	2,718.38	14,516	66,032	金融
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	5,820	9,050	41,167	金融
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	2,001.24	5,893	26,809	金融
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	2,133.81	4,929	22,421	金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,039.93	7,527	34,241	金融
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,340	3,954	17,989	金融
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	10,402.31	9,590	43,628	金融
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	2,180	3,716	16,907	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	4,230.28	10,998	50,032	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,722.14	4,563	20,759	金融
LARGAN PRECISION CO LTD	40	6,920	31,478	情報技術
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	110	4,169	18,964	情報技術
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	140	2,821	12,832	情報技術
WISTRON CORP	1,381.1	3,977	18,093	情報技術
INNOLUX CORP	7,230	9,832	44,728	情報技術
PEGATRON CORP	640	4,390	19,971	情報技術
CHALEASE HOLDING CO LTD	247.94	5,392	24,530	金融
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,520	4,104	18,668	金融
POWERTECH TECHNOLOGY INC	484	4,772	21,708	情報技術
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	360	3,488	15,868	エネルギー
COMPAL ELECTRONICS	1,740	3,967	18,046	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	3,030	155,439	707,076	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY	2,889.02	32,212	146,531	情報技術
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	140	3,689	16,780	生活必需品
ASUSTEK COMPUTER INC	277.6	9,022	41,040	情報技術
UNITED MICROELECTRONICS CORP	3,100	15,376	69,943	情報技術
台湾・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	86,423.01 50銘柄	526,984 <11.8%>	
(トルコ)	百株	千トルコ・リラ	千円	
TURKIYE GARANTI BANKASI	4,268.52	6,407	50,137	金融
AKBANK T. A. S.	5,781.32	4,873	38,137	金融
TURKIYE IS BANKASI-C	8,102.36	3,889	30,433	金融
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	1,956.33	3,482	27,249	コミュニケーション・サービス
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	204.07	5,518	43,180	エネルギー
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	1,162.93	3,537	27,683	素材
HACI OMER SABANCI HOLDING	2,082.02	4,084	31,965	金融

銘柄	2022年6月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千トルコ・リラ	千円	
TURKIYE HALK BANKASI	3,356.45	1,923	15,049	金融
YAPI VE KREDI BANKASI	4,210.52	1,945	15,222	金融
KOC HOLDING AS	1,226.98	4,851	37,964	資本財・サービス
TURK HAVA YOLLARI AO	1,219.46	5,714	44,716	資本財・サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	356.99	2,986	23,368	生活必需品
トルコ・リラ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	33,927.95 49,213	385,108 <1.9%>	
	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
(メキシコ)				
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	10,736	21,407	140,551	コミュニケーション・サービス
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	1,113	3,689	24,224	コミュニケーション・サービス
CEMEX SAB-CPO	11,105.19	8,317	54,610	素材
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	881	12,483	81,962	生活必需品
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	197	2,520	16,545	生活必需品
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	688	6,217	40,820	素材
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	1,603	10,682	70,135	生活必需品
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	820	9,739	63,947	金融
メキシコ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	27,143.19 8銘柄	492,797 <2.4%>	
	百株	千チリ・ペソ	千円	
(チリ)				
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE	2.41	17,050	2,650	素材
CENCOSUD SA	671.12	87,581	13,612	生活必需品
BANCO SANTANDER CHILE	42,682.55	165,608	25,739	金融
ENEL AMERICAS SA	13,632.94	123,105	19,133	公益事業
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	18.72	151,401	23,531	素材
FALABELLA SA	558.41	117,266	18,225	一般消費財・サービス
BANCO DE CHILE	20,598.72	173,235	26,924	金融
チリ・ペソ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	78,164.87 7銘柄	129,816 <0.6%>	
	百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
(サウジアラビア)				
SAUDI ARABIAN MINING	128.08	742	26,772	素材
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	233.24	2,509	90,448	素材
SAUDI TELECOM CO	164.45	1,677	60,453	コミュニケーション・サービス
AL RAJHI BANK	254.22	2,290	82,550	金融
RIYAD BANK	231.11	821	29,610	金融
ETIHAD ETISALAT CO	144.62	498	17,981	コミュニケーション・サービス
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	72.59	390	14,074	素材
ALINMA BANK	188.42	673	24,276	金融
THE SAUDI NATIONAL BANK	270.87	1,812	65,308	金融
SAUDI ARABIAN OIL CO	561.61	2,193	79,038	エネルギー
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	275.76	443	16,000	素材
SAUDI ELECTRICITY CO	365.17	848	30,585	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	537,102 <2.6%>	
	百株	千インド・ルピー	千円	
(インド)				
TATA STEEL LTD	425.77	42,413	73,798	素材
AXIS BANK LTD	526.55	34,265	59,621	金融
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	23.5	18,357	31,941	一般消費財・サービス
TATA POWER CO LTD	556.46	12,264	21,340	公益事業
BANK OF BARODA	873.29	8,780	15,278	金融
HINDUSTAN UNILEVER LTD	91.66	19,899	34,624	生活必需品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	524.85	11,231	19,543	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	751.56	33,677	58,598	金融
NTPC LTD	1,829.05	27,691	48,183	公益事業
JSW STEEL LTD	300.41	16,880	29,371	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,332.5	29,841	51,923	公益事業
INDIAN OIL CORP LTD	1,457.95	16,073	27,968	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	715.4	22,485	39,123	エネルギー
JINDAL STEEL & POWER LTD	260.88	9,085	15,808	素材
ULTRATECH CEMENT LTD	15.97	8,669	15,084	素材
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	46.17	7,380	12,842	金融
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	90.2	10,277	17,883	金融
TECH MAHINDRA LTD	117.02	12,054	20,975	情報技術
YES BANK LTD	176.4	224	389	金融
TATA MOTORS LTD-A-DVR	281.75	5,567	9,687	一般消費財・サービス
REC LTD	725.16	8,230	14,321	金融
COAL INDIA LTD	1,657.98	31,866	55,447	エネルギー
INDUS TOWERS LTD	411.72	8,292	14,428	コミュニケーション・サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	787.03	8,008	13,933	金融
GAIL INDIA LTD	1,294.03	19,015	33,087	公益事業
HINDALCO INDUSTRIES LTD	659.18	23,618	41,096	素材
GRASIM INDUSTRIES LTD	137.11	17,952	31,237	素材
WIPRO LTD	155.83	6,948	12,090	情報技術
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	135.39	43,467	75,633	情報技術
INFOSYS LTD	502.75	72,423	126,017	情報技術
LARSEN & TOUBRO LTD	189.47	29,266	50,923	資本財・サービス
TATA MOTORS LTD	1,289.11	52,228	90,877	一般消費財・サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	350.93	74,028	128,809	金融

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千インド・ルピー	千円	
ICICI BANK LTD	267.64	18,346	31,923	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD	700.02	183,972	320,111	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	2,316.58	36,127	62,861	エネルギー
ITC LTD	909.71	24,148	42,017	生活必需品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	363.7	37,070	64,502	一般消費財・サービス
HERO MOTOCORP LTD	58.06	14,849	25,838	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD	413.67	28,214	49,092	コミュニケーション・サービス
UPL LTD	171.76	12,292	21,389	素材
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	154.16	12,718	22,131	ヘルスケア
HCL TECHNOLOGIES LTD	180.04	17,948	31,229	情報技術
VEDANTA LTD	794.58	23,134	40,253	素材
インド・ルピー通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	25,022.95 44銘柄	1,151,290 <9.9%>	2,003,245
	百株	千インドネシア・ルピア	千円	
(インドネシア)				
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	4,829	3,368,227	30,987	一般消費財・サービス
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	12,563	5,163,393	47,503	コミュニケーション・サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	3,155	2,610,762	24,019	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	7,016	5,191,840	47,764	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	4,441	3,641,620	33,502	金融
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	15,072	6,571,392	60,456	金融
ADARO ENERGY TBK PT	8,504	2,772,304	25,505	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	29,319,539 <1.3%>	269,739
	百株	千ブラジル・リアル	千円	
(ブラジル)				
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	265	166	4,403	公益事業
ENERGISA SA-UNITS	147	619	16,333	公益事業
RUMO SA	509	868	22,902	資本財・サービス
VIBRA ENERGIA SA	1,134	1,930	50,904	一般消費財・サービス
VIA SA	2,265	518	13,680	一般消費財・サービス
NATURA & CO HOLDING SA	412	576	15,201	生活必需品
TIM SA	526.26	655	17,294	コミュニケーション・サービス
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	555	316	8,343	ヘルスケア
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	3,763	11,138	293,770	エネルギー
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	312	292	7,710	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	4,701.59	8,763	231,139	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	4,159.36	9,836	259,441	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	307	556	14,679	素材
VALE SA	1,785.9	14,594	384,917	素材
GERDAU SA-PREF	634	1,610	42,489	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	2,491	8,145	214,834	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	991.73	1,075	28,353	公益事業
ITAUSA SA	1,323.2	1,153	30,431	金融
BRASKEM SA-PREF A	166	687	18,121	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	245	987	26,047	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	1,277	4,280	112,895	金融
COSAN SA	392	720	18,992	エネルギー
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	559	2,317	61,110	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	1,084	747	19,726	公益事業
EMBRAER SA	489	552	14,560	資本財・サービス
METALURGICA GERDAU SA-PREF	1,192	1,290	34,047	素材
CCR SA	786	967	25,518	資本財・サービス
BRF SA	797	1,048	27,662	生活必需品
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	266	1,119	29,528	公益事業
LOJAS RENNEN S. A.	277.75	636	16,797	一般消費財・サービス
JBS SA	801	2,643	69,715	生活必需品
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	115	106	2,817	素材
SUZANO SA	158.45	803	21,187	素材
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,380	1,585	41,819	金融
CIELO SA	2,931.28	1,108	29,223	情報技術
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	411	962	25,376	公益事業
SUL AMERICA SA - UNITS	343.18	821	21,677	金融
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	276.3	419	11,054	公益事業
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	407	1,227	32,374	金融
TELEFONICA BRASIL S. A.	340	1,575	41,563	コミュニケーション・サービス
KLABIN SA - UNIT	325	679	17,931	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	1,106	1,350	35,616	エネルギー
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	393	797	21,020	金融
COGNA EDUCACAO	4,014	903	23,820	一般消費財・サービス
BANCO BRADESCO S. A.	1,381.21	2,146	56,610	金融
AMBEV SA	1,910	2,511	66,243	生活必需品
ブラジル・リアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	50,105.21 46銘柄	97,818 <12.7%>	2,579,895
	百株	千オフショア・人民元	千円	
(中国)				
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	1,044	2,112	42,270	金融
BANK OF BEIJING CO LTD -A	1,860	837	16,752	金融
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	518	2,342	46,881	金融
IND & COMM BK OF CHINA-A	3,012	1,421	28,453	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	130	233	4,675	ヘルスケア

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	千オフショア・人民元	千円	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	29	119	2,393	一般消費財・サービス
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	6	1,122	22,468	生活必需品
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	159	575	11,513	素材
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	564	853	17,090	不動産
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	2,719	2,139	42,827	金融
CITIC SECURITIES CO-A	215	453	9,083	金融
CHINA MERCHANTS BANK-A	512	2,009	40,210	金融
PING AN BANK CO LTD-A	786	1,109	22,212	金融
GF SECURITIES CO LTD-A	148	284	5,687	金融
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	4,804	2,584	51,728	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-A	101	243	4,871	一般消費財・サービス
SAIC MOTOR CORP LTD-A	871	1,592	31,866	一般消費財・サービス
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	439	173	3,470	金融
CHINA COAL ENERGY CO-A	262	298	5,977	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	171.6	251	5,024	資本財・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHINA-A	1,079	378	7,580	資本財・サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	704	349	7,002	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-A	135	253	5,082	素材
YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	41	177	3,557	エネルギー
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	306	183	3,680	金融
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	10,813	3,265	65,357	金融
BANK OF CHINA LTD-A	3,144	1,015	20,324	金融
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	2,849	1,207	24,176	エネルギー
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	3,699	1,842	36,868	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	344	1,187	23,759	エネルギー
CHINA VANKE CO LTD -A	674	1,196	23,944	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	333	726	14,535	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	487	230	4,610	金融
CHINA MINSHENG BANKING-A	4,294	1,670	33,431	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	3,928	1,253	25,078	金融
CRRC CORP LTD-A	1,187	607	12,163	資本財・サービス
CHINA UNITED NETWORK-A	2,495	865	17,327	コミュニケーション・サービス
CGN POWER CO LTD-A	189	53	1,062	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	213	306	6,143	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	335	328	6,577	金融
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	2,064	1,281	25,653	資本財・サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	1,231	816	16,334	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	102	304	6,089	金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	1,583	813	16,284	金融
BYD CO LTD -A	10	343	6,876	一般消費財・サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	71	121	2,441	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-A	237	304	6,090	資本財・サービス
ZUIJIN MINING GROUP CO LTD-A	269	269	5,389	素材
HUANENG POWER INTL INC-A	456	280	5,612	公益事業
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA	953	495	9,918	金融
オフショア・人民元通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	62,575.6 50 銘柄	42,890 <4.2% >	858,419
(マレーシア)	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYAN BANKING BHD	763	662	20,224	金融
PUBLIC BANK BERHAD	1,686	760	23,219	金融
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	807	779	23,805	素材
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	1,104	550	16,822	金融
マレーシア・リンギット通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,360 4 銘柄	2,753 <0.4% >	84,071
(南アフリカ)	百株	千南アフリカ・ランド	千円	
GOLD FIELDS LTD	237.82	3,572	30,082	素材
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	11.13	2,282	19,219	金融
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	9,718.7	2,458	20,703	一般消費財・サービス
OLD MUTUAL LTD	1,535.77	1,758	14,806	金融
VODACOM GROUP LTD	153.79	2,059	17,337	コミュニケーション・サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD	154.54	3,232	27,221	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD	162.94	3,474	29,252	金融
BIDVEST GROUP LTD	89.12	1,880	15,832	資本財・サービス
BID CORP LTD	86.49	2,733	23,012	生活必需品
STANDARD BANK GROUP LTD	308.84	4,919	41,422	金融
SASOL LTD	306.1	12,345	103,950	素材
REMGRO LTD	135.67	1,790	15,073	金融
DISCOVERY LTD	130.47	1,697	14,292	金融
EXXARO RESOURCES LTD	101.92	2,033	17,122	エネルギー
KLUMBA IRON ORE LTD	26.67	1,434	12,082	素材
SANLAM LTD	452.73	2,469	20,794	金融
FIRSTRAND LTD	1,179.95	7,653	64,439	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	454.23	2,384	20,079	一般消費財・サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	143.47	1,797	15,138	一般消費財・サービス
ABSA GROUP LTD	237	3,849	32,413	金融
NASPERS LTD-N SHS	35.59	6,192	52,142	一般消費財・サービス
MTN GROUP LTD	511.77	7,167	60,348	コミュニケーション・サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	112.5	1,909	16,080	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	137.42	1,909	16,079	ヘルスケア

銘柄	株数	2022年6月15日現在		業種等
		評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	139.52	千南アフリカ・ランド 3,542	千円 29,825	素材
MR PRICE GROUP LTD	81.72	1,543	12,992	一般消費財・サービス
SIBANYE STILLWATER LTD	798.07	3,293	27,732	素材
南アフリカ・ランド通貨計	17,443.94	91,387	769,480	
	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	27 銘柄	<3.8% >	
(タイ)	百株	千タイ・パーツ	千円	
SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	1,653	17,769	68,413	金融
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	271	3,644	14,033	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR	503	18,057	69,522	素材
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	385	5,678	21,863	金融
KASIKORN BANK PCL-NVDR	675	9,956	38,331	金融
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	31,683	3,928	15,125	金融
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	983	5,037	19,395	素材
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	389	8,130	31,300	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	6,963	10,931	42,087	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	4,964	6,651	25,609	エネルギー
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	2,061	5,070	19,519	ヘルスケア
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	772	13,394	51,567	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	11,202	3,831	14,749	エネルギー
PTT PCL-NVDR	9,340	34,091	131,250	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	1,242	6,768	26,060	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	1,718	10,694	41,174	生活必需品
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	474	6,375	24,544	金融
LAND & HOUSES PUB - NVDR	4,672	3,901	15,019	不動産
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	3,746	9,833	37,858	生活必需品
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,966	9,092	35,007	素材
タイ・パーツ通貨計	85,662	192,839	742,433	
	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	20 銘柄	<3.7% >	
ファンド合計	981,133.17	—	17,028,113	
	銘柄数 < 比率 >	402 銘柄	<83.9% >	

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 新株予約権証券

銘柄	証券数	2022年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(タイ)	証券	千タイ・パーツ	千円
TMBTHANACHA-CW25	31,683	18	71
ファンド合計	証券数、金額 銘柄数 < 比率 >	31,683	18
	1 銘柄		<0.0% >

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 外国投資信託証券

銘柄	口数	2022年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千アメリカ・ドル	千円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	771.6	14,452	1,951,173
合計	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	771.6	14,452
	1 銘柄		<9.6% >

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(4) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2022年6月15日現在	
	買建額	売建額
外国	百万円	百万円
MSCI EMGMKT (アメリカ)	1,230	—

(注1) 外貨建の評価額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

運用報告書 第11期 (決算日 2021年7月5日)

(作成対象期間 2020年7月7日～2021年7月5日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

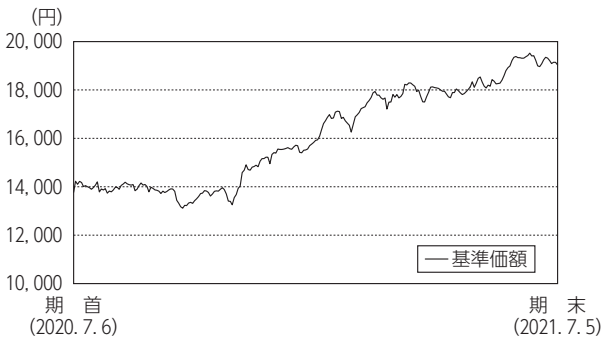
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：13,774円 期末：19,034円 騰落率：38.2%

【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。経済回復への期待から世界的な株高となる中で新興国株式市況は上昇し、基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆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、新型コロナウイルスの感染拡大に対する懸念が継続する一方で、市場予想を上回る米国の経済指標や中国の景気持ち直しから上昇しました。その後2020年9月に入ると、高値警戒感や欧州でのウイルス感染拡大による行動制限を嫌じたことなどから、下落基調へと転換しました。11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通りの当選確実となり、選挙に対する不確実性が後退したことや、米国での大規模経済対策などの政策期待から上昇しました。2021年1月末から当作成期末にかけては、金利上昇に伴って軟調な展開となる場面も散見されたものの、経済活動の正常化期待から堅調な展開になり、当作成期は大幅な上昇となりました。

○為替相場

新興国通貨の為替相場は、対円で上昇 (円安) しました。

新興国の為替相場は、当作成期首から2020年12月末にかけて、緩和的な金融環境によって米国の実質金利が低下したことなどが米ドルの下落要因となり、新興国通貨高で推移しました。また、新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念、米中関係の動向や追加経済対策をめぐる先行きの見通しの不透明感なども、米ドル安要因となりました。2021年に入ると、米国において民主党が大統領府・連邦議会上下両院を制したことやワウチンの実用化などから市場のリスク選好姿勢が強まりました。また、F R B (米国連邦準備制度理事会) 高官の量的緩和政策の縮小時期をめぐる発言が、米国の金利上昇とともに米ドル買いにつながったことで、新興国通貨は米ドルに対して横ばいの推移となりました。一方この期間の円は弱く、対円でも上昇しました。4月から当作成期末にかけては、再び米ドル安となり新興国通貨高で当作成期を迎えました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

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

年月日	基準価額		FTSE RAFI エマージング インデックス (円換算)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率			
(期首) 2020年7月6日	13,774	—	15,645	—	82.7	3.0	13.8
7月末	13,738	△ 0.3	15,586	△ 0.4	87.5	2.7	9.5
8月末	14,010	1.7	15,863	1.4	93.2	2.9	3.9
9月末	13,221	△ 4.0	14,980	△ 4.2	95.6	4.0	0.4
10月末	13,397	△ 2.7	15,175	△ 3.0	94.7	2.6	2.6
11月末	15,220	10.5	17,279	10.4	94.1	2.9	3.2
12月末	15,763	14.4	17,902	14.4	91.9	3.6	4.2
2021年1月末	16,539	20.1	18,706	19.6	88.1	4.6	6.9
2月末	17,668	28.3	20,139	28.7	88.2	4.0	7.8
3月末	18,118	31.5	20,599	31.7	86.2	11.2	1.0
4月末	18,338	33.1	20,813	33.0	94.1	2.3	3.1
5月末	18,921	37.4	21,532	37.6	91.5	2.2	5.9
6月末	19,090	38.6	21,707	38.7	88.6	5.1	6.1
(期末) 2021年7月5日	19,034	38.2	21,635	38.3	88.1	8.7	2.9

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

(注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

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38.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は38.2%となりました。

配当金に対する課税分や売買手数料・保管費用等のコスト負担が、マイナス要因となりました。

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

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

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	18円 (13)
(新株予約権証券)	(0)
(先物・オプション)	(2)
(投資信託証券)	(3)
有価証券取引税 (株式)	10 (10)
(新株予約権証券)	(0)
(投資信託証券)	(0)
その他費用 (保管費用)	32 (22)
(その他)	(10)
合 計	60

(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

(2020年7月7日から2021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 48,920.05 (2)	千アメリカ・ドル 5,867 (△ 95)	百株 54,215.61	千アメリカ・ドル 4,625
	香港	百株 172,167 (486.74)	千香港・ドル 137,155 (△ 43)	百株 90,792.54	千香港・ドル 67,975
	シンガポール	百株 540 ()	千シンガポール・ドル 57 ()	百株 —	千シンガポール・ドル —
	台湾	百株 40,550 (304.98)	千台湾・ドル 240,294 (△ 217)	百株 30,847.47	千台湾・ドル 213,730
	トルコ	百株 10,320.93 ()	千トルコ・リラ 8,416 ()	百株 2,239.54	千トルコ・リラ 1,404
	メキシコ	百株 8,819 ()	千メキシコ・ペソ 23,420 (△ 33)	百株 8,129.23	千メキシコ・ペソ 20,332
	チリ	百株 26,824.87 (2.74)	千チリ・ペソ 303,684 ()	百株 23,591.85	千チリ・ペソ 188,530
	サウジアラビア	百株 1,226.07 ()	千サウジアラビア・リアル 4,176 ()	百株 962.7	千サウジアラビア・リアル 4,914
	インド	百株 15,624.43 (3.51)	千インド・ルピー 333,172 (791)	百株 17,150.95	千インド・ルピー 115,090
	インドネシア	百株 44,534 ()	千インドネシア・ルピア 14,948,841 ()	百株 —	千インドネシア・ルピア —
国	ブラジル	百株 29,729 (3,286.6)	千ブラジル・リアル 61,962 ()	百株 1,156.89	千ブラジル・リアル 6,496
	中国	百株 23,707.07 ()	千オフショア・人民元 16,868 ()	百株 7,461.07	千オフショア・人民元 6,036

	買 付		売 付		
	株 数	金 額	株 数	金 額	
外 国	マレーシア	百株 2,639 (1,796)	千マレーシア・リンギット 1,586 ()	百株 991	千マレーシア・リンギット 744
	南アフリカ	百株 3,281.3 (3.21)	千南アフリカ・ランド 28,767 (△ 63)	百株 5,065.75	千南アフリカ・ランド 33,160
国	タイ	百株 57,946 ()	千タイ・バーツ 80,478 (△ 128)	百株 4,250	千タイ・バーツ 8,166

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

(2)新株予約権証券

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

	買 付		売 付		
	証 券 数	金 額	証 券 数	金 額	
外 国	タイ	証券 — (7,487)	千タイ・バーツ — (34)	証券 7,487 ()	千タイ・バーツ 40 ()

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) ()内は、割当、権利行使及び権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 単位未満は切捨て。

(3)投資信託証券

(2020年7月7日から2021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 963.6 ()	千アメリカ・ドル 21,090 ()	千口 1,436 ()	千アメリカ・ドル 30,083 ()
	メキシコ	千口 20.2 ()	千メキシコ・ペソ 343 (△ 40)	千口 100.4 ()	千メキシコ・ペソ 2,391 ()
国	南アフリカ	千口 — ()	千南アフリカ・ランド — ()	千口 76.93 ()	千南アフリカ・ランド 1,017 ()

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

(4)先物取引の種類別取引状況

(2020年7月7日から2021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 8,120	百万円 7,077	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

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

当 期				期 末			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ALIBABA GROUP HOLDING LTD (ケイマン諸島)	95.1	313,294	3,294	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	155	354,624	2,287
HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	549	241,857	440	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR (ケイマン諸島)	8.5	225,640	26,545
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	103	175,474	1,703	CHINA MOBILE LTD (香港)	282	177,806	630
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	2,407	170,280	70	BAIDU INC - SPON ADR (ケイマン諸島)	3	85,509	28,503
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	302.4	160,751	531	VALE SA (ブラジル)	46	83,384	1,812
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR (ブラジル)	313.8	143,431	457	CNOOC LTD (香港)	773	81,115	104
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	1,635	131,283	80	MEDIA TEK INC (台湾)	22	75,353	3,425
PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)	102.5	130,526	1,273	UNITED MICROELECTRONICS CORP (台湾)	410	73,223	178
PETROBRAS - PETROLEO BRAS (ブラジル)	285.2	129,148	452	CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	738	67,886	91
BANCO BRADESCO SA-PREF (ブラジル)	239.2	119,232	498	BANK OF CHINA LTD-H (中国)	1,371	56,132	40

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

当 期				期 末			
買 付		売 付		買 付		売 付	
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	963.6	2,269,015	2,354	INVESCO FTSE RAFI EMERGING M (アメリカ)	1,436	3,264,963	2,273
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	20.2	1,630	80	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA (メキシコ)	100.4	12,867	128
				GROWTHPOINT PROPERTIES LTD (南アフリカ)	76.93	7,549	98

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国株式

銘柄	株数	金額	期 首		当 期		期 末		業 種 等
			株数	株数	評 価 額				
					外貨建金額	邦貨換算金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円					
(アメリカ)									
JOYY INC-ADR	—	10	64	7,137	コミュニケーション・サービス				
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	—	52	39	4,375	一般消費財・サービス				
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR PEF	337	290	181	20,212	エネルギー				
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	64	—	—	—	一般消費財・サービス				
BAIDU INC - SPON ADR	44	28	550	61,222	コミュニケーション・サービス				
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	80	56	106	11,808	一般消費財・サービス				
CANADIAN SOLAR INC	28	23	99	11,014	情報技術				
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	25	34	99	11,073	資本財・サービス				
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	199.5	353.5	340	37,841	コミュニケーション・サービス				
JD.COM INC-ADR	82	78	594	66,095	一般消費財・サービス				
NETEASE INC-ADR	5	30	339	37,786	コミュニケーション・サービス				
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	56	93	330	36,689	一般消費財・サービス				
VTB BANK JSC -GDR-REG S	1,642.98	1,912.17	249	27,759	金融				
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	45.6	72.9	227	25,331	素材				
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	60.5	96.08	424	47,131	エネルギー				
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	296	360.75	179	19,914	エネルギー				
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	92.1	169.93	580	64,564	素材				
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	249.7	206.94	295	32,894	生活必需品				
RUSHYDRO PJSC-ADR	604.95	—	—	—	公益事業				
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	811	1,569.77	2,626	291,931	金融				
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	12.2	24.98	561	62,449	エネルギー				
LUKOIL PJSC-SPON ADR	168.3	202.88	1,890	210,185	エネルギー				
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	487	912.99	698	77,699	エネルギー				
GAZPROM PJSC-SPON ADR	3,272.9	3,923.39	3,041	338,083	エネルギー				
SEVERSTAL - GDR REG S	102.7	134.6	288	32,108	素材				
TATNEFT PJSC - PEF	35.1	155.09	106	11,849	エネルギー				
SISTEMA PJSC	147	3,192	137	15,283	コミュニケーション・サービス				
ROSSETI PJSC	29,890	—	—	—	公益事業				
INTER RAO UES PJSC	10,160	27,261	173	19,320	公益事業				
ALROSA PJSC	791.6	1,803.1	309	34,354	素材				
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	362.29	566.19	131	14,644	金融				
AEROFLOT PJSC	402.5	1,649.1	153	17,112	資本財・サービス				
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	50,554.92	45,261.36	14,824	1,647,876				
	銘柄数 < 比率 >	30銘柄	29銘柄	< 10.2% >					
(香港)									
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1,410	—	—	—	資本財・サービス				
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	2,770	4,600	1,849	26,462	資本財・サービス				
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	400	620	706	10,114	資本財・サービス				
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	760	780	1,817	26,006	一般消費財・サービス				

銘柄	期首		期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千香港・ドル	千円	
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	1,100	—	—	—	資本財・サービス
JIANGXI COPPER CO LTD-H	750	510	801	11,472	素材
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	1,400	—	—	—	公益事業
CHINA GAS HOLDINGS LTD	196	492	1,163	16,650	公益事業
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	17,438	20,798	8,132	116,369	エネルギー
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	155	—	—	—	公益事業
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,060	2,460	1,699	24,324	一般消費財・サービス
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	—	3,540	350	5,015	一般消費財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	980	—	—	—	資本財・サービス
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	135	290	932	13,341	資本財・サービス
FOSUN INTERNATIONAL LTD	930	715	795	11,377	資本財・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD	182	215	12,351	176,753	コミュニケーション・サービス
CHINA TELECOM CORP LTD-H	6,920	—	—	—	コミュニケーション・サービス
AIR CHINA LTD-H	600	1,100	621	8,893	資本財・サービス
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	3,320	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	470	605	1,161	16,622	不動産
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	1,500	2,580	670	9,599	不動産
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	580	—	—	—	公益事業
PETROCHINA CO LTD-H	12,580	20,520	7,777	111,290	エネルギー
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	—	155	1,079	15,448	一般消費財・サービス
CNOOC LTD	5,930	—	—	—	エネルギー
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	880	—	—	—	不動産
HUANENG POWER INTL INC-H	3,380	6,120	1,817	26,010	公益事業
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	195	355	1,444	20,675	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,150	1,050	1,377	19,713	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	38,110	47,080	28,577	408,944	金融
CHINA MOBILE LTD	2,150	—	—	—	コミュニケーション・サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	656	1,242	1,602	22,927	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	5,380	7,040	2,583	36,972	金融
GF SECURITIES CO LTD-H	306	500	501	7,169	金融
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	284	484	541	7,743	金融
HENGAN INTL GROUP CO LTD	140	275	1,454	20,817	生活必需品
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	2,660	4,750	2,484	35,549	金融
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	700	760	364	5,209	資本財・サービス
HUADIAN POWER INTL CORP-H	1,420	—	—	—	公益事業
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	1,705	2,450	3,660	52,378	エネルギー
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	312	1,091.2	1,204	17,239	ヘルスケア
SINOPHARM GROUP CO-H	512	1,028	2,343	33,540	ヘルスケア
CHINA RESOURCES LAND LTD	700	1,100	3,465	49,584	不動産
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	260	—	—	—	その他
YANZHOU COAL MINING CO-H	1,000	1,820	1,856	26,565	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	430	1,285	959	13,736	ヘルスケア
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	—	220	1,016	14,544	公益事業
BYD CO LTD-H	80	50	1,106	15,826	一般消費財・サービス
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	14,670	25,230	6,812	97,481	金融
CHINA RESOURCES CEMENT	—	820	594	8,507	素材
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	—	254	276	3,961	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	210	358	930	13,319	金融
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	2,120	3,900	1,014	14,510	金融
CITIC LTD	880	2,150	1,806	25,843	資本財・サービス
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	—	1,165	1,211	17,337	素材
IND & COMM BK OF CHINA-H	30,830	54,900	24,979	357,456	金融
CHINA TOWER CORP LTD-H	5,820	16,760	1,776	25,422	コミュニケーション・サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	916	—	—	—	情報技術
MEITUAN-CLASS B	106	52	1,580	22,621	一般消費財・サービス
SEAZEN GROUP LTD	—	1,240	908	13,006	不動産
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	—	951	20,161	288,506	一般消費財・サービス
GUANGDONG INVESTMENT LTD	420	860	949	13,586	公益事業
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	2,150	2,150	380	5,445	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-H	—	250	673	9,641	一般消費財・サービス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	1,220	3,180	5,673	81,182	不動産
CRRC CORP LTD - H	1,240	—	—	—	資本財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	3,110	—	—	—	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-H	—	4,570	776	11,117	公益事業
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	915	1,940	14,530	207,932	金融
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	290	1,040	2,766	39,587	不動産
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	—	585	1,172	16,784	資本財・サービス
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	3,845.8	7,335.8	2,721	38,945	金融
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	2,200	2,440	2,110	30,202	不動産
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	70	60	1,055	15,102	一般消費財・サービス
CHINA VANKE CO LTD-H	409	899	2,198	31,454	不動産
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	1,940	2,900	522	7,469	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	560	960	655	9,382	一般消費財・サービス
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	55	64	1,223	17,510	一般消費財・サービス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	—	330	1,504	21,533	生活必需品
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	2,020	3,600	2,480	35,494	金融
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	1,075	415	1,016	14,549	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	440	560	937	13,414	資本財・サービス
SUNNY OPTICAL TECH	—	37	875	12,527	情報技術
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	2,680	2,920	1,316	18,845	素材
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	646	882	2,125	30,417	金融

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	百株	百株	千香港・ドル	千円		
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	349	606	993	14,221	ヘルスケア	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	1,210	1,950	2,987	42,749	金融	
ENIN ENERGY HOLDINGS LTD	100	132	1,958	28,031	公益事業	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	620	660	728	10,426	素材	
KUNLUN ENERGY CO LTD	1,400	2,020	1,442	20,639	公益事業	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	804	—	—	—	不動産	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	1,140	620	648	9,280	素材	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	—	1,280	670	9,598	資本財・サービス	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	2,300	2,680	2,420	34,630	素材	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	4,381	8,521	4,447	63,650	金融	
CHINA EVERGRANDE GROUP	800	1,420	1,428	20,442	不動産	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	520	—	—	—	不動産	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	—	1,980	605	8,670	金融	
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	12,260	3,800	752	10,766	情報技術	
CHINA MERCHANTS BANK-H	915	1,010	6,534	93,511	金融	
BANK OF CHINA LTD-H	33,860	33,500	9,313	133,269	金融	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	335	440	837	11,988	金融	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	1,600	2,400	698	9,994	金融	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	680	1,272	859	12,304	金融	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	—	940	686	9,819	一般消費財・サービス	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	300	580	2,479	35,481	不動産	
香港・ドル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	268,387.8 90銘柄	350,249 88銘柄	250,487 <22.2% >	3,584,473	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING		887	1,427	205	16,950	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 >	887 1銘柄	1,427 1銘柄	205 <0.1% >	16,950	
(台湾)		百株	百株	千台湾・ドル	千円	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO		200	220	3,388	13,450	情報技術
TAIWAN CEMENT		1,272.32	1,481.45	7,481	29,701	素材
ASIA CEMENT CORP		630	—	—	—	素材
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT		940	1,160	12,992	51,579	情報技術
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA		420	—	—	—	金融
WALSIN TECHNOLOGY CORP		—	90	1,899	7,539	情報技術
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO		821.12	881.12	6,467	25,676	生活必需品
FORMOSA PLASTICS CORP		496	806	8,463	33,598	素材
NAN YA PLASTICS CORP		441.4	621.4	5,250	20,846	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE		433.9	593.9	5,054	20,065	素材
CHINA STEEL CORP		976.86	3,206.86	12,490	49,589	素材
HOTAI MOTOR COMPANY LTD		30	—	—	—	一般消費財・サービス
LITE-ON TECHNOLOGY CORP		586.16	676.16	3,847	15,274	情報技術
DELTA ELECTRONICS INC		470	340	10,166	40,360	情報技術
YAGEO CORPORATION		60	80	4,448	17,659	情報技術
WINBOND ELECTRONICS CORP		—	750	2,610	10,361	情報技術
ACER INC		—	1,730	4,956	19,677	情報技術
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD		300	670	4,355	17,289	情報技術
QUANTA COMPUTER INC		850	720	6,400	25,411	情報技術
AU OPTRONICS CORP		7,450	6,680	15,096	59,935	情報技術
CHUNGHWA TELECOM CO LTD		884	834	9,507	37,746	コミュニケーション・サービス
MEDIATEK INC		280.03	160.03	15,314	60,801	情報技術
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD		230	360	6,516	25,869	情報技術
EVA AIRWAYS CORP		—	1,690	3,405	13,519	資本財・サービス
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD		—	1,180	3,068	12,180	金融
FUBON FINANCIAL HOLDING CO		1,234.11	1,884.11	13,735	54,529	金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO		1,548.38	1,968.38	10,609	42,121	金融
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL		2,240	4,120	5,417	21,509	金融
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO		1,440.27	2,065.05	5,369	21,315	金融
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO		1,388.28	2,553.81	6,767	26,868	金融
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT		1,589.93	1,769.93	5,761	22,872	金融
TAISHIN FINANCIAL HOLDING		1,287.68	—	—	—	金融
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING		4,193.34	4,243.34	4,001	15,886	金融
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS		1,670	—	—	—	金融
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT		2,720.28	2,470.28	5,533	21,968	金融
FIRST FINANCIAL HOLDING CO		1,191.72	1,467.47	3,294	13,079	金融
LARGAN PRECISION CO LTD		10	20	6,210	24,654	情報技術
NOVATEK MICROELECTRONICS COR		110	80	3,948	15,673	情報技術
TAIWAN MOBILE CO LTD		310	340	3,468	13,768	コミュニケーション・サービス
WISTRON CORP		1,291.1	1,331.1	4,306	17,095	情報技術
INNOLUX CORP		9,660	6,600	14,025	55,680	情報技術
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD		310	—	—	—	コミュニケーション・サービス
PEGATRON CORP		630	1,680	11,424	45,354	情報技術
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING		150	240	2,496	9,909	情報技術
CHAILEASE HOLDING CO LTD		214.71	264.71	5,333	21,176	金融
POWERTECH TECHNOLOGY INC		194	324	3,483	13,827	情報技術
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP		320	360	3,960	15,721	エネルギー
COMPAL ELECTRONICS		1,070	1,850	4,079	16,195	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC		2,660	2,140	125,832	499,565	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY		3,679.02	9,169.02	102,234	405,881	情報技術
PRESIDENT CHAIN STORE CORP		80	130	3,386	13,444	生活必需品

銘柄	株数	金額	期首		期末		業種等	
			株数	金額	株数	金額		
ASUSTEK COMPUTER INC FAR EASTERN NEW CENTURY CORP UNITED MICROELECTRONICS CORP	137.6 690 4,580	百株 百株	317.6 — 2,060	百株 百株	千台湾・ドル 千円	11,782 — 10,835	46,779 — 43,018	情報技術 資本財・サービス 情報技術
台湾・ドル通貨計	株数 銘柄数	金額 <比率>	64,372.21 49銘柄	74,379.72 47銘柄	530,473	2,106,031	<13.1%>	
(トルコ) IS YATIRIM MENKUL DEGERLER A TURKIYE GARANTI BANKASI AKBANK T. A. S. TURKIYE IS BANKASI-C TURKCELL ILETISIM HIZMET AS TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK HACI OMER SABANCI HOLDING TURKIYE HALK BANKASI YAPI VE KREDI BANKASI TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D KOC HOLDING AS TURK HAVA YOLLARI AO BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	— 1,060.2 1,492.72 1,271 696.6 90.9 868.81 803.9 1,108.3 — 961.2 399.15 567.8 94.4	百株 百株	324.96 2,418.41 3,342.74 2,498.56 877.6 199.9 842.22 1,279.23 1,108.22 2,377.87 — 807.81 1,294.89 123.96	百株 百株	千トルコ・リラ 千円	475 2,031 1,781 1,286 1,408 1,912 1,530 1,169 549 520 — 1,571 1,779 774	6,094 26,041 22,839 16,495 18,056 24,511 19,617 14,988 7,046 6,675 — 20,141 22,807 9,923	金融 金融 金融 金融 コミュニケーション・サービス エネルギー 素材 金融 金融 金融 金融 資本財・サービス 資本財・サービス 生活必需品
トルコ・リラ通貨計	株数 銘柄数	金額 <比率>	9,414.98 12銘柄	17,496.37 13銘柄	16,790	215,240	<1.3%>	
(メキシコ) COCA-COLA FEMSA SAB DE CV GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO CEMEX SAB-CPO FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B WALMART DE MEXICO SAB DE CV GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	134 — 7,766 719 10,067.19 430 296.23 648 956 648	百株 百株	— 88 8,965 758 8,967.19 756 — 574 1,593 653	百株 百株	千メキシコ・ペソ 千円	— 1,866 13,268 4,358 14,768 12,675 — 5,441 10,163 8,513	— 10,477 74,474 24,464 82,898 71,149 — 30,543 57,046 47,788	生活必需品 資本財・サービス コミュニケーション・サービス コミュニケーション・サービス 素材 生活必需品 素材 素材 生活必需品 金融
メキシコ・ペソ通貨計	株数 銘柄数	金額 <比率>	21,664.42 9銘柄	22,354.19 8銘柄	71,056	398,841	<2.5%>	
(チリ) ENEL CHILE SA CENCOSUD SA BANCO SANTANDER CHILE ENEL AMERICAS SA SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B FALABELLA SA BANCO DE CHILE	6,997.67 — 21,058.8 8,533.63 — 218 12,197.92	百株 百株	— 461.15 28,986.96 12,217.63 14.72 215.93 10,345.39	百株 百株	千チリ・ペソ 千円	— 65,944 102,816 133,172 51,888 67,478 73,969	— 9,965 15,537 20,125 7,841 10,197 11,178	公益事業 生活必需品 金融 公益事業 素材 一般消費財・サービス 金融
チリ・ペソ通貨計	株数 銘柄数	金額 <比率>	49,006.02 5銘柄	52,241.78 6銘柄	495,269	74,846	<0.5%>	
(サウジアラビア) SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP SAUDI TELECOM CO AL RAJHI BANK SAMBA FINANCIAL GROUP RIYAD BANK ETIHAD ETISALAT CO SAVOLA YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL ALINMA BANK THE SAUDI NATIONAL BANK SAUDI ARABIAN OIL CO SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO SAUDI ELECTRICITY CO	214.6 75 174 126.2 163.6 120.7 71.2 62.1 174.26 130.5 98.8 309.9 —	百株 百株	131.73 54.52 241.62 — — 176.9 — — 329.25 118.42 280.37 285.25 366.17	百株 百株	千サウジアラビア・リアル 千円	1,604 717 2,725 — — 574 — — 723 688 982 552 884	47,620 21,294 80,892 — — 17,063 — — 21,459 20,420 29,166 16,407 26,256	素材 コミュニケーション・サービス 金融 金融 金融 コミュニケーション・サービス 生活必需品 素材 金融 金融 エネルギー 素材 公益事業
サウジアラビア・リアル通貨計	株数 銘柄数	金額 <比率>	1,720.86 12銘柄	1,984.23 9銘柄	9,453	280,582	<1.7%>	
(インド) RELIANCE INDUSTRIES-PARTLY P TATA STEEL LTD AXIS BANK LTD MARUTI SUZUKI INDIA LTD TATA POWER CO LTD BANK OF BARODA HINDUSTAN UNILEVER LTD HINDUSTAN PETROLEUM CORP STATE BANK OF INDIA NTPC LTD POWER FINANCE CORPORATION JSW STEEL LTD POWER GRID CORP OF INDIA LTD INDIAN OIL CORP LTD	— 185.4 233.9 13.5 — — 27.3 469.4 554.7 916 359.4 335.2 — 1,020.7	百株 百株	25.19 348.72 431.9 19.5 794.37 736.29 52.23 664.96 782.7 2,405.22 — 317.64 650.99 2,304.71	百株 百株	千インド・ルピー 千円	3,791 39,614 32,420 14,769 9,607 6,273 12,991 19,812 33,217 28,261 — 21,323 14,839 24,994	5,686 59,421 48,630 22,153 14,411 9,409 19,486 29,718 49,826 42,392 — 31,984 22,258 37,491	エネルギー 素材 金融 一般消費財・サービス 公益事業 金融 生活必需品 エネルギー 金融 公益事業 金融 素材 公益事業 エネルギー

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		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	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	422.05	686.05	31,746	47,620	エネルギー
VODAFONE IDEA LTD	11,058.9	—	—	—	コミュニケーション・サービス
JINDAL STEEL & POWER LTD	276.9	220.88	8,573	12,860	素材
ULTRATECH CEMENT LTD	—	10.97	7,371	11,057	素材
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	30.5	53.46	7,282	10,923	金融
TECH MAHINDRA LTD	58.2	92.74	10,103	15,154	情報技術
YES BANK LTD	176.4	176.4	239	358	金融
TATA MOTORS LTD-A-DVR	318.2	282.02	4,399	6,599	一般消費財・サービス
REC LTD	383.6	530.6	7,664	11,496	金融
COAL INDIA LTD	725.1	1,440.5	21,268	31,903	エネルギー
INDUS TOWERS LTD	206.8	—	—	—	コミュニケーション・サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	217.4	622.66	16,189	24,283	金融
GAIL INDIA LTD	378.66	691.94	10,469	15,703	公益事業
HINDALCO INDUSTRIES LTD	528	640.18	24,073	36,110	素材
GRASIM INDUSTRIES LTD	106.8	136.2	20,290	30,435	素材
WIPRO LTD	204.23	160.49	8,643	12,965	情報技術
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	84.16	108.98	36,240	54,361	情報技術
INFOSYS LTD	472.4	487.24	76,389	114,584	情報技術
LARSEN & TOUBRO LTD	155.72	135.49	20,129	30,193	資本財・サービス
TATA MOTORS LTD	1,066.8	1,103.73	38,067	57,101	一般消費財・サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	147.9	218.9	54,193	81,289	金融
ICICI BANK LTD	—	222.99	14,276	21,415	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD	400.4	526.81	112,160	168,240	エネルギー
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	1,211.25	2,380.25	28,194	42,291	エネルギー
ITC LTD	432.9	804.34	16,279	24,419	生活必需品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	169.5	234.85	18,379	27,569	一般消費財・サービス
HERO MOTOCORP LTD	25.1	29.67	8,663	12,994	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD	211.42	290.16	15,233	22,850	コミュニケーション・サービス
UPL LTD	—	137.76	11,011	16,517	素材
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	152.4	147.6	10,055	15,082	ヘルスケア
HCL TECHNOLOGIES LTD	151.4	162.74	16,024	24,036	情報技術
VEDANTA LTD	1,334.6	1,329.16	34,830	52,245	素材
インド・ルピー通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	25,123.19 39銘柄	23,600.18 43銘柄	950,361 <8.8% >	
(インドネシア)		百株	百株	千インドネシア・ルピア	千円
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,563	4,933	2,466,500	18,992	一般消費財・サービス
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	—	1,013	780,010	6,006	素材
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	9,272	18,061	5,544,727	42,694	コミュニケーション・サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	1,727	4,250	2,052,750	15,806	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	615	1,194	3,641,700	28,041	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	3,370	5,474	3,257,030	25,079	金融
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	—	8,570	886,995	6,829	公益事業
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	7,761	13,452	5,367,348	41,328	金融
ADARO ENERGY TBK PT	—	12,895	1,624,770	12,510	エネルギー
インドネシア・ルピア通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	25,308 6銘柄	69,842 9銘柄	25,621,830 <1.2% >	
(ブラジル)		百株	百株	千ブラジル・リアル	千円
ULTRAPAR PARTICIPACOES RIGHTS SA	—	902.93	0	19	エネルギー
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	6	164	92	2,025	公益事業
ENERGISA SA-UNITS	—	106	483	10,633	公益事業
RUMO SA	—	285	562	12,367	資本財・サービス
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	146	1,765	1,009	22,181	金融
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	36	184	578	12,718	金融
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	268	755	2,218	48,752	一般消費財・サービス
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	66	108	423	9,304	生活必需品
TIM SA	—	485.26	557	12,239	コミュニケーション・サービス
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	1,300	4,438	12,950	284,528	エネルギー
BANCO BRADESCO SA-PREF	1,437.26	4,212.18	10,951	240,621	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	1,833.36	4,857.36	14,576	320,272	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	246	185	833	18,319	素材
VALE SA	1,035.9	948.9	10,777	236,796	素材
GERDAU SA-PREF	367	570	1,696	37,270	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	821	3,673	11,030	242,342	エネルギー
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	413.97	1,074.87	1,301	28,599	公益事業
ITAUSA SA	—	1,361	1,528	33,580	金融
BRASKEM SA-PREF A	125	261	1,566	34,406	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	48	222	960	21,095	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	453	1,543	4,959	108,959	金融
COSAN SA	—	644	1,573	34,567	エネルギー
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	123	372	1,620	35,602	公益事業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	33	792	472	10,388	公益事業
EMBRAER SA	282	712	1,349	29,644	資本財・サービス
METALURGICA GERDAU SA-PREF	753	949	1,327	29,170	素材
CCR SA	252	886	1,189	26,124	資本財・サービス
BRF SA	197	571	1,533	33,697	生活必需品
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	68	260	949	20,867	公益事業
TIM PARTICIPACOES SA	194.26	—	—	—	その他
TELEFONICA BRASIL S. A. -PREF	153	—	—	—	その他
LOJAS RENNEN S. A.	50.05	197.05	854	18,785	一般消費財・サービス

銘柄	期首	当	期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	百株	百株	千ブラジル・リアル	千円	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	85.84	147.84	315	6,941	一般消費財・サービス
JBS SA	429	965	2,849	62,610	生活必需品
SUZANO SA	89.45	122.45	724	15,927	素材
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	197	379	729	16,037	生活必需品
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	141	906	1,487	32,685	金融
CIELO SA	752.28	2,442.28	886	19,478	情報技術
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	90	370	905	19,884	公益事業
SUL AMERICA SA - UNITS	—	188.18	641	14,102	金融
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	32	186.54	270	5,938	公益事業
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	146	332	1,356	29,812	金融
RAIA DROGASIL SA	—	235	582	12,804	生活必需品
TELEFONICA BRASIL S. A.	10	369	1,548	34,018	コミュニケーション・サービス
KLABIN SA - UNIT	144	—	—	—	素材
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	565	732	1,387	30,477	エネルギー
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	199	516	1,376	30,236	金融
LOJAS AMERICANAS SA	22.93	46.93	95	2,104	一般消費財・サービス
COGNA EDUCACAO	475	2,643	1,147	25,202	一般消費財・サービス
BANCO BRADESCO S. A.	382.41	1,267.65	2,786	61,218	金融
AMBEV SA	878	1,872	3,262	71,689	生活必需品
ブラジル・リアル通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	15,346.71 43 銘柄	47,205.42 48 銘柄	112,285 2,467,055 <15.3% >	
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元	千円	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	650	737	1,532	26,315	金融
BANK OF BEIJING CO LTD -A	—	1,495	729	12,530	金融
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	682	—	—	—	資本財・サービス
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	—	175	291	5,001	金融
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	131	249	1,551	26,642	金融
IND & COMM BK OF CHINA-A	2,318	3,796	1,992	34,227	金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	55	93	193	3,319	ヘルスケア
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	60	94	300	5,164	金融
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	84	29	121	2,085	一般消費財・サービス
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	4	3	603	10,371	生活必需品
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	46	80	322	5,541	素材
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	—	500	604	10,382	不動産
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	996	1,733	1,720	29,555	金融
HUADIAN POWER INTL CORP-A	404	—	—	—	公益事業
CITIC SECURITIES CO-A	110	148	350	6,011	金融
CHINA MERCHANTS BANK-A	359	388	2,058	35,351	金融
PING AN BANK CO LTD-A	378	464	1,011	17,380	金融
GF SECURITIES CO LTD-A	98	134	197	3,390	金融
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	2,175	3,940	1,824	31,330	資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-A	—	101	259	4,458	一般消費財・サービス
SAIC MOTOR CORP LTD-A	379	630	1,325	22,765	一般消費財・サービス
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	238	337	124	2,135	素材
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	291	421	250	4,302	資本財・サービス
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	—	289	114	1,965	金融
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	—	132	404	6,950	資本財・サービス
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	845	903	267	4,590	資本財・サービス
ALUMINIUM CORP OF CHINA LTD-A	621	704	361	6,214	素材
JIANGXI COPPER CO LTD-A	96	68	150	2,576	素材
YANZHOU COAL MINING CO-A	49	81	119	2,049	エネルギー
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	303	306	204	3,510	金融
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	4,834	8,046	2,437	41,871	金融
BANK OF CHINA LTD-A	2,442	2,581	794	13,653	金融
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	1,704	2,089	900	15,463	エネルギー
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	1,733	3,315	1,624	27,898	金融
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	263	398	767	13,179	エネルギー
CHINA VANKE CO LTD -A	191	344	827	14,209	不動産
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	122	153	431	7,407	金融
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	412	487	247	4,257	金融
CHINA MINSHENG BANKING-A	1,525	3,033	1,331	22,868	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	1,551	2,530	951	16,338	金融
CRRC CORP LTD-A	552	—	—	—	資本財・サービス
CHINA UNITED NETWORK-A	913	—	—	—	コミュニケーション・サービス
CGN POWER CO LTD-A	—	189	50	866	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	90	154	239	4,112	金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	123	229	261	4,491	金融
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	—	1,850	965	16,585	資本財・サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	268	—	—	—	資本財・サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	815	915	698	11,990	素材
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	35	52	231	3,978	金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	603	1,174	725	12,460	金融
AIR CHINA LTD-A	148	207	157	2,709	資本財・サービス
BYD CO LTD -A	18	7	167	2,873	一般消費財・サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	44	71	93	1,599	一般消費財・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-A	98	98	167	2,884	資本財・サービス
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	259	130	127	2,197	素材
HUANENG POWER INTL INC-A	386	665	280	4,819	公益事業
オフショア・人民元通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	30,501 48 銘柄	46,747 51 銘柄	33,469 574,840 <3.6% >	

ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円		
MISC BHD	429	—	—	—	資本財・サービス	
MALAYAN BANKING BHD	675	583	472	12,649	金融	
GENTING BHD	—	878	434	11,627	一般消費財・サービス	
PUBLIC BANK BERHAD	349	2,617	1,075	28,775	金融	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	691	1,360	631	16,882	金融	
TENAGA NASIONAL BHD	347	497	483	12,937	公益事業	
マレーシア・リンギット通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,491 5銘柄	5,935 5銘柄	3,097	82,871 <0.5%>	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円		
GOLD FIELDS LTD	154.2	241.42	3,195	24,894	素材	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	—	15.03	2,510	19,552	金融	
NEPI ROCKCASTLE PLC	75	151.07	1,540	12,001	不動産	
MULTICHOICE GROUP LTD	127.3	118.08	1,395	10,870	コミュニケーション・サービス	
OLD MUTUAL LTD	1,695.4	1,295.77	1,709	13,314	金融	
VODACOM GROUP LTD	171.2	141.5	1,807	14,083	コミュニケーション・サービス	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	227.2	157.17	2,444	19,046	生活必需品	
NEDBANK GROUP LTD	119	139.46	2,347	18,287	金融	
BIDVEST GROUP LTD	88.7	90.87	1,701	13,252	資本財・サービス	
BID CORP LTD	73.1	68.49	2,139	16,670	生活必需品	
NETCARE LTD	566.9	—	—	—	ヘルスケア	
STANDARD BANK GROUP LTD	364.2	320.36	4,040	31,477	金融	
SASOL LTD	236.4	273.1	5,977	46,563	素材	
REMGRO LTD	124.1	—	—	—	金融	
DISCOVERY LTD	89.4	130.47	1,603	12,491	金融	
EXXARO RESOURCES LTD	80.3	—	—	—	エネルギー	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	210.2	—	—	—	一般消費財・サービス	
SANLAM LTD	427.2	530.72	3,234	25,194	金融	
TIGER BRANDS LTD	66.8	—	—	—	生活必需品	
FIRSTRAND LTD	889.3	1,215.28	6,445	50,213	金融	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	399.6	278.95	1,506	11,734	一般消費財・サービス	
THE FOSCHINI GROUP LTD	78.4	—	—	—	一般消費財・サービス	
ABSA GROUP LTD	254.6	255.81	3,396	26,461	金融	
NASPERS LTD-N SHS	17.29	26.73	7,910	61,626	一般消費財・サービス	
MTN GROUP LTD	385.9	433.66	4,531	35,298	コミュニケーション・サービス	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	64.3	64.45	1,554	12,105	素材	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	132.8	119.7	1,936	15,084	ヘルスケア	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	54.5	122.25	3,309	25,783	素材	
SAPPI LIMITED	470.8	—	—	—	素材	
TELKOM SA SOC LTD	350	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
SPAR GROUP LIMITED/THE	77.7	—	—	—	生活必需品	
MR PRICE GROUP LTD	59	79.44	1,659	12,924	一般消費財・サービス	
SIBANYE STILLWATER LTD	265	344.77	2,064	16,082	素材	
南アフリカ・ランド通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	8,395.79 32銘柄	6,614.55 24銘柄	69,963	545,014 <3.4%>	
(タイ)	百株	百株	千タイ・バーツ	千円		
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	208	271	3,035	10,501	金融	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	309	458	19,602	67,824	素材	
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	227	385	4,620	15,985	金融	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	—	1,139	3,388	11,724	一般消費財・サービス	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	116	169	2,002	6,929	金融	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,068	1,641	15,876	54,933	金融	
THANACHART CAPITAL PCL-NVDR	372	—	—	—	金融	
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	—	31,683	3,548	12,277	金融	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	685	917	3,828	13,246	素材	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	221	412	7,065	24,447	コミュニケーション・サービス	
KRUNG THAI BANK - NVDR	2,994	6,418	6,803	23,538	金融	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	3,163	3,723	5,026	17,390	エネルギー	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	—	1,520	3,556	12,306	ヘルスケア	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	384	670	7,906	27,354	エネルギー	
IRPC PCL - NVDR	8,853	11,202	4,323	14,960	エネルギー	
BANGCHAK CORP PCL-NVDR	—	1,048	2,588	8,956	エネルギー	
PTT PCL-NVDR	5,902	10,368	40,176	139,008	エネルギー	
THAI OIL PCL-NVDR	706	961	5,189	17,955	エネルギー	
CP ALL PCL-NVDR	693	1,447	8,645	29,914	生活必需品	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	—	539	3,355	11,609	資本財・サービス	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	—	187	2,094	7,246	金融	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	—	3,271	2,616	9,054	不動産	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	1,316	2,294	6,079	21,033	生活必需品	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	1,214	1,404	8,424	29,147	素材	
タイ・バーツ通貨計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	28,431 17銘柄	82,127 23銘柄	169,753	587,347 <3.6%>	
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 < 比率 >	601,604.9 398銘柄	847,464.8 404銘柄	—	14,204,803 <88.1%>	

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

(2) 外国投資信託証券

銘柄	期首 □ 数	当 □ 数	期末 評 価 額	
			外貨建金額 千アメリカ・ドル	邦貨換算金額 千円
(アメリカ) INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	千口 651	千口 178.6	4,156	461,983
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	651 1 銘柄	178.6 1 銘柄	4,156 <2.9%>
(メキシコ) FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	千口 80.2	千口 —	—	—
メキシコ・ペソ通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	80.2 1 銘柄	— —	— <—>
(南アフリカ) GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	千口 76.93	千口 —	—	—
南アフリカ・ランド通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	76.93 1 銘柄	— —	— <—>
合 計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	808.13 3 銘柄	178.6 1 銘柄	— 461,983 <2.9%>

(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 1,401	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) 評価額の単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 14,204,803	% 88.0
投資信託証券	461,983	2.9
コール・ローン等、その他	1,477,725	9.1
投資信託財産総額	16,144,512	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=111.16円、1香港・ドル=14.31円、1シンガポール・ドル=82.49円、1台湾・ドル=3.97円、1トルコ・リラ=12.819円、1メキシコ・ペソ=5.613円、100チリ・ペソ=15.112円、1サウジアラビア・リアル=29.68円、1インド・ルピー=1.50円、100インドネシア・ルピア=0.77円、1ブラジル・リアル=21.971円、1オフショア・人民元=17.174円、1マレーシア・リングギット=26.753円、1南アフリカ・ランド=7.79円、1タイ・バーツ=3.46円です。
 (注3) 当期末における外貨建純資産(16,010,106千円)の投資信託財産総額(16,144,512千円)に対する比率は、99.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	16,467,168,379円
コール・ローン等	842,077,407
株式(評価額)	14,204,803,209
投資信託証券(評価額)	461,983,406
未収入金	712,351,835
未収配当金	107,607,095
差入委託証拠金	138,345,427
(B) 負債	340,596,345
未払金	333,023,836
未払解約金	7,566,569
その他未払費用	5,940
(C) 純資産総額(A-B)	16,126,572,034
元本	8,472,556,221
次期繰越損益金	7,654,015,813
(D) 受益権総口数	8,472,556,221口
1万口当り基準価額(C/D)	19,034円

* 期首における元本額は6,697,704,657円、当作成期間中における追加設定元本額は2,563,269,417円、同解約元本額は788,417,853円です。
 * 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、新興国株式インデックスファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)30,073,026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)244,455,917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)247,588,516円、D-I's 新興国株式インデックス135,184,864円、i F r e e 新興国株式インデックス3,368,872,878円、i F r e e 8資産バランス2,090,080,781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)717,072,972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1,170,193,060円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式372,572,544円、ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド96,461,663円です。
 * 当期末の計算口数当りの純資産額は19,034円です。

■損益の状況

当期 自 2020年7月7日 至 2021年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	420,452,414円
受取配当金	420,289,006
受取利息	198,675
その他収益金	225
支払利息	△ 35,492
(B) 有価証券売買損益	3,619,866,641
売買益	4,235,122,648
売買損	△ 615,256,007
(C) 先物取引等損益	81,757,968
取引益	158,263,439
取引損	△ 76,505,471
(D) その他費用	△ 24,606,978
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	4,097,470,045
(F) 前期繰越損益金	2,527,410,481
(G) 解約差損益金	△ 506,206,067
(H) 追加信託差損益金	1,535,341,354
(I) 合計 (E + F + G + H)	7,654,015,813
次期繰越損益金 (I)	7,654,015,813

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

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

【注記】

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

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

ダイワファンドラップ 日本債券インデックス

運用報告書(全体版)

第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）	
運用方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	日本債券インデックスマザーファンドの受益証券
	日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の30%以下
	マザーファンドの株式組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<4643>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公社債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
2期末(2018年6月15日)	円 9,915	円 0	% 0.6	525.468	% 0.7	% 99.4	% —	百万円 25,120
3期末(2019年6月17日)	10,149	0	2.4	538.684	2.5	99.4	—	27,372
4期末(2020年6月15日)	10,024	0	△ 1.2	532.954	△ 1.1	99.4	—	33,339
5期末(2021年6月15日)	9,987	0	△ 0.4	532.014	△ 0.2	99.3	—	36,597
6期末(2022年6月15日)	9,645	0	△ 3.4	514.574	△ 3.3	99.4	—	36,841

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

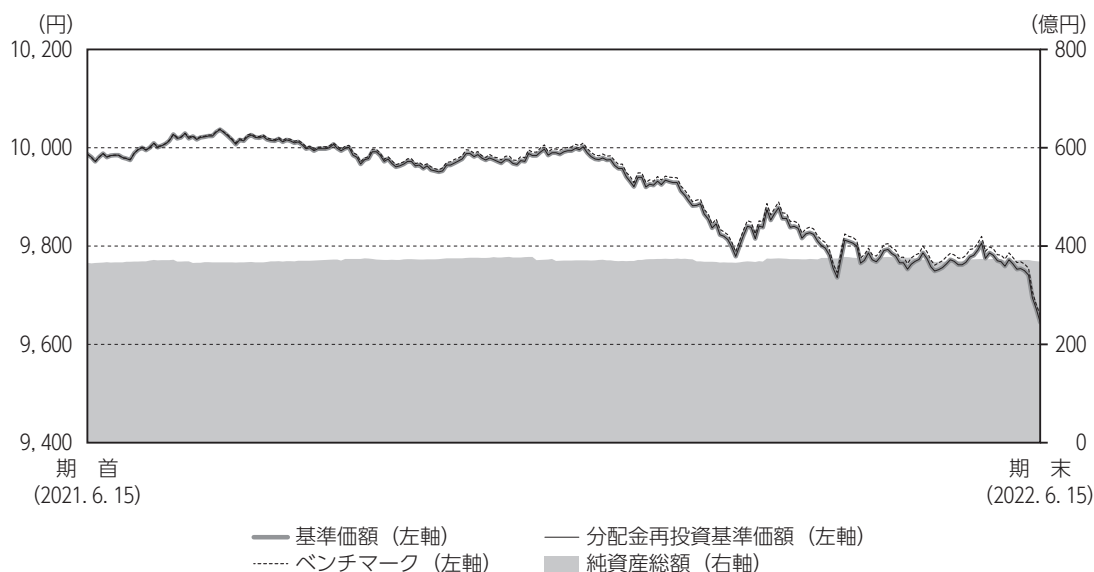
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

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

*ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数です。

■基準価額・騰落率

期首：9,987円

期末：9,645円 (分配金0円)

騰落率：△3.4% (分配金込み)

■基準価額の主な変動要因

「日本債券インデックスマザーファンド」の受益証券を通じて、わが国の公社債に投資した結果、投資している債券の価格が下落したことにより、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期首)2021年 6月15日	円	%			%	%
	9,987	—	532.014	—	99.3	—
6月末	9,975	△ 0.1	531.421	△ 0.1	99.5	—
7月末	10,024	0.4	534.087	0.4	99.1	—
8月末	10,014	0.3	533.627	0.3	99.0	—
9月末	9,978	△ 0.1	531.730	△ 0.1	99.3	—
10月末	9,965	△ 0.2	531.186	△ 0.2	99.4	—
11月末	9,988	0.0	532.469	0.1	99.1	—
12月末	9,964	△ 0.2	531.310	△ 0.1	99.6	—
2022年 1月末	9,892	△ 1.0	527.510	△ 0.8	99.4	—
2月末	9,841	△ 1.5	524.780	△ 1.4	99.3	—
3月末	9,812	△ 1.8	523.357	△ 1.6	99.5	—
4月末	9,786	△ 2.0	522.056	△ 1.9	99.5	—
5月末	9,770	△ 2.2	521.104	△ 2.1	99.4	—
(期末)2022年 6月15日	9,645	△ 3.4	514.574	△ 3.3	99.4	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

国内債券市場

国内債券市場では、長期金利は上昇（債券価格は下落）しました。

国内長期金利は、当作成期首より2021年8月にかけて、米国金利の低下や国内での新型コロナウイルスの感染急拡大により、一時ゼロ%程度まで低下しました。その後、世界的にインフレ懸念が高まったことで0.1%程度まで上昇しましたが、11月から先進各国で金融引き締めが始まると、将来のインフレ鈍化や景気減速を織り込んで長期金利は低下しました。2022年に入ると、世界的なインフレ圧力のさらなる高まりや各国での金融引き締め加速観測を受けて長期金利は上昇し、2月には0.2%台となりました。その後は、日銀が金利上昇に歯止めをかける姿勢を示したことや、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こともあり、3月下旬には0.2%台半ばまで上昇しました。4月以降も世界的なインフレ率の上振れが金利上昇要因になる一方、日銀が長期金利を0.25%にとどめる方針を改めて示したことで、当作成期末にかけて0.2%台前半から半ばでの推移が続きました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

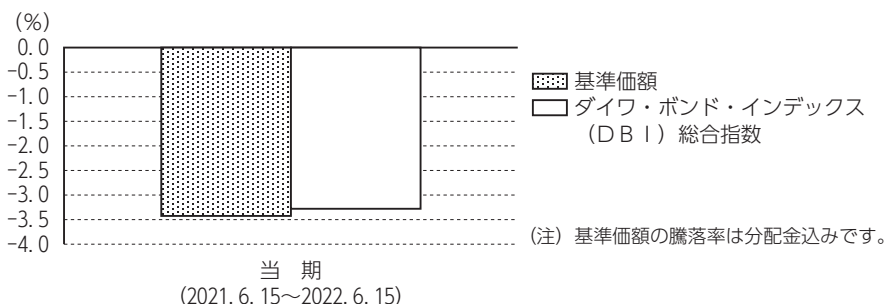
組入ファンド	ベンチマーク
日本債券インデックスマザーファンド	ダイワ・ボンド・インデックス（DB I）総合指数

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△3.3%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。

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差異は0.1%でした。差異の内訳は、運用管理費用等の要因によるベンチマークとの差異が0.2%程度、「日本債券インデックスマザーファンド」におけるベンチマークとの差異が0.0%程度となっており、信託報酬要因を除くと、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス（DB I）総合指数です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、収益分配を見送らせていただきました。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	267

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■日本債券インデックスマザーファンド

今後も、ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行います。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。

なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2021. 6. 16~2022. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	15円	0.148%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,914円です。
(投信会社)	(8)	(0.082)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(5)	(0.055)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(1)	(0.011)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合計	15	0.154	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

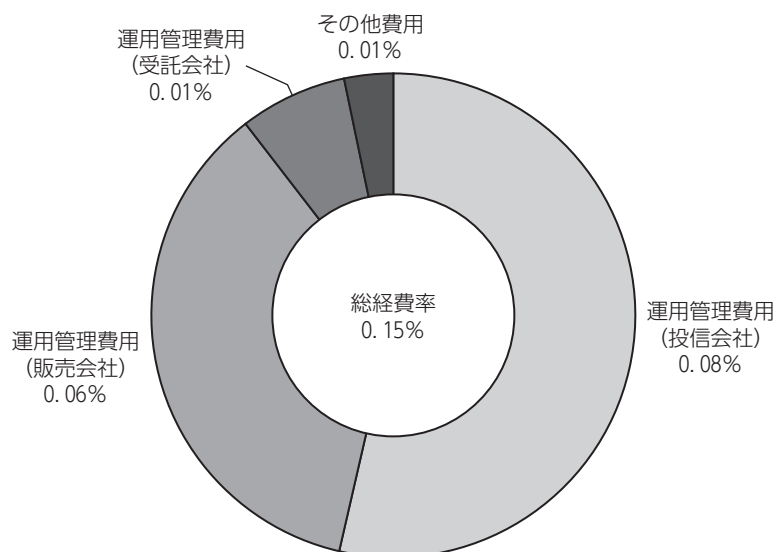
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

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



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日本債券 インデックス マザーファンド	千口 4,879,566	千円 6,878,424	千口 3,828,615	千円 5,399,736

(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6月16日から2022年6月15日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	29,291	225	0.8	14,659	504	3.4
コール・ローン	94,348	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合38.7%

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

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

種 類	当 期	
	日本債券インデックスマザーファンド 買 付 額	
公社債	百万円 600	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

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

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額
日本債券インデックス マザーファンド	千口 25,768,859	千口 26,819,810	千円 36,804,825

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日本債券インデックス マザーファンド	千円 36,804,825	% 99.7
コール・ローン等、その他	101,754	0.3
投資信託財産総額	36,906,580	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6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	36,906,580,198円
コール・ローン等	98,374,797
日本債券インデックス マザーファンド (評価額)	36,804,825,787
未収入金	3,379,614
(B) 負債	64,961,249
未払解約金	36,381,084
未払信託報酬	27,559,528
その他未払費用	1,020,637
(C) 純資産総額 (A - B)	36,841,618,949
元本	38,196,306,569
次期繰越損益金	△ 1,354,687,620
(D) 受益権総口数	38,196,306,569口
1万口当り基準価額 (C/D)	9,645円

* 期首における元本額は36,644,197,981円、当作成期中における追加設定元本額は10,246,997,124円、同解約元本額は8,694,888,536円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,645円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1,354,687,620円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 15,924円
受取利息	2,258
支払利息	△ 18,182
(B) 有価証券売買損益	△ 1,179,215,638
売買益	60,441,426
売買損	△ 1,239,657,064
(C) 信託報酬等	△ 57,234,187
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 1,236,465,749
(E) 前期繰越損益金	12,588,424
(F) 追加信託差損益金	△ 130,810,295
(配当等相当額)	(706,038,113)
(売買損益相当額)	(△ 836,848,408)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 1,354,687,620
次期繰越損益金 (G)	△ 1,354,687,620
追加信託差損益金	△ 130,810,295
(配当等相当額)	(706,038,113)
(売買損益相当額)	(△ 836,848,408)
分配準備積立金	314,955,207
繰越損益金	△ 1,538,832,532

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

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

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

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	706,038,113
(d) 分配準備積立金	314,955,207
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,020,993,320
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,020,993,320
(h) 受益権総口数	38,196,306,569口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 日本債券インデックス）が投資対象としている「日本債券インデックスマザーファンド」の決算日（2021年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在における日本債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■日本債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
365 10年国債 0.1% 2031/12/20	1,357,117	135 5年国債 0.1% 2023/3/20	1,552,681
150 5年国債 0.005% 2026/12/20	1,248,921	134 5年国債 0.1% 2022/12/20	952,223
151 5年国債 0.005% 2027/3/20	1,139,936	136 5年国債 0.1% 2023/6/20	951,833
148 5年国債 0.005% 2026/6/20	1,105,606	415 2年国債 0.1% 2022/8/1	751,784
364 10年国債 0.1% 2031/9/20	1,093,029	421 2年国債 0.1% 2023/2/1	601,220
149 5年国債 0.005% 2026/9/20	1,044,515	133 5年国債 0.1% 2022/9/20	551,287
431 2年国債 0.005% 2023/12/1	901,055	329 10年国債 0.8% 2023/6/20	504,650
433 2年国債 0.005% 2024/2/1	900,721	424 2年国債 0.005% 2023/5/1	500,456
363 10年国債 0.1% 2031/6/20	814,552	327 10年国債 0.8% 2022/12/20	454,338
366 10年国債 0.2% 2032/3/20	797,033	425 2年国債 0.005% 2023/6/1	380,364

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2022年6月15日現在における日本債券インデックスマザーファンド（73,960,042千円）の内容です。

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

作 成 期	2022年6月15日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	う ち B B 格 以 下 組 入 率 比	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	90,875,000	92,613,356	91.2	—	58.4	23.5	9.4
地方債証券	3,100,000	3,235,573	3.2	—	1.6	1.2	0.4
特殊債券（除く金融債券）	2,000,000	2,040,068	2.0	—	1.2	0.7	0.1
金融債券	100,000	99,471	0.1	—	—	0.1	—
普通社債券	3,000,000	3,011,147	3.0	—	1.3	1.5	0.2
合 計	99,075,000	100,999,617	99.5	—	62.5	26.9	10.1

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(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）

2022年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国債証券	426 2年国債	0.0050	390,000	390,425	2023/07/01
	427 2年国債	0.0050	166,000	166,185	2023/08/01
	428 2年国債	0.0050	450,000	450,517	2023/09/01
	137 5年国債	0.1000	800,000	801,864	2023/09/20
	330 10年国債	0.8000	612,000	618,842	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	365,000	368,160	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	92,258	2023/09/20
	429 2年国債	0.0050	40,000	40,046	2023/10/01
	430 2年国債	0.0050	303,000	303,354	2023/11/01
	431 2年国債	0.0050	900,000	901,116	2023/12/01
	138 5年国債	0.1000	1,200,000	1,203,168	2023/12/20
	332 10年国債	0.6000	250,000	252,552	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	180,232	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	185,000	190,250	2023/12/20
	433 2年国債	0.0050	900,000	901,098	2024/02/01
	434 2年国債	0.0050	100,000	100,128	2024/03/01
	139 5年国債	0.1000	950,000	952,840	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	700,000	708,253	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	56,907	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	124,796	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	114,203	2024/03/20
	435 2年国債	0.0050	100,000	100,134	2024/04/01

2022年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	436 2年国債	0.0050	500,000	500,700	2024/05/01
	140 5年国債	0.1000	1,120,000	1,123,606	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	900,000	911,952	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	87,110	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	130,687	2024/06/20
	141 5年国債	0.1000	1,210,000	1,214,101	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	690,000	698,597	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	105,000	110,113	2024/09/20
	142 5年国債	0.1000	1,040,000	1,043,785	2024/12/20
	336 10年国債	0.5000	275,000	278,767	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	400,000	403,468	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	126,171	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	76,938	2024/12/20
	143 5年国債	0.1000	800,000	802,976	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	580,000	586,965	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	84,716	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	53,724	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	137,304	2025/03/20
	144 5年国債	0.1000	1,090,000	1,094,098	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	590,000	597,552	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	64,538	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	53,050	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	56,393	2025/06/20
	145 5年国債	0.1000	1,250,000	1,254,687	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	760,000	770,290	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	93,006	2025/09/20
	146 5年国債	0.1000	780,000	782,870	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	500,000	505,355	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	99,876	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	1,120,000	1,119,787	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	880,000	882,974	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	62,554	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	86,883	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	59,525	2026/03/20
	148 5年国債	0.0050	1,100,000	1,099,109	2026/06/20
	343 10年国債	0.1000	780,000	782,340	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	109,115	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	84,797	2026/06/20
	149 5年国債	0.0050	780,000	778,837	2026/09/20
	344 10年国債	0.1000	780,000	781,989	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	20,000	21,838	2026/09/20
	150 5年国債	0.0050	1,250,000	1,247,175	2026/12/20
	345 10年国債	0.1000	950,000	951,919	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	310,000	338,532	2026/12/20
	151 5年国債	0.0050	1,140,000	1,136,477	2027/03/20
	346 10年国債	0.1000	780,000	781,107	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	109,154	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	142,516	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	600,000	600,294	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	55,526	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	55,000	60,529	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	550,000	549,708	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	44,386	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	320,000	353,414	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	1,300,000	1,297,855	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	100,000	110,812	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	550,000	548,427	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	155,000	173,240	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	350,000	395,188	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	97,368	2028/04/20
	351 10年国債	0.1000	1,000,000	995,530	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	170,000	191,601	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	10,000	11,151	2028/06/20
	11 フィリピン共和国	0.9900	100,000	99,872	2028/08/15
	352 10年国債	0.1000	700,000	695,884	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	140,938	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	168,712	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	930,000	923,127	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	90,000	100,960	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	300,000	332,676	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	600,000	594,408	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	55,000	61,133	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	260,000	292,455	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	690,000	682,161	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	200,000	226,870	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	150,000	169,119	2029/06/20

2022年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	356 10年国債	0.1000	710,000	702,147	2029/09/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	18,930	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	310,000	351,158	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	940,000	925,166	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	70,000	79,285	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	205,200	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	27,794	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	800,000	786,672	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	200,000	228,812	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	200,000	227,296	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	34,671	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	880,000	865,216	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	107,717	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	103,993	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	317,000	349,511	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	900,000	883,701	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	200,000	225,710	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	200,000	224,098	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	43,695	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	1,070,000	1,049,616	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	200,000	229,690	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	300,000	342,045	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	760,000	745,430	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	130,000	151,015	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	125,906	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	250,000	284,015	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	32,624	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	770,000	755,493	2031/06/20
	128 20年国債	1.9000	250,000	284,970	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	200,000	226,222	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	910,000	898,042	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	159,500	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	169,537	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	28,727	2031/11/20
	365 10年国債	0.1000	1,130,000	1,114,767	2031/12/20
	132 20年国債	1.7000	100,000	113,262	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	430,000	491,012	2031/12/20
	366 10年国債	0.2000	800,000	796,184	2032/03/20
	134 20年国債	1.8000	30,000	34,299	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	104,310	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	550,000	618,376	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	65,666	2032/05/20
	138 20年国債	1.5000	100,000	111,500	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	370,000	416,139	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	300,000	340,461	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	30,925	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	47,505	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	400,000	454,288	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	160,000	183,336	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	48,298	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	236,359	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	290,000	323,405	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	45,460	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	450,000	511,425	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	70,840	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	350,000	397,964	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	87,819	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	400,000	450,592	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	99,857	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	450,000	501,925	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	50,000	61,609	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	502,000	560,146	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	250,000	308,662	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	180,000	198,718	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	130,000	159,272	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	480,000	518,342	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	97,154	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	460,000	496,533	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	69,321	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	530,000	578,261	2035/06/20
	154 20年国債	1.2000	550,000	593,087	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	73,206	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	440,000	462,862	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	170,000	212,129	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	370,000	359,451	2036/03/20
	157 20年国債	0.2000	460,000	433,416	2036/06/20

2022年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	24 30年国債	2.5000	92,000	115,193	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	350,000	342,923	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	183,796	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	240,000	237,777	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	180,000	223,322	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	360,000	360,964	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	420,000	414,292	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	188,793	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	450,000	442,876	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	340,000	333,608	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	170,000	214,342	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	500,000	482,040	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	300,000	288,453	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	249,642	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	400,000	395,664	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	400,000	382,496	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	271,777	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	320,000	300,195	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	320,000	294,278	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	300,000	366,483	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	220,000	201,632	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	500,000	456,685	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	285,000	353,397	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	100,000	92,699	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	410,000	378,811	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	280,000	333,275	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	550,000	506,467	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	400,000	373,720	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	270,000	330,577	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	380,000	353,897	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	380,000	346,620	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	250,000	297,835	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	390,000	361,717	2041/09/20
	179 20年国債	0.5000	550,000	509,256	2041/12/20
	36 30年国債	2.0000	350,000	418,092	2042/03/20
	180 20年国債	0.8000	100,000	97,830	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	450,000	528,930	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	250,000	289,352	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	230,000	270,399	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	180,000	208,170	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	210,000	238,772	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	205,000	233,142	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	260,000	295,497	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	200,000	227,354	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	250,000	274,227	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	180,000	197,416	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	370,000	413,071	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	260,000	279,362	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	120,000	128,892	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	310,000	293,864	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	270,000	226,816	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	280,000	246,173	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	250,000	224,350	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	310,000	290,770	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	260,000	243,269	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	240,000	223,994	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	230,000	214,120	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	89,980	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	400,000	371,440	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	300,000	271,338	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	210,000	198,607	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	179,704	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	136,567	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	230,000	195,801	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	300,000	247,755	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	220,000	181,238	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	200,000	164,690	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	187,479	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	200,000	164,626	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	260,000	224,702	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	290,000	250,107	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	350,000	309,858	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	180,000	224,730	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	235,000	207,657	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	260,000	229,309	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	320,000	281,987	2051/09/20

2022年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	73 30年国債	0.7000	363,000	319,610	2051/12/20
	5 40年国債	2.0000	185,000	221,583	2052/03/20
	74 30年国債	1.0000	259,000	245,754	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	123,453	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	136,322	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	241,099	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	170,150	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	275,000	249,559	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	280,598	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	380,000	298,444	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	360,000	281,358	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	430,000	358,878	2061/03/20
	15 40年国債	1.0000	500,000	457,085	2062/03/20
種別小計	銘 柄 数	263銘柄			
	金 額		90,875,000	92,613,356	
地方債証券	126 共同発行地方	0.8100	100,000	100,987	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	201,842	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	101,014	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	101,057	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	100,988	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	202,595	2025/04/16
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	105,332	2025/11/21
	27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	101,234	2025/11/27
	751 東京都公債	0.3700	100,000	100,884	2025/12/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,621	2026/06/19
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,010	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,138	2027/03/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	199,693	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,009	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	99,955	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	112,308	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	110,806	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	113,072	2029/06/20
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	112,452	2029/12/14
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	113,253	2030/05/24
	2-2 岡山県公債	0.1200	100,000	97,311	2031/01/29
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	97,498	2031/06/30
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	113,747	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	111,006	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	110,876	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	103,921	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	119,781	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	104,170	2045/12/20
種別小計	銘 柄 数	28銘柄			
	金 額		3,100,000	3,235,573	
特殊債券 (除く金融債券)	51 地方公共団体	0.8410	100,000	100,977	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	101,090	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	100,825	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	101,058	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	202,373	2025/11/28
	127 都市再生	0.0750	100,000	99,551	2026/09/18
	80 住宅支援機構	1.5890	100,000	106,000	2026/09/18
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	105,792	2027/08/25
	1 地方公共団15年	1.3340	100,000	105,927	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	111,941	2029/07/31
	47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	104,353	2029/09/20
	123 住宅支援機構	1.8010	100,000	113,370	2032/09/17
	31 地方公共団20	1.7440	100,000	112,677	2033/09/28
	223 政保道路機構	1.4270	100,000	109,994	2034/07/31
	284 政保道路機構	0.1490	200,000	185,435	2036/07/31
	298 政保道路機構	0.5470	100,000	97,749	2036/12/26
	247 道路機構	0.3420	200,000	180,947	2040/03/19
種別小計	銘 柄 数	17銘柄			
	金 額		2,000,000	2,040,068	
金融債券	19 利付商工債	0.1000	100,000	99,471	2026/09/18
種別小計	銘 柄 数	1銘柄			
	金 額		100,000	99,471	
普通社債券	175 オリックス	1.0640	100,000	101,319	2023/11/24
	21 西日本高速道	0.7540	100,000	101,045	2023/12/20
	1 三菱 UFJFG 劣後	0.9400	100,000	100,901	2024/06/26
	482 九州電力	0.1700	100,000	99,920	2024/08/23

2022年6月15日現在					
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	5 野村不動産 HD	0.9240	100,000	101,879	2025/05/30
	11日本たばこ産業	0.5990	100,000	101,389	2025/07/15
	63 中日本高速道	0.5760	100,000	101,495	2025/11/13
	4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	101,785	2025/12/18
	14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	99,846	2025/12/19
	16 NTT ファイナンス	0.1800	100,000	99,707	2025/12/19
	1 日生2021基金	0.2800	100,000	99,363	2026/08/03
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,644	2026/08/21
	17 パナソニック	0.4700	100,000	100,540	2026/09/18
	7 三井住友海上	0.1900	100,000	99,291	2026/11/13
	6 楽天カード	0.6200	100,000	98,264	2026/12/17
	509 関西電力	0.4700	100,000	99,804	2027/05/25
	12 アサヒグループ HD	0.3300	100,000	99,909	2027/06/11
	15 デンソー	0.2450	100,000	99,580	2027/06/18
	78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	99,623	2027/07/23
	11 東京電力パワー	0.7900	100,000	100,016	2028/01/25
	20 ZHD	0.4600	100,000	98,102	2028/07/28
	15 ソフトバンク	0.4100	100,000	97,689	2028/10/12
	41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	110,908	2029/01/29
	13 NTT ファイナンス	1.0900	100,000	103,896	2029/09/20
	7 凸版印刷	1.1040	100,000	103,826	2029/12/12
	65 東京瓦斯	0.2250	100,000	96,986	2030/09/10
	18 楽天グループ	1.0500	100,000	96,399	2031/12/02
	332 北海道電力	0.9070	100,000	97,937	2036/04/25
	23 森ビル	0.9700	100,000	95,962	2038/05/17
	107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	104,109	2045/01/27
種別小計	銘柄数	30銘柄			
	金額		3,000,000	3,011,147	
合計	銘柄数	339銘柄			
	金額		99,075,000	100,999,617	

(注) 単位未満は切捨て。

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第22期 (決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日)

日本債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

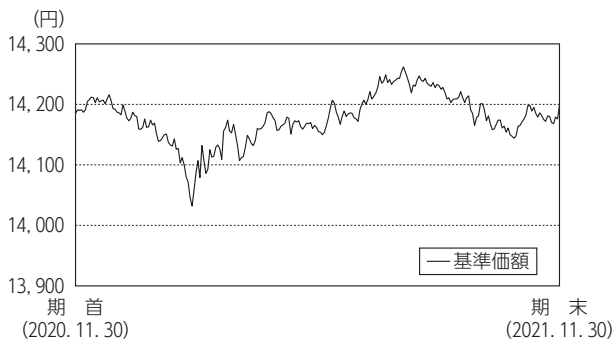
運用方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	わが国の公社債
株式組入制限	純資産総額の30%以下

大和アセットマネジメント

Daiva Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公社債 債券	
	円	騰落率 (%)	総合指数	騰落率 (%)	組入比率 (%)	先物比率 (%)
(期首) 2020年11月30日	14,185	—	531.781	—	99.6	—
12月末	14,186	0.0	531.946	0.0	99.6	—
2021年1月末	14,151	△ 0.2	530.582	△ 0.2	99.6	—
2月末	14,032	△ 1.1	526.155	△ 1.1	99.3	—
3月末	14,132	△ 0.4	529.811	△ 0.4	99.4	—
4月末	14,158	△ 0.2	530.887	△ 0.2	99.4	—
5月末	14,165	△ 0.1	531.127	△ 0.1	99.1	—
6月末	14,172	△ 0.1	531.421	△ 0.1	99.6	—
7月末	14,243	0.4	534.087	0.4	99.2	—
8月末	14,231	0.3	533.627	0.3	99.1	—
9月末	14,181	△ 0.0	531.730	△ 0.0	99.4	—
10月末	14,165	△ 0.1	531.186	△ 0.1	99.5	—
(期末) 2021年11月30日	14,199	0.1	532.469	0.1	99.2	—

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注5) 債券先物比率は買建比率 - 売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：14,185円 期末：14,199円 騰落率：0.1%

【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、金利は上昇 (債券価格は下落) したものの、債券の利息収入がプラス要因となり、基準価額は当作成期首と同程度の水準となりました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内債券市場

国内債券市場では、長期金利は上昇後、当作成期首の水準まで一時低下しましたが、再び上昇しました。

国内長期金利は、日銀の短長金利操作の下、2020年中はゼロ%をやや上回る狭いレンジで推移しました。2021年に入ると、日銀が3月の金融政策決定会合での各種施策の点検において長期金利の許容変動幅を拡大するとの感や、米国長期金利の急上昇を受け、2月末にかけて0.1%台半ばまで上昇しました。3月の金融政策決定会合では長期金利の変動幅の明確化等が決定されましたが、政策の大枠に変更がなかったこともあり、長期金利は低下基調に転じました。その後も、米国長期金利の低下や新型コロナウイルスの感染拡大も重なり、8月には一時ゼロ%程度まで低下しました。9月以降は、商品市況の上昇などによる世界的なインフレ懸念を受けた先進各国の長期金利の上昇に連動して、国内長期金利は当作成期末にかけて上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

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

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

*ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数です。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

(注1) 費用の項目および算出法については前掲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

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	19,816,548	(14,064,024)
	地方債証券	421,001	(1,009,011)
	特殊債券	225,389	(605,562)
	社債券	700,719	(505,306)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債券(転換社債券)は含まれておりません。

(注4) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	千円	銘 柄	千円
145 5年国債 0.1% 2025/9/20	1,110,680	410 2年国債 0.1% 2022/3/1	2,005,080
148 5年国債 0.005% 2026/6/20	1,005,249	131 5年国債 0.1% 2022/3/20	1,173,167
360 10年国債 0.1% 2030/9/20	895,581	132 5年国債 0.1% 2022/6/20	882,041
147 5年国債 0.005% 2026/3/20	872,273	415 2年国債 0.1% 2022/8/1	751,784
362 10年国債 0.1% 2031/3/20	745,643	347 10年国債 0.1% 2027/6/20	709,633
363 10年国債 0.1% 2031/6/20	744,395	348 10年国債 0.1% 2027/9/20	608,574
361 10年国債 0.1% 2030/12/20	630,890	133 5年国債 0.1% 2022/9/20	551,287
421 2年国債 0.1% 2023/2/1	602,557	357 10年国債 0.1% 2029/12/20	404,692
348 10年国債 0.1% 2027/9/20	557,039	144 5年国債 0.1% 2025/6/20	388,457
364 10年国債 0.1% 2031/9/20	520,914	323 10年国債 0.9% 2022/6/20	384,073

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

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

作 成 期	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちBB格以下組入率	残存期間別組入比率		
区 分	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
					%	%	%
国債証券	79,992,000	85,097,080	89.5	—	58.1	21.6	9.7
地方債証券	3,300,000	3,514,853	3.7	—	2.2	1.0	0.5
特殊債券(除く金融債券)	2,500,000	2,602,888	2.7	—	1.3	0.8	0.6
金融債券	100,000	100,201	0.1	—	—	0.1	—
普通社債券	2,900,000	2,976,109	3.1	—	1.6	1.4	0.1
合 計	88,792,000	94,291,133	99.2	—	63.3	24.8	11.0

(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 銘 柄	年 利 率	末		償還年月日
			額 面 金 額	評 価 額	
		%	千円	千円	
国債証券	134 5年国債	0.1000	950,000	952,251	2022/12/20
	326 10年国債	0.7000	30,000	30,258	2022/12/20
	327 10年国債	0.8000	450,000	454,360	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	45,862	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,160	2022/12/20
	421 2年国債	0.1000	600,000	601,614	2023/02/01
	135 5年国債	0.1000	1,550,000	1,554,526	2023/03/20
	328 10年国債	0.6000	350,000	353,300	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	101,463	2023/03/20
	423 2年国債	0.0050	100,000	100,180	2023/04/01
	424 2年国債	0.0050	500,000	500,955	2023/05/01
	425 2年国債	0.0050	380,000	380,767	2023/06/01
	136 5年国債	0.1000	950,000	953,391	2023/06/20
	329 10年国債	0.8000	500,000	507,185	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	96,365	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	133,887	2023/06/20
	426 2年国債	0.0050	390,000	390,830	2023/07/01
	427 2年国債	0.0050	166,000	166,373	2023/08/01
	137 5年国債	0.1000	800,000	803,392	2023/09/20
	330 10年国債	0.8000	612,000	622,281	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	365,000	369,814	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	93,301	2023/09/20
	429 2年国債	0.0050	40,000	40,099	2023/10/01
	138 5年国債	0.1000	1,200,000	1,205,676	2023/12/20
	332 10年国債	0.6000	250,000	253,727	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	182,290	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	185,000	192,326	2023/12/20
	139 5年国債	0.1000	900,000	904,770	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	700,000	711,697	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	57,560	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	126,416	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	115,628	2024/03/20
	140 5年国債	0.1000	700,000	704,025	2024/06/20
	334 10年国債	0.6000	900,000	916,695	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	88,362	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	132,436	2024/06/20
	141 5年国債	0.1000	1,120,000	1,127,078	2024/09/20
	335 10年国債	0.5000	690,000	702,123	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	105,000	111,555	2024/09/20
	142 5年国債	0.1000	850,000	855,856	2024/12/20
	336 10年国債	0.5000	275,000	280,263	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	400,000	405,208	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	127,792	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	77,964	2024/12/20
	143 5年国債	0.1000	700,000	705,215	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	580,000	589,987	2025/03/20
75 20年国債	2.1000	80,000	85,881	2025/03/20	
76 20年国債	1.9000	51,000	54,411	2025/03/20	
77 20年国債	2.0000	130,000	139,126	2025/03/20	
144 5年国債	0.1000	890,000	896,977	2025/06/20	
339 10年国債	0.4000	590,000	600,938	2025/06/20	
78 20年国債	1.9000	61,000	65,381	2025/06/20	
79 20年国債	2.0000	50,000	53,770	2025/06/20	
80 20年国債	2.1000	53,000	57,185	2025/06/20	
145 5年国債	0.1000	1,100,000	1,109,031	2025/09/20	
340 10年国債	0.4000	760,000	775,093	2025/09/20	
82 20年国債	2.1000	87,000	94,341	2025/09/20	
146 5年国債	0.1000	480,000	484,099	2025/12/20	
341 10年国債	0.3000	500,000	508,445	2025/12/20	
83 20年国債	2.1000	93,000	101,365	2025/12/20	
147 5年国債	0.0050	840,000	843,981	2026/03/20	
342 10年国債	0.1000	880,000	887,981	2026/03/20	
85 20年国債	2.1000	58,000	63,536	2026/03/20	
86 20年国債	2.3000	80,000	88,326	2026/03/20	
87 20年国債	2.2000	55,000	60,487	2026/03/20	
148 5年国債	0.0050	1,000,000	1,005,020	2026/06/20	
343 10年国債	0.1000	780,000	787,488	2026/06/20	
88 20年国債	2.3000	100,000	110,996	2026/06/20	
89 20年国債	2.2000	78,000	86,220	2026/06/20	
149 5年国債	0.0050	220,000	221,060	2026/09/20	
344 10年国債	0.1000	780,000	787,527	2026/09/20	
90 20年国債	2.2000	20,000	22,219	2026/09/20	
345 10年国債	0.1000	900,000	909,135	2026/12/20	
92 20年国債	2.1000	310,000	344,627	2026/12/20	

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率 %	末		償還年月日
			額 面 金 額 千円	評 価 額 千円	
	346 10年国債	0.1000	780,000	788,307	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	111,186	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	145,234	2027/03/20
	347 10年国債	0.1000	600,000	606,528	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	56,682	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	55,000	61,736	2027/06/20
	348 10年国債	0.1000	550,000	556,253	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	45,343	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	320,000	360,876	2027/09/20
	349 10年国債	0.1000	1,050,000	1,062,453	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	100,000	113,326	2027/12/20
	350 10年国債	0.1000	500,000	506,015	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	155,000	177,426	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	350,000	405,076	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	99,550	2028/04/20
	351 10年国債	0.1000	800,000	809,744	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	170,000	196,642	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	10,000	11,435	2028/06/20
	11 フィリピン共和国	0.9900	100,000	101,955	2028/08/15
	352 10年国債	0.1000	700,000	708,855	2028/09/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	144,787	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	150,000	173,392	2028/09/20
	353 10年国債	0.1000	580,000	587,609	2028/12/20
	107 20年国債	2.1000	90,000	103,914	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	300,000	342,126	2028/12/20
	354 10年国債	0.1000	600,000	607,926	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	55,000	62,971	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	260,000	301,498	2029/03/20
	355 10年国債	0.1000	690,000	699,163	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	200,000	234,462	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	150,000	174,708	2029/06/20
	356 10年国債	0.1000	510,000	516,599	2029/09/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	19,579	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	310,000	362,634	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	620,000	627,768	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	70,000	82,200	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	212,828	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	28,854	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	660,000	667,966	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	200,000	237,400	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	200,000	235,734	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	35,947	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	930,000	940,360	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	111,531	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	107,588	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	317,000	361,294	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	900,000	909,117	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	200,000	233,758	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	200,000	231,996	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	45,364	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	633,000	638,437	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	200,000	237,910	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	300,000	354,150	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	710,000	715,268	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	130,000	156,302	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	130,214	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	250,000	293,620	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	33,734	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	700,000	703,990	2031/06/20
	128 20年国債	1.9000	250,000	294,380	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	200,000	233,600	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	520,000	522,277	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	163,899	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	174,142	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	29,580	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	40,000	46,531	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	430,000	504,506	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	30,000	35,288	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	107,278	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	300,000	346,755	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	67,672	2032/05/20
	138 20年国債	1.5000	100,000	114,796	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	370,000	428,615	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	300,000	351,486	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	31,965	2032/11/22

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率 %	末		
			額 面 金 額 千円	評 価 額 千円	償還年月日
	9 30年国債	1.4000	43,000	49,056	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	200,000	234,850	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	240,000	284,443	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	49,915	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	244,782	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	240,000	277,072	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	47,173	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	420,000	495,318	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	73,740	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	350,000	413,633	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	91,533	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	320,000	375,148	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	104,279	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	530,000	616,029	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	50,000	64,395	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	402,000	467,988	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	250,000	323,187	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	180,000	207,610	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	130,000	166,909	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	400,000	451,740	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	102,026	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	460,000	520,260	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	72,888	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	430,000	492,401	2035/06/20
	154 20年国債	1.2000	550,000	623,034	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	77,168	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	350,000	387,208	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	170,000	223,884	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	270,000	275,969	2036/03/20
	157 20年国債	0.2000	360,000	357,220	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	121,895	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	350,000	362,229	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	194,889	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	170,000	178,243	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	180,000	237,198	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	360,000	382,741	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	320,000	335,008	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	200,848	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	350,000	366,117	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	340,000	355,347	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	170,000	228,825	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	500,000	514,340	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	300,000	308,244	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	267,398	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	350,000	370,615	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	300,000	307,488	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	291,638	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	320,000	322,083	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	320,000	316,044	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	300,000	394,329	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	220,000	216,882	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	300,000	295,197	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	285,000	380,899	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	100,000	100,000	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	410,000	409,290	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	280,000	360,231	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	420,000	418,534	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	400,000	405,284	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	270,000	358,030	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	340,000	343,933	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	365,000	362,043	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	250,000	323,395	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	150,000	151,363	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	310,000	402,364	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	350,000	448,668	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	250,000	316,517	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	230,000	296,389	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	180,000	228,472	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	170,000	212,629	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	205,000	256,668	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	200,000	250,668	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	200,000	250,922	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	200,000	242,592	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	140,000	169,923	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	400,000	494,788	2045/06/20

区 分	当 期		末		償還年月日
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	
	48 30年国債	1.4000 %	160,000 千円	190,832 千円	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	120,000	143,187	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	260,000	274,814	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	240,000	226,044	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	260,000	256,321	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	250,000	251,920	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	310,000	326,485	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	260,000	273,639	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	170,000	178,593	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	230,000	241,451	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	100,678	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	350,000	367,150	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	300,000	306,870	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	210,000	224,544	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	203,706	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	153,078	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	230,000	222,258	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	230,000	216,057	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	220,000	206,078	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	200,000	187,026	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	209,835	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	200,000	186,930	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	230,000	226,412	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	290,000	285,441	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	259,000	261,843	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	180,000	253,659	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	235,000	237,307	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	240,000	242,373	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	140,000	141,218	2051/09/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	141,153	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	156,797	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	279,128	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	200,910	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	275,000	293,053	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	330,697	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	380,000	354,897	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	430,000	400,394	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	300,000	298,161	2061/03/20
種別小計	銘柄数	262銘柄			
	金額		79,992,000	85,097,080	
地方債証券	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	100,888	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	100,639	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	101,485	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	202,723	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	101,460	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	101,504	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	101,447	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	203,686	2025/04/16
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	106,623	2025/11/21
	27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	101,874	2025/11/27
	751 東京都公債	0.3700	100,000	101,482	2025/12/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	100,259	2026/06/19
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,916	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	101,119	2027/03/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	201,625	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	101,039	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	101,351	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	115,199	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	113,930	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	116,763	2029/06/20
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	116,484	2029/12/14
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	117,498	2030/05/24
	2-2 岡山県公債	0.1200	100,000	100,154	2031/01/29
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	100,139	2031/06/30
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	117,121	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	115,382	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	115,827	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	109,600	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	130,694	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	115,929	2045/12/20
種別小計	銘柄数	30銘柄			
	金額		3,300,000	3,514,853	

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当 期		末		償還年月日	
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		
		%	千円	千円		
特殊債券 (除く金融債券)	25 政保日本政策	0.8150	100,000	101,061	2023/02/24	
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	100,916	2023/03/15	
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	100,927	2023/03/17	
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	101,190	2023/05/26	
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	100,960	2023/05/31	
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	101,467	2023/08/28	
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	101,524	2024/10/28	
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,108	2025/01/31	
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	101,547	2025/04/28	
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	203,284	2025/11/28	
	127 都市再生	0.0750	100,000	100,191	2026/09/18	
	80 住宅支援機構	1.5890	100,000	107,467	2026/09/18	
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	107,540	2027/08/25	
	1 地方公共団15年	1.3340	100,000	107,919	2028/01/28	
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	115,190	2029/07/31	
	47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	107,254	2029/09/20	
	123 住宅支援機構	1.8010	100,000	116,970	2032/09/17	
	31 地方公共団20	1.7440	100,000	117,162	2033/09/28	
	223 政保道路機構	1.4270	100,000	114,844	2034/07/31	
	284 政保道路機構	0.1490	200,000	195,373	2036/07/31	
	298 政保道路機構	0.5470	100,000	103,238	2036/12/26	
	247 道路機構	0.3420	200,000	195,749	2040/03/19	
	種別小計	銘 柄 数	22銘柄			
		金 額		2,500,000	2,602,888	
金融債券	19 利付商工債	0.1000	100,000	100,201	2026/09/18	
種別小計	銘 柄 数	1銘柄				
	金 額		100,000	100,201		
普通社債券	175 オリックス	1.0640	100,000	101,961	2023/11/24	
	21 西日本高速道	0.7540	100,000	101,538	2023/12/20	
	1 三菱 UFJFG 劣後	0.9400	100,000	101,659	2024/06/26	
	482 九州電力	0.1700	100,000	100,233	2024/08/23	
	5 野村不動産 HD	0.9240	100,000	102,551	2025/05/30	
	11日本たばこ産業	0.5990	100,000	101,889	2025/07/15	
	63 中日本高速道	0.5760	100,000	102,163	2025/11/13	
	4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	102,699	2025/12/18	
	14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	100,443	2025/12/19	
	16 NTT ファイナンス	0.1800	100,000	100,241	2025/12/19	
	1 日生2021基金	0.2800	100,000	100,018	2026/08/03	
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	100,249	2026/08/21	
	17 パナソニック	0.4700	100,000	101,500	2026/09/18	
	7 三井住友海上	0.1900	100,000	100,049	2026/11/13	
	509 関西電力	0.4700	100,000	101,460	2027/05/25	
	12 アサヒグループHD	0.3300	100,000	101,050	2027/06/11	
	15 デンソー	0.2450	100,000	100,656	2027/06/18	
	78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	100,754	2027/07/23	
	11 東京電力パワー	0.7900	100,000	102,792	2028/01/25	
	20 ZHD	0.4600	100,000	99,967	2028/07/28	
	15 ソフトバンク	0.4100	100,000	99,989	2028/10/12	
	41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	114,360	2029/01/29	
	13 NTT ファイナンス	1.0900	100,000	106,692	2029/09/20	
	7 凸版印刷	1.1040	100,000	106,876	2029/12/12	
65 東京瓦斯	0.2250	100,000	100,444	2030/09/10		
18 楽天グループ	1.0500	100,000	100,138	2031/12/02		
332 北海道電力	0.9070	100,000	104,791	2036/04/25		
23 森ビル	0.9700	100,000	102,592	2038/05/17		
107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	116,343	2045/01/27		
種別小計	銘 柄 数	29銘柄				
	金 額		2,900,000	2,976,109		
合 計	銘 柄 数	344銘柄				
	金 額		88,792,000	94,291,133		

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	94,291,133	99.0
コール・ローン等、その他	905,947	1.0
投資信託財産総額	95,197,080	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

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	95,197,080,993円
コール・ローン等	304,345,621
公社債(評価額)	94,291,133,700
未収入金	403,578,000
未収利息	195,282,238
前払費用	2,741,434
(B) 負債	117,470,022
未払金	100,000,000
未払解約金	17,470,022
(C) 純資産総額 (A - B)	95,079,610,971
元本	66,960,247,306
次期繰越損益金	28,119,363,665
(D) 受益権総口数	66,960,247,306口
1万口当り基準価額 (C / D)	14,199円

* 期首における元本額は63,632,169,674円、当作成期間中における追加設定元本額は13,191,022,279円、同解約元本額は9,862,944,647円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

ダイワ国内重視バランスファンド30V A (一般投資家私募)	59,050,508円
ダイワ国内重視バランスファンド50V A (一般投資家私募)	412,666,474円
ダイワ国際分散バランスファンド30V A (一般投資家私募)	49,180,012円
ダイワ国際分散バランスファンド50V A (一般投資家私募)	693,952,196円
DCダイワ日本債券インデックス	9,573,099,389円
ダイワ国内債券インデックス(ラップ専用)	704,912円
ダイワ・バランスファンド35V A	10,117,083,683円
ダイワ・バランスファンド25V A (適格機関投資家専用)	1,686,540,655円
ダイワ国内バランスファンド25V A (適格機関投資家専用)	219,254,803円
ダイワ国内バランスファンド30V A (適格機関投資家専用)	314,922,939円
ダイワ・ノーロード日本債券ファンド	61,401,829円
ダイワファンドラップ日本債券インデックス	26,594,045,062円
ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)	6,074,653,568円
ダイワファンドラップオンライン日本債券インデックス	2,139,796,937円
ダイワ・インデックスセレクト日本債券	965,018,800円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,784,763,908円
ダイワライフスタイル25	477,075,499円
ダイワライフスタイル50	581,511,996円
ダイワライフスタイル75	155,524,136円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,199円です。

■損益の状況

当期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	676,821,899円
受取利息	676,924,268
支払利息	△ 102,369
(B) 有価証券売買損益	△ 562,204,040
売買益	73,052,280
売買損	△ 635,256,320
(C) その他費用	△ 221
(D) 当期損益金 (A + B + C)	114,617,638
(E) 前期繰越損益金	26,626,976,422
(F) 解約差損益金	△ 4,127,794,494
(G) 追加信託差損益金	5,505,564,099
(H) 合計 (D + E + F + G)	28,119,363,665
次期繰越損益金 (H)	28,119,363,665

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

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

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジあり)

運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型		
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）		
運用方針	投資成果をFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの受益証券	
	外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	外国の公社債	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の10%以下	
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2734>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
2 期末 (2018年 6 月15日)	円 9,475	円 0	% △ 2.4	円 9,567	% △ 1.9	% 95.4	% 2.1	百万円 61,154
3 期末 (2019年 6 月17日)	円 9,905	円 0	% 4.5	円 10,050	% 5.1	% 97.3	% 1.4	72,847
4 期末 (2020年 6 月15日)	円 10,451	円 0	% 5.5	円 10,666	% 6.1	% 97.5	—	87,728
5 期末 (2021年 6 月15日)	円 10,198	円 0	% △ 2.4	円 10,462	% △ 1.9	% 98.5	—	98,409
6 期末 (2022年 6 月15日)	円 8,787	円 0	% △ 13.8	円 9,048	% △ 13.5	% 101.6	% 0.2	97,518

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

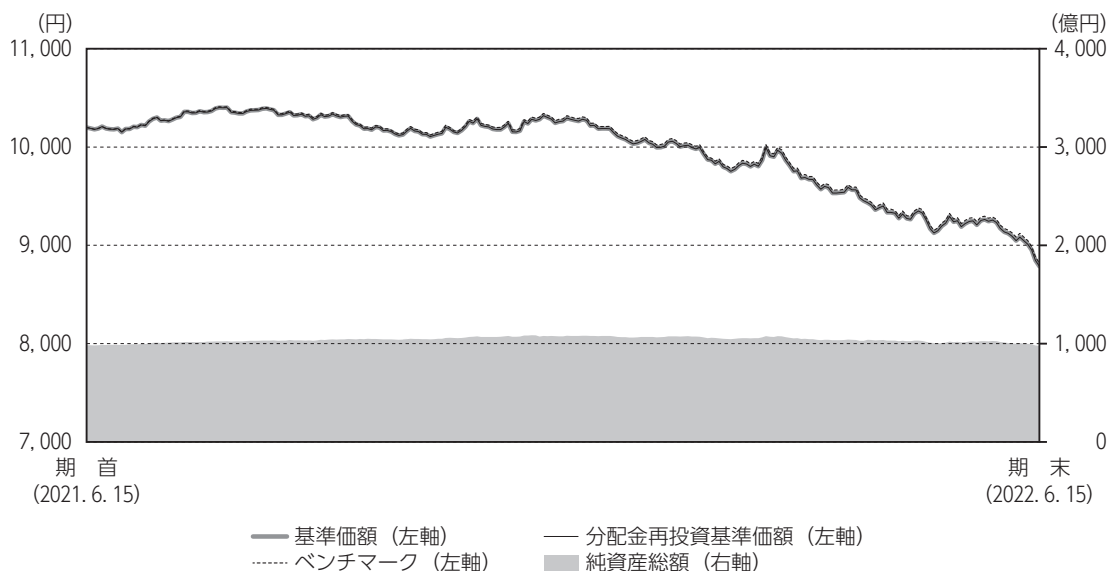
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注7) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：10,198円

期末：8,787円 (分配金 0円)

騰落率：△13.8% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%		%	%	%
(期首)2021年 6月15日	10,198	—	10,462	—	98.5	—
6月末	10,183	△ 0.1	10,450	△ 0.1	97.5	—
7月末	10,357	1.6	10,632	1.6	96.3	—
8月末	10,355	1.5	10,635	1.7	97.7	—
9月末	10,188	△ 0.1	10,468	0.1	98.4	—
10月末	10,181	△ 0.2	10,461	△ 0.0	98.8	2.2
11月末	10,240	0.4	10,528	0.6	96.8	—
12月末	10,145	△ 0.5	10,433	△ 0.3	99.6	—
2022年 1月末	10,017	△ 1.8	10,305	△ 1.5	97.0	0.4
2月末	9,804	△ 3.9	10,087	△ 3.6	97.7	0.4
3月末	9,541	△ 6.4	9,819	△ 6.1	102.9	1.4
4月末	9,329	△ 8.5	9,605	△ 8.2	101.0	—
5月末	9,233	△ 9.5	9,504	△ 9.2	97.3	0.5
(期末)2022年 6月15日	8,787	△ 13.8	9,048	△ 13.5	101.6	0.2

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

■ 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、主要国の国債金利は、米国などで将来の利上げ後の経済回復ペースや物価上昇圧力の鈍化が意識されたことで、長期ゾーンを中心に低下しましたが、2021年9月にF R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げ見通しが市場予想を上回ったことなどから、上昇に転じました。2022年に入ってから、ロシアがウクライナに侵攻したことで原油価格が高騰し、インフレ期待が上昇したことで、金利上昇が加速しました。その後も、インフレ率の上振れなどから各国で金融政策正常化が意識され、主要国の金利は上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに金利は上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■ 当ファンド

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

■ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■ 当ファンド

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

■ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

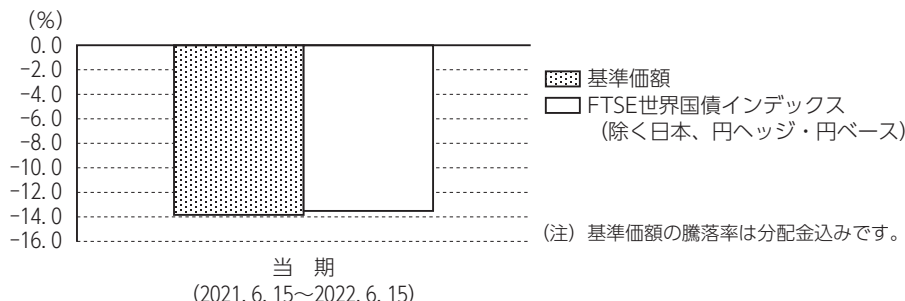
組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△13.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△13.8%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。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳 (1万口当り)

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ~2022年6月15日	
当期分配金 (税込み) (円)	—	
対基準価額比率 (%)	—	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	858	

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2021. 6. 16~2022. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	42円	0.418%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,954円です。
（投信会社）	(28)	(0.286)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販売会社）	(11)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0.000	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0.011	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.008)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（その他）	(0)	(0.002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	43	0.429	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

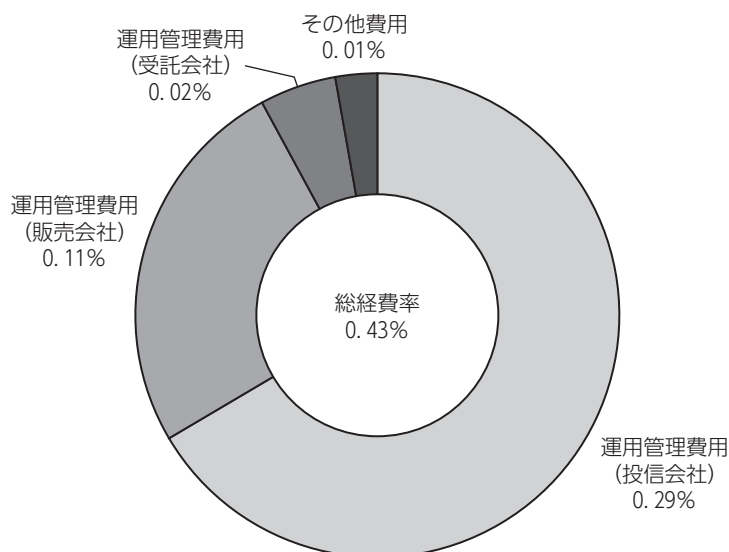
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

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



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	20,868,494	21,287,035	7,123,848	7,184,274

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	94,364,692	108,109,338	97,222,728

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	97,222,728	99.4
コール・ローン等、その他	571,868	0.6
投資信託財産総額	97,794,596	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.01円、1カナダ・ドル=104.20円、1オーストラリア・ドル=93.10円、1シンガポール・ドル=96.95円、1イギリス・ポンド=162.21円、1イスラエル・シケル=38.942円、1デンマーク・クローネ=18.93円、1ノルウェー・クローネ=13.49円、1スウェーデン・クローネ=13.25円、1メキシコ・ペソ=6.565円、1オフショア・人民元=20.014円、1マレーシア・リングギット=30.536円、1南アフリカ・ランド=8.42円、1ポーランド・ズロチ=30.093円、1ユーロ=140.80円です。

(注3) 外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (123,970,109千円) の投資信託財産総額 (124,495,550千円) に対する比率は、99.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	97,794,596,870円
コール・ローン等	552,806,888
外国債券インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド (評価額)	97,222,728,050
未収入金	19,061,932
(B) 負債	276,593,585
未払解約金	57,641,186
未払信託報酬	217,840,098
その他未払費用	1,112,301
(C) 純資産総額 (A - B)	97,518,003,285
元本	110,985,788,072
次期繰越損益金	△ 13,467,784,787
(D) 受益権総口数	110,985,788,072口
1万口当り基準価額 (C / D)	8,787円

* 期首における元本額は96,502,550,747円、当作成期間中における追加設定元本額は32,610,525,682円、同解約元本額は18,127,288,357円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は8,787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13,467,784,787円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 110,261円
受取利息	11,701
支払利息	△ 121,962
(B) 有価証券売買損益	△ 14,516,838,164
売買益	542,156,108
売買損	△ 15,058,994,272
(C) 信託報酬等	△ 437,355,074
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 14,954,303,499
(E) 前期繰越損益金	1,984,050,744
(F) 追加信託差損益金	△ 497,532,032
(配当等相当額)	(5,674,879,117)
(売買損益相当額)	(△ 6,172,411,149)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 13,467,784,787
次期繰越損益金 (G)	△ 13,467,784,787
追加信託差損益金	△ 497,532,032
(配当等相当額)	(5,674,879,117)
(売買損益相当額)	(△ 6,172,411,149)
分配準備積立金	3,855,821,932
繰越損益金	△ 16,826,074,687

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

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

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

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	5,674,879,117
(d) 分配準備積立金	3,855,821,932
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	9,530,701,049
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	9,530,701,049
(h) 受益権総口数	110,985,788,072口

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

運用報告書 第6期（決算日 2022年6月15日）

（作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

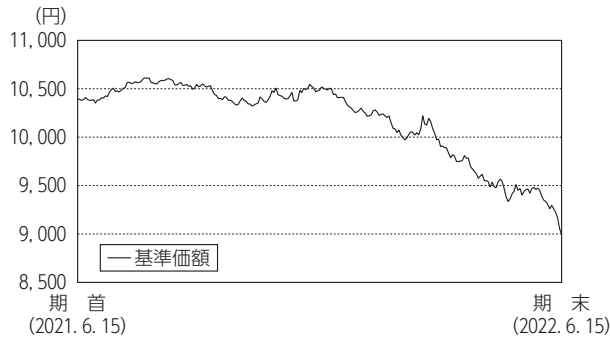
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：10,398円 期末：8,993円 騰落率：△13.5%

【基準価額の主な変動要因】

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

◆投資環境について

○海外債券市況

主要国の国債金利は、上昇しました。

当作成期首より、主要国の国債金利は、米国などで将来の利上げ後の経済回復ペースや物価上昇圧力の鈍化が意識されたことで、長期ゾーンを中心に低下しましたが、2021年9月にFRB（米国連邦準備制度理事会）の利上げ見通しが市場予想を上回ったことなどから、上昇に転じました。2022年に入ってから、ロシアがウクライナに侵襲したことで原油価格が高騰し、インフレ期待が上昇したことで、金利上昇が加速しました。その後も、インフレ率の上振れなどから各国で金融政策正常化が意識され、主要国の金利は上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに金利は上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△13.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△13.5%となりました。当作成期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー（両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの）は0.1%程度でした。

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

《今後の運用方針》

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

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）		公社債比率	債券先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首)2021年6月15日	円	%	円	%	%	%
6月末	10,385	△0.1	10,450	△0.1	97.8	—
7月末	10,566	1.6	10,632	1.6	96.6	—
8月末	10,568	1.6	10,635	1.7	98.0	—
9月末	10,401	0.0	10,468	0.1	98.7	—
10月末	10,397	△0.0	10,461	△0.0	99.1	2.2
11月末	10,462	0.6	10,528	0.6	97.1	—
12月末	10,368	△0.3	10,433	△0.3	99.9	—
2022年1月末	10,240	△1.5	10,305	△1.5	97.2	0.4
2月末	10,025	△3.6	10,087	△3.6	98.0	0.4
3月末	9,759	△6.1	9,819	△6.1	103.2	1.4
4月末	9,545	△8.2	9,605	△8.2	101.3	—
5月末	9,450	△9.1	9,504	△9.2	97.6	0.5
(期末)2022年6月15日	8,993	△13.5	9,048	△13.5	101.9	0.2

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 公 社 債

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

		買付額	売付額
外	アメリカ	千アメリカ・ドル 211,180	千アメリカ・ドル 148,074 ()
	カナダ	千カナダ・ドル 7,549	千カナダ・ドル 5,916 ()
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 1,269	千オーストラリア・ドル 5,764 ()
	シンガポール	千シンガポール・ドル 1,237	千シンガポール・ドル 1,024 ()
	イギリス	千イギリス・ポンド 11,119	千イギリス・ポンド 13,115 ()
	イスラエル	千イスラエル・シケル 2,574	千イスラエル・シケル 3,603 ()
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 4,851	千デンマーク・クローネ 5,617 ()
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 7,237	千ノルウェー・クローネ 1,612 ()
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 2,569	千スウェーデン・クローネ 7,192 ()
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 27,964	千メキシコ・ペソ 16,065 ()
	中国	千オフショア・人民元 133,144	千オフショア・人民元 5,531 ()
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 4,569	千マレーシア・リンギット 1,120 ()
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 3,346	千ポーランド・ズロチ 4,236 ()	

		買付額	売付額
外	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 782	千ユーロ 1,047 ()
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 4,038	千ユーロ 2,589 ()
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 3,985	千ユーロ 3,165 ()
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 21,144	千ユーロ 16,945 ()
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 16,619	千ユーロ 14,217 ()
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 13,500	千ユーロ 10,554 ()
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 20,956	千ユーロ 17,688 ()
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 1,172	千ユーロ 1,480 ()
	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 3,269	千ユーロ 2,832 ()
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 85,469	千ユーロ 70,521 ()

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

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国 債券先物取引	百万円 9,290	百万円 9,089	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

当 期			期 末		
買 付	金 額		売 付	金 額	
銘 柄	金 額	千円	銘 柄	金 額	千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2023/5/15	4,104,317		United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2023/5/15	6,491,804	
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.75% 2023/11/15	1,704,658		United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2022/11/15	3,962,372	
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.875% 2028/8/15	1,480,220		United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/9/30	2,893,065	
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.625% 2029/2/15	1,130,062		United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2023/2/15	1,291,607	
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2026/11/15	1,070,131		FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 1.75% 2023/5/25	661,054	
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.5% 2024/5/15	944,969		SPANISH GOVERNMENT BOND (スペイン) 5.4% 2023/1/31	549,284	
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.25% 2031/8/15	855,174		United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2026/5/15	487,393	
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.375% 2023/9/30	793,513		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (イタリア) 5.5% 2022/11/1	436,393	
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.375% 2031/11/15	753,902		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro (イタリア) 4.75% 2023/8/1	434,658	
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2025/11/15	719,534		United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.375% 2049/11/15	362,153	

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	当 期		組入比率	うちB B格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		評 価 額				5年以上	2年以上	2年未満
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額					
アメリカ	千アメリカ・ドル 500,462	千アメリカ・ドル 460,256	千円 62,139,230	% 51.7	% —	% 24.0	% 18.0	% 9.8
カナダ	千カナダ・ドル 26,257	千カナダ・ドル 24,111	2,512,414	2.1	—	1.1	0.5	0.5
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 22,874	千オーストラリア・ドル 20,474	1,906,160	1.6	—	1.1	0.4	0.1

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	額 面 金 額	当 期		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				5年以上	2年以上	2年未満
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額					
シンガポール	千シンガポール・ドル 6,122	千シンガポール・ドル 5,875	千円 569,604	% 0.5	% —	% 0.3	% 0.1	% 0.1
イギリス	千イギリス・ポンド 37,977	千イギリス・ポンド 38,197	6,195,990	5.2	—	4.0	0.7	0.4
イスラエル	千イスラエル・シケル 11,250	千イスラエル・シケル 10,897	424,355	0.4	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーク・クローネ 25,540	千デンマーク・クローネ 25,680	486,130	0.4	—	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 21,380	千ノルウェー・クローネ 20,125	271,486	0.2	—	0.1	0.0	0.1
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 25,320	千スウェーデン・クローネ 24,686	327,093	0.3	—	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 158,730	千メキシコ・ペソ 146,498	961,839	0.8	—	0.4	0.4	0.0
中国	千オフショア・人民元 124,500	千オフショア・人民元 127,855	2,558,941	2.1	—	1.0	0.8	0.3
マレーシア	千マレーシア・リンギット 23,280	千マレーシア・リンギット 22,570	689,224	0.6	—	0.3	0.2	0.0
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 22,395	千ポーランド・ズロチ 18,173	546,920	0.5	—	0.2	0.2	0.1
ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 6,218	千ユーロ 5,885	828,708	0.7	—	0.5	0.1	0.0
ユーロ (オランダ)	千ユーロ 15,320	千ユーロ 15,155	2,133,921	1.8	—	1.3	0.4	0.1
ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 18,354	千ユーロ 17,576	2,474,729	2.1	—	1.5	0.4	0.1
ユーロ (フランス)	千ユーロ 78,471	千ユーロ 76,884	10,825,331	9.0	—	5.5	2.7	0.8
ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 56,163	千ユーロ 58,046	8,173,016	6.8	—	4.2	1.6	1.0
ユーロ (スペイン)	千ユーロ 46,538	千ユーロ 45,613	6,422,322	5.3	—	3.1	1.6	0.7
ユーロ (イタリア)	千ユーロ 71,847	千ユーロ 69,510	9,787,137	8.1	—	4.6	2.6	1.0
ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 5,020	千ユーロ 4,553	641,137	0.5	—	0.3	0.2	0.0
ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 11,100	千ユーロ 10,649	1,499,450	1.2	—	0.7	0.5	0.0
ユーロ (小計)	309,031	303,876	42,785,754	35.6	—	21.7	10.0	3.9
合計	—	—	122,375,149	101.9	—	54.8	31.7	15.4

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

(2)外国（外貨建）公社債（銘柄別）

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期		未		償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	13,310	13,205	1,782,930	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	27,905	27,704	3,740,366	2023/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	15,000	14,848	2,004,736	2024/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	16,580	16,300	2,200,680	2024/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	3,300	3,421	461,924	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	8,950	10,032	1,354,463	2027/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	3,700	4,050	546,873	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	1,400	1,661	224,378	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	630	716	96,784	2031/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	300	354	47,837	2037/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	430	428	57,790	2039/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,410	1,555	209,994	2039/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,390	1,581	213,569	2040/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	2,270	2,611	352,609	2041/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	600	602	81,391	2041/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	670	614	82,922	2042/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,500	1,287	173,877	2042/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,500	3,921	529,463	2043/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,100	1,080	145,912	2043/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,532	2,536	342,405	2043/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	1,000	982	132,614	2044/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	2,200	2,076	280,359	2044/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,940	2,662	359,435	2044/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	12,810	12,432	1,678,527	2024/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,100	889	120,072	2045/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	15,300	14,681	1,982,200	2025/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	370	327	44,247	2045/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	14,820	14,107	1,904,627	2025/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	19,800	18,930	2,555,817	2025/11/15	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	期 末			償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,400	1,242	167,719	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	12,000	11,179	1,509,368	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,865	6,358	858,414	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	1,070	864	116,741	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	11,750	10,772	1,454,365	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	500	383	51,767	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	12,000	11,718	1,582,144	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	14,850	13,854	1,870,490	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,330	2,026	273,530	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,670	4,393	593,158	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	900	803	108,437	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	8,050	7,595	1,025,522	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	950	847	114,370	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	14,000	13,094	1,767,866	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	14,700	14,301	1,930,902	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,810	2,395	323,446	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	7,000	6,759	912,654	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	15,800	15,378	2,076,245	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,435	328,847	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,500	4,150	560,314	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	7,300	7,013	946,918	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	12,000	11,520	1,555,315	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,500	1,350	182,372	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	9,300	9,047	1,221,453	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	1,850	1,793	242,138	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	13,000	12,270	1,656,667	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,200	2,902	391,831	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	1,772	239,345	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,800	3,522	475,601	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	7,000	6,545	883,706	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,100	1,633	220,548	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,400	4,783	645,832	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	1,300	1,041	140,601	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,500	3,894	525,805	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	1,832	247,405	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	3,400	2,035	274,809	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	11,300	7,488	1,011,069	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,300	5,016	677,320	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,700	2,292	309,513	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	4,900	3,971	536,185	2030/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,800	2,520	340,246	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	4,500	3,832	517,409	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	5,300	4,528	611,347	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,100	2,903	391,951	2051/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	4,900	4,041	545,698	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,400	1,800	243,092	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,500	4,825	651,473	2028/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,600	3,946	532,764	2031/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,400	3,512	474,278	2051/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	1,600	1,275	172,220	2041/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	5,700	4,704	635,153	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	3,900	2,845	384,162	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	5,750	4,177	564,033	2041/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	6,700	5,570	752,057	2031/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	3,500	2,476	334,389	2051/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	2,000	1,517	204,939	2041/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	3,800	3,300	445,558	2032/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	1,000	777	105,032	2052/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	1,000	810	109,389	2042/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	2,400	2,278	307,644	2032/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	800	717	96,818	2052/05/15
通貨小計	銘柄数	90銘柄					
	金額			500,462	460,256	62,139,230	
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	860	736	76,744	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	907	1,025	106,866	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,050	1,249	130,146	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	300	349	36,438	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	620	660	68,835	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	140	140	14,622	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,038	3,971	413,800	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	730	717	74,733	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	700	617	64,330	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,492	1,442	150,259	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,920	1,777	185,255	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	930	822	85,720	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	600	549	57,250	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,520	1,126	117,429	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	300	275	28,666	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,000	981	102,226	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,342	139,878	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,700	1,421	148,136	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	818	85,278	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,313	136,861	2030/12/01
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,000	1,676	174,662	2031/06/01	
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	750	514	53,585	2053/12/01	
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	700	582	60,684	2031/12/01	
通貨小計	銘柄数	23銘柄					
	金額			26,257	24,111	2,512,414	

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区分	銘柄	種類	年利率	当 期			償還年月日
				額 面 金 額	評 価 額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	889	931	86,751	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,156	1,149	107,002	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	320	308	28,736	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,800	1,790	166,686	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	359	375	34,958	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,398	2,453	228,388	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	725	697	64,958	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	800	695	64,749	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	684	611	56,895	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,300	1,238	115,266	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	658	605	56,329	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	575	470	43,829	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,250	1,174	109,362	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,100	1,901	177,024	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	510	416	38,743	2041/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,800	1,468	136,676	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,350	1,832	170,564	2032/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,300	1,816	169,130	2030/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	900	538	50,104	2051/06/21
通貨小計	銘柄数 金 額	19銘柄		22,874	20,474	1,906,160	
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	203	206	20,027	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	150	150	14,605	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	600	588	57,064	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	239	223	21,715	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	700	701	68,035	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	420	427	41,411	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	500	494	47,893	2029/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	400	394	38,237	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	330	308	29,865	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	200	193	18,790	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	260	231	22,448	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	800	782	75,892	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	500	494	47,982	2024/02/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	300	268	26,001	2039/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	350	274	26,569	2050/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	170	134	13,064	2051/10/01
通貨小計	銘柄数 金 額	16銘柄		6,122	5,875	569,604	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	1,350	1,342	217,779	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	810	806	130,860	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,875	1,825	296,068	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,150	893	144,862	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	820	717	116,452	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	900	721	117,103	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	650	620	100,576	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	800	770	124,965	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	517	394	63,913	2071/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	1,500	1,470	238,514	2024/04/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	800	654	106,134	2049/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	660	107,150	2054/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	800	720	116,862	2029/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,200	929	150,814	2041/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	400	338	54,939	2030/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	850	422	68,493	2061/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	370	220	35,699	2050/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,450	1,114	180,836	2035/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	1,200	979	158,830	2031/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	500	338	54,895	2046/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	200	142	23,036	2051/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	100	75	12,264	2053/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	200	123	20,045	2073/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	963	1,175	190,752	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,600	1,838	298,154	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,275	1,367	221,861	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	915	1,075	174,498	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	550	697	113,094	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	850	1,152	186,977	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	770	974	158,094	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,300	1,431	232,156	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	911	1,157	187,713	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	907	1,069	173,539	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	543	701	113,815	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,130	1,363	221,203	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	300	356	57,895	2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	527	709	115,038	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,000	1,214	196,987	2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	700	855	138,795	2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	675	728	118,108	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,390	1,392	225,807	2023/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	638	809	131,377	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,000	1,012	164,210	2024/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	740	831	134,808	2045/01/22
通貨小計	銘柄数 金 額	44銘柄		37,977	38,197	6,195,990	

区分	銘柄	種類	年利率	期末			償還年月日
				額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円	2042/01/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	1,200	1,507	58,691	2024/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	1,650	1,683	65,572	2025/08/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	500	481	18,769	2027/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	4,000	3,815	148,574	2027/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	1,200	1,194	46,505	2047/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	1,700	1,449	56,435	2030/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,000	765	29,807	2037/05/31
通貨小計	銘柄数 金額	7銘柄		11,250	10,897	424,355	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ		2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	6,740	9,008	170,528	2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	670	674	12,777	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,830	2,840	53,773	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,200	2,975	56,316	2027/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,700	4,226	80,002	2029/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	1,408	26,663	2052/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,651	31,253	2031/11/15
DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,895	54,814	2024/11/15	
通貨小計	銘柄数 金額	8銘柄		25,540	25,680	486,130	
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,300	6,329	85,390	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	150	145	1,956	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,430	1,352	18,242	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,000	2,826	38,125	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	4,000	3,763	50,770	2029/09/06
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,000	1,822	24,588	2030/08/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	2,500	2,187	29,503	2031/09/17
NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,000	1,698	22,908		
通貨小計	銘柄数 金額	8銘柄		21,380	20,125	271,486	
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ		2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,520	3,045	40,358	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	4,150	4,142	54,888	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,820	3,874	51,336	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,780	4,576	60,639	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,550	2,373	31,449	2032/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	500	513	6,802	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,000	2,750	36,449	2031/05/12
SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	4,000	3,409	45,169		
通貨小計	銘柄数 金額	8銘柄		25,320	24,686	327,093	
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		2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	24,200	21,337	140,092	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	11,450	10,025	65,823	2024/09/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,900	27,048	177,588	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	6,740	6,594	43,298	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	6,340	6,399	42,016	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	20,800	19,263	126,475	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	2,750	2,922	19,190	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	6,500	6,241	40,977	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	5,000	4,685	30,763	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,700	20,701	135,912	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	14,050	12,082	79,329	2034/11/23
Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,300	9,195	60,371		
通貨小計	銘柄数 金額	12銘柄		158,730	146,498	961,839	
中国	China Government Bond	国債証券	3.2500	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		2028/11/22
	China Government Bond	国債証券	3.2900	6,500	6,711	134,324	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3.1300	3,000	3,110	62,261	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2.9400	2,800	2,862	57,283	2024/10/17
	China Government Bond	国債証券	2.6800	14,000	14,204	284,286	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	2.8800	3,000	2,969	59,424	2023/11/05
	China Government Bond	国債証券	2.8800	19,000	19,193	384,156	2025/10/22
	China Government Bond	国債証券	3.0200	4,000	4,072	81,505	2027/12/03
	China Government Bond	国債証券	3.2800	8,500	8,780	175,729	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3.2700	4,000	4,136	82,787	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	3.8100	3,000	3,255	65,154	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.7200	1,600	1,713	34,286	2031/05/27
	China Government Bond	国債証券	3.0200	1,800	1,823	36,502	2026/05/05
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	7,000	7,094	141,993	2026/08/04
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7400	10,000	10,075	201,661	2027/08/03
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5900	6,500	6,826	136,624	2048/10/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0800	3,400	3,841	76,876	2049/07/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8600	1,800	1,966	39,367	2025/03/08
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7700	10,000	10,419	208,546	2050/03/16
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	1,100	1,113	22,278	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	3,500	3,532	70,695	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	3,300	3,429	68,645	2031/11/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	5,300	5,323	106,549	2032/05/15
CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	1,400	1,398	27,998		
通貨小計	銘柄数 金額	23銘柄		124,500	127,855	2,558,941	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,760	1,773	54,146	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	1,000	985	30,099	2027/03/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	1,950	1,937	59,152		

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千マレーシア・リンギット	千円	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,400	1,315	40,159	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,500	1,460	44,594	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,150	1,157	35,337	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	500	478	14,599	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,600	1,616	49,354	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	1,420	1,361	41,561	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	2,700	2,729	83,358	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	500	493	15,082	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,000	997	30,460	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	1,500	1,498	45,773	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	1,200	1,164	35,567	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,187	36,264	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,216	37,149	2040/05/22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	1,400	1,197	36,562	2050/06/15
通貨小計	銘柄数 金額	17銘柄		23,280	22,570	689,224	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,640	2,152	64,785	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	1,815	1,410	42,453	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,900	2,653	79,843	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	2,300	1,675	50,409	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	2,000	1,779	53,536	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	1,800	1,106	33,305	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	900	655	19,721	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	700	418	12,587	2032/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	600	543	16,367	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	710	682	20,533	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	1,800	1,384	41,651	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,230	3,712	111,724	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金額	12銘柄		22,395	18,173	546,920	
ユーロ（アイルランド）	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	688	761	107,193	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	300	311	43,918	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	680	697	98,172	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	410	366	51,553	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	520	507	71,493	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	570	515	72,539	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	752	105,933	2028/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	150	133	18,823	2033/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	1,100	1,026	144,555	2031/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	300	282	39,770	2029/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	300	230	32,431	2050/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	—	200	161	22,713	2031/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	200	139	19,609	2041/04/22
国小計	銘柄数 金額	13銘柄		6,218	5,885	828,708	
ユーロ（オランダ）	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	580	694	97,728	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,400	1,724	242,871	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	980	1,224	172,365	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	890	925	130,240	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	750	758	106,737	2033/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	910	1,026	144,469	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	980	994	140,044	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	690	664	93,587	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,670	1,596	224,792	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,470	1,399	197,076	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	393	55,382	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	900	845	119,014	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	624	87,929	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	189	26,611	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	750	642	90,486	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	433	61,086	2052/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	754	106,178	2031/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	265	37,318	2029/01/15
国小計	銘柄数 金額	18銘柄		15,320	15,155	2,133,921	
ユーロ（ベルギー）	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,170	1,143	161,021	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	300	269	37,974	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	460	419	58,995	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	595	578	81,488	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	614	484	68,265	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	470	390	54,975	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	400	396	55,826	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	730	694	97,716	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	500	490	69,014	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	310	272	38,315	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	400	344	48,519	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	880	823	116,005	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	500	448	63,198	2033/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,100	1,018	143,353	2029/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	350	276	38,980	2050/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	400	340	47,877	2030/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	600	406	57,278	2040/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	300	271	38,248	2027/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	1,800	1,453	204,698	2031/10/22

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	270	116	16,399	2071/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	200	163	23,021	2032/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	300	212	29,907	2053/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,000	1,201	169,100	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	750	956	134,670	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	965	1,180	166,235	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	700	773	108,975	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	300	344	48,479	2032/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	500	507	71,506	2023/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	390	457	64,434	2045/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	800	821	115,653	2024/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	300	316	44,591	2034/06/22
国小計	銘柄数 金額	31銘柄		18,354	17,576	2,474,729	
ユーロ（フランス）				千ユーロ	千ユーロ		
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,415	3,906	550,057	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,600	3,418	481,296	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,210	1,520	214,043	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,232	1,565	220,400	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,265	1,516	213,591	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,200	1,255	176,743	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,143	2,739	385,670	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,000	1,291	181,865	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,640	3,886	547,198	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,910	4,082	574,833	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,340	1,481	208,614	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,500	3,567	502,311	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,986	2,048	288,400	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,360	3,387	477,019	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,400	4,269	601,194	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,250	2,124	299,081	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,240	3,240	456,287	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,150	1,837	258,755	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,100	832	117,233	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,070	1,933	272,240	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,800	1,614	227,323	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,343	189,176	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,800	1,586	223,437	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,500	2,333	328,532	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	1,580	222,489	2034/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,750	2,543	358,070	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,157	303,713	2024/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,650	1,279	180,199	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,400	3,065	431,685	2029/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,057	289,735	2029/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,100	666	93,883	2052/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,300	910	128,171	2040/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,497	351,673	2030/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	200	80	11,378	2072/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	1,780	250,645	2031/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	825	116,246	2027/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	300	177	24,978	2053/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	600	476	67,148	2032/05/25
国小計	銘柄数 金額	38銘柄		78,471	76,884	10,825,331	
ユーロ（ドイツ）				千ユーロ	千ユーロ		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	455	564	79,451	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	800	973	137,064	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	800	947	133,370	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	2,096	2,785	392,192	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,660	2,170	305,550	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	3,270	4,340	611,156	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,090	1,394	196,365	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,020	1,378	194,153	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,810	2,613	368,010	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	656	814	114,619	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,098	1,240	174,648	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	760	772	108,723	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,300	4,356	613,347	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,575	1,801	253,704	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,990	2,005	282,338	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,000	1,991	280,344	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,190	1,165	164,132	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,800	3,758	529,229	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,883	1,822	256,599	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,850	3,625	510,514	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,550	1,464	206,193	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,100	2,939	413,852	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,460	1,298	182,830	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,050	989	139,311	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,800	1,659	233,681	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,800	1,648	232,130	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	967	136,229	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	618	87,109	2030/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	237	33,502	2035/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	1,401	197,302	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	954	134,449	2031/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	155	21,901	2036/05/15

外国債券インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末				償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		額	
					外 貨 建 金 額	千 円		
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	243	34,218	2050/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,115	157,132	2031/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	600	348	49,013	2052/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	991	139,532	2023/10/13	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	490	69,107	2024/04/05	
国 小 計	銘柄数 金 額	37銘柄		56,163	58,046	8,173,016		
ユーロ（スペイン）				千ユーロ	千ユーロ			
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	1,420	1,714	241,470	2029/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	3,100	3,064	431,416	2025/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	910	854	120,300	2030/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,565	2,566	361,397	2025/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	1,400	1,382	194,650	2026/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	989	909	128,047	2046/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,480	1,387	195,305	2066/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,049	1,961	276,177	2026/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,100	2,008	282,773	2027/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,320	1,227	172,888	2033/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,170	1,107	155,902	2027/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	1,650	1,545	217,644	2028/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	850	745	104,898	2048/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	800	740	104,226	2029/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,400	1,195	168,293	2035/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	900	774	109,102	2029/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	842	118,564	2030/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	100	56	7,890	2050/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,800	1,589	223,815	2030/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	950	668	94,061	2040/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	800	626	88,200	2031/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	200	99	13,997	2071/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	866	122,039	2028/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	500	353	49,768	2027/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	719	101,246	2031/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	1,000	801	112,792	2032/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	680	844	118,907	2032/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	900	1,003	141,348	2037/01/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	800	977	137,685	2040/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,043	1,248	175,748	2041/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,000	1,141	160,704	2026/07/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	2,188	2,281	321,175	2023/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,700	1,950	274,629	2028/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,090	1,400	197,199	2044/10/31	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	3,700	3,849	542,017	2024/04/30	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,084	1,108	156,032	2024/10/31	
国 小 計	銘柄数 金 額	36銘柄		46,538	45,613	6,422,322		
ユーロ（イタリア）				千ユーロ	千ユーロ			
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	2,700	3,153	443,996	2026/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,135	1,310	184,531	2027/11/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,100	3,087	434,786	2024/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	905	780	109,955	2046/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	920	884	124,506	2025/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	1,500	1,218	171,538	2032/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	900	870	122,501	2025/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,400	1,087	153,093	2047/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,250	996	140,321	2036/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	3,700	3,650	514,036	2023/10/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,000	727	102,457	2067/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,700	1,448	203,886	2033/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,700	1,611	226,937	2027/06/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	950	840	118,313	2048/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	1,550	1,451	204,418	2027/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	700	600	84,521	2038/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,500	2,317	326,247	2028/02/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	1,400	1,337	188,324	2028/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,300	1,279	180,089	2025/11/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	700	644	90,748	2035/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	500	470	66,187	2049/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,100	1,051	148,031	2029/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	1,400	1,341	188,909	2026/07/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	500	417	58,758	2030/04/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	150	106	15,033	2050/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	500	360	50,745	2036/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	1,591	224,024	2030/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	600	502	70,722	2030/12/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	600	415	58,439	2041/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,000	773	108,977	2031/04/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	100	58	8,275	2051/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	200	130	18,349	2037/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	1,600	1,186	167,047	2031/08/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	200	122	17,306	2045/04/30	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	450	268	37,872	2072/03/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	500	404	57,004	2029/02/15	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	500	321	45,277	2052/09/01	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	400	354	49,965	2038/03/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	1,540	1,698	239,150	2029/11/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	1,488	1,719	242,135	2031/05/01	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,300	1,482	208,764	2033/02/01	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,650	1,786	251,574	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	1,270	1,250	176,094	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,140	1,252	176,320	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,870	1,937	272,869	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,900	3,071	432,447	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	1,714	1,883	265,172	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	4,250	4,465	628,762	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,080	2,215	311,976	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,025	1,106	155,819	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,830	2,946	414,805	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,110	2,166	305,058	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	1,370	1,349	190,044	2030/03/01
国 小 計	銘柄数 金 額	53銘柄		71,847	69,510	9,787,137	
ユーロ（フィンランド）				千ユーロ	千ユーロ		
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	190	168	23,778	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	800	782	110,113	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	180	172	24,230	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	270	219	30,973	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	200	186	26,268	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	150	131	18,464	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	456	64,297	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	300	269	37,875	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	350	257	36,227	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	150	101	14,360	2040/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	200	104	14,739	2052/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	200	165	23,307	2031/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	400	371	52,263	2026/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	200	215	30,275	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	120	125	17,694	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	460	470	66,192	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	350	355	50,071	2024/04/15
国 小 計	銘柄数 金 額	17銘柄		5,020	4,553	641,137	
ユーロ（オーストリア）				千ユーロ	千ユーロ		
	Austria Government Bond	国債証券	1.2000	540	534	75,197	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	490	469	66,165	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	270	225	31,790	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	280	186	26,215	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,000	940	132,409	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	150	121	17,111	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	562	79,181	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	700	632	89,088	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	450	382	53,824	2030/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	600	393	55,403	2051/03/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.8500	100	40	5,729	2120/06/30
	Austria Government Bond	国債証券	—	500	412	58,095	2031/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	383	54,024	2025/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	200	147	20,728	2036/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	150	74	10,501	2071/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	200	177	24,957	2049/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	380	463	65,251	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	800	972	136,881	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	700	784	110,504	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	170	223	31,518	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	630	714	100,656	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	280	283	39,884	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	630	634	89,277	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	880	888	125,050	2024/10/21
国 小 計	銘柄数 金 額	24銘柄		11,100	10,649	1,499,450	
通貨小計	銘柄数 金 額	267銘柄		309,031	303,876	42,785,754	
合 計	銘柄数 金 額	554銘柄				122,375,149	

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

(3) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
US 2YR NOTE (CBT) (アメリカ)	280	—

(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6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	122,375,149	98.3
コール・ローン等、その他	2,120,401	1.7
投資信託財産総額	124,495,550	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。
 (注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.01円、1カナダ・ドル=104.20円、1オーストラリア・ドル=93.10円、1シンガポール・ドル=96.95円、1イギリス・ポンド=162.21円、1イスラエル・シケル=38.942円、1デンマーク・クローネ=18.93円、1ノルウェー・クローネ=13.49円、1スウェーデン・クローネ=13.25円、1メキシコ・ペソ=6.565円、1オフショア・人民元=20.014円、1マレーシア・リンギット=30.536円、1南アフリカ・ランド=8.42円、1ポーランド・ズロチ=30.093円、1ユーロ=140.80円です。
 (注3) 当期末における外貨建純資産（123,970,109千円）の投資信託財産総額（124,495,550千円）に対する比率は、99.6%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	250,197,435,277円
コール・ローン等	1,024,545,039
公社債（評価額）	122,375,149,528
未収入金	125,705,971,494
未収利息	810,738,948
前払費用	30,000,154
差入委託証拠金	251,030,114
(B) 負債	130,076,644,054
未払金	130,057,582,122
未払解約金	19,061,932
(C) 純資産総額（A－B）	120,120,791,223
元本	133,574,429,591
次期繰越損益金	△ 13,453,638,368
(D) 受益権総口数	133,574,429,591口
1万口当り基準価額（C／D）	8,993円

* 期首における元本額は113,403,229,819円、当作成期間中における追加設定元本額は33,395,160,755円、同解約元本額は13,223,960,983円です。
 * 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：
 ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） 108,109,338,430円
 ダイワファンドラップオンライン 外国債券インデックス（為替ヘッジあり） 4,161,900,030円
 ダイワ先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ラップ専用） 1,564,129円
 ダイワバランスファンド2021-02（適格機関投資家専用） 3,239,349,686円
 ダイワ外国債券インデックス（為替ヘッジあり）（ダイワSMA専用） 18,062,277,316円
 * 当期末の計算口数当りの純資産額は8,993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13,453,638,368円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3,083,779,205円
受取利息	3,084,971,375
その他収益金	67,780
支払利息	△ 1,259,950
(B) 有価証券売買損益	22,001,327,273
売買益	25,747,247,464
売買損	△ 47,748,574,737
(C) 先物取引等損益	19,513,013
取引益	21,398,787
取引損	△ 40,911,800
(D) その他費用	12,206,581
(E) 当期損益金（A＋B＋C＋D）	18,949,267,662
(F) 前期繰越損益金	4,514,657,781
(G) 解約差損益金	115,808,446
(H) 追加信託差損益金	865,163,067
(I) 合計（E＋F＋G＋H）	△ 13,453,638,368
次期繰越損益金（I）	△ 13,453,638,368

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

ダイワファンドラップ 外国債券インデックス (為替ヘッジなし)

運用報告書(全体版)

第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/債券/インデックス型		
信託期間	無期限(設定日:2016年9月26日)		
運用方針	投資成果をFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行いません。		
主要投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券	
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率	純資産総額の30%以下	
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2735>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
2 期末 (2018年 6 月15日)	円 10,709	円 0	% 0.8	10,815	% 1.8	% 98.6	% —	百万円 2,405
3 期末 (2019年 6 月17日)	10,978	0	2.5	11,109	2.7	98.5	—	3,676
4 期末 (2020年 6 月15日)	11,579	0	5.5	11,801	6.2	98.3	—	4,949
5 期末 (2021年 6 月15日)	12,187	0	5.3	12,457	5.6	98.7	—	6,651
6 期末 (2022年 6 月15日)	12,025	0	△ 1.3	12,308	△ 1.2	98.4	—	7,620

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

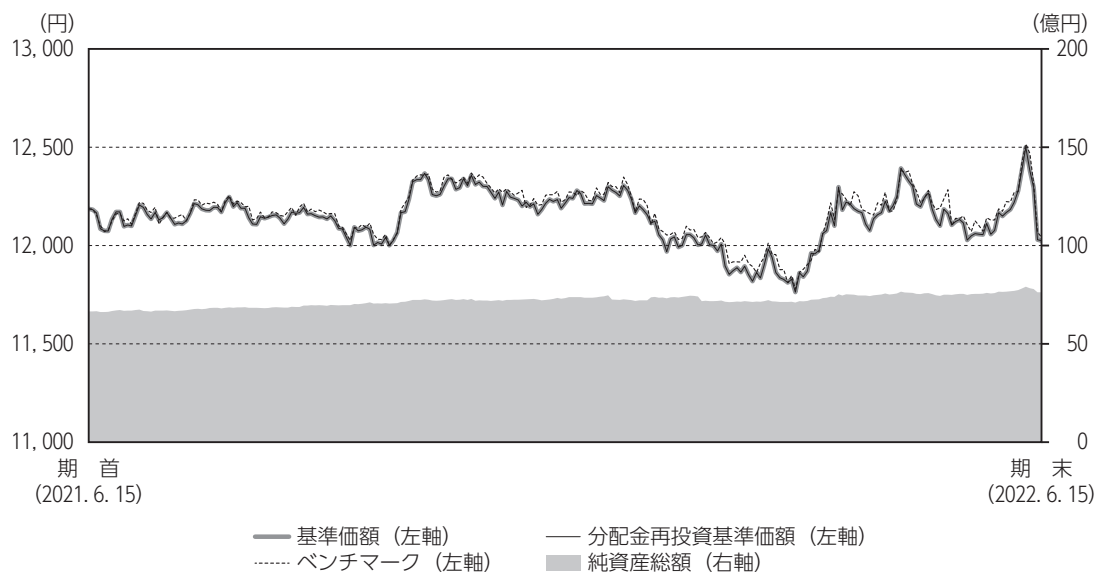
(注6) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注7) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：12,187円

期末：12,025円（分配金0円）

騰落率：△1.3%（分配金込み）

■ 基準価額の変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
	円	%		%	%	%
(期首)2021年 6月15日	12,187	—	12,457	—	98.7	—
6月末	12,099	△ 0.7	12,375	△ 0.7	98.3	—
7月末	12,178	△ 0.1	12,483	0.2	98.4	—
8月末	12,170	△ 0.1	12,464	0.1	98.0	—
9月末	12,083	△ 0.9	12,382	△ 0.6	98.1	—
10月末	12,339	1.2	12,610	1.2	98.1	—
11月末	12,198	0.1	12,475	0.1	98.3	—
12月末	12,270	0.7	12,572	0.9	98.4	—
2022年 1月末	12,055	△ 1.1	12,346	△ 0.9	98.3	—
2月末	11,835	△ 2.9	12,173	△ 2.3	98.5	—
3月末	12,221	0.3	12,506	0.4	98.4	—
4月末	12,243	0.5	12,509	0.4	98.3	—
5月末	12,167	△ 0.2	12,457	△ 0.0	98.0	—
(期末)2022年 6月15日	12,025	△ 1.3	12,308	△ 1.2	98.4	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

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、主要国の国債金利は、米国などで将来の利上げ後の経済回復ペースや物価上昇圧力の鈍化が意識されたことで、長期ゾーンを中心に低下しましたが、2021年9月にF R B (米国連邦準備制度理事会) の利上げ見通しが市場予想を上回ったことなどから、上昇に転じました。2022年に入ってから、ロシアがウクライナに侵攻したことで原油価格が高騰し、インフレ期待が上昇したことで、金利上昇が加速しました。その後も、インフレ率の上振れなどから各国で金融政策正常化が意識され、主要国の金利は上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに金利は上昇しました。

為替相場

為替相場は円安となりました。

当作成期首より、米ドル円は比較的狭いレンジでの推移となりましたが、2021年9月以降は米国金利が上がったことにより上昇 (円安) しました。2022年に入っても、期待インフレ率の上昇により米国金利がさらに上がったため、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、その他の通貨も対円で上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに円安が進みました。

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. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

「外国債券インデックスマザーファンド」を高位に組み入れました。

■外国債券インデックスマザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

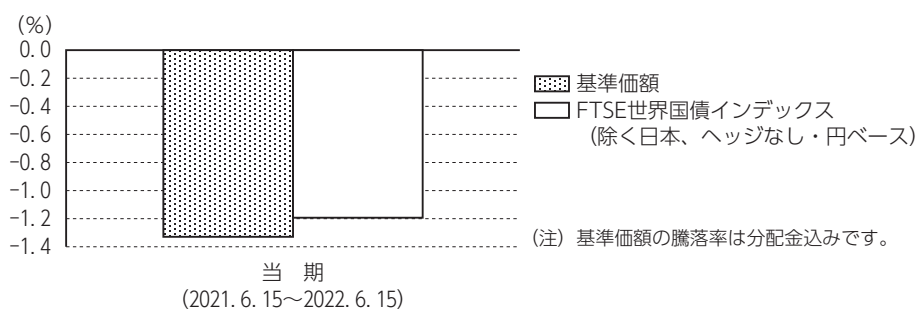
組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックスマザーファンド	FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は $\Delta 1.2\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 1.3\%$ となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、収益分配を見送らせていただきました。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	2,025

- (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 (2021.6.16～2022.6.15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	51円	0.418%	信託報酬＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は12,141円です。
（投信会社）	(35)	(0.286)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販売会社）	(13)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当期中の売買委託手数料／当期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当期中の有価証券取引税／当期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	3	0.021	その他費用＝当期中のその他費用／当期中の平均受益権口数
（保管費用）	(2)	(0.013)	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	53	0.439	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

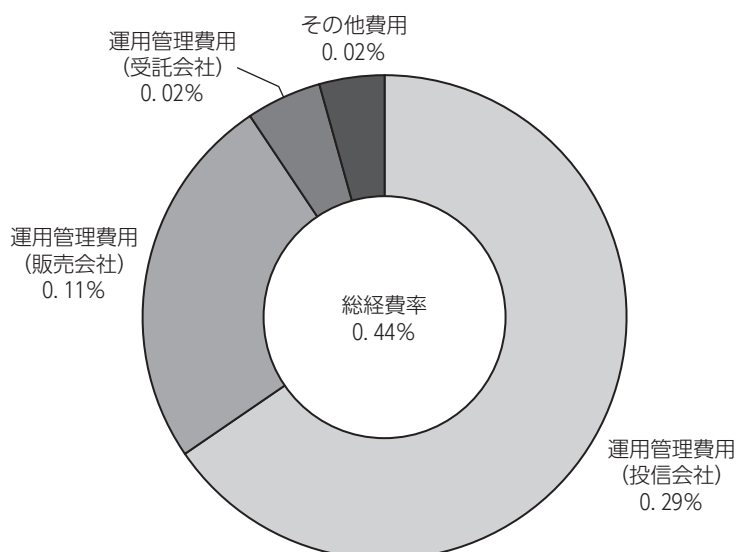
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

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



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券 インデックス マザーファンド	655,819	2,048,587	324,872	1,016,427

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	2,120,293	2,451,240	7,597,619	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス マザーファンド	7,597,619	99.5
コール・ローン等、その他	38,924	0.5
投資信託財産総額	7,636,544	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.01円、1カナダ・ドル=104.20円、1オーストラリア・ドル=93.10円、1シンガポール・ドル=96.95円、1イギリス・ポンド=162.21円、1イスラエル・シケル=38.942円、1デンマーク・クローネ=18.93円、1ノルウェー・クローネ=13.49円、1スウェーデン・クローネ=13.25円、1メキシコ・ペソ=6.565円、1オフショア・人民元=20.014円、1マレーシア・リンギット=30.536円、1ポーランド・ズロチ=30.093円、1ユーロ=140.80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(232,842,571千円)の投資信託財産総額(233,898,338千円)に対する比率は、99.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	7,636,544,365円
コール・ローン等	38,924,876
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	7,597,619,489
(B) 負債	15,706,506
未払信託報酬	15,402,599
その他未払費用	303,907
(C) 純資産総額(A-B)	7,620,837,859
元本	6,337,300,973
次期繰越損益金	1,283,536,886
(D) 受益権総口数	6,337,300,973口
1万口当り基準価額(C/D)	12,025円

* 期首における元本額は5,457,959,297円、当作成期間中における追加設定元本額は2,102,589,183円、同解約元本額は1,223,247,507円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,025円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 6,665円
受取利息	840
支払利息	△ 7,505
(B) 有価証券売買損益	△ 63,153,203
売買益	11,836,851
売買損	△ 74,990,054
(C) 信託報酬等	△ 30,621,398
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 93,781,266
(E) 前期繰越損益金	399,854,454
(F) 追加信託差損益金	977,463,698
(配当等相当額)	(392,390,652)
(売買損益相当額)	(585,073,046)
(G) 合計(D+E+F)	1,283,536,886
次期繰越損益金(G)	1,283,536,886
追加信託差損益金	977,463,698
(配当等相当額)	(392,390,652)
(売買損益相当額)	(585,073,046)
分配準備積立金	399,858,245
繰越損益金	△ 93,785,057

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

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

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

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	883,689,097
(d) 分配準備積立金	399,858,245
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,283,547,342
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	1,283,547,342
(h) 受益権総口数	6,337,300,973口

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国債券インデックス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日（2021年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在における外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■外国債券インデックスマザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

（2021年6月16日から2022年6月15日まで）

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.25% 2031/8/15	1,145,094	GERMAN GOVERNMENT BOND (ドイツ) 2023/4/14	790,367
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) 1.625% 2022/11/15	777,091
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.875% 2032/2/15	897,130	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2022/11/30	736,251
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 0.375% 2024/9/15	848,795	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2023/5/15	630,327
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.25% 2028/9/30	785,770	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.125% 2022/6/30	604,766
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2% 2051/8/15	781,896	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.125% 2022/12/31	583,924
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2031/5/15	699,257	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 1.75% 2023/5/25	578,812
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.375% 2051/5/15	696,719	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2023/2/15	537,083
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) 0.5% 2023/3/15	535,344
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 0.625% 2026/7/31	667,034	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2.25% 2022/10/25	487,862

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2022年6月15日現在における外国債券インデックスマザーファンド（75,409,227千円）の内容です。

(1) 外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちB格以下組入率	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
			千円	%	%	%	%	%	
アメリカ	千アメリカ・ドル 964,623	千アメリカ・ドル 872,910	117,851,629	50.4	—	22.1	18.1	10.2	
カナダ	千カナダ・ドル 49,221	千カナダ・ドル 44,650	4,652,632	2.0	—	1.0	0.5	0.5	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 42,534	千オーストラリア・ドル 37,820	3,521,107	1.5	—	1.1	0.4	0.0	
シンガポール	千シンガポール・ドル 11,030	千シンガポール・ドル 10,470	1,015,081	0.4	—	0.2	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 70,612	千イギリス・ポンド 71,375	11,577,757	5.0	—	3.9	0.6	0.5	
イスラエル	千イスラエル・シケル 24,300	千イスラエル・シケル 23,697	922,846	0.4	—	0.2	0.1	0.1	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 45,211	千デンマーク・クローネ 46,934	888,471	0.4	—	0.3	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 34,905	470,872	0.2	—	0.1	0.1	0.0	
スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 48,205	千スウェーデン・クローネ 47,350	627,394	0.3	—	0.1	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 291,735	千メキシコ・ペソ 271,753	1,784,194	0.8	—	0.4	0.3	0.1	
中国	千オフショア・人民元 225,900	千オフショア・人民元 231,967	4,642,686	2.0	—	0.9	0.8	0.2	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 40,255	千マレーシア・リンギット 39,008	1,191,192	0.5	—	0.3	0.2	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 39,450	千ポーランド・ズロチ 31,760	955,807	0.4	—	0.2	0.2	0.1	
ユ ー ロ 圏	アイルランド	千ユーロ 12,353	千ユーロ 11,379	1,602,218	0.7	—	0.5	0.2	0.0
	オランダ	千ユーロ 28,548	千ユーロ 27,831	3,918,735	1.7	—	1.2	0.4	0.2
	ベルギー	千ユーロ 34,826	千ユーロ 33,685	4,742,859	2.0	—	1.5	0.4	0.1
	フランス	千ユーロ 148,961	千ユーロ 144,067	20,284,741	8.7	—	5.3	2.5	0.8
	ドイツ	千ユーロ 108,055	千ユーロ 108,235	15,239,508	6.5	—	4.0	1.7	0.9
	スペイン	千ユーロ 88,003	千ユーロ 85,065	11,977,175	5.1	—	3.1	1.5	0.5
	イタリア	千ユーロ 139,978	千ユーロ 131,177	18,469,760	7.9	—	4.5	2.4	1.1
	フィンランド	千ユーロ 9,836	千ユーロ 8,847	1,245,772	0.5	—	0.3	0.1	0.1
	オーストリア	千ユーロ 22,679	千ユーロ 21,412	3,014,908	1.3	—	0.7	0.4	0.1
	小計	593,239	571,702	80,495,680	34.4	—	21.0	9.5	3.9
合 計	—	—	230,597,354	98.7	—	51.8	31.2	15.6	

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

(2)外国 (外貨建) 公社債 (銘柄別)

2022年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,568	4,532	611,902	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	4,984	673,011	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,176	698,851	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	4,829	651,974	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	678	91,544	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	924	124,775	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	794	107,297	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	807	109,079	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	847	114,433	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	2,720	367,321	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,324	178,865	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	1,000	135,061	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	607	82,031	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	583	78,779	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	1,044	140,982	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,222	164,990	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,189	160,584	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,334	180,207	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,149	155,183	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	1,847	249,412	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,123	151,645	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,583	213,854	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,442	194,789	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,493	201,694	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,524	205,785	2041/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,331	179,735	2041/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,487	200,870	2042/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,212	163,758	2042/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,231	1,915	258,613	2042/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	1,395	188,378	2042/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	2,389	322,542	2043/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	2,002	270,379	2043/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	3,157	426,328	2043/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	2,084	281,416	2043/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	3,248	438,557	2044/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	3,140	423,979	2044/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	6,021	813,013	2024/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	1,746	235,833	2044/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	5,746	775,844	2024/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,746	2,430	328,187	2044/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,515	744,619	2025/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	2,072	279,769	2045/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	5,554	749,867	2025/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,835	2,511	339,035	2045/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,466	738,075	2025/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,873	1,623	219,188	2045/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	5,583	753,837	2025/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	659	584	78,948	2045/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,866	4,533	612,048	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,148	2,543	343,460	2046/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,729	7,158	966,451	2026/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,823	2,281	308,001	2046/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,465	332,830	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	2,945	397,735	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	4,950	668,389	2026/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,780	2,131	287,827	2046/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,721	367,453	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,349	317,213	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,446	330,272	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	4,944	667,582	2026/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,444	329,994	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,000	869	117,395	2046/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,448	330,567	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,459	332,063	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,640	3,424	462,333	2027/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,436	328,988	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,345	2,092	282,538	2047/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,252	304,129	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,550	4,449	600,713	2024/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	6,038	815,322	2027/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	1,783	240,779	2047/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	2,923	394,742	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,157	696,376	2024/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,333	314,983	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	5,518	745,029	2027/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,918	394,061	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,950	2,515	339,561	2047/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	1,931	260,758	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,500	2,426	327,581	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,130	692,722	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,134	288,185	2047/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,398	458,874	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,094	417,852	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	2,711	366,063	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,350	6,075	820,268	2028/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,530	341,660	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,642	356,722	2025/02/28

外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,000	2,695	363,891	2048/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	2,825	381,462	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,800	3,504	473,154	2048/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	6,245	843,146	2028/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	1,861	251,347	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,479	469,810	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,491	336,390	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,486	335,742	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	2,927	395,280	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,850	3,832	517,371	2023/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	6,432	868,384	2028/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,220	3,800	513,075	2048/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,447	330,416	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,578	483,110	2023/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,507	473,501	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,452	331,051	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	2,986	403,255	2023/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,451	331,010	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	3,978	537,123	2023/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,700	3,599	485,954	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,520	4,381	591,602	2048/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	2,927	395,220	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	1,988	268,521	2023/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,500	3,386	457,177	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,473	333,883	2023/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	6,229	841,077	2029/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	3,945	532,695	2024/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,415	326,106	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	4,262	575,502	2049/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,402	324,418	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,245	438,221	2024/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,378	321,175	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	4,121	556,478	2049/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	3,615	488,117	2029/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,426	462,583	2024/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,675	361,251	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	2,834	382,688	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,383	456,842	2024/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	2,618	353,482	2026/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,500	5,308	716,736	2024/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,333	315,109	2026/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,133	558,052	2029/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	3,578	483,105	2049/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,555	345,067	2026/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,811	514,636	2024/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,303	311,022	2026/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,867	387,119	2024/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	953	128,796	2024/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	2,757	372,246	2026/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,850	5,182	699,651	2029/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	3,604	486,698	2049/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	1,836	247,994	2026/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	2,856	385,693	2024/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,306	311,339	2026/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,391	322,862	2024/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,700	1,607	217,035	2025/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,000	4,327	584,228	2030/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	6,500	5,917	798,987	2027/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	3,958	534,396	2050/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	268	36,183	2027/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	4,875	658,194	2025/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,500	1,377	185,973	2025/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,390	187,780	2027/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,800	5,451	736,024	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,464	332,685	2025/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,400	2,068	279,214	2027/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	3,352	452,628	2050/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	3,313	447,375	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,006	405,860	2027/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,719	367,216	2025/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,500	5,345	721,726	2023/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	5,875	793,231	2025/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	2,998	404,863	2027/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	967	130,684	2023/07/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,063	413,667	2025/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,500	5,311	717,085	2023/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	10,000	7,963	1,075,111	2030/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,246	573,367	2027/07/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	6,700	4,151	560,469	2050/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	6,000	3,946	532,800	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	2,982	402,647	2027/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,925	259,934	2023/09/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	5,823	786,236	2025/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,375	455,739	2027/09/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,144	424,596	2025/08/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,200	4,029	544,048	2023/10/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	7,700	7,376	995,873	2023/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	9,800	7,942	1,072,370	2030/11/15

2022年6月15日現在

区分	銘柄	種類	年利率	評価額			償還年月日
				額面金額	外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,573	482,444	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,000	3,394	458,229	2027/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	6,800	4,509	608,862	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,100	3,497	472,139	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,100	4,566	616,521	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,258	574,899	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,859	386,074	2023/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,250	573,839	2027/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	1,000	892	120,527	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,000	3,801	513,286	2024/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	7,000	5,980	807,439	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,900	4,177	564,027	2051/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	10,700	8,826	1,191,627	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,000	4,739	639,873	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,452	601,105	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,365	589,345	2028/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,700	3,526	476,056	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,000	2,677	361,424	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,894	255,746	2024/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,509	473,798	2028/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,595	485,441	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	3,000	2,838	383,287	2024/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	8,700	7,463	1,007,619	2031/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,100	4,801	648,284	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,500	4,034	544,651	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,249	708,672	2028/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	5,109	689,860	2051/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,800	3,029	409,024	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	972	131,248	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,491	471,352	2028/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,400	3,935	531,295	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,877	253,448	2024/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,500	1,453	196,279	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	4,356	588,184	2028/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	5,000	4,484	605,486	2026/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	5,500	5,162	696,984	2024/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	3,000	2,806	378,889	2024/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	10,300	8,501	1,147,734	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	6,900	5,034	679,672	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	3,700	2,688	362,943	2041/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.1250	2,500	2,415	326,052	2023/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	6,000	5,315	717,591	2026/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	5,000	4,281	578,058	2028/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.1250	3,000	2,892	390,473	2023/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	5,000	4,305	581,332	2028/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	5,000	4,442	599,734	2026/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	7,500	6,995	944,459	2024/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	7,000	6,070	819,621	2028/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,500	3,120	421,331	2026/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,442	194,817	2023/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	2,000	1,871	252,719	2024/10/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	2,000	1,871	252,698	2024/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	9,000	7,482	1,010,225	2031/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,600	3,962	535,023	2051/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	4,000	3,035	409,879	2041/11/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	4,000	3,843	518,940	2023/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	6,000	5,240	707,465	2028/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	4,000	3,598	485,782	2026/10/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,612	487,677	2026/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.5000	5,000	4,800	648,095	2023/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	5,600	4,923	664,731	2028/11/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	2,200	2,066	279,037	2024/12/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	2,500	2,402	324,300	2023/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.3750	4,000	3,489	471,141	2028/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	4,000	3,606	486,921	2026/12/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	1,000	940	126,929	2025/01/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,000	2,881	389,096	2024/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	7,400	6,426	867,665	2032/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	3,700	3,503	473,056	2025/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	4,300	3,836	517,948	2029/01/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	3,900	3,034	409,626	2052/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	1,500	1,215	164,083	2042/02/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	5,000	4,498	607,274	2029/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.5000	4,000	3,876	523,331	2024/02/29
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.8750	1,000	925	124,967	2027/02/28
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	5,000	4,762	642,985	2025/03/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.3750	3,000	2,781	375,519	2029/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	5,000	4,758	642,505	2027/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.2500	2,000	1,959	264,543	2024/03/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.6250	2,000	1,948	263,037	2025/04/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	3,000	2,848	384,555	2032/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,930	395,613	2025/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	2,000	1,792	242,045	2052/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	3.2500	1,500	1,402	189,319	2042/05/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	4,500	4,424	597,386	2024/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.8750	3,000	2,870	387,561	2029/04/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.7500	3,000	2,886	389,667	2027/04/30

外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.5000	4,500	4,420	596,876	2024/05/31	
通貨小計	銘柄数	263銘柄						
	金 額			964,623	872,910	117,851,629		
カナダ	Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	605	518	53,988	2064/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,111	115,821	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,328	138,451	2033/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,179	122,919	2037/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	913	972	101,365	2041/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	961	963	100,375	2045/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,232	128,403	2023/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,380	143,836	2024/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,179	122,872	2048/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,117	116,421	2025/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	897	93,496	2026/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,096	114,293	2027/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	650	595	62,021	2028/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,300	1,279	133,307	2023/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,710	2,750	286,619	2051/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,118	116,575	2029/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,177	122,671	2024/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,342	139,878	2024/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	2,885	300,630	2030/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	700	660	68,794	2025/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,628	273,839	2025/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,000	1,545	161,014	2030/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,100	1,862	194,069	2026/03/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,134	118,207	2024/04/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	300	270	28,159	2026/09/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,400	2,849	296,925	2031/06/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	100	96	10,069	2023/08/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,000	940	98,027	2024/10/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,450	994	103,599	2053/12/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	961	100,178	2023/11/01	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	200	179	18,753	2027/03/01	
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	3,000	2,873	299,452	2024/02/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,700	1,414	147,376	2031/12/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	200	189	19,737	2025/04/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	400	385	40,208	2024/05/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,000	865	90,226	2032/06/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	100	91	9,506	2029/12/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	383	40,011	2027/09/01		
CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	200	196	20,525	2024/08/01		
通貨小計	銘柄数	39銘柄						
	金 額			49,221	44,650	4,652,632		
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,989	2,084	194,092	2027/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	573	569	53,038	2024/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,354	1,306	121,589	2029/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,798	1,788	166,501	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,258	1,315	122,501	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,748	1,788	166,481	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,071	99,722	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,307	1,136	105,785	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	707	65,879	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,672	1,592	148,250	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,178	1,083	100,845	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	1,025	95,434	2047/03/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,800	1,691	157,481	2028/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,900	1,762	164,077	2029/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,870	2,598	241,933	2030/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,390	1,134	105,595	2041/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	2,316	215,645	2031/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,700	1,325	123,387	2032/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,232	207,817	2024/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	1,974	183,837	2030/12/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,400	837	77,940	2051/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,429	133,097	2025/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	1,924	179,145	2031/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,051	97,919	2026/09/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,100	892	83,095	2032/11/21	
	AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.0000	1,300	1,181	110,011	2033/11/21	
	通貨小計	銘柄数	26銘柄					
		金 額			42,534	37,820	3,521,107	
	シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	785	76,162	2027/03/01
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	3.0000	923	926	89,869	2024/09/01	
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.8750	809	793	76,942	2030/09/01	
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.7500	400	374	36,343	2042/04/01	
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.7500	671	672	65,216	2023/07/01	
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	3.3750	568	577	56,003	2033/09/01	
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.8750	625	617	59,866	2029/07/01	
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.3750	524	516	50,090	2025/06/01	
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.7500	688	642	62,265	2046/03/01	
SINGAPORE GOVERNMENT		国債証券	2.7500	688	642	62,265	2046/03/01	

2022年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	436	42,279	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	750	667	64,754	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	538	52,176	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	490	485	47,022	2024/02/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	312	30,335	2039/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	710	555	53,897	2050/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	750	692	67,135	2025/11/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	600	529	51,319	2031/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	200	158	15,369	2051/10/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	200	185	18,028	2026/11/01
通貨小計	銘柄数	19銘柄					
	金 額			11,030	10,470	1,015,081	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	921	915	148,573	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,582	1,575	255,582	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,426	231,328	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,760	1,366	221,702	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,450	1,269	205,921	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,810	1,451	235,508	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,410	1,345	218,174	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	2,300	2,268	368,020	2023/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,500	1,444	234,309	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,040	792	128,568	2071/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	1,800	1,764	286,217	2024/04/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,210	989	160,528	2049/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	660	107,150	2054/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	800	720	116,862	2029/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,900	1,818	294,989	2025/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,190	922	149,557	2041/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	2,300	1,947	315,904	2030/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	1,000	496	80,581	2061/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,394	226,275	2026/01/30
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,600	1,419	230,244	2028/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	654	106,132	2050/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,700	1,307	212,015	2035/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,300	1,258	204,160	2024/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	1,300	1,060	172,066	2031/07/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	500	338	54,895	2046/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	500	461	74,786	2026/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	300	213	34,554	2051/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.2500	100	94	15,369	2025/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	600	469	76,156	2039/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.5000	700	618	100,314	2029/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.8750	300	249	40,514	2033/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	300	226	36,792	2053/07/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.0000	100	86	14,049	2032/01/31
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	420	259	42,095	2073/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,158	187,978	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,240	2,573	417,416	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,579	256,141	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,662	1,953	316,957	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,357	1,720	279,033	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	2,316	375,713	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,366	1,729	280,463	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,356	220,012	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,116	2,687	436,006	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,600	1,886	305,964	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	1,735	281,498	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	1,745	283,061	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,560	1,855	301,058	2034/09/07
United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,174	1,579	256,271	2060/01/22	
United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	1,915	310,649	2040/12/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	1,897	307,729	2052/07/22	
United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,866	2,012	326,505	2044/01/22	
United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,582	1,584	256,998	2023/09/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,386	1,757	285,003	2068/07/22	
United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,092	1,105	179,317	2024/09/07	
United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,724	1,936	314,066	2045/01/22	
通貨小計	銘柄数	55銘柄					
	金 額			70,612	71,375	11,577,757	
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	1,800	2,033	79,206	2026/10/30
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,600	2,009	78,255	2042/01/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,000	2,041	79,481	2024/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,217	86,339	2025/08/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,716	66,858	2027/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,400	2,388	93,011	2047/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,800	1,713	66,745	2028/09/28
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,500	1,489	58,011	2023/11/30
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	2,400	2,045	79,673	2030/03/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.5000	1,600	1,495	58,255	2025/04/30
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,700	1,301	50,672	2037/05/31
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.1500	2,000	1,961	76,368	2023/07/31
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.5000	200	182	7,098	2026/02/27
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.4000	900	849	33,083	2024/10/31

外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	% 1.3000	千イスラエル・シケル 300	千イスラエル・シケル 251	千円 9,782	2032/04/30
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		24,300	23,697	922,846	
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	千デンマーク・クローネ 13,662	千デンマーク・クローネ 18,259	345,660	2039/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	4,881	92,415	2023/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	6,035	114,255	2025/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	7,100	6,600	124,953	2027/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	8,590	7,724	146,217	2029/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,500	2,054	38,884	2052/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	412	7,813	2031/11/15
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	965	18,271	2024/11/15
	通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄		45,211	46,934	888,471
ノルウェー	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	千ノルウェー・クローネ 4,095	千ノルウェー・クローネ 4,114	55,503	2024/03/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	5,395	5,215	70,360	2025/03/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,340	4,104	55,364	2026/02/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,450	4,192	56,553	2027/02/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,500	3,293	44,424	2028/04/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	3,508	47,332	2029/09/06
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	6,800	5,948	80,250	2030/08/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,500	2,971	40,090	2031/09/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1250	1,700	1,556	20,992	2032/05/18
	通貨小計	銘柄数 金 額	9銘柄		37,630	34,905	470,872
スウェーデン	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	千スウェーデン・クローネ 4,655	千スウェーデン・クローネ 5,626	74,551	2039/03/30
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	8,025	8,010	106,139	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,595	7,703	102,068	2025/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	6,874	91,086	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,050	4,700	62,282	2028/05/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,300	3,388	44,896	2032/06/01
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	7,400	6,785	89,907	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1250	5,000	4,261	56,461	2031/05/12
	通貨小計	銘柄数 金 額	8銘柄		48,205	47,350	627,394
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 37,290	千メキシコ・ペソ 32,879	215,869	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	21,300	18,650	122,449	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	23,800	23,073	151,491	2024/09/05
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	7,000	5,954	39,091	2027/03/04
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	1,000	891	5,853	2025/03/06
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	30,033	29,386	192,934	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	23,919	24,143	158,514	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	27,968	25,902	170,061	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	8,874	9,431	61,925	2036/11/20
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,544	28,368	186,251	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	18,894	17,705	116,248	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	32,515	29,651	194,678	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	21,654	18,622	122,262	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	7,944	7,091	46,562	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄		291,735	271,753	1,784,194	
中国	China Government Bond	国債証券	3.2200	千オフショア・人民元 5,200	千オフショア・人民元 5,336	106,804	2025/12/06
	China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,162	103,326	2028/11/22
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,000	5,184	103,768	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3.2500	5,000	5,141	102,901	2026/06/06
	China Government Bond	国債証券	3.1200	12,000	12,281	245,804	2026/12/05
	China Government Bond	国債証券	3.1300	5,000	5,110	102,292	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2.8500	6,000	6,062	121,343	2027/06/04
	China Government Bond	国債証券	2.6800	6,500	6,433	128,753	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	2.8800	27,000	27,275	545,906	2023/11/05
	China Government Bond	国債証券	3.2700	6,500	6,721	134,529	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3.0300	7,000	7,130	142,706	2026/03/11
	China Government Bond	国債証券	3.8100	7,300	7,921	158,543	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	3.0100	5,000	5,077	101,619	2028/05/13
	China Government Bond	国債証券	3.7200	3,000	3,212	64,287	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.0200	5,800	5,876	117,619	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,522	90,512	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7400	5,000	5,037	100,830	2026/08/04
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5700	11,000	11,305	226,263	2024/06/22
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5900	5,500	5,776	115,605	2027/08/03
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	15,000	15,498	310,192	2024/09/21
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6900	5,000	5,305	106,188	2028/05/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.6100	10,000	10,384	207,833	2025/06/07
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5400	4,500	4,730	94,686	2028/08/16
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0800	3,100	3,502	70,093	2048/10/22
CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8600	3,300	3,606	72,174	2049/07/22	
CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7700	11,000	11,461	229,400	2025/03/08	

2022年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3900	千オフショア・人民元 6,500	千オフショア・人民元 6,577	千円 131,646	2050/03/16
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	5,500	5,550	111,093	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	3,500	3,637	72,806	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	4,000	4,017	80,414	2031/11/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	5,000	4,955	99,174	2027/01/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	7,200	7,164	143,384	2032/02/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	5,000	5,005	100,179	2029/03/24
通貨小計	銘柄数	33銘柄					
	金 額			225,900	231,967	4,642,686	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	千マレーシア・リンギット 2,373	千マレーシア・リンギット 2,311	70,587	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,186	36,241	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,541	47,078	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,281	39,129	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	726	22,174	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,340	40,934	2033/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,836	56,069	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	1,300	1,287	39,325	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,057	1,071	32,708	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,747	53,375	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,166	35,621	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,302	1,315	40,162	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	891	27,220	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,550	1,544	47,158	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,550	1,567	47,853	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,175	35,895	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,950	1,945	59,398	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,208	36,905	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,198	36,584	2033/11/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	600	597	18,259	2038/06/08
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	649	19,835	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,610	2,533	77,358	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,179	36,008	2048/07/06
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	400	399	12,211	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,187	36,264	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,520	46,436	2040/05/22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	1,950	1,667	50,925	2050/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,800	1,568	47,882	2031/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	500	466	14,259	2032/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	400	390	11,926	2042/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5040	500	504	15,397	2029/04/30
通貨小計	銘柄数	31銘柄					
	金 額			40,255	39,008	1,191,192	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	千ポーランド・ズロチ 4,377	千ポーランド・ズロチ 3,569	107,411	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	3,170	2,463	74,147	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	2,870	2,625	79,017	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,840	3,524	106,079	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,400	3,024	91,012	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	2,000	1,660	49,976	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,000	1,844	55,509	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	2,200	1,601	48,208	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	861	25,933	2024/07/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	900	537	16,184	2032/04/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	500	418	12,591	2027/05/25
	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	827	749	22,559	2029/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	2,125	2,042	61,455	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	3,650	2,806	84,459	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	4,591	4,029	121,259	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	15銘柄					
	金 額			39,450	31,760	955,807	
ユーロ (アイルランド)	IRISH TREASURY	国債証券	5.4000	千ユーロ 1,031	千ユーロ 1,140	160,635	2025/03/13
	IRISH TREASURY	国債証券	3.4000	607	631	88,861	2024/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	2.4000	961	985	138,740	2030/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	2.0000	931	831	117,063	2045/02/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.0000	1,073	1,047	147,525	2026/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	550	497	69,994	2037/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	752	105,933	2028/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	750	668	94,117	2033/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	750	700	98,560	2031/03/18
	IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	950	894	125,939	2029/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	700	537	75,672	2050/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	350	270	38,113	2035/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	738	103,991	2027/05/15
	IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	679	95,614	2030/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	-	800	645	90,855	2031/10/18
	IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	400	278	39,218	2041/04/22
	IRISH TREASURY	国債証券	0.3500	100	80	11,382	2032/10/18
国小計	銘柄数	17銘柄					
	金 額			12,353	11,379	1,602,218	

外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ (オランダ)	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,139	1,363	191,919	2028/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,755	2,162	304,456	2037/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,729	2,159	304,101	2042/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,468	1,525	214,823	2033/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,399	197,108	2023/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,929	2,175	306,243	2047/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,536	216,353	2024/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,725	242,920	2025/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,938	1,852	260,866	2026/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,094	294,944	2027/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,376	193,839	2024/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,267	178,521	2028/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,070	150,735	2029/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	680	95,800	2040/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,199	168,908	2030/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	740	104,202	2027/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,150	623	87,812	2052/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,089	153,369	2031/07/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	641	90,339	2038/01/15
	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	795	111,954	2029/01/15
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	94	13,288	2026/01/15	
NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	300	257	36,223	2032/07/15	
国小計	銘柄数	22銘柄					
	金額			28,548	27,831	3,918,735	
ユーロ (ベルギー)	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,699	1,660	233,824	2025/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	1,594	224,553	2031/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	963	135,690	2038/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,863	1,812	255,149	2026/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	982	138,309	2047/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	740	614	86,556	2066/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	940	931	131,191	2023/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,100	1,045	147,244	2027/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,029	144,930	2024/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	580	509	71,686	2057/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	600	516	72,778	2037/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,490	1,395	196,417	2028/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	650	583	82,157	2033/04/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,388	195,482	2029/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	700	553	77,960	2050/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,037	146,026	2030/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	860	583	82,098	2040/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,086	152,994	2027/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	—	1,600	1,292	181,954	2031/10/22
	Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	530	228	32,191	2071/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	400	327	46,043	2032/06/22
	BELGIUM GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	600	424	59,815	2053/06/22
	Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,048	288,485	2028/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,904	2,428	341,883	2035/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	1,962	276,312	2041/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,106	155,835	2026/03/28
	Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	895	126,047	2032/03/28
Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,359	191,351	2023/06/22	
Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	843	989	139,277	2045/06/22	
Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,545	217,572	2024/06/22	
Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	788	111,033	2034/06/22	
国小計	銘柄数	31銘柄					
	金額			34,826	33,685	4,742,859	
ユーロ (フランス)	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	3,460	487,239	2025/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	4,062	571,967	2029/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,227	4,242	597,362	2032/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	3,340	470,365	2035/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,764	2,241	315,572	2055/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	2,846	400,843	2038/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	4,997	5,227	735,991	2023/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,664	4,683	659,401	2041/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,717	2,217	312,263	2060/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,646	3,892	548,100	2026/04/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	5,699	5,950	837,846	2027/10/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,588	2,861	402,906	2045/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	5,086	5,184	729,929	2024/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,087	5,246	738,718	2030/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,899	4,939	695,511	2024/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,388	477,129	2025/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	4,993	703,095	2025/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,620	5,305	747,038	2031/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,387	4,181	588,744	2026/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	4,169	3,563	501,745	2036/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,387	1,049	147,820	2066/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,050	3,782	532,644	2026/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	2,305	324,566	2039/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,262	459,427	2027/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,550	2,248	316,536	2048/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,400	4,106	578,216	2028/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	3,467	488,241	2034/05/25

2022年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	4,577	644,527	2028/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,333	469,375	2024/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,150	2,443	344,016	2050/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,350	3,922	552,303	2029/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,330	4,152	584,740	2025/03/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	3,601	507,037	2029/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,770	1,679	236,415	2052/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,820	397,089	2026/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	1,540	216,906	2040/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	3,330	468,897	2030/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	980	395	55,756	2072/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	98	13,829	2024/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,500	969	136,504	2044/06/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,600	3,722	524,076	2031/11/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,100	2,843	400,404	2027/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,300	768	108,240	2053/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	1,271	179,061	2032/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	95	13,508	2025/02/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	200	166	23,388	2038/05/25
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	300	280	39,429	2028/02/25
国小計	銘柄数	47銘柄					
	金額			148,961	144,067	20,284,741	
ユーロ (ドイツ)	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,056	148,706	2024/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,447	203,780	2027/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	2,630	370,417	2028/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,124	158,377	2028/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	2,592	365,060	2030/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,048	3,984	561,034	2031/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,305	3,059	430,799	2034/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,571	4,569	643,323	2037/01/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	1,791	252,208	2039/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,739	2,511	353,574	2040/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,274	2,821	397,323	2042/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	3,172	446,641	2044/07/04
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,624	228,748	2023/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,581	222,659	2024/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	3,064	431,539	2046/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,606	226,154	2024/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,042	4,023	566,575	2024/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,149	302,610	2025/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,134	3,099	436,475	2025/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,368	2,291	322,691	2026/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,279	320,894	2026/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,200	3,968	558,716	2027/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,180	307,052	2027/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,770	2,463	346,876	2048/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,790	252,086	2028/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,100	2,858	402,452	2028/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,015	283,715	2029/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	2,675	376,721	2029/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,250	1,360	191,572	2050/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,546	217,773	2030/02/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,100	1,665	234,515	2035/05/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,839	258,998	2027/11/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,576	221,965	2030/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,052	148,218	2030/08/15
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	781	110,004	2031/02/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,088	153,312	2036/05/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	1,808	254,698	2028/11/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	668	94,101	2050/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,600	3,090	435,136	2031/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	602	84,784	2031/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,273	179,298	2032/02/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	994	140,019	2023/06/16	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	99	13,951	2023/09/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	580	81,689	2052/08/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	4,150	584,458	2023/12/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	98	13,836	2024/03/15	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2000	100	98	13,808	2024/06/14	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,882	265,112	2023/10/13	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,884	265,372	2024/04/05	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,651	232,535	2024/10/18	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,313	325,683	2025/04/11	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,199	309,672	2025/10/10	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	95	13,489	2025/10/10	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,083	293,420	2026/04/10	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,220	171,779	2026/10/09	
GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	92	13,080	2027/04/16	
国小計	銘柄数	56銘柄					
	金額			108,055	108,235	15,239,508	
ユーロ (スペイン)	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	2,652	3,202	450,972	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	2,021	284,595	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	1,926	271,271	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,193	308,843	2025/10/31

外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千ユーロ	千円	
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	2,698	379,984	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	1,794	252,727	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	1,452	204,543	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,630	2,517	354,488	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	1,817	255,842	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,750	1,627	229,208	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	1,940	273,163	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,400	2,248	316,573	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,500	1,314	185,114	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	2,400	2,384	335,737	2023/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,900	2,706	381,142	2028/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,480	208,453	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,850	1,579	222,387	2035/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,228	313,771	2024/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,410	339,428	2029/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,360	1,145	161,248	2030/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,375	334,505	2025/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	784	110,464	2050/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,206	310,616	2027/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,400	2,119	298,420	2030/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,300	914	128,715	2040/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	460	64,850	2026/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	2,200	1,722	242,551	2031/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	290	40,897	2024/05/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	650	323	45,492	2071/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	433	61,019	2028/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	900	636	89,583	2037/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,518	213,743	2031/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	600	394	55,592	2042/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	803	113,100	2027/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	2,100	1,682	236,863	2032/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9000	600	415	58,447	2052/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	93	13,232	2025/05/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	100	87	12,333	2029/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,179	2,706	381,028	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	2,254	2,514	353,999	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	2,158	2,637	371,406	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	1,772	249,569	2024/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,973	2,361	332,455	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,789	3,001	422,575	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,242	315,785	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	1,981	279,047	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,030	285,937	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	1,669	235,010	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,049	288,587	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,143	301,844	2024/10/31
国小計	銘柄数	50銘柄					
	金 額			88,003	85,065	11,977,175	
ユーロ (イタリア)	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	906	995	140,129	2023/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,296	182,531	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	2,762	388,898	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,806	254,420	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	1,302	183,340	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,390	336,572	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	1,677	236,151	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,891	2,794	393,502	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	1,250	176,057	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,386	2,250	316,900	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	1,852	260,885	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	980	138,042	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	1,550	1,529	215,339	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	704	99,178	2067/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,277	179,900	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,431	201,573	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,289	181,528	2024/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,850	1,636	230,399	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,700	2,529	356,084	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,553	218,701	2024/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,114	156,967	2038/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	1,946	274,048	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,248	175,723	2025/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,550	2,436	343,019	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	2,200	2,221	312,721	2023/10/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,525	214,721	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,169	164,643	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,650	1,551	218,420	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	1,815	255,690	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,200	2,170	305,621	2024/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	2,100	2,012	283,364	2026/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	1,250	1,077	151,745	2040/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	1,585	223,282	2030/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,300	1,222	172,066	2025/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,107	296,776	2027/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,550	1,103	155,341	2050/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,081	152,235	2036/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,000	1,987	279,797	2023/06/15

2022年6月15日現在							
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,300	2,226	313,425	2025/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	1,591	224,024	2030/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,100	1,758	247,528	2030/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3000	1,300	1,282	180,634	2023/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,200	1,940	273,270	2027/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,549	218,169	2026/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,500	1,037	146,097	2041/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,900	1,470	207,057	2031/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,065	150,041	2024/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	1,200	705	99,309	2051/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	700	456	64,223	2037/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,580	222,488	2028/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,300	1,705	240,130	2031/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	700	430	60,573	2045/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	975	137,336	2026/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,439	202,656	2024/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	460	274	38,713	2072/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	667	93,967	2028/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,443	203,202	2031/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	948	133,493	2024/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,160	163,438	2024/01/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	963	135,611	2026/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,700	1,270	178,861	2032/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	900	728	102,608	2029/02/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	280	39,455	2024/12/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	600	385	54,333	2052/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	194	27,384	2023/11/29
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.1000	300	269	37,972	2027/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	500	472	66,523	2025/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	800	751	105,851	2029/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	300	258	36,357	2032/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	300	266	37,474	2038/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	3,254	3,588	505,321	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	3,292	463,604	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,058	289,861	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	2,488	350,374	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	2,698	379,920	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	2,245	316,140	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,332	328,464	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,243	315,835	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	2,464	347,013	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,175	306,244	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	2,567	361,472	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	1,957	275,610	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,283	321,583	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,260	318,215	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,318	2,283	321,550	2030/03/01
国小計	銘柄数	85銘柄					
	金額			139,978	131,177	18,469,760	
ユーロ (フィンランド)				千ユーロ	千ユーロ		
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	364	323	45,555	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	272	38,402	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	775	109,173	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	700	693	97,603	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	293	41,298	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	746	105,075	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	670	585	82,474	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	456	64,297	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	448	63,126	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	194	27,373	2024/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	227	32,087	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	271	38,295	2040/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	500	419	59,083	2030/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	209	29,479	2052/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	496	69,922	2031/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	185	26,131	2026/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	250	169	23,817	2043/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	717	100,967	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	407	57,360	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	415	58,565	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	537	75,680	2024/04/15
国小計	銘柄数	21銘柄					
	金額			9,836	8,847	1,245,772	
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	1,357	191,195	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,079	152,045	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	655	92,310	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	159	22,470	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	—	900	892	125,672	2023/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,203	169,484	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	590	478	67,305	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	1,124	158,362	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	980	885	124,723	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,300	1,268	178,542	2024/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	—	980	832	117,217	2030/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	459	64,637	2051/03/20

外国債券インデックスマザーファンド

2022年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	254	35,840	2040/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.8500	350	142	20,051	2120/06/30
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,200	990	139,429	2031/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	480	460	64,829	2025/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	441	62,186	2036/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	300	149	21,003	2071/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	263	37,138	2028/10/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	500	439	61,818	2032/02/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	265	37,436	2049/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,006	141,665	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,373	1,668	234,922	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	981	138,130	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	445	62,666	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	723	820	115,515	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	970	136,605	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	775	109,259	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	940	132,439	2024/10/21
国小計	銘柄数	29銘柄					
	金 額			22,679	21,412	3,014,908	
通貨小計	銘柄数	358銘柄					
	金 額			593,239	571,702	80,495,680	
合 計	銘柄数	893銘柄					
	金 額					230,597,354	

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第22期 (決算日 2021年11月30日)

(作成対象期間 2020年12月1日～2021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

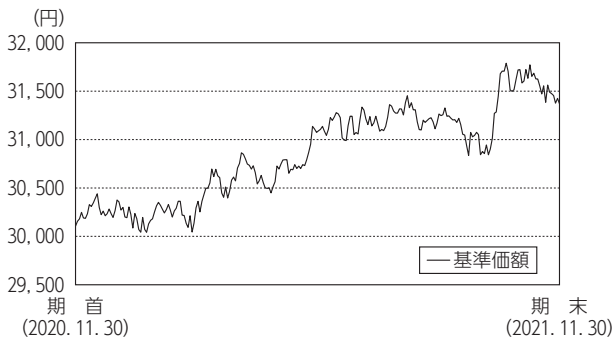
大和アセットマネジメント

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：30,106円 期末：31,370円 騰落率：4.2%

【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、為替市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、当作成期を通して見ると上昇しました。

当作成期首より、米国の財政拡大観測の高まりなどから各国の金利は上昇しました。また、米国で今後の金融緩和策の後退が市場で意識されたことも、さらなる金利上昇要因となりました。その後はレンジ内で推移しましたが、2021年6月には、米国で将来の利上げ後の経済回復ペースや物価上昇圧力の鈍化が意識されたことで、長期ゾーンを中心に金利は低下しました。しかし9月には、FRB(米連邦準備制度理事会)の利上げ見通しが市場予想を上回ったことなどから、金利は上昇に転じました。10月に入っても、物資の供給制約の長期化を背景にインフレへの懸念が高まったことが、主要国の金利上昇圧力となりました。

○為替相場

為替相場は、当作成期を通して見ると円安が進みました。

対円為替相場は、当作成期首より、米国において民主党が大統領府および議会上下両院を制したことから、株価が上昇するなど市場のリスク選好姿勢が強まり、円安となりました。2021年3月には、米国での追加経済対策の成立や経済指標の改善により米国金利が上昇したことなどを背景に米ドルが買い進められ、全般的に円安が進行了しました。7月以降は、新型コロナウイルスの新規感染者数の増加を受けた景気への懸念などを受け、円高が進みました。9月以降は、日本以外の各国で利上げ観測が高まり、金融政策の方向性の違いを要因として、円安となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は4.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.2%となりました。

当作成期のファンドのベンチマークに対するトラッキング・エラー(両者の月次収益率の差の標準偏差を年率換算したもの)は0.1%程度でした。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 %	ベンチマーク	騰落率 %		
(期首)2020年11月30日	30,106	—	30,435	—	98.5	—
12月末	30,356	0.8	30,690	0.8	98.5	—
2021年1月末	30,316	0.7	30,621	0.6	98.2	—
2月末	30,045	△0.2	30,493	0.2	98.5	—
3月末	30,706	2.0	30,924	1.6	98.4	—
4月末	30,696	2.0	31,035	2.0	98.5	—
5月末	31,109	3.3	31,499	3.5	98.8	—
6月末	31,058	3.2	31,389	3.1	98.6	—
7月末	31,273	3.9	31,662	4.0	98.7	—
8月末	31,264	3.8	31,613	3.9	98.3	—
9月末	31,051	3.1	31,407	3.2	98.4	—
10月末	31,722	5.4	31,985	5.1	98.4	—
(期末)2021年11月30日	31,370	4.2	31,642	4.0	98.6	—

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) FTSE 世界国債インデックス (除く日本、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)	3 (3)
(その他)	(0)
合 計	3

(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

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

		買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	千アメリカ・ドル 290,158	千アメリカ・ドル 194,720 (—)
	カナダ	千カナダ・ドル 12,555	千カナダ・ドル 12,968 (—)
	オーストラリア	千オーストラリア・ドル 3,221	千オーストラリア・ドル 25,367 (—)
	シンガポール	千シンガポール・ドル 1,966	千シンガポール・ドル 1,383 (—)
	イギリス	千イギリス・ポンド 7,995	千イギリス・ポンド 14,829 (—)
	イスラエル	千イスラエル・シケル 4,974	千イスラエル・シケル 3,106 (—)
	デンマーク	千デンマーク・クローネ 2,013	千デンマーク・クローネ 7,808 (—)
	ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 5,487	千ノルウェー・クローネ — (—)
	スウェーデン	千スウェーデン・クローネ 5,442	千スウェーデン・クローネ 8,760 (—)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 44,370	千メキシコ・ペソ 68,282 (—)
	中国	千オフショア・人民元 26,878	千オフショア・人民元 — (—)

		買 付 額	売 付 額
外 国	マレーシア	千マレーシア・リンギット 4,471	千マレーシア・リンギット 4,895 (—)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 5,211	千ポーランド・ズロチ 9,327 (—)
	ユーロ (アイルランド)	千ユーロ 2,269	千ユーロ 1,287 (—)
	ユーロ (オランダ)	千ユーロ 4,757	千ユーロ 3,976 (—)
	ユーロ (ベルギー)	千ユーロ 3,234	千ユーロ 5,045 (—)
	ユーロ (フランス)	千ユーロ 25,245	千ユーロ 21,124 (—)
	ユーロ (ドイツ)	千ユーロ 19,386	千ユーロ 15,981 (—)
	ユーロ (スペイン)	千ユーロ 13,911	千ユーロ 10,877 (—)
	ユーロ (イタリア)	千ユーロ 24,037	千ユーロ 22,394 (—)
	ユーロ (フィンランド)	千ユーロ 2,007	千ユーロ 1,677 (—)
	ユーロ (オーストリア)	千ユーロ 3,575	千ユーロ 2,505 (—)
	ユーロ (ユーロ通貨計)	千ユーロ 98,425	千ユーロ 84,871 (—)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄
公 社 債

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄		銘 柄	
	千円		千円
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.125% 2031/2/15	1,124,989	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2023/4/15	1,037,740
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.25% 2031/8/15	1,032,228	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.125% 2022/6/30	604,766
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.875% 2030/11/15	1,019,561	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 3.125% 2028/11/15	575,884
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.625% 2031/5/15	974,457	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2022/5/25	529,651
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 0.375% 2024/9/15	848,795	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 3% 2022/4/25	502,618
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.25% 2023/11/15	842,947	FRENCH GOVERNMENT BOND (フランス) 2.25% 2022/10/25	487,862
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 1.25% 2028/9/30	785,770	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2022/7/31	474,174
UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND (アメリカ) 2% 2051/8/15	781,896	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2.25% 2027/2/15	457,380
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.25% 2028/3/31	760,295	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 1.75% 2022/7/15	446,593
United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 0.75% 2028/1/31	751,258	United States Treasury Note/Bond (アメリカ) 2% 2021/12/31	426,726

(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 B B 格 以 下 組 入 比 率	残存期間別組入比率			
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
アメリカ	千アメリカ・ドル 922,829	千アメリカ・ドル 955,962	千円 108,759,849	46.6%	—%	21.2%	16.7%	8.6%	
カナダ	千カナダ・ドル 48,671	千カナダ・ドル 50,556	4,512,686	1.9	—	0.9	0.6	0.4	
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 46,852	千オーストラリア・ドル 49,050	3,987,292	1.7	—	1.2	0.4	0.1	
シンガポール	千シンガポール・ドル 10,980	千シンガポール・ドル 11,571	962,856	0.4	—	0.3	0.1	0.0	
イギリス	千イギリス・ポンド 73,322	千イギリス・ポンド 93,472	14,166,718	6.1	—	4.8	0.8	0.5	
イスラエル	千イスラエル・シケル 27,300	千イスラエル・シケル 30,584	1,101,379	0.5	—	0.2	0.2	0.1	
デンマーク	千デンマーク・クローネ 50,511	千デンマーク・クローネ 63,327	1,093,665	0.5	—	0.3	0.1	0.1	
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 42,134	千ノルウェー・クローネ 42,491	535,815	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 52,123	653,106	0.3	—	0.2	0.1	0.0	
メキシコ	千メキシコ・ペソ 282,935	千メキシコ・ペソ 286,643	1,505,707	0.6	—	0.4	0.2	0.0	
中国	千オフショア・人民元 26,800	千オフショア・人民元 27,057	482,437	0.2	—	0.1	0.0	0.1	
マレーシア	千マレーシア・リンギット 38,656	千マレーシア・リンギット 39,646	1,064,579	0.5	—	0.3	0.1	0.0	
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 41,500	千ポーランド・ズロチ 40,366	1,108,694	0.5	—	0.2	0.2	0.1	
ユ	アイルランド	千ユーロ 12,877	千ユーロ 14,293	1,835,439	0.8	—	0.6	0.2	0.0
	オランダ	千ユーロ 28,587	千ユーロ 33,774	4,337,032	1.9	—	1.3	0.4	0.2
	ベルギー	千ユーロ 33,676	千ユーロ 40,353	5,181,793	2.2	—	1.7	0.4	0.1
	フランス	千ユーロ 152,793	千ユーロ 178,981	22,982,963	9.8	—	6.4	2.6	0.9
イ	ドイツ	千ユーロ 110,312	千ユーロ 130,913	16,810,567	7.2	—	4.6	1.7	0.8
	スペイン	千ユーロ 90,321	千ユーロ 105,873	13,595,192	5.8	—	3.7	1.6	0.6
ロ	イタリア	千ユーロ 142,231	千ユーロ 162,937	20,922,845	9.0	—	5.5	2.4	1.0
	フィンランド	千ユーロ 10,032	千ユーロ 10,846	1,392,797	0.6	—	0.4	0.2	0.1
	オーストリア	千ユーロ 22,501	千ユーロ 26,075	3,348,351	1.4	—	0.9	0.3	0.2
	小計	603,330	704,049	90,406,985	38.7	—	25.0	9.7	4.0
合 計	—	—	230,341,773	98.6	—	55.2	29.3	14.1	

(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手しています。

(2)外国(外貨建) 公社債(銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期			末		償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	千アメリカ・ドル 6,668	千アメリカ・ドル 6,758	千円 768,958	2022/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	4,350	4,441	505,277	2023/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	4,685	4,781	543,939	2023/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,568	4,729	538,129	2023/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,021	5,241	596,339	2023/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	5,229	5,478	623,274	2024/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,912	5,131	583,829	2024/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	654	718	81,796	2023/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	855	1,029	117,099	2026/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	906	103,134	2027/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.5000	700	884	100,662	2028/08/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	928	105,595	2028/11/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	989	112,537	2030/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	3,203	364,425	2031/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,627	185,146	2036/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	1,239	141,043	2037/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	758	86,344	2038/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	729	82,969	2038/05/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	1,319	150,159	2039/02/15		
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,540	175,242	2039/05/15		

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期 末				償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価		額	
					外 貨 建 金 額	額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,500	170,708	2039/08/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,688	192,123	2039/11/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,453	165,314	2040/02/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	2,352	267,640	2040/05/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,440	163,890	2040/08/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	2,030	230,976	2040/11/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,843	209,692	2041/02/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,924	218,955	2041/05/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,981	225,430	2041/08/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,450	1,742	198,294	2041/11/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,623	1,954	222,414	2042/02/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	1,353	1,601	182,226	2042/05/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,231	2,541	289,137	2042/08/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	1,630	1,858	211,420	2042/11/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	2,626	3,168	360,471	2043/02/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,298	2,672	304,090	2043/05/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,214	4,178	475,379	2043/08/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	2,081	2,758	313,793	2043/11/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.6250	3,307	4,315	490,989	2044/02/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	3,327	4,198	477,633	2044/05/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,162	6,430	731,637	2024/08/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	1,929	2,348	267,142	2044/08/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,921	6,169	701,917	2024/11/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,746	3,284	373,723	2044/11/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,946	676,504	2025/02/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,563	2,829	321,958	2045/02/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	5,788	6,019	684,886	2025/05/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,835	3,405	387,497	2045/05/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,743	5,950	677,013	2025/08/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,873	2,209	251,396	2045/08/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,840	6,112	695,425	2025/11/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	659	795	90,461	2045/11/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,558	2,597	295,511	2022/10/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	6,287	6,399	728,039	2022/11/30	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,992	5,094	579,559	2022/12/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,866	4,970	565,540	2026/02/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,561	2,605	296,428	2023/01/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	3,148	3,496	397,766	2046/02/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	2,962	3,006	342,105	2023/02/28	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,623	3,680	418,738	2023/03/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	7,729	7,896	898,356	2026/05/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,070	2,107	239,818	2023/04/30	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,823	3,136	356,877	2046/05/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,547	289,789	2023/05/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	3,000	3,047	346,709	2023/06/30	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,400	5,485	624,052	2026/08/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,780	2,955	336,244	2046/08/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	2,780	2,819	320,774	2023/07/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,400	2,439	277,547	2023/08/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,505	2,547	289,824	2023/09/30	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,508	626,672	2026/11/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,554	290,633	2023/10/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,500	1,785	203,157	2046/11/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,490	2,570	292,437	2023/11/30	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,588	294,468	2023/12/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,640	3,831	435,876	2027/02/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,480	2,569	292,332	2024/01/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,845	3,466	394,350	2047/02/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,300	2,379	270,675	2024/02/29	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	4,550	4,706	535,507	2024/03/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,400	6,778	771,189	2027/05/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,000	2,445	278,183	2047/05/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	3,000	3,097	352,388	2024/04/30	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,300	5,473	622,692	2024/05/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,400	2,479	282,124	2024/06/30	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,900	6,212	706,745	2027/08/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,110	353,907	2024/07/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,950	3,458	393,435	2047/08/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,000	2,060	234,461	2024/08/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	2,500	2,594	295,210	2024/09/30	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	2,500	2,541	289,123	2022/10/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	5,500	5,797	659,612	2027/11/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,500	4,104	467,007	2047/11/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,646	414,883	2024/10/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,200	3,324	378,196	2024/11/30	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,800	2,919	332,142	2024/12/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,500	3,586	408,038	2023/01/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	6,350	6,879	782,712	2028/02/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,300	3,396	386,452	2023/02/28	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,600	2,734	311,053	2025/01/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,700	2,862	325,655	2025/02/28	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,800	4,672	531,588	2048/02/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,900	2,984	339,534	2023/03/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,900	3,064	348,594	2025/03/31	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	4,200	5,290	601,917	2048/05/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,500	7,101	807,909	2028/05/15	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,585	294,123	2023/04/30	
United States	Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	1,900	2,024	230,330	2025/04/30	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	末 評 価 額			償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	額		
						千 ア メ リ カ ・ ド ル	千 円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,550	3,784	430,576	2025/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	2,500	2,589	294,621	2023/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,588	294,533	2023/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,000	3,187	362,693	2025/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,850	4,000	455,171	2023/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	6,700	7,335	834,612	2028/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,220	5,202	591,845	2048/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,500	2,670	303,845	2025/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,745	426,081	2023/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.7500	3,600	3,829	435,710	2025/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,685	305,577	2025/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,132	356,361	2023/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	2,500	2,688	305,845	2025/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,000	4,182	475,822	2023/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.1250	3,700	4,121	468,928	2028/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.3750	4,520	5,962	678,391	2048/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	3,000	3,214	365,761	2025/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	2,000	2,094	238,250	2023/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	3,500	3,718	423,018	2025/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,607	296,700	2023/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	6,600	7,141	812,476	2029/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	4,000	4,166	474,011	2024/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.6250	2,500	2,656	302,244	2026/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	4,700	5,824	662,671	2049/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.5000	2,500	2,644	300,890	2026/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,300	3,431	390,353	2024/02/29	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	2,500	2,620	298,176	2026/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.8750	4,650	5,646	642,354	2049/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	3,900	4,155	472,783	2029/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,500	3,634	413,453	2024/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	2,800	2,951	335,777	2026/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.1250	3,000	3,132	356,399	2026/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	3,500	3,593	408,846	2024/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,800	2,892	329,055	2026/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,500	5,650	642,867	2024/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	2,500	2,583	293,910	2026/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	4,700	4,767	542,381	2029/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	4,600	4,961	564,429	2049/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,800	2,828	321,827	2026/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	4,053	461,173	2024/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,500	2,555	290,710	2026/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.0000	3,000	3,060	348,228	2024/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	1,000	1,020	116,085	2024/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,066	348,829	2026/10/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	5,850	5,988	681,334	2029/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	4,500	4,988	567,559	2049/11/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	2,000	2,045	232,675	2026/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,000	3,061	348,269	2024/11/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	3,000	3,043	346,282	2022/12/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,571	292,590	2026/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.7500	2,500	2,569	292,377	2024/12/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	4,000	4,056	461,546	2023/01/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	1,700	1,726	196,474	2025/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	2,250	2,280	259,481	2023/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	5,000	5,016	570,755	2030/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.5000	3,200	3,250	369,808	2027/01/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.0000	5,400	5,533	629,520	2050/02/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	300	298	33,978	2027/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,200	5,241	596,271	2025/02/28	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,200	4,209	478,971	2023/03/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	1,500	1,479	168,340	2025/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,200	3,197	363,750	2023/04/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	1,600	1,551	176,512	2027/03/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	7,800	7,272	827,435	2030/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,488	396,900	2023/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	2,700	2,649	301,440	2025/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	2,400	2,306	262,445	2027/04/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,600	4,799	546,068	2050/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,370	497,254	2040/05/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,360	382,267	2027/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,000	2,926	332,910	2025/05/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,500	5,489	624,583	2023/06/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	7,500	7,308	831,439	2025/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,357	382,016	2027/06/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	995	113,285	2023/07/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,400	3,308	376,435	2025/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,500	5,472	622,625	2023/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	10,000	9,301	1,058,186	2030/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,760	541,647	2027/07/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	6,700	5,920	673,585	2050/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	6,000	5,227	594,732	2040/08/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,500	3,347	380,897	2027/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,988	226,277	2023/09/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	6,500	6,312	718,125	2025/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	4,000	3,794	431,720	2027/09/30	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	3,500	3,400	386,870	2025/08/31	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,200	4,173	474,809	2023/10/15	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	7,700	7,663	871,885	2023/11/15	

外国債券インデックスマザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	期 末			償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額		
			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	9,800	9,301	1,058,273	2030/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,500	3,498	397,975	2022/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	4,000	3,877	441,140	2025/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	4,000	3,815	434,064	2027/10/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	6,800	6,389	726,908	2050/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.3750	5,100	4,635	527,368	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,997	341,026	2022/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,100	4,960	564,381	2025/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,799	546,004	2027/11/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,975	338,494	2023/12/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.6250	5,000	4,793	545,339	2027/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	1,000	971	110,565	2025/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,700	1,697	193,173	2022/12/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	4,000	3,963	450,884	2024/01/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	7,000	6,755	768,516	2028/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	5,900	5,879	668,933	2051/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	10,700	10,369	1,179,723	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	5,000	4,950	563,269	2024/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,997	227,228	2023/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	5,000	4,852	552,091	2026/01/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.1250	5,000	4,936	561,602	2028/02/29
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.8750	4,700	4,648	528,869	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.5000	3,000	2,924	332,695	2026/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	2,000	1,996	227,121	2023/02/28
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,983	225,662	2024/03/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,000	2,992	340,466	2023/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	7,000	6,956	791,412	2028/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,937	447,967	2026/03/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.3750	3,000	2,980	339,053	2024/04/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.6250	8,700	8,800	1,001,280	2031/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	5,100	5,046	574,175	2024/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	4,500	4,426	503,625	2026/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	3,400	3,390	385,684	2023/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	6,000	5,956	677,711	2028/04/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.3750	6,100	6,787	772,231	2051/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	2.2500	3,800	3,990	453,972	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,000	996	113,369	2023/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	4,000	3,968	451,484	2028/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.7500	3,000	2,949	335,589	2026/05/31
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.2500	2,000	1,977	224,987	2024/06/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.1250	1,500	1,494	170,008	2023/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	1.2500	5,000	4,955	563,827	2028/06/30
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	0.8750	5,000	4,939	562,001	2026/06/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	5,500	5,450	620,134	2024/07/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	3,000	2,971	338,040	2024/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	9,300	9,076	1,032,635	2031/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	2.0000	6,900	7,083	805,862	2051/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.7500	3,000	2,901	330,135	2041/08/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.1250	2,500	2,488	283,102	2023/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	6,000	5,855	666,162	2026/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.0000	5,000	4,871	554,270	2028/07/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.1250	3,000	2,984	339,548	2023/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.1250	5,000	4,908	558,405	2028/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.7500	5,000	4,904	557,979	2026/08/31
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.3750	7,500	7,421	844,375	2024/09/15
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	1.2500	7,000	6,926	788,051	2028/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.8750	3,500	3,451	392,640	2026/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,494	170,061	2023/09/30
	UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	0.6250	2,000	1,991	226,570	2024/10/15
通貨小計	銘柄数	255銘柄					
	金額			922,829	955,962	108,759,849	
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	405	487	43,542	2064/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,280	114,286	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,581	141,163	2033/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,444	128,961	2037/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	913	1,226	109,472	2041/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	961	1,251	111,737	2045/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,253	1,265	112,953	2023/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,405	1,454	129,802	2024/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,566	139,843	2048/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,196	106,802	2025/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	974	87,022	2026/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,211	108,142	2027/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	650	671	59,960	2028/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,300	4,352	388,485	2023/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,300	1,324	118,226	2023/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,710	3,760	335,701	2051/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,287	114,949	2029/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,200	1,232	110,024	2024/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,400	1,414	126,263	2024/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	3,377	301,477	2030/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	700	701	62,587	2025/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,806	250,511	2025/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	700	697	62,243	2022/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,000	1,820	162,510	2030/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,100	2,004	178,924	2026/03/01

区分	銘柄	種類	年率	期末			償還年月日
				額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,177	105,147	2024/04/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,500	1,491	133,114	2023/02/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,100	1,091	97,400	2023/05/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	300	294	26,272	2026/09/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,400	2,374	211,983	2031/06/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	100	98	8,832	2023/08/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,000	988	88,262	2024/10/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	700	663	59,225	2053/12/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	991	88,498	2023/11/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	200	197	17,649	2027/03/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	500	497	44,372	2024/02/01
	CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	300	295	26,331	2031/12/01
通貨小計	銘柄数	37銘柄					
	金額			48,671	50,556	4,512,686	
オーストラリア	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,168	1,251	101,734	2023/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,989	2,336	189,943	2027/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,973	2,071	168,357	2024/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,754	1,959	159,294	2029/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,798	1,928	156,732	2025/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	1,258	1,609	130,867	2033/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,748	3,098	251,855	2026/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,361	110,639	2037/04/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,307	1,433	116,498	2035/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	914	74,318	2039/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,672	1,795	145,980	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,178	1,232	100,194	2028/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	1,400	113,847	2047/03/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,800	1,943	158,008	2028/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,350	1,377	111,954	2022/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,900	2,060	167,482	2029/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,870	3,061	248,900	2030/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,390	1,491	121,264	2041/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	2,784	226,364	2031/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,300	1,236	100,484	2032/05/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,353	191,356	2024/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,200	3,011	244,772	2030/12/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,400	1,217	98,938	2051/06/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,540	125,213	2025/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	2,330	189,476	2031/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,153	93,771	2026/09/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,100	1,095	89,038	2032/11/21
通貨小計	銘柄数	27銘柄					
	金額			46,852	49,050	3,987,292	
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	850	70,758	2027/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	923	973	81,010	2024/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	809	882	73,442	2030/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	448	37,348	2042/04/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	671	692	57,621	2023/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	655	54,518	2033/09/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	678	56,478	2029/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	546	45,433	2025/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	775	64,519	2046/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	465	38,755	2026/06/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	750	779	64,825	2036/08/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.7500	450	456	37,946	2023/02/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	585	48,740	2028/05/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.0000	490	502	41,814	2024/02/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	370	30,827	2039/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	710	685	57,011	2050/03/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	750	729	60,710	2025/11/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	300	297	24,753	2031/07/01
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	200	196	16,342	2051/10/01
通貨小計	銘柄数	19銘柄					
	金額			10,980	11,571	962,856	
イギリス	United Kingdom Gilt	国債証券	2.0000	921	971	147,252	2025/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.5000	1,682	2,767	419,439	2065/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,465	1,528	231,649	2026/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.5000	1,940	2,161	327,604	2047/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	2,350	2,596	393,488	2037/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,810	2,303	349,090	2057/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,410	1,461	221,510	2027/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.7500	3,000	3,017	457,376	2023/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	1,500	1,599	242,424	2028/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	940	1,325	200,886	2071/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.0000	1,800	1,824	276,553	2024/04/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.7500	1,210	1,435	217,549	2049/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.6250	850	1,018	154,341	2054/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	800	809	122,721	2029/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,900	1,910	289,593	2025/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	1,190	1,232	186,728	2041/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	2,300	2,294	347,765	2023/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	2,300	2,219	336,418	2030/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.5000	750	679	102,953	2061/10/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,500	1,474	223,457	2026/01/30

外国債券インデックスマザーファンド

区分	銘柄	種類	年 利率	期 間	末			償還年月日
					評 価 額		額 面 金 額	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
			%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円		
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,600	1,551	235,085	2028/01/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,100	1,014	153,753	2050/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.6250	1,300	1,234	187,068	2035/07/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.1250	1,300	1,289	195,504	2024/01/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.2500	1,300	1,227	186,102	2031/07/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.8750	500	483	73,323	2046/01/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	0.3750	100	98	14,962	2026/10/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	1.2500	300	322	48,837	2051/07/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.2500	100	99	15,011	2025/01/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.1250	600	606	91,845	2039/01/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.5000	100	98	14,918	2029/01/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	0.8750	300	298	45,312	2033/07/31	
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	1.5000	300	348	52,812	2053/07/31	
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,296	196,550	2028/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,240	3,000	454,762	2032/06/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,685	255,494	2025/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,662	2,386	361,660	2036/03/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,357	2,155	326,716	2038/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,908	3,794	575,079	2055/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,366	2,341	354,915	2046/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,494	226,560	2027/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,416	4,009	607,628	2042/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,600	2,155	326,678	2030/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	2,427	367,948	2049/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	2,207	334,626	2039/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,560	2,224	337,187	2034/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,174	2,403	364,198	2060/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	2,454	372,045	2040/12/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	2,714	411,397	2052/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	2,166	3,124	473,503	2044/01/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.2500	1,582	2,632	247,411	2023/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,386	2,889	437,971	2068/07/22	
	United Kingdom Gilt	国債証券	2.7500	1,092	1,160	175,847	2024/09/07	
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,724	2,607	395,192	2045/01/22	
通貨小計	銘柄数 金額	54銘柄		73,322	93,472	14,166,718		
イスラエル				千イスラエル・シェケル	千イスラエル・シェケル			
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	2,000	2,567	92,447	2026/10/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	4.2500	1,800	1,901	68,481	2023/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	5.5000	1,900	3,080	110,934	2042/01/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,000	2,168	78,085	2024/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.7500	2,300	2,422	87,223	2025/08/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.0000	1,800	1,941	69,928	2027/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.2500	1,000	1,012	36,478	2022/11/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	3.7500	2,400	3,166	114,016	2047/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	2.2500	1,800	1,987	71,563	2028/09/28	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,500	1,541	55,502	2023/11/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.0000	2,400	2,413	86,922	2030/03/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.5000	1,600	1,611	58,044	2025/04/30	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	1.5000	1,700	1,660	59,799	2037/05/31	
	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	0.1500	2,000	2,002	72,120	2023/07/31	
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.5000	200	200	7,234	2026/02/27	
	ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	国債証券	0.4000	900	905	32,594	2024/10/31	
通貨小計	銘柄数 金額	16銘柄		27,300	30,584	1,101,379		
デンマーク				千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ			
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	13,662	24,709	426,740	2039/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,846	5,053	87,265	2023/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	6,013	6,555	113,207	2025/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	7,900	8,302	143,377	2027/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	9,590	10,134	175,029	2029/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,300	4,338	74,924	2022/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,700	2,714	46,877	2052/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	502	8,681	2031/11/15	
	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,016	17,561	2024/11/15	
通貨小計	銘柄数 金額	9銘柄		50,511	63,327	1,093,665		
ノルウェー				千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ			
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	8,204	8,311	104,811	2023/05/24	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	4,095	4,254	53,647	2024/03/14	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	5,395	5,457	68,817	2025/03/13	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	4,340	4,347	54,826	2026/02/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,450	4,505	56,810	2027/02/17	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,400	3,600	45,401	2028/04/26	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	3,850	3,898	49,162	2029/09/06	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	4,800	4,721	59,540	2030/08/19	
	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,500	3,393	42,797	2031/09/17	
通貨小計	銘柄数 金額	9銘柄		42,134	42,491	535,815		
スウェーデン				千スウェーデン・クローネ	千スウェーデン・クローネ			
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	4,655	7,006	87,785	2039/03/30	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	8,025	8,305	104,072	2023/11/13	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	7,595	8,291	103,894	2025/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	7,180	7,537	94,447	2026/11/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	5,050	5,268	66,008	2028/05/12	
	SWEDISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	3,300	3,991	50,009	2032/06/01	

区分		銘柄	種類	年利	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
		IRISH TREASURY	国債証券	1.7000	千ユーロ 550	千ユーロ 653	千円 83,973	2037/05/15	
		IRISH TREASURY	国債証券	0.9000	800	856	109,992	2028/05/15	
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3000	750	838	107,664	2033/05/15	
		IRISH TREASURY	国債証券	1.3500	750	839	107,858	2031/03/18	
		IRISH TREASURY	国債証券	1.1000	950	1,033	132,648	2029/05/15	
		IRISH TREASURY	国債証券	1.5000	700	824	105,832	2050/05/15	
		IRISH TREASURY	国債証券	0.4000	350	351	45,186	2035/05/15	
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	822	105,623	2027/05/15	
		IRISH TREASURY	国債証券	0.2000	800	811	104,176	2030/10/18	
		IRISH TREASURY	国債証券	—	800	786	100,959	2031/10/18	
		IRISH TREASURY	国債証券	0.5500	400	398	51,181	2041/04/22	
国小計	銘柄数 金額	17銘柄			12,877	14,293	1,835,439		
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5000	千ユーロ 548	千ユーロ 599	千円 77,044	2023/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	1,139	1,562	200,633	2028/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,555	2,507	322,002	2037/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	791	832	106,904	2023/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,729	3,023	388,241	2042/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,168	1,509	193,881	2033/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,385	1,443	185,388	2023/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,929	3,226	414,283	2047/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,514	1,624	208,663	2024/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,791	1,850	237,606	2025/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,938	2,038	261,732	2026/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,200	2,358	302,836	2027/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,422	182,675	2024/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	1,350	1,457	187,112	2028/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,200	1,253	160,990	2029/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	900	980	125,867	2040/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,400	1,431	183,793	2030/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	800	821	105,480	2027/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,050	1,002	128,710	2052/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,322	169,772	2031/07/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	892	114,575	2038/01/15	
		NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	国債証券	—	600	613	78,837	2029/01/15	
国小計	銘柄数 金額	22銘柄			28,587	33,774	4,337,032		
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	千ユーロ 1,699	千ユーロ 1,786	千円 229,408	2025/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,774	1,952	250,677	2031/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	1.9000	1,058	1,311	168,357	2038/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	1.0000	1,863	1,995	256,184	2026/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	1.6000	1,244	1,506	193,426	2047/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	2.1500	640	935	120,071	2066/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	0.2000	940	957	122,930	2023/10/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,100	1,176	151,113	2027/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	0.5000	1,050	1,087	139,634	2024/10/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	580	831	106,772	2057/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	1.4500	600	696	89,412	2037/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	0.8000	1,490	1,603	205,858	2028/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	1.2500	650	737	94,713	2033/04/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	0.9000	1,500	1,630	209,372	2029/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	1.7000	700	870	111,814	2050/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	0.1000	1,220	1,244	159,807	2030/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	0.4000	660	644	82,824	2040/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,200	1,228	157,777	2027/10/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	—	1,600	1,594	204,704	2031/10/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	0.6500	680	596	76,655	2071/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	5.5000	1,706	2,357	302,698	2028/03/28	
		Belgium Government Bond	国債証券	5.0000	1,904	3,103	398,469	2035/03/28	
		Belgium Government Bond	国債証券	4.2500	1,604	2,705	347,415	2041/03/28	
		Belgium Government Bond	国債証券	4.5000	1,001	1,226	157,496	2026/03/28	
		Belgium Government Bond	国債証券	4.0000	780	1,103	141,758	2032/03/28	
		Belgium Government Bond	国債証券	2.2500	1,338	1,401	180,020	2023/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	3.7500	843	1,424	182,883	2045/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	2.6000	1,505	1,634	209,938	2024/06/22	
		Belgium Government Bond	国債証券	3.0000	747	1,009	129,595	2034/06/22	
国小計	銘柄数 金額	29銘柄			33,676	40,353	5,181,793		
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	8.5000	千ユーロ 1,985	千ユーロ 2,243	千円 288,101	2023/04/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	3,025	3,815	489,959	2025/10/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,323	4,758	611,022	2029/04/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	3,227	5,242	673,220	2032/10/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,659	4,263	547,451	2035/04/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,764	3,453	443,514	2055/04/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	2,374	3,808	489,063	2038/10/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	4,997	5,478	703,469	2023/10/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	3,664	6,425	825,044	2041/04/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	1,717	3,534	453,888	2060/04/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	3,646	4,298	551,978	2026/04/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	5,699	6,777	870,339	2027/10/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,588	4,121	529,197	2045/05/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,047	4,198	539,137	2023/05/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	5,086	5,462	701,487	2024/05/25	
		FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	5,087	6,243	801,757	2030/05/25	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	期 末	評 価 額			償 還 年 月 日
					額 面 金 額	外 貨 建 金 額		
						千 ユーロ	千 ユーロ	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	4,899	5,255	674,877	2024/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,492	3,627	465,850	2025/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	5,101	5,421	696,207	2025/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	5,420	6,210	797,553	2031/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	3,787	3,959	508,487	2026/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	4,169	4,724	606,616	2036/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,387	1,838	236,106	2066/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,050	4,196	538,912	2026/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,570	3,182	408,649	2039/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,400	3,668	471,041	2027/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,850	3,790	486,690	2048/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,424	311,339	2023/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,400	4,709	604,712	2028/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,950	4,454	571,986	2034/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	4,950	5,307	681,572	2028/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,400	3,456	443,789	2024/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,950	3,556	456,741	2050/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	4,350	4,586	588,892	2029/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,830	3,909	501,995	2025/03/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,200	4,253	546,219	2029/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,424	311,272	2023/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	2,770	2,769	355,592	2052/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,067	393,859	2026/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,200	2,203	282,976	2040/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	4,000	4,024	516,788	2030/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	880	731	93,876	2072/05/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	13,041	2024/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,000	985	126,557	2044/06/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,700	3,684	473,140	2031/11/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,600	1,634	209,920	2027/02/25	
	FRENCH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	700	693	89,060	2053/05/25	
国 小 計	銘柄数 金 額	47銘柄		152,793	178,981	22,982,963		
ユーロ (ドイツ)				千ユーロ	千ユーロ			
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	974	1,120	143,912	2024/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	1,167	1,646	211,378	2027/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.6250	2,162	3,008	386,344	2028/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	950	1,293	166,104	2028/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.2500	1,951	3,049	391,545	2030/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.5000	3,448	5,369	689,555	2031/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,305	3,819	490,479	2034/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	3,571	5,918	759,935	2037/01/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,325	2,394	307,518	2039/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,739	3,384	434,580	2040/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	2,574	4,431	569,108	2042/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,808	4,525	581,099	2044/07/04	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,410	1,450	186,220	2023/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,817	1,879	241,377	2023/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,599	1,677	215,388	2023/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,561	1,650	211,915	2024/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,679	4,435	569,540	2046/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,594	1,684	216,368	2024/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	4,042	4,239	544,336	2024/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,194	2,283	293,243	2025/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	3,134	3,336	428,490	2025/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,368	2,488	319,591	2026/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,420	2,497	320,721	2026/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	4,200	4,393	564,217	2027/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,300	2,446	314,171	2027/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,770	3,738	480,064	2048/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	2,028	260,437	2028/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	3,100	3,267	419,519	2028/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,200	2,323	298,378	2029/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	3,000	3,112	399,626	2029/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,250	2,261	290,335	2050/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,750	1,815	233,135	2030/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,946	249,971	2035/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,070	265,826	2027/11/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,800	1,867	239,805	2030/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,200	1,251	160,705	2030/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	931	119,606	2031/02/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	917	117,819	2036/05/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,553	199,510	2028/11/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,118	143,566	2050/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,600	2,682	344,469	2031/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	724	93,011	2031/08/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	12,947	2022/12/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,010	129,728	2023/03/10	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,000	1,012	130,042	2023/06/15	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	101	13,028	2023/09/15	

外国債券インデックスマザーファンド

区分	銘柄	種類	当 期 年 率	期 末 額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	700	696	89,486	2052/08/15
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,730	5,795	744,206	2023/04/14
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,900	1,929	247,802	2023/10/13
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,920	1,956	251,216	2024/04/05
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,700	1,738	223,178	2024/10/18
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,400	2,460	315,940	2025/04/11
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,300	2,364	303,639	2025/10/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	103	13,226	2025/10/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,200	2,266	291,047	2026/04/10
	GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,300	1,340	172,141	2026/10/09
国小計	銘柄数 金額	56銘柄		110,312	130,913	16,810,567	
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	3,792	486,939	2029/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,045	2,189	281,145	2025/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,052	2,352	302,131	2030/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,192	2,411	309,661	2025/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,733	3,006	386,053	2026/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	2,715	348,693	2046/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	2,433	312,457	2066/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,630	2,833	363,830	2026/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	2,073	266,317	2027/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,750	2,107	270,600	2033/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	2,237	287,324	2027/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.4500	1,600	1,617	207,752	2022/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,400	2,617	336,154	2028/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,300	1,763	226,478	2048/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	2,400	2,439	313,272	2023/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,900	3,171	407,315	2028/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,760	226,067	2029/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,850	2,126	273,011	2035/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,300	2,346	301,288	2024/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,900	372,398	2029/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,360	1,391	178,706	2030/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,460	2,483	318,892	2023/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,536	325,737	2025/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	1,321	169,692	2050/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,521	323,845	2027/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,900	3,146	404,094	2030/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,300	1,350	173,378	2040/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	506	65,020	2026/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	2,200	2,148	275,908	2031/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	303	38,988	2024/05/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	650	594	76,295	2071/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	500	64,272	2028/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	900	898	115,415	2037/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,400	1,410	181,064	2031/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	600	600	77,080	2042/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	302	38,827	2027/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	2,179	3,393	435,771	2032/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2000	2,254	3,384	434,594	2037/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.9000	2,158	3,666	470,871	2040/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8000	1,682	1,881	241,646	2024/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7000	1,973	3,321	426,539	2041/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.6500	2,789	3,311	425,203	2025/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.9000	1,965	2,537	325,845	2026/07/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.4000	1,958	2,096	269,174	2023/01/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.4000	1,901	2,087	268,044	2023/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,770	2,397	307,867	2028/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	5.1500	1,299	2,399	308,119	2044/10/31
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8000	1,970	2,180	280,009	2024/04/30
	SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	2,097	2,300	295,387	2024/10/31
国小計	銘柄数 金額	49銘柄		90,321	105,873	13,595,192	
ユーロ (イタリア)				千ユーロ	千ユーロ		
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	9.0000	906	1,069	137,360	2023/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2500	1,110	1,495	192,048	2026/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	6.5000	2,392	3,248	417,195	2027/11/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,814	1,957	251,402	2024/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,509	1,968	252,752	2046/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,487	2,621	336,690	2025/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,065	2,198	282,349	2032/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,891	2,040	261,957	2025/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	1,610	1,923	246,936	2047/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,359	1,384	177,746	2023/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,386	2,543	326,595	2026/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	2,324	2,617	336,145	2036/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	1,068	1,123	144,280	2026/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6500	1,550	1,580	203,010	2023/10/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	968	1,112	142,796	2067/03/01

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価		償 還 年 月 日
					額		
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
				千ユーロ	千ユーロ	千円	
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,500	1,719	220,752	2033/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	1,510	1,667	214,095	2027/06/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,300	1,367	175,565	2024/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,850	2,506	321,860	2048/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0500	2,700	2,959	380,035	2027/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,675	215,137	2024/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9500	1,300	1,597	205,142	2038/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	2,100	2,303	295,739	2028/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,933	248,343	2023/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,300	1,367	175,648	2025/05/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,550	2,947	378,471	2028/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	2,200	2,316	297,452	2023/10/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,550	1,702	218,594	2025/11/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3500	1,270	1,595	204,842	2035/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.8500	1,650	2,388	306,644	2049/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,900	2,236	287,224	2029/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,200	2,311	296,830	2024/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1000	2,100	2,289	293,933	2026/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1000	1,250	1,565	201,072	2040/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3500	1,900	1,993	255,994	2030/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0500	740	744	95,648	2023/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3500	1,300	1,318	169,350	2025/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	2,350	2,421	310,949	2027/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4500	1,550	1,764	226,597	2050/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,500	1,533	196,954	2036/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,000	2,034	261,211	2023/06/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,300	2,454	315,172	2025/07/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,000	2,025	260,058	2030/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6500	2,400	2,567	329,695	2030/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.3000	1,300	1,316	169,054	2023/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	2,200	2,273	291,923	2027/09/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,700	1,729	222,080	2026/02/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8000	1,300	1,346	172,924	2041/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	2,300	2,302	295,685	2031/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,107	142,217	2024/01/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7000	1,200	1,167	149,857	2051/09/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	700	661	84,960	2037/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,900	1,874	240,741	2028/03/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,700	2,619	336,357	2031/08/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	700	677	86,947	2045/04/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,093	140,428	2026/04/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,500	1,508	193,680	2024/04/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	100	12,906	2022/11/29
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	460	446	57,300	2072/03/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	800	798	102,573	2028/07/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9500	1,900	1,895	243,369	2031/12/01
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,000	2,008	257,854	2024/08/15
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	502	64,561	2024/01/30
	ITALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	1,100	1,089	139,920	2026/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.2500	3,254	4,421	567,748	2029/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	6.0000	2,849	4,184	537,331	2031/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.7500	1,805	2,707	347,707	2033/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,298	3,331	427,771	2034/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.0000	2,740	3,734	479,488	2037/02/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,044	3,162	406,138	2039/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,251	2,448	314,472	2023/08/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,118	2,470	317,174	2025/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.0000	2,243	3,523	452,392	2040/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,070	2,460	315,934	2026/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	5.5000	1,960	2,068	265,624	2022/11/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	2,410	3,089	396,666	2028/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	1,894	2,029	260,607	2023/05/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.7500	1,813	2,880	369,842	2044/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	4.5000	2,194	2,431	312,186	2024/03/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.7500	2,201	2,439	313,295	2024/09/01
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	3.5000	2,318	2,841	364,826	2030/03/01
国 小 計	銘柄数 金 額	81銘柄		142,231	162,937	20,922,845	
ユーロ (フィンランド)				千ユーロ	千ユーロ		
	Finland Government Bond	国債証券	0.7500	364	393	50,570	2031/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	295	37,917	2025/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	850	109,179	2026/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	700	709	91,084	2023/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	455	58,553	2047/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	843	108,361	2027/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	1.1250	670	757	97,213	2034/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	528	67,823	2028/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	529	67,996	2029/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	—	200	203	26,194	2024/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	307	39,438	2036/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	399	51,266	2040/09/15

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	Finland Government Bond	国債証券	—	500	506	64,988	2030/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	371	47,674	2052/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	610	78,380	2031/09/15
	FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	204	26,301	2026/09/15
	Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	781	100,334	2025/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	470	60,445	2028/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	1.5000	446	460	59,108	2023/04/15
	Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	603	77,514	2042/07/04
	Finland Government Bond	国債証券	2.0000	529	564	72,448	2024/04/15
国 小 計	銘柄数	21銘柄					
	金 額			10,032	10,846	1,392,797	
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	1,471	188,907	2025/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,196	153,672	2026/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	988	126,904	2047/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	325	41,782	2086/11/02
	Austria Government Bond	国債証券	—	900	911	117,017	2023/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,347	172,977	2027/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	894	114,873	2117/09/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	1,283	164,849	2028/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.5000	980	1,033	132,720	2029/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	800	814	104,592	2024/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	—	980	991	127,339	2030/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,000	1,009	129,692	2023/04/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.7500	700	747	96,037	2051/03/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	400	374	48,070	2040/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	0.8500	350	328	42,241	2120/06/30
	Austria Government Bond	国債証券	—	1,200	1,206	154,959	2031/02/20
	Austria Government Bond	国債証券	—	480	489	62,891	2025/04/20
	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	599	76,933	2036/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	6.2500	825	1,144	146,949	2027/07/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.1500	1,373	2,201	282,667	2037/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	4.8500	875	1,082	138,967	2026/03/15
	Austria Government Bond	国債証券	3.4000	872	906	116,455	2022/11/22
	Austria Government Bond	国債証券	3.8000	338	723	92,859	2062/01/26
	Austria Government Bond	国債証券	3.1500	623	1,008	129,455	2044/06/20
	Austria Government Bond	国債証券	1.7500	959	1,005	129,096	2023/10/20
	Austria Government Bond	国債証券	2.4000	771	992	127,477	2034/05/23
	Austria Government Bond	国債証券	1.6500	932	996	127,958	2024/10/21
国 小 計	銘柄数	27銘柄					
	金 額			22,501	26,075	3,348,351	
通貨小計	銘柄数	349銘柄					
	金 額			603,330	704,049	90,406,985	
合 計	銘柄数	846銘柄					
	金 額					230,341,773	

(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

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	230,341,773	98.5
コール・ローン等、その他	3,574,230	1.5
投資信託財産総額	233,916,004	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=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1シンガポール・ドル=83.21円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シェケル=36.01円、1デンマーク・クローネ=17.27円、1ノルウェー・クローネ=12.61円、1スウェーデン・クローネ=12.53円、1メキシコ・ペソ=5.252円、1オフショア・人民元=17.83円、1マレーシア・リンギット=26.851円、1ポーランド・ズロチ=27.465円、1ユーロ=128.41円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産 (232,057,536千円) の投資信託財産総額 (233,916,004千円) に対する比率は、99.2% です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	235,621,577,410円
コール・ローン等	2,308,332,577
公社債(評価額)	230,341,773,353
未収入金	1,708,792,363
未収利息	1,240,818,660
前払費用	21,860,457
(B) 負債	1,989,462,808
未払金	1,964,328,808
未払解約金	25,134,000
(C) 純資産総額(A-B)	233,632,114,602
元本	74,475,307,643
次期繰越損益金	159,156,806,959
(D) 受益権総口数	74,475,307,643口
1万口当り基準価額(C/D)	31,370円

*期首における元本額は72,688,498,430円、当作成期間中における追加設定元本額は10,294,827,028円、同解約元本額は8,508,017,815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	498,388,691円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA(一般投資家私募)	10,756,510円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)	79,498,163円
ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)	22,023,940円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)	312,397,465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)	211,430,078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)	505,972,682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)	2,311,980,333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)	842,742,592円
D-1's 外国債券インデックス	744,003円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	7,190,607円
iFree 外国債券インデックス	1,686,822,876円
iFree 8資産バランス	1,443,360,479円
iFree 年金バランス	229,923,693円
DCダイワ外国債券インデックス	49,590,694,433円
ダイワ・ライフ・バランス30	964,870,268円
ダイワ・ライフ・バランス50	601,682,079円
ダイワ・ライフ・バランス70	393,993,399円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	578,219,728円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	439,097,748円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	160,496,213円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	28,543,954円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	10,558,255円
ダイワつみたてインデックス外国債券	599,439,774円
ダイワつみたてインデックスバランス30	3,367,466円
ダイワつみたてインデックスバランス50	1,453,811円
ダイワつみたてインデックスバランス70	1,909,053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)	317,987円
ダイワ世界バランスファンド40VA	163,610,849円
ダイワ世界バランスファンド60VA	135,308,646円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,912,241,392円
ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)	231,133,046円
ダイワ・インデックスセレクト 外国債券	143,219,876円
ダイワ・ノーロード 外国債券ファンド	43,309,779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)	2,367,106,464円
ダイワ投信倶楽部外国債券インデックス	5,825,688,039円
ダイワライフスタイル25	33,014,942円
ダイワライフスタイル50	65,372,616円
ダイワライフスタイル75	17,425,714円

*当期末の計算口数当りの純資産額は31,370円です。

■損益の状況

当期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	4,032,833,956円
受取利息	4,035,525,127
その他収益金	139,937
支払利息	△ 2,831,108
(B) 有価証券売買損益	5,115,214,393
売買益	14,985,731,779
売買損	△ 9,870,517,386
(C) その他費用	△ 24,346,635
(D) 当期損益金(A+B+C)	9,123,701,714
(E) 前期繰越損益金	146,146,957,181
(F) 解約差損益金	△ 17,570,758,729
(G) 追加信託差損益金	21,456,906,793
(H) 合計(D+E+F+G)	159,156,806,959
次期繰越損益金(H)	159,156,806,959

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

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

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

運用報告書(全体版)

第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2733>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			公社債組入比率	債券先物比率	純資産総額
	(分配)	税込み 分配金	期中 騰落率			
2期末(2018年6月15日)	円 10,746	円 0	% △ 0.0	% 98.1	% —	百万円 1,195
3期末(2019年6月17日)	11,026	0	2.6	98.0	—	1,344
4期末(2020年6月15日)	11,508	0	4.4	97.8	—	1,706
5期末(2021年6月15日)	12,204	0	6.0	98.3	—	1,952
6期末(2022年6月15日)	11,993	0	△ 1.7	98.1	—	2,294

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)を除きます。

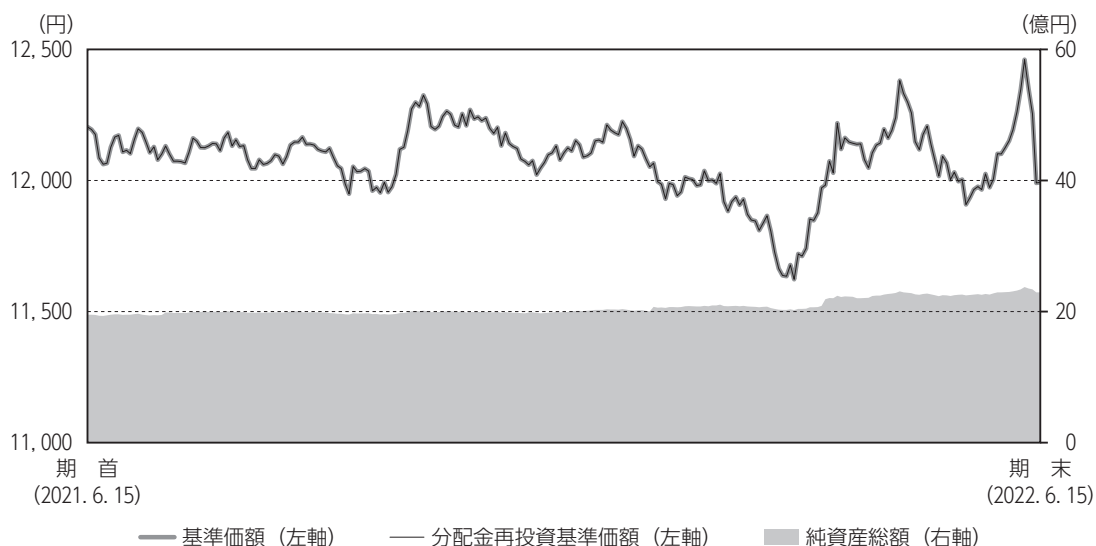
(注4) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

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



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：12,204円

期末：11,993円(分配金0円)

騰落率：△1.7%(分配金込み)

■ 組入ファンドの当作成期中の騰落率と期末の組入比率

組入ファンド	騰落率	比率
外国債券インデックスマザーファンド	△0.9%	79.7%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	△3.2%	20.0%

■ 基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率		
(期首) 2021年 6月15日	12,204	—	98.3	—
6 月末	12,103	△ 0.8	97.9	—
7 月末	12,131	△ 0.6	98.0	—
8 月末	12,135	△ 0.6	97.7	—
9 月末	12,036	△ 1.4	97.8	—
10月末	12,253	0.4	97.8	—
11月末	12,060	△ 1.2	97.8	—
12月末	12,182	△ 0.2	98.1	—
2022年 1 月末	12,007	△ 1.6	98.0	—
2 月末	11,810	△ 3.2	98.3	—
3 月末	12,163	△ 0.3	97.9	—
4 月末	12,176	△ 0.2	97.8	—
5 月末	12,102	△ 0.8	97.6	—
(期末) 2022年 6月15日	11,993	△ 1.7	98.1	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■ 海外債券市場

海外債券市場では、金利は上昇しました。

当作成期首より、主要国の国債金利は、米国などで将来の利上げ後の経済回復ペースや物価上昇圧力の鈍化が意識されたことで、長期ゾーンを中心に低下しましたが、2021年9月にF R B（米国連邦準備制度理事会）の利上げ見通しが市場予想を上回ったことなどから、上昇に転じました。2022年に入ってから、ロシアがウクライナに侵攻したことで原油価格が高騰し、インフレ期待が上昇したことで、金利上昇が加速しました。その後も、インフレ率の上振れなどから各国で金融政策正常化が意識され、主要国の金利は上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに金利は上昇しました。

新興国でも、米国の金利が上昇したことや多くの国で利上げが行われたことなどから、先進国と同様に金利は上昇しました。

■ 為替相場

為替相場は円安となりました。

当作成期首より、米ドル円は比較的狭いレンジでの推移となりましたが、2021年9月以降は米国金利が上がったことにより上昇（円安）しました。その後2022年に入ってから、期待インフレ率の上昇により米国金利がさらに上がったため、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、その他の通貨も対円で上昇しました。6月には、米国の利上げ幅の拡大観測の高まりなどから、さらに円安が進みました。

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

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

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

ベンチマークとの差異について

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

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、収益分配を見送らせていただきました。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	1,992

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



今後の運用方針

■当ファンド

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

■外国債券インデックスマザーファンド

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

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2021. 6. 16~2022. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	52円	0.429%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12,082円です。
(投信会社)	(36)	(0.297)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(13)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	5	0.039	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.026)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(1)	(0.005)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	57	0.468	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

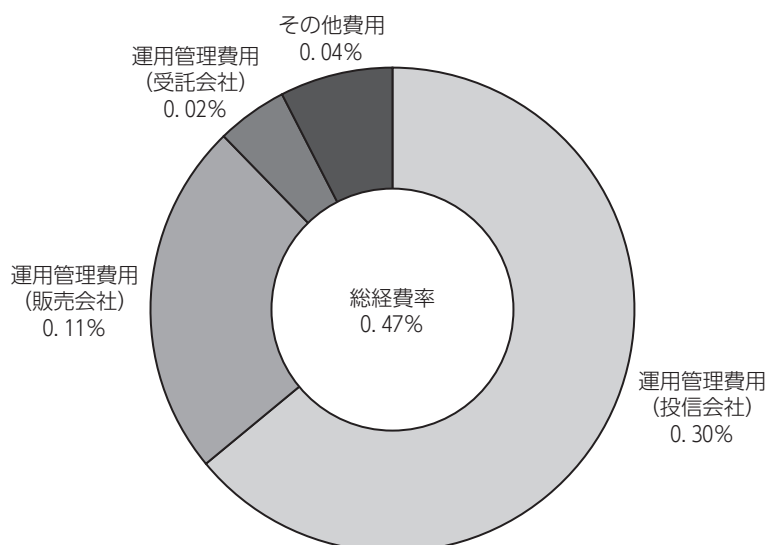
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

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



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ新興国債券 インデックス・ マザーファンド	95,851	135,624	38,393	55,465
外国債券 インデックス マザーファンド	127,742	398,825	35,871	112,094

(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	金 額	評 価 額	口 数	金 額	評 価 額
	千口	千円	千円	千口	千円	千円
ダイワ新興国債券 インデックス・マザーファンド	262,791	458,470	458,470	320,250	458,470	458,470
外国債券インデックス マザーファンド	498,273	1,829,156	1,829,156	590,145	1,829,156	1,829,156

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国債券インデックス・ マザーファンド	458,470	19.9
外国債券インデックス マザーファンド	1,829,156	79.6
コール・ローン等、その他	11,666	0.5
投資信託財産総額	2,299,293	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.01円、1カナダ・ドル=104.20円、1オーストラリア・ドル=93.10円、1シンガポール・ドル=96.95円、1イギリス・ポンド=162.21円、1エジプト・ポンド=7.204円、1イスラエル・シケル=38.942円、1トルコ・リラ=7.825円、1デンマーク・クローネ=18.93円、1ノルウェー・クローネ=13.49円、1スウェーデン・クローネ=13.25円、1メキシコ・ペソ=6.565円、1フィリピン・ペソ=2.535円、1アルゼンチン・ペソ=1.101円、100チリ・ペソ=15.542円、100コロンビア・ペソ=3.401円、100インドネシア・ルピア=0.92円、1ブラジル・レアル=26.374円、1チエコ・コルナ=5.692円、1ルーマニア・レイ=28.483円、1オフショア・人民元=20.014円、1マレーシア・リンギット=30.536円、1南アフリカ・ランド=8.42円、1タイ・バーツ=3.85円、1ペルー・ソル=35.932円、1ポーランド・ズロチ=30.093円、100ハンガリー・フォリント=35.115円、1ウルグアイ・ペソ=3.368円、1ドミニカ・ペソ=2.458円、1ユーロ=140.80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(24,791,417千円)の投資信託財産総額(25,007,878千円)に対する比率は、99.1%です。
外国債券インデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(232,842,571千円)の投資信託財産総額(233,898,338千円)に対する比率は、99.5%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,299,293,448円
コール・ローン等	11,666,767
ダイワ新興国債券インデックス・ マザーファンド(評価額)	458,470,137
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	1,829,156,544
(B) 負債	4,683,299
未払信託報酬	4,595,021
その他未払費用	88,278
(C) 純資産総額(A-B)	2,294,610,149
元本	1,913,328,634
次期繰越損益金	381,281,515
(D) 受益権総口数	1,913,328,634口
1万口当り基準価額(C/D)	11,993円

* 期首における元本額は1,600,235,730円、当作成期間中における追加設定元本額は483,164,155円、同解約元本額は170,071,251円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,993円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,764円
受取利息	90
支払利息	△ 1,854
(B) 有価証券売買損益	△ 24,886,645
売買益	1,830,076
売買損	△ 26,716,721
(C) 信託報酬等	△ 9,024,269
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 33,912,678
(E) 前期繰越損益金	152,810,001
(F) 追加信託差損益金	262,384,192
(配当等相当額)	(114,551,325)
(売買損益相当額)	(147,832,867)
(G) 合計(D+E+F)	381,281,515
次期繰越損益金(G)	381,281,515
追加信託差損益金	262,384,192
(配当等相当額)	(114,551,325)
(売買損益相当額)	(147,832,867)
分配準備積立金	152,811,045
繰越損益金	△ 33,913,722

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

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

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

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	228,473,278
(d) 分配準備積立金	152,811,045
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	381,284,323
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	381,284,323
(h) 受益権総口数	1,913,328,634口

★「外国債券インデックスマザーファンド」の第22期にかかる運用状況については212~226ページをご参照ください。

＜補足情報＞

当ファンド(ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス(為替ヘッジなし))が投資対象としている「外国債券インデックスマザーファンド」の決算日(2021年11月30日)と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日(2022年6月15日)現在における外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。199~211ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国債券インデックス エマージングプラス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド」の決算日（2021年7月5日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 10.5% 2026/12/21	151,198	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2022/7/1	209,806
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2023/7/1	149,929	Mexican Bonos (メキシコ) 6.5% 2022/6/9	176,262
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	140,106	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	132,848
Poland Government Bond (ポーランド) 0.25% 2026/10/25	132,125	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	111,695
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8.75% 2048/2/28	121,388	Poland Government Bond (ポーランド) 5.75% 2022/9/23	105,665
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8% 2030/1/31	109,977	Colombian TES (コロンビア) 7% 2022/5/4	104,290
THAILAND GOVERNMENT BOND (タイ) 1% 2027/6/17	109,478	Malaysia Government Investment Issue (マレーシア) 3.948% 2022/4/14	94,312
Mexican Bonos (メキシコ) 7.75% 2031/5/29	108,788	Poland Government Bond (ポーランド) 2.25% 2022/4/25	93,023
Mexican Bonos (メキシコ) 8% 2024/9/5	108,238	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 7% 2022/5/15	90,178
RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ (ロシア) 6.9% 2031/7/23	106,642	Mexican Bonos (メキシコ) 8.5% 2029/5/31	76,819

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

下記は、2022年6月15日現在におけるダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド（17,421,108千口）の内容です。

(1)外国（外貨建）公社債（通貨別）

区 分	額 面 金 額	2022年6月15日現在						
		評 価 額		組入比率	うちB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
エジプト	千エジプト・ポンド 52,500	千エジプト・ポンド 50,439	千円 363,373	1.5%	1.5%	0.5%	1.0%	—%
トルコ	千トルコ・リラ 37,720	千トルコ・リラ 30,070	235,307	0.9	0.9	0.3	0.4	0.3
メキシコ	千メキシコ・ペソ 387,850	千メキシコ・ペソ 360,645	2,367,817	9.5	—	4.2	4.1	1.2
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 9,982	25,310	0.1	—	0.1	—	—
チリ	千チリ・ペソ 3,815,000	千チリ・ペソ 3,432,312	533,460	2.1	—	1.2	0.8	0.2
コロンビア	千コロンビア・ペソ 39,925,000	千コロンビア・ペソ 31,618,206	1,075,588	4.3	—	2.9	1.4	0.0
インドネシア	千インドネシア・ルピア 272,429,000	千インドネシア・ルピア 275,798,470	2,537,345	10.2	—	6.4	2.5	1.2
ブラジル	千ブラジル・レアル 103,950	千ブラジル・レアル 89,775	2,367,787	9.5	—	1.2	3.0	5.3
チェコ	千チェコ・コルナ 240,800	千チェコ・コルナ 193,230	1,099,967	4.4	—	2.3	1.6	0.5
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 27,570	千ルーマニア・レイ 23,594	672,069	2.7	—	1.1	0.9	0.8
中国	千オフショア・人民元 125,550	千オフショア・人民元 128,071	2,563,282	10.3	—	4.9	3.6	1.8
ロシア	千ロシア・ルーブル 1,194,420	—	—	—	—	—	—	—
マレーシア	千マレーシア・リンギット 85,930	千マレーシア・リンギット 83,314	2,544,176	10.2	—	5.5	3.4	1.3
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 336,590	千南アフリカ・ランド 284,720	2,397,347	9.6	—	7.6	1.7	0.3
タイ	千タイ・バーツ 665,360	千タイ・バーツ 639,648	2,462,645	9.9	—	5.9	2.9	1.1
ペルー	千ペルー・ソル 18,100	千ペルー・ソル 16,235	583,372	2.3	—	2.0	0.3	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 68,960	千ポーランド・ズロチ 55,654	1,674,840	6.7	—	2.2	2.9	1.6
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 2,663,800	千ハンガリー・フォリント 2,003,969	703,695	2.8	—	1.3	1.1	0.4
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 9,800	千ウルグアイ・ペソ 8,526	28,723	0.1	—	0.1	—	—
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 10,851	26,672	0.1	0.1	—	0.1	—
合 計	—	—	24,262,786	97.3	2.5	49.6	31.8	15.8

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の中値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。
(注4) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入力しています。

(2)外国(外貨建)公社債(銘柄別)

2022年6月15日現在								
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
エジプト	ARAB REP EGYPT	国債証券	16.1000	千エジプト・ポンド 1,500	千エジプト・ポンド 1,512	千円 10,896	2029/05/07	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3500	1,000	979	7,059	2024/09/10	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4000	4,000	3,818	27,506	2029/09/10	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	13.5360	1,500	1,439	10,369	2025/01/14	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.6640	4,500	4,257	30,670	2030/10/06	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5560	2,000	1,900	13,693	2027/10/13	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.3690	9,000	8,680	62,533	2025/10/20	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.2920	6,000	5,658	40,763	2028/01/05	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.0600	10,000	9,544	68,758	2026/01/12	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.4830	9,000	8,732	62,908	2026/04/06	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5630	1,000	967	6,966	2026/07/06	
	ARAB REP EGYPT	国債証券	14.5310	3,000	2,949	21,245	2024/09/14	
	通貨小計	銘柄数	12銘柄					
	金額			52,500	50,439	363,373		
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	千トルコ・リラ 2,780	千トルコ・リラ 2,500	19,569	2023/03/08	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	553	4,327	2024/03/20	
	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	1,630	1,257	9,840	2024/07/24	
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	2,690	1,930	15,103	2025/03/12	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	2,570	1,915	14,990	2026/02/11	
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,168	16,966	2027/02/24	
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	2,500	1,825	14,286	2027/08/11	
	Turkey Government Bond	国債証券	12.2000	2,600	2,467	19,305	2023/01/18	
	Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	2,000	1,650	12,911	2028/03/08	
	Turkey Government Bond	国債証券	16.2000	2,800	2,626	20,556	2023/06/14	
	Turkey Government Bond	国債証券	12.6000	6,100	4,943	38,687	2025/10/01	
	Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	8,400	6,231	48,763	2030/11/13	
	通貨小計	銘柄数	12銘柄					
	金額			37,720	30,070	235,307		
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 52,400	千メキシコ・ペソ 46,202	303,340	2026/03/05	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,800	24,341	159,817	2047/11/07	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	41,000	39,749	260,972	2024/09/05	
	Mexican Bonos	国債証券	6.7500	17,500	17,203	112,949	2023/03/09	
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	13,000	11,057	72,599	2027/03/04	
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,250	26,663	175,056	2023/12/07	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	26,550	26,799	175,950	2024/12/05	
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	36,230	33,554	220,299	2027/06/03	
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	7,854	51,569	2036/11/20	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	31,730	30,467	200,032	2029/05/31	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	29,100	27,270	179,042	2038/11/18	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	41,350	37,708	247,576	2031/05/29	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	26,120	22,462	147,478	2042/11/13	
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,430	9,311	61,133	2034/11/23	
	通貨小計	銘柄数	14銘柄					
		金額			387,850	360,645	2,367,817	
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 9,982	25,310	2036/01/14	
通貨小計	銘柄数	1銘柄						
	金額			10,000	9,982	25,310		
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	千チリ・ペソ 500,000	千チリ・ペソ 466,770	72,546	2026/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	570,000	495,164	76,959	2035/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	510,000	479,053	74,455	2043/01/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	685,000	606,430	94,253	2030/09/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.0000	250,000	241,850	37,589	2023/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	850,000	765,297	118,944	2025/03/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.3000	250,000	194,652	30,253	2028/10/01	
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	200,000	183,094	28,457	2028/10/01	
	通貨小計	銘柄数	8銘柄					
	金額			3,815,000	3,432,312	533,460		
コロンビア	Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	千コロンビア・ペソ 90,000	千コロンビア・ペソ 88,179	2,999	2027/06/28	
	Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	43,132	1,467	2023/03/21	
	Colombian TES	国債証券	10.0000	3,850,000	3,831,366	130,335	2024/07/24	
	Colombian TES	国債証券	6.0000	4,870,000	3,798,843	129,229	2028/04/28	
	Colombian TES	国債証券	7.5000	4,710,000	4,162,556	141,601	2026/08/26	
	Colombian TES	国債証券	7.7500	3,600,000	2,889,396	98,291	2030/09/18	
	Colombian TES	国債証券	7.0000	4,650,000	3,408,961	115,966	2032/06/30	
	Colombian TES	国債証券	6.2500	2,700,000	2,353,941	80,076	2025/11/26	
	Colombian TES	国債証券	7.2500	4,200,000	2,991,576	101,767	2034/10/18	
	Colombian TES	国債証券	5.7500	3,200,000	2,507,552	85,301	2027/11/03	
	Colombian TES	国債証券	7.2500	2,310,000	1,428,919	48,608	2050/10/26	

2022年6月15日現在								
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日	
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額		
			%	千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ	千円		
	Colombian TES	国債証券	6.2500	1,900,000	1,188,355	40,425	2036/07/09	
	COLOMBIAN TES	国債証券	7.0000	2,300,000	1,737,397	59,102	2031/03/26	
	COLOMBIAN TES	国債証券	9.2500	1,500,000	1,188,030	40,414	2042/05/28	
通貨小計	銘柄数	14銘柄						
	金 額			39,925,000	31,618,206	1,075,588		
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	8,250,000	8,492,220	78,128	2036/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	6,000,000	6,425,520	59,114	2031/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	5,472,060	50,342	2032/08/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,234,227	66,554	2038/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	10,543,500	97,000	2024/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	4,700,000	5,033,747	46,310	2039/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	12,000,000	12,654,840	116,424	2029/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	17,800,000	17,434,922	160,401	2030/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	15,700,000	15,980,559	147,021	2025/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	9,300,000	9,190,632	84,553	2035/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	11,500,000	11,809,695	108,649	2040/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	14,400,000	14,052,960	129,287	2026/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	15,800,000	14,860,532	136,716	2031/02/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	4,300,000	3,850,306	35,422	2036/06/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	12,600,000	11,708,046	107,714	2032/04/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	5.1250	9,000,000	8,444,880	77,692	2027/04/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	5,700,000	5,528,658	50,863	2042/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	3,600,000	4,141,044	38,097	2025/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	2,180,000	2,635,576	24,247	2030/08/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,393,076	31,216	2031/07/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,824,000	13,721,551	126,238	2026/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	4,978,617	45,803	2032/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	12,530,000	12,749,901	117,299	2027/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	6,910,000	7,008,191	64,475	2023/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	11,450,000	11,046,960	101,632	2028/05/15	
Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	7,075,000	6,613,710	60,846	2033/05/15		
Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,520,000	13,149,004	120,970	2034/03/15		
Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	15,150,000	15,977,038	146,988	2024/03/15		
Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	10,620,000	11,666,494	107,331	2029/03/15		
通貨小計	銘柄数	29銘柄						
	金 額			272,429,000	275,798,470	2,537,345		
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,710	10,513	277,292	2023/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,390	9,716	256,253	2025/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,950	9,832	259,321	2027/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	8,100	7,043	185,759	2029/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	4,600	3,888	102,568	2031/01/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	19,300	16,854	444,532	2023/07/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	27,700	22,734	599,616	2024/01/01	
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	9,300	7,195	189,789	2024/07/01	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	2,900	1,996	52,653	2025/07/01	
	通貨小計	銘柄数	9銘柄					
		金 額			103,950	89,775	2,367,787	
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	19,600	16,483	93,830	2028/08/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	12,100	12,002	68,323	2024/05/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	21,100	19,034	108,352	2025/09/17	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	17,900	14,950	85,103	2026/06/26	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	16,000	11,417	64,992	2030/05/15	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	11,900	11,018	62,721	2023/10/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	22,500	17,597	100,172	2027/02/10	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	18,000	15,143	86,204	2029/07/23	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	19,000	13,490	76,797	2033/10/13	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	16,200	11,459	65,230	2031/03/13	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	10,000	6,725	38,282	2029/11/29	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	9,500	8,221	46,799	2036/12/04	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	14,500	10,420	59,318	2032/06/23	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	17,500	15,469	88,057	2025/02/14	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	10,000	5,487	31,238	2040/04/24	
CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	—	5,000	4,311	24,541	2024/12/12		
通貨小計	銘柄数	16銘柄						
	金 額			240,800	193,230	1,099,967		
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	5.8500	1,430	1,404	40,013	2023/04/26	
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,046	29,821	2025/02/24	
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,100	1,856	52,882	2027/07/26	
	Romania Government Bond	国債証券	3.5000	1,090	1,066	30,391	2022/12/19	
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,600	1,460	41,587	2024/04/29	

2022年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
			%	千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ	千円	
	Romania Government Bond	国債証券	4.2500	1,500	1,444	41,137	2023/06/28
	Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,121	60,439	2029/02/12
	Romania Government Bond	国債証券	4.8500	1,600	1,405	40,023	2026/04/22
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,400	958	27,300	2031/09/24
	Romania Government Bond	国債証券	4.5000	900	836	23,814	2024/06/17
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,500	1,305	37,185	2025/07/28
	Romania Government Bond	国債証券	4.0000	1,600	1,516	43,189	2023/10/25
	Romania Government Bond	国債証券	4.1500	1,600	1,284	36,598	2028/01/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.7000	1,300	1,166	33,219	2024/11/25
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	2,100	1,726	49,174	2026/06/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1500	2,000	1,471	41,905	2030/10/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	800	558	15,895	2034/10/11
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	1,300	965	27,489	2027/10/25
通貨小計	銘柄数	18銘柄					
	金 額			27,570	23,594	672,069	
				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	3.2900	2,700	2,742	54,881	2023/10/18
	China Government Bond	国債証券	3.2200	3,700	3,797	75,995	2025/12/06
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,956	99,193	2028/11/22
	China Government Bond	国債証券	3.1900	4,000	4,070	81,475	2024/04/11
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,900	6,117	122,447	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,935	98,784	2026/06/06
	China Government Bond	国債証券	3.1200	4,200	4,298	86,031	2026/12/05
	China Government Bond	国債証券	3.1300	5,700	5,826	116,613	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2.9400	4,500	4,565	91,377	2024/10/17
	China Government Bond	国債証券	2.8500	8,600	8,690	173,925	2027/06/04
	China Government Bond	国債証券	2.6800	8,000	7,917	158,466	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	1.9900	6,500	6,423	128,566	2025/04/09
	China Government Bond	国債証券	2.3600	6,150	6,168	123,467	2023/07/02
	China Government Bond	国債証券	2.8800	4,900	4,950	99,071	2023/11/05
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,126	142,635	2025/10/22
	China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,164	103,370	2027/12/03
	China Government Bond	国債証券	3.2700	7,300	7,548	151,087	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3.0300	3,900	3,972	79,508	2026/03/11
	China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	6,293	125,965	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	2.8400	4,000	4,041	80,886	2024/04/08
	China Government Bond	国債証券	3.0100	5,000	5,077	101,619	2028/05/13
	China Government Bond	国債証券	3.7200	2,000	2,141	42,858	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.0200	5,800	5,876	117,619	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	1,500	1,507	30,170	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	1,800	1,816	36,357	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	1,000	1,039	20,801	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	1,000	1,004	20,103	2031/11/18
通貨小計	銘柄数	27銘柄					
	金 額			125,550	128,071	2,563,282	
				千ロシア・ルーブル	千ロシア・ルーブル		
ロシア	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	46,760	—	—	2027/02/03
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	24,400	—	—	2023/01/25
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0500	46,160	—	—	2028/01/19
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	33,800	—	—	2023/08/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.5000	43,000	—	—	2031/09/17
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7500	45,600	—	—	2026/09/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	54,000	—	—	2022/12/07
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	46,100	—	—	2033/03/23
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1000	48,600	—	—	2024/10/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.5000	48,000	—	—	2024/02/28
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.2500	55,000	—	—	2034/05/10
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.9000	49,000	—	—	2029/05/23
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.9500	46,000	—	—	2026/10/07
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.4000	55,000	—	—	2024/07/17
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.1500	59,000	—	—	2025/11/12
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6500	65,000	—	—	2030/04/10
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.7000	38,000	—	—	2039/03/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.0000	68,000	—	—	2027/10/06
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	4.5000	71,000	—	—	2025/07/16
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	6.1000	63,000	—	—	2035/07/18
	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	5.7000	65,000	—	—	2028/05/17
	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ	国債証券	6.9000	74,000	—	—	2031/07/23
	RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ	国債証券	6.7000	50,000	—	—	2029/03/14
通貨小計	銘柄数	23銘柄					
	金 額			1,194,420	—	—	
				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
マレーシア	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,826	55,778	2027/07/26
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0940	2,000	2,035	62,166	2023/11/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	3,500	3,509	107,162	2028/10/31

2022年 6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年利率	額 面 金 額	評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額	
			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1280	1,900	1,934	59,069	2025/08/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	1,600	1,595	48,724	2029/07/09
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.6550	3,700	3,737	114,117	2024/10/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	4,200	4,207	128,483	2026/03/31
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	4,000	3,758	114,778	2030/10/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4220	3,700	3,573	109,109	2027/09/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4470	3,100	2,723	83,171	2036/07/15
	MALAYSIA T-BILL	国債証券	4.4170	2,100	1,990	60,797	2041/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,450	2,386	72,878	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4800	2,500	2,515	76,828	2023/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	3,250	3,164	96,620	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,763	53,843	2024/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	4,450	4,477	136,741	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	2,300	2,199	67,155	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,400	1,414	43,185	2023/08/17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	3,800	3,786	115,615	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	1,720	1,738	53,102	2024/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	2,520	2,489	76,014	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	2,600	2,593	79,198	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,500	1,510	46,132	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,412	43,132	2023/04/20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	2,000	1,998	61,031	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,950	2,863	87,436	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	3,300	3,299	100,747	2024/06/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	2,350	2,146	65,555	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	3,600	3,128	95,526	2040/05/22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	3,600	3,078	94,016	2050/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	2,900	2,526	77,144	2031/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	1,000	933	28,519	2032/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1930	1,000	995	30,390	2032/10/07
通貨小計	銘柄数	33銘柄					
	金 額			85,930	83,314	2,544,176	
南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	47,950	50,788	427,640	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	14,720	9,701	81,690	2036/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	13,280	8,271	69,645	2041/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	19,540	15,528	130,749	2031/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.7500	8,880	8,998	75,771	2023/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	45,520	35,582	299,608	2048/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	29,900	23,975	201,872	2037/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	42,400	37,201	313,238	2030/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	27,600	21,711	182,811	2044/01/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	34,900	29,565	248,941	2032/03/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	28,800	24,467	206,012	2035/02/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	23,100	18,926	159,365	2040/01/31
通貨小計	銘柄数	12銘柄					
	金 額			336,590	284,720	2,397,347	
タイ	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	36,050	40,374	155,440	2029/06/22
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	23,300	23,859	91,860	2023/06/16
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	31,610	33,058	127,274	2025/12/12
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	28,700	29,934	115,246	2031/06/20
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	29,600	28,956	111,482	2036/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	35,400	34,676	133,502	2026/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	24,000	24,135	92,920	2022/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	37,500	39,641	152,620	2032/06/25
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	34,900	28,404	109,358	2046/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.4000	21,500	21,772	83,822	2023/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	26,500	26,483	101,962	2028/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	40,500	38,326	147,556	2038/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.4500	34,000	33,571	129,250	2024/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	36,500	33,021	127,131	2029/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	15,500	12,609	48,547	2035/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	0.9500	34,000	32,908	126,699	2025/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	0.7500	39,900	39,079	150,456	2024/06/17
	Thailand Government Bond	国債証券	1.5850	32,900	26,321	101,337	2035/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	36,000	32,902	126,676	2031/12/17
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	19,000	14,463	55,685	2042/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	32,000	29,527	113,680	2027/06/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7500	16,000	15,618	60,132	2024/09/17
通貨小計	銘柄数	22銘柄					
	金 額			665,360	639,648	2,462,645	
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	5.7000	730	725	26,076	2024/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	2,870	2,680	96,315	2028/08/12

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

2022年6月15日現在							
区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	Peru Government Bond	国債証券	6.1500	千ペルー・ソル 2,550	千ペルー・ソル 2,209	千円 79,377	2032/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.9400	2,700	2,439	87,656	2029/02/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.4000	2,050	1,612	57,945	2034/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	5.3500	1,000	723	25,981	2040/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	1,565	1,634	58,745	2026/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	2,065	1,817	65,293	2037/08/12
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	2,570	2,392	85,980	2031/08/12
通貨小計	銘柄数	9銘柄					
	金 額			18,100	16,235	583,372	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	千ポーランド・ズロチ 7,490	千ポーランド・ズロチ 6,107	183,804	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,240	4,072	122,565	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,500	4,394	132,253	2023/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,700	4,299	129,401	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	7,150	5,207	156,708	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	5,000	4,447	133,842	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	4,700	3,902	117,445	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	5,600	3,443	103,617	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	5,700	4,150	124,902	2026/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,500	1,493	44,956	2032/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	4,530	4,353	131,009	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	5,700	4,382	131,896	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	6,150	5,397	162,436	2025/07/25
通貨小計	銘柄数	13銘柄					
	金 額			68,960	55,654	1,674,840	
ハンガリー	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	千ハンガリー・フォリント 98,500	千ハンガリー・フォリント 89,689	31,494	2024/06/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	170,000	131,928	46,326	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.7500	140,000	137,611	48,322	2022/10/26
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000	103,321	36,281	2026/12/22
	Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	88,000	81,273	28,539	2028/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	225,000	156,739	55,039	2030/08/21
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	110,000	97,519	34,244	2024/10/24
	Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	272,000	185,789	65,240	2031/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	40,000	37,382	13,126	2023/08/23
	Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	200,000	158,440	55,636	2025/11/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	202,000	109,251	38,363	2038/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	169,000	132,267	46,445	2026/04/22
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	135,000	91,536	32,143	2029/05/23
	Hungary Government Bond	国債証券	2.2500	215,000	124,592	43,750	2033/04/20
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	100,000	76,377	26,819	2026/08/26
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	70,000	35,619	12,507	2041/04/25
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	75,000	41,580	14,600	2034/06/22
	Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	81,800	80,090	28,123	2023/11/24
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	142,500	132,959	46,688	2025/06/24
通貨小計	銘柄数	19銘柄					
	金 額			2,663,800	2,003,969	703,695	
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	千ウルグアイ・ペソ 2,800	千ウルグアイ・ペソ 2,558	8,619	2028/03/15
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.2500	7,000	5,967	20,103	2031/05/21
通貨小計	銘柄数	2銘柄					
	金 額			9,800	8,526	28,723	
ドミニカ共和国	Dominican Republic International Bond	国債証券	9.7500	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 10,851	26,672	2026/06/05
通貨小計	銘柄数	1銘柄					
	金 額			11,000	10,851	26,672	
合 計	銘柄数	294銘柄					
	金 額					24,262,786	

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

運用報告書 第11期 (決算日 2021年7月5日)

(作成対象期間 2020年7月7日～2021年7月5日)

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

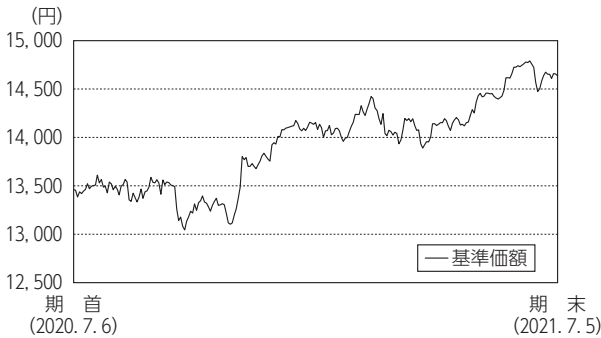
運用方針	投資成果をJ Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼィング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (円換算)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	新興国通貨建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



《運用経過》

【基準価額・騰落率】

期首：13,460円 期末：14,635円 騰落率：8.7%

【基準価額の主な変動要因】

投資している債券からの利息収入や、多くの投資対象国通貨の対円為替レートが上昇(円安)したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○新興国債券市況

新興国債券価格は、多くの国で下落(金利は上昇)しました。

新興国債券価格は、当作成期首より2020年10月にかけて、緩やかな金融環境を背景に横ばい圏で推移しました。11月には、新型コロナウイルスのワクチン開発で進展があったことにより、新興国債券価格は上昇しました。2021年2月以降は、米国債が金利上昇したことと連動して新興国の金利も上昇し、債券価格は下落しました。個別国では、感染者数および死者数が新興国最多で財政悪化が懸念され、また2022年の大統領選挙の見通しに不透明感が高まったブラジルや、エルドアン大統領による中央銀行人事への介入で中央銀行の独立性が懸念されたトルコなどの債券価格が大きく下落しました。

○為替相場

新興国為替市場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

新興国通貨は、当作成期首より、緩やかな金融環境を背景に堅調に推移しました。2020年11月には、新型コロナウイルスのワクチン開発で進展があったことにより、一段と上昇しました。2021年2月以降は、ウイルスの変異種の感染拡大や米国金利上昇に伴う新興国からの資金流出への懸念で、上昇幅を縮小させる局面もありました。米ドル円相場が円安米ドル高方向に進行したことで、多くの新興国通貨は対円で上昇しました。個別国では、いち早く景気回復局面に入り、また株式や債券の国際的なインデックス入りに伴う資金流入が期待された中国・人民元、米国の大型財政出動や景気回復の恩恵を強く受けると期待されたメキシコ・ペソ、財政再建の進展が期待された南アフリカ・ランドなどが大きく上昇しました。

◆前作成期における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は9.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は8.7%となり、ベンチマークの騰落率を下回りました。これは、税金、売買に伴う費用などが主な要因です。

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

年 月 日	基準価額		J Pモルガン ガバメント・ボンド・インデックス・エマーゼィング・マーケット グローバル・ダイバーシファイド (円換算)		公社債組入比率
	円	騰落率 (%)	ベンチマーク	騰落率 (%)	
(期首) 2020年7月6日	13,460	—	14,417	—	95.5
7月末	13,428	△ 0.2	14,349	△ 0.5	95.0
8月末	13,448	△ 0.1	14,390	△ 0.2	95.5
9月末	13,133	△ 2.4	14,080	△ 2.3	95.9
10月末	13,103	△ 2.7	14,062	△ 2.5	96.1
11月末	13,777	2.4	14,777	2.5	96.4
12月末	14,148	5.1	15,170	5.2	96.0
2021年1月末	14,062	4.5	15,108	4.8	96.0
2月末	14,039	4.3	15,158	5.1	96.4
3月末	14,005	4.0	15,054	4.4	96.6
4月末	14,287	6.1	15,347	6.4	96.2
5月末	14,617	8.6	15,731	9.1	96.3
6月末	14,609	8.5	15,710	9.0	96.6
(期末) 2021年7月5日	14,635	8.7	15,713	9.0	97.1

(注1) 騰落率は期首比。

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

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

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

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

《今後の運用方針》

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

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	13 (12)
(その他)	(1)
合 計	13

(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

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

		買付額	売付額
外 国	トルコ	千トルコ・リラ 7,490	千トルコ・リラ 3,507 (—)
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 73,031	千メキシコ・ペソ 20,003 (—)
	チリ	千チリ・ペソ 687,215	千チリ・ペソ 57,691 (—)
	コロンビア	千コロンビア・ペソ 6,549,900	千コロンビア・ペソ 2,892,000 (—)
	インドネシア	千インドネシア・ルピア 62,416,644	千インドネシア・ルピア 3,465,000 (—)
	ブラジル	千ブラジル・レアル 29,279	千ブラジル・レアル 15,421 (—)
	チェコ	千チェコ・コルナ 29,444	千チェコ・コルナ 15,794 (—)
	ルーマニア	千ルーマニア・レイ 4,869	千ルーマニア・レイ 1,012 (—)
	中国	千オフショア・人民元 89,993	千オフショア・人民元 9,471 (—)
	ロシア	千ロシア・ルーブル 298,895	千ロシア・ルーブル 104,221 (—)
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 21,127	千マレーシア・リンギット 2,197 (—)
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 30,142	千南アフリカ・ランド 5,607 (—)
	タイ	千タイ・バーツ 166,995	千タイ・バーツ 38,130 (—)
	ペルー	千ペルー・ソル 764	千ペルー・ソル 926 (—)
	ポーランド	千ポーランド・ズロチ 20,869	千ポーランド・ズロチ 3,613 (—)
	ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 789,018	千ハンガリー・フォリント 90,602 (—)
	ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 6,996	千ウルグアイ・ペソ 5,464 (—)

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

公 社 債

(2020年7月7日から2021年7月5日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄		銘 柄	
Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	309,188	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2022/1/1	134,458
China Government Bond (中国) 2.36% 2023/7/2	176,741	Thailand Government Bond (タイ) 3.65% 2021/12/17	108,962
China Government Bond (中国) 2.68% 2030/5/21	143,302	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2023/1/1	98,282
Mexican Bonos (メキシコ) 6.75% 2023/3/9	123,869	China Government Bond (中国) 2.36% 2023/7/2	85,852
Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 6.5% 2031/2/15	122,145	Russian Federal Bond - OFZ (ロシア) 7% 2021/12/15	70,878
China Government Bond (中国) 3.27% 2030/11/19	121,040	Mexican Bonos (メキシコ) 7.25% 2021/12/9	53,367
Poland Government Bond (ポーランド) 0.75% 2025/4/25	115,880	Poland Government Bond (ポーランド) 5.75% 2021/10/25	50,962
China Government Bond (中国) 3.02% 2025/10/22	110,931	China Government Bond (中国) 2.68% 2030/5/21	48,410
Poland Government Bond (ポーランド) 1.25% 2030/10/25	109,534	Poland Government Bond (ポーランド) 2.75% 2028/4/25	48,104
China Government Bond (中国) 2.85% 2027/6/4	107,997	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/1/1	45,491

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)外国(外貨建) 公社債(通貨別)

作成期	当 期				末			
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
トルコ	千トルコ・リラ 33,510	千トルコ・リラ 27,790	千円 356,260	1.7%	1.7%	0.5%	0.5%	0.6%
メキシコ	千メキシコ・ペソ 324,900	千メキシコ・ペソ 341,228	1,915,315	9.0	—	4.5	3.1	1.4
フィリピン	千フィリピン・ペソ 10,000	千フィリピン・ペソ 11,966	27,025	0.1	—	0.1	—	—
チリ	千チリ・ペソ 2,790,000	千チリ・ペソ 2,834,115	428,297	2.0	—	1.0	0.8	0.2
コロンビア	千コロンビア・ペソ 31,630,000	千コロンビア・ペソ 31,986,957	948,573	4.5	—	3.1	0.9	0.5
インドネシア	千インドネシア・ルピア 244,089,000	千インドネシア・ルピア 260,230,570	2,003,775	9.4	—	6.6	2.0	0.8
ブラジル	千ブラジル・レアル 85,150	千ブラジル・レアル 79,736	1,751,898	8.2	—	1.8	3.6	2.8
チェコ	千チェコ・コルナ 163,800	千チェコ・コルナ 165,613	853,073	4.0	—	2.5	1.3	0.2
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 20,170	千ルーマニア・レイ 21,520	574,354	2.7	—	1.0	1.0	0.7
中国	千オフショア・人民元 121,450	千オフショア・人民元 121,621	2,088,833	9.8	—	5.3	4.1	0.5
ロシア	千ロシア・ルーブル 1,019,330	千ロシア・ルーブル 1,025,580	1,548,626	7.3	—	4.6	1.9	0.7
マレーシア	千マレーシア・リンギット 57,030	千マレーシア・リンギット 59,115	1,581,530	7.4	—	4.5	2.1	0.8
南アフリカ	千南アフリカ・ランド 233,090	千南アフリカ・ランド 211,551	1,647,990	7.7	—	7.3	—	0.4
タイ	千タイ・バーツ 487,060	千タイ・バーツ 524,481	1,814,706	8.5	—	5.2	2.2	1.1
ペルー	千ペルー・ソル 15,050	千ペルー・ソル 16,037	456,833	2.1	—	2.0	0.1	—
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 58,370	千ポーランド・ズロチ 61,151	1,786,658	8.4	—	3.9	2.8	1.6
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 2,152,800	千ハンガリー・フォリント 2,237,781	838,465	3.9	—	2.0	1.5	0.5
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 9,800	千ウルグアイ・ペソ 10,088	25,669	0.1	—	0.1	—	—
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 12,443	24,280	0.1	0.1	—	0.1	—
合計	—	—	20,672,166	97.1	1.8	56.1	28.1	12.8

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

(2)外国(外貨建) 公社債(銘柄別)

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	当 期			償還年月日
				額 面 金 額		評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	8.5000%	千トルコ・リラ 790	千トルコ・リラ 714	千円 9,157	2022/09/14
	Turkey Government Bond	国債証券	7.1000	2,780	2,367	30,350	2023/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	10.4000	680	579	7,428	2024/03/20
	Turkey Government Bond	国債証券	9.0000	1,630	1,313	16,840	2024/07/24
	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	2,690	2,012	25,800	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	2,570	2,014	25,820	2026/02/11
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,400	2,299	29,483	2022/03/02
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	2,970	2,291	29,373	2027/02/24
	Turkey Government Bond	国債証券	10.7000	1,900	1,766	22,639	2022/08/17
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	2,500	1,862	23,876	2027/08/11
	Turkey Government Bond	国債証券	12.2000	1,400	1,301	16,686	2023/01/18
	Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	2,000	1,638	21,001	2028/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	16.2000	1,400	1,366	17,518	2023/06/14
	Turkey Government Bond	国債証券	12.6000	3,500	2,989	38,328	2025/10/01
	Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	4,300	3,272	41,954	2030/11/13
通貨小計	銘柄数 金 額	15銘柄		33,510	27,790	356,260	
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 34,400	千メキシコ・ペソ 33,456	187,788	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	20,500	21,529	120,847	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	26,000	27,356	153,551	2024/09/05
	Mexican Bonos	国債証券	6.7500	23,000	23,427	131,497	2023/03/09
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	27,250	28,553	160,271	2023/12/07
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	26,550	29,628	166,306	2024/12/05
	Mexican Bonos	国債証券	7.5000	30,230	31,418	176,354	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	7,390	9,257	51,963	2036/11/20

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	未 評 価 額		償還年月日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
					千メキシコ・ペソ	千円	
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	27,730	30,354	170,380	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	20,400	22,403	125,753	2038/11/18
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	22,450	23,581	132,365	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	6.5000	28,450	28,719	161,202	2022/06/09
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	20,120	20,587	115,560	2042/11/13
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	10,430	10,951	61,472	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金額	14銘柄		324,900	341,228	1,915,315	
フィリピン	Philippine Government International Bond	国債証券	6.2500	10,000	11,966	27,025	2036/01/14
通貨小計	銘柄数 金額	1銘柄		10,000	11,966	27,025	
チリ	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	500,000	516,710	78,086	2026/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	570,000	571,305	86,336	2035/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	410,000	451,594	68,245	2043/01/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	410,000	407,330	61,556	2030/09/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.0000	250,000	257,000	38,838	2023/03/01
	BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	650,000	630,175	95,233	2025/03/01
通貨小計	銘柄数 金額	6銘柄		2,790,000	2,834,115	428,297	
コロンビア	Colombia Government International Bond	国債証券	9.8500	90,000	106,914	3,170	2027/06/28
	Colombia Government International Bond	国債証券	4.3750	45,000	46,078	1,366	2023/03/21
	Colombian TES	国債証券	7.0000	3,635,000	3,754,773	111,347	2022/05/04
	Colombian TES	国債証券	10.0000	3,050,000	3,480,904	103,226	2024/07/24
	Colombian TES	国債証券	6.0000	4,290,000	4,131,827	122,529	2028/04/28
	Colombian TES	国債証券	7.5000	3,710,000	3,927,702	116,476	2026/08/26
	Colombian TES	国債証券	7.7500	2,700,000	2,821,311	83,665	2030/09/18
	Colombian TES	国債証券	7.0000	3,000,000	2,946,090	87,366	2032/06/30
	Colombian TES	国債証券	6.2500	2,700,000	2,746,386	81,444	2025/11/26
	Colombian TES	国債証券	7.2500	3,400,000	3,371,270	99,975	2034/10/18
	Colombian TES	国債証券	5.7500	2,400,000	2,306,040	68,385	2027/11/03
	Colombian TES	国債証券	7.2500	1,410,000	1,294,323	38,383	2050/10/26
	Colombian TES	国債証券	6.2500	1,200,000	1,053,336	31,236	2036/07/09
通貨小計	銘柄数 金額	13銘柄		31,630,000	31,986,957	948,573	
インドネシア	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	8,250,000	9,070,050	69,839	2036/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	6,000,000	6,906,360	53,178	2031/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	5,500,000	5,791,940	44,597	2032/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,300,000	7,486,734	57,647	2038/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.1250	10,000,000	10,917,500	84,064	2024/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	7,200,000	7,973,424	61,395	2039/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	12,000,000	13,383,720	103,054	2029/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	14,300,000	14,802,073	113,975	2030/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	16,000,000	16,792,160	129,299	2025/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	9,300,000	9,618,246	74,060	2035/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	10,000,000	10,241,900	78,862	2040/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	9,200,000	9,239,284	71,142	2026/04/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	15,800,000	15,727,636	121,102	2031/02/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	2,300,000	2,267,064	17,456	2036/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	3,600,000	4,337,496	33,398	2025/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	2,180,000	2,756,174	21,222	2030/08/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,561,000	27,419	2031/07/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,824,000	14,441,234	111,197	2026/09/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,278,627	40,645	2032/06/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	10,330,000	10,953,518	84,342	2027/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	11,060,000	11,397,661	87,761	2022/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.6250	10,910,000	11,163,766	85,961	2023/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	11,450,000	11,454,236	88,197	2028/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	7,075,000	7,055,968	54,330	2033/05/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	12,520,000	13,825,961	106,459	2034/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	13,150,000	14,375,185	110,688	2024/03/15
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	8,120,000	9,411,648	72,469	2029/03/15
通貨小計	銘柄数 金額	27銘柄		244,089,000	260,230,570	2,003,775	
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,210	10,590	232,688	2023/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	10,690	11,250	247,193	2025/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	9,150	9,660	212,242	2027/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	5,300	5,608	123,221	2029/01/01
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	2,400	2,521	55,404	2031/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	6,100	5,721	125,705	2022/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	12,700	10,957	240,739	2023/07/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	23,200	19,157	420,911	2024/01/01
	Brazil Letras do Tesouro Nacional	国債証券	—	5,400	4,268	93,792	2024/07/01
通貨小計	銘柄数 金額	9銘柄		85,150	79,736	1,751,898	

区 分	銘 柄	種 類	年 利 率	期 末			償 還 年 月 日	
				額 面 金 額	評 価 額			
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
				千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ	千円		
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	15,600	16,388	84,415	2028/08/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	5.7000	8,600	9,670	49,813	2024/05/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.7000	8,700	9,143	47,099	2022/09/12	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	16,100	16,614	85,580	2025/09/17	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	17,900	17,356	89,405	2026/06/26	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	16,000	14,903	76,768	2030/05/15	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.4500	9,900	9,723	50,085	2023/10/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	15,500	14,331	73,820	2027/02/10	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	12,000	12,883	66,365	2029/07/23	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	17,000	17,306	89,143	2033/10/13	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	13,000	12,302	63,372	2031/03/13	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	6,000	5,198	26,775	2029/11/29	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	7,500	9,789	50,427	2036/12/04	
	通貨小計	銘柄数 金 額	13銘柄		163,800	165,613	853,073	
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	5.8500	1,430	1,521	40,607	2023/04/26	
	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	1,150	1,237	33,017	2025/02/24	
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,100	2,452	65,462	2027/07/26	
	Romania Government Bond	国債証券	3.5000	1,090	1,111	29,661	2022/12/19	
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	1,600	1,636	43,687	2024/04/29	
	Romania Government Bond	国債証券	3.4000	1,700	1,716	45,815	2022/03/08	
	Romania Government Bond	国債証券	4.2500	1,500	1,557	41,573	2023/06/28	
	Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,918	77,892	2029/02/12	
	Romania Government Bond	国債証券	4.8500	1,600	1,750	46,715	2026/04/22	
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,400	1,423	37,995	2031/09/24	
	Romania Government Bond	国債証券	4.5000	900	952	25,424	2024/06/17	
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	1,500	1,564	41,754	2025/07/28	
	Romania Government Bond	国債証券	4.1500	800	856	22,857	2028/01/26	
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	800	820	21,887	2026/06/24	
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄		20,170	21,520	574,354		
中国	China Government Bond	国債証券	3.2900	3,900	3,958	67,983	2023/10/18	
	China Government Bond	国債証券	3.2200	5,700	5,776	99,215	2025/12/06	
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,853	83,356	2028/11/22	
	China Government Bond	国債証券	3.1900	6,700	6,782	116,487	2024/04/11	
	China Government Bond	国債証券	3.2900	8,200	8,309	142,714	2029/05/23	
	China Government Bond	国債証券	3.2500	6,800	6,900	118,508	2026/06/06	
	China Government Bond	国債証券	3.1200	7,000	7,051	121,109	2026/12/05	
	China Government Bond	国債証券	3.1300	7,000	6,996	120,155	2029/11/21	
	China Government Bond	国債証券	2.9400	4,500	4,519	77,615	2024/10/17	
	China Government Bond	国債証券	2.8500	8,600	8,512	146,206	2027/06/04	
	China Government Bond	国債証券	2.6800	9,400	9,051	155,459	2030/05/21	
	China Government Bond	国債証券	3.9000	8,000	7,738	132,913	2025/04/09	
	China Government Bond	国債証券	2.3600	6,150	6,110	104,945	2023/07/02	
	China Government Bond	国債証券	2.8800	4,900	4,919	84,486	2023/11/05	
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,028	120,716	2025/10/22	
	China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,071	87,099	2027/12/03	
	China Government Bond	国債証券	3.2700	7,300	7,394	127,006	2030/11/19	
	China Government Bond	国債証券	3.0300	1,700	1,707	29,334	2026/03/11	
	China Government Bond	国債証券	3.8100	5,800	5,931	101,869	2050/09/14	
	China Government Bond	国債証券	2.8400	1,000	1,002	17,215	2024/04/08	
	China Government Bond	国債証券	3.0100	1,000	995	17,094	2028/05/13	
	China Government Bond	国債証券	3.7200	1,000	1,009	17,340	2051/04/12	
	通貨小計	銘柄数 金 額	22銘柄		121,450	121,621	2,088,833	
	ロシア	Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	8.1500	46,760	49,399	74,592	2027/02/03
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.6000	32,910	33,371	50,391	2022/07/20
		Russian Federal Bond - OFZ	国債証券	7.0000	14,400	14,453	21,824	2023/01/25
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	7.0500	46,160	46,513	70,234	2028/01/19	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	7.0000	33,800	33,977	51,305	2023/08/16	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	8.5000	31,000	34,234	51,693	2031/09/17	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	7.7500	51,600	53,618	80,963	2026/09/16	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	7.4000	51,000	51,669	78,020	2022/12/07	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	7.7000	46,100	48,232	72,830	2033/03/23	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	7.1000	48,600	49,001	73,992	2024/10/16	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	6.5000	38,000	37,718	56,955	2024/02/28	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	7.2500	45,000	45,598	68,853	2034/05/10	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	6.9000	51,000	50,885	76,836	2029/05/23	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	7.9500	51,000	53,381	80,606	2026/10/07	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	7.4000	55,000	55,784	84,235	2024/07/17	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	7.1500	59,000	59,551	89,922	2025/11/12	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	7.6500	65,000	67,699	102,226	2030/04/10	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	7.7000	38,000	40,211	60,718	2039/03/16	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	6.0000	58,000	55,369	83,608	2027/10/06	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	4.5000	39,000	35,787	54,038	2025/07/16	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	6.1000	53,000	48,373	73,044	2035/07/18	
Russian Federal Bond - OFZ		国債証券	5.7000	65,000	60,749	91,730	2028/05/17	
通貨小計	銘柄数 金 額	22銘柄		1,019,330	1,025,580	1,548,626		

ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

区 分	銘 柄	種 類	年 利率	当 期 末				償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価		額	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
マレーシア	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.9480	千マレーシア・リンギット 3,400	千マレーシア・リンギット 3,457	千円 92,510	2022/04/14	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,930	51,657	2027/07/26	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0940	2,000	2,098	56,142	2023/11/30	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	1,700	1,836	49,128	2028/10/31	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	1,600	1,703	45,566	2029/07/09	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.6550	1,700	1,774	47,471	2024/10/15	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	2,200	2,310	61,816	2026/03/31	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	2,500	2,532	67,755	2030/10/15	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4220	2,200	2,261	60,493	2027/09/30	
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4470	900	849	22,714	2036/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	1,750	1,809	48,412	2027/05/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	2,350	2,463	65,899	2028/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1810	1,740	1,835	49,094	2024/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	2,950	3,114	83,320	2025/09/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,800	1,886	50,471	2035/05/31	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8000	1,400	1,451	38,843	2023/08/17	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	2,000	2,132	57,044	2026/11/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.6200	1,200	1,208	32,340	2021/11/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0590	3,020	3,183	85,170	2024/09/30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	2,520	2,662	71,222	2027/11/16	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	2,600	2,816	75,344	2037/04/07	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,400	1,445	38,664	2023/04/20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	2,000	2,117	56,648	2026/07/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,150	2,266	60,648	2029/08/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.4780	1,100	1,139	30,476	2024/06/14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	2,350	2,350	62,869	2034/07/05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,800	1,698	45,451	2040/05/22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	1,900	1,832	49,025	2050/06/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,000	946	25,322	2031/04/15	
	通貨小計	銘柄数	29銘柄		57,030	59,115	1,581,530	
		金 額						
	南アフリカ	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	千南アフリカ・ランド 34,550	千南アフリカ・ランド 39,114	304,698	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	11,220	7,951	61,938	2036/03/31
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	6.5000	12,580	8,450	65,830	2041/02/28	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	7.0000	12,440	10,643	82,914	2031/02/28	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	7.7500	11,380	11,811	92,010	2023/02/28	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.7500	31,520	26,664	207,712	2048/02/28	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.5000	20,900	17,941	139,765	2037/01/31	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.0000	26,900	25,449	198,254	2030/01/31	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.7500	17,600	14,911	116,159	2044/01/31	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.2500	19,600	17,845	139,014	2032/03/31	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	8.8750	20,600	18,654	145,320	2035/02/28	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		国債証券	9.0000	13,800	12,114	94,371	2040/01/31	
通貨小計	銘柄数	12銘柄		233,090	211,551	1,647,990		
	金 額							
タイ	Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	千タイ・バーツ 30,050	千タイ・バーツ 37,447	129,566	2029/06/22	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6250	23,300	24,707	85,486	2023/06/16	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	26,610	30,235	104,615	2025/12/12	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.6500	22,700	26,734	92,500	2031/06/20	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.8750	17,200	17,432	60,316	2022/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.4000	23,600	26,977	93,340	2036/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.1250	29,400	31,300	108,298	2026/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	24,000	24,530	84,876	2022/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.7750	32,500	38,725	133,988	2032/06/25	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	24,900	26,233	90,766	2046/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.4000	24,500	25,611	88,614	2023/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.8750	26,500	29,363	101,598	2028/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	3.3000	31,500	35,587	123,131	2038/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.4500	30,000	30,844	106,721	2024/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	27,500	27,615	95,548	2029/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.6000	15,500	14,550	50,344	2035/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	0.9500	28,000	28,310	97,954	2025/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	0.7500	20,900	21,005	72,679	2024/06/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	1.5850	12,400	11,536	39,915	2035/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	9,000	9,215	31,887	2031/12/17	
	Thailand Government Bond	国債証券	2.0000	7,000	6,518	22,554	2042/06/17	
通貨小計	銘柄数	21銘柄		487,060	524,481	1,814,706		
	金 額							
ペルー	Peru Government Bond	国債証券	5.7000	千ペルー・ソル 730	千ペルー・ソル 811	23,105	2024/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.3500	1,970	2,191	62,418	2028/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.1500	1,850	1,919	54,670	2032/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.9400	1,900	2,066	58,854	2029/02/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.4000	2,050	1,925	54,841	2034/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	5.3500	1,000	877	24,999	2040/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	8.2000	1,565	1,937	55,203	2026/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9000	2,065	2,172	61,899	2037/08/12	
	Peru Government Bond	国債証券	6.9500	1,920	2,135	60,839	2031/08/12	
	通貨小計	銘柄数	9銘柄		15,050	16,037	456,833	
	金 額							

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	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	5.7500	千ポーランド・ズロチ 3,610	千ポーランド・ズロチ 3,858	千円 112,726	2022/09/23
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,990	6,350	185,551	2026/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,140	4,398	128,511	2027/07/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,200	3,261	95,279	2022/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	4,500	4,658	136,096	2023/01/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	5,500	5,784	169,008	2024/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	6,450	7,025	205,258	2029/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.2500	3,100	3,248	94,921	2024/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.7500	4,000	3,978	116,250	2025/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	1.2500	3,900	3,757	109,780	2030/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	0.2500	2,400	2,274	66,439	2026/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	4.0000	3,530	3,818	111,572	2023/10/25
	Poland Government Bond	国債証券	2.7500	4,500	4,873	142,395	2028/04/25
	Poland Government Bond	国債証券	3.2500	3,550	3,863	112,866	2025/07/25
通貨小計	銘柄数 金 額	14銘柄		58,370	61,151	1,786,658	
ハンガリー	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	千ハンガリー・フォリント 98,500	千ハンガリー・フォリント 102,454	38,388	2024/06/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	170,000	177,242	66,410	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.7500	140,000	141,610	53,059	2022/10/26
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000	134,329	50,331	2026/12/22
	Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	88,000	113,546	42,544	2028/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	145,000	150,913	56,545	2030/08/21
	Hungary Government Bond	国債証券	2.5000	160,000	164,003	61,449	2024/10/24
	Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	202,000	213,354	79,940	2031/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	40,000	40,205	15,064	2023/08/23
	Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	130,000	124,800	46,760	2025/11/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	75,000	73,125	27,398	2038/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	95,000	92,569	34,684	2026/04/22
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	80,000	77,824	29,159	2029/05/23
	Hungary Government Bond	国債証券	2.2500	100,000	94,008	35,223	2033/04/20
Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	100,000	97,222	36,427	2026/08/26	
Hungary Government Bond	国債証券	6.0000	131,800	146,192	54,776	2023/11/24	
Hungary Government Bond	国債証券	7.0000	125,000	132,406	49,610	2022/06/24	
Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	142,500	161,975	60,689	2025/06/24	
通貨小計	銘柄数 金 額	18銘柄		2,152,800	2,237,781	838,465	
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.5000	千ウルグアイ・ペソ 2,800	千ウルグアイ・ペソ 2,923	7,438	2028/03/15
	Uruguay Government International Bond	国債証券	8.2500	7,000	7,165	18,230	2031/05/21
通貨小計	銘柄数 金 額	2銘柄		9,800	10,088	25,669	
ドミニカ共和国	Dominican Republic International Bond	国債証券	9.7500	千ドミニカ・ペソ 11,000	千ドミニカ・ペソ 12,443	24,280	2026/06/05
通貨小計	銘柄数 金 額	1銘柄		11,000	12,443	24,280	
合 計	銘柄数 金 額	262銘柄				20,672,166	

(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

2021年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 20,672,166	% 95.5
コール・ローン等、その他	983,961	4.5
投資信託財産総額	21,656,127	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=111.16円、1トルコ・リラ=12.819円、1メキシコ・ペソ=5.613円、1フィリピン・ペソ=2.258円、1アルゼンチン・ペソ=1.16円、100チリ・ペソ=15.112円、100コロンビア・ペソ=2.965円、100インドネシア・ルピア=0.77円、1ブラジル・リアル=21.971円、1チエコ・コルナ=5.151円、1ルーマニア・レイ=26.689円、1オフショア・人民元=17.174円、1ロシア・ルーブル=1.51円、1マレーシア・リンギット=26.753円、1南アフリカ・ランド=7.79円、1タイ・バーツ=3.46円、1ペルー・ソル=28.486円、1ポーランド・ズロチ=29.216円、100ハンガリー・フォリント=37.468円、1ウルグアイ・ペソ=2.544円、1ドミニカ・ペソ=1.951円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産(20,973,875千円)の投資信託財産総額(21,656,127千円)に対する比率は、96.8%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	22,222,755,636円
コール・ローン等	674,373,087
公社債（評価額）	20,672,166,113
未収入金	604,557,331
未収利息	255,476,931
前払費用	16,182,174
(B) 負債	923,205,227
未払金	919,638,550
未払解約金	3,560,737
その他未払費用	5,940
(C) 純資産総額（A－B）	21,299,550,409
元本	14,553,919,275
次期繰越損益金	6,745,631,134
(D) 受益権総口数	14,553,919,275口
1万口当り基準価額（C／D）	14,635円

* 期首における元本額は11,831,677,635円、当作成期間中における追加設定元本額は3,356,035,460円、同解約元本額は633,793,820円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、新興国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）139,125,730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）264,519,469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）431,390,249円、D-I's 新興国債券インデックス54,698,190円、i F r e e 新興国債券インデックス3,803,181,162円、i F r e e 8資産バランス2,737,955,446円、DCダイワ新興国債券インデックスファンド6,926,685,621円、ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券162,851,958円、ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド33,511,450円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,635円です。

■損益の状況

当期 自 2020年7月7日 至 2021年7月5日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	967,591,713円
受取利息	967,675,396
支払利息	△ 83,683
(B) 有価証券売買損益	617,999,402
売買益	1,665,193,821
売買損	△ 1,047,194,419
(C) その他費用	△ 16,880,636
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	1,568,710,479
(E) 前期繰越損益金	4,093,541,775
(F) 解約差損益金	△ 253,784,839
(G) 追加信託差損益金	1,337,163,719
(H) 合計（D＋E＋F＋G）	6,745,631,134
次期繰越損益金（H）	6,745,631,134

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

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

ダイワファンドラップ J-REITインデックス

運用報告書(全体版)

第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日～2022年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／不動産投信（リート）／インデックス型	
信託期間	無期限（設定日：2016年9月26日）	
運用方針	投資成果を東証REIT指数（配当込み。）の動きに連動させることをめざして運用を行います。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワJ-REITマザーファンドの受益証券
	ダイワJ-REITマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<4640>

最近5期の運用実績

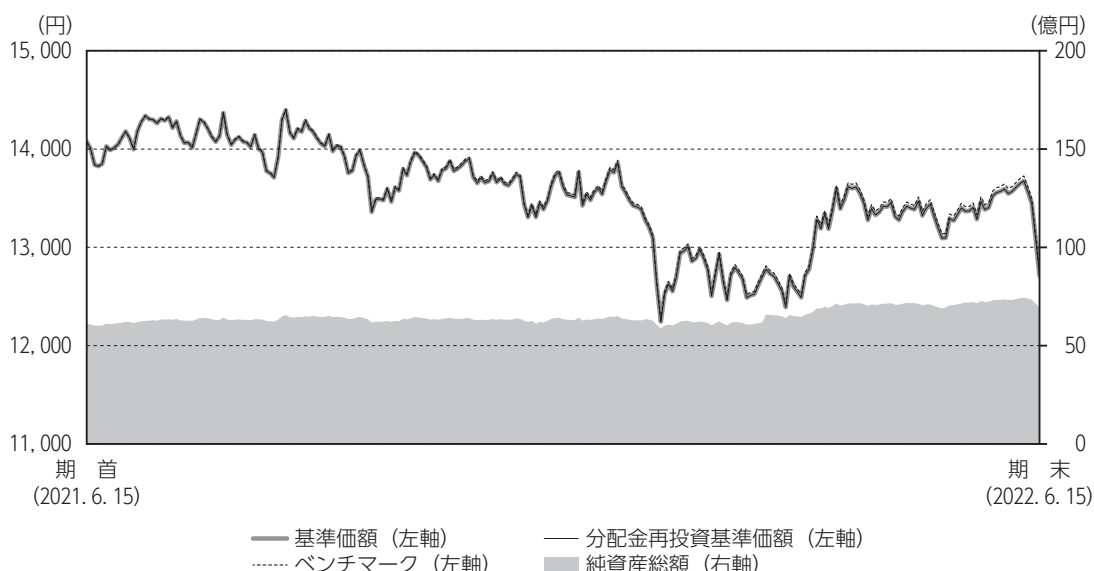
決算期	基準価額			東証REIT指数 (配当込み)		投資信託 証券 組入比率	不動産投信 指数 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
2期末(2018年6月15日)	円 10,250	円 0	% 3.5	3,398.25	% 3.8	% 98.3	% 1.5	百万円 2,355
3期末(2019年6月17日)	11,818	0	15.3	3,934.65	15.8	98.4	1.4	3,254
4期末(2020年6月15日)	10,318	0	△ 12.7	3,448.87	△ 12.3	96.3	2.6	4,081
5期末(2021年6月15日)	14,075	0	36.4	4,720.99	36.9	96.9	2.4	6,102
6期末(2022年6月15日)	12,709	0	△ 9.7	4,278.73	△ 9.4	97.2	2.4	6,943

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
 (注2) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
 (注3) 投資信託証券および不動産投信指数先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含まず。
 (注4) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：14,075円
 期末：12,709円（分配金0円）
 騰落率：△9.7%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券を通じて、ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、国内リート市況が下落したことを反映して、基準価額も下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数 (配当込み)		投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指 数 先 物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%		%	%	%
(期首)2021年6月15日	14,075	—	4,720.99	—	96.9	2.4
6月末	14,106	0.2	4,732.24	0.2	97.5	2.4
7月末	14,207	0.9	4,767.40	1.0	96.3	2.4
8月末	14,166	0.6	4,755.00	0.7	97.1	2.5
9月末	13,718	△ 2.5	4,605.71	△ 2.4	97.0	2.5
10月末	13,877	△ 1.4	4,660.54	△ 1.3	97.5	2.5
11月末	13,306	△ 5.5	4,470.13	△ 5.3	97.4	2.5
12月末	13,761	△ 2.2	4,624.94	△ 2.0	97.4	2.5
2022年1月末	13,004	△ 7.6	4,372.24	△ 7.4	97.4	2.5
2月末	12,620	△ 10.3	4,243.65	△ 10.1	97.4	2.5
3月末	13,485	△ 4.2	4,536.64	△ 3.9	97.5	2.5
4月末	13,322	△ 5.3	4,483.12	△ 5.0	97.5	2.5
5月末	13,556	△ 3.7	4,563.32	△ 3.3	97.5	2.4
(期末)2022年6月15日	12,709	△ 9.7	4,278.73	△ 9.4	97.2	2.4

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021.6.16～2022.6.15)

国内リート市況

国内リート市況は下落しました。

国内リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展による経済活動の正常化期待から上昇が続きました。その後は、国内外で長期金利が上昇したことや中国の大手不動産会社の資金繰り懸念などから投資家のリスク回避姿勢が強まり、下落が続きました。2021年末から2022年初めにかけては、新型コロナウイルスの新しい変異株であるオミクロン株が確認されたことやウクライナ情勢の悪化、米国金融政策の引き締めペース加速への懸念から、投資家のリスク選好姿勢が後退したことなどを背景に、軟調に推移しました。3月中旬以降は、FRB（米国連邦準備制度理事会）の利上げ決定で悪材料出尽くし観測が強まったことや、ロシアとウクライナによる停戦協議の進展期待もあり、国内リート市況は一時反発しました。しかしその後は、FRBの利上げペースが一層加速するとの懸念などから、当作成期末にかけて下落しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

ダイワJ-REITマザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

国内リートへの投資は、「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券を通じて行いました。

■ダイワJ-REITマザーファンド

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

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

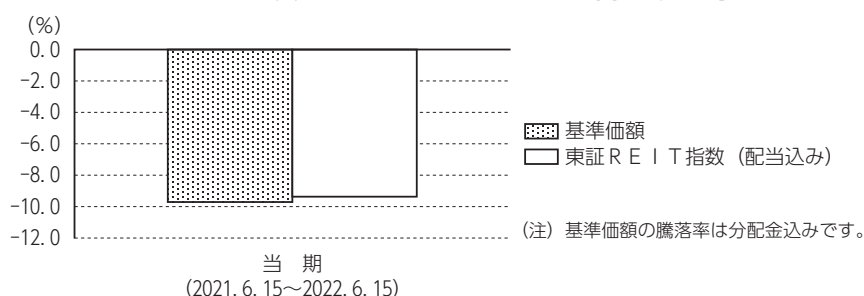
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワJ-REITマザーファンド	東証REIT指数（配当込み）

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△9.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△9.7%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークは東証REIT指数（配当込み）です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2021年6月16日 ~2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	(円)	—
対基準価額比率	(%)	—
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	3,934

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



今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワJ-REITマザーファンド」の受益証券組入比率を高位に維持します。

■ダイワJ-REITマザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2021. 6. 16~2022. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	46円	0.341%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は13,547円です。
(投信会社)	(28)	(0.209)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(15)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	0	0.002	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用	1	0.005	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	47	0.348	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

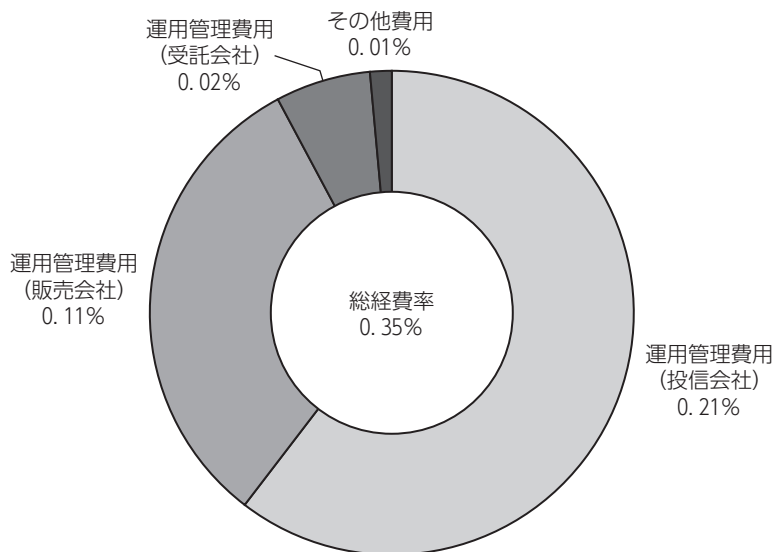
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

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



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

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ J-REIT マザーファンド	597,730	1,997,230	152,234	514,980

(注) 単位未満は切捨て。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

種 類	当 期		
	ダイワ J-REIT マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
投資信託証券	2,442	2,072	13,083

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンド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6月16日から2022年6月15日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A		売付額等 C			
区 分	うち利害関係人との取引状況 B	B/A	うち利害関係人との取引状況 D	D/C		
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	86,193	2,803	3.3	73,951	686	0.9
不動産投信 指数先物取引	48,457	—	—	48,862	—	—
コール・ローン	2,227,929	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合1.4%
 ※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

種 類	当 期	
	ダイワ J-REIT マザーファンド	
	買 付 額	
	百万円	
投資信託証券	1,485	

(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

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、大和証券オフィス投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、大和証券リビング投資法人です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種類	期首	当期末	
	□数	□数	評価額
	千口	千口	千円
ダイワJ-REIT マザーファンド	1,742,654	2,188,150	6,939,720

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ダイワJ-REIT マザーファンド	6,939,720	99.6
コール・ローン等、その他	25,258	0.4
投資信託財産総額	6,964,978	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6月15日現在

項目	当期末
(A) 資産	6,964,978,851円
コール・ローン等	25,258,380
ダイワJ-REITマザーファンド (評価額)	6,939,720,471
(B) 負債	21,680,187
未払解約金	10,102,771
未払信託報酬	11,393,726
その他未払費用	183,690
(C) 純資産総額 (A - B)	6,943,298,664
元本	5,463,295,501
次期繰越損益金	1,480,003,163
(D) 受益権総口数	5,463,295,501口
1万口当り基準価額 (C / D)	12,709円

* 期首における元本額は4,336,083,892円、当作成期間中における追加設定元本額は1,972,084,634円、同解約元本額は844,873,025円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,709円です。

■収益分配金の計算過程 (総額)

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	1,128,740,648
(d) 分配準備積立金	1,020,863,659
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,149,604,307
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,149,604,307
(h) 受益権総口数	5,463,295,501口

東証REIT指数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。

《お知らせ》

■マザーファンドにおける運用の基本方針の記載変更について

当ファンドの主要投資対象である「ダイワJ-REITマザーファンド」において、株式会社東京証券取引所が東証REIT指数の算出等にかかる業務を株式会社JPX総研に移管したことに伴い、信託約款における運用の基本方針の記載を、下記の通り変更しました。（下線部を削除）
現行：東京証券取引所が算出・公表する「東証REIT指数」（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

変更後：「東証REIT指数」（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 3,278円
受取利息	318
支払利息	△ 3,596
(B) 有価証券売買損益	△ 603,971,781
売買益	37,154,433
売買損	△ 641,126,214
(C) 信託報酬等	△ 22,559,079
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 626,534,138
(E) 前期繰越損益金	1,020,861,311
(F) 追加信託差損益金	1,085,675,990
(配当等相当額)	(1,128,740,648)
(売買損益相当額)	(△ 43,064,658)
(G) 合計 (D + E + F)	1,480,003,163
次期繰越損益金 (G)	1,480,003,163
追加信託差損益金	1,085,675,990
(配当等相当額)	(1,128,740,648)
(売買損益相当額)	(△ 43,064,658)
分配準備積立金	1,020,863,659
繰越損益金	△ 626,536,486

(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「収益分配金の計算過程 (総額)」をご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ J-REITインデックス）が投資対象としている「ダイワJ-REITマザーファンド」の決算日（2022年3月15日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在におけるダイワJ-REITマザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワJ-REITマザーファンドの主要な売買銘柄
投資信託証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買 付				売 付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
日本ビルファンド	8.445	5,801,317	686,952	インベスコ・オフィス・Jリート	264.318	6,012,934	22,748
GLP投資法人	24.404	4,476,348	183,426	日本ビルファンド	6.676	4,640,954	695,169
日本プロロジスリート	12.144	4,455,172	366,862	ジャパンリアルエステイト	6.212	4,099,623	659,952
ジャパンリアルエステイト	6.303	4,096,537	649,934	GLP投資法人	19.418	3,606,567	185,733
大和ハウスリート投資法人	12.155	3,960,229	325,810	日本プロロジスリート	9.725	3,565,867	366,670
野村不動産マスターF	20.383	3,364,783	165,077	野村不動産マスターF	20.089	3,317,831	165,156
日本都市ファンド投資法人	31.833	3,332,350	104,682	日本都市ファンド投資法人	28.716	2,954,606	102,890
アドバンス・レジデンス	7.815	2,816,234	360,362	大和ハウスリート投資法人	8.944	2,925,500	327,090
ユナイテッド・アーバン投資法人	17.598	2,619,604	148,858	オリックス不動産投資	12.38	2,313,124	186,843
日本プライムリアルティ	6.143	2,492,023	405,668	アドバンス・レジデンス	5.667	2,024,644	357,269

(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6月15日現在におけるダイワJ-REITマザーファンド（139,303,981千口）の内容です。

(1) 国内投資信託証券

銘柄	2022年6月15日現在		銘柄	2022年6月15日現在	
	口数	評価額		口数	評価額
	千口	千円		千口	千円
エスコンジャパンリート	8.307	1,064,126	日本都市ファンド投資法人	208.146	21,022,746
サンケイリアルエステート	13.067	1,253,125	オリックス不動産投資	82.197	14,392,694
SOSILA 物流リート投	19.191	2,721,283	日本プライムリアルティ	28.189	10,937,332
東海道リート投資法	3.159	365,180	NTT 都市開発リート投資法人	39.543	5,658,603
日本アコモデーションファンド投資法人	14.244	9,130,404	東急リアル・エステート	27.659	5,083,724
森ヒルズリート	48.511	6,995,286	グローバル・ワン不動産投資法人	28.263	2,916,741
産業ファンド	58.566	10,073,352	ユナイテッド・アーバン投資法人	92.869	12,537,315
アドバンス・レジデンス	41.247	13,797,121	森トラスト総合リート	29.484	3,992,133
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	29.519	5,965,789	インヴェンシブル投資法人	181.574	6,963,362
API 投資法人	21.986	8,662,484	フロンティア不動産投資	14.462	7,288,848
GLP 投資法人	133.61	20,602,662	平和不動産リート	28.123	3,900,660
コンフォリア・レジデンシャル	19.191	6,150,715	日本ロジスティクスファンド投資法人	27.816	8,525,604
日本プロロジスリート	67.495	21,463,410	福岡リート投資法人	21.336	3,424,428
星野リゾート・リート	6.913	4,562,580	ケネディクス・オフィス投資法人	12.762	8,001,774
Oneリート投資法人	7.159	1,867,067	いちごオフィスリート投資法人	33.803	2,738,043
イオンリート投資	48.515	7,088,041	大和証券オフィス投資法人	8.722	5,651,856
ヒューリックリート投資法	38.485	5,918,993	阪急阪神リート投資法人	18.634	2,653,481
日本リート投資法人	12.73	4,563,705	スターツプロシード投資法人	6.424	1,478,804
積水ハウス・リート投資	125.223	9,454,336	大和ハウスリート投資法人	61.942	17,963,180
トーセイ・リート投資法人	8.619	1,097,198	ジャパン・ホテル・リート投資法人	126.383	7,709,363
ケネディクス商業リート	16.471	4,328,578	大和証券リビング投資法人	55.743	6,209,770
ヘルスケア & メディカル投資	10.106	1,516,910	ジャパンエクセレント投資法人	37.844	4,601,830
サムティ・レジデンシャル	9.345	1,221,391			
野村不動産マスターF	133.405	21,291,438	合計	口数、金額	2,410,663 429,701,345
いちごホテルリート投資	6.834	610,276		銘柄数 < 比率 >	61 銘柄 < 97.3% >
ラサールロジポート投資	50.502	8,393,432			
スターアジア不動産投	42.633	2,515,347			
マリモ地方創生リート	4.831	645,421			
三井不ロジパーク	16.25	8,222,500			
大江戸温泉リート	6.659	443,489			
投資法人みらい	49.971	2,408,602			
森トラスト・ホテルリート投	9.679	1,179,870			
三菱地所物流 REIT	11.985	5,177,520			
CRE ロジスティクスファンド	15.977	3,027,641			
ザイマックス・リート	6.658	814,939			
タカラレーベン不動産投	16.268	1,830,150			
アドバンス・ロジスティクス投資法人	16.085	2,380,580			
日本ビルファンド	48.095	32,367,935			
ジャパンリアルエステイト	41.254	24,876,162			

(注1) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別	2022年6月15日現在	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
東証REIT	10,402	—

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワJ-REITマザーファンド

運用報告書 第36期 (決算日 2022年3月15日)

(作成対象期間 2021年9月16日～2022年3月15日)

ダイワJ-REITマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

大和アセットマネジメント

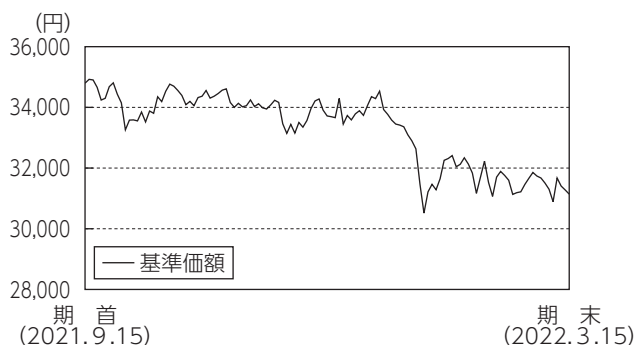
Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額		東証REIT指数(配当込み)		投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率
	円	%	(ベンチマーク)	%		
(期首)2021年9月15日	34,797	-	4,692.90	-	96.7	2.5
9月末	34,150	△ 1.9	4,605.71	△ 1.9	97.1	2.5
10月末	34,555	△ 0.7	4,660.54	△ 0.7	97.5	2.5
11月末	33,143	△ 4.8	4,470.13	△ 4.7	97.5	2.5
12月末	34,288	△ 1.5	4,624.94	△ 1.4	97.5	2.5
2022年1月末	32,411	△ 6.9	4,372.24	△ 6.8	97.4	2.5
2月末	31,460	△ 9.6	4,243.65	△ 9.6	97.5	2.5
(期末)2022年3月15日	31,141	△10.5	4,200.48	△10.5	97.0	2.5

(注1) 騰落率は期首比。

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

(注3) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：34,797円 期末：31,141円 騰落率：△10.5%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークの動きに連動した投資成果をめざした運用を行った結果、新型コロナウイルスの新しい変異株であるオミクロン株が確認されたことなどを背景に国内リート市況が下落したことにより、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内リート市況

国内リート市況は下落しました。

国内リート市況は、当作成期首より、国内外で長期金利が上昇したことや、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念などから投資家のリスク回避姿勢が強まり、下落が続きました。その後は、割安感から買いが入り上昇に転じましたが、2021年11月に南アフリカにおいて新型コロナウイルスの新しい変異株であるオミクロン株が確認されたことが懸念され、軟調に推移しました。2022年に入ると、年初から公募増資の発表が相次ぎ、需給悪化から下落しました。加えて、米国金融政策の引き締めペース加速への懸念から投資家のリスク選好姿勢が悪化したことや、ウクライナ情勢の悪化などを背景に、軟調に推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

◆ポートフォリオについて

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△10.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△10.5%となりました。

ポートフォリオの騰落率とベンチマークの騰落率の違い、先物取引の影響、売買等のコストなどが差異の要因となりました。

*ベンチマークは東証REIT指数(配当込み)です。

《今後の運用方針》

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

■1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 投資信託証券

(2021年9月16日から2022年3月15日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内	千口 138.714	千円 27,144,862	千口 191.226 (-)	千円 35,916,458 (-)

(注1) 金額は受渡し代金。

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

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2021年9月16日から2022年3月15日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内 不動産投信指数先物取引	百万円 25,298	百万円 25,500	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。

ダイワJ-REITマザーファンド

■主要な売買銘柄
投資信託証券

(2021年9月16日から2022年3月15日まで)

当				期			
買				売			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
	千口	千円	円		千口	千円	円
日本ビルファンド	3.384	2,267,738	670,135	日本ビルファンド	3.69	2,524,525	684,153
日本プロロジスリート	5.049	1,890,675	374,465	ジャパンリアルエステイト	3.307	2,140,318	647,208
ジャパンリアルエステイト	1.923	1,239,860	644,753	G L P 投資法人	10.706	1,949,782	182,120
G L P 投資法人	6.225	1,147,436	184,327	日本プロロジスリート	5.23	1,899,349	363,164
野村不動産マスターF	6.216	992,103	159,604	野村不動産マスターF	10.69	1,717,991	160,710
日本都市ファンド投資法人	9.7	962,668	99,244	日本都市ファンド投資法人	16.68	1,638,533	98,233
大和ハウスリート投資法人	2.888	950,529	329,130	大和ハウスリート投資法人	4.965	1,617,214	325,723
三井不動産リート	1.596	919,736	576,275	オリックス不動産投資	6.589	1,164,804	176,780
三菱地所物流 R E I T	1.92	855,871	445,766	アドバンス・レジデンス	3.306	1,155,348	349,470
日本プライムリアルティ	2.119	811,986	383,193	ユナイテッド・アーバン投資法人	7.441	1,015,159	136,427

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内投資信託証券

銘柄	期首		当期末	
	口数	評価額	口数	評価額
	千口	千円	千口	千円
エスコジャパンリート	8.096	7,818	1,029,630	5,422,851
サンケイリアルエステート	12.735	12,297	1,301,022	2,709,150
S O S I L A 物流リート投	16.867	18,061	2,709,150	325,543
東海道リート投資法	3.079	2,973	325,543	8,217,265
日本アコモデーションファンド投資法人	13.883	13,405	8,217,265	6,144,893
森ヒルズリート	47.279	45,657	6,144,893	9,446,711
産業ファンド	57.079	55,115	9,446,711	12,518,482
アドバンス・レジデンス	40.201	38,817	12,518,482	5,422,851
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	27.461	27,781	5,422,851	8,038,453
A P I 投資法人	21.428	20,691	8,038,453	21,790,395
G L P 投資法人	130.219	125,738	21,790,395	5,508,300
コンフォリア・レジデンシャル	18.103	18,06	5,508,300	21,532,602
日本プロロジスリート	63.699	63,518	21,532,602	4,176,852
星野リゾート・リート	6.203	6,506	4,176,852	1,866,149
One リート投資法人	6.267	6,737	1,866,149	6,419,374
イオンリート投資	47.284	45,657	6,419,374	5,516,001
ヒューリックリート投資法	35.345	36,218	5,516,001	4,222,950
日本リート投資法人	12.407	11,98	4,222,950	8,732,314
積水ハウス・リート投資	118.257	117,845	8,732,314	1,027,790
トーセイ・リート投資法人	8.401	8,112	1,027,790	4,100,014
ケネディクス商業リート	16.053	15,501	4,100,014	9,511,717
ヘルスケア&メディカル投資	8.576	9,51	9,511,717	1,019,224
サムティ・レジデンシャル	9.108	8,794	1,019,224	18,630,878
野村不動産マスターF	130.019	125,545	18,630,878	512,630
いちごホテルリート投資	6.661	6,432	512,630	47,527
ラサールロジポート投資	49.22	47,527	47,527	2,335,042
スターアジア不動産投	41.551	40,121	2,335,042	576,559
マリモ地方創生リート	3.767	4,547	576,559	7,982,946
三井不動産リート	14.945	15,293	7,982,946	409,796
大江戸温泉リート	6.49	6,266	409,796	2,269,052
投資法人みらい	45.835	47,027	2,269,052	1,069,396
森トラスト・ホテルリート投	9.433	9,109	1,069,396	4,900,725
三菱地所物流 R E I T	10.218	11,279	4,900,725	2,927,314
C R E ロジスティクスファンド	15.541	15,035	2,927,314	721,843
ザイマックス・リート	5.836	6,266	721,843	1,717,782
タカラレーベン不動産投	15.855	15,31	1,717,782	2,211,661
伊藤忠アドバンスロジ	15.677	15,138	2,211,661	28,876,518
日本ビルファンド	45.567	45,261	28,876,518	23,332,623
ジャパンリアルエステイト	40.207	38,823	23,332,623	18,275,883
日本都市ファンド投資法人	202.863	195,883	18,275,883	12,546,818
オリックス不動産投資	80.111	77,354	12,546,818	9,841,888
日本プライムリアルティ	26.423	26,528	9,841,888	5,418,212
N T T 都市開発リート投資法人	36.315	37,213	5,418,212	4,653,985
東急リアル・エステート	26.957	26,029	4,653,985	2,890,004
グローバル・ワン不動産投資法人	27.919	26,959	2,890,004	10,811,008
ユナイテッド・アーバン投資法人	90.512	87,397	10,811,008	3,745,845
森トラスト総合リート	28.735	27,747	3,745,845	6,664,164
インヴェンシブル投資法人	176.965	170,876	6,664,164	6,294,625
フロンティア不動産投資	14.095	13,61	6,294,625	3,337,537
平和不動産リート	26.047	25,151	3,337,537	7,709,126
日本ロジスティクスファンド投資法人	26.27	26,177	7,709,126	3,114,252
福岡リート投資法人	20.794	20,079	3,114,252	8,106,750
ケネディクス・オフィス投資法人	12.438	12,01	8,106,750	2,595,777
いちごオフィスリート投資法人	32.945	31,811	2,595,777	5,745,600
大和証券オフィス投資法人	8.5	8,208	5,745,600	2,483,097
阪急阪神リート投資法人	18.161	17,536	2,483,097	1,347,653
スタートアップリート投資法人	6.261	6,046	1,347,653	17,866,804
大和ハウスリート投資法人	60.37	59,293	17,866,804	6,910,239
ジャパン・ホテル・リート投資法人	123.175	118,937	6,910,239	5,828,194
大和証券リビング投資法人	52.589	52,459	5,828,194	4,463,373
ジャパンエクセレント投資法人	37.308	36,024	4,463,373	
合計	2,320,605 61銘柄	2,268,093 61銘柄	399,426,751 <97.0%>	

(注1) 合計欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄	別	当		期		末	
		買	建	売	建	額	額
		百万円		百万円		百万円	
国内	東証 R E I T		10,337				

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年3月15日現在

項目	当期		比率
	評価額	比率	
千円			
投資信託証券	399,426,751	96.4	%
コール・ローン等、その他	14,762,613	3.6	%
投資信託財産総額	414,189,365	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3月15日現在

項目	当	期	末
千円			
(A) 資産	419,218,740,625円		
コール・ローン等	6,638,010,617		
投資信託証券(評価額)	399,426,751,850		
未収入金	3,181,884,052		
未収配当金	4,806,079,106		
差入委託証拠金	5,166,015,000		
(B) 負債	7,276,441,000		
未払金	184,856,000		
未払解約金	2,062,210,000		
差入委託証拠金代用有価証券	5,029,375,000		
(C) 純資産総額(A-B)	411,942,299,625		
元本	132,282,348,763		
次期繰越損益金	279,659,950,862		
(D) 受益権総口数	132,282,348,763口		
1万口当り基準価額(C/D)	3,141円		

* 期首における元本額は137,936,526,812円、当作成期間中における追加設定元本額は9,698,245,164円、同解約元本額は15,352,423,213円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額:

ダイワJ-REITオープン	4,717,690,898円
ダイワJ-REITオープン (毎月分配型)	115,809,276,949円
ダイワJ-REITオープン (年1回決算型)	349,988,867円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	10,912,637円
iFree J-REITインデックス	610,923,825円
iFree 8資産バランス	1,493,803,230円
DC・ダイワJ-REITオープン	5,312,633,236円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	6,522,613円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	5,068,402円
ダイワ国内REITインデックス (投資一任専用)	313,398円
ダイワ・ノーロード J-REITファンド	95,801,012円
ダイワファンドラップ J-REITインデックス	2,074,049,260円
ダイワJ-REITインデックス (ダイワSMA専用)	321,257,153円
ダイワファンドラップオンライン J-REITインデックス	530,113,475円
ダイワ・インデックスセレクト J-REIT	943,993,808円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は31,141円です。

■損益の状況

当期 自2021年9月16日 至2022年3月15日

項目	当	期
千円		
(A) 配当等収益	7,977,261,954円	
受取配当金	7,978,262,875	
受取利息	1,318	
その他収益金	345	
支払利息	△ 1,002,584	
(B) 有価証券売買損益	△ 55,710,936,011	
売買益	252,573,529	
売買損	△ 55,963,509,540	
(C) 先物取引等損益	△ 1,237,417,990	
取引損	△ 1,237,417,990	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 48,971,092,047	
(E) 前期繰越損益金	342,046,097,462	
(F) 解約差損益金	△ 35,919,608,889	
(G) 追加信託差損益金	22,504,554,336	
(H) 合計(D+E+F+G)	279,659,950,862	
次期繰越損益金(H)	279,659,950,862	

(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。

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

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス (為替ヘッジあり)

運用報告書(全体版)

第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日~2022年6月15日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/不動産投信(リート)/インデックス型	
信託期間	無期限(設定日:2016年9月26日)	
運用方針	投資成果をS&P先進国REIT指数(除く日本)(円ヘッジ・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンドの受益証券
	先進国リート・インデックス(為替ヘッジあり)マザーファンド	イ. 先進国(日本を除きます。)の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)または店頭登録(登録予定を含みます。)の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券(以下総称して「リート」といいます) ロ. 先進国のリート指数との連動をめざすETF(上場投資信託証券) ハ. 先進国のリートを対象としたリート指数先物取引
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率 マザーファンドの株式組入上限比率	無制限
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

<2736>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ヘッジ・円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	不動産投信 指数 先物比率	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
2期末(2018年6月15日)	9,722	0	△ 1.2	9,861	△ 0.1	0.8	99.1	1.0	8,688
3期末(2019年6月17日)	10,760	0	10.7	11,020	11.8	0.6	98.4	1.0	10,895
4期末(2020年6月15日)	9,117	0	△ 15.3	9,402	△ 14.7	2.2	94.5	3.2	12,056
5期末(2021年6月15日)	12,187	0	33.7	12,690	35.0	0.9	97.8	1.7	17,785
6期末(2022年6月15日)	10,481	0	△ 14.0	11,006	△ 13.3	3.6	98.8	2.3	16,269

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ヘッジ・円ベース) は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

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

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

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

(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。

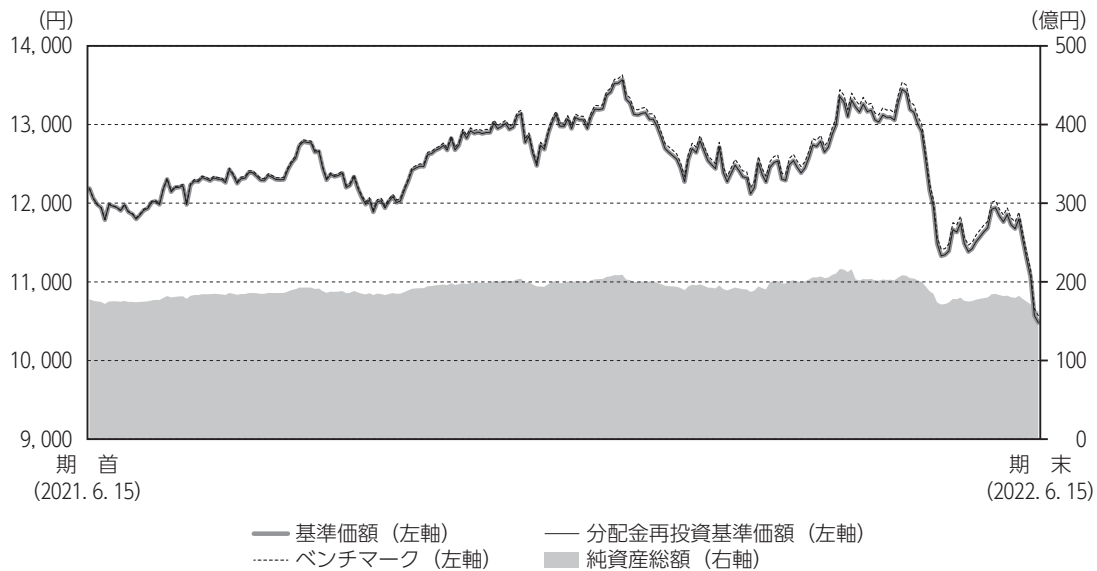
※当ファンドの約款変更に伴い、参考指数「S & P先進国REIT指数 (除く日本) (現地通貨ベース)」からベンチマーク「S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ヘッジ・円ベース)」に変更しました。

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



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

■ 基準価額・騰落率

期首：12,187円

期末：10,481円(分配金0円)

騰落率：△14.0%(分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

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

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ヘッジ・円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指 数 先 物 比 率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首)2021年6月15日	円	%			%	%	%
	12,187	—	12,690	—	0.9	97.8	1.7
6月末	11,859	△ 2.7	12,359	△ 2.6	0.8	98.0	1.7
7月末	12,285	0.8	12,812	1.0	2.0	95.0	1.6
8月末	12,514	2.7	13,057	2.9	1.5	97.1	2.0
9月末	12,041	△ 1.2	12,568	△ 1.0	0.5	98.8	2.0
10月末	12,824	5.2	13,384	5.5	1.4	98.2	2.9
11月末	12,852	5.5	13,426	5.8	0.9	96.1	2.2
12月末	13,523	11.0	14,134	11.4	1.7	97.5	2.6
2022年1月末	12,555	3.0	13,146	3.6	1.4	95.6	2.7
2月末	12,513	2.7	13,112	3.3	0.7	97.0	2.7
3月末	13,284	9.0	13,922	9.7	0.1	98.7	7.2
4月末	12,911	5.9	13,542	6.7	1.3	100.8	3.2
5月末	11,943	△ 2.0	12,528	△ 1.3	2.5	94.5	2.2
(期末)2022年6月15日	10,481	△ 14.0	11,006	△ 13.3	3.6	98.8	2.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021.6.16 ~ 2022.6.15)

■海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展により経済活動の正常化が順次進んだことや、好調な経済指標の発表などからおおむね上昇しました。しかし2021年9月に入ると、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念から世界的に市場心理が悪化したことに加え、世界的にインフレの長期化が懸念されて長期金利が急上昇したことで、売られる展開となりました。10月については、好調な決算発表や米国長期金利の低下に加え、中国の大手不動産会社に対する信用不安の後退などから上昇に転じたものの、11月からは新型コロナウイルスの新変異株であるオミクロン株への懸念などから下落に転じました。その後は、年末にかけてオミクロン株への過度の懸念の後退などから上昇する局面はあったものの、2022年に入ると、2021年12月のFOMC (米国連邦公開市場委員会) 議事録を受けて米国の金融引き締めに対する懸念が高まり、米国を中心に下落に転じました。2月以降は、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、ロシアとウクライナの断片的な停戦協定による状況改善期待などから、一進一退の展開となりました。4月以降は、米国の金融引き締めの加速懸念などからリスク回避の展開となり、海外リート市場も米国を中心に軟調に推移し、当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

(2021. 6. 16 ~ 2022. 6. 15)

■当ファンド

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」および「先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド」の受益証券への投資を90~110%の範囲で行いました。また、2022年3月に主要投資対象を「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」から「先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド」に変更しました。

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

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

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

■先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド

ポートフォリオ構築にあたっては、原則として浮動株修正後の時価総額ウエートで組成し、保有する外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、ベンチマークとの連動性を維持するような運用を行いました。また、運用の効率化を図るため、ETF (上場投資信託証券) および不動産投信指数先物を組み入れました。

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

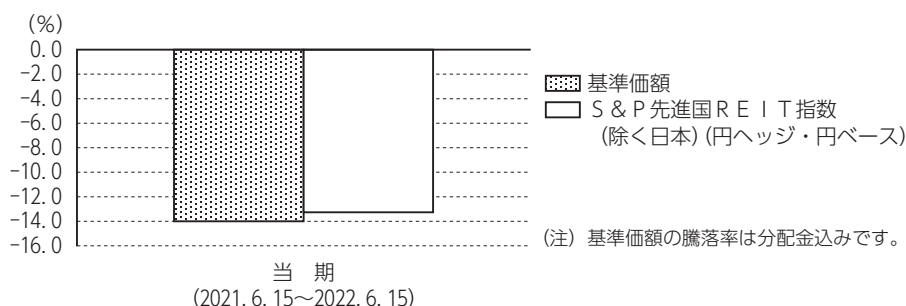
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)
先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ヘッジ・円ベース)

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△13.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△14.0%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークはS & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ヘッジ・円ベース) です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、収益分配を見送らせていただきました。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	3,133

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



今後の運用方針

■当ファンド

主として「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の受益証券に投資します。

■先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

先進国（日本を除きます。）の金融商品取引所上場または店頭登録のリートに投資し、保有する外貨建資産については為替ヘッジを行うことで、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、運用の効率化を図るため、ETF（上場投資信託証券）ならびに不動産投信指数先物取引を利用することがあります。

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2021. 6. 16~2022. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	54円	0.434%	信託報酬＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は12,475円です。
(投信会社)	(38)	(0.302)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(14)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	4	0.034	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
(先物・オプション)	(0)	(0.004)	
(投資信託受益証券)	(0)	(0.003)	
(投資信託証券)	(3)	(0.027)	
有価証券取引税	6	0.044	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
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(5)	(0.044)	
その他費用	2	0.015	その他費用＝当期中のその他費用／当期中の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.005)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(1)	(0.004)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	66	0.527	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

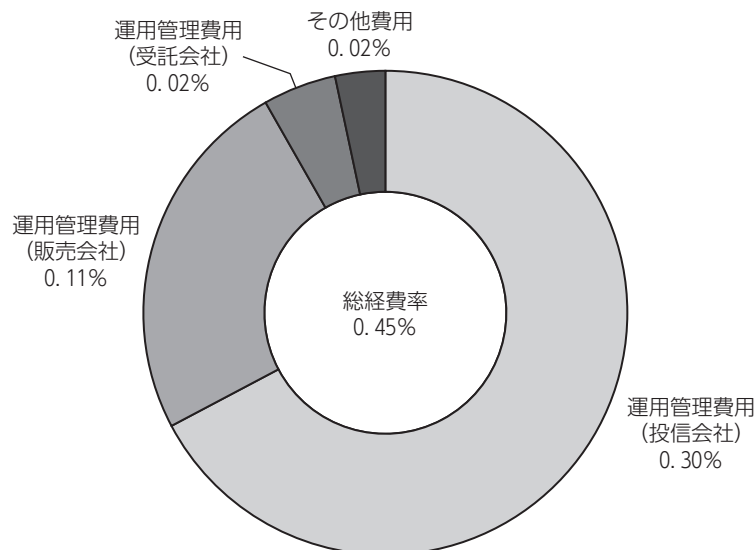
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

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



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	20,677,310	22,060,398	2,141,320	2,300,681
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	1,311,187	3,966,820	7,417,704	24,600,072

(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
先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	—	18,535,989	16,269,038
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	6,106,516	—	—

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド	16,269,038	99.7
コール・ローン等、その他	44,718	0.3
投資信託財産総額	16,313,756	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.01円、1カナダ・ドル=104.20円、1オーストラリア・ドル=93.10円、1香港・ドル=17.20円、1シンガポール・ドル=96.95円、1ニュージーランド・ドル=83.95円、1イギリス・ポンド=162.21円、1イスラエル・シェケル=38.942円、100韓国・ウォン=10.46円、1ユーロ=140.80円です。

(注3) 先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産 (21,257,560千円) の投資信託財産総額 (21,489,082千円) に対する比率は、98.9%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	16,313,756,591円
コール・ローン等	44,718,355
先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド (評価額)	16,269,038,236
(B) 負債	44,227,541
未払解約金	1,342,516
未払信託報酬	42,349,051
その他未払費用	535,974
(C) 純資産総額 (A - B)	16,269,529,050
元本	15,522,412,035
次期繰越損益金	747,117,015
(D) 受益権総口数	15,522,412,035口
1万口当り基準価額 (C / D)	10,481円

* 期首における元本額は14,593,897,109円、当作成期間中における追加設定元本額は5,111,449,724円、同解約元本額は4,182,934,798円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,481円です。

■損益の状況

当期 自 2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 7,213円
受取利息	1,240
支払利息	△ 8,453
(B) 有価証券売買損益	△ 2,650,781,471
売買益	3,569,464,782
売買損	△ 6,220,246,253
(C) 信託報酬等	△ 84,654,240
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 2,735,442,924
(E) 前期繰越損益金	2,541,462,080
(F) 追加信託差損益金	941,097,859
(配当等相当額)	(2,321,738,980)
(売買損益相当額)	(△ 1,380,641,121)
(G) 合計 (D + E + F)	747,117,015
次期繰越損益金 (G)	747,117,015
追加信託差損益金	941,097,859
(配当等相当額)	(2,321,738,980)
(売買損益相当額)	(△ 1,380,641,121)
分配準備積立金	2,541,468,191
繰越損益金	△ 2,735,449,035

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

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

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

■収益分配金の計算過程 (総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	2,321,738,980
(d) 分配準備積立金	2,541,468,191
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	4,863,207,171
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	4,863,207,171
(h) 受益権総口数	15,522,412,035口

《お知らせ》

■投資対象ファンドの変更について

当ファンドの投資対象ファンドを「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」から「先進国リート・インデックス (為替ヘッジあり) マザーファンド」に変更しました。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジあり））が投資対象としている「先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド」の第1期決算日が到来しておりませんので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在における先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	107.449	1,400,753	13,036	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	43.937	575,901	13,107

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
PROLOGIS INC (アメリカ)	98.06	1,866,778	19,037	PROLOGIS INC (アメリカ)	12.507	258,005	20,628
EQUINIX INC (アメリカ)	11.929	1,048,731	87,914	EQUINIX INC (アメリカ)	1.519	142,322	93,694
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	20.215	900,173	44,529	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	2.577	125,134	48,558
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	43.546	704,404	16,176	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	5.555	89,621	16,133
WELLTOWER INC (アメリカ)	57.646	643,034	11,154	WELLTOWER INC (アメリカ)	7.323	87,822	11,992
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	37.583	634,199	16,874	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	4.774	87,699	18,370
REALTY INCOME CORP (アメリカ)	73.57	604,370	8,214	REALTY INCOME CORP (アメリカ)	9.518	84,301	8,857
AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	18.509	544,810	29,434	GOODMAN GROUP (オーストラリア)	39.715	83,793	2,109
GOODMAN GROUP (オーストラリア)	249.655	508,682	2,037	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	2.351	72,336	30,768
EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	45.257	483,169	10,676	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	5.749	63,807	11,098

(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6月15日現在における先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド（23,434,151千口）の内容です。

(1) 外国投資信託受益証券

銘柄	口数	2022年6月15日現在	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ) VANGUARD REAL ESTATE ETF	63.512	5,545	748,747
合計	63.512	5,545	748,747
	口数、金額 銘柄数 < 比率 >	1銘柄	< 3.6% >

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	口数	2022年6月15日現在	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)			
MANULIFE US REAL ESTATE INV	203.4	118	16,064
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	95.4	65	8,822
PRIME US REIT	68.4	47	6,418
(アメリカ)			
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15.189	292	39,475
URBAN EDGE PROPERTIES	12.73	189	25,625
XENIA HOTELS & RESORTS INC	13.204	204	27,631
AVALONBAY COMMUNITIES INC	16.158	2,992	403,990
SIMON PROPERTY GROUP INC	37.991	3,666	495,015
BOSTON PROPERTIES INC	16.434	1,489	201,107
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	18.583	108	14,702

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	口数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
VORNADO REALTY TRUST	18.382	532	71,871
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	9.959	187	25,318
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9.474	432	58,326
NEXPOINT RESIDENTIAL	2.627	160	21,631
EQUITY RESIDENTIAL	39.508	2,717	366,870
APPLE HOSPITALITY REIT INC	24.552	363	49,124
EPR PROPERTIES	8.648	376	50,859
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.427	89	12,085
CITY OFFICE REIT INC	5.316	60	8,224
GLOBAL NET LEASE INC	11.978	157	21,233
EQUINIX INC	10.41	6,438	869,287
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8.943	220	29,762
CHATHAM LODGING TRUST	5.953	65	8,816
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6.366	507	68,517
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	14.038	216	29,262
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2.867	94	12,726
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6.929	35	4,789
HOST HOTELS & RESORTS INC	82.551	1,418	191,474
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	34.138	1,124	151,819
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17.628	286	38,698
RLJ LODGING TRUST	19.259	225	30,447
FARMLAND PARTNERS INC	3.465	48	6,483
PHYSICIANS REALTY TRUST	25.468	421	56,906
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8.218	104	14,168
KIMCO REALTY CORP	71.293	1,368	184,805
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7.367	79	10,761
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	25.532	690	93,277
WHITESTONE REIT	5.635	60	8,102
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	27.151	1,174	158,612
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14.352	186	25,131
PARK HOTELS & RESORTS INC	27.34	419	56,622
INVITATION HOMES INC	68.994	2,320	313,259
JBG SMITH PROPERTIES	13.198	305	41,250
ALEXANDER & BALDWIN INC	8.385	152	20,614
CLIPPER REALTY INC	1.647	12	1,681
GLADSTONE LAND CORP	3.8	83	11,312
AMERICOLD REALTY TRUST	30.842	892	120,505
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7.984	110	14,972
VICI PROPERTIES INC	97.469	2,741	370,170
BRT APARTMENTS CORP	1.402	29	3,920
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3.145	359	48,524
SAFEHOLD INC	1.726	59	8,053
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	15.076	102	13,779
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	14.055	282	38,103
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4.224	75	10,179
STORE CAPITAL CORP	28.372	703	94,958
CREATIVE MEDIA AND COMMUNITY TRUST	1.854	12	1,739
BROADSTONE NET LEASE INC	18.644	360	48,605
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	12.994	97	13,174
LIFE STORAGE INC	9.483	971	131,128
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6.088	175	23,671
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	25.513	536	72,369
PARAMOUNT GROUP INC	18.985	138	18,659
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	16.35	109	14,767
NETSTREIT CORP	4.837	90	12,277
APARTMENT INCOME REIT CO	18.149	715	96,639
CTO REALTY GROWTH INC	0.728	41	5,653
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	18.528	1,073	144,909
STAG INDUSTRIAL INC	20.373	619	83,644
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1.311	22	3,090
INDUS REALTY TRUST INC	0.807	46	6,289
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2.085	29	4,031
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	13.116	419	56,683
ORION OFFICE REIT INC	6.912	80	10,815
VENTAS INC	46.15	2,235	301,753
CARETRUST REIT INC	11.218	187	25,277
INVENTRUST PROPERTIES CORP	7.776	202	27,295
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	34.434	686	92,746
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5.911	114	15,482
SABRA HEALTH CARE REIT INC	26.438	347	46,901
UMH PROPERTIES INC	5.564	94	12,762
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3.127	75	10,153

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
IRON MOUNTAIN INC	33.475	1,582	213,680
TERRENO REALTY CORP	8.728	478	64,668
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	14.764	534	72,216
SUN COMMUNITIES INC	13.407	2,024	273,394
ACADIA REALTY TRUST	10.226	164	22,214
ALEXANDER'S INC	0.262	56	7,675
PROLOGIS INC	85.553	9,467	1,278,179
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16.827	2,277	307,535
BRANDYWINE REALTY TRUST	19.784	188	25,401
SAUL CENTERS INC	1.591	67	9,141
VERIS RESIDENTIAL INC	9.253	130	17,564
CAMDEN PROPERTY TRUST	11.815	1,488	200,988
COUSINS PROPERTIES INC	17.19	507	68,557
SITE CENTERS CORP	20.756	260	35,140
DUKE REALTY CORP	44.031	2,254	304,364
EASTGROUP PROPERTIES INC	4.704	715	96,647
ESSEX PROPERTY TRUST INC	7.543	1,932	260,919
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	15.063	706	95,378
FEDERAL REALTY INVS TRUST	8.18	778	105,092
GETTY REALTY CORP	4.815	121	16,349
WELLTOWER INC	50.323	3,897	526,203
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	62.35	1,461	197,314
HIGHWOODS PROPERTIES INC	12.127	407	55,077
SERVICE PROPERTIES TRUST	19.087	106	14,353
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	17.058	424	57,344
EQUITY COMMONWEALTH	13.075	356	48,191
KILROY REALTY CORP	12.144	602	81,289
LTC PROPERTIES INC	4.552	162	21,939
LXP INDUSTRIAL TRUST	32.697	334	45,203
MID-AMERICA APARTMENT COMM	13.334	2,133	288,089
MACERICH CO/THE	24.63	228	30,792
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	19.96	1,370	185,051
NATL HEALTH INVESTORS INC	5.301	299	40,422
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	20.305	804	108,640
REALTY INCOME CORP	65.408	4,106	554,481
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	12.986	333	45,023
PENN REAL ESTATE INVEST TST	7.636	2	298
PUBLIC STORAGE	17.638	5,253	709,248
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2.325	432	58,366
REGENCY CENTERS CORP	17.815	1,008	136,134
RPT REALTY	10.289	99	13,391
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	12.022	174	23,615
SL GREEN REALTY CORP	7.411	364	49,167
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	29.173	53	7,247
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3.682	58	7,918
UDR INC	34.575	1,463	197,548
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.565	77	10,515
WP CAREY INC	22.036	1,784	240,892
WASHINGTON REIT	9.785	216	29,182
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4.132	23	3,218
AGREE REALTY CORP	8.241	552	74,545
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	27.628	764	103,173
CUBESMART	25.297	983	132,754
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	25.358	262	35,399
DIGITAL REALTY TRUST INC	32.809	4,087	551,788
CEDAR REALTY TRUST INC	1.501	37	5,064
EXTRA SPACE STORAGE INC	15.48	2,457	331,759
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4.032	40	5,454
CENTERSPACE	1.734	133	18,059
KITE REALTY GROUP TRUST	25.32	440	59,481
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1.965	50	6,767
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	16.088	1,036	139,922
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4.549	82	11,165
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	24.35	216	29,192
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	68.999	1,030	139,174
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	11.605	46	6,267
DOUGLAS EMMETT INC	20.288	459	62,095
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	2,922,589 149銘柄	113,621 <74.6%>
(カナダ)		千カナダ・ドル	千円
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2	14	1,475

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千カナダ・ドル	千円
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	4.6	16	1,754
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	5.6	22	2,316
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	3.6	36	3,833
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	5.725	73	7,629
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	7.1	85	8,922
SLATE GROCERY REIT	3.6	51	5,326
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	6.7	113	11,847
SLATE OFFICE REIT	4.9	22	2,384
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2.5	38	4,011
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	13	158	16,499
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	11	185	19,370
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5.5	33	3,478
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2.4	31	3,261
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4	316	33,014
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	14.6	178	18,636
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	8.1	99	10,415
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	13	185	19,303
CHOICE PROPERTIES REIT	19.8	271	28,244
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2.4	40	4,251
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	6.2	98	10,284
PLAZA RETAIL REIT	6.3	27	2,822
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	8.8	239	24,913
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10.5	463	48,337
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	17.1	216	22,575
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	18.7	376	39,185
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3	58	6,126
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2.7	119	12,463
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6.1	96	10,011
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7.7	265	27,712
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	227.225 30銘柄	3,938 <2.0%>
(オーストラリア)	千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU	132.82	1,204	112,155
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	33.012	51	4,794
HOME CONSORTIUM LTD	21.693	98	9,189
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	46.291	38	3,555
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	39.378	123	11,474
CROMWELL PROPERTY GROUP	167.757	117	10,932
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	65.291	191	17,810
RURAL FUNDS GROUP	45.313	121	11,348
WAYPOINT REIT	87.433	196	18,315
CHARTER HALL LONG WALE REIT	75.404	327	30,467
CENTURIA OFFICE REIT	52.359	91	8,530
CENTURIA CAPITAL GROUP	75.235	145	13,553
IRONGATE GROUP	65.105	123	11,455
HOMECO DAILY NEEDS REIT	176.023	219	20,402
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	137.848	365	34,009
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	34.802	121	11,275
NATIONAL STORAGE REIT	133.591	287	26,740
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	26.502	70	6,563
GDI PROPERTY GROUP	64.299	61	5,746
SCENTRE GROUP	640.95	1,634	152,164
ARENA REIT	41.056	159	14,830
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	22.847	73	6,806
BWP TRUST	58.372	214	19,998
GPT GROUP	236.551	984	91,615
CHARTER HALL RETAIL REIT	64.281	244	22,741
MIRVAC GROUP	486.873	998	92,922
STOCKLAND	294.787	1,061	98,800
ABACUS PROPERTY GROUP	45.39	122	11,409
GOODMAN GROUP	209.94	3,760	350,058
VICINITY CENTRES	477.829	833	77,627
CHARTER HALL GROUP	57.635	658	61,277
INGENIA COMMUNITIES GROUP	43.391	154	14,421
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,160.058 32銘柄	1,382,995 <6.7%>
(香港)	千口	千香港・ドル	千円
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	289	884	15,210
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	128	483	8,322
FORTUNE REIT	183	1,237	21,277
PROSPERITY REIT	156	413	7,110

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
LINK REIT	千口 255.7	千香港・ドル 17,489	千円 300,825
CHAMPION REIT	241	845	14,549
香港・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 > 1,252.7 6銘柄	21,354	367,296 <1.8%>
(シンガポール)	千口	千シンガポール・ドル	千円
KEPPEL DC REIT	163.3	315	30,555
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	153.8	43	4,249
AIMS APAC REIT	57.8	78	7,565
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	355.3	454	44,091
SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT	66.4	52	5,085
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	203.2	159	15,464
EC WORLD REIT	32.9	19	1,881
IREIT GLOBAL	64.5	39	3,814
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRUST	414.7	1,140	110,564
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	628.4	1,332	129,157
SUNTEC REIT	265.6	438	42,487
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	390.1	631	61,268
KEPPEL REIT	243	274	26,621
ASCOTT RESIDENCE TRUST	238.7	269	26,150
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	621.4	248	24,097
CDL HOSPITALITY TRUSTS	103.4	129	12,530
FRASERS CENTREPOINT TRUST	132.4	295	28,624
STARHILL GLOBAL REIT	166.8	95	9,217
CAPITALAND CHINA TRUST	133.9	151	14,669
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	45.9	220	21,360
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	236.7	572	55,534
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	267.2	470	45,592
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	124.3	79	7,712
SPH REIT	113	106	10,298
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	284.1	109	10,604
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 > 5,506.8 25銘柄	7,727	749,200 <3.6%>
(ニュージーランド)	千口	千ニュージーランド・ドル	千円
ARGOSY PROPERTY LTD	107.307	126	10,584
KIWI PROPERTY GROUP LTD	199.256	189	15,891
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	54.226	145	12,222
GOODMAN PROPERTY TRUST	132.996	266	22,385
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	164.981	219	18,420
ニュージーランド・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 > 658.766 5銘柄	947	79,505 <0.4%>
(イギリス)	千口	千イギリス・ポンド	千円
ASSURA PLC	347.117	230	37,387
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	71.016	62	10,102
STANDARD LIFE INV PROP INC	51.354	40	6,630
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	100.969	81	13,249
PICTON PROPERTY INCOME LTD	64.471	61	9,903
REGIONAL REIT LTD	54.681	43	7,069
NEWRIVER REIT PLC	39.166	34	5,597
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES	101.897	151	24,528
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	73.284	58	9,521
CUSTODIAN REIT PLC	51.902	53	8,705
PRS REIT PLC/THE	64.664	69	11,202
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	45.413	55	8,987
LXI REIT PLC	109.114	155	25,239
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	46.825	40	6,630
AEW UK REIT PLC	20.041	24	3,933
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST	94.111	108	17,555
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	117.956	149	24,204
HOME REIT PLC	66.127	75	12,206
LAND SECURITIES GROUP PLC	88.454	647	104,970
SEGRO PLC	141.566	1,351	219,254
HAMMERSON PLC	417.915	95	15,496
UNITE GROUP PLC/THE	46.99	497	80,719
BRITISH LAND CO PLC	110.429	559	90,745
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	29.888	185	30,058
DERWENT LONDON PLC	13.211	364	59,188
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	156.924	214	34,720
WORKSPACE GROUP PLC	16.231	106	17,297
SAFESTORE HOLDINGS PLC	24.82	251	40,864
SHAFTESBURY PLC	33.926	194	31,588

先進国リート・インデックス（為替ヘッジあり）マザーファンド

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千円	千イギリス・ポンド	千円
BIG YELLOW GROUP PLC	20.359	254	41,280
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	115.214	265	43,059
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	71.398	40	6,497
TRITAX BIG BOX REIT PLC	219.898	398	64,597
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	3,027.331 6.923	1,122.994 <5.5%>
(イスラエル)	千円	千イスラエル・シケル	千円
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	26.7	243	9,494
REIT 1 LTD	25.897	458	17,850
イスラエル・シケル通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	52.597 2銘柄	27.344 <0.1%>
(韓国)	千円	千韓国・ウォン	千円
SK REITS LTD	7.476	50,238	5,254
D&D PLATFORM REIT LTD	6.865	35,698	3,734
JR GLOBAL	2.822	588	61
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	7.432	58,712	6,141
LOTTE REIT CO LTD	15.417	92,347	9,659
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	11.781	56,195	5,878
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	3.918	22,724	2,376
JR REIT XXVII	14.711	80,910	8,463
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5.393	33,868	3,542
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	18.659	116,991	12,237
韓国・ウォン通貨計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	94.474 10銘柄	57.349 <0.3%>
ユーロ (アイルランド)	千円	千ユーロ	千円
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	53.167	68	9,686
HIBERNIA REIT PLC	76.097	121	17,121
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	129.264 2銘柄	26.808 <0.1%>
ユーロ (オランダ)	千円	千ユーロ	千円
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	4.541	101	14,245
WERELDHAVE NV	4.993	70	9,884
NSI NV	2.198	75	10,692
VASTNED RETAIL NV	2.242	50	7,055
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	13.974 4銘柄	41.877 <0.2%>
ユーロ (ベルギー)	千円	千ユーロ	千円
AEDIFICA	4.175	396	55,786
COFINIMMO	3.389	381	53,729
BEFIMMO	2.813	132	18,615
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	2.935	72	10,248
RETAIL ESTATES	1.308	80	11,289
WAREHOUSES DE PAUW SCA	16.147	496	69,932
CARE PROPERTY INVEST	3.339	77	10,883
XIOR STUDENT HOUSING NV	2.396	98	13,932
MONTEA NV	1.175	99	14,045
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	37.677 9銘柄	258.463 <1.3%>
ユーロ (フランス)	千円	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13.386	716	100,834
ICADE	3.682	173	24,448
CARMILA	5.596	74	10,542
ALTAREA	0.528	66	9,411
GECINA SA	6.251	598	84,229
KLEPIERRE	22.429	422	59,433
COVIVIO	5.437	308	43,405
MERCIALYS	6.169	50	7,066
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	63.478 8銘柄	339.371 <1.7%>
ユーロ (ドイツ)	千円	千ユーロ	千円
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1.766	22	3,167
HAMBORNER REIT AG	8.773	72	10,240
国 小 計	□ 数、金 額 銘柄 数 < 比 率 >	10.539 2銘柄	13.407 <0.1%>
ユーロ (スペイン)	千円	千ユーロ	千円
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7.263	35	4,969
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	31.023	201	28,348

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	千口 38.351	千ユーロ 370	千円 52,108
国 小 計	□ 数、金 額 76.637 銘柄数 < 比率 > 3 銘柄	606	85,426 <0.4%>
ユーロ（イタリア） COIMA RES SPA IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZI	千口 2.686 6.703	千ユーロ 26 23	千円 3,728 3,317
国 小 計	□ 数、金 額 9.389 銘柄数 < 比率 > 2 銘柄	50	7,046 <0.0%>
ユーロ（その他） CROMWELL REIT EUR	千口 38.3	千ユーロ 77	千円 10,947
国 小 計	□ 数、金 額 38.3 銘柄数 < 比率 > 1 銘柄	77	10,947 <0.1%>
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金 額 379.258 銘柄数 < 比率 > 31 銘柄	5,563	783,349 <3.8%>
合 計	□ 数、金 額 18,281.798 銘柄数 < 比率 > 323 銘柄	—	20,320,475 <98.8%>

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3)先物取引の銘柄別残高（評価額）

銘柄別	2022年6月15日現在	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
DJ US REAL ESTATE （アメリカ）	379	—
STOXX 600 REAL（ドイツ）	95	—

(注1) 外貨建の評価額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

運用報告書 第17期（決算日 2021年11月30日）

（作成対象期間 2020年12月1日～2021年11月30日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

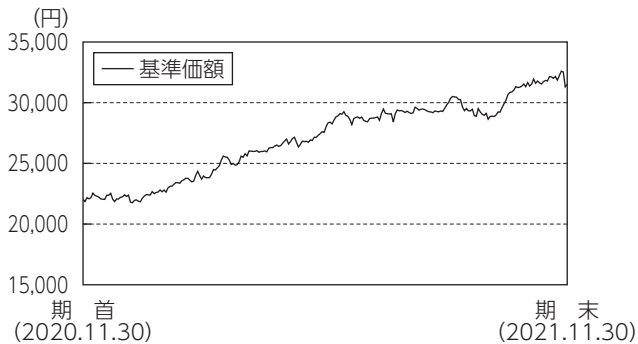
運用方針	S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）に連動した投資成果をめざして運用を行いません。
主要投資対象	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券
投資信託証券組入制限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	不動産 投資信託 先物比率
	円	騰落率 (ベンチマーク)	騰落率 (ベンチマーク)	%	%	%	%
(期首)2020年11月30日	22,044	-	25,605	-	0.5	97.0	2.5
12月末	22,276	1.1	25,887	1.1	0.7	97.1	2.2
2021年1月末	22,806	3.5	26,474	3.4	1.0	96.6	2.4
2月末	24,006	8.9	27,999	9.3	0.9	96.6	2.4
3月末	25,793	17.0	29,872	16.7	0.7	97.0	2.3
4月末	27,005	22.5	31,406	22.7	1.6	96.7	1.8
5月末	27,611	25.3	32,186	25.7	0.7	97.7	1.7
6月末	28,466	29.1	33,118	29.3	0.8	97.6	1.7
7月末	29,191	32.4	34,044	33.0	2.0	96.3	1.7
8月末	29,804	35.2	34,715	35.6	1.5	97.0	2.0
9月末	29,119	32.1	33,918	32.5	0.5	97.5	2.0
10月末	31,656	43.6	36,792	43.7	1.3	95.9	2.9
(期末)2021年11月30日	31,508	42.9	36,654	43.1	0.9	97.0	2.3

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

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：22,044円 期末：31,508円 騰落率：42.9%

【基準価額の主な変動要因】

米国を中心としたリート市況の上昇等を受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

◆投資環境について

○海外リート市況

海外リート市況は上昇しました。

海外リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン開発で高い効果を示す結果が報告され、経済活動正常化への期待が高まったことなどから、上昇しました。2021年に入っても、各国におけるワクチン接種の進展や渡航制限、行動規制の緩和などにより、上昇傾向が続きました。しかし9月に入ると、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念から世界的に市場心理が悪化したことに加えインフレの長期化が懸念されて長期金利が急上昇したことで、売られる展開となりました。10月以降は、好調な決算発表や米国長期金利の低下に加え、中国大手不動産会社に対する信用不安の後退などから、再度上昇に転じました。当作成期末にかけては、新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念から、不安定な相場展開となりました。

○為替相場

為替相場は上昇（円安）しました。

対円為替相場は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展などで市場のリスク選好度が強まったこと、および円安傾向となりました。2021年に入っても、米国の追加経済対策への期待が高まったこと、世界的にワクチン接種が進み感染状況が改善基調にあったことなどから、おおむね円安傾向となりました。7月以降は、新型コロナウイルスの変異株の影響により世界的に感染が再拡大し、景気回復への不透明感が高まったことなどから、円高に転じました。しかし9月以降は、インフレ懸念から世界的に金利が上昇したことで日本との金利差拡大などが意識され、再度円安が進行しました。当作成期末にかけては、新たな変異株への懸念から、おおむね円高となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

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

◆ポートフォリオについて

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

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

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は43.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は42.9%となりました。

配当に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナスに作用しました。

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

*ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）です。

《今後の運用方針》

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

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

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

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	4円
（先物・オプション）	(1)
（投資信託受益証券）	(1)
（投資信託証券）	(2)
有価証券取引税	3
（投資信託受益証券）	(0)
（投資信託証券）	(3)
その他費用	17
（保管費用）	(7)
（その他）	(10)
合計	23

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 投資信託受益証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	買		付		売		付	
	口数	金額	口数	金額	口数	金額	口数	金額
外	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	716.6 (-)	70,733 (-)	700.15 (-)	69,035 (-)				

(注1) 金額は受渡し代金。

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

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

(注4) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

	買		付		売		付	
	口数	金額	口数	金額	口数	金額	口数	金額
外	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
アメリカ	1,438.7 (△ 249.81)	59,811 (△ 1,626)	217.753 (-)	12,693 (-)				
カナダ	119.6 (△ 10.8)	2,136 (△ 198)	15.2 (-)	327 (-)				
オーストラリア	1,952.08 (4,741)	8,098 (27)	586.648 (-)	2,691 (-)				
香港	329.7 (-)	8,843 (-)	19 (-)	1,361 (-)				
シンガポール	3,018.1 (891.885)	4,660 (42)	2,182.22 (-)	1,219 (-)				
ニュージーランド	291.95 (-)	526 (-)	- (-)	- (-)				
イギリス	1,536.61 (△ 69.036)	3,619 (△ 65)	128.23 (-)	616 (-)				
国	千口	千イスラエル・シェケル	千口	千イスラエル・シェケル				
イスラエル	20 (-)	349 (-)	- (-)	- (-)				

		買		付		売		付	
		口数	金額	口数	金額	口数	金額	口数	金額
外	韓国	千口 93.93 (20.575)	千韓国ウォン 577,802 (34,813)	千口 -	千韓国ウォン -	千口 -	千韓国ウォン -	千口 -	千韓国ウォン -
	ユーロ (アイルランド)	千口 63 (-)	千ユーロ 80 (-)	千口 -	千ユーロ -	千口 -	千ユーロ -	千口 -	千ユーロ -
	ユーロ (オランダ)	千口 5.55 (0.457)	千ユーロ 106 (-)	千口 -	千ユーロ -	千口 -	千ユーロ -	千口 -	千ユーロ -
	ユーロ (ベルギー)	千口 21.07 (0.68)	千ユーロ 1,141 (28)	千口 2.88 (-)	千ユーロ 194 (-)				
	ユーロ (フランス)	千口 37.9 (0.13)	千ユーロ 1,661 (17)	千口 9.98 (-)	千ユーロ 613 (-)				
	ユーロ (ドイツ)	千口 16.94 (-)	千ユーロ 226 (△ 21)	千口 2.6 (-)	千ユーロ 46 (-)				
	ユーロ (スペイン)	千口 43.07 (-)	千ユーロ 357 (△ 37)	千口 9.5 (-)	千ユーロ 89 (-)				
	ユーロ (イタリア)	千口 12.19 (-)	千ユーロ 62 (-)	千口 -	千ユーロ -				
	ユーロ (その他)	千口 70 (△ 283.68)	千ユーロ 54 (-)	千口 -	千ユーロ -				
国	ユーロ (ユーロ通貨計)	千口 269.72 (△ 282.413)	千ユーロ 3,690 (△ 13)	千口 24.96 (-)	千ユーロ 945 (-)				

(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

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

種類別	買		建		売		建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
不動産投信指数先物取引	4,583	4,460	-	-	-	-	-	-

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当				期				
買		付		売		付		
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
		千口	千円	円		千口	千円	円
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)		716.6	7,762,024	10,831	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	700.15	7,590,754	10,841

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

当				期				
買		付		売		付		
銘柄	柄	口数	金額	平均単価	銘柄	口数	金額	平均単価
		千口	千円	円		千口	千円	円
PROLOGIS INC (アメリカ)		36.6	448,224	12,246	PROLOGIS INC (アメリカ)	9.3	126,652	13,618
EQUINIX INC (アメリカ)		4.7	378,799	80,595	EQUINIX INC (アメリカ)	1.1	93,308	84,825
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)		16.8	259,246	15,431	GOODMAN GROUP (オーストラリア)	42.049	74,392	1,769
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT (アメリカ)		11.3	221,399	19,592	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	2	65,114	32,557
PUBLIC STORAGE (アメリカ)		7.6	221,005	29,079	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	4.4	61,403	13,955
SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)		17.4	212,800	12,229	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	3.6	59,690	16,580
REALTY INCOME CORP (アメリカ)		28.2	199,312	7,067	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD (フランス)	6.46	56,998	8,823
WELLTOWER INC (アメリカ)		21.1	172,105	8,156	UDR INC (アメリカ)	8.6	49,608	5,768
GOODMAN GROUP (オーストラリア)		104.78	170,916	1,631	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	5.7	49,572	8,696
SUN COMMUNITIES INC (アメリカ)		9.5	167,703	17,653	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	2	46,515	23,257

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 外国投資信託受益証券

銘柄	柄	期首		期末	
		口数	口数	評価額	評価額
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(アメリカ)		17.5	33.95	3,693	420,239
VANGUARD REAL ESTATE ETF		17.5	33.95	3,693	420,239
合計		17.5	33.95	3,693	420,239
		銘柄数<比率>	1銘柄	1銘柄	<0.9%>

(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) 外国投資信託証券

銘柄	柄	期首		期末	
		口数	口数	評価額	評価額
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
(シンガポール)		320.562	364.562	258	29,448
MANULIFE US REAL ESTATE INV		151.4	193.4	152	17,382
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		90	90	3	350
EAGLE HOSPITALITY TRUST		99	147	121	13,797
PRIME US REIT					
(アメリカ)		29.5	33.2	714	81,246
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST		13.7	-	-	-
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP		21.982	28.682	499	56,876
URBAN EDGE PROPERTIES		25.4	28.8	461	52,523
XENIA HOTELS & RESORTS INC		31.4	36	8,668	986,167
AVALONBAY COMMUNITIES INC		71.847	84.847	13,570	1,543,907
SIMON PROPERTY GROUP INC		31.4	36.7	4,049	460,709
BOSTON PROPERTIES INC		32.467	36.789	280	31,893
APARTMENT INV T & MGMT CO -A		35.064	41.064	1,707	194,255
VORNADO REALTY TRUST		18	21.2	444	50,529
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI		13.9	21.1	1,307	148,761
NATIONAL STORAGE AFFILIATES		4.8	5.5	423	48,187
NEXPOINT RESIDENTIAL		13.6	-	-	-
QTS REALTY TRUST INC-CL A		76.5	88	7,587	863,213
EQUITY RESIDENTIAL		43.8	54.8	843	95,950
APPLE HOSPITALITY REIT INC		16.1	18.9	895	101,878
EPR PROPERTIES		3.5	7.1	106	12,164
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH		9.3	10.9	184	20,945
CITY OFFICE REIT INC		19,833	25,933	374	42,603
GLOBAL NET LEASE INC		19.6	23.2	19,024	2,164,360
EQUINIX INC		15,529	19,829	539	61,361
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST		7.4	10.8	133	15,137
CHATHAM LODGING TRUST		7.1	8.8	129	14,697
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT		12.3	14.2	1,153	131,213
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES		25.7	31.4	558	63,516
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN		4.9	6	261	29,700
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I		-	13.1	60	6,900
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC		157.6	184.3	3,026	344,291
HOST HOTELS & RESORTS INC		59,008	70,708	2,874	327,006
AMERICAN HOMES 4 RENT- A		9.5	11.4	1,953	222,263
CORESITE REALTY CORP					

銘柄	柄	期首		期末	
		口数	口数	評価額	評価額
		千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN		34.1	39.4	973	110,718
RLJ LODGING TRUST		35.871	41.871	540	61,498
FARMLAND PARTNERS INC		2.9	6.7	78	8,987
PHYSICIANS REALTY TRUST		46.1	56.1	1,015	115,587
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN		14	15.7	224	25,506
CYRUSONE INC		25.9	32	2,860	325,400
KIMCO REALTY CORP		94.4	158.362	3,686	419,432
GLOBAL MEDICAL REIT INC		9.8	15.6	256	29,142
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A		48.85	56.55	1,923	218,874
WHITESTONE REIT		8.5	11.2	106	12,066
GAMING AND LEISURE PROPERTIE		46.349	57.437	2,629	299,154
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A		27.2	32.3	575	65,447
PARK HOTELS & RESORTS INC		51.68	61.08	1,097	124,874
DIGITALBRIDGE GROUP INC		105.011	126.711	1,046	119,075
INVITATION HOMES INC		125.297	148.797	6,140	698,644
JBG SMITH PROPERTIES		25.132	29.932	857	97,597
ALEXANDER & BALDWIN INC		16.5	18.7	417	47,507
CLIPPER REALTY INC		1.4	1.4	12	1,427
GLADSTONE LAND CORP		4.5	6.4	183	20,889
AMERICOLD REALTY TRUST		45.1	67.4	2,183	248,446
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT		14.3	16.9	376	42,818
VICI PROPERTIES INC		118.2	157.4	4,427	503,735
RETAIL VALUE INC		2.815	4.49	27	3,075
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A		12.5	-	-	-
BRT APARTMENTS CORP		1.3	2.9	54	6,222
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP		10.1	-	-	-
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER		4.9	6.1	1,619	184,290
SAFEHOLD INC		3.2	3.3	233	26,599
WASHINGTON PRIME GROUP INC		29.96	-	-	-
AMERICAN FINANCE TRUST INC		22.4	29.6	239	27,243
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY		22.9	30.5	834	94,973
CORECIVIC INC		25.224	-	-	-
COREPOINT LODGING INC		6.7	10.7	165	18,832
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC		3.4	7.4	225	25,661
STORE CAPITAL CORP		50.5	63.1	2,128	242,215

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2.4	5.9	41	4,752
BROADSTONE NET LEASE INC	-	41	1,042	118,573
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	22.4	25.3	231	26,337
LIFE STORAGE INC	10.4	20.25	2,708	308,138
AMERICAN ASSETS TRUST INC	10.1	13.2	464	52,892
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	20.082	26.582	664	75,545
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	9.2	12.2	165	18,835
PARAMOUNT GROUP INC	36.4	40.2	332	37,869
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29.2	36.5	346	39,366
NETSTREIT CORP	-	9.9	216	24,655
APARTMENT INCOME REIT CO	-	40.489	2,100	238,935
CTO REALTY GROWTH INC	-	1.2	66	7,605
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	27.4	35.6	2,527	287,565
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	23.7	29.7	568	64,639
STAG INDUSTRIAL INC	32.5	41.8	1,816	206,630
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	-	2.6	46	5,324
INDUS REALTY TRUST INC	-	1.1	81	9,324
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	-	3.2	56	6,411
ORION OFFICE REIT INC	-	14.223	264	30,097
VENTAS INC	83.379	101.629	4,992	567,941
CARETRUST REIT INC	21.503	24.503	494	56,255
GEO GROUP INC/THE	27.4	31.6	269	30,630
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	64.3	76.7	1,794	204,104
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	10.6	11.8	284	32,313
SABRA HEALTH CARE REIT INC	44.987	56.987	742	84,478
UMH PROPERTIES INC	8.6	10.6	245	27,966
IRON MOUNTAIN INC	63.8	74.7	3,500	398,245
TERRENO REALTY CORP	15.2	18.2	1,389	158,049
VEREIT INC	240.908	-	-	-
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22.32	30.72	1,406	160,071
SUN COMMUNITIES INC	21.8	29.9	5,882	669,289
ACADIA REALTY TRUST	17.011	22.811	487	55,433
ALEXANDER'S INC	0.4	0.5	129	14,760
PROLOGIS INC	163.619	190.919	29,264	3,329,372
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	26.2	35.8	7,348	836,017
BRANDYWINE REALTY TRUST	38.3	43.3	578	65,814
SAUL CENTERS INC	2.4	3.2	160	18,316
MACCK-CALI REALTY CORP	20.2	20.1	343	39,081
CAMDEN PROPERTY TRUST	21.8	26	4,390	499,461
COUSINS PROPERTIES INC	32.906	38.406	1,480	168,486
SITE CENTERS CORP	31.878	46.278	722	82,240
DUKE REALTY CORP	82.1	97.7	5,808	660,806
EASTGROUP PROPERTIES INC	8.7	10.4	2,128	242,202
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14.467	16.767	5,809	660,977
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	27.8	33.3	2,032	231,290
FEDERAL REALTY INVS TRUST	15.4	18.1	2,280	259,443
GETTY REALTY CORP	7.703	9.803	302	34,440
WELLTOWER INC	93.2	109.1	8,950	1,018,305
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	120.3	139.2	4,741	539,400
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23.1	26.9	1,182	134,505
SERVICE PROPERTIES TRUST	36.5	41.7	372	42,413
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30.1	37.6	1,187	135,048
EQUITY COMMONWEALTH	27.375	31.475	804	91,563
KILROY REALTY CORP	23.2	27.1	1,762	200,560
LTC PROPERTIES INC	8.4	9.6	306	34,851
LEXINGTON REALTY TRUST	60	70.1	1,055	120,027
MID-AMERICA APARTMENT COMM	25.328	29.928	6,284	715,030
MACERICH CO/THE	21.979	54.979	1,089	123,910
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	37.5	44.1	3,740	425,563
NATL HEALTH INVESTORS INC	9.6	11.9	622	70,793
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	38.4	45.3	2,057	234,084
REALTY INCOME CORP	77.117	142.239	9,928	1,129,540
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	24	28.5	731	83,233
PENN REAL ESTATE INVEST TST	-	17	20	2,359
PUBLIC STORAGE	33.8	39.4	13,076	1,487,709
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4.3	5.1	892	101,586
REGENCY CENTERS CORP	34.92	39.52	2,796	318,150
RPT REALTY	17.8	21.1	276	31,471
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17.6	26.3	532	60,620
SL GREEN REALTY CORP	16.4	17.357	1,222	139,118
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	49	57.5	162	18,513
TAUBMAN CENTERS INC	13.3	-	-	-
URSTADT BIDDLE - CLASS A	6	7.6	144	16,462
UDR INC	65.3	72	4,137	470,762
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2.6	3.1	173	19,753
WP CAREY INC	38.5	47.6	3,748	426,466
WASHINGTON REIT	17.8	21.6	553	62,934
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	25.9	-	-	-
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	-	7	78	8,903
AGREE REALTY CORP	11.7	17.8	1,236	140,684
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50.748	61.648	1,711	194,700
CUBESMART	43.3	52.1	2,862	325,711
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45.526	56.326	636	72,412
DIGITAL REALTY TRUST INC	59.778	72.978	12,317	1,401,413

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
CEDAR REALTY TRUST INC	-	3.1	68	7,783
EXTRA SPACE STORAGE INC	28.6	34.5	7,005	796,984
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7.875	7.875	72	8,206
CENTERSPACE	2.46	3.66	377	42,930
KITE REALTY GROUP TRUST	18.95	55.741	1,133	128,925
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	21	24.9	517	58,838
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2.233	3.633	120	13,726
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	30.5	35.9	1,884	214,428
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6.3	8.8	193	22,025
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	42.342	54.342	498	56,693
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	117.1	153.8	3,305	376,028
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	21	21	124	14,167
DOUGLAS EMMETT INC	36.5	45.3	1,517	172,651
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	46.7	-	-	-
アメリカ・ドル	□ 数、金額	5,540.075	6,511.212	315,743
通貨計	銘柄数<比率>	155銘柄	157銘柄	<73.9%>
(カナダ)	千口	千口	千カナダ・ドル	千円
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	-	4.2	39	3,557
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	-	9.4	38	3,431
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	-	11.4	50	4,477
NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT UNITS	-	4.3	52	4,694
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	13.1	17.1	197	17,614
SLATE GROCERY REIT	8.1	7	93	8,335
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	10.2	14.7	337	30,126
SLATE OFFICE REIT	5.1	5.1	25	2,262
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4.2	4.2	93	8,311
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	19.7	28	382	34,115
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	17.6	22.2	514	45,952
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	11.2	11.2	81	7,277
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	8.5	-	-	-
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	4.1	4.1	55	4,940
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6.2	8.5	858	76,622
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	18.3	27	452	40,416
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	16.2	17.5	298	26,617
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	24.7	27.6	508	45,379
CHOICE PROPERTIES REIT	36.8	43.2	628	56,143
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4.2	4.2	75	6,718
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	11.9	14.1	244	21,785
PLAZA RETAIL REIT	11.1	11.1	51	4,587
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	16.3	19.1	592	52,850
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	19.5	22.8	1,332	118,973
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21.79	21.79	252	22,522
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	32.566	38.166	620	55,358
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	34.3	42	929	82,926
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	5.4	7.2	162	14,460
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4.7	5.9	325	29,033
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	9.5	12.3	216	19,355
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13.3	16.8	723	64,541
カナダ・ドル	□ 数、金額	388.556	482.156	10,232
通貨計	銘柄数<比率>	27銘柄	30銘柄	<1.9%>
(オーストラリア)	千口	千口	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS/AU	-	284.343	3,085	250,789
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	78.38	93.38	344	28,010
CROMWELL PROPERTY GROUP	435.284	371.284	317	25,805
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	95.11	144.87	533	43,337
AVENTUS GROUP	88	103	342	27,881
RURAL FUNDS GROUP	78.595	108.595	321	26,129
WAYPOINT REIT	177.83	202.491	532	43,291
CHARTER HALL LONG WALE REIT	98.668	149.458	720	58,560
CENTURIA OFFICE REIT	84.95	118.83	263	21,444
CENTURIA CAPITAL GROUP	97.59	166.05	524	42,654
IRONGATE GROUP	119.63	149.63	235	19,157
HOME CONSORTIUM	35	48	363	29,537
HOMECO DAILY NEEDS REIT	17.5	130.34	183	14,939
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	241.86	291.52	816	66,353
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	70.547	79.167	323	26,256
NATIONAL STORAGE REIT	206.195	288.195	708	57,631
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	29.76	54.67	179	14,576
GDI PROPERTY GROUP	123.31	123.31	135	10,976
SCENTRE GROUP	1,194.91	1,372.159	4,171	339,090
ARENA REIT	79.89	93.89	415	33,811
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	38.3	47.12	160	13,023
BWP TRUST	105.55	123.87	510	41,485
DEXUS	251.73	-	-	-
GPT GROUP	444	506.413	2,628	213,653
CHARTER HALL RETAIL REIT	120.4	139.51	574	46,723
MIRVAC GROUP	908.06	1,042.307	3,022	245,714
STOCKLAND	550.01	631.087	2,745	223,159
ABACUS PROPERTY GROUP	81.12	107.93	385	31,321
GOODMAN GROUP	381.71	444.441	10,911	886,957
VICINITY CENTRES	878.9	1,022.946	1,733	140,948
CHARTER HALL GROUP	105.06	123.136	2,335	189,884
INGENIA COMMUNITIES GROUP	68.66	94.74	582	47,363
オーストラリア・ドル	□ 数、金額	7,286.509	8,656.682	40,109
通貨計	銘柄数<比率>	31銘柄	31銘柄	<6.7%>

ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額
(香港)	千口	千口	千香港ドル	千円
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	349	398	1,337	19,510
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	193	250	1,135	16,559
FORTUNE REIT	311	378	3,046	44,451
PROSPERITY REIT	300	300	930	13,568
LINK REIT	476.9	564.6	38,788	565,917
CHAMPION REIT	431	481	1,972	28,772
香港ドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	2,060.9 6銘柄	2,371.6 6銘柄	47,209 688,780 < 1.4%>
(シンガポール)	千口	千口	千シンガポールドル	千円
KEPPEL DC REIT	293.783	331.683	786	65,410
FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	126.2	419.876	123	10,306
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	455	583.9	589	49,072
AIMS APAC REIT	89	119	166	13,862
FRASERS HOSPITALITY TRUST	121.8	-	-	-
FRASERS LOGISTICS & COMMERC	591.19	783.99	1,160	96,548
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	86	134	119	9,923
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	208.9	208.9	181	15,122
EC WORLD REIT	57	57	46	3,889
IREIT GLOBAL	105.124	175.124	111	9,253
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	722.377	905.877	2,708	225,380
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,029.422	1,346.522	2,881	239,774
SUNTEC REIT	473.4	565.4	853	71,040
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	608.2	770.8	1,472	122,504
KEPPEL REIT	375.4	501.4	556	46,310
ASCOTT RESIDENCE TRUST	417.456	505.456	505	42,058
ESR-REIT	559.902	709.902	340	28,354
CDL HOSPITALITY TRUSTS	161.6	191.6	216	18,015
FRASERS CENTREPOINT TRUST	211.776	281.176	649	54,046
STARHILL GLOBAL REIT	308.8	383.8	247	20,598
CAPITALAND CHINA TRUST	179.396	269.442	320	26,680
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	86.3	98.3	491	40,897
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	467.2	-	-	-
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	384.78	513.769	1,376	114,571
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	244.5	354.5	317	26,400
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	498.484	579.884	1,211	100,846
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	182.1	248.1	145	12,076
SPH REIT	220.6	275.6	278	23,162
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	202.1	-	-	-
SABANA INDUSTRIAL REIT TRUST	219.4	-	-	-
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	541.063	651.063	289	24,107
(非上場)				
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	10.046	-	-	-
シンガポールドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	10,238.299 32銘柄	11,966.064 27銘柄	18,149 1,510,218 < 3.1%>
(ニュージーランド)	千口	千口	千ニュージーランドドル	千円
ARGOSY PROPERTY LTD	158.52	224.47	317	24,625
KIWI PROPERTY GROUP LTD	357.92	423.8	483	37,457
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	76.8	102.92	293	22,781
GOODMAN PROPERTY TRUST	248.22	299.22	725	56,256
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	245.82	328.82	506	39,259
ニュージーランドドル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	1,087.28 5銘柄	1,379.23 5銘柄	2,326 180,380 < 0.4%>
(イギリス)	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
ASSURA PLC	594.52	707.1	483	73,249
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	129.57	159.57	129	19,613
STANDARD LIFE INV PROP INC	100	100	74	11,276
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	177.71	220.71	168	25,589
PICTON PROPERTY INCOME LTD	121.11	146.11	145	22,011
REGIONAL REIT LTD	81.31	111.31	100	15,166
NEWRIVER REIT PLC	69.33	69.33	61	9,288
CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	183.29	224.81	374	56,696
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	135.49	155.49	143	21,680
CUSTODIAN REIT PLC	89.42	109.42	106	16,086
GCP STUDENT LIVING PLC	96.86	112.86	237	36,006
PRS REIT PLC/THE	-	119.64	123	18,676
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	67.9	90.9	107	16,366
LXI REIT PLC	118.038	180.188	269	40,800
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	75.2	98.2	93	14,124
AEW UK REIT PLC	25.61	49.61	55	8,451
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	180	201.12	206	31,274
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	150	207	251	38,118
HOME REIT PLC	-	60	70	10,684
RDI REIT PLC	41.036	-	-	-
LAND SECURITIES GROUP PLC	166.381	198.461	1,490	225,891
SEGRO PLC	263.74	317.05	4,494	681,138
HAMMERSON PLC	811.984	1,076.984	332	50,453
UNITE GROUP PLC/THE	87.26	105.39	1,143	173,306
BRITISH LAND CO PLC	208.52	247.76	1,291	195,788
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	53.581	67.061	483	73,280
DERWENT LONDON PLC	24.39	29.63	1,014	153,807
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	283.37	346.37	519	78,796
WORKSPACE GROUP PLC	26.46	32.26	263	39,896
SAFESTORE HOLDINGS PLC	46.35	54.57	731	110,826
SHAFTESBURY PLC	53.85	75.77	484	73,495
BIG YELLOW GROUP PLC	36.96	45.64	739	112,058

銘柄	期首		期末	
	□ 数	□ 数	外貨建金額	邦貨換算金額
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	千口	千口	千イギリス・ポンド	千円
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	203.15	237.15	645	97,763
TRITAX BIG BOX REIT PLC	121.6	121.6	63	9,657
イギリス・ポンド 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	5,194.25 33銘柄	6,533.594 34銘柄	17,987 2,726,240 < 5.6%>
(イスラエル)	千口	千口	千イスラエル・シェケル	千円
REIT 1 LTD	28.84	48.84	1,050	37,813
イスラエル・シェケル 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	28.84 1銘柄	48.84 1銘柄	1,050 37,813 < 0.1%>
(韓国)	千口	千口	千韓国ウォン	千円
ESR KENDALL SQUARE REIT LTD	-	13.16	987	94
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6	11.44	91,520	8,767
LOTTE REIT CO LTD	17.96	34.375	192,500	18,441
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	17.96	25.06	122,418	11,727
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	-	5.6	32,704	3,133
JR REIT XXVII	-	31.29	168,340	16,126
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	-	8.5	55,760	5,341
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	-	27	175,500	16,812
韓国ウォン 通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	41.92 3銘柄	156,425 8銘柄	839,729 80,446 < 0.2%>
ユーロ (アイルランド)	千口	千口	千ユーロ	千円
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	82.05	102.05	156	20,075
HIBERNIA REIT PLC	116.24	159.24	207	26,582
国小計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	198.29 2銘柄	261.29 2銘柄	363 46,658 < 0.1%>
ユーロ (オランダ)	千口	千口	千ユーロ	千円
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	-	9.887	176	22,725
WERELDHAVE NV	6.47	8.97	107	13,833
EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	8.23	-	-	-
NSI NV	3.231	4.131	141	18,115
VASTNED RETAIL NV	3.75	4.7	105	13,609
国小計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	21.681 4銘柄	27.688 4銘柄	531 68,284 < 0.1%>
ユーロ (ベルギー)	千口	千口	千ユーロ	千円
AEDIFICA	6.256	8.886	1,060	136,127
COFINIMMO	5.3	6.88	961	123,419
BEFIMMO	5.07	5.86	186	23,891
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	4.61	5.48	148	19,034
RETAIL ESTATES	1.94	2.54	175	22,537
WAREHOUSES DE PAUW SCA	25.48	34.45	1,420	182,345
CARE PROPERTY INVEST	4.9	6.1	156	20,052
XIOR STUDENT HOUSING NV	2.7	4.58	224	28,817
MONTEA NV	2.15	2.5	320	41,091
国小計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	58.406 9銘柄	77.276 9銘柄	4,651 597,318 < 1.2%>
ユーロ (フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円
ALTAREA RIGHTS	-	0.01	0	2
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	26.77	28.68	1,720	220,967
ICADE	5.94	7.67	488	62,689
CARMILA	10	11.8	151	19,455
ALTAREA	0.74	1.01	162	20,880
GEICINA SA	10.521	13.391	1,598	205,226
KLEPIERRE	39.94	48.64	926	119,014
COVIVIO	8.992	11.652	854	109,763
MERCIALYS	4.03	12.13	102	13,138
国小計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	106.933 8銘柄	134.983 9銘柄	6,005 771,140 < 1.6%>
ユーロ (ドイツ)	千口	千口	千ユーロ	千円
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	34.82	43.86	853	109,656
HAMBORNER REIT AG	11.98	17.28	163	21,050
国小計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	46.8 2銘柄	61.14 2銘柄	1,017 130,707 < 0.3%>
ユーロ (スペイン)	千口	千口	千ユーロ	千円
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	10.53	14.53	68	8,853
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	50.033	63.533	522	67,101
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	66.1	82.17	815	104,775
国小計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	126.663 3銘柄	160.233 3銘柄	1,407 180,730 < 0.4%>
ユーロ (イタリア)	千口	千口	千ユーロ	千円
COIMA RES SPA	-	5.19	37	4,818
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6.24	13.24	46	5,993
国小計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	6.24 1銘柄	18.43 2銘柄	84 10,811 < 0.0%>
ユーロ (その他)	千口	千口	千ユーロ	千円
CROMWELL REIT EUR	294.6	80.92	204	26,289
国小計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	294.6 1銘柄	80.92 1銘柄	204 26,289 < 0.1%>
ユーロ通貨計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	859.613 30銘柄	821.96 32銘柄	14,266 1,831,939 < 3.8%>
合計	□ 数、金額 銘柄数<比率>	32,726.242 323銘柄	38,927.763 331銘柄	- 47,151,826 < 97.0%>

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

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外国	百万円	百万円
DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	892	-
STOXX 600 REAL (ドイツ)	210	-

(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

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資信託受益証券	千円	%
投資信託証券	420,239	0.9
コール・ローン等、その他	47,151,826	96.7
投資信託財産総額	1,208,291	2.4
	48,780,356	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=113.77円、1カナダ・ドル=89.26円、1オーストラリア・ドル=81.29円、1香港ドル=14.59円、1シンガポール・ドル=83.21円、1ニュージーランド・ドル=77.53円、1イギリス・ポンド=151.56円、1イスラエル・シケル=36.011円、100韓国ウォン=9.58円、1ユーロ=128.41円です。
(注3) 当期末における外貨建純資産 (48,020,659千円) の投資信託財産総額 (48,780,356千円) に対する比率は、98.4%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	49,434,462,118円
コール・ローン等	751,562,447
投資信託受益証券(評価額)	420,239,075
投資信託証券(評価額)	47,151,826,564
未収入金	668,763,396
未収配当金	56,716,807
差入委託証拠金	385,353,829
(B) 負債	805,521,183
未払金	803,305,110
未払株式払込金	2,215,073
未払解約金	1,000
(C) 純資産総額(A-B)	48,628,940,935
元本	15,433,680,362
次期繰越損益金	33,195,260,573
(D) 受益権総口数	15,433,680,362口
1万口当り基準価額(C/D)	31,508円

* 期首における元本額は13,110,290,968円、当作成期間中における追加設定元本額は5,480,584,788円、同解約元本額は3,157,195,394円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：
 ダイワファンドラップ 外国REITインデックス (為替ヘッジあり) 6,291,808,323円
 ダイワファンドラップ 外国REITインデックス (為替ヘッジなし) 1,162,934,430円
 ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス (為替ヘッジあり) 333,980,799円
 ダイワファンドラップオンライン 外国REITインデックス (為替ヘッジなし) 289,623,388円
 D-I's グローバルREITインデックス 2,223,608円
 DCダイワ・ターゲットイヤー2050 8,326,903円
 iFree 外国REITインデックス 632,249,938円
 iFree 8資産バランス 1,462,352,614円
 グローバル・リート・インデックスファンド (資産形成型) 236,948,723円
 グローバル・リート・インデックスファンド (毎月決算型) 113,742,003円
 DCダイワ・グローバルREITインデックスファンド 3,300,676,766円
 DCダイワ・ターゲットイヤー2030 6,106,352円
 DCダイワ・ターゲットイヤー2040 5,186,807円
 ダイワバランスファンド2020-07 (適格機関投資家専用) 183,749,014円
 ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用) 184,925,099円
 ダイワ・インデックスセレクト グローバルREIT 243,151,995円
 ダイワ・ノーロード グローバルREITファンド 59,517,654円
 ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジあり) (ダイワSMA専用) 912,182,345円
 ダイワ外国REITインデックス (為替ヘッジなし) (ダイワSMA専用) 3,993,601円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は31,508円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月1日 至2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,170,369,078円
受取配当金	1,166,078,286
受取利息	273
その他収益金	4,393,512
支払利息	△ 102,993
(B) 有価証券売買損益	12,530,341,971
売買益	12,953,251,906
売買損	△ 422,909,935
(C) 先物取引等損益	199,972,869
取引益	211,186,295
取引損	△ 11,213,426
(D) その他費用	△ 24,978,913
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	13,875,705,005
(F) 前期繰越損益金	15,789,555,929
(G) 解約差損益金	△ 5,533,781,623
(H) 追加信託差損益金	9,063,781,262
(I) 合計(E+F+G+H)	33,195,260,573
次期繰越損益金(I)	33,195,260,573

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

ダイワファンドラップ 外国REITインデックス (為替ヘッジなし)

運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2022年6月15日)

(作成対象期間 2021年6月16日~2022年6月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/海外/不動産投信(リート)/インデックス型		
信託期間	無期限(設定日:2016年9月26日)		
運用方針	投資成果をS&P先進国REIT指数(除く日本)(円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの受益証券	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)および店頭登録(登録予定を含みます。)の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率		無制限
	マザーファンドの投資信託証券組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

<2737>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			S&P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証券 組入比率	不動産投信 指数 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2期末(2018年6月15日)	10,864	0	1.3	11,093	2.9	0.8	97.8	1.0	1,189
3期末(2019年6月17日)	11,931	0	9.8	12,298	10.9	0.6	98.2	1.0	1,667
4期末(2020年6月15日)	10,120	0	△ 15.2	10,533	△ 14.4	2.2	94.6	3.2	2,091
5期末(2021年6月15日)	14,252	0	40.8	14,945	41.9	0.9	97.3	1.7	3,226
6期末(2022年6月15日)	14,737	0	3.4	15,564	4.1	4.0	94.8	1.8	3,454

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) S & P 先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース) は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指数は、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスの持つグローバル・インデックスであるS & Pグローバル株価指数採用銘柄の中から、不動産業種に採用され、各国ごとのREIT制度に基づいて設立・運営されていると判定される銘柄を抽出して算出するインデックスです。

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

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

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

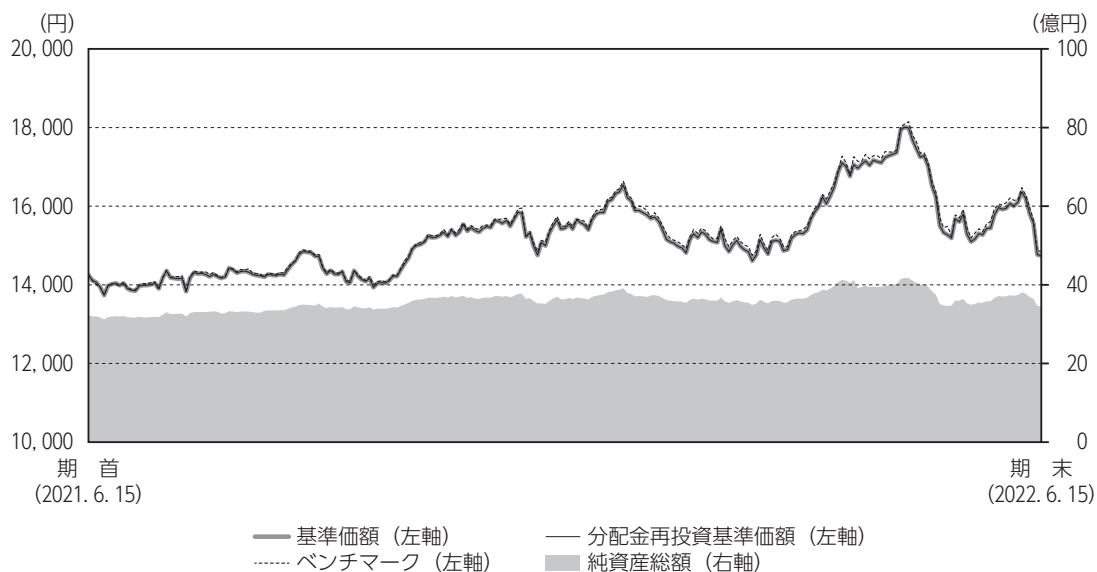
(注6) 不動産投信指数先物比率は買建比率-売建比率です。

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



運用経過

基準価額等の推移について



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

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

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

* ベンチマークは S & P 先進国 REIT 指数 (除く日本) (円ベース) です。

■ 基準価額・騰落率

期首：14,252円

期末：14,737円 (分配金0円)

騰落率：3.4% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の受益証券を通じて海外リートにほぼ100%投資した結果、リート市況は下落したものの、為替相場が上昇 (円安) 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」および「ポートフォリオについて」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		S & P先進国REIT指数 (除く日本) (円ベース)		投資信託 受益証券 組入比率	投資信託 証 券 組入比率	不動産投信 指 数 先 物 比 率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期首)2021年6月15日	円	%			%	%	%
	14,252	—	14,945	—	0.9	97.3	1.7
6月末	13,865	△ 2.7	14,555	△ 2.6	0.8	97.6	1.7
7月末	14,213	△ 0.3	14,962	0.1	2.0	96.3	1.7
8月末	14,506	1.8	15,257	2.1	1.5	97.0	2.0
9月末	14,167	△ 0.6	14,906	△ 0.3	0.5	97.5	2.0
10月末	15,396	8.0	16,169	8.2	1.3	95.9	2.9
11月末	15,318	7.5	16,109	7.8	0.9	97.0	2.3
12月末	16,322	14.5	17,195	15.1	1.7	95.8	2.6
2022年1月末	15,149	6.3	15,963	6.8	1.5	95.8	2.7
2月末	15,142	6.2	16,023	7.2	0.7	96.5	2.7
3月末	17,015	19.4	17,943	20.1	0.9	96.9	2.1
4月末	17,281	21.3	18,206	21.8	—	98.6	1.5
5月末	15,964	12.0	16,830	12.6	2.0	96.2	1.8
(期末)2022年6月15日	14,737	3.4	15,564	4.1	4.0	94.8	1.8

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

■海外リート市況

海外リート市況は下落しました。

海外リート市況は、当作成期首より、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展により経済活動の正常化が順次進んだことや、好調な経済指標の発表などからおおむね上昇しました。しかし2021年9月に入ると、中国の大手不動産会社の資金繰り懸念から世界的に市場心理が悪化したことに加え、世界的にインフレの長期化が懸念されて長期金利が急上昇したことで、売られる展開となりました。10月については、好調な決算発表や米国長期金利の低下に加え、中国の大手不動産会社に対する信用不安の後退などから上昇に転じたものの、11月からは新型コロナウイルスの新変異株であるオミクロン株への懸念などから下落に転じました。その後は、年末にかけてオミクロン株への過度の懸念の後退などから上昇する局面はあったものの、2022年に入ると、2021年12月のFOMC（米国連邦公開市場委員会）議事録を受けて米国の金融引き締めに対する懸念が高まり、米国を中心に下落に転じました。2月以降は、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、ロシアとウクライナの断片的な停戦協定による状況改善期待などから、一進一退の展開となりました。4月以降は、米国の金融引き締めの加速懸念などからリスク回避の展開となり、海外リート市場も米国を中心に軟調に推移し、当作成期末を迎えました。

■為替相場

為替相場は上昇しました。

為替相場は、当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大を受け、おおむね対円で下落（円高）しました。2021年9月からは、FRB（米国連邦準備制度理事会）による金融引き締め観測等から米国金利が上昇したことで、米ドル高が進行しました。その後も、インフレ懸念から世界的に金利が上昇したことで、日本との金利差拡大などが意識され、おおむね円安となりました。2022年3月以降は、ウクライナ情勢などを受けて資源価格が高騰したことや、米国で早期の金融政策正常化が意識されたことから米国金利が上昇した一方で、日銀は金融緩和姿勢を継続したことから金融政策の相違が意識され、円安が進行しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

ポートフォリオについて

（2021.6.16～2022.6.15）

■当ファンド

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

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

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

*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	S & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）

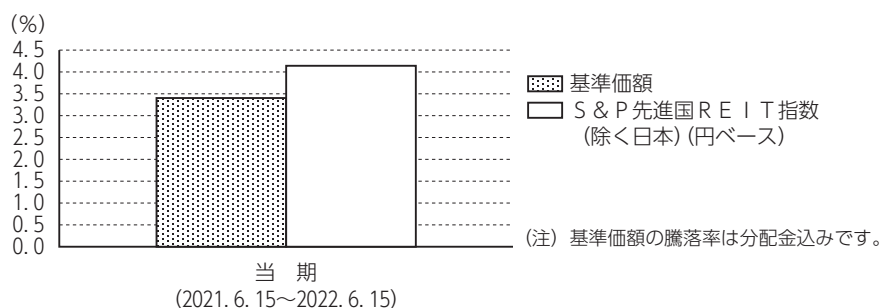
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は4.1%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。

配当金に対する課税分や保管費用等のコスト要因が、マイナス要因となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



*ベンチマークはS & P先進国REIT指数（除く日本）（円ベース）です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長を考慮して、収益分配を見送らせていただきました。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2021年6月16日 ～2022年6月15日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（%）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	4,737

- (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

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

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド

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

1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2021. 6. 16~2022. 6. 15)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	66円	0.434%	信託報酬＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は15,223円です。
(投信会社)	(46)	(0.302)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(17)	(0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	4	0.029	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
(先物・オプション)	(1)	(0.004)	
(投資信託受益証券)	(1)	(0.004)	
(投資信託証券)	(3)	(0.021)	
有価証券取引税	1	0.009	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
(投資信託受益証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(1)	(0.009)	
その他費用	11	0.069	その他費用＝当期中のその他費用／当期中の平均受益権口数
(保管費用)	(4)	(0.029)	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)	(5)	(0.035)	みなし配当にかかる税金支払い、信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	82	0.542	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

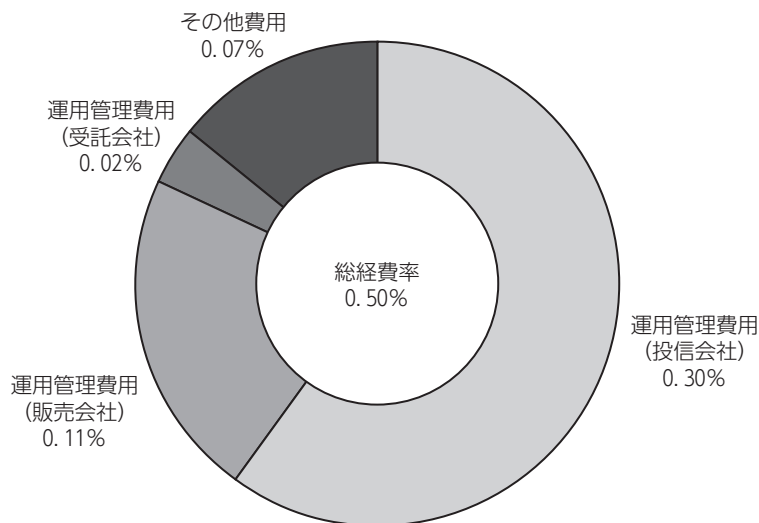
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当り)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.50%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■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6月16日から2022年6月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	258,009	803,035	224,183	726,240

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	1,102,903	1,136,729	3,453,951

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	3,453,951	99.8
コール・ローン等、その他	8,529	0.2
投資信託財産総額	3,462,480	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、6月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=135.01円、1カナダ・ドル=104.20円、1オーストラリア・ドル=93.10円、1香港・ドル=17.20円、1シンガポール・ドル=96.95円、1ニュージーランド・ドル=83.95円、1イギリス・ポンド=162.21円、1イスラエル・シェケル=38.942円、100韓国・ウォン=10.46円、1ユーロ=140.80円です。

(注3) ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(25,085,971千円)の投資信託財産総額(25,549,246千円)に対する比率は、98.2%です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2022年6月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,462,480,857円
コール・ローン等	8,434,244
ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド(評価額)	3,453,951,613
未収入金	95,000
(B) 負債	8,205,770
未払信託報酬	8,103,288
その他未払費用	102,482
(C) 純資産総額(A-B)	3,454,275,087
元本	2,343,884,195
次期繰越損益金	1,110,390,892
(D) 受益権総口数	2,343,884,195口
1万口当り基準価額(C/D)	14,737円

* 期首における元本額は2,264,129,492円、当作成期間中における追加設定元本額は709,209,320円、同解約元本額は629,454,617円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,737円です。

■損益の状況

当期自2021年6月16日 至 2022年6月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,138円
受取利息	178
支払利息	△ 1,316
(B) 有価証券売買損益	70,571,736
売買益	150,024,668
売買損	△ 79,452,932
(C) 信託報酬等	△ 15,793,885
(D) 当期損益金(A+B+C)	54,776,713
(E) 前期繰越損益金	555,017,995
(F) 追加信託差損益金	500,596,184
(配当等相当額)	(420,576,233)
(売買損益相当額)	(80,019,951)
(G) 合計(D+E+F)	1,110,390,892
次期繰越損益金(G)	1,110,390,892
追加信託差損益金	500,596,184
(配当等相当額)	(420,576,233)
(売買損益相当額)	(80,019,951)
分配準備積立金	609,795,846
繰越損益金	△ 1,138

(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	54,777,132
(c) 収益調整金	500,596,184
(d) 分配準備積立金	555,018,714
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,110,392,030
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	1,110,392,030
(h) 受益権総口数	2,343,884,195口

★「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の第17期にかかる運用状況については273~278ページをご参照ください。

<補足情報>

当ファンド（ダイワファンドラップ 外国REITインデックス（為替ヘッジなし））が投資対象としている「ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド」の決算日（2021年11月30日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2022年6月15日）現在におけるダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

■ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

(1) 投資信託受益証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	□数	金額	平均単価	銘柄	□数	金額	平均単価
VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 694.09	千円 8,502,428	円 12,249	VANGUARD REAL ESTATE ETF (アメリカ)	千口 642.43	千円 7,906,750	円 12,307

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 投資信託証券

(2021年6月16日から2022年6月15日まで)

買付				売付			
銘柄	□数	金額	平均単価	銘柄	□数	金額	平均単価
PROLOGIS INC (アメリカ)	15.6	232,601	14,910	PROLOGIS INC (アメリカ)	98.606	1,879,113	19,056
VICI PROPERTIES INC (アメリカ)	61.765	220,757	3,574	EQUINIX INC (アメリカ)	12.01	1,059,530	88,220
EQUINIX INC (アメリカ)	2.097	193,347	92,201	PUBLIC STORAGE (アメリカ)	20.655	918,442	44,465
GOODMAN GROUP (オーストラリア)	69.269	132,061	1,906	SIMON PROPERTY GROUP INC (アメリカ)	44.242	714,721	16,154
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT (アメリカ)	5.871	126,281	21,509	DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	37.687	640,587	16,997
PUBLIC STORAGE (アメリカ)	3.511	124,433	35,441	WELLTOWER INC (アメリカ)	56.5	633,755	11,216
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC (アメリカ)	29.069	113,149	3,892	REALTY INCOME CORP (アメリカ)	72.2	594,605	8,235
REALTY INCOME CORP (アメリカ)	14.686	113,043	7,697	AVALONBAY COMMUNITIES INC (アメリカ)	18.811	551,516	29,318
WELLTOWER INC (アメリカ)	11.676	111,920	9,585	GOODMAN GROUP (オーストラリア)	252.169	515,656	2,044
DIGITAL REALTY TRUST INC (アメリカ)	6.305	110,257	17,487	EQUITY RESIDENTIAL (アメリカ)	46.649	494,904	10,609

(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6月15日におけるダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド（8,345,562千円）の内容です。

(1) 外国投資信託受益証券

銘柄	□数	2022年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ) VANGUARD REAL ESTATE ETF	千口 85.16	千アメリカ・ドル 7,436	千円 1,003,957
合計	□数、金額 銘柄数 < 比率 >	85.16 1銘柄	7,436 <4.0%>

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。
(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 外国投資信託証券

銘柄	□数	2022年6月15日現在	
		評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)	千口	千アメリカ・ドル	千円
MANULIFE US REAL ESTATE INV	247.362	144	19,536
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	110.2	75	10,191
EAGLE HOSPITALITY TRUST	90	—	—
PRIME US REIT	79.1	54	7,422
(アメリカ)			
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	18.096	348	47,030
URBAN EDGE PROPERTIES	15.182	226	30,561
XENIA HOTELS & RESORTS INC	15.7	243	32,854
AVALONBAY COMMUNITIES INC	19.241	3,563	481,073
SIMON PROPERTY GROUP INC	45.189	4,361	588,804
BOSTON PROPERTIES INC	19.564	1,773	239,410

銘柄	2022年6月15日現在		
	口数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	20.988	122	16,604
VORNADO REALTY TRUST	21.821	631	85,317
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	11.878	223	30,196
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11.3	515	69,567
NEXPOINT RESIDENTIAL	3.126	190	25,740
EQUITY RESIDENTIAL	47.062	3,236	437,017
APPLE HOSPITALITY REIT INC	29.2	432	58,424
EPR PROPERTIES	10.284	447	60,480
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3.9	101	13,753
CITY OFFICE REIT INC	6	68	9,283
GLOBAL NET LEASE INC	14.233	186	25,230
EQUINIX INC	12.387	7,661	1,034,376
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10.629	262	35,373
CHATHAM LODGING TRUST	6.665	73	9,871
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7.6	605	81,798
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16.7	257	34,812
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3.2	105	14,205
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	7.8	39	5,391
HOST HOTELS & RESORTS INC	98.272	1,688	227,939
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	40.673	1,339	180,882
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	21	341	46,100
RLJ LODGING TRUST	22.921	268	36,237
FARMLAND PARTNERS INC	3.9	54	7,297
PHYSICIANS REALTY TRUST	30.3	501	67,702
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	9.3	118	16,033
KIMCO REALTY CORP	84.828	1,628	219,890
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8.3	89	12,124
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	30.395	822	111,044
WHITESTONE REIT	6.4	68	9,202
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	32.274	1,396	188,540
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17.1	221	29,943
PARK HOTELS & RESORTS INC	32.48	498	67,267
INVITATION HOMES INC	82.143	2,762	372,960
JBG SMITH PROPERTIES	15.732	364	49,170
ALEXANDER & BALDWIN INC	10	182	24,585
CLIPPER REALTY INC	1.89	14	1,929
GLADSTONE LAND CORP	4.251	93	12,655
AMERICOLD REALTY TRUST	36.695	1,061	143,374
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9	125	16,877
VICI PROPERTIES INC	115.665	3,253	439,276
BRT APARTMENTS CORP	1.6	33	4,473
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3.589	410	55,374
SAFEHOLD INC	1.957	67	9,131
NECESSITY RETAIL REIT INC CLASS A	16.943	114	15,486
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	16.743	336	45,390
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4.75	84	11,447
STORE CAPITAL CORP	33.77	837	113,024
CREATIVE MEDIA AND COMMUNITY TRUST	2.1	14	1,970
BROADSTONE NET LEASE INC	22.2	428	57,876
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14.668	110	14,872
LIFE STORAGE INC	11.313	1,158	156,433
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7.274	209	28,283
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	30.319	637	86,001
PARAMOUNT GROUP INC	22.593	164	22,206
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	19.5	130	17,612
NETSTREIT CORP	5.5	103	13,960
APARTMENT INCOME REIT CO	21.601	851	115,020
CTO REALTY GROWTH INC	0.86	49	6,678
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	22.079	1,279	172,682
STAG INDUSTRIAL INC	24.266	737	99,627
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST INC	1.5	26	3,535
INDUS REALTY TRUST INC	0.861	49	6,710
POSTAL REALTY TRUST INC CLASS A	2.3	32	4,446
PHILLIPS EDISON AND COMPANY INC	15.569	498	67,284
ORION OFFICE REIT INC	7.823	90	12,241
VENTAS INC	54.913	2,659	359,050
CARETRUST REIT INC	13.304	222	29,978
INVENTRUST PROPERTIES CORP	9.5	247	33,347
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	41.01	818	110,458
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	6.654	129	17,428
SABRA HEALTH CARE REIT INC	31.443	413	55,780
UMH PROPERTIES INC	6.244	106	14,322

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千アメリカ・ドル	千円
CBL ASSOCIATES PROPERTIES INC	3.6	86	11,689
IRON MOUNTAIN INC	39.886	1,885	254,603
TERRENO REALTY CORP	10.35	568	76,686
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17.593	637	86,054
SUN COMMUNITIES INC	15.994	2,415	326,148
ACADIA REALTY TRUST	12.211	196	26,526
ALEXANDER'S INC	0.3	65	8,789
PROLOGIS INC	101.813	11,266	1,521,107
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20.071	2,717	366,823
BRANDYWINE REALTY TRUST	23.542	223	30,226
SAUL CENTERS INC	1.8	76	10,342
VERIS RESIDENTIAL INC	11	154	20,880
CAMDEN PROPERTY TRUST	14.031	1,767	238,684
COUSINS PROPERTIES INC	20.455	604	81,578
SITE CENTERS CORP	24.678	309	41,780
DUKE REALTY CORP	52.4	2,682	362,215
EASTGROUP PROPERTIES INC	5.578	848	114,604
ESSEX PROPERTY TRUST INC	8.934	2,288	309,035
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17.907	839	113,386
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9.707	923	124,711
GETTY REALTY CORP	5.403	135	18,345
WELLTOWER INC	59.876	4,637	626,094
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	74.221	1,739	234,882
HIGHWOODS PROPERTIES INC	14.4	484	65,401
SERVICE PROPERTIES TRUST	22.7	126	17,070
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	20.259	504	68,105
EQUITY COMMONWEALTH	15.575	425	57,405
KILROY REALTY CORP	14.409	714	96,450
LTC PROPERTIES INC	5.408	193	26,065
LXP INDUSTRIAL TRUST	38.895	398	53,772
MID-AMERICA APARTMENT COMM	15.878	2,540	343,054
MACERICH CO/THE	29.279	271	36,604
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	23.715	1,628	219,865
NATL HEALTH INVESTORS INC	6.3	355	48,039
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	24.12	955	129,052
REALTY INCOME CORP	77.825	4,886	659,744
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	15.41	395	53,427
PENN REAL ESTATE INVEST TST	17	4	665
PUBLIC STORAGE	20.956	6,241	842,669
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2.764	513	69,386
REGENCY CENTERS CORP	21.226	1,201	162,199
RPT REALTY	11.6	111	15,097
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	14.316	208	28,122
SL GREEN REALTY CORP	8.838	434	58,634
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	32.9	60	8,172
URSTADT BIDDLE - CLASS A	4.1	65	8,817
UDR INC	41.167	1,742	235,212
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1.8	89	12,095
WP CAREY INC	26.243	2,124	286,882
WASHINGTON REIT	11.6	256	34,595
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4.7	27	3,661
AGREE REALTY CORP	9.8	656	88,647
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	32.906	910	122,883
CUBESMART	30.158	1,172	158,264
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	30.126	311	42,055
DIGITAL REALTY TRUST INC	39.096	4,870	657,524
CEDAR REALTY TRUST INC	1.7	42	5,735
EXTRA SPACE STORAGE INC	18.429	2,925	394,960
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4.575	45	6,189
CENTERSPACE	2.06	158	21,454
KITE REALTY GROUP TRUST	30.169	524	70,872
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2.2	56	7,577
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	19.19	1,236	166,902
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5.121	93	12,569
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	28.942	257	34,698
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	82.122	1,226	165,644
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	13.105	52	7,077
DOUGLAS EMMETT INC	24.186	548	74,025
アメリカ・ドル通貨計	□ 数、金額	3,561.29	135,027
	銘柄数 < 比率 >	150銘柄	<71.9%>

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千カナダ・ドル	千円
(カナダ)			
INOVALIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	2.3	16	1,696
BTB REAL ESTATE INVESTMENT UNITS T	5.1	18	1,944
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ESTATE I	6.2	24	2,564
NEXUS INDUSTRIAL REIT UNITS	4.3	43	4,579
PRIMARIS REAL ESTATE INVESTMENT UN	6.741	86	8,983
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8.4	101	10,555
SLATE GROCERY REIT	4	56	5,918
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8	135	14,146
SLATE OFFICE REIT	5.1	23	2,481
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2.8	43	4,493
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15.5	188	19,671
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12.2	206	21,483
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	6.1	37	3,858
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	2.7	35	3,668
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4.5	356	37,141
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	16.2	198	20,678
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	9.7	119	12,472
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	15.2	216	22,569
CHOICE PROPERTIES REIT	22.6	309	32,238
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	2.7	45	4,782
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	7.4	117	12,275
PLAZA RETAIL REIT	7	30	3,136
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10	271	28,311
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12	530	55,242
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	19.966	252	26,359
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	21.4	430	44,842
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3.3	64	6,739
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3.2	141	14,771
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	7.2	113	11,816
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8.8	303	31,671
カナダ・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	260.607 30銘柄	4,521 <1.9%>
(オーストラリア)			
DEXUS/AU	155.65	1,411	131,433
HEALTHCO HEALTHCARE & WELLNESS REI	38.4	59	5,577
HOME CONSORTIUM LTD	25.79	117	10,924
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPERTY UN	53.9	44	4,139
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	46.82	146	13,643
CROMWELL PROPERTY GROUP	199.444	139	12,997
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	76	222	20,731
RURAL FUNDS GROUP	53.875	144	13,492
WAYPOINT REIT	101.781	229	21,320
CHARTER HALL LONG WALE REIT	86.122	373	34,797
CENTURIA OFFICE REIT	62.25	108	10,142
CENTURIA CAPITAL GROUP	89.45	173	16,114
IRONGATE GROUP	77.4	146	13,619
HOMECO DAILY NEEDS REIT	204.898	255	23,749
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	165.43	438	40,814
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	41.377	143	13,405
NATIONAL STORAGE REIT	152.575	328	30,540
DEXUS INDUSTRIA REIT STAPLED UNIT	31.51	83	7,803
GDI PROPERTY GROUP	71.46	68	6,386
SCENTRE GROUP	760.116	1,938	180,455
ARENA REIT	48.81	189	17,631
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	27.16	86	8,091
BWP TRUST	67.951	250	23,280
GPT GROUP	277.21	1,153	107,362
CHARTER HALL RETAIL REIT	73.41	278	25,970
MIRVAC GROUP	570.551	1,169	108,892
STOCKLAND	350.431	1,261	117,450
ABACUS PROPERTY GROUP	53.96	145	13,563
GOODMAN GROUP	248.1	4,443	413,687
VICINITY CENTRES	556.686	971	90,438
CHARTER HALL GROUP	68.052	777	72,353
INGENIA COMMUNITIES GROUP	51.59	184	17,146
オーストラリア・ドル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	4,888.159 32銘柄	1,627.959 <6.4%>
(香港)			
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	321	982	16,894
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	142	536	9,232

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
	千口	千香港・ドル	千円
FORTUNE REIT	203	1,372	23,603
PROSPERITY REIT	174	461	7,930
LINK REIT	303.6	20,766	357,179
CHAMPION REIT	268	940	16,179
香港・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	1,411.6 6銘柄	25,059 <1.7%>
	千口	千シンガポール・ドル	千円
(シンガポール)			
KEPPEL DC REIT	186.483	359	34,893
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	170.976	48	4,724
AIMS APAC REIT	64.3	86	8,415
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	411.29	526	51,039
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	73.8	58	5,652
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	262.44	206	19,973
EC WORLD REIT	36.5	21	2,087
IREIT GLOBAL	71.624	43	4,235
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	483.177	1,328	128,821
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	732.122	1,552	150,475
SUNTEC REIT	307.4	507	49,174
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	460.6	746	72,341
KEPPEL REIT	277.6	313	30,412
ASCOTT RESIDENCE TRUST	272.656	308	29,870
ESR-LOGOS REAL ESTATE INVESTMENT T	730.702	292	28,336
CDL HOSPITALITY TRUSTS	127.7	159	15,475
FRASERS CENTREPOINT TRUST	151.176	337	32,684
STARHILL GLOBAL REIT	198.4	113	10,963
CAPITALAND CHINA TRUST	159.142	179	17,434
PARKWAYLIFE REAL ESTATE	54.6	262	25,408
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	285.969	692	67,093
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	309.284	544	52,773
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	147.8	94	9,170
SPH REIT	134.4	126	12,248
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	337.763	130	12,607
シンガポール・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	6,447.904 25銘柄	9,038 <3.5%>
	千口	千ニュージーランド・ドル	千円
(ニュージーランド)			
ARGOSY PROPERTY LTD	119.25	140	11,762
KIWI PROPERTY GROUP LTD	221.44	210	17,660
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	60.26	161	13,582
GOODMAN PROPERTY TRUST	147.8	296	24,877
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	183.35	243	20,471
ニュージーランド・ドル通貨計	□ 数、金 額 銘柄数 < 比率 >	732.1 5銘柄	1,052 <0.3%>
	千口	千イギリス・ポンド	千円
(イギリス)			
ASSURA PLC	407.27	270	43,866
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	83.32	73	11,852
STANDARD LIFE INV PROP INC	56.2	44	7,256
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	118.46	95	15,545
PICTON PROPERTY INCOME LTD	75.64	71	11,619
REGIONAL REIT LTD	59.84	47	7,736
NEWRIVER REIT PLC	42.86	37	6,124
CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	117.59	174	28,306
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	85.98	68	11,171
CUSTODIAN REIT PLC	60.9	62	10,214
PRS REIT PLC/THE	75.872	81	13,144
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	53.28	65	10,543
LXI REIT PLC	125.918	179	29,126
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	51.24	44	7,256
AEW UK REIT PLC	21.93	26	4,304
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	110.42	126	20,597
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	136.123	172	27,931
HOME REIT PLC	77.587	88	14,322
LAND SECURITIES GROUP PLC	105.957	775	125,742
SEGRO PLC	170.889	1,631	264,669
HAMMERSON PLC	482.269	110	17,883
UNITE GROUP PLC/THE	56.29	596	96,695
BRITISH LAND CO PLC	132.28	670	108,701
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	35.071	217	35,270
DERWENT LONDON PLC	15.83	437	70,922
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	184.12	251	40,737
WORKSPACE GROUP PLC	20.759	136	22,123

銘柄	2022年6月15日現在		
	口数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額
	千口	千イギリス・ポンド	千円
SAFESTORE HOLDINGS PLC	29.124	295	47,950
SHAFTESBURY PLC	39.8	228	37,057
BIG YELLOW GROUP PLC	23.89	298	48,439
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	135.177	311	50,519
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	78.138	43	7,110
TRITAX BIG BOX REIT PLC	263.418	477	77,382
イギリス・ポンド通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	3,533.442 8,212	1,332,126 <5.3%>
	千口	千イスラエル・シケル	千円
(イスラエル)			
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	31.07	283	11,047
REIT 1 LTD	26.1	461	17,990
イスラエル・シケル通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	57.17 2銘柄	29,038 <0.1%>
	千口	千韓国・ウォン	千円
(韓国)			
SK REITS LTD	8.7	58,464	6,115
D&D PLATFORM REIT LTD	8	41,600	4,351
JR GLOBAL	3.137	653	68
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8.26	65,254	6,825
LOTTE REIT CO LTD	17.135	102,638	10,736
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	13.09	62,439	6,531
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	5.6	32,480	3,397
JR REIT XXVII	16.35	89,925	9,406
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	5.99	37,617	3,934
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	20.74	130,039	13,602
韓国・ウォン通貨計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	107.002 10銘柄	64,968 <0.3%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (アイルランド)			
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	54.94	71	10,009
HIBERNIA REIT PLC	84.78	135	19,075
国小計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	139.72 2銘柄	29,085 <0.1%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (オランダ)			
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5.057	112	15,863
WERELDHAVE NV	5.16	72	10,214
NSI NV	2.271	78	11,047
VASTNED RETAIL NV	2.32	51	7,300
国小計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	14.808 4銘柄	44,427 <0.2%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (ベルギー)			
AEDIFICA	4.776	453	63,816
COFINIMMO	3.882	437	61,545
BEFIMMO	3.13	147	20,713
INTERVEST OFFICES & WAREHOUS	3.03	75	10,580
RETAIL ESTATES	1.457	89	12,575
WAREHOUSES DE PAUW SCA	18.468	568	79,985
CARE PROPERTY INVEST	3.45	79	11,245
XIOR STUDENT HOUSING NV	2.67	110	15,526
MONTEA NV	1.31	111	15,659
国小計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	42.173 9銘柄	291,647 <1.2%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (フランス)			
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	15.315	819	115,364
ICADE	4.098	193	27,211
CARMILA	5.78	77	10,888
ALTAREA	0.55	69	9,803
GECINA SA	7.153	684	96,383
KLEPIERRE	25.657	482	67,987
COVIVIO	6.222	352	49,672
MERCIALYS	6.37	51	7,296
国小計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	71.145 8銘柄	384,608 <1.5%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (ドイツ)			
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	1.82	23	3,264
HAMBORNER REIT AG	9.07	75	10,586
国小計	□ 数、金額 銘柄数 < 比率 >	10.89 2銘柄	13,851 <0.1%>
	千口	千ユーロ	千円
ユーロ (スペイン)			
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7.5	36	5,132

銘柄	2022年6月15日現在		
	□ 数	評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	千口 34.559	千ユーロ 224	千円 31,579
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	43.87	423	59,607
国 小 計	□ 数、金 額 85.929	684	96,318
	銘 柄 数 < 比 率 >	3 銘柄	<0.4%>
ユーロ (イタリア)	千口	千ユーロ	千円
COIMA RES SPA	2.77	27	3,845
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6.93	24	3,429
国 小 計	□ 数、金 額 9.7	51	7,275
	銘 柄 数 < 比 率 >	2 銘柄	<0.0%>
ユーロ (その他)	千口	千ユーロ	千円
CROMWELL REIT EUR	43.52	88	12,439
国 小 計	□ 数、金 額 43.52	88	12,439
	銘 柄 数 < 比 率 >	1 銘柄	<0.0%>
ユ ー ロ 通 貨 計	□ 数、金 額 417.885	6,247	879,652
	銘 柄 数 < 比 率 >	31 銘柄	<3.5%>
合 計	□ 数、金 額 21,417.159	—	24,030.593
	銘 柄 数 < 比 率 >	324 銘柄	<94.8%>

(注1) 邦貨換算金額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) < >内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の銘柄別残高 (評価額)

銘柄別	2022年6月15日現在	
	買 建 額	売 建 額
外	百万円	百万円
DJ US REAL ESTATE (アメリカ)	329	—
国	134	—
STOXX 600 REAL (ドイツ)		

(注1) 外貨建の評価額は、2022年6月15日現在の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。

(注2) 単位未満は切捨て。