

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合
信託期間	無期限
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。
主要投資対象	<p>下記の各投資信託の受益証券</p> <p>※各投資対象ファンドは、それぞれ『』内に掲げる指 数に採用されている資産に投資を行い、投資成果を 当該指標の動きに連動させることをめざして運用 を行います。</p> <p>&lt;auスマート・ベーシック（安定）&gt; &lt;auスマート・ベーシック（安定成長）&gt;</p> <p>イ) 日本株式インデックスファンド（FOFs用） （適格機関投資家専用） 『東証株価指数』</p> <p>ロ) 日本債券インデックスファンド（FOFs用） （適格機関投資家専用） 『NOMURA-BPI総合指数』</p> <p>ハ) 外国株式インデックスファンド（FOFs用） （適格機関投資家専用） 『MSCIコクサイ指数（円ベース）』</p> <p>二) 外国債券インデックスファンド（FOFs用） （適格機関投資家専用） 『FTSE世界国債インデックス（除く日本、 ヘッジなし・円ベース）』</p> <p>&lt;auスマート・ベーシック（安定成長）&gt;のみ</p> <p>ホ) 新興国株式インデックスファンド（FOFs 用）（適格機関投資家専用） 『FTSE RAFI エマージング インデック ス（円換算）』</p> <p>ヘ) 新興国債券インデックスファンド（FOFs 用）（適格機関投資家専用） 『JPモルガンガバメント・ボンド・インデッ クスエマージング・マーケット グロー バル ダイバーシファイド（円換算）』</p>
組入制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>株式への直接投資は、行いません。</li> <li>外貨建資産への直接投資は、行いません。</li> </ul>
分配方針	<ul style="list-style-type: none"> <li>分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</li> <li>原則として、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。</li> </ul>

auスマート・ベーシック（安定）

auスマート・ベーシック（安定成長）

## 運用報告書（全体版）

### 第6期

（決算日 2024年9月18日）

（作成対象期間 2023年9月20日～2024年9月18日）

### 受益者の皆様へ

平素より格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、投資対象ファンドへの投資を通じて、内外の債券、株式に投資を行い、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざしております。当期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

### auアセットマネジメント株式会社

東京都千代田区西神田三丁目2番1号



ホームページ

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



お問い合わせ先 03-5657-7185

（受付時間 営業日の午前9時～午後5時）

## auスマート・ベーシック（安定）

## ■最近5期の運用実績

決算期 (分配額)	基準価額		投資信託受益証券組入比率	純資産総額
	税引前分配金	期中騰落率		
2期(2020年9月18日)	円 10,255	円 0	% 1.1	% 99.0 百万円 233
3期(2021年9月21日)	10,883	0	6.1	99.0 500
4期(2022年9月20日)	10,669	0	△2.0	98.8 935
5期(2023年9月19日)	11,048	0	3.6	99.0 1,484
6期(2024年9月18日)	11,269	0	2.0	98.9 2,175

(注) 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標がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

## ■当期中の基準価額と市況等の推移

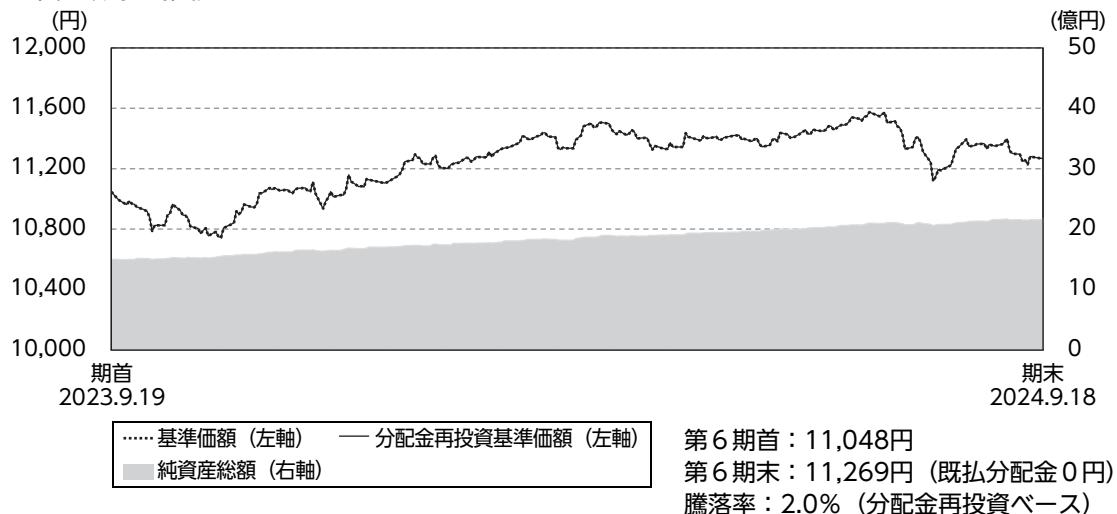
年月日	基準価額		投資信託受益証券組入比率
		騰落率	
(期首)2023年9月19日	円 11,048	% —	% 99.0
9月末	10,948	△0.9	98.9
10月末	10,749	△2.7	98.9
11月末	11,062	0.1	98.9
12月末	11,127	0.7	99.0
2024年1月末	11,233	1.7	99.0
2月末	11,399	3.2	99.0
3月末	11,506	4.1	99.0
4月末	11,344	2.7	99.0
5月末	11,345	2.7	99.0
6月末	11,457	3.7	99.0
7月末	11,411	3.3	98.8
8月末	11,350	2.7	98.9
(期末)2024年9月18日	11,269	2.0	98.9

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

## ■運用経過

### □基準価額等の推移について



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

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

### □基準価額の主な変動要因

投資対象ファンドの受益証券を通じて、内外（国内及び先進国）の債券、株式に投資しました。当期は国内と先進国の株式市況及び先進国の債券市況がプラス要因となった一方、国内の債券市況がマイナス要因となりました。基準価額は、期首の11,048円から期末の11,269円に上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

資産区分	ファンド名称	当期末時点 組入比率	騰落率
国内株式	日本株式インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	14.8%	7.4%
国内債券	日本債券インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	64.4%	△0.9%
先進国株式	外国株式インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	5.0%	19.9%
先進国債券	外国債券インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	14.7%	5.5%

## □投資環境について

### <株式市況>

国内株式市況は、期初は米国株の下落や日銀の政策変更への懸念などから軟調に推移しました。2023年11月には日銀金融政策決定会合でイールドカーブ・コントロールが再修正された後の為替市場の反応が限定的であったことや、FOMC（米国連邦公開市場委員会）を通過し米国の追加利上げ観測が後退したことなどを好感して上昇しました。2024年に入ると年明けに進んだ円安や、海外投資家の大幅買い越しが追い風となり大幅高となりました。3月には日銀が金融政策決定会合でマイナス金利の解除を決めたものの、当面は緩和的な金融環境が続くとの観測などから、日経平均株価は4万円台に乗せるなど最高値を更新し、上値を追う展開となりました。4月以降は地政学リスクの拡大などにより上値の重い状況が継続しましたが、7月に入ると米国の雇用統計で労働需給の緩和が示唆されたことや米CPIの大幅な下振れなどを受けて米利下げ期待が高まり、米国株の上昇に連れて日本株も上昇しました。8月には米景気後退懸念や急速な円高の進行で歴史的な下落幅を記録しましたが、内田日銀副総裁のハト派発言やその後の良好な米景気指標を受けて、月半ばにかけて株価は急反発しました。その後は為替が円高基調で推移したことや9月初の米経済指標が再び景気後退懸念につながる内容となつたことで下落し、その後も軟調な推移となる中で期末を迎えることになりました。

先進国株式市況は、期初は米国では、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融引き締めが長期化するとの観測や、国債の需要悪化などが嫌気されたことを背景に米長期金利が大幅に上昇し、軟調な展開となりました。欧州株式市場でも、ECB（欧州中央銀行）による金融引き締め局面が長引くとの観測から下落しました。2023年11月から年末にかけては世界的に長期金利が大きく低下したことを受け、投資家のリスク選好姿勢が強まることなどから先進国株式市場は大きく上昇しました。2024年以降も米経済のソフトランディング期待や米企業の好決算により上昇基調で推移しました。4月の中東情勢をめぐる地政学リスクの拡大時には一時的に下落するも、米国株は7月中旬まで堅調に推移しました。8月には予想外の経済指標の悪化により米景気後退懸念が高まり、先進国株式市場は大幅に下落しましたが、その後は良好な米景気指標などを受けて反発上昇し、期末まで上昇基調が継続しました。

新興国株式市況は、期初よりFRBの利上げ見送りによる追加利上げ警戒感の後退や、米中関係の改善期待などを背景に上昇しました。2024年2月には政府系ファンドのETFの買い増し発表や空売り規制などの中国当局の株価対策を受けて、上昇しました。その後は米経済のソフトランディング期待などから先進国株式市場が安定推移する中で、新興国株式市場も底堅く推移しました。8月以降は先進国株式市場の大幅下落やその後の反発上昇に左右される形で推移しました。

### <債券市況>

国内の債券市況は、期初より米国金利の上昇、早期の金融政策正常化観測が高まったことで上昇しましたが、11月以降は米国金利の低下や日銀による早期の金融政策修正に対する思惑が後退したことにより金利は低下しました。2024年3月には日銀の金融政策修正観測を背景に月半ばにかけて金利は上昇しました。その後、日銀はマイナス金利政策の解除とイールドカーブ・コントロールの撤廃を決定しましたが、当面は国債買い入れ額を維持する方針が示されたことから、金利は低下しました。4月以降は米国金利の上昇、円安の進行、日銀の国債買い入れ減額や日銀高官の発言を受けて金融引き締めへの警戒感が強まり、5月後半には1.0%台をつけるなど金利は上昇しました。8月以降は米国金利

の低下や金融市場の不安定化を受けて金利は低下し、その後も植田日銀総裁が利上げを急がない姿勢を示したことを受け、金利は低下しました。

先進国の債券市況は、期初より米国経済の底堅さが確認されたことや、FRB高官から引き締め環境の長期化が示唆されたことで、金利は上昇基調となりました。11月以降はFRBが政策金利を据え置いたことや、雇用やインフレ関連指標が市場予想を下回る結果であったことなどから金利は低下しました。その他の国についても、米国金利に連れる形で、金利は低下しました。2024年以降は米国においては、経済指標が市場予想を上振れしたことなどを背景に上昇しました。8月には米雇用統計が予想を下回ると、米景気後退懸念により同国の利下げが早まるとの見方から米金利は大幅に低下し、その他の国も同様に低下しました。その後もインフレ鈍化期待を背景に先進国金利は低下基調で推移し、期末を迎えました。

新興国の債券市況は、期初より米国の早期利下げ観測の高まりから米国金利が低下したことを受け、多くの国で金利は低下しました。2024年4月には米国で利下げ期待が後退したことや、中東で地政学リスクが高まったことなどから金利は上昇傾向となりました。その後選挙結果や財政悪化懸念など個別の悪材料を受けて金利が上昇する国が散見されましたが、米金利低下の影響を受けて新興国全体では金利が低下しました。米国の利下げ開始を受けて多くの新興国においても利下げを実施しやすくなり、新興国債券市場でも幅広い国の金利が低下し期末を迎えました。

### ＜為替市況＞

期初より米国金利の低下や日銀の政策修正期待の後退から円高となりました。2024年以降は米国金利の上昇を背景に日米金利差の拡大が意識されることや、日銀の副総裁がマイナス金利解除後も緩和的な金融環境を維持する見通しと発言したことなどから円安となりました。7月以降は政府日銀による介入観測や、米国金利の大幅な低下により日米金利差の縮小が意識されたことなどから、円高が進行しました。

## □ポートフォリオについて

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

資産区分	配分比率	投資対象ファンド	当期末時点 組入比率
国内株式	15%	日本株式インデックスファンド	14.8%
国内債券	65%	日本債券インデックスファンド	64.4%
先進国株式	5%	外国株式インデックスファンド	5.0%
先進国債券	15%	外国債券インデックスファンド	14.7%

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

(注2) 配分比率は、純資産総額に対する各資産の目標とする組入比率です。

## □ベンチマークとの差異について

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

## □分配金について

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

### <分配原資の内訳（1万口当り）>

項目	当期	
	2023年9月20日～2024年9月18日	
当期分配金（税引前）（円）	0	
（対基準価額比率）（%）	(0.00)	
当期の収益（円）	—	
当期の収益以外（円）	—	
翌期繰越分配対象額（円）	1,269	

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

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

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

## ■今後の運用方針

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

## ■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2023. 9. 20～2024. 9. 18)		項目の概要
	金額（円）	比率（%）	
運用管理費用 (信託報酬) (投信会社)	27円 ( 12)	0.241% ( 0.110)	運用管理費用（信託報酬）＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 当期中の平均基準価額は11,253円です。 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	( 12)	( 0.110)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	( 2)	( 0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当期中の売買委託手数料／当期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当期中の有価証券取引税／当期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用 (監査費用)	1 ( 1)	0.010 ( 0.010)	その他費用＝当期中のその他費用／当期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合計	28	0.251	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しております。

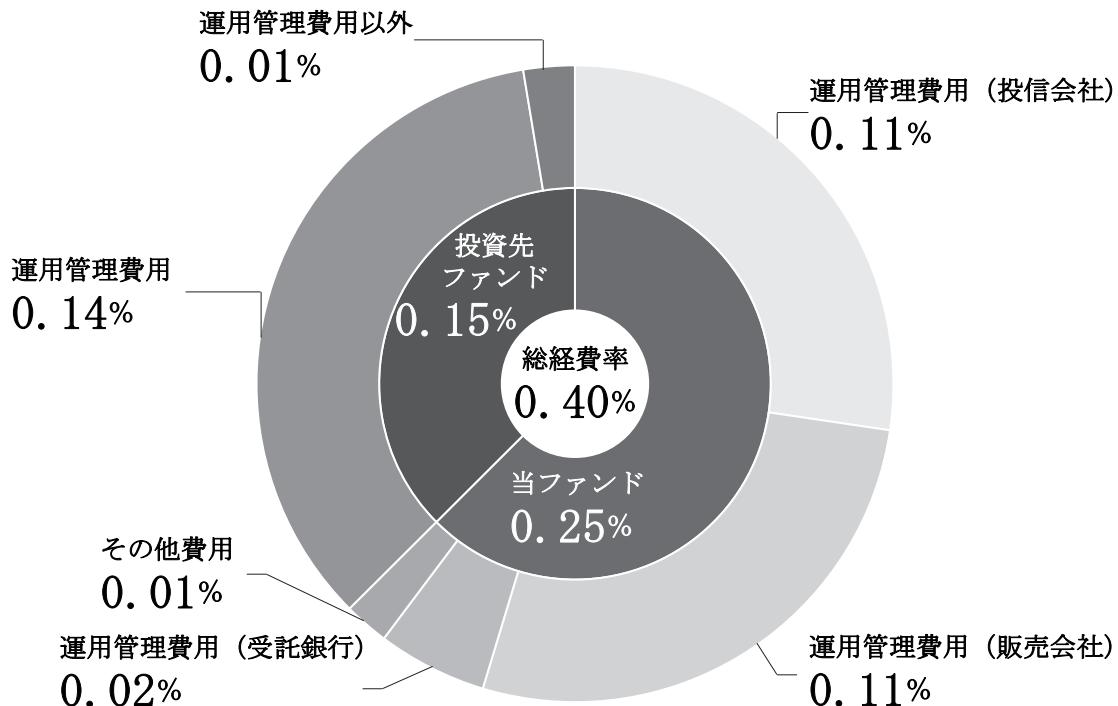
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入しております。

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

## (参考情報)

## ■総経費率

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



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

(注1) ①の費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券です。

(注5) ①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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

## ■売買および取引の状況

### 投資信託受益証券

(2023年9月20日から2024年9月18日まで)

銘柄名	買付		売付		
	口数	金額	口数	金額	
国内	日本株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	千口 51,083.783	千円 85,030	千口 7,883.041	千円 13,510
	日本債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	493,735.982	467,650	3,491.377	3,260
	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)	11,912.946	26,580	3,466.705	7,970
	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)	73,187.897	92,630	566.743	720

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

## ■利害関係人との取引状況等 (2023年9月20日から2024年9月18日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ■組入資産明細表

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	当期末		
	口数	評価額	比率
日本株式インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	千口 189,492.593	千円 321,076	% 14.8
日本債券インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	1,480,932.822	1,401,702	64.4
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)	45,081.791	108,043	5.0
外国債券インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	253,858.08	320,901	14.7
合計	口数、金額 銘柄数 <比率>	1,969,365.286 4銘柄	2,151,724 <98.9%>

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2024年9月18日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 2,151,724	% 98.8
コール・ローン等、その他	26,662	1.2
投資信託財産総額	2,178,386	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2024年9月18日現在

項目	当期末
(A) 資産	2,178,386,666円
コール・ローン等	26,662,483
投資信託受益証券(評価額)	2,151,724,183
(B) 負債	2,772,115
未払解約金	236,762
未払信託報酬	2,435,793
その他の未払費用	99,560
(C) 純資産総額(A-B)	2,175,614,551
元本	1,930,584,029
次期繰越損益金	245,030,522
(D) 受益権総口数	1,930,584,029口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,269円

(注1) 期首における元本額は1,344,175,198円、当期中における追加設定元本額は737,941,338円、同解約元本額は151,532,507円です。

(注2) 当期末の計算口数当たりの純資産額は11,269円です。

## ■損益の状況

当期 自2023年9月20日 至2024年9月18日

項目	当期
(A) 配当等収益	10,724円
受取利息	12,094
支払利息	△ 1,370
(B) 有価証券売買損益	31,957,084
売買益	46,138,577
売買損	△ 14,181,493
(C) 信託報酬等	△ 4,617,150
(D) 当期損益金(A+B+C)	27,350,658
(E) 前期繰越損益金	49,940,906
(F) 追加信託差損益金	167,738,958
(配当等相当額)	( 127,368,331)
(売買損益相当額)	( 40,370,627)
(G) 合計(D+E+F)	245,030,522
次期繰越損益金(G)	245,030,522
追加信託差損益金	167,738,958
(配当等相当額)	( 127,368,331)
(売買損益相当額)	( 40,370,627)
分配準備積立金	77,291,564

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

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

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「分配金の計算過程」をご参照ください。

### 分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	9,339円
(b) 経費控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	27,338,132円
(c) 収益調整金	167,738,958円
(d) 分配準備積立金	49,944,093円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	245,030,522円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	1,269.20円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金(1万口当たり)	0円

## ■お知らせ

該当事項はございません。

## auスマート・ベーシック（安定成長）

## ■最近5期の運用実績

決算期 (分配額)	基準価額		投資信託受益証券組入比率	純資産総額
	税引前分配金	期中騰落率		
2期(2020年9月18日)	円 10,247	円 0	% 1.4	% 99.0 百万円 452
3期(2021年9月21日)	11,393	0	11.2	99.0 1,112
4期(2022年9月20日)	11,316	0	△0.7	98.7 2,182
5期(2023年9月19日)	12,148	0	7.4	99.0 4,172
6期(2024年9月18日)	12,632	0	4.0	99.0 6,236

(注) 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標がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

## ■当期中の基準価額と市況等の推移

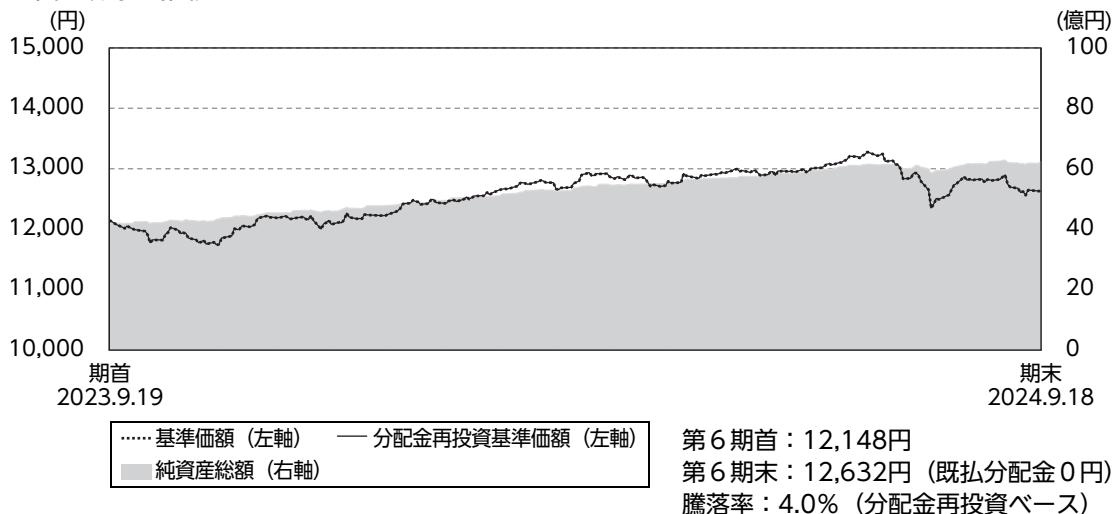
年月日	基準価額		投資信託受益証券組入比率
		騰落率	
(期首)2023年9月19日	円 12,148	% —	% 99.0
9月末	11,992	△1.3	98.8
10月末	11,740	△3.4	98.9
11月末	12,176	0.2	98.8
12月末	12,236	0.7	99.0
2024年1月末	12,472	2.7	99.0
2月末	12,758	5.0	99.0
3月末	12,917	6.3	99.0
4月末	12,774	5.2	99.0
5月末	12,893	6.1	99.0
6月末	13,064	7.5	99.0
7月末	12,931	6.4	98.7
8月末	12,806	5.4	99.0
(期末)2024年9月18日	12,632	4.0	99.0

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

## ■運用経過

### □基準価額等の推移について



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

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

### □基準価額の主な変動要因

投資対象ファンドの受益証券を通じて、内外（国内、先進国及び新興国）の債券、株式に投資しました。当期は国内と先進国、新興国の株式市況及び先進国と新興国の債券市況がプラス要因となった一方、国内の債券市況がマイナス要因となりました。基準価額は、期首の12,148円から期末の12,632円に上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

資産区分	ファンド名称	当期末時点 組入比率	騰落率
国内株式	日本株式インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	19.5%	7.4%
国内債券	日本債券インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	49.8%	△0.9%
先進国株式	外国株式インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	9.9%	19.9%
先進国債券	外国債券インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	9.8%	5.5%
新興国株式	新興国株式インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	5.0%	9.8%
新興国債券	新興国債券インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	4.9%	5.4%

## □投資環境について

### <株式市況>

国内株式市況は、期初は米国株の下落や日銀の政策変更への懸念などから軟調に推移しました。2023年11月には日銀金融政策決定会合でイールドカーブ・コントロールが再修正された後の為替市場の反応が限定的であったことや、FOMC（米国連邦公開市場委員会）を通過し米国の追加利上げ観測が後退したことなどを好感して上昇しました。2024年に入ると年明けに進んだ円安や、海外投資家の大幅買い越しが追い風となり大幅高となりました。3月には日銀が金融政策決定会合でマイナス金利の解除を決めたものの、当面は緩和的な金融環境が続くとの観測などから、日経平均株価は4万円台に乗せるなど最高値を更新し、上値を追う展開となりました。4月以降は地政学リスクの拡大などにより上値の重い状況が継続しましたが、7月に入ると米国の雇用統計で労働需給の緩和が示唆されたことや米CPIの大幅な下振れなどを受けて米利下げ期待が高まり、米国株の上昇に連れて日本株も上昇しました。8月には米景気後退懸念や急速な円高の進行で歴史的な下落幅を記録しましたが、内田日銀副総裁のハト派発言やその後の良好な米景気指標を受けて、月半ばにかけて株価は急反発しました。その後は為替が円高基調で推移したことや9月初の米経済指標が再び景気後退懸念につながる内容となつたことで下落し、その後も軟調な推移となる中で期末を迎えることになりました。

先進国株式市況は、期初は米国では、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融引き締めが長期化するとの観測や、国債の需要悪化などが嫌気されたことを背景に米長期金利が大幅に上昇し、軟調な展開となりました。欧州株式市場でも、ECB（欧州中央銀行）による金融引き締め局面が長引くとの観測から下落しました。2023年11月から年末にかけては世界的に長期金利が大きく低下したことを受け、投資家のリスク選好姿勢が強まることなどから先進国株式市場は大きく上昇しました。2024年以降も米経済のソフトランディング期待や米企業の好決算により上昇基調で推移しました。4月の中東情勢をめぐる地政学リスクの拡大時には一時的に下落するも、米国株は7月中旬まで堅調に推移しました。8月には予想外の経済指標の悪化により米景気後退懸念が高まり、先進国株式市場は大幅に下落しましたが、その後は良好な米景気指標などを受けて反発上昇し、期末まで上昇基調が継続しました。

新興国株式市況は、期初よりFRBの利上げ見送りによる追加利上げ警戒感の後退や、米中関係の改善期待などを背景に上昇しました。2024年2月には政府系ファンドのETFの買い増し発表や空売り規制などの中国当局の株価対策を受けて、上昇しました。その後は米経済のソフトランディング期待などから先進国株式市場が安定推移する中で、新興国株式市場も底堅く推移しました。8月以降は先進国株式市場の大幅下落やその後の反発上昇に左右される形で推移しました。

### <債券市況>

国内の債券市況は、期初より米国金利の上昇、早期の金融政策正常化観測が高まったことで上昇しましたが、11月以降は米国金利の低下や日銀による早期の金融政策修正に対する思惑が後退したことにより金利は低下しました。2024年3月には日銀の金融政策修正観測を背景に月半ばにかけて金利は上昇しました。その後、日銀はマイナス金利政策の解除とイールドカーブ・コントロールの撤廃を決定しましたが、当面は国債買い入れ額を維持する方針が示されたことから、金利は低下しました。4月以降は米国金利の上昇、円安の進行、日銀の国債買い入れ減額や日銀高官の発言を受けて金融引き締めへの警戒感が強まり、5月後半には1.0%台をつけるなど金利は上昇しました。8月以降は米国金利

の低下や金融市場の不安定化を受けて金利は低下し、その後も植田日銀総裁が利上げを急がない姿勢を示したことを受け、金利は低下しました。

先進国の債券市況は、期初より米国経済の底堅さが確認されたことや、FRB高官から引き締め環境の長期化が示唆されたことで、金利は上昇基調となりました。11月以降はFRBが政策金利を据え置いたことや、雇用やインフレ関連指標が市場予想を下回る結果であったことなどから金利は低下しました。その他の国についても、米国金利に連れる形で、金利は低下しました。2024年以降は米国においては、経済指標が市場予想を上振れしたことなどを背景に上昇しました。8月には米雇用統計が予想を下回ると、米景気後退懸念により同国の利下げが早まるとの見方から米金利は大幅に低下し、その他の国も同様に低下しました。その後もインフレ鈍化期待を背景に先進国金利は低下基調で推移し、期末を迎えました。

新興国の債券市況は、期初より米国の早期利下げ観測の高まりから米国金利が低下したことを受け、多くの国で金利は低下しました。2024年4月には米国で利下げ期待が後退したことや、中東で地政学リスクが高まったことなどから金利は上昇傾向となりました。その後選挙結果や財政悪化懸念など個別の悪材料を受けて金利が上昇する国が散見されましたが、米金利低下の影響を受けて新興国全体では金利が低下しました。米国の利下げ開始を受けて多くの新興国においても利下げを実施しやすくなり、新興国債券市場でも幅広い国の金利が低下し期末を迎えました。

### ＜為替市況＞

期初より米国金利の低下や日銀の政策修正期待の後退から円高となりました。2024年以降は米国金利の上昇を背景に日米金利差の拡大が意識されることや、日銀の副総裁がマイナス金利解除後も緩和的な金融環境を維持する見通しと発言したことなどから円安となりました。7月以降は政府日銀による介入観測や、米国金利の大幅な低下により日米金利差の縮小が意識されたことなどから、円高が進行しました。

## □ポートフォリオについて

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

資産区分	配分比率	投資対象ファンド	当期末時点 組入比率
国内株式	20%	日本株式インデックスファンド	19.5%
国内債券	50%	日本債券インデックスファンド	49.8%
先進国株式	10%	外国株式インデックスファンド	9.9%
先進国債券	10%	外国債券インデックスファンド	9.8%
新興国株式	5 %	新興国株式インデックスファンド	5.0%
新興国債券	5 %	新興国債券インデックスファンド	4.9%

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

(注2) 配分比率は、純資産総額に対する各資産の目標とする組入比率です。

## □ベンチマークとの差異について

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

## □分配金について

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

### <分配原資の内訳（1万口当り）>

項目	当期	
	2023年9月20日～2024年9月18日	
当期分配金（税引前）（円）	0	
（対基準価額比率）（%）		(0.00)
当期の収益（円）	—	
当期の収益以外（円）	—	
翌期繰越分配対象額（円）	2,632	

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

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

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

## ■今後の運用方針

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

## ■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2023. 9. 20～2024. 9. 18)		項目の概要
	金額（円）	比率（%）	
運用管理費用 (信託報酬) (投信会社)	30円 ( 14)	0.241% ( 0.110)	運用管理費用（信託報酬）＝当期中の平均基準価額×信託報酬率 <b>当期中の平均基準価額は12,578円です。</b> 投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	( 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
(受託銀行)	( 3)	( 0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	—	—	売買委託手数料＝当期中の売買委託手数料／当期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税＝当期中の有価証券取引税／当期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
その他費用 (監査費用)	1 ( 1)	0.009 ( 0.009)	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 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合計	32	0.251	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しております。

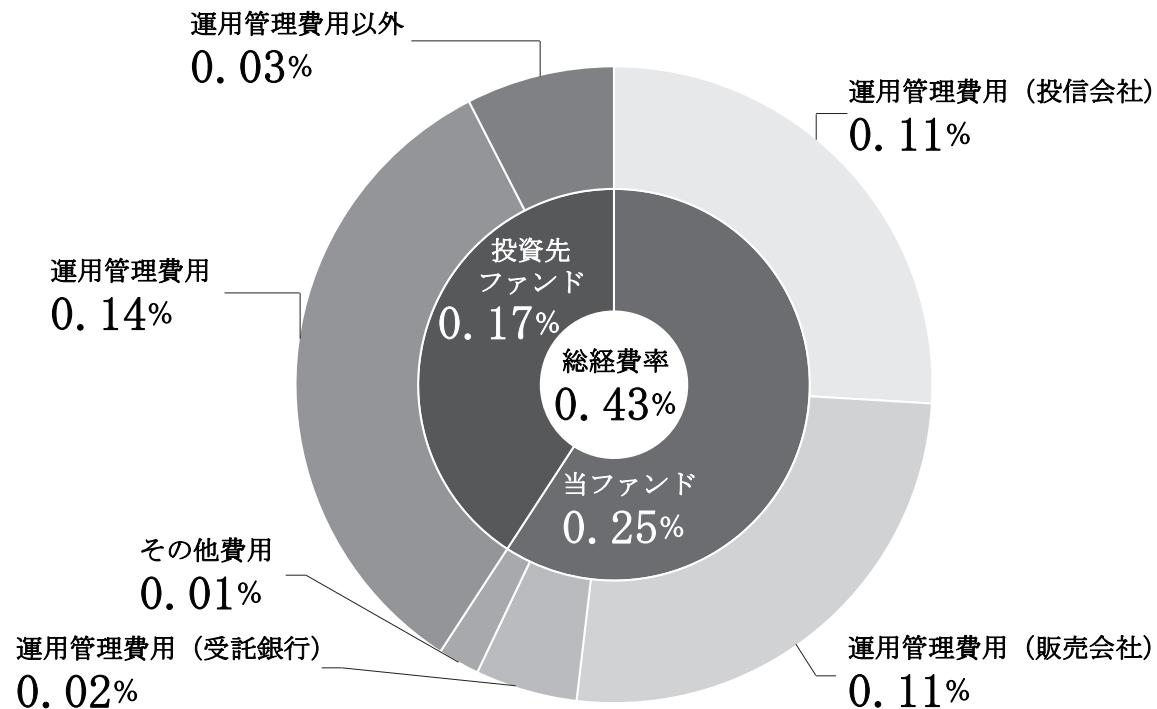
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入しております。

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

## (参考情報)

## ■総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.43%です。



総経費率 (①+②+③)	0.43%
①当ファンドの費用の比率	0.25%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.14%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.03%

(注1) ①の費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 投資先ファンドとは、このファンドが組入れている投資信託証券です。

(注5) ①の費用は、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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

## ■売買および取引の状況

### 投資信託受益証券

(2023年9月20日から2024年9月18日まで)

銘柄名	買付		売付		
	口数	金額	口数	金額	
国内	日本株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	千口 197,454.78	千円 326,740	千口 14,532.677	千円 24,780
	日本債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	1,140,554.516	1,081,190	5,045.311	4,700
	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)	65,466.599	145,740	12,634.115	28,220
	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)	147,023.264	185,760	2,828.234	3,470
	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)	54,882.488	86,910	1,876.813	3,070
	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)	66,261.66	93,910	1,356.645	1,870

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

## ■利害関係人との取引状況等 (2023年9月20日から2024年9月18日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ■組入資産明細表

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	当期末		
	口数	評価額	比率
日本株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	千口 718,809.742	千円 1,217,951	% 19.5
日本債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	3,279,658.774	3,104,197	49.8
外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	258,130.693	618,636	9.9
外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	484,488.077	612,441	9.8
新興国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	192,148.292	311,587	5.0
新興国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	217,801.329	308,515	4.9
合計	口数 銘柄数 < 比率 >	金額 5,151,036.907 6銘柄	6,173,328 <99.0%>

(注1) 比率欄は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注2) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2024年9月18日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 6,173,328	% 98.9
コール・ローン等、その他	71,658	1.1
投資信託財産総額	6,244,987	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2024年9月18日現在

項目	当期末
(A) 資産	6,244,987,228円
コール・ローン等	71,658,325
投資信託受益証券(評価額)	6,173,328,903
(B) 負債	8,889,763
未払解約金	1,539,341
未払信託報酬	7,081,901
その他未払費用	268,521
(C) 純資産総額(A-B)	6,236,097,465
元本	4,936,565,320
次期繰越損益金	1,299,532,145
(D) 受益権総口数	4,936,565,320口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,632円

(注1) 期首における元本額は3,434,795,606円、当期中における追加設定元本額は1,844,099,468円、同解約元本額は342,329,754円です。

(注2) 当期末の計算口数当りの純資産額は12,632円です。

## ■損益の状況

当期 自2023年9月20日 至2024年9月18日

項目	当期
(A) 配当等収益	31,018円
受取利息	35,010
支払利息	△ 3,992
(B) 有価証券売買損益	173,194,065
売買益	213,113,559
売買損	△ 39,919,494
(C) 信託報酬等	△ 13,229,250
(D) 当期損益金(A+B+C)	159,995,833
(E) 前期繰越損益金	287,266,231
(F) 追加信託差損益金	852,270,081
(配当等相当額)	( 554,635,609)
(売買損益相当額)	( 297,634,472)
(G) 合計(D+E+F)	1,299,532,145
次期繰越損益金(G)	1,299,532,145
追加信託差損益金	852,270,081
(配当等相当額)	( 554,635,609)
(売買損益相当額)	( 297,634,472)
分配準備積立金	447,262,064

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

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

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「分配金の計算過程」をご参照ください。

### 分配金の計算過程

項目	当期
(a) 経費控除後の配当等収益	28,372円
(b) 経費控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	159,958,971円
(c) 収益調整金	852,270,081円
(d) 分配準備積立金	287,274,721円
(e) 分配対象額(a+b+c+d)	1,299,532,145円
(f) 分配対象額(1万口当たり)	2,632.46円
(g) 分配金	0円
(h) 分配金(1万口当たり)	0円

## ■お知らせ

該当事項はございません。

# 日本株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

## 運用報告書 (全体版) 第6期

(決算日 2023年11月30日)

(作成対象期間 2022年12月1日～2023年11月30日)

### 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）（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行なっています。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

### 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			TOP I X (配当込み)		株式組入率比	株式先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
2期末(2019年12月2日)	円 10,236	円 0	% 5.3	2,611.46	% 5.5	% 98.7	% 1.4	百万円 52
3期末(2020年11月30日)	10,724	0	4.8	2,738.72	4.9	97.9	1.8	147
4期末(2021年11月30日)	12,020	0	12.1	3,073.26	12.2	97.2	3.0	318
5期末(2022年11月30日)	12,700	0	5.7	3,249.61	5.7	97.1	2.8	641
6期末(2023年11月30日)	15,550	0	22.4	3,986.65	22.7	97.9	1.9	1,154

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 指数值は、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) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注5) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

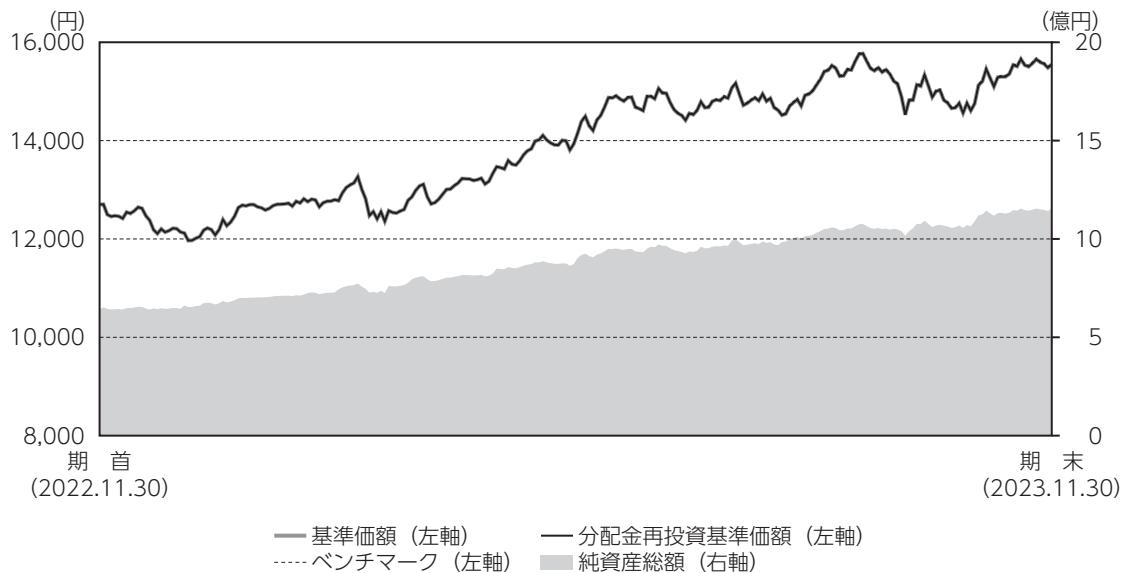
\*ベンチマークを「TOP I X」から「TOP I X (配当込み)」に変更しました。

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



# 運用経過

## 基準価額等の推移について



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

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

\*ベンチマークはTOPIX（配当込み）です。

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

## 基準価額・騰落率

期首：12,700円

期末：15,550円（分配金0円）

騰落率：22.4%（分配金込み）

## 基準価額の主な変動要因

国内株式市況が上昇したことを見て、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参考ください。

日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）

年 月 日	基 準 價 額	T O P I X (配当込み)		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
		騰 落 率	(ベンチマーク) 騰 落 率		
(期首) 2022年11月30日	円 12,700	% —	3,249.61	% —	% 97.1
12月末	12,119	△ 4.6	3,101.25	△ 4.6	97.3
2023年 1月末	12,652	△ 0.4	3,238.48	△ 0.3	96.7
2月末	12,769	0.5	3,269.12	0.6	98.2
3月末	12,985	2.2	3,324.74	2.3	97.2
4月末	13,333	5.0	3,414.45	5.1	97.5
5月末	13,809	8.7	3,537.93	8.9	97.2
6月末	14,851	16.9	3,805.00	17.1	96.6
7月末	15,071	18.7	3,861.80	18.8	98.6
8月末	15,133	19.2	3,878.51	19.4	96.5
9月末	15,211	19.8	3,898.26	20.0	96.8
10月末	14,752	16.2	3,781.64	16.4	95.9
(期末) 2023年11月30日	15,550	22.4	3,986.65	22.7	97.9

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2022.12.1～2023.11.30)

### ■国内株式市況

国内株式市況は、大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、世界的な景況感の悪化や日銀の政策変更による急速な円高進行が懸念され、2022年末にかけて下落しました。2023年に入ると、中国のゼロコロナ政策見直しにより景気回復期待が高まったことや、日銀総裁人事への不透明感が解消して円安が進んだことなどが好感され、3月上旬にかけて上昇しました。3月半ばには、米国地方銀行の経営破綻や欧州金融機関の破綻懸念などで金融不安が高まり下落しましたが、その後は、欧州金融機関の破綻回避などを受けて金融不安が一定程度後退したことにより、上昇に転じました。4月以降も、経済活動正常化や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたこと、日銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調し円安が進行したこと、米国著名投資家の強気見通しにより海外投資家の資金が大量に流入したことなどから、大幅に上昇しました。7月に入り、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇、中国の不動産大手の債務不履行懸念などから下落する場面もありましたが、8月半ばに発表された2023年4～6月期GDP（国内総生産）成長率が予想を上回る高い伸びとなつたことなどが好感され、再び上昇しました。9月下旬は、米国における長期金利の上昇や景気の先行き不透明感、パレスチナ情勢の悪化などが懸念されて反落しました。11月に入ると、欧米のインフレ率が予想以上に鈍化し金利が低下したことや好調な企業決算発表などが好感され、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

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

### ■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

(2022.12.1～2023.11.30)

### ■当ファンド

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

### ■トピックス・インデックス・マザーファンド

株式を中心に、先物取引も利用し、株式組入比率（株式先物を含む。）につきましては、当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な手法）を用いて構築しています。

当成期中、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、隨時、株式の売買を行いました。

\*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

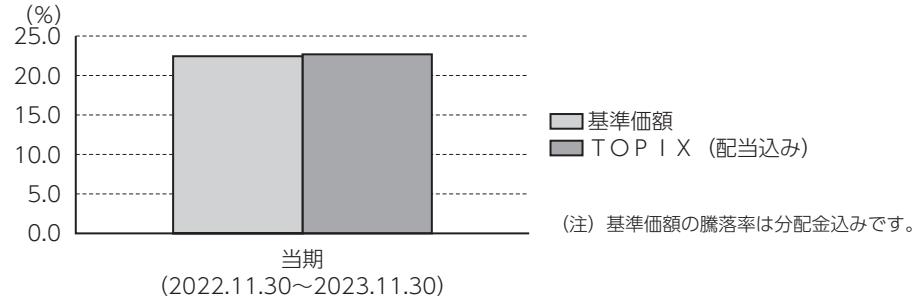
組入ファンド	ベンチマーク
トピックス・インデックス・マザーファンド	TOPIX (配当込み)

### ベンチマークとの差異について

当成期のベンチマークの騰落率は22.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は22.4%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\*ベンチマークはTOPIX (配当込み) です。

## 分配金について

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

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期 2022年12月1日 ～2023年11月30日
<b>当期分配金（税込み）（円）</b>	—
対基準価額比率（%）	—
当期の収益（円）	—
当期の収益以外（円）	—
翌期継越分配対象額（円）	5,712

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

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

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

(注4) 投資信託の計算上、「翌期継越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■トピックス・インデックス・マザーファンド

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

## 1万口当たりの費用の明細

項 目	当期 (2022.12.1~2023.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	20円	0.143%	信託報酬=当成期中の平均基準価額×信託報酬率 当成期中の平均基準価額は13,921円です。
(投 信 会 社)	(15)	(0.110)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(2)	(0.011)	販売会社分は、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0.006	売買委託手数料=当成期中の売買委託手数料／当成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(1)	(0.005)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
有価証券取引税	—	—	有価証券取引税=当成期中の有価証券取引税／当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=当成期中のその他費用／当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	21	0.154	

(注1) 当成期中の費用（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1万口当たりのそれぞれの費用金額を当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「1万口当たりの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

## ■売買および取引の状況

### 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
トピックス・インデックス・マザーファンド	千口	千円	千口	千円
	227,793	340,787	12,208	19,027

(注) 単位未満は切捨て。

### ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

項 目	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	57,123,482千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	234,706,615千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.24

(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成期中の利害関係人との取引状況

当成期中に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成期中の利害関係人との取引状況

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

決 算 期		当 期							
区 分	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	期首 口 数	当期 末 口 数	当期 末 評価 額 千円
株式	百万円 47,116	百万円 17,326	% 36.8	百万円 10,006	百万円 12	% 0.1			
新株予約権証券	-	-	-	2	2	100.0			
株式先物取引	57,635	33,480	58.1	59,605	34,058	57.1			
コール・ローン	2,764,349	-	-	-	-	-			

(注) 平均保有割合0.4%

※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。

### (3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

種 類	当 期		
	トピックス・インデックス・マザーファンド		
買 付 額	売 付 額	作成期末保有額	
株式	百万円 117	百万円 1	百万円 632

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

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

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

種 類	当 期
	トピックス・インデックス・マザーファンド
買 付 額	百万円 66
株式	百万円 66

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

### (5) 当成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	51千円
うち利害関係人への支払額 (B)	6千円
(B)/(A)	12.4%

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

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

## ■組入資産明細表

### 親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
		口 数	評 価 額 千円
トピックス・インデックス・マザーファンド	461,873	677,458	1,154,320

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額 千円	比 率 %
トピックス・インデックス・マザーファンド	1,154,320	99.9
コール・ローン等、その他	840	0.1
投資信託財産総額	1,155,161	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

# 日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年11月30日現在

項目	当期末
<b>(A) 資産</b>	<b>1,155,161,269円</b>
コール・ローン等	820,558
トピックス・インデックス・マザーファンド(評価額)	1,154,320,711
未収入金	20,000
<b>(B) 負債</b>	<b>759,290</b>
未払信託報酬	731,248
その他未払費用	28,042
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>1,154,401,979</b>
元本	742,378,301
次期繰越損益金	412,023,678
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>742,378,301口</b>
<b>1万口当たり基準価額(C/D)</b>	<b>15,550円</b>

\*期首における元本額は505,373,849円、当作成期間中における追加設定元本額は249,822,507円、同解約元本額は12,818,055円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は15,550円です。

## ■損益の状況

当期 自2022年12月1日 至2023年11月30日

項目	当期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 19円</b>
支払利息	△ 19
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>188,904,139</b>
売買益	190,867,561
売買損	△ 1,963,422
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 1,309,407</b>
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>187,594,713</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>67,935,827</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>156,493,138</b>
(配当等相当額)	( 168,549,750)
(売買損益相当額)	(△ 12,056,612)
<b>(G) 合計(D+E+F)</b>	<b>412,023,678</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>412,023,678</b>
追加信託差損益金	156,493,138
(配当等相当額)	( 168,549,750)
(売買損益相当額)	(△ 12,056,612)
分配準備積立金	255,530,559
繰越損益金	△ 19

(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	187,594,732
(c) 収益調整金	168,549,750
(d) 分配準備積立金	67,935,827
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	424,080,309
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	424,080,309
(h) 受益権総口数	742,378,301口

## 《お知らせ》

### ■ベンチマークの変更について

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

	変更前	変更後
日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）	東証株価指数（T O P I X）	東証株価指数（T O P I X）（配当込み）
トピックス・インデックス・マザーファンド	東証株価指数	東証株価指数（配当込み）

## &lt;補足情報&gt;

当ファンド（日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用））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（2023年9月19日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2023年11月30日）現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

## ■トピックス・インデックス・マザーファンドの主要な売買銘柄

## 株式

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

買付				売付			
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
トヨタ自動車	千株 730.4	千円 1,653,352	円 2,263	東芝	千株 151.5	千円 699,916	円 4,619
ソニーグループ	94	1,169,300	12,439	日本電信電話	1,922.8	341,056	177
ゆうちょ銀行	705.7	985,979	1,397	ソフトバンクグループ	63.4	318,164	5,018
三菱UFJフィナンシャルG	817.9	864,535	1,057	みずほフィナンシャルG	81	208,153	2,569
三菱商事	128	822,547	6,426	HOYA	14.2	206,292	14,527
キーエンス	13.2	819,473	62,081	三菱UFJフィナンシャルG	219.2	195,395	891
三井物産	144	723,088	5,021	伊藤忠テクノソリュ	41.9	181,217	4,325
信越化学	144.4	716,803	4,964	SMC	2.1	142,861	68,029
日本電信電話	2,444.2	696,623	285	キヤノン	38.2	137,977	3,611
伊藤忠	134.3	696,348	5,185	富士通	6.6	127,421	19,306

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

下記は、2023年11月30日現在におけるトピックス・インデックス・マザーファンド（166,904,971千口）の内容です。

## (1) 国内株式

銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額
水産・農林業（0.1%）	千株	千円	日本アクア	千株	千円	錢高組	千株	千円	日本ハウスHLDGS	千株	千円
極洋	4.5	17,235	ファーストコーポレーション	1.6	1,180	鹿島建設	179.6	419,635	新日本建設	17.1	5,574
ニッスイ	116.2	85,685	ペステラ	1.5	1,554	不動テトラ	5.6	12,258	東亜道路	3.2	12,665
マルハニチロ	17.4	49,416	キャンディル	1.1	636	大末建設	1.8	2,433	日本道路	9.5	21,408
雪国まいたけ	10.1	9,595	ダイセオ環境リユーション	1.3	1,329	鉄建建設	5.8	11,327	東亜建設	6.2	18,021
カネコ種苗	3.7	5,261	第一カッター興業	2.9	3,790	西松建設	15.4	60,275	日本国土開発	22.8	22,165
サカタのタネ	13.2	52,602	安藤一・間	67	73,164	三井住友建設	60.1	23,919	若築建設	2.8	13,429
ホクト	9.4	16,487	東急建設	36.2	28,525	大豊建設	2.8	10,220	東洋建設	20.3	8,248
ホクリョウ	1.1	1,261	コムシホールディングス	37	118,659	佐田建設	2.8	1,836	五洋建設	114.9	26,999
鉱業（0.4%）			ビーアールホールディングス	16.9	6,067	ナカノフードー建設	3.3	1,491	世紀東急	10.4	93,114
住石ホールディングス	11.4	8,800	高松コンストラクションGP	8.6	22,678	奥村組	13.1	59,146	福田組	3	17,305
日鉄鉱業	4.6	25,990	東建コーポレーション	3.3	26,730	東鉄工業	10	29,020	住友林業	70	15,660
三井松島HLDGS	6.9	19,444	ソネック	0.7	666	イチケン	1.1	2,530	日本基礎技術	70	12,665
INPEX	428.2	894,938	ヤマウラ	5.8	8,340	富士ピー・エス	2	890	巴コーポレーション	224	3,192
石油資源開発	13.4	76,246	オリエンタル白石	42.5	14,025	浅沼組	5.9	21,800	大和ハウス	224	2,125
K&Oエナジーグループ	5.2	11,382	大成建設	75.8	381,349	戸田建設	109.6	92,535	ライト工業	16.7	940,576
建設業（2.1%）			大林組	289.7	361,400	熊谷組	13.5	45,900	積木ハウス	17.7	33,066
ショーピンドHD	15.8	95,195	清水建設	229.7	223,176	北野建設	0.8	2,480	日特建設	7.7	245.7
ミライト・ワン	38.3	70,720	飛島建設	8.3	10,781	植木組	1.3	1,892	北陸電気工事	5.5	7,915
タマホーム	7.3	25,404	長谷工コーポレーション	74.3	135,114	矢作建設	11	14,146	ユアテック	6.3	5,197
サンヨーホームズ	0.8	579	松井建設	7.5	5,812	ピース三菱	10.2	9,598	日本リーテック	17.7	17,753

日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）

銘柄		2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄		2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄		2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄		2023年11月30日現在 株数	評価額
四電工		千株	千円	六甲バター		千株	千円	ファーマフーズ		千株	千円	レンゴー		千株	千円
中電工		12.5	30,387	ヤクルト	116.3	384,138		ユーブレナ	50.5	37,673		トモク	4.7	10,217	
関電工		50.7	67,329	明治ホールディングス	99.8	341,615		紀文食品	7.2	8,294		ザ・パック	6.1	19,611	
きんでん		57	126,511	雪印メグミルク	19.8	42,827		ピックルスホールディングス	4.9	5,914		<b>化学（6.0%）</b>			
東京エヌシス		8.1	7,816	ブリマハム	11.1	24,975		ミヨシ油脂	1.8	2,637		北の達人コーポ	34.8	7,238	
トーエニッペ		2.6	11,037	日本ハム	35.1	154,229		理研ビタミン	7.1	15,996		クラレ	120.5	181,292	
住友電設		7.7	19,688	林兼産業	1.9	1,138		<b>織維製品（0.4%）</b>				旭化成	559.6	574,429	
日本電設工業		15.2	30,764	丸大食品	8.4	13,582		片倉工業	7.6	12,745		共和レザー	2.6	1,892	
エクシオグループ		40.7	126,902	S F o o d s	9	28,845		グンゼ	5.9	28,320		巴川製紙	1.3	967	
新日本空調		5.2	11,622	柿安本店	3.1	7,675		東洋紡	35.7	37,556		レジナック・ホールディング	79.9	220,524	
九電工		17.5	81,602	伊藤ハム米久HLDGS	12.5	49,375		ユニチカ	26.9	4,922		住友化学	613.6	231,634	
三機工業		17.5	30,625	サッポロホールディングス	26.8	154,528		富士紡ホールディングス	3.6	13,284		住友精化	3.9	19,695	
日揮ホールディングス		80.2	133,252	アサヒグループホールディングス	187.9	1,024,994		倉敷紡績	6.2	15,853		日産化学	38.9	209,787	
中外炉工業		2.7	6,045	キリンHD	338.9	707,284		シキボウ	3.7	4,044		ラサ工業	3.2	6,822	
ヤマト		3.7	3,481	宝ホールディングス	55.7	67,675		日本毛織	21.8	28,231		クレハ	6	51,900	
太平電業		5	19,375	オエノンホールディングス	24.5	9,163		ダイイトウボウ	7.3	642		多木化学	3.2	10,112	
高砂熱学		21.7	65,078	養命酒	2.8	5,244		トーワコーポレーション	1.8	828		ティカ	7.1	9,407	
三光金属		0.6	2,820	コカ・コーラボトラーズHD	63.9	129,429		ダイドーリミテッド	6.6	2,640		石原産業	13.7	18,810	
朝日工業社		3.8	10,632	サントリー食品インター	57.3	266,330		帝国織維	9.3	18,869		片倉コーポアグリ	1.1	1,252	
明星工業		15.7	17,584	ダイドーブループHD	4.7	28,106		帝人	79.5	106,967		日本曹達	9.8	52,332	
大氣社		9.3	39,339	伊藤園	27.6	124,062		東レ	554.3	425,203		東ソー	110.5	217,353	
ダイダン		10.6	15,688	キーコーヒー	9.3	19,232		住江織物	0.9	2,022		トクヤマ	26.7	64,106	
日比谷総合設備		5.8	13,676	ユニカフェ	1.7	1,626		日本フエルト	2.7	1,142		セントラル硝子	8.8	23,927	
フィル・カンパニー		1.3	774	ジャパンフーズ	0.9	1,052		イチカワ	0.6	976		東亞合成	41.4	56,304	
テスホールディングス		17.5	7,735	日清オイリオグループ	11.5	48,127		日東製綱	0.5	736		大阪ソーダ	5.8	56,376	
インフロニアHD		93.3	145,687	不二製油グループ	19	44,118		アツギ	3.1	1,447		関東電化	16	13,280	
東洋エンジニア		12	8,472	かどや製油	0.6	2,136		ダイニック	1.4	1,015		デンカ	30.1	79,614	
レイズネクスト		11.7	16,239	J-Oイルミルズ	9.6	18,940		セーレン	15.9	36,888		信越化学	750	3,909,000	
<b>食料品（3.4%）</b>				キッコーマン	53.9	488,603		ソート	1.4	987		日本カーバイド	3.1	4,696	
ニップン		24.6	55,940	味の素	193.2	1,067,623		東海染工	0.4	376		堺化学	6.3	11,875	
日清製粉G本社		75.3	154,252	ブルドツクソース	4.4	9,204		小松マテーレ	12	9,360		第一稀元素化学工	9	8,955	
日東富士製粉		1.5	7,080	キューピー	43.9	113,262		ワコルホールディングス	16.9	55,009		エア・ウォーター	78	151,437	
昭和産業		8	24,480	ハウス食品G本社	28.1	90,734		ホギメディカル	10.9	37,332		日本酸素HLDGS	80.2	311,416	
鳥越製粉		4.6	3,289	カゴメ	35.1	111,512		クラウディアHLDGS	1	407		日本化学工業	3	6,087	
中部飼料		11.6	12,586	焼津水産化工	2	2,340		T S I ホールディングス	27.8	21,517		東邦アセチレン	1	1,877	
フィード・ワン		12.2	9,662	アリਆケジャパン	8.1	37,381		マツオカコーポレーション	1.4	2,125		日本ペーカライジング	36.9	42,582	
東洋精糖		0.9	1,816	ピエトロ	0.6	1,093		ワールド	11.7	19,071		高圧ガス	11.8	9,546	
日本甜菜糖		4.9	9,863	エバラ食品工業	2	5,668		三陽商会	2.7	7,284		チタン工業	0.6	772	
DM三井製糖ホールディ		8.2	24,764	やまみ	0.5	1,552		ナイガイ	1.5	403		四国化成ホールディング	10.6	18,518	
塩水港精糖		6.7	1,567	ニチレイ	37.3	120,255		オンワードホールディングス	48.7	24,398		戸田工業	1.9	3,100	
ウェルネオシュガー		4.2	8,668	東洋水産	41.1	323,457		ルックホールディングス	2	4,966		ステラ ケミファ	4.5	14,602	
森永製菓		17.5	92,347	イートアンドHLDGS	3.7	7,566		ゴールドワイン	14.6	168,411		保土谷化学	2.6	9,360	
中村屋		2.1	6,447	大冷	0.8	1,542		デサント	14.3	60,846		日本触媒	12.6	67,422	
江崎グリコ		23.4	95,448	ヨシムラ・フード・HLDGS	3.7	4,121		キンプ	1.7	1,145		大日精化	5.8	12,858	
名糖産業		3.4	5,559	日清食品HD	28.6	419,419		ヤマトイントナショナル	3.5	1,050		カネカ	21	77,973	
井村屋グループ		5	11,595	永谷園ホールディングス	4.1	8,892		<b>パルプ・紙（0.2%）</b>				三菱瓦斯化学	61.8	144,457	
不二家		5.6	14,005	一正蒲鉾	2.2	1,623		特種東海製紙	4.5	16,717		三井化学	68.2	295,169	
山崎製パン		54.5	176,307	フジッコ	8.6	16,649		王子ホールディングス	344.5	189,199		J S R	90.1	366,616	
第一屋製パン		1	695	ロックフィールド	9.3	14,796		日本製紙	46.6	62,304		東京応化工業	13.2	120,951	
モロゾフ		2.7	10,489	日本たばこ産業	494.2	1,878,454		三菱製紙	6.2	3,286		大阪有機化学	6.9	18,416	
亀田製菓		4.7	18,259	ケンコーマヨネーズ	5.7	9,205		北越コーポレーション	40.6	57,205		三菱ケミカルグループ	604.7	585,651	
寿スピリッツ		38.4	90,163	わらべや日洋HD	5.5	19,167		中越パレプ	1.9	3,279		K Hネオケム	12.6	28,854	
カルビー		37.3	103,283	なとり	5.3	10,785		大王製紙	36.4	38,129		ダイセル	106.3	151,052	
森永乳業		29.6	81,696	イフジ産業	0.9	1,207		阿波製紙	1.2	480		住友ベーフライト	12.3	86,850	

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

銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額
千株	千円	千株	千円	千株	千円	千株	千円	千株	千円	千株	千円
積水化学	167.7	352,253	コーセー	16.8	175,812	科研製薬	14.2	47,967	日本板硝子	39.5	25,438
日本ゼオン	56.7	77,905	コタ	7.4	11,632	エーザイ	100.7	772,570	石塚硝子	0.8	2,692
アイカ工業	20.8	69,160	シーボン	0.6	895	ロート製薬	80.2	247,818	日本山村硝子	1.7	2,561
U B E	39.4	91,545	ボーラ・オルビスHD	42.4	66,080	小野薬品	175.8	478,351	日本電気硝子	33.8	105,456
積水樹脂	12.3	30,823	ノエビアホールディングス	7.4	38,628	久光製薬	18.4	84,971	オハラ	3.9	5,124
タキロンシーアイ	20.9	12,310	アジュバンホールディング	1.1	1,021	持田製薬	9.5	31,872	住友大阪セメント	13.8	49,790
旭有機材	5.5	23,320	新日本製薬	4.7	7,402	参天製薬	150.9	211,109	太平洋セメント	49	136,097
ニチバン	4.4	7,735	アカシアージ	4.2	4,271	扶桑薬品	2.9	5,530	日本ヒューム	7.2	6,832
リケンテクノス	17.7	15,363	エステー	6.2	9,405	日本ケミファ	0.5	811	日本コンクリート	15.8	5,103
大倉工業	3.8	10,708	アグロカネショウ	3.3	4,448	ツムラ	26	72,670	三谷セキサン	3.5	15,365
積水化成品	11.6	5,602	コニシ	13.8	35,631	キッセイ薬品工業	13.7	41,853	アジアパイルHD	11.8	8,307
群栄化学	1.9	5,861	長谷川香料	15.8	50,876	生化学工業	13.9	11,008	東海カーボン	76.4	83,581
タイガース ポリマー	2.1	1,923	小林製薬	24.1	164,362	榮研化学	16.1	26,516	日本カーボン	4.4	20,438
ミライアル	1.6	2,430	荒川化学工業	6.9	7,024	鳥居薬品	4.4	16,104	東洋炭素	5.8	26,622
ダイキアクシス	1.9	1,470	メック	6.8	27,506	J C R ファーマ	28	37,072	ノリタケ	4.6	31,924
ダイキヨーニシカワ	18.4	14,168	日本高純度化学	1.8	4,500	東和薬品	12.7	31,369	T O T O	54.7	207,695
竹本容器	1.7	1,349	タカラバイオ	22.3	27,250	富士製薬工業	6	9,360	日本碍子	96.3	173,725
森六ホールディングス	4.7	13,912	J C U	9.3	36,735	ゼリア新薬工業	11.4	23,096	日本特殊陶業	69.4	238,250
恵和	6	8,160	新田ゼラチン	3.3	2,587	そせいグループ	26.7	37,086	ダントーホールディングス	3	2,877
日本化薬	63.1	85,185	O A T アグリオ	2.4	4,622	第一三共	721.4	2,885,600	M A R U W A	3.1	92,287
カーリットホールディングス	9	8,505	デクセリアルズ	20.8	96,366	杏林製薬	17.8	32,538	品川リフラクトリーズ	10.2	17,391
日本精化	5.5	14,712	アース製薬	7.5	35,850	大幸薬品	17	5,117	黒崎播磨	1.7	19,091
扶桑化学工業	8.7	38,149	北興化学	8.4	8,190	ダイト	6.3	12,253	ヨータイ	5.1	7,425
トリケミカル	10	35,100	大成ラミック	2.4	7,041	大塚ホールディングス	172.3	980,214	東京窯業	4.8	2,020
A D E K A	28.9	82,928	クミアイ化学	32.9	35,828	大正製薬HD	18.4	159,877	ニッカトー	2.1	1,199
日油	25.6	175,232	日本農業	15.2	9,089	ペプチドリーム	40.1	50,786	フジインコーポレーテッド	22.2	65,023
新日本理化	6.2	1,209	アキレス	5.2	8,096	セルソース	2.3	3,675	クニミネ工業	1.3	1,277
ハリマ化成グループ	4.4	3,498	有沢製作所	14.5	15,877	あすか製薬HD	8.5	15,478	エーアンドエーティアリアル	0.9	1,136
花王	187	1,065,152	日東電工	53.2	559,398	サワイグループHD	18.9	92,950	ニチアス	20.9	65,939
第一工業製薬	3.3	6,184	レック	10.5	10,437	石油・石炭製品(0.5%)			ニチハ	10.4	28,870
石原ケミカル	3.7	7,329	三光合成	10.4	5,616	日本コクス工業	83.8	10,223	<b>鉄鋼(1.0%)</b>		
日華化学	1.8	1,773	きもと	7.6	1,451	ニチレキ	10.7	24,460	日本製鉄	381.5	1,318,845
ニイタカ	0.8	1,599	藤森工業	6.5	25,252	ユシロ化学	4.3	7,387	神戸製鋼所	171.3	296,605
三洋化成	5.1	21,853	前澤化成工業	5.3	8,374	ビーピー・カストロール	1.7	1,519	中山製鋼所	19.5	16,438
有機合成薬品	3.6	1,040	未来工業	2.9	9,120	富士石油	24.1	8,796	合同製鐵	4.8	21,888
大日本塗料	9.2	9,025	ウェーブロックHDG S	1.7	1,094	M O R E S C O	1.6	2,108	J E ホールディングス	236.9	516,442
日本ペイントHOLD	439.2	485,096	ジェイ エス ピー	5.8	10,341	出光興産	92	373,152	東京製鐵	23.9	42,876
関西ペイント	81.1	182,637	エフピコ	15.7	43,818	ENEOSホールディングス	1,311.2	766,265	共英製鋼	9.7	20,176
神東塗料	3.8	486	天馬	6	14,016	コスモエネルギーHDG S	24.6	138,621	大和工業	16.1	120,138
中国塗料	17	26,197	信越ポリマー	17.8	25,436	<b>ゴム製品(0.7%)</b>			東京鐵鋼	3.8	15,048
日本特殊塗料	3.3	4,187	東リ	11.3	3,819	横浜ゴム	41.9	137,809	大阪製鐵	3.9	7,437
藤倉化成	10.1	4,504	ニフコ	24.8	89,577	T O Y O T I R E	47.6	116,834	淀川製鋼所	9.6	37,488
太陽ホールディングス	14.4	43,056	バルカー	6.9	26,944	ブリヂストン	242.4	1,478,155	中部鋼板	5.6	10,998
D I C	32.3	78,602	ユニ・チャーム	172.5	821,617	住友ゴム	81.2	138,811	丸一鋼管	25.9	98,963
サカタインクス	18.4	24,048	ショーエイコーポ	1.4	819	藤倉コンポジット	5.6	7,924	モリ工業	1.5	6,277
東洋インキSCホールдин	18	48,006	医薬品(4.8%)			オカモト	3.9	21,255	大同特殊鋼	10.7	73,048
T & K T O K A	7.9	11,391	協和キリン	100.1	243,943	フコク	4.3	6,028	日本高周波	1.8	1,013
富士フィルムHLDGS	153.7	1,331,042	武田薬品	732.9	3,052,528	ニッタ	8.4	31,458	日本冶金工	6.2	25,916
資生堂	172.9	685,721	アステラス製薬	726.5	1,305,883	住友理工	12.9	13,338	山陽特殊製鋼	8.4	21,974
ライオン	108.4	140,269	住友ファーマ	61.4	28,735	三ツ星ベルト	10.1	45,096	愛知製鋼	4.9	16,831
高砂香料	6.2	21,793	塩野義製薬	104.4	728,503	パンドー化学	12.3	19,188	日本金属	1.2	1,095
マンダム	17.9	22,804	わかもと製薬	4.7	935	ガラス・土石製品(0.7%)			大平洋金属	7.3	9,008
ミルボン	11.2	41,395	日本新薬	21.7	115,682	日東紡績	10.5	47,197	新日本電工	42.3	12,816
ファンケル	36.2	82,427	中外製薬	259.2	1,352,505	A G C	77.2	414,564	栗本鉄工所	3.9	13,026

日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）

銘柄	柄	2023年11月30日現在		銘柄	柄	2023年11月30日現在		銘柄	柄	2023年11月30日現在		銘柄	柄	2023年11月30日現在	
		株数	評価額			株数	評価額			株数	評価額			株数	評価額
虹技		千株	千円	日本ファイルコン		千株	千円	ヤマシンフィルタ		千株	千円	トヨーカネツ		千株	千円
日本鉄錆管		0.6	685	ノーリツ		14.1	21,121	日阪製作所		20	6,900	栗田工業		3.2	11,888
三菱製鋼		0.5	548	長府製作所		8.4	17,656	やまびこ		9.1	8,708	椿本チエイン		46.7	244,614
日亜鋼業		6.3	9,695	リンナイ		41.7	125,308	野村マイクロ・サイエンス		13.7	20,358	大同工業		11.9	44,922
日本精線		4.7	1,447	ダイニチ工業		2.3	1,690	平田機工		2.8	32,004	木村化工機		2	1,474
エンビプロHD		1.3	6,116	日東精工		12.3	6,937	P E G A S U S		4	25,520	アネスト岩田		6.4	4,582
シンニッタン		4.5	2,839	三洋工業		0.5	1,107	マルマ工		9.2	4,397	ダイワフ		12.9	14,112
新家工業		5.8	1,455	岡部		15.1	10,615	タツモ		3.6	6,573	サムコ		140.8	391,846
非鉄金属（0.7%）		1	2,893	ジーテクト		10.8	18,835	ナブテスコ		5	18,200	加藤製作所		2.2	10,527
大紀アルミニウム		10.7	12,914	東プレ		15	30,030	三井海洋開発		52.4	145,017	油研工業		2.4	2,992
日本軽金属HD		24.8	41,887	高周波熱鍊		13.1	13,139	レオン自動機		10.6	20,214	タダノ		48.1	55,531
三井金属		24.8	112,592	東京製綱		5.5	7,590	SMC		9.7	15,151	フジテック		19.5	66,865
東邦亜鉛		5.4	6,469	サンコール		6.5	3,087	ホソカワミクロン		25	1,861,250	C K D		23.1	55,647
三菱マテリアル		60.9	148,230	モリテックスチル		4.1	1,209	ユニオンツール		5.4	22,950	平和		24.6	51,758
住友鉱山		98.8	424,049	パイオラックス		10.6	24,009	瑞光		3.7	12,524	理想科学工業		6.7	18,498
DOWAホールディングス		21	110,376	エイチワン		8.6	6,604	オレス工業		6	8,598	S A N K Y O		20.5	130,954
古河機金		11.2	20,966	日本発条		75.4	84,825	日精エースピー		11.3	22,080	日本金銭機械		10.1	11,322
エス・サイエンス		27.7	609	中央発條		6.3	4,548	サトーホールディングス		3.3	16,450	マースグループHLDGS		4.2	10,008
大阪チタニウム		14.8	42,949	アドバネクス		0.6	557	技研製作所		11.9	24,264	フクシマガリレイ		5.4	26,460
東邦チタニウム		17.6	32,225	立川ブライド		3.8	5,639	日本工アーテック		7.9	14,678	オーイズミ		1.7	674
U A C J		11.9	41,233	三益半導体		6.6	18,321	カワタ		3.9	5,460	ダイコク電機		4.1	14,165
C Kサンエツ		2	7,390	機械（5.2%）				日精樹脂工業		1.5	1,635	竹内製作所		15.1	65,307
古河電工		28.4	67,549	日本ドライケミカル		1.1	2,835	オカダエイヨン		6.2	6,720	アマノ		23.7	74,583
住友電工		318.8	584,679	日本製鋼所		23	58,730	ワエイシホールディングス		1.6	3,712	J U K I		13	6,565
フジクラ		100.5	114,419	三浦工業		34.8	99,736	小松製作所		2.7	6,831	サンデン		6.7	1,125
SWCC		9.5	25,469	タクマ		28.2	46,022	T O W A		391	1,474,852	ジャノメ		8.4	6,022
タツタ電線		15	10,245	ツガミ		18.5	22,755	日立建機		49.4	174,332	マックス		11.7	32,923
カナレ電気		0.8	1,272	オーフマ		7.3	45,216	日工		33.3	127,705	グローリー		20	55,400
平河ヒューテック		5.4	7,365	芝浦機械		8.3	31,664	巴工業		12.3	8,277	新晃工業		8.4	20,823
リョービ		9.1	26,526	アマダ		133.2	197,469	井関農機		3.3	9,490	大和冷機工業		12.7	18,313
アーレスティ		5.2	4,248	アイデエンジニア		19.3	16,791	T O W A		7.9	8,737	セガサミホールディングス		74.5	159,988
AREホールディングス		31.8	60,706	F U J I		39.3	98,485	丸山製作所		9.3	65,658	T P R		10.6	18,327
金属製品（0.5%）				牧野フライス		9.2	53,360	北川鉄工所		0.8	2,024	ツバキ・ナカシマ		16.7	12,391
稻葉製作所		4.4	6,538	オーエスジー		36.8	67,748	ローツエ		3.3	4,342	ホシザキ		49.2	231,682
宮地エンジニアリングG		4.3	13,695	ダイジェット		0.5	442	タカキタ		4.4	64,064	大豊工業		7.2	6,285
トカロ		24.6	35,374	旭ダイヤモンド		20	18,380	クボタ		1.5	717	日本精工		154.5	119,752
アルファCO		1.7	2,521	DMG森精機		50.6	134,418	荏原実業		4.4	12,988	N T N		181	50,118
S U M C O		151.4	335,578	ソディツク		20.5	15,395	三菱化工業		3	9,855	ジェイテクト		74.3	100,713
川田テクノロジーズ		2	14,000	ディスコ		40.1	1,286,809	月島ホールディングス		11.3	15,006	不二越		6.2	23,467
RS TECHNOLOGIES		5.7	16,313	日東工器		4	7,448	帝国電機製作所		5.9	17,788	日本トムソン		22.8	13,452
ジェイックコーポレーション		0.6	1,224	日進工具		7.7	7,931	東京機械		1.2	528	T H K		48.1	142,063
信和		3.1	2,294	パンチ工業		4.6	1,968	新東工業		16.9	18,370	ユーシン精機		48.1	119,752
東洋製罐グループHD		50.8	116,560	富士ダイス		4.3	2,816	渡谷工業		11.6	20,042	前澤給装工業		6.3	8,133
ホッカントホールディングス		4.2	6,615	豊和工業		2.5	1,937	アイチ コーポレーション		34.2	10,822	イーグル工業		9.2	15,244
コロナ		4.6	4,250	石川製作所		1.2	1,443	小森コーポレーション		21.1	24,665	前澤工業		2.6	2,545
横河ブリッジH L D G S		13.4	36,501	リケンN P R		9.1	17,836	鶴見製作所		6.4	22,816	日本ピラーア工業		7.7	35,420
駒井ハルテック		0.8	1,772	東洋機械金属		3.9	2,601	日本ギア工業		1.8	883	キッツ		27.9	31,889
高田機工		0.3	1,005	津田駒工業		0.8	284	酒谷重工業		1.2	7,044	マキタ		95.1	373,172
三和ホールディングス		85.6	181,557	エンシュウ		1.1	757	荏原製作所		34.2	286,288	三井E & S		21.7	11,783
文化シヤツター		22.2	30,636	島精機製作所		13.3	20,402	石井鉄工所		0.5	1,364	日立造船		73.6	66,313
三協立山		9.7	7,934	オプトラン		13.7	22,289	西島製作所		7.2	15,818	三菱重工業		145.9	1,206,301
アルインコ		6.4	6,540	NCホールディングス		1.1	2,092	北越工業		8.4	18,891	I H I		62.1	177,357
東洋シヤツター		1.1	787	イワキポンプ		5.6	11,519	ダイキン工業		99.6	2,206,638	サノヤスホールディングス		7.4	1,021
L I X I L		133	240,131	フリュー		7.9	9,732	オルガノ		10	60,600	スター精密		15.6	29,281

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

銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	
千株	千円	千株	千円	千株	千円	千株	千円	千株	千円	千株	千円	
<b>電気機器 (17.3%)</b>			アクセル	2.9	6,119	OBARA GROUP	4.5	16,650	三桜工業	12.6	10,999	
日清紡ホールディングス	62.7	68,123	E I Z O	6.1	29,737	澤藤電機	0.5	629	デンソー	681.3	1,576,528	
イビデン	43.5	307,588	ジャパンディスプレイ	61.7	1,789	原田工業	2	1,564	東海理化電機	23.3	57,737	
コニカミノルタ	186.2	87,122	日本信号	18.9	18,087	コーセル	9.9	12,513	川崎重工業	67.4	226,666	
ブラー工業	111.5	278,304	京三製作所	17.5	8,330	イリソ電子工業	7.6	30,210	名村造船所	18	18,522	
ミネベアミツミ	145.1	408,166	能美防災	11.3	21,300	オブテックスグループ	15.2	26,022	日本車輪	2.8	5,863	
日立	405.6	4,171,596	ホーチキ	6.2	10,248	千代田インテグレ	3.2	9,728	三菱ロジスネクスト	13.2	17,476	
三菱電機	928.3	1,864,954	星和電機	2	972	レザーテック	37.8	1,248,912	近畿車輛	0.7	1,228	
富士電機	50.7	314,390	エレコム	19.9	32,317	スタンレー電気	52.9	144,734	日産自動車	1,173.2	683,858	
東洋電機製造	1.5	1,404	パナソニック ホールディング	985.2	1,507,356	ウシオ電機	42	80,010	いすゞ自動車	240.1	469,515	
安川電機	90.6	513,973	シャープ	140.6	130,139	岡谷電機	3.4	1,016	トヨタ自動車	4,533.8	12,669,704	
シンフォニア テクノロジー	9.2	18,988	アンリツ	58.7	75,341	ヘリオステクノH	4.6	2,300	日野自動車	124.2	59,293	
明電舎	15.5	37,928	富士通ゼネラル	23.6	63,956	エノモト	1.2	1,902	三菱自動車工業	322.2	155,107	
オリジン	1	1,216	ソニーグループ	584	7,486,880	日本セラミック	6.7	19,657	エフティック	3.2	2,035	
山洋電気	3.6	21,924	T D K	132.1	907,527	遠藤照明	2.1	2,698	レッドホールディングス	1.9	1,113	
デンヨー	6.4	13,824	帝国通信工業	3.6	7,070	古河電池	6.1	5,441	GMB	0.9	1,192	
P H Cホールディングス	15.5	23,017	タムラ製作所	33.2	18,890	双信電機	1.8	588	ファルティック	0.8	438	
ソシオネクスト	12.1	160,325	アルプスアルバイン	74.5	96,514	山一電機	7.4	14,023	武藏精密工業	20.2	32,602	
東芝テック	10.7	31,126	池上通信機	1.4	1,299	国研	7.2	30,528	日産車体	9.7	8,691	
芝浦メカトロニクス	4.7	31,490	日本電波工業	10	12,500	日本電子	20.7	121,343	新明和工業	23.8	28,179	
マブチモーター	20.7	96,213	鈴木	4.5	5,553	カシオ	59.7	74,565	極東開発工業	13.7	26,030	
ニチエック	184.1	1,031,696	マイコー	8.3	36,146	ファナック	402.6	1,656,296	トピー工業	6.7	18,512	
ユーズミーエレクトロニクス	5.2	1,991	日本トリム	1.9	5,899	日本シイムケイ	17.5	13,142	ティラド	1.8	5,697	
トレックス・セミコンダクター	4.3	8,617	ローランド ディー. ジー.	4.6	16,629	エンプラス	2.4	32,016	タチエス	15.2	26,752	
東光高岳	5	10,345	フォスター電機	6.2	6,894	大真空	12.3	10,430	NOK	32.1	60,508	
ダブル・スコープ	23.9	21,988	SMK	2.2	5,535	ローム	152.7	431,453	フタバ産業	22.1	18,917	
ダイヘン	8.4	48,972	ヨコオ	7.4	11,588	浜松ホトニクス	66.3	388,252	カヤバ	8	38,040	
ヤーマン	14.4	15,278	ティアップ	7.4	754	三井ハイテック	7.3	54,012	大同タル工業	16	9,264	
J V Cケンウッド	65.8	50,468	ホシデン	19	34,352	新光電気工業	29.2	161,154	プレス工業	33	20,460	
ミマキエンジニアリング	7.9	7,655	ヒロセ電機	12.3	203,565	京セラ	128.3	1,050,777	ミクニ	5.8	2,644	
I - P E X	5.7	10,396	日本航空電子	19.9	58,645	太陽説電	40.2	154,126	太平洋工業	18.9	26,403	
大崎電気	18.3	12,023	T O A	9.5	9,975	村田製作所	751.3	2,166,373	河西工業	7.2	1,591	
オムロン	63.7	394,876	マクセル	18.4	30,507	双葉電子工業	15.7	8,682	アイシン	63.7	347,228	
日東工業	11.2	40,208	古野電気	10.8	19,548	北陸電気工業	1.7	2,383	マツダ	273.2	431,246	
I D E C	12.3	34,747	スミダコーポレーション	11.2	13,238	ニチコン	21.7	31,920	今仙電機製作所	2.8	1,719	
正興電機製作所	1.5	1,711	アイコム	3.2	10,432	日本ケミコン	8.8	12,188	本田技研	2,013.7	3,038,673	
不二電機工業	0.9	1,018	リオン	3.4	7,578	K O A	12.5	20,237	ズスキ	151.7	913,385	
ジース・ユアサ コーポ	27.4	59,553	横河電機	91.2	255,451	市光工業	14.9	8,031	S U B A R U	261.3	684,867	
サクサホールディングス	1.1	2,970	新電元工業	3.2	9,776	小糸製作所	89.4	199,943	安永	2	1,416	
メルコホールディングス	2.6	8,996	アズビル	57.7	275,344	ミツバ	15.4	14,368	ヤマハ発動機	119	449,463	
テクノメディカ	2	4,870	東亜ディーケーベー	2.1	1,848	SCREENホールディングス	28.2	303,714	T B K	4.9	1,901	
ダイヤンドエレクトリクHD	3.1	2,213	日本光電工業	35.4	131,404	キヤノン電子	9.1	17,936	エクセディ	13.5	34,398	
日本電気	109.5	902,280	チノー	3.4	7,024	キヤノン	411.9	1,568,103	豊田合成	24.1	71,287	
富士通	76.7	1,619,049	共和電業	4.2	1,827	リコー	207.1	249,969	愛三工業	13.6	17,843	
沖電気	37.7	36,041	日本電子材料	5.1	8,017	象印マホービン	22.4	34,854	盟和産業	0.6	595	
岩崎通信機	2.1	1,587	堀場製作所	15.8	157,320	MUTOHホールディングス	0.6	1,158	日本プラスト	3.8	2,173	
電気興業	3.7	8,946	アドバンテスト	236.5	1,107,056	東京エレクトロン	174.8	4,199,570	ヨロズ	7.7	6,945	
サンケン電気	7.7	58,173	小野測器	1.8	817	イノテック	5.4	9,336	エフ・シー・シー	14.7	26,871	
ナカヨ	0.7	842	エスペック	6.6	15,589	トヨタ紡織	34.8	88,740	シマノ	33.5	762,292	
アイホン	4.5	12,456	キーエンス	82.6	5,232,710	芦森工業	0.9	1,981	ティ・エス テック	29.4	53,684	
ルネサスエレクトロニクス	544.3	1,417,085	日置電機	3.9	25,584	ユニプレス	14.8	14,652	ジャムコ	3.5	5,208	
セイコーホーリング	107	235,186	システムズ	71.2	582,487	豊田自動織機	70.4	895,136	精密機器 (2.3%)	テルモ	230.9	1,089,386
ワコム	63.4	43,619	日本マイクロニクス	14.8	56,758	モリタホールディングス	14.5	22,127	クリエートメディア	1.5	1,371	
アルパック	19.8	128,858	メガチップス	6.5	27,495							

日本株式インデックスファンド (F O F s用) (適格機関投資家専用)

銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	
日機装	千株	千円	ホクシン	千株	千円	東急	千株	千円	日新	千株	千円	
日本エム・ディ・エム	19.2	19,315	ウッドワン	3.4	397	京浜急行	201.5	401,768	三菱倉庫	6.3	15,813	
島津製作所	6.5	4,569	TOPPANホールディングス	1.7	1,669	小田急電鉄	102.1	128,850	三井倉庫	20.3	89,949	
J M S	109.7	420,699	大日本印刷	101.5	351,596	京王電鉄	136.5	283,851	三井倉庫HOLD	7.7	37,229	
クボテック	7.5	3,877	共同印刷	90.3	375,015	京成電鉄	39.7	169,241	住友倉庫	22.2	54,145	
長野計器	1.2	332	N I S S H A	2.3	8,280	富士急行	53.2	317,072	渋沢倉庫	3.7	10,482	
ブイ・テクノロジー	6	12,498	光村印刷	14.1	20,797	東日本旅客鉄道	10.2	44,166	東陽倉庫	1.2	1,821	
東京計器	4.4	11,690	TAKARA & COMPANY	0.4	506	西日本旅客鉄道	151.7	1,212,841	日本トランシティ	16.4	10,200	
愛知時計	6.3	11,100	アシックス	5.3	13,038	東海旅客鉄道	97.9	572,421	ケイヒン	0.8	1,408	
インター・アクション	3.6	8,467	ツツミ	70.4	372,416	西武ホールディングス	318	1,128,900	中央倉庫	4.4	4,945	
オーバル	4	4,064	ローランド	1.9	4,073	鴻池運輸	99.9	178,271	川西倉庫	0.8	868	
東京精密	4	1,944	小松ウォール工業	6.1	27,694	西日本鉄道	14	27,566	安田倉庫	5.5	6,187	
マニー	16.9	144,951	ヤマハ	3.3	9,659	西日本鉄道	22	52,085	ファイズホールディングス	0.7	758	
ニコン	33	72,369	河合楽器	52.1	180,318	ハマキヨウレックス	9.1	23,769	東洋埠頭	1.3	1,787	
トプコン	119.4	70,085	クリナップ	2.5	7,887	サカイ引越センター	近鉄グループ	395	上組	1,787	127,940	
オリンパス	40.1	60,831	ビジョン	7.9	5,498	HLDGS	82.4	341,630	サンリツ	1.1	809	
理研計器	508.3	1,100,977	キングジム	52.6	87,263	阪急阪神HLDGS	109.9	491,362	キムラユニティー	2.1	2,988	
タムロン	5.8	38,454	キンテック	7.1	6,177	南海電鉄	36.7	102,851	キューソー流通システム	3.2	2,886	
H O Y A	5.1	22,516	イートーキ	16.6	41,400	京阪ホールディングス	45.4	167,616	東海運	2.6	741	
シード	164	2,733,060	任天堂	16.9	22,308	神戸電鉄	2.2	6,463	エーアイティー	5.1	8,486	
ノーリツ鋼機	2.3	1,959	三菱鉛筆	521.3	3,603,225	名古屋鉄道	85	183,982	内外トランスライン	3.3	8,312	
A&Dホローホールディングス	7.8	23,345	タカラスタンダード	11.7	22,089	山陽電鉄	9.1	12,950	日本コンセプト	3	5,049	
朝日インテック	12	22,440	コクヨ	17.3	30,742	アルプス物流	36.7	102,851	<b>情報・通信業 (7.7%)</b>			
シヂズン時計	92.2	264,291	ナカバヤシ	33.8	77,824	ヤマトホールディングス	45.4	167,616	NECネットエスアイ	32.3	69,735	
リズム	76	65,892	グローブライド	8.7	4,593	山九	2.2	6,463	クロスキャット	5.2	5,860	
大研医器	1	2,491	オカムラ	7.4	14,977	丸運	9.1	21	サンリツ	125.5	37,148	
メニコン	3.8	1,960	美津濃	24.8	52,848	丸全昭和運輸	6.1	6,463	内外トランスライン	5.2	25,038	
シンシア	28.4	61,173	電気・ガス業 (1.4%)	17.3	30,742	セコーグループHLDGS	5.1	19,074	日鉄ソリューションズ	14.1	65,494	
松風	0.5	280	東京電力HD	33.8	77,824	トナミホールディングス	43.5	45,979	キューピッシュシステム	4.4	4,892	
セイコーブループ	3.7	9,890	中部電力	8.7	4,593	ニッコーホールディングス	1.8	8,334	コア	3.7	6,582	
ニプロ	11.5	28,807	関西電力	7.4	14,977	日石輸送	26.4	84,928	手間いらず	1.4	3,494	
その他製品 (2.3%)	68.7	76,806	中国電力	21.4	140,113	福山通運	0.5	1,116	ラクーンホールディングス	6.9	4,698	
K Y O R I T S U	17.1	47,247	北陸電力	84.4	143.5	セイノーホールディングス	6.1	9,442	ソリトンシステムズ	4.2	5,359	
中本パックス	5.4	11,404	東北電力	84.4	60,962	エスライントグループ本社	46.3	96,442	ソフトクリエイトHD	6.8	11,526	
スノーピーク	1.5	2,451	四国電力	217.4	140,113	神奈川中央交通	1.3	1,116	T I S	90.6	283,306	
パラマウントベッドHD	11.8	11,941	九州電力	84.4	60,962	AZ-COM丸和ホールディ	2.3	7,003	テクミラホールディングス	2.1	989	
トランザクション	5.0	2,491	北海道電力	217.4	205,856	C&Fジョホールディングス	19.9	29,869	グリー	6.2	12,552	
粧美堂	17.1	27,972	沖縄電力	76.9	78,668	九州旅客鉄道	7.9	34,451	GMOペパボ	22.1	1,351	
二ホンフラッシュ	1.2	734	中国電力	21.4	140,113	SGホールディングス	58.2	179,896	コーポレーテクモHD	6.8	93,783	
前田工織	7.7	6,899	北陸電力	21.4	140,113	NIIPPON EXPRESS	138.4	295,830	三菱総合研究所	1.1	41,19,700	
永大産業	6.9	20,417	東北電力	21.4	140,113	海運業 (0.8%)	28	225,988	ボルテージ	1.3	341	
アートネイチャー	5.3	1,176	四国電力	21.4	140,113	日本郵船	236.3	939,056	電算	0.5	759	
バンダイナムコHLDGS	7.4	5,846	九州電力	21.4	140,113	商船三井	178.9	726,512	A G S	1.9	1,425	
アイフイジャパン	7.4	1,118	沖縄電力	21.4	140,113	川崎汽船	69.7	361,673	ファインデックス	6.6	6,283	
S H O E I	11.8	2,451	中国電力	21.4	140,113	N S ユナイテッド海運	4.4	21,406	ブレイインパッド	6.2	6,348	
フランスペッドHLDGS	17.1	27,972	北陸電力	21.4	140,113	明海グループ	5	3,460	K L a b	15.3	4,253	
パイロットコーポレーション	10.6	13,260	東北電力	21.4	140,113	飯野海運	30.2	36,934	ポールトゥウインホールディ	14.1	7,543	
萩原工業	11.6	51,840	四国電力	21.4	140,113	共栄タンカー	0.8	660	ネクソン	18.5	591,630	
フジルインターナショナル	5.5	8,750	九州電力	21.4	140,113	乾汽船	9.6	11,654	アイスタイル	24.5	10,731	
タカラトミー	16.7	27,972	沖縄電力	21.4	140,113	空運業 (0.5%)	202.4	568,946	エムアップホールディングス	10.1	10,281	
広済堂ホールディングス	37.6	78,151	中国電力	21.4	140,113	日本航空	224.3	684,563	エイチーム	4.9	3,351	
エステールホールディングス	18.5	11,747	北陸電力	21.4	140,113	ANAホールディングス	2.9	18,144	エニグモ	10.6	4,059	
タカノ	1.7	629	東北電力	21.4	140,113	バスコ	0.9	1,520	テクノスジャパン	4.1	2,615	
プロネクサス	8.5	1,431	沖縄電力	21.4	140,113	倉庫・運輸関連業 (0.1%)	トランコム	4	724	e n i s h	32	19,488
	8.5	10,276	中国電力	21.4	140,113					コロプラ		

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

銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額
オルトプラス	千株	千円	マイネット	千株	千円	ベース	千株	千円	クロップス	千株	千円
プロードリーフ	3.8	627	アカツキ	1.4	429	J M D C	14.1	60,827	日本電信電話	39.3	600
クロス・マーケティングG	39.3	22,243	ベネフィットジャパン	4	9,248	フォーカスシステムズ	5.5	5,450	KDDI	24,635.4	4,264,387
デジタルハーツHLDGS	2.7	1,530	UBICOMホールディングス	0.3	359	クレスコ	6.8	12,988	ソフトバンク	640	2,960,000
メディアドゥ	5.2	5,200	カナミックネットワーク	2.6	4,443	フジ・メディア・HD	79.5	121,158	光通信	1,332.4	2,396,321
じげん	3.7	5,609	ノムラシステムコーポレーション	8.8	3,414	オービック	27.7	628,651	エムティーアイ	8.3	190,817
ブイキューブ	24.1	12,965	チエンジホールディングス	4.9	578	ジャストシステム	11.9	39,627	GMOインターネットグループ	5.6	3,371
エンカレッジ・テクノロジ	9.9	3,276	シンプロ・フード	18	28,080	T D C ソフト	7.8	16,372	ファイバーゲート	30.6	72,720
サイバーリンクス	1	519	オーネット	2.9	2,090	L I N E ヤフー	1,178.9	507,634	アイドマーマーケティングコミュニ	4.5	4,324
ディー・エル・イー	1.8	1,312	キャピタル・アセット・プラン	3.3	6,075	トレンドマイクロ	39.2	294,548	KADOKAWA	1.2	282
フィックススターズ	4.3	958	セグエグループ	0.9	651	I D ホールディングス	5.6	8,573	学研ホールディングス	43.8	116,683
CARTA HOLDINGS	9.3	12,610	エイトレッド	1.4	1,282	日本オラクル	0.7	180,673	ゼンリン	13.7	13,384
オプティム	3.9	5,116	マクロミル	0.7	964	アルファシステムズ	15.8	16,372	昭文社ホールディングス	14	12,516
セレス	8.4	7,106	マグローリ	16.3	12,909	フューチャー	2.2	6,146	インプレスホールディングス	1.9	678
S H I F T	3.3	3,019	ビーグリー	0.9	1,092	CAC HOLDINGS	17.7	31,930	松竹	4.6	837
ティーガイア	5.5	189,420	オロ	3	7,482	S B テクノロジー	4.4	7,867	東宝	5	9,500
セック	8.6	15,781	ユーザーローカル	3	5,166	トーセ	1.3	929	東急	4.3	40,325
テクマトリックス	0.9	3,910	テモナ	1	239	オービックビジネスC	1.3	929	東宝	2.7	236,539
プロシップ	15.1	26,198	ニーズウェル	2.5	1,822	オービック	11.6	78,404	東映	46.1	47,844
ガンホー・オンライン・エンタ	4	5,284	マネーフォワード	18.4	83,572	アイティフォー	10.6	12,338	NTTデータグループ	216.6	389,230
GMOペイメントゲートウェイ	21.5	49,278	サインポスト	1.8	815	東計電算	1.1	7,755	ピー・シー・エー	16.5	5,630
ザッパラス	16.5	143,665	SUN ASTERISK	5.9	5,882	エックスネット	0.6	638	ビジネスB太田昭和	17.7	6,841
システムリサーチ	1.2	585	電算システムHD	5.9	5,882	大塚商会	0.6	638	DTS	17.6	61,864
インターネットイニシアティブ	2.8	10,052	APPIER GROUP	3.7	10,282	サイボウズ	41.1	248,038	スクウェア・エニックス・HD	1.9	193,989
さくらインターネット	39.6	105,217	ソルクシーズ	2.8	46,412	電通国際情報S	11.4	23,734	シーエーシー	4.6	18,847
ヴィンクス	9.3	16,656	フェイス	3.6	1,508	ACC E S S	10.1	12,338	カブコン	3.7	368,742
GMOグローバルサインHD	1.1	2,216	プロトコルレーション	1.3	635	デジタルガレージ	8.6	6,286	アイ・エス・ビー	1.2	6,312
SRAホールディングス	2.5	6,227	ハイマックス	9	12,060	イーエムシステムズ	13.2	40,854	ジャステック	1.1	7,461
システムインテグレータ	4.2	15,099	野村総合研究所	2.5	3,550	ウェザーニューズ	13.8	9,811	SCSK	1.2	157,992
朝日ネット	1.3	521	サイバネットシステム	183.5	761,892	C I J	2.6	15,262	NSW	3.7	10,859
e B A S E	8.8	5,517	CEホールディングス	5.9	6,442	ビジネスエンジニアリング	13.7	8,466	aines	4.4	10,662
アバントグループ	11.7	9,430	日本システム技術	2.4	1,488	日本エンタープライズ	1.4	6,188	T K C	13.1	46,374
アドソル日進	10.4	15,475	インテージホールディングス	2.7	7,311	WOWOW	4.7	582	富士ソフト	1.9	99,434
ODKソリューションズ	3.5	5,621	東邦システムサイエンス	9.3	15,252	スカラ	6.1	6,642	NSD	16.6	29.5
フリー ピット	0.9	517	ソースネクスト	2.7	3,283	インテリジェントウェイブ	6.4	5,967	コナミグループ	29.5	82,600
コムチュア	4.3	5,112	インフォコム	38	7,106	IMAGICA GROUP	2.4	2,469	福井コンピュータHLDGS	31	226,765
サイバーコム	11.9	23,978	シンプレクスHD	10.7	26,236	ネットワンシステムズ	8.3	5,204	JBCCホールディングス	5.1	13,479
アステリア	0.7	1,330	H E R O Z	12.4	32,488	システムソフト	33.4	68,670	ミクロク情報サービス	13.1	17,462
アイル	6.5	4,725	ラクスル	2.8	3,861	アルゴグラフィックス	28	1,876	ソフトバンクグループ	7.5	13,027
マークラインズ	3.9	13,923	メルカリ	19.9	28,457	マーべラス	7.6	2,836	卸売業 (7.0%)	408.5	2,459,170
メディカル・データ・ビジ	4.5	12,442	I P S	50.2	32,488	エイベックス	13.3	9,270	高千穂交易	2.4	8,160
g u m i	9.8	6,801	F I G	2.3	4,636	B I P R O G Y	14.1	19,627	オルベナルスケアHLDGS	0.7	1,229
ショーケース	12.2	5,075	システムサポート	5.2	4,835	都築電気	27.1	115,798	伊藤忠食品	2.4	14,320
モバイルファクトリー	1	399	イール	3.2	6,032	TBSホールディングス	4.3	8,999	エレマテック	7.8	14,320
テラスカイ	1	725	東海ソフト	6	3,648	日本テレビHLDGS	42.4	116,451	あらた	6.7	13,782
デジタル・インフォメーション	3.6	5,637	ウイングアーク1 S T	0.7	807	朝日放送グループHD	73.2	105,481	トーメンデバイス	1.3	41,875
PCIホールディングス	4.8	7,852	ヒト・コミュニケーションズHD	8.6	28,251	テレビ朝日HD	7.6	4,886	東京エレクトロンデバイス	1.1	6,890
アイビーシー	1.8	1,870	サーバーワークス	2.2	2,998	スカパーJ SAT HD	19.9	33,332	円谷フィールズホールディ	8.7	42,412
ネオジャパン	0.7	352	東名	1.7	6,043	テレビ東京HD	64.2	43,527	双日	15	16,890
P R T I M E S	2.7	2,802	ヴィッツ	0.4	712	日本B S放送	5.9	17,641	アルフレッサホールディングス	97.3	320,408
ラクス	1.7	2,917	トビラシステムズ	0.5	470	日本B S放送	1.6	1,419	横浜冷凍	87.7	208,506
ランドコンピュータ	39.1	104,201	S a n s a n	1.3	1,153	ビジョン	1.25	14,525	神栄	23.9	26,505
ダブルスタンダード	2.2	2,041	27.1	41,896	スマートバリュー	1.1	462	ラサ商事	0.7	1,246	
オープンドア	2.5	3,760	L i n k - U	1.1	828	USEN-NEXT HLDGS	81.6	35,107	アルコニックス	3.1	4,677
オーピンドア	4.9	3,542	ギフティ	7.2	13,672	ワイアレスグート	2	382	神戸物産	11.6	15,312
			メドレー	11.1	49,117	日本通信	81.6	18,523		67.6	263,910

日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）

銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額
2023年11月30日現在 株数	評価額	2023年11月30日現在 株数	評価額	2023年11月30日現在 株数	評価額	2023年11月30日現在 株数	評価額	2023年11月30日現在 株数	評価額	2023年11月30日現在 株数	評価額
ハイパー	千株	千円	リックス	千株	千円	稻畠産業	千株	千円	カワチ薬品	千株	千円
あい ホールディングス	1.1	380	丸文	7.8	11,762	G S I クレオス	4.7	9,644	エーピーシー・マート	6.8	17,346
ディープイエックス	14	34,608	ハピネット	7.4	19,069	明和産業	10.3	6,787	ハードオフコーポレーション	38.2	93,227
ダイワボウ HD	1.3	1,322	橋本総業HLDGS	3.4	4,080	クワザワホールディングス	1.7	1,171	アスクル	2.7	4,131
マクニカホールディングス	38.7	112,597	日本ライフайн	25.6	29,798	ワキタ	14.5	21,532	ゲオホールディングス	18	38,862
ラクト・ジャパン	20.7	151,379	タカショウ	7.5	4,125	東邦ホールディングス	24.1	77,843	アダストリア	9.8	23,000
グリムス	3.4	6,633	I DOM	23.1	21,298	サンゲツ	20.1	57,646	ジーフット	10.5	39,900
バータルK S K H D	3.7	7,792	進和	5.4	13,494	ミツウロコグループ	11.1	14,563	ジー・ヴィ・エス・ベイエリア	3.8	1,094
八洲電機	13.2	14,137	エスケイジャパン	1.2	973	シナネンホールディングス	2.4	9,756	くら寿司	0.6	412
メディアホールディングス	7	8,897	ダイトロン	3.4	10,077	伊藤忠エネクス	21.6	33,004	キャンドゥ	10.2	37,485
レスターホールディングス	5.5	4,246	シーカス	12.5	18,975	サンリオ	24.8	150,511	IKホールディングス	3.1	8,118
ジオリーブグループ	7.4	19,854	田中商事	1.3	910	サンワ テクノス	4.5	10,048	パルブループHLDGS	1.5	510
大光	1.1	1,369	オーハシテクニカ	4.6	8,040	リヨーサン	6.2	30,659	エディオン	17.1	39,945
OCH I ホールディングス	2.3	1,467	白銅	2.4	5,517	新光商事	11.7	14,133	サーラコーポレーション	34.5	51,232
TOKA I ホールディングス	1.1	1,567	ダイコー通産	0.5	597	トーホー	3.4	10,523	ワッツ	18.2	12,940
黒谷	47.3	44,509	伊藤忠	587.3	3,369,927	三信電気	3.5	8,036	ハローズ	2.3	1,329
Cominix	1.3	757	丸紅	728.4	1,680,418	東陽テクニカ	8.8	12,214	フジオフードG本社	3.9	16,165
三洋貿易	0.9	710	高島	3.3	3,158	モスフード サービス	12.7	42,354	アミヤキ亭	9.7	14,006
ビューティガレージ	9.9	12,998	長瀬産業	40	92,940	加賀電子	8	53,040	ひらまつ	2.1	7,686
ワイン・パートナーズ	2.7	6,804	蝶理	5.5	15,317	ソーダニッカ	6.5	6,721	ひらまつ	11.3	2,802
ミタチ産業	5.5	6,556	豊田通商	76.5	626,535	立花エレック	5.8	16,849	大黒天物産	2.7	16,632
シップヘルスケアHD	1.2	1,389	三共生興	12.1	8,978	フオーバル	3.4	4,726	ハニーズホールディングス	6.9	11,536
明治電機工業	31.4	65,547	兼松	36.5	74,971	P A L T A C	11.8	56,109	ファーマライズHD	1	640
デリカフーズHLDGS	3.4	4,862	ツカモトコーポレーション	0.7	856	三谷産業	15	5,010	アルペン	7.1	13,845
スターイアホールディングス	2.4	1,425	三井物産	658.2	3,549,014	太平洋興発	15	1,431	ハブ	1.5	1,080
コメダホールディングス	1.2	1,600	日本紙パルプ	4.2	20,979	西本WISMETTAC HD	2.2	13,618	クオールホールディングス	12	20,472
ピーパンドットコム	21.3	58,937	カメイ	9.3	15,856	ヤマタヘルスケアHLDGS	2.2	13,618	ジシズホールディングス	5.2	24,414
アセンテック	0.6	226	東都水産	36.5	20,058	コーア商事HLDGS	0.4	848	ピックカメラ	46.4	56,654
富士興産	3.4	1,955	OUGホールディングス	0.9	2,151	K P P グループホールディン	4.8	3,528	DCMホールディングス	1	551
協栄産業	1.3	2,389	スターゼン	6.2	15,270	ヤマタネ	22.6	16,023	ペッパー・フードサービス	3.1	135,856
フルサト・マルカHD	0.5	1,238	山善	62.5	31,800	丸紅建材リース	1.8	1,018	Mon o t a R O	12.9	2,169
ヤマエグブループHD	7.8	21,060	椿本興業	1.8	10,872	泉州電業	3.9	14,938	東京一番フーズ	123.8	184,833
小野建	4.9	16,978	住友商事	528.9	1,639,590	トラスコ中山	0.4	9,767	D C M ホールディングス	1.1	551
南陽	8.5	14,339	内田洋行	3.5	25,200	オートバックスセブン	18.3	43,499	ペッパー・フードサービス	3.1	4,132
佐鳥電機	1	2,058	三菱商事	577.1	3,973,910	モリト	30.3	46,828	トースト・ド・リスHD	1.1	1,127
エコトレーーディング	4.2	8,248	第一実業	8.2	15,711	加藤産業	6.2	8,029	きらりホールディングス	1.1	1,127
伯東	0.9	1,342	キノノマーケティングJPN	20.2	75,366	北恵	10.9	51,012	トースト・ド・リスHD	1.1	1,127
コンドーテック	5	27,350	西華産業	3.5	9,369	イエローハット	1.2	996	マツキヨコカラ&カンパニー	1.1	551
中山福	6.6	7,715	佐藤商事	6	9,144	J K ホールディングス	13.9	24,714	ブランコビリー	5.1	16,116
ナガイレーベン	2.5	892	菱洋エレクトロ	8.3	30,793	J K ホールディングス	6.6	6,382	Z O Z O	57.7	180,312
第一興商	11	24,992	東京産業	8.1	7,038	日伝	2.9	15,640	トレジャー・ファクトリー	4.2	5,304
三菱食品	33.8	8,1	ユアサ商事	6.8	30,124	北沢産業	4.2	812	物語コーポレーション	14.6	158.9
松田産業	6.6	39,366	神鋼商事	2.2	12,562	杉本商事	5.9	9,433	三越伊勢丹HD	147.2	245,971
第一興商	6.6	16,876	トルク	2.5	717	因幡電機産業	2.9	74,128	H a m e e	3	3,042
メディパルHD	33.8	75,543	阪和興業	15.7	71,592	東テク	2.9	13,760	マーケットインター・プライズ	0.5	601
S P K	90.5	211,770	正栄食品	5.8	26,187	ミスミグループ本社	2.9	316,560	ウェルシアHD	45.3	117,055
萩原電気HLDGS	3.9	7,133	カナデン	6.6	9,721	アルテック	2.5	580	クリエイトSDH	14.4	44,064
アズワン	3.7	18,278	R Y O D E N	7	18,242	タキヒヨー	2.5	1,221	丸善CHI HD	5.6	1,842
スズデン	13.7	69,486	岩谷産業	19.9	141,409	蔵王産業	0.8	1,920	ミサワ	1	634
尾家産業	3	6,849	ナイス	2.5	4,047	スズケン	0.8	1,920	ティーライフ	0.7	991
シモジマ	1.2	2,268	ニチモウ	0.8	3,276	ジェコス	33.2	167,427	エー・ピー・ホールディングス	1.1	993
ドウシシャ	5.9	7,445	グローセル	5.2	9,817	ローソン	5.1	5,406	チムニー	1.5	2,080
たけびし	8	16,880	アステナホールディングス	16.4	8,150	小売業（4.3%）	8.9	5,704	シュッピン	25.4	45,516
小津産業	1.1	1,760	三愛オブリ	21	33,957	サンエー	6.6	30,360	オイシックス・ラ・大地	11.7	16,298
高速	5.1	10,398							ネクステージ	19.9	45,551
たけびし	3.3	6,230							ジョイフル本田	11.7	16,298

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

銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額
千株	千円	千株	千円	千株	千円	千株	千円	千株	千円	千株	千円
鳥貴族ホールディングス	3.2	9,081	ハーツクスレイ	1.7	1,171	日産東京販売HD	7.1	3,109	三菱UFJフィナンシャルG	5,094.3	6,393,346
ホットランド	6.6	13,015	サイゼリヤ	12.9	74,046	シルバーライフ	1.7	1,757	りそなホールディングス	949.4	729,613
すかいらーくHD	119.4	260,351	V Tホールディングス	33	17,292	GENKY DRUGSTORES	3.8	19,380	三井住友トラストHD	146.3	813,281
S F Pホールディングス	4.8	10,718	魚力	3	6,615	ナルミヤ・インターナショナル	0.8	902	三井住友フィナンシャルG	578.5	4,198,753
綿半ホールディングス	6.6	9,042	ボプラ	1.2	235	ブックオフGHD	4.4	4,774	千葉銀行	226.8	250,954
ヨシッキスホールディングス	1.6	4,864	フジ・コーポレーション	4.3	6,880	ギフトホールディングス	3.7	7,518	群馬銀行	157.9	118,077
ユナイティッド・スマート・マーク	24.2	24,466	ユナイテッドアローズ	10.3	20,177	アイムホールディングス	12	54,000	武藏野銀行	11.4	32,558
ゴルフダイジェスト・オン	3.9	2,640	ハイディ日高	12.9	35,462	元気寿司	4.9	15,631	千葉興業銀行	13.5	11,205
B E ENOS	3.6	5,382	YU-WA CREATION H	2.7	429	ヤマダホールディングス	268.6	115,095	筑波銀行	35.8	9,558
あさひ	8.1	10,667	コロワイド	37.5	83,775	アークランズ	25.9	42,683	七十七銀行	23.7	81,291
日本調剤	5.9	7,599	吉番屋	6.9	36,777	ニトリホールディングス	31.8	542,508	秋田銀行	5.5	10,873
コスマス薬品	8.6	134,590	トップカルチャー	1.6	272	グルメ杵屋	6.9	7,314	山形銀行	9.1	9,636
トーエル	2.1	1,474	P L A N T	1.1	1,573	愛眼	3.5	602	岩手銀行	5.2	12,870
セブン&アイ・HLDGS	301.1	1,654,544	スギホールディングス	17.6	112,886	ケーユーホールディングス	4	4,504	東邦銀行	64.4	18,740
クリエイト・システムズ・ホール	59.1	61,759	薬王堂ホールディングス	4.2	11,386	吉野家ホールディングス	32.2	105,294	東北銀行	2.2	2,558
ツルハホールディングス	18.3	227,652	ヴィア・ホールディングス	7.1	1,526	松屋フーズHLDGS	4	20,000	ふくおかフィナンシャルG	70.9	243,399
サンマルクホールディングス	6.9	13,786	スクロール	13	12,025	サガミホールディングス	13	17,940	スルガ銀行	63	47,313
フェリシモ	1.1	1,004	ヨンヅシホールディングス	8.3	16,226	関西フードマーケット	5.9	8,348	八十二銀行	174.6	139,872
トリドールホールディングス	24.4	101,284	木曾路	13.2	32,881	王将フードサービス	6.5	52,065	山梨中央銀行	9.1	16,325
TOKYO B A S E	10.4	2,818	SRSホールディングス	14.1	14,621	ミニストップ	6.4	9,676	大垣共立銀行	15.6	29,593
ウイループラスHLDGS	0.8	872	千趣会	15.7	6,248	アーカス	16	43,488	福井銀行	7.3	11,344
JMホールディングス	6.5	13,500	タカキュー	3.3	264	パローホールディングス	16.6	39,358	清水銀行	3.2	4,902
サツドラホールディングス	2.1	1,619	リテールパートナーズ	12.9	22,936	ベルク	4.3	27,391	富山銀行	0.8	1,365
アレンザホールディングス	6.4	6,489	上新電機	8.6	19,891	大庄	3.6	4,539	滋賀銀行	13.5	50,557
串カツ中田HLDGS	2.3	3,737	日本瓦斯	46.3	103,573	ファーストリテイリング	39.3	1,473,357	南都銀行	12.3	30,577
バロックジャパン	6.8	5,576	ロイヤルホールディングス	15.4	41,210	サンドラッグ	29.5	132,012	百五銀行	76.7	41,494
クスリのアオキHLDGS	23.4	80,074	東天紅	0.4	330	サックスピーホールディング	7.4	6,623	紀陽銀行	29.2	46,457
力の源HD	3.9	6,115	いなげや	8.3	12,458	ヤマザワ	1	1,259	ほくほくフィナンシャルG	50.4	79,027
FOOD&LIFE COMPAN	46.6	133,415	チヨダ	8.2	6,912	やまや	1	3,040	山陰合同銀行	51	48,858
メディカルシステムネットワーク	9.3	6,045	ライフコーポレーション	9.2	31,326	ペルーナ	20.9	13,083	鳥取銀行	1.6	2,120
一家ホールディングス	1.2	806	リンガーハット	11.2	25,894	銀行業 (7.2%)			百十四銀行	8	20,776
ジャパンソフトラボルティ	2.8	498	M r Ma x HD	10.8	6,782	いよぎんホールディング	96.8	92,521	四国銀行	12.1	12,112
はるやまHLDGS	2.2	1,161	テニアライド	6.2	1,915	しづおかフィナンシャルG	180.8	216,236	阿波銀行	11.5	28,692
ノジマ	25.3	35,318	AOKIホールディングス	18.7	22,122	ちゅうぎんフィナンシャ	68.5	72,541	大分銀行	4.9	12,945
カッパ・クリエイト	13.6	22,494	オーフワ	12.4	10,292	楽天銀行	28.4	72,647	宮崎銀行	4.9	12,965
ライトオン	3.6	1,695	コメリ	13.4	42,277	京都フィナンシャルG	25.8	228,304	佐賀銀行	4.8	9,000
良品計画	95.4	222,902	青山商事	18.7	29,564	島根銀行	1.4	719	琉球銀行	17.4	19,470
バリミキホールディングス	5.9	3,062	しまむら	10.3	170,516	じもとホールディングス	4.1	2,283	セブン銀行	255.4	76,696
アドヴァンブループ	8.2	8,519	はせがわ	2.2	809	めぶきフィナンシャルG	403.9	179,735	みずほフィナンシャルG	1,098.5	2,759,432
アルビス	2.8	7,226	高島屋	60.4	120,347	東京さらばしFG	10.4	44,720	高知銀行	1.6	1,542
コナカ	5.2	2,147	松屋	14.8	12,713	九州フィナンシャルG	157.5	131,166	山口フィナンシャルG	79.9	103,750
ハウス ローゼ	0.6	963	エイチ・ツー・オーリテイリング	38.6	63,535	ゆうちょう銀行	893.8	1,304,501	名古屋銀行	5.3	29,468
G-7ホールディングス	9.5	11,428	近鉄百貨店	3.7	9,779	富山第一銀行	25.8	20,304	北洋銀行	123.4	45,041
イオン北海道	25.8	23,013	丸井グループ	58.1	137,377	コンコルディア・フィナンシャル	436.6	302,956	大光銀行	1.5	1,962
コジマ	14.2	10,266	アクシル リティリング	5.9	22,980	西日本フィナンシャルHD	45.9	74,954	愛媛銀行	11.1	11,188
ヒマラヤ	1.5	1,377	井筒屋	2.3	809	33FG	7.4	13,823	トマト銀行	1.7	1,946
コーナン商事	10.7	39,590	イオン	296.1	906,362	第四北越フィナンシャルG	12.8	50,432	京葉銀行	34.1	23,904
エコス	3.2	7,126	イズミ	15.5	54,777	ひろざんHLDGS	115.8	107,346	栃木銀行	40.7	12,942
ワタミ	9.2	9,568	平和堂	14.6	33,901	おきなわFG	7	16,786	北日本銀行	2.7	5,713
マルシェ	1.7	464	フジ	13.4	25,125	十六FG	10.6	40,598	東和銀行	15.2	9,454
パン・パシフィックHD	176.4	565,185	ヤオコー	9.8	79,056	北國FHD	8.6	38,958	福島銀行	5	1,260
西松屋チェーン	17.2	37,100	ゼビオホールディングス	11.8	11,139	プロクレアホールディングス	9.3	17,642	大東銀行	2	1,532
ゼンショーホールディングス	43	353,202	ケーズホールディングス	61.7	77,711	あいちフィナンシャルグル	12.5	29,312	トモニホールディングス	66.1	32,389
幸楽苑ホールディングス	6.3	7,301	OLYMPICグループ	2.1	1,073	あおぞら銀行	58.5	177,840	フィデアホール	8.5	12,478

日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）

銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額
池田泉州HD	千株 113.1	千円 38,680	オリコ	千株 26.8	千円 28,997	スター・コーポレーション	千株 11.7	千円 32,631	アイロムグループ	千株 3.4	千円 6,905
証券・商品先物取引業 (0.8%)			オリックス	495.6	1,337,376	フジ住宅	10.2	7,293	セントケア・ホールディングス	6.1	5,709
F P G	27.5	44,770	三菱HCキャピタル	363.1	350,173	空港施設	11.3	6,384	サイネックス	0.8	670
ジャパンインベストメントA	6.7	10,579	九州リースサービス	1.8	1,692	明和地所	4	4,736	ルネサンス	6.6	5,709
マーキュリアホールディングス	2.4	1,936	日本取引所グループ	212.3	640,933	ゴールドクレスト	6.6	13,246	ディップ	13	41,210
S B I ホールディングス	119.1	381,953	イー・ギャランティ	13.3	25,828	エスリード	3.8	12,084	デジタルホールディングス	4.5	5,692
日本アジア投資	3.4	802	アサックス	2.3	1,605	日神グループHLDGS	13	6,435	新日本科学	7.7	12,681
ジャフコ グループ	24.3	41,382	NECキャピタルリユーション	4	13,460	日本エヌコン	15.2	13,908	キヤリアデザインセンター	1	2,015
大和証券G本社	630.4	602,284	不動産業 (1.9%)			MIRARTHホールディング	37.3	17,381	ペネフィット・ワン	29.5	44,692
野村ホールディングス	1,368.2	830,907	大東建託	29.8	485,740	A V A N T I A	2.5	2,152	エムスリー	167.7	410,110
岡三証券グループ	71.5	51,051	いちご	93.9	32,958	イオンモール	42.1	72,390	ツカダ・グローバルHOLD	3.1	1,190
丸三証券	27.1	23,007	日本駐車場開発	86	17,544	毎日コムネット	1.6	1,188	プラス	0.5	349
東洋証券	21.6	6,458	スター・マイカ・HLDGS	9.4	5,705	ファースト住建	1.9	2,038	アウトソーシング	54.5	65,400
東海東京HD	96.9	53,585	S R E ホールディングス	3.5	9,709	ランド	444.7	3,112	ウェルネット	3.6	2,034
光世証券	1.1	564	ADワーフスグループ	11.6	2,853	カチタス	21.9	47,085	ワールドホールディングス	3.8	10,301
水戸証券	24.2	10,551	ヒューリック	189.8	278,626	トーセイ	13.5	24,313	ディー・エヌ・エー	30.1	45,270
いちはし証券	15.5	11,346	野村不動産HLDGS	45.3	163,261	穴吹興産	0.9	1,819	博報堂DYHLDGS	108.3	120,808
松井証券	40.3	29,902	三重交通グループHD	17.1	9,781	サンフロティア不動産	12	18,720	ぐるなび	16	4,704
マネックスG	79.7	52,681	サムティ	13	30,446	インテリックス	1.1	551	タカミヤ	11.4	5,198
極東証券	11.3	11,672	地主	6.2	14,297	ランドビジネス	1.6	419	ジャパンベストレスキューS	4.1	4,087
岩井コスモホールディングス	9.4	16,544	プレサンスコーポレーション	12.9	19,401	サンネクスタグレープ	1.3	1,225	ファンコミュニケーションズ	11.9	4,962
アイザワ証券グループ	11.8	14,136	ハウスコム	0.7	623	グランディハウス	5.3	3,127	ライク	3.1	4,228
マネーパートナーズGP	4.9	1,401	J PMC	4.6	5,165	日本空港ビルディング	28.8	187,200	A o b a - B B T	1.7	720
スパークス・グループ	9.1	13,549	サンセイランディック	1.3	1,380	サービス業 (4.8%)			エスプール	24.4	9,686
小林洋行	2.1	489	エストラスト	0.5	320	明豊ファシリティワークス	2.3	1,851	WDBホールディングス	4.3	9,945
保険業 (2.4%)			フージャースHD	12.5	13,225	L I F U L L	29	5,684	ティア	2.7	1,242
かんぱ生命保険	80.9	223,688	オーブンハウスグループ	29.8	123,014	M I X I	18.2	43,989	CDG	0.5	624
SOMPOホールディングス	128	864,896	東急不動産HD	244.6	223,564	ジェイエシーリカルトメント	7.6	20,223	アドウェイズ	11.7	6,446
アニコム ホールディングス	27	16,281	飯田GHD	78	172,380	日本M&Aセンター・ホールデ	135.3	92,707	バリューコマース	7.5	10,395
MS & AD	180.5	998,706	イーグランド	0.7	1,049	メンバーズ	2.9	3,190	インフォマート	88.1	38,852
第一生命HLDGS	396.2	1,220,692	ビーロット	3.2	3,222	中広	0.7	288	J P ホールディングス	21.7	8,484
東京海上HD	801.9	2,925,331	ファーストブラザーズ	1	1,008	UTグループ	11.2	24,808	エコナックホールディングス	4.3	614
T & Dホールディングス	235.4	514,702	AND DOホールディングス	4.9	5,120	アイティメディア	3.2	3,110	C L ホールディングス	2	1,700
アドバンスクリエイト	4.6	4,609	シーアールイー	4.5	7,092	E・J ホールディングス	5	8,025	プレステージ・インター	39.7	25,844
その他金融業 (1.2%)			ケイアイスター不動産	3.9	13,611	オープンアップグループ	25.5	55,054	アミューズ	5.2	7,846
全国保証	21.3	106,436	アグレ都市デザイン	0.8	1,207	コシダカホールディングス	25.4	26,492	ドリームインキュベータ	2.8	9,044
あんしん保証	2.1	525	ジェイ・エス・ピー	4	10,244	アルトナー	2	3,614	クイック	5.9	13,316
ジェイエイース	2.1	3,920	ロードスター・キャピタル	5.3	11,660	パソナグループ	10.2	23,919	T A C	2.2	444
イントラスト	1.8	1,531	テンポイノベーション	1.3	1,448	C D S	1.2	2,078	電通グループ	83.4	332,349
日本モーゲージサービス	2.7	1,422	グローバルリンクマネジメント	0.8	1,976	リンクアンドモチベーション	24.4	14,298	テイクアンドギヴィーナス	2.9	3,317
C a s a	2	1,756	フェイスネットワーク	1.2	1,668	エス・エム・エス	29.7	83,457	ぴあ	2.9	9,613
アルヒ	7.7	6,444	霞ヶ関キャピタル	1.9	17,328	サニーサイドアップG	1.4	866	イオンファンタジー	3	7,806
プレミアグループ	13.7	24,235	パーク24	52.8	95,172	パーソルホールディングス	864.1	220,172	シーティーエス	10.6	7,070
ネットプロHD	27	6,561	パラカ	2.9	5,608	リニカル	3	1,590	ネクシィーズグループ	1.4	992
クレディセゾン	51.6	128,509	ミガロホールディングス	0.7	924	クックパッド	23.1	2,748	H U グループHD	24.8	63,711
芙蓉総合リース	7.5	90,000	宮越ホールディングス	3.7	4,610	エスクリ	1.9	537	アルプス技研	8	21,808
みずほリース	13.7	67,952	三井不動産	376.1	1,305,819	アイ・ケイ・ケイホールディング	2.4	1,627	サニックス	13.6	5,222
東京センチュリー	15.2	89,558	三菱地所	531.7	1,061,539	学情	4.3	8,690	日本空調サービス	8.9	7,128
日本証券金融	29.9	46,614	平和不動産	13.2	53,262	スタジオアリス	4.2	8,668	オリエンタルランド	449.2	2,257,230
アイフル	120.1	45,517	東京建物	71.1	149,416	シミックホールディングス	4.1	10,840	ダスキン	18.9	61,576
リコーアーレス	7.8	36,192	京阪神ビルディング	15.1	21,411	エプロ	1.3	1,053	明光ネットワークジャパン	10.3	7,385
イオンフィナンシャルサービス	47.1	59,675	住友不動産	117.7	491,279	N J S	1.8	5,088	ファルコホールディングス	3.8	8,044
アコム	146.3	50,985	データーオーシー	14.5	8,700	綜合警備保障	141.8	121,494	秀英予備校	1	343
ジャックス	8.7	46,719	東京楽天地	1.3	5,590	カカクコム	56.1	94,107	田谷	0.8	331

# 日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）

銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額	銘柄	2023年11月30日現在 株数	評価額
ラウンドワン	千株	千円	アトラエ	千株	千円	スペース	千株	千円
リゾートトラスト	79.9	47,141	ストライク	5	3,585	燐ホールディングス	5.5	4,988
ビー・エム・エル	36.9	83,043	ソラスト	3.6	13,968	スバル興業	8	8,832
リソー教育	10.4	30,503	セラク	23.4	13,735	東京テアトル	0.5	6,615
早稻田アカデミー	43.5	10,483	インソース	2.6	3,481	タナベンサルティング	1.7	1,856
ユー・エス・エス	4.7	7,444	ペイケントコンサルティング	18.4	17,572	ナガワ	2.5	2,600
東京個別指導学院	95.2	275,413	ORCHESTRA HLDGS	62.4	310,502	東京都競馬	2.6	17,394
サイバーエージェント	10.1	4,848	アイモバイル	1.8	2,300	常磐興産	7.1	31,311
楽天グループ	187.6	167,826	キャリアインデックス	11.3	5,186	カナモト	1.8	2,224
クリーク・アンド・リバー社	726.9	425,745	MS-Japan	1.6	372	乃村工藝社	13.2	34,056
SBIグローバルアセット	4.3	8,999	船場	2.7	3,383	ニシオホールディングス	37	28,756
マー・オー・ダブリュー	16.4	9,134	ジャパンエレベーターSHD	1	895	アゴーラ ホスピタリティG	29.8	685
山田コンサルティングGP	16.9	5,475	フルテック	27.5	64,625	トランス・コスマス	10.6	32,860
セントラルスボーリン	3.7	6,845	グリーンズ	0.6	741	藤田観光	3.4	31,080
フルキャストホールディングス	3.2	7,852	ツナググループHLDGS	1.7	3,299	KNT-CTホールディングス	1.8	13,498
エン・ジャパン	8.1	15,527	GAMEWITH	1.3	1,111	トーカイ	5.1	6,349
リソルホールディングス	13.8	35,714	MS&CONSULTING	0.4	422	白洋舎	7.5	14,362
テクノプロ・ホールディング	0.4	2,168	ウェルビー	0.6	412	セコム	0.7	1,701
アトラグループ	50.2	172,386	エル・ティー・エス	4.2	3,129	セントラル警備保障	86.4	889,488
アイ・アールジャパンHD	1.4	274	ミダックホールディングス	1	3,885	丹青社	4.6	11,288
KeePeR技研	4.4	6,886	キュービーネットHLDGS	5.1	8,935	メテックグループホールデ	16.4	14,596
ファーストロジック	5.2	30,576	RPAホールディングス	4	6,084	応用地質	30.6	330
三機サービス	1.1	555	スプリックス	11.5	3,473	船井総研ホールディン	7.9	16,518
Gu nosy	0.7	781	マネジメントリューションズ	2	1,027	進学会ホールディングス	17.6	44,369
デザインワン・ジャパン	6.8	4,732	プロレド・パートナーズ	3.6	10,508	オオバ	2.9	330
マー・ガーディアン	1.3	191	AND FACTORY	1.4	766	いであ	4.4	2,662
リブセンス	3.2	4,924	テノ・ホールディングス	0.4	487	学究社	1.2	2,107
ジャパンマテリアル	2.1	567	フロンティア・マネジメント	0.6	286	ベネッセホールディングス	3.4	6,575
ペクトル	25.9	67,262	ピアラ	0.9	286	イオンディライト	28.6	74,588
ウチヤマホールディングス	10.4	11,367	コプロ・ホールディングス	0.9	290	ナック	9.4	33,041
チャームケアコーポレーション	2	708	ギーフス	1.5	2,203	ダイセキ	3.6	3,546
キヤリアリンク	7.1	8,512	アンビスホールディングス	0.6	278	ステップ	17.3	5,812
I B J	3.1	6,782	カーブスホールディングス	9.1	26,162	合計	千株	千円
アサンテ	6.5	4,803	フォーラムエンジニアリング	23.1	15,407	株数、金額	124,750.8	278,401,688
バリューハ R	4.1	6,625	FAST FITNESS JAP	11.6	9,222	銘柄数<比率>	2,135銘柄	<97.9%>
M&Aキャピタルパートナー	7.4	11,085	ダイレクトマケティングミクス	2.9	3,233	(注1) 銘柄欄の( )内は国内株式の評価額に対する各業種の比率。		
ライドオンエクスプレスHD	6.9	15,642	ボピングズ	8.8	4,056	(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。		
ERIホールディングス	3.3	3,356	LITALICO	1.3	1,483	(注3) 評価額の単位未満は切捨て。		
アビスト	1.2	2,067	コンフィデン・インターワーク	6.6	14,130	(2) 先物取引の銘柄別残高		
シグマクシス・ホールディング	0.7	2,128	アドバンテッジスクマネ	0.4	617	(評価額)		
ウィルグループ	11.4	15,116	リログループ	2.3	1,120	銘柄別	2023年11月30日現在	
エスクローラ J	7.1	7,944	東祥	42.6	66,157	銘柄	貢建額	売建額
メドピア	5.5	781	ID&Eホールディングス	5.1	16,702	国 内	TOPIX	百万円
レアジョブ	7.4	5,683	ビーウィズ	2.1	4,769	外 地		百万円
リクルートホールディングス	0.9	870	TREホールディングス	16.2	18,176	(注) 単位未満は切捨て。		
エラン	628.4	3,459,342	人・夢・技術グループ	3.2	5,932			
土木管理総合試験	11.2	11,412	NISSOHD	7.3	5,737			
日本郵政	2.1	678	大栄環境	15.4	35,743			
ペルシステム24HLDGS	995.5	1,298,629	日本管財ホールディング	8.9	22,143			
鎌倉新書	9	14,976	エイチ・アイ・エス	24.7	42,533			
S MN	7.2	4,197	ラックランド	3.8	10,393			
一蔵	0.9	263	共立メンテナンス	13.3	76,328			
グローバルキッズCOMP	0.6	353	イチネンホールディングス	8.9	13,732			
エアトリ	0.9	570	建設技術研究所	4.4	21,362			
	6.2	9,740						

## ■有価証券の貸付および借入状況

区分	2023年11月30日現在	
	貸付	借入
株式	3,327,800	( 12,700 ) (-)

(注1) ( )内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

(注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、大和証券株式会社へ12,700株を貸付けています。

## トピックス・インデックス・マザーファンド

### 運用報告書 第35期（決算日 2023年9月19日）

（作成対象期間 2022年9月21日～2023年9月19日）

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（配当込み）をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	東京証券取引所上場株式（上場予定を含みます。）
株式組入制限	無制限

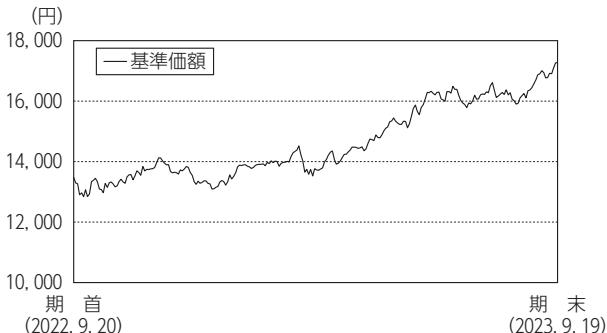
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

## ■当作成期中の基準価額と市況等の推移



## 《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：13,480円 期末：17,276円 謄落率：28.2%

## 【基準価額の主な変動要因】

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

## ◆投資環境について

## ○国内株式市況

国内株式市況は、一進一退で推移した後、大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、英国の財政悪化や欧米の金利上昇などが嫌気され、2022年9月末にかけて下落しました。11月下旬にかけては、欧米の金利上昇が一段落したことや国内で経済活動正常化への期待が高まったことなどから、上昇しました。12月には、世界的な景況感の悪化や日銀の政策変更による急速な円高などで下落しましたが、2023年1月以降は、中国のゼロコロナ政策見直しにより景気回復期待が高まったことや、日銀総裁人事への不透明感が解消して円安が進んだことなどが好感され、3月上旬にかけて上昇しました。3月半ばにかけては、米国地方銀行の経営破綻や欧州金融機関の破綻懸念などで金融不安が高まり下落しましたが、その後は、欧州金融機関の破綻回避などを受けて金融不安が一定程度後退したことにより、上昇に転じました。4月以降は、経済活動正常化や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたこと、日銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調したこと、米国著名投資家の強気見直しにより日本株見直しの動きが強まったことなどから、大幅に上昇しました。7月に入り、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇、中国の不動産大手の債務不履行懸念などから下落する場面もありましたが、8月半ばに発表された2023年4～6月期GDP（国内総生産）成長率が予想を上回る高い伸びとなったことなどが好感され、当作成期末にかけて再び上昇しました。

## ◆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、銘柄、株数を決定するシステム的な手法）を用いて構築しています。

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

## ◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの謄落率は28.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の謄落率は28.2%となりました。

ファンドで組み入れている現物株式ポートフォリオの謄落率とベンチマークの謄落率との差異、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（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。

# 日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）

## ■ 1万口当りの費用の明細

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

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■ 売買および取引の状況

### （1）株式

（2022年9月21日から2023年9月19日まで）

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
国内	千株 19,029.2 ( 26,020.281)	千円 42,766,074 ( —)	千株 4,695.88	千円 9,449,161

(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おりません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

## （2）先物取引の種類別取引状況

（2022年9月21日から2023年9月19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 47,963	百万円 52,286	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## （3）新株予約権証券

（2022年9月21日から2023年9月19日まで）

	買付		売付	
	証券数	金額	証券数	金額
国内	証券 — ( 8,000)	千円 — ( —)	証券 — ( —)	千円 8,000 ( —)

(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おりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

## ■ 主要な売買銘柄

### 株式

（2022年9月21日から2023年9月19日まで）

銘柄	当期						
	買付		売付				
銘柄	株数	金額	平均単価	銘柄	株数	金額	平均単価
トヨタ自動車	千株 908.5	千円 1,892,409	円 2,083	ソフトバンクグループ	千株 115.3	千円 634,454	円 5,502
ソニーブループ	91	1,074,921	11,812	三菱商事	51	229,413	4,498
日本電信電話	1,620.7	753,361	464	日立	31.4	205,035	6,529
キーエンス	11.4	701,411	61,527	伊藤忠テクノソリューションズ	41.9	181,217	4,325
三菱UFJ フィナンシャルG	723.1	693,305	958	三菱UFJ フィナンシャルG	205.3	177,900	866
第一三共	144.5	636,177	4,402	日立金属	71.5	155,941	2,181
三井住友フィナンシャルG	89.3	498,599	5,583	キヤノン	37.1	134,110	3,614
武田薬品	114.4	484,771	4,237	スズキ	26.3	126,757	4,819
東京海上HD	154.6	460,532	2,978	SBI新生銀行	51.1	124,569	2,437
みずほフィナンシャルG	235.9	457,270	1,938	日立物流	13.3	118,542	8,913

(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 株数	当期末			銘柄	期首 株数	当期末			銘柄	期首 株数	当期末		
		株数	評価額	千円			株数	評価額	千円			株数	評価額	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>					富士ピー・エス	3.5	2.3	1,099		東洋エンジニア	10.1	10.1	7,029	
極洋	3.3	4.3	17,479		浅沼組	5.2	6.1	22,600		レイズネクスト	10.3	11	17,050	
ニッスイ	96.7	112.2	85,698		戸田建設	91.8	96.1	81,214		<b>食料品 (3.3%)</b>				
マルハニチロ	13.8	16.7	44,255		熊谷組	11.8	12.9	45,085	ニップン	18.6	21.3	46,434		
雪国まいたけ	7.5	9.6	8,889		北野建設	1.4	1	3,045	日清製粉G本社	72.3	72.8	143,088		
カネコ種苗	3	3.5	5,327		植木組	2.1	1.5	2,370	日東富士製粉	1.1	1.4	7,000		
サカタのタネ	11.3	12.8	57,088		矢作建設	10.1	10.5	14,343	昭和産業	6	6.9	21,562		
ホクト	7.9	9.9	18,354		ピーエス三菱	7.8	10.3	9,012	鳥越製粉	5.4	4.8	3,297		
ホクリヨウ	1.3	1.1	1,196		日本ハウス HLDGS	12.6	16.3	6,145	中部飼料	7.8	11	12,848		
<b>鉱業 (0.4%)</b>					新日本建設	10.5	10.9	13,853	フィード・ワン	8.9	11.6	9,593		
住石ホールディングス	18.6	11.6	5,278		東亜道路	1.3	3.1	16,430	東洋精糖	1	1	2,233		
日鉄鉱業	2	4.5	25,110		日本道路	2.1	1.6	15,584	日本甜菜糖	3.9	4.6	8,993		
三井松島 HLDGS	4.4	5.1	15,045		東亜建設	5.3	6.7	25,560	DM三井製糖ホールディ	6.1	7.8	24,375		
I N P E X	329.6	414.5	977,391		日本国土開発	18.8	21.9	14,607	塩水港精糖	7.9	6.4	1,702		
石油資源開発	12.3	13	76,830		若築建設	3.8	3.5	11,095	ウェルネオシュガー	3.5	4.1	8,708		
K&O エナジープラーブ	4	5.1	13,673		東洋建設	27.1	25.3	29,929	森永製菓	15.5	14	75,348		
<b>建設業 (2.1%)</b>					五洋建設	88.2	111.1	105,545	中村屋	1.6	1.9	5,947		
ショーボンドHD	12.1	15.3	90,576		世紀東急	10.8	10.1	17,250	江崎グリコ	17.9	22.5	92,002		
ミライト・ワン	33.5	37.1	76,277		福田組	2.4	2.9	14,239	名糖産業	2.8	3.1	5,177		
タマホーム	6.3	7	25,270		住友林業	47.8	67.7	289,079	井村屋グループ	3.8	4.3	9,997		
サンヨーホームズ	1.8	0.9	656		日本基礎技術	5.9	3.1	1,590	不二村	4.4	5.4	13,635		
日本アクリア	4.2	3	3,123		巴コーポレーション	9.6	6	3,492	山崎製パン	42	52.7	150,326		
ファーストコーポレーション	2.6	1.9	1,508		大和ハウス	189.7	216.6	909,936	第一屋製パン	0.6	1	438		
ベステラ	2.1	1.7	1,671		ライトイ工業	13.2	14.6	30,251	モロゾフ	2.3	2.5	9,287		
キャンディル	1.5	1.4	872		積水ハウス	227.6	237.6	742,262	鶴田製菓	4	5	21,750		
ダイセキ環境ソリューション	2	1.5	1,893		日特建設	5.1	7.6	8,732	寿スピリッツ	6.7	8.4	98,616		
第一カッター興業	2.2	2.8	3,645		北陸電気工事	4.1	5.5	5,841	カルビー	35	36	107,244		
安藤・間	47.2	64.6	82,042		ユアテック	13.9	17.5	17,780	森永乳業	13	14.3	83,812		
東急建設	28	31.1	26,341		日本リーテック	4.6	6.9	9,584	六甲バター	4.5	5.8	8,056		
コムシスホールディングス	33.4	35.5	115,907		四電工	2.3	3.3	9,966	ヤクルト	48.8	56.2	426,052		
ビーアールホールディングス	12.8	18.2	7,007		中電工	9.2	12.3	31,119	明治ホールディングス	42.3	96.5	360,620		
高松コストラクションGP	6.9	7.2	19,944		関電工	39.1	43.2	59,356	雪印メグミルク	16.9	19.1	44,483		
東建コーポレーション	2.9	3.2	25,760		きんでん	48.8	55.4	124,317	プリマハム	9.6	10.6	26,712		
ソネック	1.1	0.8	810		東京エヌシス	7	7.6	7,850	日本ハム	26.9	30.8	141,526		
ヤマウラ	4.8	5.5	6,979		トーエック	2.4	2.6	11,453	林兼産業	1.7	1.6	891		
オリエンタル白石	35	39.2	13,210		住友電設	5.9	7.5	21,780	丸大食品	6.8	7.9	13,453		
大成建設	66.6	73.3	392,888		日本電設工業	10.2	12.9	30,160	S F o o d s	6.9	8.7	29,884		
大林組	222.6	279.8	395,357		エクシオグループ	33	36.2	115,984	柿安本店	2.7	3.2	7,990		
清水建設	205.9	221.8	233,999		新日本空調	5.2	4.2	10,542	伊藤ハム米久 HLDGS	48.5	60.3	49,446		
飛島建設	6.2	8.6	12,323		九電工	15.2	19.1	89,006	サッポロホールディングス	20.7	25.9	122,144		
長谷工コーポレーション	64.3	80.7	159,301		三機工業	15.6	17.6	29,233	アサヒグループホールдин	144.4	181.9	1,078,121		
松井建設	8	7.1	5,644		日揮ホールディングス	67.9	77.4	174,188	キリンHD	282.1	327.9	700,722		
錢高組	0.9	0.6	2,421		中外炉工業	2.2	2.5	5,555	宝ホールディングス	42.7	53.8	67,626		
鹿島建設	163.1	173.6	450,665		ヤマト	5.9	4.4	4,364	オエノンホールディングス	17.5	23.5	10,598		
不動テトラ	5	5.5	11,297		太平電業	4.3	4.8	19,608	養命酒	2	2.6	4,973		
大末建設	2.6	1.9	2,962		高砂熟字	18.2	19	56,126	コカ・コーラボトラーズJHD	48.9	61.7	127,533		
鉄建建設	4.7	5.5	12,358		三晃金属	1	0.6	2,598	サントリー食品インターナ	44	55.4	260,823		
西松建設	14.5	13.2	51,453		朝日工業社	2.9	3.3	8,454	ダイドーグループHD	3.9	4.5	25,920		
三井住友建設	53.5	62.3	26,602		明星工業	12	13.6	14,443	伊藤園	23.3	26.7	130,990		
大豊建設	3.5	3.2	13,232		大氣社	10	9.1	43,771	キーコーヒー	7	8.8	17,890		
佐田建設	4.9	3.3	1,679		ダイダン	4.4	5.3	16,377	ユニカフェ	2	1.7	1,621		
ナカノフードー建設	5.4	3.6	1,508		日比谷総合設備	6.4	6.4	15,097	ジャパンフーズ	1.1	0.8	897		
奥村組	11.8	12.6	59,283		フィル・カンパニー	1.1	1.3	949	日清オイリオグループ	8.7	11.1	48,562		
東鉄工業	9.5	10.8	32,778		テスホールディングス	6.7	16.9	8,534	不二製油グループ	16.6	18.3	42,639		
イチケン	1.7	1.1	2,365		インプロニアHD	83.6	81.8	132,761	かどや製油	0.7	0.6	2,112		

日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）

銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末			
		株数	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	
J一オイルミルズ	6.8	8.1	14,928	ワコールホールディングス	15.3	14.6	48,326	日本パーカライジング	31.5	39.7	47,004	日本	31.5	39.7	
キッコーマン	46	52.2	441,612	ホギメディカル	9.3	10.7	34,828	高圧ガス	10.6	11.7	9,231	高圧ガス	10.6	11.7	
味の素	152.9	190	1,111,500	クラウディア HLDGS	2	1.3	720	チタン工業	0.9	0.6	847	チタン工業	0.9	0.6	
ブルドックソース	2.8	4.2	8,820	T S I ホールディングス	22.8	26.9	22,192	四国化成ホールディング	8.5	10.2	15,575	四国化成ホールディング	8.5	10.2	
キューピー	33.6	42.3	104,206	マツオカコーポレーション	2.1	1.4	2,277	戸田工業	1.6	1.8	3,641	戸田工業	1.6	1.8	
ハウス食品G本社	24	24.1	76,300	ワールド	9.9	10.4	17,815	ステラ ケミファ	3.8	4.7	15,134	ステラ ケミファ	3.8	4.7	
カゴメ	29.2	33.9	112,480	三陽商会	3.4	2	4,242	保土谷化学	2	2.3	7,521	保土谷化学	2	2.3	
焼津水産化工	3.1	2	2,486	ナイガイ	2.3	1.7	491	日本触媒	10.7	12.2	69,174	日本触媒	10.7	12.2	
アリアケジャパン	7	6.9	35,121	オフードホールディングス	41.6	51.9	28,545	大日精化	5.4	5.6	13,501	大日精化	5.4	5.6	
ピエトロ	0.9	0.7	1,305	ルックホールディングス	2.1	1.7	3,530	カネカ	16.1	18.3	77,262	カネカ	16.1	18.3	
エバラ食品工業	1.7	2.1	6,384	ゴールドワイン	12.4	14.2	153,928	三菱瓦斯化学	58.9	59.8	128,570	三菱瓦斯化学	58.9	59.8	
やまみ	0.7	0.5	973	デサント	12.8	13.8	52,647	三井化学	58.2	66	261,294	三井化学	58.2	66	
ニチレイ	28.6	36.1	128,516	キング	3.7	2.3	1,557	J S R	69.7	74.7	302,385	J S R	69.7	74.7	
東洋水産	34.3	39.8	236,690	ヤマトイタナショナル	5.5	4.1	1,189	東京応化工業	11.1	12.7	116,497	東京応化工業	11.1	12.7	
イートアンド HLDGS	3	3.5	7,455	パルプ・紙 (0.2%)	3.9	3.6	12,780	大阪有機化	4.8	6.7	17,198	大阪有機化	4.8	6.7	
大冷	0.6	0.7	1,430	特種東海製紙	289.1	333.7	226,115	三菱ケミカルグループ	464.6	540.4	530,024	三菱ケミカルグループ	464.6	540.4	
ヨシムラ・フード・HLDGS	3.8	5	6,590	王子ホールディングス	30	41.7	59,380	K H ネオケム	10.6	12.2	29,316	K H ネオケム	10.6	12.2	
日清食品HD	24.8	27.7	345,557	日本製紙	9.6	6.4	3,699	ダイセル	100.3	111.6	147,591	ダイセル	100.3	111.6	
永谷園ホールディングス	3.3	3.9	9,063	三菱製紙	44.6	50.6	54,293	住友ベーベクライト	10.6	11.9	77,659	住友ベーベクライト	10.6	11.9	
一正蒲鉾	3	2.2	1,720	北越コーポレーション	2.3	2.2	3,337	積水化学	143	162.2	368,437	積水化学	143	162.2	
フジッコ	7.1	8.1	15,876	中越パルプ	巴川製紙	2.3	1.7	1,157	日本ゼオン	56.3	48	82,728	日本ゼオン	56.3	48
ロックフィールド	7.7	8.8	14,396	大王製紙	31.9	35.3	46,225	アイカ工業	17.6	20.1	69,445	アイカ工業	17.6	20.1	
日本たばこ産業	411.2	478.3	1,618,567	ア波製紙	1.4	1.3	685	U B E	35.1	41.3	111,282	U B E	35.1	41.3	
ケンコーマヨネーズ	3.9	5.4	7,878	レンゴー	58.3	72.9	76,945	積水樹脂	10.4	11	26,059	積水樹脂	10.4	11	
わらべや日洋HD	4.7	5.8	16,918	トーモク	3.6	4.6	11,665	タキロンシーアイ	16.4	17.1	10,071	タキロンシーアイ	16.4	17.1	
などり	4.3	4.9	9,790	ザ・パック	4.8	6	19,710	旭有機材	4.3	5.3	20,378	旭有機材	4.3	5.3	
イフジ産業	1.2	0.9	1,454	化学 (5.8%)	北の達人コーポ	27.1	34	8,364	ニチバン	4	4.9	9,398	ニチバン	4	4.9
ファーマフーズ	9.7	11.3	17,571	クラレ	101.2	116.7	202,591	リケンテクノス	15.2	17.3	13,113	リケンテクノス	15.2	17.3	
ユーブレナ	40.2	49	39,690	旭化成	463	499.7	500,949	大倉工業	3	3.7	9,760	大倉工業	3	3.7	
紀文食品	5.9	6.2	7,551	共和化成	4.1	3	2,031	積水化成品	7.7	11.3	5,514	積水化成品	7.7	11.3	
ピックルスホールディングス	3.7	4.6	5,906	共和レザー	61.4	77.4	197,253	群栄化学	1.5	1.9	6,631	群栄化学	1.5	1.9	
ミヨシ油脂	2.3	2	2,390	レノック・ホールディング	510.7	594	257,796	タイガース ポリマー	4.1	2.4	1,860	タイガース ポリマー	4.1	2.4	
理研ビタミン	5.3	6.8	15,830	住友化学	3	3.4	16,354	ミライアル	2.4	1.6	2,235	ミライアル	2.4	1.6	
織錦製品 (0.4%)				テイカ	13.4	14.5	22,634	ダイキアクシス	2.3	2.2	1,621	ダイキアクシス	2.3	2.2	
片倉工業	6	7.3	13,227	石原産業	1.7	1.1	1,322	ダイキヨーニシカワ	15.7	17.7	15,310	ダイキヨーニシカワ	15.7	17.7	
グンゼ	4.4	5.7	26,476	バクー	8.2	8.6	49,536	竹本容器	2.5	2	1,630	竹本容器	2.5	2	
東洋紡	29.4	34.7	38,811	森六ホールディングス	92.7	106.9	216,793	森六ホールディングス	3.7	4.1	9,872	森六ホールディングス	3.7	4.1	
ユーチカ	20.9	24.1	5,133	東ソーラー	22.3	25.9	64,607	恵和	2.1	5.8	7,534	恵和	2.1	5.8	
富士筋ホールディングス	3	3.1	11,671	トクヤマ	11.3	12.9	40,312	日本化薬	52.5	61.2	80,080	日本化薬	52.5	61.2	
倉敷紡績	5.3	6	15,432	セントラル硝子	32.6	40.2	55,797	カーリットホールディングス	6.4	7.2	7,178	カーリットホールディングス	6.4	7.2	
シキボウ	4.2	2.9	3,224	東亞合成	5.8	4.8	31,488	日本精化	4.8	4.6	11,932	日本精化	4.8	4.6	
日本毛織	18.6	21.1	29,012	大阪ソーダ	13.7	15.5	14,136	扶桑化学工業	5.9	7.4	29,526	扶桑化学工業	5.9	7.4	
ダイトウボウ	16.5	8.5	807	関東電化	25.2	29.1	84,186	トリケミカル	7.7	10.7	32,849	トリケミカル	7.7	10.7	
トーア紡コーポレーション	2.3	2	924	信越化学	118.7	665.6	3,093,043	A D E K A	29.5	27.9	77,729	A D E K A	29.5	27.9	
ダイドーリミテッド	12.6	7.6	2,371	日本カーバイド	2.9	2	3,568	日油	21.6	24.8	163,109	日油	21.6	24.8	
帝人	7.2	9	17,712	関東電化	4.8	6.1	13,102	新日本理化	10.7	7.2	1,677	新日本理化	10.7	7.2	
東レ	66.1	77	124,124	第一稀元素化学工	6.3	7.3	7,154	ハリマ化成グループ	5	3.8	3,294	ハリマ化成グループ	5	3.8	
住江織物	1.3	1.1	2,543	デンカ	59.9	75.6	144,055	花王	157.9	181.1	1,018,325	花王	157.9	181.1	
日本フエルト	4.1	2.9	1,276	日本酸素 HLDGS	61.6	77.7	280,341	第一工業製葉	2.5	2.9	5,089	第一工業製葉	2.5	2.9	
イチカワ	0.9	0.7	1,082	日本化学工業	2.1	2.7	5,386	石原ケミカル	3.5	3.6	6,159	石原ケミカル	3.5	3.6	
日東製綱	0.7	0.5	767	東邦アセチレン	1.5	1.1	1,797	日華化学	2.9	2.1	1,900	日華化学	2.9	2.1	
アツギ	5.3	3	1,347					ニイタカ	1.4	1	2,005	ニイタカ	1.4	1	
ダイニック	2.1	1.3	1,075					三洋化成	4.5	4.9	20,580	三洋化成	4.5	4.9	
セーレン	13.8	15.4	36,374					有機合成藁品	5	3.8	1,132	有機合成藁品	5	3.8	
ソトー	2.8	1.6	1,260					大日本塗料	8.4	9.8	9,809	大日本塗料	8.4	9.8	
東海染工	0.8	0.5	547					日本ペイント HOLD	281.3	425.2	474,735	日本ペイント HOLD	281.3	425.2	
小松マテーレ	11.3	11.5	8,866					関西ペイント	64.7	64.2	142,395	関西ペイント	64.7	64.2	
								神東塗料	4.7	4.3	576	神東塗料	4.7	4.3	

日本株式インデックスファンド (F O F s用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末		
		株数	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
中国塗料	15.9	13.2	19,008	ユニー・チャーム	132.6	167	919,335			住友理工	14.9	15.6	18,454	
日本特殊塗料	4.6	3.4	4,987	ショーエイコーポ	2	1.9	1,172			三ツ星ベルト	9.4	11.7	58,500	
藤倉化成	9.3	10.8	5,400	医薬品 (5.0%)						バンドー化成	12.5	11.9	20,456	
太陽ホールディングス	10.9	12.2	32,098	協和キリン	76.9	96.8	261,553			ガラス・土石製品 (0.7%)				
D I C	24.8	31.4	78,876	武田薬品	600.8	709.5	3,426,175			日東紡績	9.5	9	32,175	
サカタインクス	14	17.8	24,759	アステラス製薬	653.6	757.3	1,664,545			A G C	64.8	74.8	402,424	
東洋インキSCホールディン	12.3	17.5	42,297	住友ファーマ	47.3	59.5	32,873			日本板硝子	34.7	40.9	34,110	
T & K T O K A	6.1	7.2	10,296	塩野義製薬	88.8	101.1	681,818			石塚硝子	1.2	0.8	2,193	
富士フィルム HLDGS	134.3	153.8	1,401,579	わかもと製薬	7.6	4.9	1,122			日本山村硝子	2.2	2	3,558	
資生堂	132.9	167.4	954,514	日本新薬	16.7	18.9	125,628			日本電気硝子	26	32.8	88,543	
ライオン	76.5	104.9	154,307	中外製薬	199.2	251	1,118,958			オハラ	3	3.8	4,784	
高砂香料	4.3	5.4	16,443	科研製薬	11	13.7	49,539			住友大阪セメント	11.5	11.3	44,194	
マンダム	14.9	17.3	24,860	エーザイ	84.5	97.5	871,065			太平洋セメント	43.5	51.1	144,791	
ミルボン	9.4	10.9	51,393	ロート製薬	36.5	77.7	318,026			日本ヒューム	7.1	7.1	6,411	
ファンケル	30.9	35.1	85,503	小野薬品	147.4	154.7	452,729			日本コンクリート	13.6	15.7	5,447	
コーネー	12.9	16.3	194,296	久光製薬	16.2	17.8	94,909			三谷セキサン	3.1	3.4	17,476	
コタ	5.3	7.3	11,899	持田製薬	8.6	9.2	31,602			アジアパイルHD	11.3	12.6	8,782	
シーポン	1	0.7	1,082	参天製薬	133.2	146.1	209,069			東海カーボン	53.3	74	90,206	
ボーラ・オルビス HD	32.7	41.1	74,658	扶桑薬品	2.5	2.5	5,102			日本カーボン	3.7	4.3	19,758	
ノエビアホールディングス	5.6	7.1	40,470	日本ケミファ	0.8	0.5	960			東洋炭素	4.1	5.7	32,433	
アジュバンホールディング	1.7	1.3	1,225	ツムラ	21.8	25.2	70,131			ノリタケ	3.9	4	26,280	
新日本製薬	3.7	4.6	7,281	日医工	22	—	—			T O T O	46.2	52.8	209,352	
アクシージア	—	4.1	4,887	キッセイ薬品工業	11.1	11.8	40,828			日本碍子	75.3	93.2	189,522	
エステー	4.8	6.1	9,375	生化学工業	13.7	15.3	12,729			日本特殊陶業	53.4	61	218,807	
アグロカネショウ	2.6	3.2	4,560	栄研化学	11.4	13	18,538			ダントーホールディングス	5.1	3.5	2,982	
コニシ	11.6	13.4	35,402	鳥居薬品	3.4	4.3	16,598			M A R U W A	2.6	3	72,420	
長谷川香料	13.2	15.3	52,555	J C R ファーマ	21.5	27.1	39,349			品川リフラクトリーズ	1.8	2.3	19,481	
星光PMC	3.5	3.2	3,414	東和薬品	11	12.3	35,596			黒崎播磨	1.3	1.6	16,352	
小林製薬	19.5	23.3	161,841	富士製薬工業	4	5.9	7,192			ヨータイ	4.9	4.3	6,677	
荒川化学工業	5.4	6.8	7,310	ゼリア新薬工業	11.3	11.1	26,329			東京窯業	8	5	1,750	
メッツク	5.2	6.6	24,882	そせいイブループ	—	25.8	41,434			ニッカトー	3.5	2.4	1,538	
日本高純度化学	1.7	2	5,222	第一三共	554.6	698.4	2,832,012			フジミンコーポレーテッド	6.1	19.2	59,808	
タカラバイオ	20	21.6	30,628	杏林製薬	13.8	17.4	31,911			フニミネ工業	2.4	1.6	1,740	
J C U	7.8	9	29,340	大幸薬品	11.6	15.9	5,644			エーアンドエーマテリアル	1.2	1	1,200	
新田ゼラチン	4.4	3.3	2,369	ダイト	4.8	6	14,544			ニチアス	16.1	20.1	62,712	
O A T アグリオ	2.9	2	3,640	大塚ホールディングス	145.6	166.8	929,076			ニチハ	9.8	9.9	31,036	
デクセリアルズ	19.9	21.9	81,774	大正製薬HD	14.2	17.8	110,947			鉄鋼 (1.0%)				
アース製薬	5.8	7.3	36,025	ペプチドリーム	30.9	38.9	64,457			日本製鉄	315.7	369.3	1,384,875	
北興化学	6.5	8.1	7,865	あすか製薬HD	7.2	8.2	13,603			神戸製鋼所	131.9	165.9	358,344	
大成ラミニック	2	2.5	8,050	サワigrループHD	14.6	18.3	84,198			中山製鋼所	10.9	17	16,796	
クミアイ化学	25.4	31.9	36,142	石油・石炭製品 (0.5%)						合同製鐵	3.6	4.1	21,033	
日本農薬	13.5	14.7	10,216	日本コクス工業	64.7	72.4	9,339			J F E ホールディングス	175	220.4	510,115	
アキレス	4.8	5	7,550	ニチレイ	8.5	9.5	19,560			東京製鐵	22.2	23.2	41,876	
有沢製作所	10.3	13	14,027	ユシロ化学	3.2	4.2	7,207			共英製鋼	7.4	9.4	20,736	
日東電工	46.2	58.2	591,312	ビーピー・カストロール	2.6	2	1,836			大和工業	12.4	13.6	101,401	
レック	8.8	11.4	11,023	富士石油	16.7	16.3	6,210			東京鐵鋼	2.9	3.9	15,424	
三光合成	8.7	10.1	7,130	M O R E S C O	2.7	1.7	2,060			大阪製鐵	4.1	3.8	7,174	
きもと	11.5	7.7	1,478	出光興産	77.8	89.1	325,660			淀川製鋼所	8.2	9.4	37,083	
藤森工業	5.9	6.3	24,979	ENEOS ホールディングス	1,149.6	1,360.2	867,263			中部鋼板	—	6.8	15,334	
前澤化成工業	4.3	5	7,675	コスマエネルギーHLDGS	30.2	31.7	184,811			丸一鋼管	21.9	25.1	95,455	
未来工業	2.7	2.8	9,282	横浜ゴム	36.3	40.6	134,101			モリ工業	1.9	1.3	5,336	
ウェーブロック HLDGS	3	1.7	1,147	TOYO TIRE	36.7	46.1	111,354			大同特殊鋼	10.3	10.4	67,215	
ジェイエスピー	4.5	5.6	11,575	ブリヂストン	203.3	234.7	1,434,251			日本高周波	2.9	1.8	1,260	
エフピコ	14.1	15.2	39,634	住友ゴム	62.5	78.6	134,209			日本冶金工	5.2	6	30,480	
天馬	5.9	6.5	17,049	藤倉コンポジット	6.3	3.8	4,537			山陽特殊製鋼	6.5	8.1	24,988	
信越ポリマー	13.8	14.8	20,216	オカモト	3.5	4.3	21,801			愛知製鋼	4.2	4.8	21,000	
東リ	17.2	11.7	4,001	フコク	3.5	4.2	6,468			日立金属	71.5	—	—	
ニフコ	25.5	28.9	121,813	ニッタ	7.2	8.2	28,946			日本金属	2	1.2	1,120	
バルカー	6.2	6.7	28,944							大洋金属	4.7	5.8	8,711	

日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）

銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
新日本電工	42	40.9	12,474	千株	ノーリツ	9.7	13.3	21,532	千株	平田機工	3.3	3.9	29,913	
栗本鉄工所	3	3.9	11,111	千円	長府製作所	6.7	8.1	17,220	千円	P E G A S U S	7.7	8.9	5,607	
虹技	1	0.6	961		リンナイ	13.1	44.7	126,568		マルマエ	3.1	3.5	6,051	
日本鋳鉄管	0.8	0.5	603		ダイニチ工業	3.8	2.7	2,011		タツモ	3.5	4.9	14,567	
三菱製鋼	4.8	5.2	8,460		日東精工	9.6	12	6,804		ナブテスコ	40.3	50.7	140,439	
日亜鋼業	8.7	5.4	1,706		三洋工業	0.8	0.6	1,300		三井海洋開発	8	10.1	21,109	
日本精線	1.2	1.1	5,489		岡部	10.7	14.4	10,944		レオン自動機	8.1	8.5	11,925	
エンビプロHD	5	3.9	2,496		ジーテクト	8.4	9.2	17,645		S M C	22.4	26.2	1,822,210	
シンニッタン	8.7	5.8	1,467		東プレ	11.6	14.5	26,781		ホソカラミクロン	4.9	5.2	22,880	
新家工業	1.5	1.2	3,440		高周波熱鍊	11.4	12.8	13,747		ユニオンツール	2.8	3.5	12,950	
<b>非鉄金属（0.7%）</b>					東京製綱	4.7	4.9	6,781		瑞光	—	5.8	7,917	
大紀アルミニウム	9.3	11.7	17,842		サンコーレ	6.6	4.8	2,448		オイレス工業	9.7	11.3	23,605	
日本軽金属HD	19.2	22.2	39,893		モリテックスチル	5.9	4	1,280		日精エースピー	2.9	3.2	14,912	
三井金属	20.4	24	97,656		パイオラックス	10	11.4	28,146		サトーホールディングス	9.9	11.5	24,564	
東邦亜鉛	3.9	4.9	8,545		エイチフン	6.8	8.4	7,459		技研製作所	6.7	7.6	15,716	
三菱マテリアル	43.6	55.1	145,023		日本発条	63.9	73	86,395		日本エアーテック	3.2	3.8	4,940	
住友鉱山	82.9	95.6	453,908		中央発條	3.6	6.1	4,690		カワタ	2.4	1.5	1,659	
DOWAホールディングス	17.6	18.5	92,426		アドバネクス	1	0.7	769		日精樹脂工業	4.6	6	6,390	
古河機金	11.1	12.1	21,937		立川ブラインド	2.9	3.6	5,302		オカダアイヨン	2.4	1.7	3,564	
エス・サイエンス	37.2	32.2	740		三益半導体	5.9	6.4	17,875		ワイエイシホールディングス	3	2.3	6,467	
大阪チタニウム	8.8	12.1	39,264		<b>機械（5.4%）</b>					小松製作所	346.5	378.3	1,705,754	
東邦チタニウム	13.6	14.9	29,055		日本ドライケミカル	1.7	1.3	2,967		住友重機械	40.9	47.8	188,140	
U A C J	10.3	11.6	38,860		日本製鋼所	19.4	22.2	67,288		日立建機	30.6	32.2	158,230	
C Kサンエツ	1.4	2	7,610		三浦工業	29.7	33.7	108,884		日工	9.3	12.1	8,433	
古河電工	21.8	27.5	72,132		タクマ	21.7	24.6	39,729		巴工業	2.7	3.1	9,594	
住友電工	263.8	284.8	531,152		ツガミ	15.4	17.9	21,855		井関農機	6	7.6	9,226	
フジクラ	84.5	88.5	110,580		オーケマ	7.2	8.1	57,534		T O W A	6.6	8.2	28,864	
SWCC	6.6	9.2	20,120		芝浦機械	8.6	8.1	33,777		丸山製作所	1.2	0.9	2,152	
東京特殊電線	1	—	—		アマダ	119.3	128.9	208,882		北川鉄工所	3	3.2	4,998	
タツタ電線	13.6	16.8	11,776		アイダエンジニア	16.5	16.6	17,197		ローツエ	3.8	4.2	44,352	
カナレ電気	1.1	0.9	1,320		T A K I S A W A	2.3	1.4	3,628		タカキタ	2.5	1.5	753	
平河ヒューテック	4.3	4.7	6,890		F U J I I	30.1	35.1	87,030		クボタ	341.8	423.7	1,019,210	
リヨービ	7.1	8.8	28,864		牧野フライス	7.7	8.9	61,944		荏原実業	3.2	4.1	12,222	
アーレスティ	8	6.1	5,532		オーエスジー	30.7	35.6	65,895		三菱化工機	2.2	2.5	7,137	
AREホールディングス	30.2	33.4	65,363		ダイジェット	0.9	0.5	475		月島ホールディングス	11.9	10.7	14,958	
<b>金属製品（0.5%）</b>					旭ダイヤモンド	18.9	22.5	20,925		帝国電機製作所	4.9	5.7	15,390	
稻葉製作所	3.9	4.2	6,631		DMG森精機	38.9	49	134,897		東京機械	3.1	1.2	489	
宮地エンジニアリングG	2.2	2.3	14,444		ソディツク	17.8	19.7	15,149		新東工業	14.2	16.3	18,842	
トーカロ	19.3	21.9	31,382		ディスコ	11.1	38.9	1,024,626		渋谷工業	6	7.6	19,904	
アルファCO	2.7	2	3,170		日東工器	3.7	3.9	8,034		アイチコーポレーション	10.7	11.3	11,300	
S U M C O	124.7	146.6	290,927		日進工具	6	6.7	7,296		小森コーポレーション	17.4	18.7	21,318	
川田テクノロジーズ	1.5	1.9	11,989		パンチ工業	6.4	4.8	2,208		鶴見製作所	5.4	6.2	20,305	
RS TECHNOLOGIES	2.1	5.5	13,673		富士ダイス	3.9	2.5	1,652		住友精密	1.2	—	—	
ジェティックコーポレーション	1	0.7	1,887		豊和工業	4	2.9	2,334		日本ギア工業	3.4	1.8	720	
信和	4.7	3	2,400		ニデックオーケー	2.9	—	—		酒井重工業	1.2	0.9	4,896	
東洋製罐グループHD	38.5	49.2	137,858		石川製作所	2.1	1.3	1,666		荏原製作所	26.2	33.1	243,781	
ホッカントホールディングス	3.3	4.4	7,031		東洋機械金属	5	3.7	2,723		石井鉄工所	1	0.6	1,842	
コロナ	3.4	4.5	4,248		津田駒工業	1.2	1	437		西島製作所	6.3	6.9	13,848	
横河プリッジHLDGS	10.8	10.4	29,993		エンシユウ	1.9	1.1	896		北越工業	6.5	8.1	17,568	
駒井ハルティック	1.2	0.9	1,734		島精機製作所	11.1	12.8	24,896		ダイキン工業	83.5	96.4	2,401,806	
高田機工	0.6	0.5	1,677		オプトラン	9.5	13.3	24,751		オルガノ	2.2	11.1	44,011	
三和ホールディングス	71.2	75.7	160,938		NCホールディングス	2.1	1.1	1,809		トヨーカネツ	2.6	3	10,605	
文化シヤツター	22.4	23.2	26,842		イワキポンプ	4.9	5.4	10,638		栗田工業	38.6	45.1	247,824	
三協立山	9.1	9.3	8,807		フリュー	6.8	8.4	14,170		椿本チエイン	10	11.5	46,690	
アルインコ	5.5	6.1	6,661		ヤマシンフィルタ	11.8	19.3	6,928		大同工業	3	2.1	1,621	
東洋シヤツター	1.6	1.2	784		日阪製作所	7.5	7.8	7,846		木村化工機	5.9	6	4,632	
L I X I L	119	120	220,560		やまびこ	10.5	13.2	20,156		アネスト岩田	11.8	13.7	16,782	
日本フィルコン	4.8	3.5	1,708		野村マイクロ・サイエンス	2.4	2.7	16,605		ダイフク	36.1	124.9	356,901	

日本株式インデックスファンド (F O F s用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
サムコ	2.1	2.2	9,823	千株	三菱電機	713.3	834.4	1,610,809	千円	シャープ	72.6	97.2	91,222	
加藤製作所	3.5	2.6	3,343		富士電機	42.5	49.1	341,392		アンリツ	48.4	56.9	62,732	
油研工業	1.2	0.8	1,867		東洋電機製造	2.3	1.8	1,868		富士通ゼネラル	20.7	22.9	64,520	
タダノ	36.9	46.5	61,752		安川電機	75.9	95.7	551,327		ソニーブループ	478.9	565.4	7,239,947	
フジテック	23.5	28.3	104,030		シンフォニアテクノロジー	7.7	8.9	14,613		T D K	110.7	127.8	725,648	
C K D	19.3	22.4	47,488		明電舎	10.9	12.3	27,933		帝国通信工業	3.3	3.6	6,908	
キトー	5.8	—	—		オリジン	1.9	1.2	1,561		タムラ製作所	27.6	34.6	20,137	
平和	21.3	26.8	60,836		山洋電気	2.8	3.5	24,220		アルプラスアルパイン	62.6	72.1	93,513	
理想科学工業	6.4	6.4	15,667		デンヨー	5.3	6.2	13,516		池上通信機	2.3	1.7	1,346	
S A N K Y O	15.8	15.9	104,987		PHCホールディングス	11.8	11.3	17,707		日本電波工業	7.7	9.7	13,744	
日本金鏡機械	7.9	8.9	9,069		ソシオネクスト	—	11.6	172,028		鈴木	3.8	4.3	5,043	
マースグループ HLDGS	4.9	4.6	13,606		東芝テック	8.2	11.7	40,833		マイコー	8.3	8.8	30,888	
フクシマガリレイ	4.7	5.9	30,680		芝浦メカトロニクス	1.4	1.4	29,540		日本トリム	1.5	1.8	5,607	
オーラズミ	2.8	2	838		マブチモーター	15.9	20	92,560		ローランドディー.ジー.	3.6	4.4	15,312	
ダイコク電機	3.5	4.4	25,432		ニデック	169.8	196.4	1,440,201		フォスター電機	7.2	7.5	7,327	
竹内製作所	11.7	14.7	75,411		ユエムシーエレクトロニクス	2.6	5.9	3,050		S M K	1.7	1.9	4,837	
アマノ	20.1	22.9	77,814		トライクス・セミコンダクター	3.3	3.8	8,500		ヨコオ	5.2	6.4	10,598	
J U K I	10	12.5	7,987		東光高岳	4.3	4.9	10,740		ティアップ	12.6	8.1	923	
サンデン	11.1	7.8	1,521		ダブル・スコープ	21	23.1	25,918		ホシデン	17	18.8	36,791	
ジャノメ	6.6	8.1	5,856		ダイヘン	7	7.3	38,398		ヒロセ電機	10.6	13	228,020	
マックス	9	9.9	27,531		ヤーマン	12.5	13.9	14,775		日本航空電子	15.4	16.5	50,572	
グローリー	18.1	19.4	62,351		J V Cケンウッド	62.6	73.5	49,024		T O A	8.3	9.2	11,224	
新晃工業	7.1	8.2	17,203		ミマキエンジニアリング	6.8	7.6	6,057		マクセル	14	16.4	28,060	
大和冷機工業	9.8	12.4	18,277		I - P E X	3.7	5.6	8,988		古野電気	9.2	10.5	14,616	
セガサミーホールディングス	68.7	64.9	180,324		日新電機	17.8	—	—		スマジコボレーション	5.8	10.8	16,264	
日本ピストリング	2.9	1.8	3,241		大崎電気	12.5	19.2	13,459		アイコム	2.4	3.1	10,648	
リケン	2.9	3.2	11,360		オムロン	63.6	74	510,970		リオン	2.7	3.3	7,593	
T P R	8.6	9.2	17,829		日東工業	9.7	10.9	42,292		本多通信工業	2.8	—	—	
ツバキ・ナカシマ	15.8	16.2	13,267		I D E C	9.5	11.9	36,830		横河電機	70.2	88.3	264,811	
ホシザキ	41.2	47.7	275,467		正興電機製作所	2.6	1.8	2,041		新電元工業	2.7	3.1	9,811	
大豊工業	6.2	6.9	6,693		不二電機工業	1.5	1	1,128		アズビル	44.3	55.9	269,438	
日本精工	130.8	148.4	130,784		ジース・ユアサコ-ポ	23	26.5	71,934		東亜ディーケー	3.9	2.4	2,112	
N T N	139.7	159.4	47,070		サクサホールディングス	1.7	1.1	2,758		日本光電工業	29.4	36.9	142,544	
ジェイテクト	65.2	71.9	108,281		メルコホールディングス	2.1	2	6,420		チノー	2.4	3.3	6,850	
不二越	4.7	6	25,350		テクノメディカ	1.7	1.9	4,020		共和電業	7	4.9	1,813	
日本トムソン	17.5	19.8	11,464		ダイヤモンドエレクトリックHD	2.1	2.7	2,330		日本電子材料	3.6	5.3	7,865	
T H K	37	46.6	126,985		日本電気	90.7	114.2	959,280		堀場製作所	14.1	15.3	122,017	
ユーシン精機	5.7	6.3	4,428		富士通	68.8	80.4	1,500,666		アドバンテスト	56.8	63	1,005,165	
前澤縫製工業	4.9	5.5	6,842		沖電気	29.1	36.5	40,880		小野測器	2.7	2.1	970	
イーグル工業	8.4	8.9	16,358		岩崎通信機	2.9	2.3	1,925		エスベック	5.7	6.4	15,584	
前澤工業	4.6	3	3,132		電気興業	3.7	3.2	8,089		キーエンス	69.3	80	4,608,800	
日本ビラー工業	6.5	7.5	30,825		サンケン電気	6.6	7.5	70,275		日置電機	3.3	3.8	28,196	
キッツ	23.4	27.1	29,593		ナカヨ	1.2	0.8	1,031		システムズ	54.7	69	530,058	
マキタ	86.4	100.4	403,106		アイホン	3.4	4.8	15,048		日本マイクロニクス	10.5	14.4	28,598	
三井E & S	21.7	21.7	13,692		ルネサスエレクトロニクス	417.2	526.9	1,193,165		メガチップス	6.8	6.6	27,225	
日立造船	60.7	65.8	59,220		セイコーエプソン	85.4	103.6	248,899		OBARA GROUP	3	4.4	18,238	
三菱重工業	112.2	141.2	1,241,006		ワコム	58.6	61.4	38,006		澤藤電機	1	0.6	766	
I H I	47.8	50.9	164,610		アルパック	15.2	19.2	105,100		原田工業	3.6	2.3	1,941	
サノヤスホールディングス	9.7	7.4	1,058		アクセラ	3	2	3,764		コーセル	8.5	9.6	12,355	
スター精密	12.4	15.3	29,360		E I Z O	5.2	5.9	30,503		イリソ電子工業	6.4	7.3	31,609	
<b>電気機器 (16.6%)</b>														
日清紡ホールディングス	52.2	60.6	66,872		ジャパンディスプレイ	61.7	61.7	2,468		オブテックスグループ	11.7	14.7	24,901	
イビデン	36.8	46.3	372,252		日本信号	16.3	18.5	17,982		千代田インテグレ	2.6	3.1	8,828	
コニカミノルタ	155.2	180.3	90,384		京三製作所	15.1	17.1	8,601		レーザーテック	31.3	36.6	791,841	
ブライザー工業	87.2	107.9	273,526		能美防災	8.7	10.9	20,230		スタンレー電気	49.3	56.3	139,764	
ミネベアミツミ	121.6	140.5	348,791		ホーチキ	4.8	6.1	10,168		岩崎電気	2.5	—	—	
日立	367.7	392.6	3,905,192		星和電機	3.1	2.4	1,195		ウシオ電機	36.3	40.6	74,988	
東芝	133.6	151.4	695,380		エレコム	17.5	19.3	34,759		岡谷電機	5.3	4	1,296	
					パナソニックホールディング	815.4	953.6	1,701,222		ヘリオステクノH	7.2	4.9	2,077	

日本株式インデックスファンド (F O F s用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末		
		株数	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
エノモト	2.1	1.3	2,247	ファルテック	1.6	0.8	468	ノーリツ鋼機	6	7.6	24,890			
日本セラミック	6.4	6.5	16,952	武蔵精密工業	17	19.5	33,208	A&Dホロンホールディングス	8.7	11.7	20,393			
遠藤照明	3.5	2.4	3,064	日産車体	11.4	14.1	13,014	朝日インテック	83.9	89.3	260,309			
古河電池	5.4	5.9	5,894	新明和工業	20	25.1	33,307	シチズン時計	74.9	73.5	70,045			
双信電機	3.8	2.1	730	極東開発工業	12.4	13.2	24,789	リズム	2.5	1.6	2,902			
山一電機	5	6.5	11,472	トピー工業	5.9	6.5	17,621	大研医器	6.1	3.9	2,145			
岡研	5	6.9	28,842	ティラド	2.1	2	4,642	メニコン	23.6	27.5	56,608			
日本電子	14.7	20	92,820	タチエス	12.6	12.6	23,448	シンシア	0.7	0.6	330			
カシオ	47.3	59.6	76,377	NOK	28.9	31	66,154	松風	2.6	3.6	8,042			
ファナック	67.1	389.8	1,578,300	フタバ産業	17.1	21.4	17,120	セイコーブループ	10.9	12.4	34,211			
日本シエムケイ	13.6	16.9	11,272	K Y B	6.7	7.7	39,424	ニプロ	53	66.6	81,718			
エンプラス	1.9	2.3	23,092	大同メタル工業	14.7	15.5	9,067	その他製品 (2.2%)						
大真空	9.5	9.7	7,585	プレス工業	34.7	35.7	25,811	K Y O R I T S U	—	7.7	1,547			
ローム	31.8	36.9	420,106	ミクニ	9.3	6.1	3,123	中本パックス	2.2	1.8	2,977			
浜松ホトニクス	50.9	64.1	423,124	太平洋工業	14.7	18.3	28,584	スノーピーク	10.9	11.4	15,732			
三井ハイテック	6.6	8.3	67,147	河西工業	9.2	7	2,086	パラマウントベッドHD	14.7	18.4	44,601			
新光電気工業	22.5	28.3	165,470	アイシン	56	61.6	363,932	トランザクション	4.8	5.3	10,292			
京セラ	107.5	124.2	961,929	マツダ	225.1	264.4	489,801	粧美堂	1.5	1.5	786			
太陽誘電	34	38.9	166,103	今仙電機製作所	5.2	3.3	2,240	ニホンフラッシュ	6	7.3	6,628			
村田製作所	208.5	242.4	2,004,163	本田技研	558.9	649.8	3,513,468	前田工織	6.8	6.7	20,535			
双葉電子工業	12.7	15.1	8,425	ズキ	151.5	146.8	923,518	永大産業	7.5	5.5	1,270			
北陸電気工業	2.8	2	3,010	SUBARU	201	252.9	782,472	アートネイチャー	6.4	8	6,712			
ニチコン	20.3	16.3	22,200	安永	3.1	2.3	1,978	バンダイナムコHLDGS	63.2	219	714,816			
日本ケミコン	7.2	7.9	11,549	ヤマハ発動機	99.7	115.2	475,430	アイフィジヤパン	2.2	1.4	858			
K O A	10.6	12.1	22,324	T B K	7.3	5.1	2,412	共立印刷	10.1	—	—			
市光工業	9.6	14.4	8,496	エクセディ	11.6	13.1	36,706	S H O E I	6.7	18	44,262			
小糸製作所	38.2	96.1	225,546	豊田合成	21.7	23.3	80,967	フランスペッドHLDGS	10	9	11,205			
ミツバ	11.7	15	12,165	愛三工業	12.2	13.2	18,519	パイロットコペレーション	10	11.2	56,806			
SCREENホールディングス	12.1	13.7	190,909	盟和産業	1.1	0.7	728	萩原工業	4.1	5.3	9,863			
キヤノン電子	7	8.8	16,588	日本プラスト	5.4	4.1	2,086	ブジールインターナショナル	15.8	16.2	29,289			
キヤノン	348.3	398.7	1,468,810	ヨロズ	5.9	7.5	7,425	タカラトミー	31.6	36.4	83,829			
リコー	181.9	200.4	268,435	エフ・シー・シー	12.8	14.2	28,087	広済堂ホールディングス	4.8	3.6	10,292			
象印マホービン	18.9	21.7	39,993	シマノ	26	32.4	663,228	エヌ曲折	1.4	1.2	774			
MUTOHホールディングス	1	0.7	1,414	ティ・エス・テック	32.5	36.6	65,349	タカノ	2.8	1.9	1,746			
東京エレクトロン	48.5	169.2	3,510,900	ジャムコ	4.6	2.9	4,758	プロネクサス	5.8	6.9	8,031			
イノテック	4.4	5.3	8,745	精密機器 (2.3%)				ホクシン	5.6	4	528			
輸送用機器 (9.0%)				テルモ	216.3	245.9	1,063,517	ウッドワン	2.3	1.7	1,849			
トヨタ紡織	26.8	33.7	97,915	クリエートメディア	2.5	1.7	1,577	大建工業	3.8	4.7	14,311			
芦森工業	1.6	1	2,258	日機装	15.8	18.6	19,306	凸版印刷	99.6	98.3	377,177			
ユーパレス	12.7	14.3	18,418	日本エム・ディ・エム	4.4	4.7	3,595	大日本印刷	82.8	87.4	355,193			
豊田自動織機	54.1	58.4	735,548	島津製作所	91.3	97.3	403,989	共同印刷	1.9	2.3	7,728			
モリタホールディングス	12.3	14	23,660	J M S	5.9	7.3	4,051	N I S S H A	12.1	13.8	23,680			
三桜工業	10.7	12.2	12,248	クボテック	2	1.2	321	光村印刷	0.4	0.6	837			
デンソー	149.6	164.9	1,695,996	長野計器	5.1	5.8	15,265	TAKARA & COMPANY	4.4	5.2	13,124			
東海理化電機	20.3	22.5	55,417	ブイ・テクノロジー	3.3	3.9	8,704	アシックス	58.6	68.1	386,263			
川崎重工業	51.9	60.2	235,863	東京計器	4.9	6.1	9,375	ツツミ	1.9	1.4	3,421			
名村造船所	20	13.7	13,275	愛知時計	2.8	3	5,307	ローランド	4.6	5.9	23,777			
日本車輪	2.4	3.1	6,813	インターフクション	3.8	3.8	3,967	小松オーラル工業	2.3	2.9	8,932			
三菱ロジスネット	10.1	12.8	18,048	オーバル	7.4	4.6	1,945	ヤマハ	44.4	50.4	217,476			
近畿車輪	1.2	0.8	1,658	東京精密	11.9	17.6	129,184	河合楽器	1.9	2.2	7,854			
日産自動車	901.8	1,135.6	806,389	マニー	28	32	60,704	クリナップ	7.3	8.7	6,394			
いすゞ自動車	221.4	232.4	470,261	ニコン	107.9	115.6	190,104	ビジョン	40.5	50.9	86,199			
トヨタ自動車	3,485.1	4,389.2	12,640,896	トプコン	36	42.1	74,222	兼松サステック	0.4	—	—			
日野自動車	95.4	103	63,036	オリソーパス	366.2	492	1,024,344	キングジム	5.6	6.9	6,092			
三菱自動車工業	283.5	311.9	206,664	理研計器	5.1	5	29,500	リンテック	14.6	16.1	39,879			
エフテック	4.7	3.7	3,267	タムロン	4.8	4.9	21,535	イトーキ	12.7	16.4	24,009			
レシップホールディングス	2.9	2.1	1,192	H O Y A	147.6	169.4	2,726,493	任天堂	43.2	504.7	3,255,819			
GMB	1.4	1	2,160	シード	3.6	2.6	2,116	三菱鉛筆	9.3	11.3	22,374			

日本株式インデックスファンド (F O F s用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
タカラスタンダード	12.3	14.3	27,270		丸全昭和運輸	4.9	4.9	19,967		WOW WORLD	1	—	—	
コクヨ	30.6	34.6	83,593		センコーホールディングス HLDGS	33.4	42.2	46,757		コア	3.1	3.5	6,230	
ナカバヤシ	5.5	8.5	4,513		トナミホールディングス	1.4	1.8	8,937		手間いらず	1.1	1.3	3,693	
グローブライド	5.7	6.4	13,241		ニッコンホールディングス	21.8	25.5	86,037		ラクーンホールディングス	6.4	6.6	4,903	
オカムラ	21.5	24	55,656		日石輸送	0.8	0.5	1,404		ソリトンシステムズ	3.3	4.1	4,751	
美津濃	6.3	7.9	38,394		福山通運	9.3	6.1	23,363		ソフトクリエイトHD	3.3	6.6	11,272	
<b>電気・ガス業 (1.4%)</b>					セイノーホールディングス	39.5	44.9	96,602		T I S	65.6	87.7	302,828	
東京電力HD	572.5	720.6	503,627		エスライジングループ本社	2	1.5	1,329		JNS ホールディングス	3.6	2.4	1,063	
中部電力	215.8	294.6	617,923		神奈川中央交通	1.8	2.2	7,315		グリー	34.3	21.4	12,540	
関西電力	267.2	308.7	723,592		日立物流	13.3	—	—		GMOペパボ	0.9	1	1,360	
中国電力	110.2	127.3	132,264		AZ-COM丸とホールディ	12.2	19.3	41,379		コーエーテクモHD	23.9	50.2	111,770	
北陸電力	64.6	75.5	69,701		C&Fロジホールディングス	6.1	7.7	11,157		三菱総合研究所	3.1	4	20,280	
東北電力	167.1	195.4	216,991		九州旅客鉄道	48.7	56.4	183,751		ボルテージ	2.1	1.5	432	
四国電力	63.7	68.2	75,872		SG ホールディングス	121.5	153.1	313,089		電算	0.7	0.6	953	
九州電力	146.6	184.3	197,753		NIPPON EXPRESS	23.6	27.1	210,567		A G S	3	2.2	1,628	
北海道電力	66.1	77.2	55,777		<b>海運業 (0.7%)</b>					ファインデックス	5.1	6.3	4,636	
沖縄電力	16.1	18.7	23,300		日本郵船	60.6	213.5	935,557		ブレインパッド	6.4	6	5,274	
電源開発	56.5	60.2	155,556		商船三井	111.7	140.7	635,260		K L a b	12	14.7	4,145	
エフオン	4.6	5.3	2,703		川崎汽船	22.3	60	333,600		ボルトウインホールдин	10.9	13.8	7,907	
イーレックス	9.9	14.2	12,027		NS ユナイテッド海運	3.4	4.3	18,834		ネクソン	171.3	178.8	521,380	
レノバ	15	21.3	26,710		明治海運	6.9	5.1	4,498		アイスタイル	19.4	23.7	11,565	
東京瓦斯	136.1	169	601,978		飯野海運	28.6	29.3	33,196		エムアップホールディングス	8.7	9.8	11,995	
大阪瓦斯	128.6	161.9	415,273		共栄タンカー	1.3	0.9	789		エイチーム	4.7	4.6	2,792	
東邦瓦斯	30	31.5	87,806		乾汽船	4.4	10.1	13,008		エニグモ	8.1	10.4	3,962	
北海道瓦斯	3.7	4.8	11,740		<b>空運業 (0.5%)</b>					テクノスマジャパン	5.8	4.5	3,240	
広島ガス	12.7	16.8	6,938		日本航空	155.7	196	590,156		e n i s h	5.6	4.2	974	
西部ガス HLDGS	7.4	7.5	15,847		ANA ホールディングス	172.3	217.1	709,048		コロプラ	24.8	31.1	20,557	
静岡ガス	14.5	15.9	17,060		パスコ	1.4	1.2	2,073		オルトラプラス	5.6	4.4	954	
メタウォーター	7.8	9.4	18,104		<b>倉庫・運輸関連業 (0.1%)</b>					ブロードリーフ	37.2	38	19,380	
<b>陸運業 (2.9%)</b>					トランコム	2	2.3	17,434		クロス・マーケティングG	2.9	3.3	2,382	
SBS ホールディングス	5.6	7.1	20,334		日新	5.3	6.1	17,531		デジタルハーツ HLDGS	3.4	5	5,340	
東武鉄道	69.8	87.8	360,506		三菱倉庫	17.5	17.2	70,967		システム情報	5.6	6.3	4,788	
相鉄ホールディングス	22.9	26.4	78,434		三井倉庫 HOLD	7.1	7.4	32,560		メディアドウ	2.5	3.1	3,620	
東急	178	224.2	412,528		住友倉庫	21.3	21.5	55,190		じげん	21.4	23.5	13,066	
京浜急行	85.3	90.6	123,034		淡沢倉庫	3.5	3.2	10,912		ブイキュー	7.6	9.5	3,876	
小田急電鉄	96.2	121.2	283,244		東陽倉庫	10.1	6.9	2,042		エンカレッジ・テクノロジ	1.7	1.2	615	
京王電鉄	33.6	42.3	226,008		日本トランシティ	12.8	16	11,184		サイバーリンクス	2.3	2	1,614	
京成電鉄	46.5	51.5	294,683		ケイビン	1.2	0.9	1,798		ディー・エル・イー	4.3	4.3	1,087	
富士急行	7.8	9.8	51,058		中央倉庫	3.6	3.8	4,183		フィックススターズ	7.3	9	10,800	
東日本旅客鉄道	116.6	135.6	1,196,805		川西倉庫	1.3	0.9	1,008		CARTA HOLDINGS	3.1	3.7	4,669	
西日本旅客鉄道	81.1	102.1	670,797		安田倉庫	4.9	5.4	5,891		オプティム	5.2	6.6	5,629	
東海旅客鉄道	53.8	61.6	1,196,580		ファイズホールディングス	1.6	1	1,153		セレス	2.5	3.3	3,197	
西武ホールディングス	92.4	96.6	148,039		東洋埠頭	1.8	1.5	2,212		S H I F T	4.7	5.3	143,232	
鴻池運輸	10.7	13.6	27,376		上組	34.4	38.3	124,245		ティーガイア	6.6	8.5	15,444	
西日本鉄道	18.3	21.4	55,607		サンリツ	1.6	1.2	895		セック	1.1	0.7	2,443	
ハマキョウレックス	5	6.2	26,009		キムラユニティー	3.8	2.6	3,637		テクマトリックス	12.7	14.6	22,805	
サカイ引越センター	3.5	3.8	19,722		キューソー流通システム	4.2	2.7	2,605		プロシップ	2.5	3.5	4,508	
近畿グループ HLDGS	68	79.8	354,391		東海運	4.1	3	870		ガーボ・オンライン・エンター	19.5	20.9	49,888	
阪急阪神 HLDGS	84.4	106.4	567,537		エーアイティー	4.5	5	8,930		GMOペイメントゲートウェイ	14.5	16	134,832	
南海電鉄	30.3	38.1	113,557		内外トランスライン	2.3	3.2	8,272		ザッパラス	2.4	1.4	667	
京阪ホールディングス	28.3	44	182,644		日本コンセプト	2	2.9	5,521		システムリサーチ	2.1	2.5	6,740	
神戸電鉄	1.7	2.1	6,468		<b>情報・通信業 (7.9%)</b>					イソネットニシアティブ	20	43.7	106,824	
名古屋鉄道	70	88.2	209,210		NEC ネットエスアイ	24.8	26.8	53,519		さくらインターネット	7.8	9	11,781	
山陽電鉄	5.2	6	13,380		クロスキッチン	4.1	4.6	4,669		ヴィンクス	2.2	1.3	1,693	
アルピス物流	5.1	6.3	10,193		システナ	107	134.7	37,446		GMOグローバルサインHD	2	2.4	6,698	
ヤマトホールディングス	99.1	102.2	260,047		デジタルアーツ	4	5.1	24,148		SRA ホールディングス	3.6	4.1	14,903	
山九	17.6	20.3	109,254		日鉄ソリューションズ	13	13.7	58,773		システムインテグレータ	2.4	1.5	642	
丸運	3	2.5	670		キューピッシュシステム	3.9	4.7	5,649		朝日ネット	6.6	8.4	5,367	

日本株式インデックスファンド (F O F s用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
e B A S E	8.9	11.3	7,695		インフォコム	8.1	10.3	29,581		システムソフト	22.6	27.2	2,094	
アバントグループ	8	10.1	13,352		シンプレクスHD	11.9	13.7	37,647		アルゴグラフィックス	5.8	7.3	25,732	
アドソル日進	2.6	3.3	5,768		H E R O Z	2.2	2.7	4,109		マーベラス	11.8	12.8	9,356	
ODK ソリューションズ	1.5	1.1	664		ラクスル	8.9	19.3	26,981		エイベックス	13	13.6	20,386	
フリービット	3.8	4.2	5,254		メルカリ	28.5	48.5	154,521		B I P R O G Y	23.4	29.5	113,250	
コムチュア	8.4	10.6	25,736		I P S	2.1	2.6	6,445		兼松エレクトロニクス	4.1	—	—	
サイバーコム	1.2	0.8	1,074		F I G	8.3	6.1	1,872		都築電気	3.4	4.2	9,828	
アステリア	5.5	6.2	4,674		システムサポート	2.6	3.1	6,723		TBS ホールディングス	36.6	41.1	108,709	
アイル	3.6	3.7	13,523		イーソル	4.1	5.8	4,384		日本テレビHLDs	62.8	71	100,358	
マークライズ	3.4	4.4	13,398		アルテリア・ネットワークス	7	—	—		朝日放送グループHD	6.1	7.3	5,124	
メディカル・データ・ビジ	9.5	9.5	7,685		東海ソフト	1.2	0.8	874		テレビ朝日HD	18	19.5	33,852	
g u m i	10.5	11.8	6,171		ウイングアーク1ST	5.7	8.3	21,696		スカパーJSATHD	63.5	71	52,824	
ショーケース	1.6	1.2	446		ヒト・コミュニケーションズHD	1.7	2.2	3,080		テレビ東京HD	4.6	5.8	17,835	
モバイルファクトリー	1.6	1.1	883		サーバーワークス	1.3	1.6	5,984		日本B S放送	2.4	1.9	1,729	
テラスカイ	2.7	3.5	7,073		東名	0.6	0.4	967		ビジョン	8.4	12	18,600	
デジタル・インフォメーション	3.3	4.6	8,326		ヴィッツ	0.7	0.5	576		スマートバリュー	1.7	1.3	546	
PCI ホールディングス	2.8	2	2,200		トビラシステムズ	1.9	1.5	1,455		USEN-NEXT HLDGS	5.7	9	29,970	
アイビーシー	1.2	0.8	484		S a n s a n	23.7	26.2	34,885		ワイヤレスゲート	3.2	2.3	499	
ネオジャパン	2.1	2.7	2,754		L i n k - U	1.3	1.2	1,034		コネクシオ	5.3	—	—	
P R T I M E S	1.6	2	3,580		ギフトイ	6.8	7	10,241		日本通信	62.6	73.9	16,258	
ラクス	34.4	37.9	83,512		メドレー	—	10.8	53,460		クロップス	1.6	0.9	999	
ランドコンピュータ	1.7	1.3	1,596		ベース	1.1	2.7	12,190		日本電信電話	840.9	25,680.6	4,648,188	
ダブルスタンダード	2.3	3.3	4,689		J M D C	9.4	13.3	72,884		K D D I	546.9	619.5	2,930,235	
オーブンドア	4.5	5.6	5,723		フォーカスシステムズ	4.5	5.8	5,753		ソフトバンク	1,135.7	1,288.5	2,267,760	
マイネット	2.3	1.7	603		クリスコ	5.5	6.2	11,600		光通信	8.6	9.4	224,660	
アカツキ	3.4	3.8	8,804		フジ・メディア・HD	66.2	77.1	124,979		エムティーアイ	5.9	5.4	3,315	
ベネフィットジャパン	0.6	0.3	367		オービック	23.6	26.8	645,880		GMOインターネットグループ	23.6	29.6	72,549	
UBICOM ホールディングス	2	2.5	3,242		ジャストシステム	10.7	11.5	33,574		ファイバーゲート	3.4	4.3	6,183	
カナミックネットワーク	9.3	8.6	4,360		T D C ソフト	5.9	6.7	11,959		アイマーケティングコミュニティ	1.7	2.1	539	
ノムラシステムコーポレーション	7	5.7	666		Z ホールディングス	1,081.4	1,140.7	502,706		K A D O K A W A	40.4	42.4	135,044	
チェンジホールディングス	15.6	19.6	37,200		トレンドマイクロ	36.8	37.9	223,382		学研ホールディングス	10.6	13.3	11,730	
シンクロ・フード	4.1	3.3	2,026		ID ホールディングス	4.5	5.4	7,641		ゼンリン	12.5	13.6	12,539	
オーフネット	3.3	3.1	5,598		日本オラクル	12.2	15.3	150,781		昭文社ホールディングス	3.3	2.2	706	
キャピタル・アセット・プラン	1.4	1	888		アルファシステムズ	2	2.5	7,437		インプレスホールディングス	6.2	4.6	855	
セグエグループ	1.6	1.7	1,630		フューチャー	15.9	17.1	25,154		アйネット	3.5	4.8	8,452	
エイトレッド	1	0.8	1,178		CAC HOLDINGS	4.1	4.3	7,679		松竹	4.3	4.6	50,577	
マクロミル	14.4	15.9	12,386		S B テクノロジー	3.2	3.4	7,820		東宝	44.3	50.1	272,694	
ビーグリー	1.2	1.1	1,222		トーセ	2	1.5	1,105		東映	2.1	2.2	44,044	
オロ	1.9	2.9	5,585		オービックビジネスC	7.2	15.8	94,326		NTT データグループ	199.7	251.5	542,485	
ユーダーローカル	2.2	2.9	5,338		伊藤忠テクノソリューションズ	34.1	—	—		ピー・シー・エー	4.4	4.6	5,823	
テモナ	1.3	1.2	358		アイテイフォー	9.2	10.5	11,644		ビジネスB太田昭和	2.5	3.4	7,306	
ニーズウェル	2.3	2.9	2,070		東計電算	0.9	1.1	7,183		D T S	13.9	17.1	57,370	
マネーフォワード	15.3	17.8	91,456		エックスネット	1.1	0.7	764		スクウェア・エニックス・HD	34.9	40.3	213,630	
サンインポスト	2.5	2.2	1,062		大塚商会	36.1	39.8	245,048		シーアイーシー	8.1	11.2	18,849	
SUN ASTERISK	—	5.7	8,105		サイボウズ	8.7	11	22,528		カブコン	70.7	79.7	449,268	
電算システムHD	3.1	3.5	10,535		電通国際情報S	7.7	9.7	54,611		アイ・エス・ピー	3.2	4.1	5,924	
APPIER GROUP	—	27.4	46,717		A C C E S S	8.6	9.4	7,585		ジャステック	3.8	4.9	7,276	
ソルクシーズ	6	4.2	1,785		デジタルガレージ	12.4	14.2	53,179		S C S K	51.8	65.4	173,931	
フェイス	1.9	1.5	751		イーエムシステムズ	10.7	13.3	9,975		N S W	2.9	3.1	8,952	
プロトコードレーション	8.1	10	12,230		ウェザーニューズ	2.3	2.5	16,075		アイネス	6.4	5.6	9,312	
ハイマックス	2	2.5	3,632		C I J	5.6	13.2	7,431		T K C	11.4	12.8	46,912	
野村総合研究所	130.4	159.7	682,557		ビジネスエンジニアリング	1.7	1.1	3,883		富士ソフト	7.2	16.1	77,280	
サイバネットシステム	5.3	5.7	4,343		日本エンターパライズ	7.3	5.4	712		N S D	23.3	28.6	73,873	
C E ホールディングス	3.7	2.7	1,579		WOWOW	2.8	6	6,954		コナミグループ	27.3	34.3	286,816	
日本システム技術	1.4	2.2	4,912		スカラ	6.2	7.3	5,679		福井コンピュータHLDs	3.4	5.6	15,204	
インテージホールディングス	8.6	9.1	19,974		インテリジェントウェイブ	4	2.8	2,466		JBCC ホールディングス	5	5.8	16,083	
東邦システムサイエンス	1.9	2.1	2,914		IMAGICA GROUP	5.4	6.6	3,946		ミクロ情報サービス	6.7	7.3	11,767	
ソースネクスト	32.7	40.6	7,795		ネットワンシステムズ	27.7	29.9	83,406		ソフトバンクグループ	449.8	395.5	2,569,563	

日本株式インデックスファンド (F O F s用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
卸売業 (6.9%)		千株	千株	千円	第一興商	14.3	32.7	86,001		カナデン	6.1	5.6	7,761	
高千穂交易	2.7		2	6,630	メディパル HD	69.7	80.9	213,899		R Y O D E N	5.8	6.8	16,435	
オルハーツケア HLDGS	1.2		0.8	1,420	S P K	2.9	3.7	7,733		岩谷産業	16.7	19.2	152,121	
伊藤忠食品	1.5		1.9	12,578	萩原電気 HLDGS	2.4	3.5	14,822		ナイス	2.5	2.5	3,807	
エレマテック	5.9		7.6	14,706	アズワン	10.8	12.1	70,555		ニチモウ	0.9	0.7	2,992	
あらた	5.5		6.5	38,090	スズデン	2.3	2.9	6,803		極東貿易	4.4	5	9,880	
トーメンデバイス	1.1		1.2	6,096	尾家産業	1.7	1.3	2,627		アステナホールディングス	11.6	15.8	7,647	
東京エレクトロンデバイス	2.2		3.1	32,395	シモジマ	4.4	5.8	7,145		三愛オブリ	16.8	22.4	40,947	
円谷フィールズホールディ	6.6		14.5	30,537	ドウシシャ	7.2	8.9	20,986		稻畑産業	15.1	16.7	54,776	
双日	77.2		84.3	296,904	小津産業	1.7	1.2	1,963		G S I クレオス	3.6	4.9	11,456	
アルフレッサホールディングス	78.1		84.9	220,867	高速	3.8	4.4	9,235		明和産業	7	11.2	7,604	
横浜冷凍	18.7		23	31,142	たけびし	2.6	3.3	6,444		クワザワホールディングス	2.6	1.8	1,026	
神栄	1.1		0.7	1,152	リックス	1.6	1.2	3,996		ワキタ	13.7	15.6	22,635	
ラサ商事	3		2.5	4,070	丸文	5.9	7.6	9,446		東邦ホールディングス	20.4	21.1	66,169	
アルコニックス	9.7		11	15,554	ハビネット	5.5	7.2	18,691		サンゲツ	18.1	21.2	66,144	
神戸物産	51.9		65.5	238,944	橋本総業 HLDGS	1.3	3.3	3,877		ミツウコグループ	8.4	10.8	14,979	
ハイパー	1.5		1.2	429	日本ライフайн	22.4	24.8	30,479		シナネンホールディングス	2.5	2.7	11,137	
あいホールディングス	10.7		13.6	33,469	タカショ一	5.9	7.3	4,737		伊藤忠エネクス	16.5	21	33,138	
ディープイエックス	2.4		1.5	1,533	I DOM	22.9	25.6	18,944		サンリオ	21.2	24	173,688	
ダイワボウHD	32		34.6	103,471	進和	4.5	5.2	12,724		サンワテクノス	3.8	4.3	9,877	
マニカホールディングス	17.8		20	131,400	エスケイジャパン	1.9	1.3	925		リョーサン	7.7	9	39,240	
ラクト・ジャパン	2.6		3.3	7,137	ダイトロン	2.6	3.3	10,246		新光商事	9.8	11.4	14,375	
グリムス	3.3		3.6	8,150	シーカス	9.6	12.1	19,009		トーホー	2.9	3.6	12,906	
バイタルKSKHD	11.8		10.5	10,552	田中商事	1.9	1.5	1,090		三信電気	2.8	3.4	7,667	
八洲電機	5.5		6.9	9,059	オーハシテクニカ	3.6	4.1	7,093		東陽テクニカ	7.3	8.5	11,381	
メディアホールディングス	4.1		5.4	4,195	白鶴	2.4	3	7,338		モスクード サービス	9.9	12.5	41,812	
レスターホールディングス	7.1		8.1	20,476	ダイコー通産	0.9	0.6	726		加賀電子	6.1	6.9	46,506	
ジオリープグループ	1.6		1.3	1,656	伊藤忠	451.3	521.1	2,999,972		ソーデニツカ	5.8	4.1	4,464	
大光	3.3		2.3	1,547	丸紅	652.2	660	1,675,740		立花エレック	4.8	6.2	18,203	
OCHIホールディングス	1.5		1.2	1,748	高島	1	0.9	3,618		フオーバル	2.7	3.3	4,101	
TOKAIホールディングス	36.3		41.6	39,145	長瀬産業	34.2	38.8	98,940		P A L T A C	10.6	13.3	64,584	
黒谷	2.1		1.5	913	蝶理	4.2	4.6	14,191		三谷産業	11.5	14.4	4,881	
Cominix	0.8		1.1	971	豊田通商	67.1	74.1	680,682		太平洋興発	2.6	2	1,640	
三洋貿易	7		9.5	13,480	三共生興	10.1	11.7	9,430		西本WISMETTAC HD	1.7	2.2	11,308	
ビューティガレージ	1.2		1.3	6,890	兼松	26	32.8	73,176		ヤマシタヘルスケア HLDGS	0.7	0.4	808	
ワイン・パートナーズ	5.3		6.1	6,844	ツカモトコーポレーション	1.1	0.8	1,030		コーア商事 HLDGS	4.8	4.6	3,321	
ミチカ産業	2.1		1.4	1,624	三井物産	545.6	600.2	3,500,366		KPPグループホールディングス	14.1	19.7	14,282	
シップヘルスケアHD	21.6		30.4	71,348	日本紙パルプ	3.6	4.5	23,220		ヤマタネ	3.1	3.7	7,699	
明治電機工業	2.2		3.2	4,896	カメイ	8	9	14,031		丸紅建材リース	0.6	0.6	1,692	
デリカフーズ HLDGS	2.8		2.2	1,496	東都水産	0.4	0.3	1,971		日鉄物産	4.5	—	—	
スタティアホールディングス	1.7		1.1	1,867	OUGホールディングス	1	0.8	2,020		泉州電業	1.7	4.2	13,860	
コメダホールディングス	16.3		20.8	61,755	スターゼン	5	6.5	17,225		トラスコ中山	14.1	17.8	45,318	
ピーバンドットコム	1.1		0.8	364	山善	27.2	22.8	28,158		オートバックスセブン	23.4	29.7	47,326	
アセントック	2.5		2.8	1,509	椿本興業	1.2	1.4	7,616		モリト	5	6	8,250	
富士興産	1.9		1.3	2,531	住友商事	445.5	511.8	1,645,948		加藤産業	8.1	10.5	44,782	
協栄産業	0.9		0.5	1,162	内田洋行	3	3.4	23,290		北恵	1.5	1.4	1,271	
フルサト・マルカHD	6.7		7.6	21,204	三菱商事	493.7	515.6	3,963,932		イエローハット	12	15.1	29,188	
ヤマエグループHD	4.3		4.8	18,120	第一実業	2.9	3	17,850		JKホールディングス	5.2	6.3	6,369	
小野建	6.9		8.3	14,823	キヤノンマーケティングJPN	15.5	19.6	75,460		日伝	5	5	13,140	
南陽	1.4		1	2,288	西華産業	3.1	3.2	7,040		北沢産業	3.6	2.9	907	
佐鳥電機	4.8		3.5	6,314	佐藤商事	5	5.9	9,434		杉本商事	3.5	3.7	8,473	
エコートレーディング	1		1.1	1,531	菱洋エレクトロ	4.4	7.2	24,012		因幡電機産業	18.5	22	73,370	
伯東	4.4		4.8	26,256	東京産業	6.3	7.5	6,630		東テク	2.2	2.8	15,204	
コンドーテック	5.5		6.3	7,560	ユアサ商事	6	7.3	31,536		ミスミグループ本社	94.5	127.7	313,631	
中山福	3.3		2.9	1,044	神鋼商事	1.7	2.1	12,957		アルテック	4.2	2.9	759	
ナガイレーベン	9.1		10.7	24,684	トルク	1.9	2.9	814		タキヒヨー	1.8	1.4	1,741	
三菱食品	7.3		7.8	32,253	阪和興業	13	15.2	76,912		蔵王産業	1.3	0.9	2,358	
松田産業	5.5		6.4	14,937	正栄食品	4.5	5.6	28,728		スズケン	26.9	24.8	111,550	

日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）

銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末		
		株数	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
ジェコス	5.1	4.9	4,802	ネクステージ	15.3	19.3	40,568	V T ホールディングス	28.8	32	16,928			
グローセル	8.1	6.8	2,978	ジョイフル本田	21.5	24.7	43,447	魚力	2	2.7	5,980			
小売業（4.2%）				鳥貴族ホールディングス	2.5	3.1	10,354	ボープラ	1.8	1.4	313			
ローソン	16.7	21	142,863	ホットランド	5	6.5	10,965	フジ・コーポレーション	4.1	4.2	8,639			
サンエー	5.1	6.4	31,296	すかいらーく HD	91.9	115.7	236,317	ユナイテッドアローズ	8	9.1	18,609			
カワチ薬品	5.8	6.6	15,364	SFP ホールディングス	3.8	4.7	10,673	ハイディ日高	11	12.6	36,237			
エービーシー・マート	11.8	37.1	102,321	綿半ホールディングス	5.2	6.5	8,931	YU-WA CREATION H	3.9	4	740			
ハーツオフコーポレーション	3.2	2.3	3,509	ヨシックスホールディングス	1.5	1.1	3,088	コロワイド	31	39	98,065			
アスクル	16.2	17.5	33,127	ゴティッド・スーパーマーケ	22	27.4	30,633	ビーシード・ポコーポ	8.4	—	—			
ゲオホールディングス	9.1	8.3	20,808	ゴルフダイジェスト・オン	3	3.8	2,758	壱番屋	5.3	6.7	36,783			
アダストリア	8.2	10.2	29,355	B E E N O S	3.8	3.5	5,600	トップカルチャーラ	1.5	2.2	420			
ジーフット	4.9	3.7	1,065	あさひ	6.2	7.3	9,431	P L A N T	1.8	1.3	1,053			
シ・ヴィ・エス・ペイエリア	0.8	0.8	691	日本調剤	4.7	5.7	8,584	スギホールディングス	15	17	107,253			
くら寿司	7.9	9.9	34,303	コスマス薬品	7.6	8.4	132,636	薬王堂ホールディングス	3.8	4.8	13,238			
キャンドゥ	2.4	3	8,199	トーエル	3.4	2.4	1,848	ヴィア・ホールディングス	9.5	9	936			
IK ホールディングス	2.3	1.7	664	セブン・アンド・HLDGS	252.4	291.5	1,769,696	スクロール	11.6	12.6	13,091			
パルグループ HLDGS	6.7	16.6	33,415	クリエイト・レストラント・ホール	50.6	63.7	74,337	ヨンドリホールディングス	6.4	7.2	13,478			
エディオン	34.4	33.7	50,550	ツルハホールディングス	16.4	17.8	184,497	木曽路	10.2	12.9	32,778			
サーラコーポレーション	14.4	17.8	13,866	サンマルクホールディングス	6	6.9	13,165	SRS ホールディングス	10.9	14.1	15,030			
ワッツ	3.6	2.7	1,641	フェリシモ	1.6	1.4	1,411	千趣会	12.2	16	6,560			
ハローズ	3.4	3.8	16,169	トリドールホールディングス	18.7	21.1	80,707	タカキュー	3.9	4.2	390			
フジオフード G 本社	5.7	9.6	13,488	TOKYO BASE	7	8.8	2,974	リテールパートナーズ	10	12.5	21,837			
あみやき亭	1.8	2.1	7,654	ウイルプラス HLDGS	1.5	0.9	1,103	ケーヨー	13.7	13.9	12,106			
ひらまつ	15.5	12.2	3,318	JM ホールディングス	5.6	6.4	12,505	上新電機	7.2	7.7	18,018			
大黒天物産	2.4	2.6	17,576	サツドーホールディングス	3.1	2.7	2,211	日本瓦斯	36	44.8	103,577			
ハニーズホールディングス	6.1	6.7	11,061	アレンザホールディングス	4.8	6.6	6,652	ロイヤルホールディングス	12.8	14.9	39,991			
ファーマライズ HD	1.3	1.2	784	串カツ田中 HLDGS	1.8	2.3	3,749	東天紅	0.5	0.5	425			
アルペン	5.5	7.1	13,717	バロックジャパン	5.2	5.4	4,595	いなげや	7.3	8.2	12,308			
ハブ	2.4	1.9	1,613	クスリのアオキ HLDGS	6.7	7.6	66,986	チヨダ	6.6	8.3	7,959			
クオールホールディングス	9.3	11.6	22,364	力の源 HD	4.4	3.3	7,372	ライフコーポレーション	5.9	7.4	27,528			
ジンズホールディングス	4	5	15,825	FOOD&LIFE COMPAN	38.5	45.1	120,101	リングハット	8.7	11	25,839			
ピックカーメラ	44.5	45.2	49,132	メディカルシステムネットワーク	6.5	7.5	3,022	M r M a x H D	9.3	12.2	7,771			
DCM ホールディングス	44.5	49.3	61,526	一家ホールディングス	1.8	1.3	920	テナライド	7.2	6.7	2,197			
ペッパー・フードサービス	14.1	18.4	2,116	ジャパンクラフトホールディ	2.4	3.4	771	AOKI ホールディングス	14.9	15.6	16,411			
Mon o t a R O	95.1	120	190,920	はるやま HLDGS	3.1	2.6	1,372	オーワクワ	10.5	13.4	12,180			
東京一番フーズ	1.1	1.4	777	ノジマ	12.2	27.6	36,238	コメリ	11.6	13.1	40,937			
D D グループ	4.1	3.7	6,549	カッパ・クリエイト	10.6	13.4	21,145	青山商事	14.6	18.1	30,697			
きちらリホールディングス	1.8	1.4	1,239	ライトイ	5.7	4.4	2,257	しまむら	8.8	9.9	148,054			
アーフラントサービスHD	5.5	—	—	良品計画	86.7	92.4	180,411	はせがわ	3.4	2.9	1,023			
J. フロントリテイリング	83.6	105.1	166,478	パリミキホールディングス	9.1	7.3	2,825	高島屋	50.6	63.7	140,617			
ドトール・日レスHD	11.9	15.1	35,726	アドヴァンブループ	6.3	7.8	8,213	松屋	12.7	14.3	15,000			
マツヨコカラ&カゾニー	44.1	51.3	423,173	アルビス	2.1	2.9	7,134	エイチ・ツー・オーリテイリング	32.8	41.1	74,925			
プロンコビリー	3.5	5	15,175	コナカ	7.9	6.5	3,003	近鉄百貨店	2.1	3.6	10,558			
Z O Z O	51.8	55.9	161,886	ハウスローゼ	0.8	0.8	1,295	丸井グループ	54.4	62.3	162,883			
トレジャーハ・ファクトリー	2.2	3.5	4,669	G-7ホールディングス	8.3	10.6	13,801	アクシアルリテイリング	5	5.8	22,011			
物語コーポレーション	3.7	14.1	61,405	イオン北海道	9.8	12.4	10,800	井筒屋	3.7	2.6	993			
三越伊勢丹HD	113.2	142.4	246,494	コジマ	12.9	14.3	9,080	イオン	248.2	286.7	870,134			
H a m e e	2.7	2.9	2,682	ヒマラヤ	2.4	2	1,892	イズミ	11.9	12.8	51,379			
マーケットエンターブライズ	0.8	0.6	736	コーナン商事	10.7	11.5	41,342	平和堂	11.1	14.1	35,250			
ウエルシアHD	39.8	43.8	116,026	エコス	2.5	3.1	6,466	フジ	16.5	13	23,725			
クリエイトSDH	11	13.9	48,858	ワタミ	9	10.2	11,791	ヤオコー	8.5	9.6	75,379			
丸善CHI HD	8.2	7.3	2,518	マルシェ	2.1	1.9	564	ゼビオホールディングス	10.3	11.6	11,832			
ミサワ	1.4	1	610	パンパシフィックHD	150.5	170.7	529,340	ケーズホールディングス	64	60	84,570			
ティーライフ	1	0.8	1,127	西松屋チェーン	14.9	18.8	31,001	OLYMPIC グループ	3.5	2	1,070			
エーピーホールディングス	1.3	1.2	1,222	ゼンショーホールディングス	36.8	46.3	305,533	日産東京販売HD	12.5	7.2	3,441			
チムニー	2.4	1.8	2,728	幸楽苑ホールディングス	4.4	5.6	5,812	シルバーライフ	1.6	1.6	1,907			
シュッピン	6.2	6.3	7,037	ハーフスレイ	3.1	2	1,542	GENKY DRUGSTORES	3.3	3.7	20,017			
オイシックス・ラ・大地	10.8	11.4	18,946	サイゼリヤ	11.2	12.5	58,187	ナルミヤ・インダーナショナル	1.7	0.9	1,069			

日本株式インデックスファンド (F O F s用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末			銘柄	期首	当期末		
		株数	株数	評価額			株数	株数	評価額			株数	株数	評価額
ブックオフGHD	4.5	3.8	4,750		千葉興業銀行	16.1	12.3	11,328		マーキュリアホールディングス	4.5	2.7	2,154	
ギフトホールディングス	1.4	3.6	8,614		筑波銀行	29.8	34.5	10,005		SBI ホールディングス	93.1	114.1	382,919	
アイシンホールディングス	9.3	11.6	53,371		七十七銀行	20.1	25.2	85,176		日本アジア投資	6.6	4.1	1,127	
元気寿司	2.1	2.4	12,360		秋田銀行	4.4	5.3	11,384		ジャフコ グループ	26.1	26.2	46,780	
ヤマダホールディングス	267.2	347.5	162,560		山形銀行	7	8.7	10,587		大和証券G本社	483.6	548.4	500,963	
アークランズ	11.9	25.4	41,071		岩手銀行	4.7	5.4	15,309		野村ホールディングス	1,151.1	1,418.8	925,483	
ニトリホールディングス	29.9	34.2	590,976		東邦銀行	55.1	62.3	18,253		岡三証券グループ	53.9	69.1	48,162	
ブルメ杵屋	6.1	7	7,938		東北銀行	3.3	2.5	3,067		丸三証券	22.2	26.1	16,965	
愛眼	6.9	4.8	883		ふくおかフィナンシャルG	54.4	62.9	239,397		東洋証券	23	26	9,672	
ケーユーホールディングス	4	4.9	6,227		静岡銀行	155.4	—	—		東海東京HD	73.5	85.7	43,021	
吉野家ホールディングス	26.3	33.2	96,047		スルガ銀行	63	63	41,076		光世証券	1.6	1.2	805	
松屋フーズ HLDGS	3.6	4.1	17,466		八十二銀行	139.4	166.3	150,634		水戸証券	17.5	21	10,143	
サガミホールディングス	11	13.7	18,495		山梨中央銀行	7.6	8.1	13,956		いちよし証券	12.6	14.4	11,217	
関西フードマーケット	6.1	7.6	11,552		大垣共立銀行	12.9	15	33,465		松井証券	36.9	46.6	40,076	
王将フードサービス	5	5.6	39,144		福井銀行	5.7	7	11,725		マネックスG	63.5	84.8	49,523	
プレナス	8.4	—			清水銀行	2.5	3.1	5,297		極東証券	8.5	9.7	8,827	
ミニストップ	5.5	6.1	8,857		富山銀行	1.2	0.8	1,532		岩井コスモホールディングス	7	9	16,785	
アークス	13.3	15.5	42,346		滋賀銀行	12.3	13.1	46,898		アイザワ証券グループ	10	11.3	11,752	
パローホールディングス	15.3	16.1	35,436		南都銀行	10.2	11.9	34,283		マネーパートナーズGP	8.5	5.3	1,590	
ベルク	3.3	4.2	28,938		百五銀行	63	74.1	42,903		スマート・グループ	35.7	8.8	13,675	
大庄	3.8	3.1	3,571		京都銀行	23.4	24.9	216,306		小林洋行	2.4	2.2	525	
ファーストリテイリング	10.1	38.1	1,323,594		紀陽銀行	22.3	28.2	45,289		保険業 (2.4%)				
サンドラッグ	28.3	32.1	136,489		ほくほくフィナンシャルG	42.8	50	80,725		かんぽ生命保険	75.8	91.7	240,712	
サックバーホールディング	7.4	8.1	7,638		山陰合同銀行	41.7	49.3	50,483		SOMPO ホールディングス	107.3	135.1	930,298	
ヤマザワ	1.2	1	1,287		中国銀行	53.1	—	—		アニコム ホールディングス	23.2	26.8	17,420	
やまや	1.7	1.3	4,030		鳥取銀行	2.4	1.7	2,446		M S & A D	155.1	160.3	930,220	
ベルーナ	16.2	20.6	15,450		伊予銀行	84.8	—	—		第一生命 HLDGS	367.2	384.7	1,223,346	
銀行業 (7.1%)					百十四銀行	7	7.2	18,806		東京海上HD	209.8	778.2	2,789,847	
いよぎんホールディング	—	93.7	104,990		四国銀行	9.5	12.5	13,162		T&D ホールディングス	167.7	211.3	548,217	
しづおかフィナンシャルク	—	175	223,212		阿波銀行	10	11.1	26,873		アドバンスクリエイト	3.7	4.6	5,313	
ちゅうぎんフィナンシャ	—	66.4	77,422		大分銀行	4	4.7	13,225		その他金融業 (1.2%)				
楽天銀行	—	27.3	58,722		宮崎銀行	4.1	5.1	14,983		全国保証	18	20.6	103,103	
島根銀行	2.1	1.8	1,071		佐賀銀行	3.7	4.6	9,747		あんしん保証	3.4	2.5	742	
じもとホールディングス	4.9	4.6	2,097		琉球銀行	15.9	18	21,006		ジェイリース	2.6	1.7	3,695	
めぐきフィナンシャルG	311.1	390.8	169,802		セブン銀行	225	282.1	91,964		イントラスト	3.3	2	1,820	
東京きらぼしFG	8.8	10.1	47,722		みずほフィナンシャルG	903.8	1,138.5	3,054,595		日本モーゲージサービス	4.2	2.8	1,610	
九州フィナンシャルG	132.1	138.6	111,933		高知銀行	2.4	1.8	2,050		C a s a	2.7	2	1,762	
ゆうちょ銀行	177.8	216.3	285,732		山口フィナンシャルG	75.5	77.3	107,794		アルビ	11.1	9.7	9,185	
富山第一銀行	17.2	25	25,950		長野銀行	2.3	—	—		プレミアグループ	11.4	13.2	20,974	
コソレイディ・フィナンシャル	373.2	422.5	306,861		名古屋銀行	4.6	5.2	26,936		ネットプロHD	22.9	26	10,192	
西日本フィナンシャルHD	39.7	48.9	84,841		北洋銀行	95.3	119.3	47,004		クレディセゾン	44.2	49.9	124,226	
33FG	5.9	7	13,860		愛知銀行	2.4	—	—		芙蓉総合リース	6.5	7.2	93,096	
第四北越フィナンシャルG	10.6	12.4	49,910		中京銀行	2.4	—	—		みずほリース	9.2	11.7	59,904	
ひろぎん HLDGS	96.5	102.7	101,313		大光銀行	2.2	1.5	2,100		東京センチュリー	11.7	14.7	92,977	
おきなわFG	6.3	7.2	18,381		愛媛銀行	9.9	10.6	10,939		日本証券金融	29.6	28.9	45,459	
十六FG	8.8	10.2	41,259		トマト銀行	2	1.7	2,213		アイフル	126.7	130.1	48,006	
北國FHD	6.3	8.3	48,887		京葉銀行	32.3	36.1	25,847		リコーリース	6.7	7.4	34,669	
プロクリアホールディングス	7.9	9.6	20,054		栃木銀行	34	36	12,420		イオンフィナンシャルサービス	41.1	45.2	60,477	
あいちフィナンシャルグル	—	11	29,128		北日本銀行	2.1	2.7	6,620		アコム	149.5	140.1	51,921	
SBI 新生銀行	49.2	—	—		東和銀行	12.4	14.4	9,460		ジャックス	7.5	8.4	45,108	
あおぞら銀行	42	49.5	158,103		福島銀行	8.2	5.4	1,393		オリコ	204.1	20.3	24,380	
三菱UFJ フィナンシャルG	4,412.5	4,930.3	6,530,182		大東銀行	3.2	2	1,512		オリックス	447.8	516.8	1,542,648	
りそなホールディングス	797.9	988.5	867,309		トモニホールディングス	55.5	63.9	30,544		三菱H C キャピタル	243.2	306.6	329,595	
三井住友トラスト HD	124.7	141.4	848,541		フィデアホール	6.8	8.1	13,834		九州リースサービス	3.3	2.4	2,212	
三井住友フィナンシャルG	489.1	559.5	4,252,200		池田泉州HD	78.8	100.7	33,130		日本取引所グループ	175.5	221.2	586,511	
千葉銀行	213	219.4	253,297		証券、商品先物取引業 (0.8%)	25.5	26.6	39,953		イー・ギャランティ	11.2	12.7	24,739	
群馬銀行	121.2	152.8	113,667		F P G	5.1	6.4	11,961		アサックス	3.5	2.3	1,575	
武藏野銀行	9.5	10.1	29,502		ジャパンインベストメントA	—	—	—		NECキャピタルソリューション	3.1	3.8	13,262	

日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）

銘柄	期首	当期末		銘柄	期首	当期末		銘柄	期首	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額			株数	評価額
不動産業 (1.9%)		千株	千円	不動産業 (1.9%)		千株	千円	不動産業 (1.9%)		千株	千円
大東建託	24.6	28.8	469,296	ファースト住建	3.4	2.2	2,708	ディー・エヌ・エー	27.9	32.8	50,544
いちご	84.4	90.7	29,658	ランド	437.9	473.6	4,262	博報堂DY HLDGS	92.4	104.9	137,943
日本駐車場開発	75.8	83.2	17,472	カチタス	18.8	21.2	47,424	ぐるなび	10.6	15	4,965
スター・マイカ・HLDGS	3.4	9.2	6,044	トーセイ	10.8	13.1	26,606	タカミヤ	8.8	11.4	5,962
SRE ホールディングス	1.9	3.9	12,304	穴吹興産	1.8	1	2,052	ジャパンベストレスキュード	4.1	4.2	3,087
AD ワークスグループ	21.2	13.4	3,430	サンフロンティア不動産	11.3	13.2	20,512	ファンコミュニケーションズ	12.8	12.4	4,984
ヒューリック	147	183.7	255,067	インテリックス	2.5	1.3	700	ライク	2.4	3.1	4,817
三井建築設計	3.3	3.7	7,481	ランドビジネス	3.7	1.9	646	ビジネス・ブレークスルー	2.5	2	798
野村不動産 HLDGS	39.3	49.3	195,277	サンネクスタブループ	3	1.5	1,465	エス・プール	18.8	23.7	11,067
三重交通グループ HD	15.8	16.8	10,248	グランディハウス	5.8	4.5	2,947	WDB ホールディングス	3.4	4.3	9,077
サムティ	10.4	12.6	30,466	日本空港ビルデンブ	24.4	27.8	183,063	ティア	4.1	3.1	1,457
地主	5.1	6	11,550	サービス業 (4.7%)				C D G	0.6	0.7	924
プレサンスコーポレーション	8.4	12.5	24,750	明豊ファシリティワークス	3.4	3	2,229	アドウェイズ	9	11.2	6,238
ハウスクム	2	0.8	750	日本工営	4.6	—	—	バリューコマース	4.9	7.1	8,938
J PMC	3.8	4.5	5,247	L I F U L L	22.5	27.9	6,584	インフォマート	67.8	85.3	40,346
サンセイランディック	3.2	1.6	1,713	M I X I	16.7	18.6	45,198	JP ホールディングス	17.9	23.5	7,943
エストラスト	2.8	0.7	454	ジェイエイシーリクルートメント	6	7.5	18,682	エコップホールディングス	13.9	9.2	763
フージャース HD	10	12.2	14,347	日本M&Aセンター・ホールデ	119.8	141.1	108,294	CL ホールディングス	1.8	2.1	1,749
オープンハウスグループ	24	28.8	150,652	メンバーズ	1.9	2.4	2,964	プレステージ・インター	27.5	34.9	22,056
東急不動産HD	205.3	236.7	232,415	中広	1.1	1.1	489	アミューズ	4	4.4	7,132
飯田GHD	61.8	67.1	178,217	UT グループ	10.5	12.1	27,418	ドリームインキュベータ	2.3	2.5	7,550
イープランド	1.3	0.8	1,282	アイティメディア	3.4	3	3,615	クイック	4.6	6.3	13,494
ビーロット	6	3.6	3,189	E・J ホールディングス	4.2	5	8,870	T A C	3.9	2.6	522
ファーストプラザーズ	1.5	1	1,213	オーブンアップグループ	23.9	24.7	46,436	電通グループ	68.4	80.8	356,974
AND DO ホールディングス	4.2	4.7	4,850	コシダカホールディングス	19.5	24.6	30,996	ティカアンドギニーズ	3.5	2.1	2,100
シーアールリー	3	4.4	6,846	アルトナー	1.9	1.4	2,535	ぴあ	2.2	2.7	10,462
プロパティエージェント	0.9	0.7	1,025	パソナグループ	7.9	10.1	16,998	イオンファンタジー	2.9	3.5	11,130
ケイアイスター不動産	3.4	3.8	18,601	C D S	1.9	1.4	2,454	シーティーエス	8.3	9.3	6,491
アグレ都市デザイン	1.3	0.9	1,415	リンクアンドモチベーション	18.9	23.8	10,971	ネクシィーズグループ	2.2	1.8	1,467
ジェイ・エス・ピー	1.7	1.9	10,659	エス・エム・エス	24.9	31.5	81,096	H U グループHD	19.1	24	63,360
ロードスター・キャピタル	2.8	5.1	9,465	サニーサイドアップG	2.5	1.7	1,388	アルプス技研	5.7	7.9	20,856
テンボイノ/ペーション	2.6	1.6	1,963	パーソルホールディングス	73.1	90.7	227,112	サンニックス	12.8	13.3	4,468
グローバリンクマネジメント	1.6	1	2,063	リニカル	4.2	3.2	2,252	ダイオーゼス	1.6	—	—
フェイスネットワーク	1.2	1.4	2,053	クックパッド	17.7	21.9	3,306	日本空調サービス	7.2	9.4	7,567
パーク24	48.7	51.1	103,349	エスクリ	3.5	2.2	743	オリエンタルランド	77.7	434.8	2,217,914
パラカ	2	2.7	5,656	アイ・ケイ・ケイホールディング	3.7	2.6	1,820	ダスキン	15.7	18.2	61,370
宮越ホールディングス	3.1	3.6	4,352	学情	3	4.2	8,282	明光ネットワークジャパン	8.5	9.7	6,285
三井不動産	294.6	336	1,159,200	スタジオアリス	3.3	4	8,372	ファルコホールディングス	3.3	3.7	7,366
三菱地所	429.9	475.1	987,970	シミックホールディングス	3.7	4.1	7,306	秀英予備校	1.6	1.2	489
平和不動産	12.1	12.8	54,464	エプロ	1.6	1.8	1,346	田谷	1.3	0.9	431
東京建物	60	68.8	150,018	N J S	1.3	1.9	5,700	ラウンドワン	20.5	68.6	40,131
京阪神ビルディング	10.2	13.2	18,585	綜合警備保障	26.7	152.8	141,294	リゾートトラスト	31	32.5	75,676
住友不動産	135.8	142.3	581,295	カカクコム	53.6	60.3	97,776	ビー・エム・エル	9.3	10.2	29,192
テオオーシー	12.2	14.2	9,301	アイロムグループ	2.7	3	5,718	りらিাコミュケーション	10.7	—	—
東京楽天地	1.3	1.3	5,473	セトア・ホールディング	4.8	5.1	4,233	リゾー教育	33.8	37.1	9,126
スターツコーポレーション	10.5	11.3	34,860	サイネット	1.2	0.9	627	早稻田アカデミー	4.1	4.4	6,661
フジ住宅	9.6	11.1	8,535	ルネサンス	5.1	5.6	5,208	ユー・エス・エス	81.8	84.6	211,584
空港施設	8.7	9.4	5,593	ディップ	12.9	14.4	53,640	東京個別指導学院	6.6	9.5	4,655
明和地所	4.1	2.5	3,020	デジタルホールディングス	5.1	4.2	4,405	サイバーエージェント	155.9	181.5	150,390
ゴールドクレスト	6.6	7.5	16,560	新日本科学	9	8.7	16,225	楽天グループ	301.2	703.2	436,054
エスリード	3.4	3.7	12,043	キャリアデザインセンター	1.6	1.2	2,496	クリーク・アンド・リバー社	3.9	4.9	10,760
日神グループ HLDGS	13.5	12.3	6,863	ベネフィット・ワン	26.4	38.1	43,091	SBI グローバルアセット	12.5	13.8	7,921
日本エスコン	14.7	14.8	14,104	エムスリー	128.9	162.3	456,793	ティー・オー・ダブリュー	13.1	17.4	5,446
MIRARTH ホールディング	32.8	39.9	19,950	ツカダ・グローバル HOLD	4.6	3.4	1,479	山田コンサルティングGP	3.9	4.2	6,993
AVANTIA	4.2	3	2,664	プラス	1	0.6	430	セントラルスポーツ	2.7	3	7,425
イオンモール	38.6	40.8	74,908	アウトソーシング	38.9	52.8	62,436	フルキャストホールディングス	6.3	7.9	15,649
毎日コムネット	3.4	1.9	1,470	ウェルネット	6.7	4.4	2,543	エン・ジャパン	13	14.9	36,341
				ワールドホールディングス	2.9	3.8	9,211	リソルホールディングス	0.8	0.5	2,430

日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）

銘柄	期首	当期末		
		株数	株数	評価額
		千株	千株	千円
テクノプロ・ホールディング	43.8	48.7	157,495	
アトラグループ	1.9	1.6	390	
インターワークス	2.5	—	—	
アイ・アールジャパンHD	3.4	4.3	10,320	
K e e P e r 技研	4.7	5.1	29,733	
ファーストロジック	1.1	1.2	636	
三機サービス	1.2	0.8	861	
G u n o s y	4.1	6.5	3,978	
デザインイン・ジャパン	2.3	1.3	218	
イー・ガーディアン	2.5	3	7,932	
リブセンス	3.7	2.5	867	
ジャパンマテリアル	22.5	25.1	59,110	
ペタル	10.2	13	16,848	
ウチヤマホールディングス	3.7	2.3	860	
チャムカーコーポレーション	5.5	6.8	7,602	
キャリアリンク	2.7	3	7,494	
I B J	3.9	6.2	3,856	
アサンテ	3.1	4.3	7,069	
バリューHR	5.7	7.1	9,045	
M&Aキャピタルパートナー	6	6.6	18,440	
ライドオンエクスプレスHD	2.9	3	3,012	
ERI ホールディングス	2.1	1.4	3,246	
アピスト	1.1	0.9	3,213	
シグマクシス・ホールディング	8.8	12.5	19,250	
ウィルグループ	5.4	7	7,826	
エスクローA J	8.1	6.7	978	
メドビア	5.1	7.2	7,286	
レアジョブ	1.4	1	1,031	
リカルトホールディングス	523.3	608.4	3,079,720	
エラン	8.6	10.8	9,104	
土木管理総合試験	3.2	3.2	1,094	
ネットマーケティング	3.6	—	—	
日本郵政	797.5	988.9	1,252,936	
ベルシステム24HLDGS	10.5	11.2	18,368	
鎌倉新書	8.4	9.3	6,082	
S M N	1.7	1.3	539	
一蔵	1	0.7	412	
グローバルキッズCOMP	1.1	1	697	
エアトリ	4.2	6	13,002	
アトラエ	5.1	4.9	5,443	
ストライク	3.2	3.5	12,040	
ソラスト	18	22.5	14,310	
セラフ	2.3	2.5	3,247	
インソース	8.1	17.9	18,204	
ペイケントコンサルティング	5.2	65.1	323,547	
ORCHESTRA HLDGS	1.4	1.7	1,791	
アイモバイル	3.6	3.6	4,701	
キャリアインデックス	2.5	1.8	531	
MS-Japan	3	1.9	2,270	
船場	0.9	1.2	1,123	
ジャパンエレベーターSHD	23.1	29.3	63,200	
フルテック	1.1	0.8	973	
グリーンズ	2.7	1.8	3,072	
ツナグループHLDGS	2.3	1.5	1,282	
GAMEWITH	2.2	1.6	523	
MS&CONSULTING	1.2	0.8	556	
ウェルビー	4.8	6	3,516	
エル・ティー・エス	0.8	0.9	3,429	

銘柄	期首	当期末		
		株数	株数	評価額
		千株	千株	千円
ミダックホールディングス	3.3	5	9,175	
日総工産	5.7	6.3	4,819	
キュービネットHLDGS	3.4	3.9	5,970	
RPA ホールディングス	10.2	11.1	3,774	
スプリックス	2.5	1.5	1,275	
マネジメントソリューションズ	3.6	3.5	10,885	
プロレド・パートナーズ	1.6	2.1	1,016	
AND FACTORY	1.7	1.6	587	
テノ・ホールディングス	0.8	0.7	431	
フロンティア・マネジメント	2.2	2.1	2,816	
ピアラ	1.2	1.1	462	
コプロ・ホールディングス	1.5	0.9	2,253	
ギース	1.3	0.7	509	
アンビスホールディングス	—	8.8	25,212	
カーブスホールディングス	20	22.5	16,582	
フォーラムエンジニアリング	4.5	4.9	6,389	
FAST FITNESS JAP	1.3	2.8	3,819	
ダイレクトマケティングミックス	7.4	8.5	4,437	
ポビンズ	0.9	1.2	1,527	
LITALICO	5.9	6.4	13,600	
コンフィデンス・インターワーク	—	0.3005	485	
アドバンテッジリスクマネ	3.9	2.5	1,200	
リログループ	40.1	45.7	75,382	
東洋	5.5	5.7	6,874	
ID&E ホールディングス	—	4.9	17,493	
ビーウィズ	2	2.1	4,790	
TRE ホールディングス	13.7	17.4	22,028	
人・夢・技術グループ	2.9	3	5,265	
大栄環境	—	21	46,977	
日本管財ホールディング	—	8.6	22,721	
エイチ・アイ・エス	17.1	23.8	42,268	
ラックランド	2.1	3.8	11,514	
共立メンテナンス	13	14.1	89,365	
イチネンホールディングス	7.4	8.9	12,504	
建設技術研究所	3.3	4.3	20,081	
スペース	4.7	5.2	4,872	
燐ホールディングス	3.2	3.4	7,279	
スバル興業	0.4	0.3	3,576	
東京テアトル	3	2	2,284	
タナベコンサルティンググル	2.6	2.2	2,580	
ナガワ	2.1	2.2	15,752	
東京都競馬	5.5	6.9	27,393	
常磐興産	2.5	1.8	2,453	
カナモト	11.9	12.8	33,766	
ニシオホールディングス	6.1	7.6	27,398	
アゴーラ ホスピタリティーG	42.7	34.5	897	
トランス・コスマス	9.2	10.2	32,640	
乃村工藝社	31.3	36.1	32,273	
藤田観光	2.9	3.3	16,929	
KNT-CT ホールディングス	4.5	4.9	6,683	
日本管財	7.7	—	—	
トーカイ	5.8	7.4	14,467	
白洋舎	0.6	0.8	2,067	
セコム	72	83.7	869,224	
セントラル警備保障	3.6	4.5	14,422	
丹青社	13.7	15.7	14,726	
メイテツク	26	32.2	83,285	
応用地質	6.3	7.7	19,735	

銘柄	期首	当期末		
		株数	株数	評価額
船井総研ホールディン	13.7	17.2	47,196	
進学会ホールディングス	2.1	1.8	527	
オオバ	4.5	3.6	3,394	
いであ	1.6	1.6	2,720	
学究社	2.2	3.2	6,608	
ベネッセホールディングス	24.3	30.6	57,665	
イオンディライト	8.3	9.2	30,314	
ナップ	4.1	3.9	3,837	
ダイセキ	13.3	16.8	71,736	
ステップ	2.7	2.9	5,153	
		千株	千株	千円
合計	株数、金額	78,099	118,452,605	275,855,624
	銘柄数×比率>	2,156 銘柄	2,141 銘柄	<98.5%>

(注1) 銘柄欄の( )内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注2) 合計欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国 内	TOP IX	百万円
	4,004	—

(注) 単位未満は切捨て。

# 日本株式インデックスファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）

## ■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	3,576,600 ( 16,400)	— ( —)

(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) 当ファンドに係る担当成期中の利害関係人のうち、大和証券株式会社へ16,400株を貸付けています。

## ■投資信託財産の構成

2023年9月19日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 275,855,624	% 95.8
コール・ローン等、その他	12,087,682	4.2
投資信託財産総額	287,943,307	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年9月19日現在

項目	当期末
<b>(A) 資産</b>	<b>288,634,027,304円</b>
コール・ローン等	11,709,990,572
株式（評価額）	275,855,624,477
未収入金	269,496,200
未収配当金	104,117,646
未取利息	307,903
その他未収収益	3,770,506
差入委託証拠金	690,720,000
<b>(B) 負債</b>	<b>8,667,292,595</b>
未払解約金	205,524,850
差入委託証拠金代用有価証券	767,800,000
受入担保金	7,693,967,745
<b>(C) 純資産総額（A - B）</b>	<b>279,966,734,709</b>
元本	162,050,849,324
次期繰越損益金	117,915,885,385
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>162,050,849,324口</b>
<b>1万口当り基準価額（C / D）</b>	<b>17,276円</b>

\*期首における元本額は146,161,636,928円、担当成期間中における追加設定元本額は30,161,540,525円、同解約元本額は14,272,328,129円です。

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

トピックス・インデックスファンド	2,794,966,122円
ダイワ・トピックス・インデックスファンドVA	4,428,862,186円
適格機関投資家専用・ダイワ・トピックスインデックスファンドVA2	912,624円
ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募）	15,316,355円
ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募）	195,111,007円

ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）	13,274,124円
ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）	424,964,925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）	622,708,014円
D-I's TOPIXインデックス	13,696,084円
DCダイワ・ターゲットイヤー2050	240,356,411円
iFree TOPIXインデックス	6,974,634,748円
iFree 8資産バランス	4,552,782,635円
iFree 年金バランス	936,907,657円
DCダイワ・ターゲットイヤー2060	760,330円
DCダイワ日本株式インデックス	70,157,904,335円
ダイワ・ライフ・バランス30	3,126,510,144円
ダイワ・ライフ・バランス50	4,815,356,904円
ダイワ・ライフ・バランス70	5,437,485,538円
年金ダイワ日本株式インデックス	7,253,536,469円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	52,146,342円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	73,459,968円
ダイワつみたてインデックス日本株式	4,348,979,651円
ダイワつみたてインデックスバランス30	13,296,558円
ダイワつみたてインデックスバランス50	11,248,003円
ダイワつみたてインデックスバランス70	27,586,525円
ダイワ国内株式インデックス（ラップ専用）	9,143,218,019円
ダイワ世界バランスファンド40VA	57,636,044円
ダイワ世界バランスファンド60VA	22,132,245円
ダイワ・バランスファンド35VA	3,969,119,137円
ダイワ国内バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	388,963,668円
ダイワ国内バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）	51,746,439円
ダイワ国内バランスファンド30VA（適格機関投資家専用）	77,438,203円
ダイワ・ノーロードTOPIXファンド	212,211,578円
ダイワファンドラップTOPIXインデックス	12,214,211,018円
ダイワTOPIXインデックス（ダイワSMA専用）	5,470,175,649円
ダイワファンドラップオンラインTOPIXインデックス	3,439,985,992円
ダイワ・インデックスセレクトTOPIX	1,173,613,678円
ダイワライフスタイル25	111,863,051円
ダイワライフスタイル50	498,094,602円
ダイワライフスタイル75	412,932,475円
DC・ダイワ・トピックス・インデックス（確定拠出年金専用ファンド）	8,274,743,867円

\*当期末の計算口数当りの純資産額は17,276円です。

## ■損益の状況

当期 自 2022年9月21日 至 2023年9月19日

項目	当期
(A)配当等収益	5,434,982,690円
受取配当金	5,299,111,418
受取利息	6,700,487
その他収益金	134,029,823
支払利息	△ 4,859,038
(B)有価証券売買損益	52,182,334,089
売買益	56,645,997,706
売買損	△ 4,463,663,617
(C)先物取引等損益	1,625,757,000
取引益	1,758,297,950
取引損	△ 132,540,950
(D)当期損益金（A+B+C）	59,243,073,779
(E)前期繰越損益金	50,857,579,661
(F)解約差損益金	△ 6,805,182,031
(G)追加信託差損益金	14,620,413,976
(H)合計（D+E+F+G）	117,915,885,385
次期繰越損益金（H）	117,915,885,385

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

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

## 《お知らせ》

## ■ベンチマークの変更について

ベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。

変更前：東証株価指数

変更後：東証株価指数（配当込み）

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

# 日本債券インデックス ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

## 運用報告書 (全体版) 第6期

(決算日 2023年11月30日)  
(作成対象期間 2022年12月1日～2023年11月30日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあざかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の公社債に投資し、投資成果をNOMURA-BP I 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っています。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

### 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI 総合指數 (ベンチマーク)	期中騰落率	公社債組入比率	債券先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率					
2期末(2019年12月2日)	円 10,246	円 0	% 2.2	10,269	% 2.4	% 99.1	% —	百万円 160
3期末(2020年11月30日)	10,150	0	△0.9	10,185	△0.8	99.1	—	437
4期末(2021年11月30日)	10,143	0	△0.1	10,199	0.1	98.8	—	996
5期末(2022年11月30日)	9,707	0	△4.3	9,770	△4.2	99.0	—	1,871
6期末(2023年11月30日)	9,570	0	△1.4	9,652	△1.2	99.0	—	3,352

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) NOMURA-BPI 総合指數は、同指數の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。

(注3) 指数值は、指數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。上記の指數は直近で知り得るデータを使用しております。

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

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

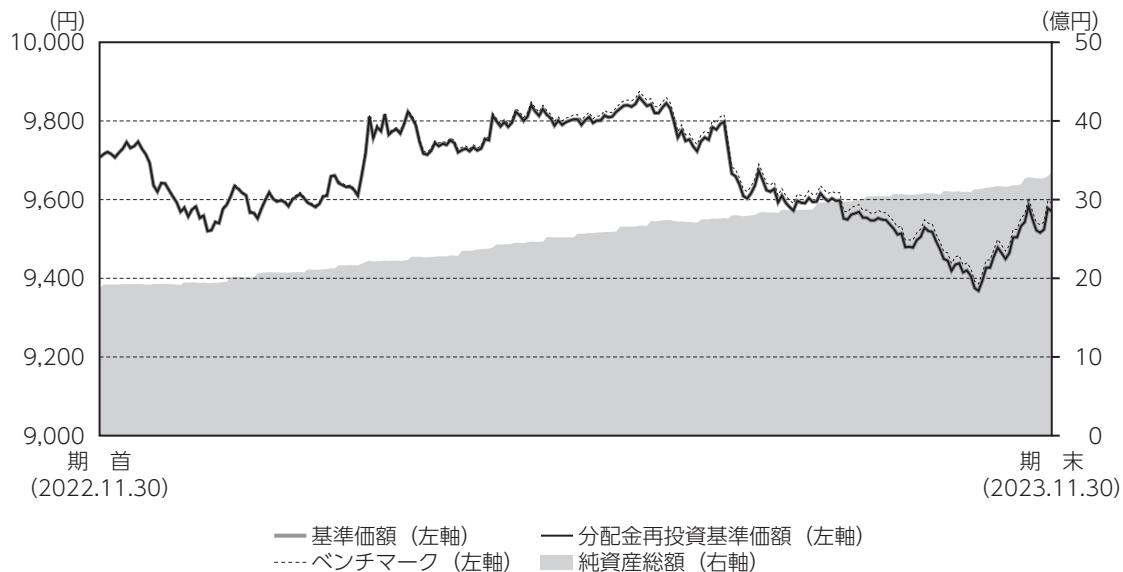
(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

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



# 運用経過

## 基準価額等の推移について



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

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

\*ベンチマークはNOMURA-BP I 総合指数です。

## 基準価額・騰落率

期首：9,707円

期末：9,570円（分配金0円）

騰落率： $\triangle 1.4\%$ （分配金込み）

## 基準価額の主な変動要因

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

日本債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

年 月 日	基 準 價 額	NOMURA-BPI 総合指数		公組入比率	債券先物比率
		騰 落 率 (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2022年11月30日	円 9,707	% —	% 9,770	% —	% 99.0
12月末	9,579	△1.3	9,645	△1.3	99.3
2023年1月末	9,552	△1.6	9,619	△1.5	99.2
2月末	9,659	△0.5	9,723	△0.5	99.0
3月末	9,790	0.9	9,859	0.9	99.4
4月末	9,813	1.1	9,882	1.2	99.4
5月末	9,801	1.0	9,873	1.1	99.7
6月末	9,820	1.2	9,900	1.3	99.2
7月末	9,666	△0.4	9,746	△0.2	99.1
8月末	9,595	△1.2	9,676	△1.0	99.2
9月末	9,526	△1.9	9,607	△1.7	99.1
10月末	9,375	△3.4	9,453	△3.2	99.3
(期末) 2023年11月30日	9,570	△1.4	9,652	△1.2	99.0

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2022.12.1～2023.11.30)

### ■国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇基調で推移しました。

国内長期金利は、当座成期首より、世界的なインフレの進行や海外金利の上昇、日銀が金融政策を一部修正するのではないかとの思惑などにより、日銀が長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）で許容する上限である0.25%程度を上限とした狭いレンジでの推移が続きました。2022年12月には、金融政策決定会合において日銀が長期金利の許容上限を0.25%程度から0.5%程度に引き上げたことを受けて長期金利は急上昇し、2023年1月には0.5%まで上昇しました。3月に入ると、米国地方銀行の経営破綻をきっかけとした信用不安が警戒されたことで投資家心理が悪化し、長期金利は一時0.2%台まで急低下（債券価格は上昇）したものの、当局の迅速な対応などが評価されて再び0.4%台後半まで上昇しました。その後は、日銀が7月の金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールの運用を一部変更して実質的に長期金利の許容上限を0.5%から1.0%に引き上げたことや、金融政策の修正を想起させる植田日銀総裁の発言、日銀が物価見通しを再び上昇修正するとの見方などにより、さらなる金融政策の修正が警戒され、10月には0.8%台まで上昇しました。10月の金融政策決定会合では、イールドカーブ・コントロールにおいて許容する上限である1.0%を「めど」に修正し、1.0%を超える長期金利の上昇を認めたものの、11月に入り米国金利が低下したことを受け、国内長期金利は低下しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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

## ポートフォリオについて

(2022.12.1～2023.11.30)

## ■当ファンド

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

## ■ダイワ日本債券インデックススマザーファンド（B P I）

当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を99%前後の高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドへの資金流入出や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

\*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

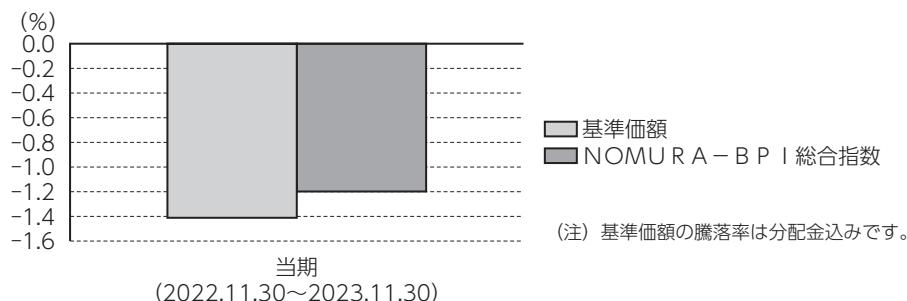
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ日本債券インデックススマザーファンド（B P I）	NOMURA-B P I 総合指数

## 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△1.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△1.4%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△0.2%でした。差異の内訳は、運用管理費用要因によるベンチマークとの差異が△0.1%程度となっており、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\*ベンチマークはNOMURA-B P I 総合指数です。

## 分配金について

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

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期
	2022年12月1日 ～2023年11月30日
<b>当期分配金（税込み）（円）</b>	—
対基準価額比率 (%)	—
当期の収益 (円)	—
当期の収益以外 (円)	—
翌期繰越分配対象額 (円)	35

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

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

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

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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

## 1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2022.12.1～2023.11.30)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	14円	0.143%	信託報酬＝当成期中の平均基準価額×信託報酬率 当成期中の平均基準価額は9,656円です。
(投信会社)	(11)	(0.110)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(1)	(0.011)	販売会社分は、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(2)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	－	－	売買委託手数料＝当成期中の売買委託手数料／当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＝当成期中の有価証券取引税／当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＝当成期中のその他費用／当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	14	0.148	

(注1) 当成期中の費用（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成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

## ■売買および取引の状況

### 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	千口 1,236,948	千円 1,525,973	千口 7,885	千円 9,748

(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成期中の利害関係人との取引状況

当成期中に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成期中の利害関係人との取引状況

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

決 算 期	当 期						
	区 分	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
公社債		百万円 20,551	百万円 1,218	% 5.9	百万円 8,839	百万円 300	% 3.4
コール・ローン		65,912	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合5.5%

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

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

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

種 類	当 期		
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）		
	買 付 額		
公社債	百万円 1,800		

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

#### (4) 当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

当成期中に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、当成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社です。

## ■組入資産明細表

### 親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
		口 数	評 価 額
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	千口 1,509,919	千円 2,738,982	千円 3,349,501

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	千円 3,349,501	% 99.8
コール・ローン等、その他	5,508	0.2
投資信託財産総額	3,355,010	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	(A) 資産	(B) 負債
(A) 資産	3,355,010,435円	2,166,889
コール・ローン等	5,508,788	2,086,714
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）(評価額)	3,349,501,647	80,175
(B) 負債		△ 150,488,678
未払信託報酬		3,503,332,224
その他未払費用		3,352,843,546
(C) 純資産総額(A - B)		△ 150,488,678
元本		3,503,332,224
次期繰越損益金		3,503,332,224
(D) 受益権総口数		1 万口当り基準価額(C / D)
		9,570円

\*期首における元本額は1,928,453,597円、当成期間中ににおける追加設定元本額は1,584,697,226円、同解約元本額は9,818,599円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は9,570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150,488,678円です。

## ■損益の状況

当期 自2022年12月1日 至2023年11月30日

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 1,014円
支払利息	△ 1,014
(B) 有価証券売買損益	△ 36,740,013
売買益	94,726
売買損	△ 36,834,739
(C) 信託報酬等	△ 3,765,879
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 40,506,906
(E) 前期繰越損益金	△ 62,022,512
(F) 追加信託差損益金	△ 47,959,260
(配当等相当額)	( 12,453,056)
(売買損益相当額)	(△ 60,412,316)
(G) 合計(D + E + F)	△150,488,678
次期繰越損益金(G)	△150,488,678
追加信託差損益金	△ 47,959,260
(配当等相当額)	( 12,453,056)
(売買損益相当額)	(△ 60,412,316)
分配準備積立金	42,880
繰越損益金	△102,572,298

(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	12,453,056
(d) 分配準備積立金	42,880
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	12,495,936
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	12,495,936
(h) 受益権総口数	3,503,332,224□

# ダイワ日本債券インデックススマザーファンド（B P I）

## 運用報告書 第19期（決算日 2023年11月30日）

（作成対象期間 2022年12月1日～2023年11月30日）

ダイワ日本債券インデックススマザーファンド（B P I）の運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

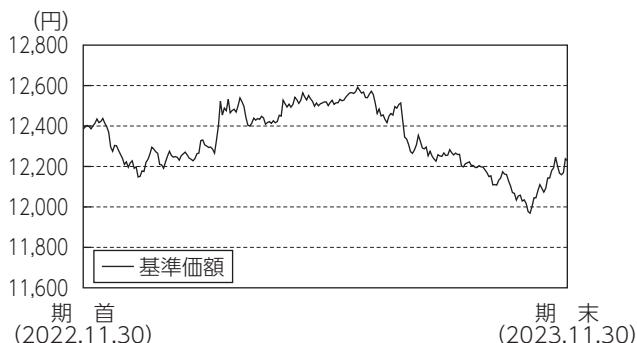
## 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

# 日本債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

## ■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年 月 日	基 準 価 額	NOMURA-BPI		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		総合指 数 (ベンチマーク)	騰落率		
(期首)2022年11月30日	12,385	—	12,408	99.1	—
12月末	12,223	△1.3	12,250	△1.3	99.4
2023年1月末	12,191	△1.6	12,217	△1.5	99.3
2月末	12,328	△0.5	12,350	△0.5	99.1
3月末	12,497	0.9	12,522	0.9	99.4
4月末	12,528	1.2	12,551	1.2	99.5
5月末	12,514	1.0	12,540	1.1	99.8
6月末	12,541	1.3	12,574	1.3	99.3
7月末	12,345	△0.3	12,378	△0.2	99.2
8月末	12,256	△1.0	12,289	△1.0	99.3
9月末	12,169	△1.7	12,201	△1.7	99.2
10月末	11,977	△3.3	12,007	△3.2	99.4
(期末)2023年11月30日	12,229	△1.3	12,260	△1.2	99.1

（注1）騰落率は期首比。

（注2）NOMURA-BPI 総合指数は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。

（注3）指値は、指値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。上記の指値は直近で知り得るデータを使用しております。

（注4）公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

（注5）債券先物比率は買建比率－売建比率です。

## 《運用経過》

### ◆基準価額等の推移について

#### 【基準価額・騰落率】

期首：12,385円 期末：12,229円 謄落率：△1.3%

#### 【基準価額の主な変動要因】

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

### ◆投資環境について

#### ○国内債券市場

国内債券市場では、長期金利は上昇基調で推移しました。

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

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

### ◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

### ◆ポートフォリオについて

当ファンドの基準価額の謄落率が、ベンチマークの謄落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を99%前後の高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づげることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドへの資金流入出や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、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謄落率は△1.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の謄落率は△1.3%となりました。

当ファンドの基準価額とベンチマークとの謄落率の差は△0.1%程度で、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度を適切にコントロールしたことから、目立った超過損益は発生しませんでした。

\*ベンチマークはNOMURA-BPI 総合指数です。

## 《今後の運用方針》

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

## ■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	一円
有価証券取引税	一
その他費用	一
合計	一

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■売買および取引の状況

### 公社債

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債券（転換社債券）は含まれておりません。

(注4) 単位未満は切捨て。

## ■主要な売買銘柄

### 公社債

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

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

区分	額面金額	評価額	組入比率	期末		
				うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率	
	千円	千円	%	%	%	%
国債証券	46,261,000	45,033,250	84.7	—	54.8	19.7
地方債証券	3,034,160	3,067,174	5.8	—	3.5	1.1
特殊債券 (除く金融債券)	1,189,084	1,216,626	2.3	—	1.5	0.4
普通社債券	3,400,000	3,365,723	6.3	—	1.8	4.3
合計	53,884,244	52,682,775	99.1	—	61.7	25.5
						11.9

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

### (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	銘柄	年利率	期末		
			額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
国債証券	142 5年国債	0.1000	320,000	320,419	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	550,000	551,881	2024/12/20
	444 2年国債	0.0050	170,000	170,073	2025/01/01
	445 2年国債	0.0050	110,000	110,044	2025/02/01
	446 2年国債	0.0050	400,000	400,148	2025/03/01
	143 5年国債	0.1000	900,000	901,458	2025/03/20
	338 10年国債	0.4000	80,000	80,441	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	14,000	14,386	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	25,000	25,625	2025/03/20
	447 2年国債	0.0050	90,000	90,029	2025/04/01
	448 2年国債	0.0050	70,000	70,014	2025/05/01
	449 2年国債	0.0050	300,000	300,021	2025/06/01
	144 5年国債	0.1000	650,000	651,105	2025/06/20
	339 10年国債	0.4000	165,000	166,047	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	17,000	17,503	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	14,000	14,436	2025/06/20
	451 2年国債	0.0050	20,000	20,003	2025/08/01
	452 2年国債	0.0050	110,000	110,000	2025/09/01
	145 5年国債	0.1000	1,070,000	1,071,829	2025/09/20
	340 10年国債	0.4000	190,000	191,352	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	65,000	67,337	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	28,000	29,057	2025/09/20
	453 2年国債	0.0050	60,000	59,977	2025/10/01
	146 5年国債	0.1000	540,000	540,826	2025/12/20
	341 10年国債	0.3000	15,000	15,084	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	800,000	799,352	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	140,000	140,191	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	31,000	32,466	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	6,000	6,311	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	35,000	36,736	2026/03/20
	148 5年国債	0.0050	500,000	499,360	2026/06/20
	343 10年国債	0.1000	300,000	300,342	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	33,000	34,886	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	15,000	15,819	2026/06/20

日本債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

区分	銘柄	当期末			
		年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
149	5年国債	0.0050	620,000	618,958	2026/09/20
344	10年国債	0.1000	90,000	90,087	2026/09/20
150	5年国債	0.0050	500,000	498,780	2026/12/20
345	10年国債	0.1000	410,000	410,184	2026/12/20
92	20年国債	2.1000	60,000	63,690	2026/12/20
151	5年国債	0.0050	450,000	448,519	2027/03/20
152	5年国債	0.1000	150,000	149,974	2027/03/20
346	10年国債	0.1000	250,000	249,957	2027/03/20
93	20年国債	2.0000	18,000	19,124	2027/03/20
94	20年国債	2.1000	45,000	47,958	2027/03/20
1	フィリピン共和国	0.7600	100,000	98,830	2027/04/22
153	5年国債	0.0050	270,000	268,852	2027/06/20
347	10年国債	0.1000	690,000	689,385	2027/06/20
95	20年国債	2.3000	30,000	32,312	2027/06/20
96	20年国債	2.1000	63,000	67,410	2027/06/20
154	5年国債	0.1000	520,000	519,110	2027/09/20
348	10年国債	0.1000	430,000	429,264	2027/09/20
97	20年国債	2.2000	25,000	26,948	2027/09/20
98	20年国債	2.1000	64,000	68,744	2027/09/20
155	5年国債	0.3000	90,000	90,470	2027/12/20
156	5年国債	0.2000	600,000	600,720	2027/12/20
349	10年国債	0.1000	430,000	428,787	2027/12/20
99	20年国債	2.1000	53,000	57,127	2027/12/20
157	5年国債	0.2000	60,000	60,012	2028/03/20
158	5年国債	0.1000	430,000	428,258	2028/03/20
350	10年国債	0.1000	400,000	398,380	2028/03/20
100	20年国債	2.2000	35,000	37,999	2028/03/20
101	20年国債	2.4000	18,000	19,696	2028/03/20
159	5年国債	0.1000	200,000	198,918	2028/06/20
161	5年国債	0.3000	100,000	100,360	2028/06/20
351	10年国債	0.1000	170,000	169,080	2028/06/20
102	20年国債	2.4000	10,000	10,987	2028/06/20
103	20年国債	2.3000	21,000	22,978	2028/06/20
104	20年国債	2.1000	64,000	69,452	2028/06/20
162	5年国債	0.3000	180,000	180,426	2028/09/20
352	10年国債	0.1000	320,000	317,721	2028/09/20
105	20年国債	2.1000	38,000	41,355	2028/09/20
106	20年国債	2.2000	16,000	17,488	2028/09/20
353	10年国債	0.1000	520,000	515,720	2028/12/20
107	20年国債	2.1000	40,000	43,680	2028/12/20
108	20年国債	1.9000	68,000	73,578	2028/12/20
354	10年国債	0.1000	280,000	277,368	2029/03/20
109	20年国債	1.9000	60,000	65,108	2029/03/20
110	20年国債	2.1000	27,000	29,580	2029/03/20
355	10年国債	0.1000	290,000	286,911	2029/06/20
111	20年国債	2.2000	35,000	38,672	2029/06/20
112	20年国債	2.1000	40,000	43,978	2029/06/20
356	10年国債	0.1000	440,000	434,728	2029/09/20
113	20年国債	2.1000	70,000	77,207	2029/09/20
357	10年国債	0.1000	420,000	414,267	2029/12/20
114	20年国債	2.1000	45,000	49,770	2029/12/20
115	20年国債	2.2000	42,000	46,701	2029/12/20
2	30年国債	2.4000	9,000	10,135	2030/02/20
358	10年国債	0.1000	480,000	472,454	2030/03/20
116	20年国債	2.2000	27,000	30,106	2030/03/20

区分	銘柄	当期末			
		年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
117	20年国債	2.1000	77,000	85,382	2030/03/20
3	30年国債	2.3000	4,000	4,493	2030/05/20
359	10年国債	0.1000	240,000	235,704	2030/06/20
118	20年国債	2.0000	13,000	14,364	2030/06/20
119	20年国債	1.8000	23,000	25,111	2030/06/20
120	20年国債	1.6000	98,000	105,742	2030/06/20
360	10年国債	0.1000	500,000	489,740	2030/09/20
4	30年国債	2.9000	8,000	9,359	2030/11/20
361	10年国債	0.1000	510,000	498,137	2030/12/20
123	20年国債	2.1000	42,000	46,848	2030/12/20
124	20年国債	2.0000	100,000	110,859	2030/12/20
362	10年国債	0.1000	550,000	535,826	2031/03/20
125	20年国債	2.2000	25,000	28,121	2031/03/20
126	20年国債	2.0000	21,000	23,316	2031/03/20
127	20年国債	1.9000	110,000	121,356	2031/03/20
5	30年国債	2.2000	8,000	9,011	2031/05/20
363	10年国債	0.1000	460,000	446,936	2031/06/20
128	20年国債	1.9000	32,000	35,349	2031/06/20
129	20年国債	1.8000	95,000	104,251	2031/06/20
364	10年国債	0.1000	430,000	416,455	2031/09/20
130	20年国債	1.8000	110,000	120,829	2031/09/20
131	20年国債	1.7000	150,000	163,639	2031/09/20
6	30年国債	2.4000	9,000	10,318	2031/11/20
365	10年国債	0.1000	410,000	396,076	2031/12/20
132	20年国債	1.7000	25,000	27,300	2031/12/20
133	20年国債	1.8000	150,000	164,965	2031/12/20
366	10年国債	0.2000	600,000	583,098	2032/03/20
134	20年国債	1.8000	15,000	16,520	2032/03/20
135	20年国債	1.7000	20,000	21,868	2032/03/20
136	20年国債	1.6000	180,000	195,386	2032/03/20
7	30年国債	2.3000	12,000	13,720	2032/05/20
367	10年国債	0.2000	330,000	319,911	2032/06/20
137	20年国債	1.7000	18,000	19,698	2032/06/20
139	20年国債	1.6000	250,000	271,547	2032/06/20
368	10年国債	0.2000	400,000	386,620	2032/09/20
140	20年国債	1.7000	100,000	109,517	2032/09/20
369	10年国債	0.5000	500,000	495,065	2032/12/20
141	20年国債	1.7000	140,000	153,419	2032/12/20
142	20年国債	1.8000	210,000	231,934	2032/12/20
370	10年国債	0.5000	550,000	543,477	2033/03/20
10	30年国債	1.1000	25,000	26,055	2033/03/20
143	20年国債	1.6000	100,000	108,711	2033/03/20
144	20年国債	1.5000	50,000	53,915	2033/03/20
371	10年国債	0.4000	480,000	468,993	2033/06/20
11	30年国債	1.7000	9,000	9,876	2033/06/20
145	20年国債	1.7000	40,000	43,895	2033/06/20
372	10年国債	0.8000	70,000	70,836	2033/09/20
12	30年国債	2.1000	11,000	12,487	2033/09/20
146	20年国債	1.7000	160,000	175,561	2033/09/20
13	30年国債	2.0000	11,000	12,389	2033/12/20
147	20年国債	1.6000	240,000	261,019	2033/12/20
14	30年国債	2.4000	22,000	25,666	2034/03/20
148	20年国債	1.5000	290,000	312,434	2034/03/20
15	30年国債	2.5000	21,000	24,750	2034/06/20
149	20年国債	1.5000	310,000	333,873	2034/06/20

日本債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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

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

日本債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

当期		期末			
区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
9	40年国債	0.4000	40,000	27,122	2056/03/20
10	40年国債	0.9000	240,000	191,049	2057/03/20
11	40年国債	0.8000	85,000	64,909	2058/03/20
12	40年国債	0.5000	99,000	67,093	2059/03/20
13	40年国債	0.5000	252,000	168,774	2060/03/20
14	40年国債	0.7000	273,000	195,099	2061/03/20
15	40年国債	1.0000	250,000	196,635	2062/03/20
16	40年国債	1.3000	300,000	258,339	2063/03/20
種別 銘柄数 小計 金額	262銘柄				
			46,261,000	45,033,250	
地方債証券					
3	兵庫県公債12年	0.5600	100,000	100,635	2025/04/16
32	東京都5年	0.0200	100,000	99,879	2025/06/20
151	共同発行地方	0.4660	100,000	100,649	2025/10/24
401	大阪府公債	0.4770	100,000	100,650	2025/10/29
22-1	福岡県15年	1.6700	100,000	103,036	2025/11/21
27-1	滋賀県公債	0.4760	100,000	100,679	2025/11/27
751	東京都公債	0.3700	100,000	100,480	2025/12/19
27-15	北海道公債	0.2200	100,000	100,134	2026/02/26
28-1	静岡県公債	0.0800	100,000	99,821	2026/03/19
222	神奈川県公債	0.0600	100,000	99,722	2026/06/19
168	共同発行地方	0.2100	100,000	99,976	2027/03/25
29-6	千葉県公債	0.2450	100,000	99,798	2028/01/25
30-3	新潟県公債	0.1460	134,160	132,422	2029/02/28
6	札幌市20年	2.2400	100,000	109,966	2029/06/20
797	東京都公債	0.0400	100,000	97,735	2029/09/20
1	埼玉県15年	0.9410	100,000	102,882	2029/10/19
11	名古屋市20年	2.1300	100,000	109,949	2029/12/14
2-1	千葉市公債	0.1310	100,000	97,658	2030/04/24
9	埼玉県20年	2.1500	100,000	110,407	2030/05/24
457	大阪府公債	0.1000	100,000	97,165	2030/06/28
11兵庫県公債20年		1.8400	100,000	108,474	2030/08/16
2-2	横浜市公債	0.1350	100,000	97,351	2030/08/19
2-1	静岡市公債	0.1400	100,000	97,099	2030/11/18
3-5	北海道公債	0.1400	100,000	96,225	2031/06/30
3-1	茨城県公債	0.1400	100,000	96,336	2031/06/30
10	京都市20年	1.8030	100,000	108,783	2031/11/21
3-3	堺市公債	0.1250	100,000	95,715	2031/12/22
4-3	長崎県公債	0.3640	100,000	97,085	2032/06/18
24-1	広島県20年	1.7000	100,000	108,333	2032/09/14
244	共同発行地方	0.5900	100,000	98,116	2033/07/25
種別 銘柄数 小計 金額	30銘柄				
			3,034,160	3,067,174	
特殊債券 (除く金利債券)					
241	政保道路機構	0.4500	100,000	100,526	2025/03/31
261	政保道路機構	0.3810	100,000	100,549	2025/11/28
127	都市再生	0.0750	100,000	99,579	2026/09/18
80	住宅支援機構	1.5890	100,000	103,814	2026/09/18
3	地方公共団体15年	1.1760	100,000	103,679	2029/01/26
81	政保道路機構	2.1000	100,000	109,294	2029/05/31
47	日本政策投資CO	1.0270	100,000	103,072	2029/09/20
129	地方公共団体	0.0950	100,000	97,323	2030/02/28
F231	地方公共団体	1.1760	100,000	103,928	2030/04/30
174	日本政策投資	0.6490	100,000	98,210	2033/07/14
47	住宅機構RMBS	1.9200	189,084	196,647	2046/04/10
種別 銘柄数 小計 金額	11銘柄				
			1,189,084	1,216,626	

当期		期末			
区分	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
普通社債券	497	関西電力	1.0020	100,000	101,187
	14	セブンアンドアイ	0.1900	100,000	99,761
	11	ヒューリック	0.3200	100,000	99,874
	36	芙蓉総合リース	0.2700	100,000	99,632
	20	成田国際空港	0.1050	100,000	99,525
	32	大和ハウス工業	0.3100	100,000	99,975
	17	パナソニック	0.4700	100,000	100,049
	7	三井住友海上	0.1900	100,000	99,610
	6	楽天カード	0.6200	100,000	89,980
	80	三菱地所	2.3050	100,000	106,323
	42	リコリース	0.3900	100,000	99,460
	9	ソフトバンク	0.4800	100,000	98,287
	16	クボタ	0.4790	100,000	99,785
	16	JERA	0.6400	100,000	99,812
	1	SOMPOHD	0.4790	100,000	100,021
	11	サントリーホールディング	0.3890	100,000	99,413
	29	東急不動産HD	0.4500	100,000	99,285
	50	大阪瓦斯	0.3900	100,000	99,314
	82	三井不動産	0.3600	100,000	99,294
	22	積水ハウス	0.3600	100,000	99,385
	26	リゾナホールディング	0.4150	100,000	99,576
	81	ホンダファイナンス	0.3890	100,000	99,434
	101	中日本高速道	0.4390	200,000	199,566
	32	住友電工	0.4640	100,000	99,137
	489	九州電力	0.4400	100,000	97,192
	65	東京瓦斯	0.2250	100,000	96,250
	18	セブンアンドアイ	1.0400	100,000	100,833
	35	東レ	0.9730	100,000	99,902
	5	NTTファイナンス	0.4890	100,000	95,639
	143	三菱地所	0.9000	100,000	98,829
	448	中国電力	0.9200	100,000	96,688
	31	トヨタ自動車	0.7350	100,000	97,542
	214	オリックス	0.8500	100,000	95,150
種別 銘柄数 小計 金額	33銘柄				
				3,400,000	3,365,723
合計 銘柄数 金額	336銘柄				
				53,884,244	52,682,775

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年11月30日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
公社債	千円	%
52,682,775	98.6	
コール・ローン等、その他	765,322	1.4
投資信託財産総額	53,448,097	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年11月30日現在

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

\*期首における元本額は34,135,552,866円、当座成期間中における追加設定元本額は10,094,084,082円、同解約元本額は774,200,349円です。

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額 :

日本債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	2,738,982,458円
iFree 日本債券インデックス	3,361,141,887円
iFree 8資産バランス	6,400,564,081円
ダイワ・ライフ・バランス30	11,825,100,390円
ダイワ・ライフ・バランス50	9,124,633,659円
ダイワ・ライフ・バランス70	3,495,533,334円
D C ダイワ・ワールドアセット (六つの羽／安定コース)	1,935,570,741円
D C ダイワ・ワールドアセット (六つの羽／6分散コース)	1,530,659,908円
D C ダイワ・ワールドアセット (六つの羽／成長コース)	611,361,968円
ダイワつみたてインデックス日本債券	2,117,596,780円
ダイワつみたてインデックスバランス30	47,452,814円
ダイワつみたてインデックスバランス50	21,682,780円
ダイワつみたてインデックスバランス70	18,604,243円
ダイワ世界バランスファンド40VA	184,289,943円
ダイワ世界バランスファンド60VA	42,261,613円

\*当期末の計算口数当たりの純資産額は12,229円です。

## ■損益の状況

当期 自2022年12月1日 至2023年11月30日

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

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

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

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

# 外国株式インデックス ファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)

## 運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2023年11月30日)  
(作成対象期間 2022年12月1日～2023年11月30日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあざかり厚くお礼申し上げます。

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

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、  
お願い申し上げます。

### 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			MSCIコクサイ指数 (税引後配当込み、円ベース) (ベンチマーク)	期中騰落率	株式組入率	株式先物比率	投資証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率						
2期末(2019年12月2日)	円 10,653	円 0	% 11.7	10,640	% 11.6	% 90.5	% 6.7	% 2.7	百万円 23
3期末(2020年11月30日)	11,652	0	9.4	11,630	9.3	93.3	4.7	2.3	68
4期末(2021年11月30日)	15,930	0	36.7	15,883	36.6	91.4	6.5	2.2	150
5期末(2022年11月30日)	16,705	0	4.9	16,639	4.8	89.7	8.1	2.2	291
6期末(2023年11月30日)	20,401	0	22.1	20,286	21.9	88.4	8.1	1.9	532

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

(注6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

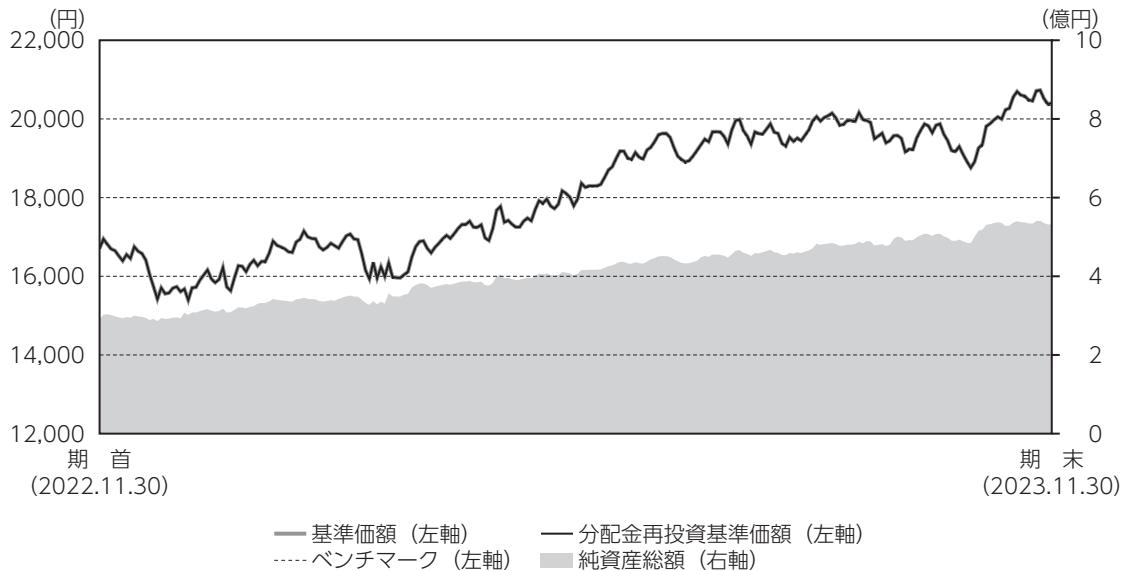
(注7) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

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



# 運用経過

## 基準価額等の推移について



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

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

\*ベンチマークはMSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）です。

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

## ■基準価額・騰落率

期首：16,705円

期末：20,401円（分配金0円）

騰落率：22.1%（分配金込み）

## ■基準価額の主な変動要因

海外株式市況が上昇したことや、為替相場が円安になったことにより、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。

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

年 月 日	基 準 価 額	M S C I コクサイ指數 (税引後配当込み、円ベース)		株式組入率	株式先物率	投 資 組 入 率	投 資 證 券 率
		騰落率 (ベンチマーク)	騰落率				
(期首) 2022年11月30日	円 16,705	% —	% 16,639	% 89.7	% 8.1	% 2.2	
12月末	15,678	△ 6.1	△ 6.2	91.3	6.4		2.2
2023年 1月末	16,268	△ 2.6	△ 2.6	90.1	7.6		2.3
2月末	16,839	0.8	0.7	93.0	5.0		2.2
3月末	16,753	0.3	0.2	92.4	5.6		2.1
4月末	17,212	3.0	2.9	92.1	5.7		2.1
5月末	18,011	7.8	7.7	91.8	6.4		2.0
6月末	19,425	16.3	16.2	92.8	5.1		2.0
7月末	19,718	18.0	18.0	91.9	6.3		2.0
8月末	20,061	20.1	20.0	90.3	7.8		1.9
9月末	19,575	17.2	17.0	92.2	6.0		1.9
10月末	18,915	13.2	13.1	90.7	7.6		1.9
(期末) 2023年11月30日	20,401	22.1	21.9	88.4	8.1		1.9

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2022.12.1～2023.11.30)

### ■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、当成期首より、米国の景況感や企業業績の悪化懸念などから、2022年末にかけて下落しました。2023年に入ると、F R B（米国連邦準備制度理事会）が今後利上げ幅を縮小させるのではないかとの期待を背景に上昇しました。2月は、米国の利上げ長期化への懸念から軟調な展開となり、3月には、米国の地方銀行の経営破綻やスイスの金融大手の株価急落により信用不安が高まり、続落しました。経営破綻した米国の地方銀行の預金保護やF R Bによる金融機関への流動性供給、スイスの金融大手の救済合併の決定などにより信用不安が後退したことから、3月下旬には上昇に転じました。その後レンジでの推移をはさみ、6月以降は、米国の債務上限問題の解決や米国のインフレ警戒感の後退、中国の経済対策への期待から、欧米株ともに上昇しました。8月以降は、米国で堅調な経済指標が追加利上げ観測からの米国金利上昇を招いたことや、欧州で弱い経済指標が欧州経済への先行き懸念を強めたことから、下落しました。11月に入ると、米国の利上げ打ち止め観測などを背景に米国金利の下落傾向が続き、上昇しました。

### ■為替相場

#### 為替相場は、当成期を通して見ると円安となりました。

対円為替相場は、当成期首より、インフレ率の低下期待などから米国金利が低下したことと日米金利差の縮小が意識され、円高米ドル安となりました。その後2023年2月には、堅調な米国の経済指標を受けて米国金利が上昇することで円安に転じましたが、3月に入り、信用不安の拡大により米国金利が大きく低下したことやリスク回避による円買い需要の高まりなどから、円高となりました。4月以降は、経済指標の上振れなどを背景に米国金利が上昇するに連れて、米ドルなどの通貨は対円で上昇（円安）しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

今後の運用にあたりましても、引き続き、「外国株式インデックススマザーファンド」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スマザーファンド

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

(2022.12.1～2023.11.30)

### ■当ファンド

「外国株式インデックススマザーファンド」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スマザーファンド

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

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

\*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

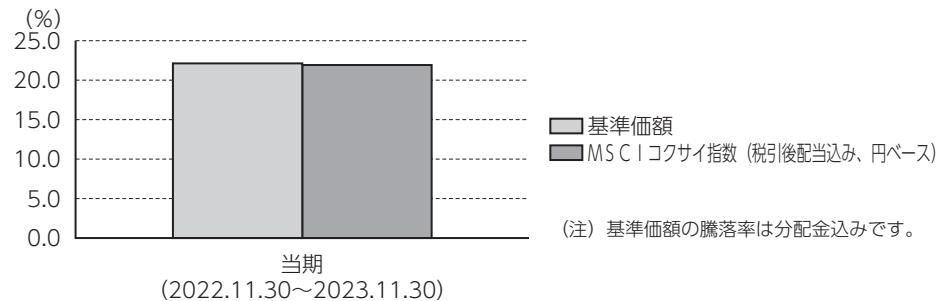
組入ファンド	ベンチマーク
外国株式インデックススマザーファンド	MSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）

### ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は21.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は22.1%となりました。

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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



\*ベンチマークはMSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）です。

## 分配金について

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

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期
	2022年12月1日 ～2023年11月30日
<b>当期分配金（税込み）（円）</b>	—
対基準価額比率 (%)	—
当期の収益 (円)	—
当期の収益以外 (円)	—
<b>翌期継越分配対象額 (円)</b>	10,401

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

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

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

(注4) 投資信託の計理上、「翌期継越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

今後の運用にあたりましても、引き続き、「外国株式インデックススマザーファンド」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スマザーファンド

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 (2022.12.1～2023.11.30)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	26円	0.143%	信託報酬＝当成期中の平均基準価額×信託報酬率 当成期中の平均基準価額は18,119円です。
(投信会社)	(20)	(0.110)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(2)	(0.011)	販売会社分は、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(4)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	1	0.004	売買委託手数料＝当成期中の売買委託手数料／当成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.002)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
有価証券取引税	1	0.005	有価証券取引税＝当成期中の有価証券取引税／当成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.005)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	4	0.022	その他費用＝当成期中のその他費用／当成期中の平均受益権口数
(保管費用)	(3)	(0.017)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	32	0.174	

(注1) 当成期中の費用（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成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

## ■売買および取引の状況

### 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
千円	千円	千円	千円	千円
外国株式インデックスマザーファンド	42,257	193,104	10,473	51,835

(注) 単位未満は切捨て。

### ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

項 目	当 期
	外国株式インデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	51,216,680千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	321,507,110千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.15

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■利害関係人との取引状況等

### 当作成期中における利害関係人との取引はありません。

## ■組入資産明細表 親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
千円	千円	千円	千円
外国株式インデックスマザーファンド	67,499	99,283	523,927

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
千円	%	
外国株式インデックスマザーファンド	523,927	98.3
コール・ローン等、その他	8,799	1.7
投資信託財産総額	532,727	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あります。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=147.07円、1カナダ・ドル=108.21円、1オーストラリア・ドル=97.45円、1香港ドル=18.84円、1シンガポール・ドル=110.38円、1ニュージーランド・ドル=90.70円、1イギリス・ポンド=186.84円、1イスラエル・シェケル=39,913円、1スイス・フラン=168.56円、1デンマーク・クローネ=21.66円、1ノルウェー・クローネ=13.81円、1スウェーデン・クローネ=14.21円、1ユーロ=161.51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（394,774,332千円）の投資信託財産総額（416,412,657千円）に対する比率は、94.8%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年11月30日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>532,727,501円</b>
コール・ローン等	6,700
外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	523,927,601
未収入金	8,793,200
<b>(B) 負債</b>	<b>352,107</b>
未払信託報酬	339,149
その他未払費用	12,958
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>532,375,394</b>
元本	260,949,285
次期繰越損益金	271,426,109
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>260,949,285口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	20,401円

\*期首における元本額は174,436,451円、当作成期間中における追加設定元本額は105,022,451円、同解約元本額は18,509,617円です。

\*当期末の計算口数当たりの純資産額は20,401円です。

## ■損益の状況

当期 自2022年12月1日 至2023年11月30日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>△ 5円</b>
支払利息	△ 5
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>88,234,742</b>
売買益	91,416,480
売買損	△ 3,181,738
<b>(C) 信託報酬等</b>	<b>△ 607,426</b>
<b>(D) 当期損益金(A+B+C)</b>	<b>87,627,311</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>47,494,249</b>
<b>(F) 追加信託差損益金</b>	<b>136,304,549</b>
(配当等相当額)	( 113,802,981)
(売買損益相当額)	( 22,501,568)
<b>(G) 合計(D+E+F)</b>	<b>271,426,109</b>
<b>次期繰越損益金(G)</b>	<b>271,426,109</b>
追加信託差損益金	136,304,549
(配当等相当額)	( 113,802,981)
(売買損益相当額)	( 22,501,568)
分配準備積立金	135,121,565
繰越損益金	△ 5

\*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	87,627,316
(c) 収益調整金	136,304,549
(d) 分配準備積立金	47,494,249
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	271,426,114
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	271,426,114
(h) 受益権総口数	260,949,285□

《お知らせ》

■ベンチマークの変更について

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

変更前：MSCIコクサイ指数（円ベース）

変更後：MSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）

# 外国株式インデックススマザーファンド

## 運用報告書 第24期（決算日 2023年11月30日）

（作成対象期間 2022年12月1日～2023年11月30日）

外国株式インデックス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（配当込み、円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	外国の株式（預託証書を含みます。）
株式組入制限	無制限

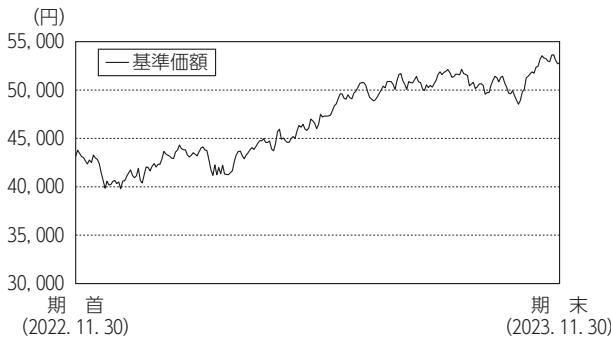
### 大和アセットマネジメント

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：43,159円 期末：52,771円 謄落率：22.3%

## 【基準価額の主な変動要因】

海外株式市況が上昇したことや、為替相場が円安になったことにより、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。

## ◆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、当成期首より、米国の景況感や企業業績の悪化懸念などから、2022年末にかけて下落しました。2023年に入ると、F R B（米国連邦準備制度理事会）が今後利上げ幅を縮小させるのではないかとの期待を背景に上昇しました。2月は、米国の方銀行の経営破綻やイスラエルの金融大手の株価急落により信用不安が高まり、続落しました。経営破綻した米国の方銀行の預金保護やF R Bによる金融機関への流動性供給、イスラエルの金融大手の救済合併の決定などにより信用不安が後退したことから、3月下旬には上昇に転じました。その後レンジでの推移をはさみ、6月以降は、米国の債務上限問題の解決や米国のインフレ警戒感の後退、中国の経済対策への期待から、欧米株ともに上昇しました。8月以降は、米国で堅調な経済指標が追加利上げ観測からの米国金利上昇を招いたことや、欧州で弱い経済指標が欧州経済への先行き懸念を強めたことから、下落しました。11月に入ると、米国の利上げ打ち止め観測などを背景に米国金利の下落傾向が続き、上昇しました。

## ○為替相場

為替相場は、当成期を通してみると円安となりました。

対円為替相場は、当成期首より、インフレ率の低下期待などから米国金利が低下したことや米国金利差の縮小が意識され、円高米ドル安となりました。その後2023年2月には、堅調な米国の経済指標を受けて米国金利が上昇することで円安に転じましたが、3月に入り、信用不安の拡大により米国金利が大きく低下したことやリスク回避による円買い需要の高まりなどから、円高となりました。4月以降は、経済指標の上振れなどを背景に米国金利が上昇するに連れて、米ドルなどの通貨は対円で上昇（円安）しました。

## ◆前成期末における「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

当成期のベンチマークの騰落率は21.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は22.3%となりました。

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。

年 月 日	基準価額	M S C Iコクサイ指数 (税引後配当込み、円ベース)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投 資 証 券 組入比率
		騰落率 (%)	ペ チ マー ク			
(期首) 2022年11月30日	43,159	—	41,586	—	89.7	8.1
12月末	40,510	△ 6.1	39,012	△ 6.2	91.3	6.4
2023年1月末	42,041	△ 2.6	40,506	△ 2.6	90.2	7.6
2月末	43,520	0.8	41,881	0.7	93.0	5.0
3月末	43,305	0.3	41,662	0.2	92.4	5.6
4月末	44,495	3.1	42,776	2.9	92.2	5.7
5月末	46,568	7.9	44,784	7.7	91.8	6.4
6月末	50,230	16.4	48,320	16.2	92.8	5.1
7月末	50,995	18.2	49,052	18.0	91.9	6.3
8月末	51,888	20.2	49,885	20.0	90.3	7.8
9月末	50,638	17.3	48,668	17.0	92.2	6.0
10月末	48,935	13.4	47,036	13.1	90.7	7.6
(期末) 2023年11月30日	52,771	22.3	50,700	21.9	89.9	8.2

(注1) 謄落率は期首比。

(注2) M S C Iコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）は、M S C I Inc.（「M S C I」）の承諾を得て、M S C Iコクサイ指数（税引後配当込み、米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンダード設定日を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。M S C Iコクサイ指数（税引後配当込み、米ドルベース）は、M S C I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M S C Iに帰属します。またM S C I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。本ファンダードは、M S C Iによって保証、推奨、または宣伝されるものではなく、M S C Iは本ファンダードまたは本ファンダードが基づいているインデックスに関する責任も負いません。免責事項全文についてはこちらをご覧ください。[<https://www.daiwa-am.co.jp/specialreport/globalmarket/notice.html>]

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

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

(注5) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

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

\*ベンチマークはMSCIコクサイ指数（税引後配当込み、円ベース）です。

### 《今後の運用方針》

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

### ■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション) (投資証券)	2円 ( 1) ( 1) ( 0)
有価証券取引税 (株式) (投資証券)	2 ( 2) ( 0)
その他費用 (保管費用) (その他)	8 ( 8) ( 0)
合計	12

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

### ■売買および取引の状況

#### (1) 株式

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
外	アメリカ 百株 26,739.9 ( 572.12)	千アメリカ・ドル 256,972 ( 5,151)	百株 3,369.84 ( 5,151)	千アメリカ・ドル 8,533
	カナダ 百株 2,442 ( 71.1)	千カナダ・ドル 13,997 ( 810)	百株 426	千カナダ・ドル 413
	オーストラリア 百株 5,460.54 ( 32.77)	千オーストラリア・ドル 10,750 ( —)	百株 1,113.97	千オーストラリア・ドル 1,263
国	香港 百株 6,507 ( —)	千香港・ドル 24,651 ( —)	百株 820	千香港・ドル 1,118
	シンガポール 百株 14,098 ( 12,844.22)	千シンガポール・ドル 2,839 ( 17)	百株 128	千シンガポール・ドル 167
	ニュージーランド 百株 569.72 ( —)	千ニュージーランド・ドル 749 ( —)	百株 —	千ニュージーランド・ドル —
	イギリス 百株 16,362.76 ( 306.04)	千イギリス・ポンド 11,511 ( 783)	百株 1,279.71	千イギリス・ポンド 1,136

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
外	イスラエル 百株 614.37 ( —)	千イスラエル・シェケル 2,513 ( —)	百株 1,069.08	千イスラエル・シェケル 1,390
	スイス 百株 1,315.43 ( 255.88)	千スイス・フラン 8,132 ( 122)	百株 2,620.45	千スイス・フラン 128
	デンマーク 百株 407.63 ( 823.58)	千デンマーク・クローネ 24,258 ( —)	百株 54.65	千デンマーク・クローネ 922
	ノルウェー 百株 536.85 ( —)	千ノルウェー・クローネ 9,041 ( 14)	百株 —	千ノルウェー・クローネ —
	スウェーデン 百株 3,298.61 ( 208.94)	千スウェーデン・クローネ 50,892 ( —)	百株 1,623.52	千スウェーデン・クローネ 16,537
	ユーロ (アイルランド) 百株 1,269.4 ( 339.42)	千ユーロ 1,294 ( 1,322)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (オランダ) 百株 1,481.07 ( 442.37)	千ユーロ 6,579 ( —)	百株 168.06	千ユーロ 986
	ユーロ (ベルギー) 百株 123.91 ( —)	千ユーロ 856 ( —)	百株 60.35	千ユーロ 60
	ユーロ (ルクセンブルク) 百株 101.76 ( —)	千ユーロ 136 ( —)	百株 435.51	千ユーロ 42
	ユーロ (フランス) 百株 1,410.96 ( —)	千ユーロ 9,797 ( △28)	百株 280.16	千ユーロ 362
国	ユーロ (ドイツ) 百株 1,683.23 ( —)	千ユーロ 8,104 ( 151)	百株 131.89	千ユーロ 153
	ユーロ (ポルトガル) 百株 435.19 ( —)	千ユーロ 248 ( —)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (スペイン) 百株 2,259.36 ( 5,532.2)	千ユーロ 2,243 ( 151)	百株 5,856.91	千ユーロ 981
	ユーロ (イタリア) 百株 2,379.1 ( —)	千ユーロ 1,342 ( 0)	百株 195.31	千ユーロ 448
	ユーロ (ワインランド) 百株 918.49 ( 215.14)	千ユーロ 1,169 ( —)	百株 215.14	千ユーロ 78
	ユーロ (オーストリア) 百株 55.35 ( —)	千ユーロ 209 ( —)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (その他) 百株 141.44 ( —)	千ユーロ 1,034 ( —)	百株 —	千ユーロ —
	ユーロ (ヨーロッパ) 百株 12,259.26 ( 5,850.29)	千ユーロ 33,017 ( 1,352)	百株 7,343.33	千ユーロ 3,112

(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らずません。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

(2) 投資証券

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

銘柄	口数	買付		売付	
		金額	千口	金額	千口
アメリカ					
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1.1	196		—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	2.2	258		—	—
BOSTON PROPERTIES INC	1	69		—	—
VORNADO REALTY TRUST	—	—		6.297	159
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.7	181		—	—
EQUITY RESIDENTIAL	2.6	165		—	—
EQUINIX INC	0.7	511		—	—
AMERICAN TOWER CORP	3.6	732		—	—
HOST HOTELS & RESORTS INC	5.4	94		—	—
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	2.7	89		—	—
KIMCO REALTY CORP	5	103		—	—
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	3	57		—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	1.7	85		—	—
INVITATION HOMES INC	4.4	145		—	—
VICI PROPERTIES INC	8.8	285		—	—
VENTAS INC	2.9	135		—	—
WEYERHAEUSER CO	4.6	147		—	—
NET LEASE OFFICE PROPERTIES	—	—		0.686	10
	( 0.686)	( —)			
CROWN CASTLE INTL CORP	3.1	388		—	—
IRON MOUNTAIN INC	2.3	129		—	—
SUN COMMUNITIES INC	1	138		—	—
PROLOGIS INC	6.5	805		—	—
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1.5	201		—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	1	110		—	—
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.4	90		—	—
WELLTOWER INC	5.2	390		—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	4.6	106		—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.8	124		—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1.4	94		—	—
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	6	122		—	—
REALTY INCOME CORP	7.7	469		—	—
PUBLIC STORAGE	1.2	349		—	—
REGENCY CENTERS CORP	1.8	112		—	—
UDR INC	2.2	91		—	—
WP CAREY INC	2.3	175		—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	2.3	260		—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	4.9	651		—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	3	35		27.2	224
	千口	千カナダ・ドル		千口	千カナダ・ドル
カナダ					
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.4	19		—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1.1	21		—	—
	千口	千オーストラリア・ドル		千口	千オーストラリア・ドル
オーストラリア					
DEXUS/AU	7.753	62		—	—
LENDLEASE GROUP	6.101	47		—	—

**外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)**

銘柄	買付 □ 数	金額	売付	
			□ 数	金額
TRANSURBAN GROUP APA GROUP SCENTRE GROUP GPT GROUP MIRVAC GROUP STOCKLAND GOODMAN GROUP VICINITY CENTRES	千口	千オーストラリア・ドル	千口	千オーストラリア・ドル
	19.259	270	—	—
	8.309	85	—	—
	32.277	93	—	—
	13.76	60	—	—
	28.18	63	—	—
	13.654	55	—	—
	10.959	224	—	—
香港 LINK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST LINK REIT HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS HKT TRUST AND HKT LTD-SS	千口	千香港・ドル	千口	千香港・ドル
	—	—	20.22	85
	( 20.22)	(△ 90)	—	—
	40.7	2,023	—	—
	( —)	( 90)	—	—
	—	—	107	536
	34	326	—	—
	—	—	—	—
シンガポール CAPITALAND ASCENDAS REIT CAPITALAND INTEGRATED COMMER MAPLETREE LOGISTICS TRUST KEPPEL REIT CAPITALAND ASCOTT STAPLED UNIT TRU MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS	千口	千シンガポール・ドル	千口	千シンガポール・ドル
	49.5	136	—	—
	( —)	(△ 3)	—	—
	56.6	113	—	—
	( —)	(△ 0)	—	—
	29.4	48	—	—
	( —)	(△ 4)	—	—
	—	—	15.14	11
イギリス LAND SECURITIES GROUP PLC SEGRO PLC BRITISH LAND CO PLC	( 15.14)	( 10)	—	—
	—	—	6.852	7
	( 6.852)	( 7)	—	—
	11.4	20	—	—
	( —)	(△ 0)	—	—
	—	—	—	—
	—	—	—	—
	—	—	—	—
ユーロ (ベルギー) WAREHOUSES DE PAUW SCA	千口	千ユーロ・ポンド	千口	千ユーリス・ポンド
	5.165	34	—	—
	6.908	56	—	—
	2.98	13	38.375	124
	—	—	—	—
	—	—	—	—
	—	—	—	—
	—	—	—	—
ユーロ (フランス) UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD GECINA SA KLEPIERRE COVIVIO	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	0.954	50	—	—
	0.347	36	—	—
	1.599	38	—	—
	( —)	(△ 7)	—	—
	0.399	18	—	—
	—	—	—	—
	—	—	—	—

(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) 金額の単位未満は切捨て。

# 外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

## (3) 先物取引の種類別取引状況

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外 国 株 式 株式先物取引	百万円 115,566	百万円 109,696	百万円 —	百万円 —

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■主要な売買銘柄

### 株式

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

銘柄	当期			銘柄	当期		
	買付	売付	平均単価		銘柄	売付	平均単価
APPLE INC (アメリカ)	90.4	2,087,159	23,088	JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	8.8	215,291	24,464
MICROSOFT CORP (アメリカ)	47.5	1,922,769	40,479	FERGUSON PLC (ジャージー)	8.777	131,432	14,974
AMAZON. COM INC (アメリカ)	67.9	1,069,788	15,755	KONINKLIJKE DSM NV (オランダ)	7.276	127,629	17,541
TESLA INC (アメリカ)	28.8	856,671	29,745	FERROVIAL SA (スペイン)	23.057	104,629	4,537
NVIDIA CORP (アメリカ)	15.9	729,013	45,849	ABIOMED INC (アメリカ)	2	101,117	50,558
ALPHABET INC-CL A (アメリカ)	38.5	607,588	15,781	SWEDISH MATCH AB (スウェーデン)	65.778	95,920	1,458
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B (アメリカ)	9.5	431,058	45,374	NEWCREST MINING LTD (オーストラリア)	40.32	89,555	2,221
UNITEDHEALTH GROUP INC (アメリカ)	6.2	430,394	69,418	BLACK KNIGHT INC (アメリカ)	7.65	86,679	11,330
JPMORGAN CHASE & CO (アメリカ)	19.8	391,454	19,770	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP (アメリカ)	9	70,363	7,818
JOHNSON & JOHNSON (アメリカ)	16.4	377,025	22,989	INVESTOR CLASS A (スウェーデン)	23.863	68,354	2,864

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

### (1) 外国株式

銘柄	期首		期末		業種等	
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	49	57	1,086	159,813	資本財・サービス	
PALO ALTO NETWORKS INC	123	148	4,275	628,851	情報技術	
FIRST SOLAR INC	—	49	761	112,009	情報技術	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	75	86	1,185	174,390	情報技術	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	54	62	771	113,495	資本財・サービス	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	26	31	354	52,093	ヘルスケア	
SYNCHRONY FINANCIAL	211	211	658	96,881	金融	
ABBOTT LABORATORIES	723.66	840.66	8,711	1,281,238	ヘルスケア	
HOWMET AEROSPACE INC	155.83	189.83	979	144,030	資本財・サービス	
VERISK ANALYTICS INC	65	71	1,691	248,790	資本財・サービス	
LAS VEGAS SANDS CORP	139	166	752	110,691	一般消費財・サービス	

## 外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘 柄	期 首	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
AMPHENOL CORP-CL A	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	247	288	2,597	381,967		情報技術	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	18	22	1,215	178,750		情報技術	
QORVO INC	253	287	1,669	245,572		金融	
AFLAC INC	44.2	48.2	462	67,974		情報技術	
DARDEN RESTAURANTS INC	253	278	2,269	333,748		金融	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	51	59	918	135,128		一般消費財・サービス	
ADOBE INC	71	79	660	97,130		コミュニケーション・サービス	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	195.2	220.2	13,594	1,999,406		情報技術	
LULULEMON ATHLETICA INC	86	94	702	103,338		素材	
GARMIN LTD	48	56	2,454	361,021		一般消費財・サービス	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	63	74	895	131,686		一般消費財・サービス	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	92	107	2,851	419,345		素材	
WR BERKLEY CORP	282	322	6,255	919,948		資本財・サービス	
AUTOZONE INC	86.42	101.42	715	105,261		金融	
DOLLAR TREE INC	8.2	9.2	2,388	351,319		一般消費財・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	92.71	102.71	1,244	182,958		生活必需品	
CELANESE CORP	478	583	564	83,083		ヘルスケア	
DR HORTON INC	44.5	49.5	680	100,055		素材	
DENTSPLY SIRONA INC	138.16	149.16	1,898	279,169		一般消費財・サービス	
AUTODESK INC	89	103	322	47,459		ヘルスケア	
MOODY'S CORP	90	103	2,202	323,944		情報技術	
DEVON ENERGY CORP	69	80	2,895	425,785		金融	
ALBEMARLE CORP	259	310	1,391	204,615		エネルギー	
ATMOS ENERGY CORP	48	57	703	103,429		素材	
ALLIANT ENERGY CORP	58	70	784	115,354		公益事業	
CITIGROUP INC	102	122	609	89,605		公益事業	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	804.73	941.73	4,308	633,638		金融	
AMERICAN ELECTRIC POWER	174	200	4,583	674,051		資本財・サービス	
DOMINO'S PIZZA INC	213	249	1,972	290,088		公益事業	
HESS CORP	15.3	17.3	672	98,938		一般消費財・サービス	
DAVITA INC	116	134	1,870	275,036		エネルギー	
DANAHER CORP	27.5	27.5	273	40,286		ヘルスケア	
FORTIVE CORP	286.5	339.5	7,554	1,111,048		ヘルスケア	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	141	171	1,157	170,283		資本財・サービス	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	231	271	3,053	449,136		金融	
BUNGE LTD	233	263	1,924	283,094		生活必需品	
TE CONNECTIVITY LTD	63	—	—	—		生活必需品	
APPLE INC	131.95	151.95	1,981	291,475		情報技術	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	6,700	7,604	143,996	21,177,631		情報技術	
BOEING CO/THE	116	124	1,102	162,105		金融	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	233	277	6,216	914,291		資本財・サービス	
BECTON DICKINSON AND CO	62.15	76.15	766	112,732		金融	
LEIDOS HOLDINGS INC	117.99	136.99	3,228	474,847		ヘルスケア	
NISOURCE INC	54	63	669	98,417		資本財・サービス	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	165	200	516	75,917		公益事業	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	53	55	448	65,980		資本財・サービス	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	317.71	375.71	1,786	262,740		金融	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,737.04	2,034.04	7,680	1,129,576		コミュニケーション・サービス	
ANSYS INC	532.5	627.5	22,507	3,310,221		金融	
TRUIST FINANCIAL CORP	36	42	1,255	184,604		情報技術	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	551.17	644.17	2,069	304,393		金融	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	290	342	3,808	560,168		金融	
	883	1,016	4,949	727,989		ヘルスケア	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘 柄	期 首	当 期 末				業種等
		株 数	株 数	評 価 額	業種等	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
JPMORGAN CHASE & CO	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
T ROWE PRICE GROUP INC	1,214.7	1,412.7	21,800	3,206,241	金融	
LNQ CORP	93	109	1,080	158,959	金融	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	111	129	572	84,216	一般消費財・サービス	
CADENCE DESIGN SYS INC	128.12	150.12	874	128,561	生活必需品	
AMERIPRIZE FINANCIAL INC	114	132	3,632	534,271	情報技術	
DOLLAR GENERAL CORP	45	50	1,741	256,159	金融	
SERVICENOW INC	94	106	1,366	200,916	生活必需品	
CATERPILLAR INC	83	99	6,721	988,517	情報技術	
BROWN & BROWN INC	221	249	6,211	913,496	資本財・サービス	
ESSENTIAL UTILITIES INC	97	117	853	125,560	金融	
CHARLES RIVER LABORATORIES	103	121	427	62,942	公益事業	
CMS ENERGY CORP	21	25	492	72,468	ヘルスケア	
MOSAIC CO/THE	120	141	800	117,681	公益事業	
DELTA AIR LINES INC	149	161	586	86,236	素材	
CORNING INC	62	78	285	42,031	資本財・サービス	
CISCO SYSTEMS INC	332	391	1,103	162,277	情報技術	
MORGAN STANLEY	1,713.5	1,970.5	9,468	1,392,495	情報技術	
DECKERS OUTDOOR CORP	541.52	605.52	4,756	699,517	金融	
MSCI INC	—	13	851	125,228	一般消費財・サービス	
FAIR ISAAC CORP	34	39	2,053	302,026	金融	
LENNOX INTERNATIONAL INC	11	12	1,290	189,737	情報技術	
MANHATTAN ASSOCIATES INC	13	15	601	88,495	資本財・サービス	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	—	32	715	105,236	情報技術	
BROADCOM INC	94	108	604	88,947	資本財・サービス	
UNITED THERAPEUTICS CORP	167.12	199.12	18,733	2,755,180	情報技術	
DICK'S SPORTING GOODS INC	—	23	533	78,500	ヘルスケア	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	50	60	396	58,334	一般消費財・サービス	
ARAMARK	96	120	984	144,725	ヘルスケア	
DTE ENERGY COMPANY	79	100	333	49,027	一般消費財・サービス	
CENTENE CORP	242.07	265.07	1,041	153,158	公益事業	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	242.07	265.07	1,868	274,758	ヘルスケア	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	44	51	915	134,635	金融	
DARLING INGREDIENTS INC	202	234	637	93,744	金融	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	75	312	45,929	生活必需品	
GARTNER INC	87	104	2,548	374,764	金融	
SPLUNK INC	33.5	38.5	1,655	243,542	情報技術	
DOMINION ENERGY INC	335.41	404.41	1,889	277,934	情報技術	
MONSTER BEVERAGE CORP	164	380	2,078	305,755	公益事業	
SMITH (A.O.) CORP	53	60	450	66,269	生活必需品	
DEERE & CO	120	135	4,913	722,582	資本財・サービス	
QUANTA SERVICES INC	60	70	1,299	191,083	資本財・サービス	
POOL CORP	17	19	656	96,493	一般消費財・サービス	
GLOBAL PAYMENTS INC	116.84	126.84	1,475	217,062	金融	
VMWARE INC-CLASS A	87	—	—	—	情報技術	
CABLE ONE INC	2	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
BURLINGTON STORES INC	27	31	531	78,198	一般消費財・サービス	
NASDAQ INC	143	166	924	135,983	金融	
VAIL RESORTS INC	17	19	408	60,139	エネルギー	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	209	—	—	—	エネルギー	
TARGA RESOURCES CORP	90	104	915	134,613	コムニケーション・サービス	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	30	34	376	55,439	金融	
WESTLAKE CORP	16	18	231	34,088	素材	

**外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)**

銘 柄	期 首	当 期 末				業種等	
		株 数	株 数	評 価 額	外貨建金額 邦貨換算金額		
				千アメリカ・ドル	千円		
CONSOLIDATED EDISON INC		百株	百株				
	147	147	168	1,510	222,221	公益事業	
COGNEX CORP		69	84	315	46,462	情報技術	
WEBSTER FINANCIAL CORP		73	85	378	55,679	金融	
TELEFLEX INC		19	23	508	74,840	ヘルスケア	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		35	40	728	107,096	資本財・サービス	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES		31	36	1,256	184,736	ヘルスケア	
BIO-RAD LABORATORIES-A		9	11	334	49,259	ヘルスケア	
CATALENT INC		69	87	344	50,630	ヘルスケア	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A		58	70	1,213	178,472	ヘルスケア	
MOLINA HEALTHCARE INC		24	28	982	144,466	ヘルスケア	
CARLISLE COS INC		22	25	687	101,151	資本財・サービス	
IDEX CORP		31	37	733	107,906	資本財・サービス	
COLGATE-PALMOLIVE CO		329	381	2,967	436,390	生活必需品	
ROLLINS INC	92.07		116.07	466	68,605	資本財・サービス	
AECOM		—	64	561	82,641	資本財・サービス	
WATSCO INC		—	16	608	89,524	資本財・サービス	
GRACO INC		—	80	640	94,242	資本財・サービス	
AMETEK INC		96	112	1,712	251,821	資本財・サービス	
TORO CO		—	49	404	59,460	資本財・サービス	
CHURCH & DWIGHT CO INC		100	118	1,116	164,275	生活必需品	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION		64.5	78.5	417	61,454	資本財・サービス	
HEICO CORP		18	21	354	52,124	資本財・サービス	
GENERAC HOLDINGS INC		26	30	346	51,003	資本財・サービス	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC		16	18	817	120,288	金融	
LYONDELLBASELL INDU-CL A		108	126	1,184	174,189	素材	
TYLER TECHNOLOGIES INC		17	20	814	119,806	情報技術	
COSTCO WHOLESALE CORP	182.6		213.6	12,556	1,846,712	生活必需品	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	32.5	—	—	—	—	情報技術	
EPAM SYSTEMS INC	24		28	733	107,882	情報技術	
RPM INTERNATIONAL INC	53		62	627	92,332	素材	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	—		28	756	111,287	素材	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	12	13	—	2,845	418,538	一般消費財・サービス	
UGI CORP	85	—	—	—	—	公益事業	
CUMMINS INC	58		68	1,522	223,967	資本財・サービス	
ACTIVISION BLIZZARD INC	323	—	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
CDW CORP/DE	56		65	1,378	202,748	情報技術	
SIGNATURE BANK	26.5	—	—	—	—	金融	
COSTAR GROUP INC	164		198	1,662	244,432	不動産	
SVB FINANCIAL GROUP	24	—	—	—	—	金融	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	40		48	1,842	271,015	資本財・サービス	
MERCADOLIBRE INC	18.9		21.9	3,527	518,740	一般消費財・サービス	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	30		35	546	80,305	金融	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	115.16		128.16	2,135	314,128	一般消費財・サービス	
DEXCOM INC	162		187	2,172	319,519	ヘルスケア	
NORDSON CORP	20.9		24.9	579	85,179	資本財・サービス	
COPART INC	174		415	2,084	306,512	資本財・サービス	
DIAMONDBACK ENERGY INC	70		83	1,276	187,728	エネルギー	
SEAGEN INC	57		68	1,451	213,536	ヘルスケア	
ALIGN TECHNOLOGY INC	31		35	757	111,431	ヘルスケア	
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	33		38	823	121,173	金融	
TRANSDIGM GROUP INC	20.9		26.9	2,563	376,953	資本財・サービス	
BIO-TECHNE CORP	15.8		76.2	480	70,736	ヘルスケア	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	39		46	522	76,812	ヘルスケア	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘 柄	期 首	当 期 末				業種等	
		株 数	株 数	評 価 額	千円		
				外貨建金額			
HORIZON THERAPEUTICS PLC	百株	百株	千アメリカ・ドル	—	—	ヘルスケア	
KINDER MORGAN INC	90	—	—	—	—	エネルギー	
HCA HEALTHCARE INC	843.81	974.81	1,688	248,308	373,648	ヘルスケア	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	98	102	2,540	62,763	62,763	金融	
COTERRA ENERGY INC	16	18	426	140,436	140,436	エネルギー	
T-MOBILE US INC	330	366	954	572,446	572,446	コミュニケーション・サービス	
ZILLOW GROUP INC - C	259.27	260.27	3,892	46,335	46,335	不動産	
COCA-COLA CO/THE	67.5	74.5	315	1,702,072	1,702,072	生活必需品	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	1,704.5	1,987.5	11,573	93,946	93,946	生活必需品	
EXPEDITORS INTL WASH INC	88	107	638	129,196	129,196	資本財・サービス	
FRANKLIN RESOURCES INC	69.5	73.5	878	50,630	50,630	金融	
CSX CORP	124	140	344	462,453	462,453	資本財・サービス	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	899	991	3,144	290,566	290,566	資本財・サービス	
EXPEDIA GROUP INC	38	43	920	135,390	135,390	ヘルスケア	
AMAZON.COM INC	63.25	68.25	926	136,259	136,259	一般消費財・サービス	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	3,788	4,467	65,361	9,612,663	9,612,663	一般消費財・サービス	
EXXON MOBIL CORP	257	293	1,975	2,942,573	2,942,573	エネルギー	
AES CORP	1,742.05	1,955.05	20,007	82,054	82,054	公益事業	
EVEREST GROUP LTD	271	324	557	124,261	124,261	金融	
EOG RESOURCES INC	16	21	844	512,934	512,934	エネルギー	
EQT CORP	242	283	3,487	102,305	102,305	エネルギー	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	141	175	695	124,216	124,216	情報技術	
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	65	73	844	243,550	243,550	ヘルスケア	
ABIOMED INC	5	5	721	268,334	268,334	ヘルスケア	
CENCORA INC	19	—	—	—	—	ヘルスケア	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	65	83	1,656	296,111	296,111	一般消費財・サービス	
FORD MOTOR CO	1,634.23	1,901.23	2,013	83,244	83,244	ヘルスケア	
EXACT SCIENCES CORP	71	87	566	110,666	110,666	コミュニケーション・サービス	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	62.37	—	—	254,619	254,619	情報技術	
ENTEGRIS INC	62	72	752	80,173	80,173	資本財・サービス	
AERCAP HOLDINGS NV	56	82	545	126,957	126,957	情報技術	
FORTINET INC	282	323	1,731	840,104	840,104	公益事業	
MARKE CORP	28	6.1	863	—	—	ヘルスケア	
NEXTERA ENERGY INC	812.8	978.8	5,712	105,754	105,754	素材	
MASIMO CORP	22	—	—	242,086	242,086	ヘルスケア	
FREEPORT-MCMORAN INC	599.08	693.08	2,576	411,831	411,831	金融	
INSULTE CORP	29	34	642	231,124	231,124	資本財・サービス	
US BANCORP	584	741	2,800	72,526	72,526	情報技術	
UNITED RENTALS INC	30	33	1,571	105,754	105,754	情報技術	
F5 NETWORKS INC	25	29	493	567,572	567,572	情報技術	
SUPER MICRO COMPUTER INC	—	25	719	50,160	50,160	情報技術	
FASTENAL CO	238	276	1,646	312,770	312,770	資本財・サービス	
FISERV INC	254.33	298.33	3,859	406,880	406,880	一般消費財・サービス	
GENERAL ELECTRIC CO	455.06	527.06	6,264	808,178	808,178	資本財・サービス	
AXON ENTERPRISE INC	—	34	767	47,813	47,813	資本財・サービス	
PAYLOCITY HOLDING CORP	—	22	341	5,703,760	5,703,760	金融	
GENERAL MOTORS CO	573	673	2,126	5,124,215	5,124,215	金融	
GENERAL DYNAMICS CORP	98	113	2,766	86,803	86,803	コミュニケーション・サービス	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	142.5	161.5	5,495	—	—	資本財・サービス	
FIRST HORIZON CORP	—	257	325	—	—	金融	
ALPHABET INC-CL A	2,488	2,873	38,782	—	—	コミュニケーション・サービス	
ALPHABET INC-CL C	2,333.4	2,554.4	34,842	—	—	コミュニケーション・サービス	
OWENS CORNING	39	44	590	—	—	資本財・サービス	

**外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)**

銘 柄	期 首	当 期 末				業種等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
GENERAL MILLS INC	百株 249	百株 283	千アメリカ・ドル 1,771	260,504	千円	生活必需品	
FIRSTENERGY CORP	224.18	263.18	973	143,134		公益事業	
GENUINE PARTS CO	59.5	68.5	916	134,854		一般消費財・サービス	
FIFTH THIRD BANCORP	284	330	937	137,882		金融	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	80.5	92.5	1,745	256,652		資本財・サービス	
HALLIBURTON CO	373	436	1,626	239,176		エネルギー	
REPLIGEN CORP	—	26	414	60,986		ヘルスケア	
HOME DEPOT INC	425.5	486.5	15,131	2,225,334		一般消費財・サービス	
ASSURANT INC	22.5	26.5	434	63,838		金融	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	595	698	776	114,254		金融	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	17.1	19.1	446	65,661		資本財・サービス	
HERSHEY CO/THE	60	71	1,318	193,928		生活必需品	
HUMANA INC	52	60	2,894	425,688		ヘルスケア	
NXP SEMICONDUCTORS NV	109	126	2,574	378,640		情報技術	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	33.2	—	—	—		情報技術	
HENRY SCHEIN INC	56	63	419	61,763		ヘルスケア	
HP INC	473	473	1,375	202,222		情報技術	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	538	625	1,032	151,849		情報技術	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	68.28	—	—	—		コミュニケーション・サービス	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	79	—	—	—		コミュニケーション・サービス	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	29.5	—	—	—		コミュニケーション・サービス	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	154	180	1,482	218,081		金融	
KRAFT HEINZ CO/THE	304.03	418.03	1,466	215,670		生活必需品	
ENPHASE ENERGY INC	56	66	666	97,998		情報技術	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	372	439	6,866	1,009,841		情報技術	
HUBBELL INC	—	26	766	112,672		資本財・サービス	
INTERNATIONAL PAPER CO	143	160	572	84,218		素材	
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC	52	61	415	61,040		資本財・サービス	
ZOETIS INC	195	224	3,937	579,116		ヘルスケア	
TRANTE TECHNOLOGIES PLC	96.99	109.99	2,448	360,131		資本財・サービス	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	—	68	401	59,064		情報技術	
CHENIERE ENERGY INC	95	117	2,111	310,486		エネルギー	
HYATT HOTELS CORP - CL A	—	23	261	38,497		一般消費財・サービス	
ALLEGION PLC	36.5	43.5	454	66,911		資本財・サービス	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	—	68	917	134,900		資本財・サービス	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	129.73	—	—	—		コミュニケーション・サービス	
WASTE CONNECTIONS INC	106.37	125.37	1,662	244,563		資本財・サービス	
JUNIPER NETWORKS INC	134	156	437	64,331		情報技術	
JM SMUCKER CO/THE	44	50	542	79,844		生活必需品	
JOHNSON & JOHNSON	1,089	1,165	17,720	2,606,200		ヘルスケア	
PLUG POWER INC	211	—	—	—		資本財・サービス	
ABBVIE INC	730.72	852.72	11,810	1,736,921		ヘルスケア	
HOLOGIC INC	101	119	840	123,559		ヘルスケア	
KIMBERLY-CLARK CORP	139	163	1,984	291,912		生活必需品	
KROGER CO	286	330	1,440	211,798		生活必需品	
KLA CORP	62	66	3,590	528,108		情報技術	
LOCKHEED MARTIN CORP	99	110	4,895	719,923		資本財・サービス	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	31	34	806	118,624		金融	
BATH AND BODY WORKS INC WHEN ISSUE	105	105	336	49,492		一般消費財・サービス	
LOWE'S COS INC	272	283	5,657	832,083		一般消費財・サービス	
ELI LILLY & CO	333.85	389.85	23,073	3,393,443		ヘルスケア	
LAM RESEARCH CORP	56.8	64.8	4,626	680,442		情報技術	
LOEWS CORP	86	94	643	94,712		金融	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘 柄	期 首	当 期 末				業種等	
		株 数	株 数	評 価 額	外貨建金額 邦貨換算金額		
				千アメリカ・ドル	千円		
LINCOLN NATIONAL CORP	百株 66.49	百株 —	—	—	—	金融	
MCDONALD'S CORP	306.5	353.5	9,911	1,457,674	一般消費財・サービス		
3M CO	234.9	266.9	2,628	386,524	資本財・サービス		
META PLATFORMS INC CLASS A	948	1,070	35,545	5,227,661	コミュニケーション・サービス		
S&P GLOBAL INC	144.39	159.39	6,608	971,977	金融		
MARTIN MARIETTA MATERIALS	26	30	1,388	204,161	素材		
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	23.2	27.2	213	31,422	情報技術		
ALCOA CORP	77	—	—	—	素材		
PHILLIPS 66	199	222	2,713	399,042	エネルギー		
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	—	73	1,427	209,944	情報技術		
MGM RESORTS INTERNATIONAL	160.5	160.5	632	93,073	一般消費財・サービス		
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	104	121	777	114,389	生活必需品		
METLIFE INC	284	315	1,989	292,601	金融		
MARVELL TECHNOLOGY INC	352	416	2,333	343,226	情報技術		
ARISTA NETWORKS INC	102	127	2,785	409,606	情報技術		
MOTOROLA SOLUTIONS INC	68.98	80.98	2,583	379,967	情報技術		
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	9	11	1,201	176,730	ヘルスケア		
BAKER HUGHES CO	408.23	490.23	1,634	240,375	エネルギー		
ROCKWELL AUTOMATION INC	48	56	1,515	222,831	資本財・サービス		
MERCK & CO. INC.	1,046.21	1,227.21	12,410	1,825,252	ヘルスケア		
DUPONT DE NEMOURS INC	207.51	225.51	1,611	236,936	素材		
MASCO CORP	98	109	658	96,776	資本財・サービス		
M & T BANK CORP	73.99	79.99	1,021	150,263	金融		
MARSH & MCLENNAN COS	207.7	238.7	4,686	689,228	金融		
BLACK KNIGHT INC	63.5	—	—	—	情報技術		
HEICO CORP-CLASS A	30.2	36.2	492	72,400	資本財・サービス		
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	115.02	124.02	2,511	369,315	一般消費財・サービス		
WORKDAY INC-CLASS A	82	100	2,634	387,514	情報技術		
WAYFAIR INC- CLASS A	29	—	—	—	一般消費財・サービス		
BLOCK INC CLASS A	215.12	263.12	1,676	246,616	金融		
TRANSUNION	80	93	546	80,410	資本財・サービス		
VISTRA CORP	176	176	614	90,388	公益事業		
NOVOCURE LTD	38.5	—	—	—	ヘルスケア		
NETAPP INC	92	103	922	135,637	情報技術		
NIKE INC -CL B	525	596	6,578	967,434	一般消費財・サービス		
NORFOLK SOUTHERN CORP	99	110	2,365	347,949	資本財・サービス		
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	229	263	2,182	320,961	情報技術		
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	81.05	96.05	996	146,558	金融		
ALLY FINANCIAL INC	142	142	406	59,811	金融		
NORTHROP GRUMMAN CORP	61	70	3,271	481,193	資本財・サービス		
APTV PLC	112	137	1,127	165,762	一般消費財・サービス		
NEWMONT CORP	328.11	384.11	1,551	228,110	素材		
MCKESSON CORP	61	65	2,968	436,584	ヘルスケア		
XYLEM INC	73	116	1,200	176,572	資本財・サービス		
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	641	751	7,033	1,034,360	生活必需品		
NUCOR CORP	111	122	1,998	293,862	素材		
WESTERN UNION CO	152.46	—	—	—	金融		
GODADDY INC - CLASS A	68	70	685	100,807	情報技術		
NEWELL BRANDS INC	164.42	—	—	—	一般消費財・サービス		
ENERGY INC	93.5	111.5	564	83,041	公益事業		
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	388.24	335.24	2,022	297,449	エネルギー		
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	11.5	12.5	358	52,755	金融		
OKTA INC	62	75	530	78,061	情報技術		

**外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)**

銘 柄	期 首	当 期 末				業種等	
		株 数	株 数	評 価 額	外貨建金額 邦貨換算金額		
				千アメリカ・ドル	千円		
COUPA SOFTWARE INC		百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
LIBERTY BROADBAND-C	29	—	—	—	—	情報技術	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	56	58	477	70,296	—	コミュニケーション・サービス	
LINDE PLC	173.05	—	—	—	—	ヘルスケア	
WIX.COM LTD	208.46	—	—	—	—	素材	
EQUITABLE HOLDINGS INC	23.1	28.1	286	42,198	—	情報技術	
KKR & CO INC	158	168	503	74,024	—	金融	
PAYCHEX INC	233	292	2,182	320,966	—	金融	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	134	157	1,902	279,735	—	資本財・サービス	
ALTRIA GROUP INC	27	29	2,824	415,388	—	一般消費財・サービス	
P.G & E CORP	749	863	3,603	530,023	—	生活必需品	
PFIZER INC	617	920	1,579	232,317	—	公益事業	
CIGNA CORP	2,321.13	2,731.13	8,215	1,208,215	—	ヘルスケア	
DELL TECHNOLOGIES -C	131	143	3,759	552,842	—	ヘルスケア	
XCEL ENERGY INC	118.01	124.01	930	136,895	—	情報技術	
STERIS PLC	225	266	1,596	234,723	—	公益事業	
SEA LTD-ADR	41	48	947	139,380	—	ヘルスケア	
FOX CORP - CLASS B	155	190	698	102,663	—	コミュニケーション・サービス	
FOX CORP - CLASS A	60.33	65.33	180	26,604	—	コミュニケーション・サービス	
STRYKER CORP	127.99	136.99	405	59,595	—	コミュニケーション・サービス	
LYFT INC-A	140.8	164.8	4,851	713,468	—	ヘルスケア	
DOW INC	125	—	—	—	—	資本財・サービス	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	301.18	342.18	1,756	258,315	—	素材	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	45	53	503	74,057	—	金融	
PARKER HANNIFIN CORP	94	115	781	114,924	—	情報技術	
UBER TECHNOLOGIES INC	53	62	2,653	390,319	—	資本財・サービス	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	609	881	4,968	730,767	—	資本財・サービス	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	95	113	2,597	382,035	—	エネルギー	
EXELON CORP	992.67	1,139.67	17,223	2,533,109	—	生活必需品	
TELADOC HEALTH INC	405.22	481.22	1,847	271,697	—	公益事業	
INGERSOLL-RAND INC	65	—	—	—	—	ヘルスケア	
NVR INC	168.08	196.08	1,364	200,708	—	資本財・サービス	
CONOCOPHILLIPS	1.3	1.6	977	143,707	—	一般消費財・サービス	
TWILIO INC - A	535.02	585.02	427	80,723	—	情報技術	
DOCSIGN INC	70	83	453	62,868	—	情報技術	
PAYCOM SOFTWARE INC	83	98	490	66,655	—	資本財・サービス	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	21	25	1,429	72,185	—	資本財・サービス	
PEPSICO INC	57	71	645	11,132	1,637,309	生活必需品	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	572	666	1,563	210,270	—	情報技術	
DROBOX INC-CLASS A	18.2	22.2	442	65,057	—	情報技術	
MONGODB INC	121	126	353	52,034	—	情報技術	
SNAP INC - A	28	34	1,429	94,875	—	情報技術	
CORTEVA INC	458	497	645	94,875	—	コミュニケーション・サービス	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	298.68	343.68	1,563	229,979	—	素材	
AMCOR PLC	155	176	1,700	250,042	—	金融	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	614	711	674	99,233	—	素材	
ROKU INC	84	108	2,531	372,374	—	情報技術	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	48	60	640	94,198	—	コミュニケーション・サービス	
ACCENTURE PLC-CL A	75	94	1,233	181,406	—	公益事業	
PENTAIR PLC	262	305	10,166	1,495,241	—	情報技術	
QUALCOMM INC	66.75	79.75	508	74,736	—	資本財・サービス	
INVESCO LTD	463	539	6,894	1,013,951	—	情報技術	
ADVANCE AUTO PARTS INC	141	167	238	35,072	—	金融	
	25.5	—	—	—	—	一般消費財・サービス	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘 柄	期 首	当 期 末				業種等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
DATADOG INC - CLASS A	106	118	875	128,716		金融	
PINTEREST INC- CLASS A	100	122	1,423	209,299		情報技術	
REGENERON PHARMACEUTICALS	238	287	955	140,471		コミュニケーション・サービス	
REPUBLIC SERVICES INC	45	52	4,204	618,380		ヘルスケア	
BOOKING HOLDINGS INC	91	107	1,711	251,673		資本財・サービス	
ROSS STORES INC	17	18	5,627	827,610		一般消費財・サービス	
PACKAGING CORP OF AMERICA	145	165	2,131	313,523		一般消費財・サービス	
RESMED INC	38.3	43.3	700	103,068		素材	
QUEST DIAGNOSTICS INC	61	71	1,127	165,870		ヘルスケア	
ROBERT HALF INTL INC	49.3	54.3	734	108,025		ヘルスケア	
MODERNA INC	45	52	418	61,563		資本財・サービス	
HUBSPOT INC	139	157	1,240	182,434		ヘルスケア	
REVIVITY INC	18.8	22.8	1,132	166,492		情報技術	
CARRIER GLOBAL CORP	51	61	545	80,212		ヘルスケア	
OTIS WORLDWIDE CORP	350.87	403.87	2,108	310,112		資本財・サービス	
BILL HOLDINGS INC	175.38	200.38	1,689	248,519		資本財・サービス	
AVANTOR INC	39	45	305	44,963		情報技術	
CARLYLE GROUP INC/THE	248	327	682	100,319		金融	
DYNATRACE INC	80	102	352	51,783		情報技術	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	81	122	651	95,866		情報技術	
REGIONS FINANCIAL CORP	183	215	1,512	222,510		コミュニケーション・サービス	
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	386.85	453.85	747	109,933		金融	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	110	132	187	27,605		コミュニケーション・サービス	
IAC/INTERACTIVECORP	144	184	494	72,793		ヘルスケア	
MATCH GROUP INC	32.3	—	—	—		コミュニケーション・サービス	
CHEVRON CORP	116	135	438	64,487		コミュニケーション・サービス	
ZSCALER INC	772.18	878.18	12,637	1,858,654		エネルギー	
EDISON INTERNATIONAL	35	42	839	123,439		情報技術	
ETSY INC	158	185	1,216	178,973		公益事業	
TESLA INC	52	60	463	68,122		一般消費財・サービス	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	1,091.5	1,379.5	33,679	4,953,187		一般消費財・サービス	
GEN DIGITAL INC	92	126	2,209	324,882		情報技術	
UNITY SOFTWARE INC	236	279	607	89,327		情報技術	
STANLEY BLACK & DECKER INC	79	113	343	50,455		情報技術	
SYNOPSYS INC	66.02	74.02	676	99,564		資本財・サービス	
CHEWY INC - CLASS A	63	74	4,088	601,252		情報技術	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	39.5	57.5	101	14,993		一般消費財・サービス	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	105	133	1,041	153,176		情報技術	
VIATRIS INC	49.05	50.05	1,996	293,624		コミュニケーション・サービス	
DOORDASH INC - A	490.21	580.21	529	77,907		ヘルスケア	
ROBLOX CORP -CLASS A	78.5	122.5	1,163	171,080		一般消費財・サービス	
AIRBNB INC-CLASS A	146	203	785	115,479		コミュニケーション・サービス	
CBRE GROUP INC - A	156	199	2,516	370,168		一般消費財・サービス	
SOUTHERN CO/THE	136	150	1,190	175,116		不動産	
SYSCO CORP	440	527	3,701	544,323		公益事業	
TRAVELERS COS INC/THE	211	245	1,756	258,386		生活必需品	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	99.03	112.03	1,987	292,354		金融	
SEI INVESTMENTS COMPANY	25	29	158	23,261		金融	
STEEL DYNAMICS INC	46	53	306	45,115		金融	
SCHLUMBERGER LTD	78.5	81.5	941	138,428		素材	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	584.52	689.52	3,576	526,001		エネルギー	
AFFIRM HOLDINGS INC	62	74	239	35,228		資本財・サービス	
	77	—	—	—		金融	

**外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)**

銘 柄	期 首	当 期 末				業種等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
AT&T INC	百株	2,961.91	3,458.91	千アメリカ・ドル	829,184	コミュニケーション・サービス	
APA CORP		144	149		79,567	エネルギー	
SOUTHWEST AIRLINES CO		60.5	69.5		25,890	資本財・サービス	
ON SEMICONDUCTOR CORP		180	209	1,496	220,142	情報技術	
CAESARS ENTERTAINMENT INC		87	104	468	68,874	一般消費財・サービス	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE		102	119	3,257	479,046	素材	
SEMPRA ENERGY		130	304	2,217	326,154	公益事業	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B		78	105	552	81,273	情報技術	
CLARIVATE PLC		134	175	134	19,817	資本財・サービス	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A		685	877	1,739	255,897	情報技術	
UIPATH INC - CLASS A	—	—	175	347	51,139	情報技術	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	84.5	88.5	694	102,147	情報技術		
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	49	81	1,035	152,267	金融		
TEXAS INSTRUMENTS INC	381	439	6,725	989,116	情報技術		
SALESFORCE.COM INC	410.66	469.66	10,818	1,591,094	情報技術		
WESTROCK CO	107	124	497	73,129	素材		
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC CLASS	166.09	192.09	1,772	260,668	金融		
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	288.34	332.34	1,753	257,876	資本財・サービス		
TERADYNE INC	66	75	695	102,316	情報技術		
UNION PACIFIC CORP	259.8	294.8	6,528	960,210	資本財・サービス		
MARATHON OIL CORP	299	299	756	111,254	エネルギー		
MARATHON PETROLEUM CORP	239.88	221.88	3,270	481,059	エネルギー		
RTX CORP	614.79	706.79	5,721	841,455	資本財・サービス		
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	304	351	5,345	786,144	資本財・サービス		
IQVIA HOLDINGS INC	78.04	90.04	1,925	283,131	ヘルスケア		
AMEREN CORPORATION	107	127	977	143,801	公益事業		
UNITEDHEALTH GROUP INC	387.66	449.66	24,055	3,537,902	ヘルスケア		
APPLOVIN CORP CLASS A	49	—	—	—	情報技術		
TOAST INC CLASS A	—	144	219	32,338	金融		
VERISIGN INC	41	45	952	140,106	情報技術		
LUCID GROUP INC	168	449	195	28,791	一般消費財・サービス		
RIVIAN AUTOMOTIVE INC CLASS A (PRO	132	309	535	78,710	一般消費財・サービス		
ROBINHOOD MARKETS INC CLASS A (PRO	—	222	198	29,123	金融		
VALERO ENERGY CORP	169.42	176.42	2,189	321,939	エネルギー		
ULTA BEAUTY INC	22	24	1,008	148,250	一般消費財・サービス		
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	108.88	124.88	554	81,527	金融		
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	28.3	31.3	424	62,489	ヘルスケア		
ELEVANCE HEALTH INC	100	115	5,351	787,065	ヘルスケア		
WALT DISNEY CO/THE	752.62	883.62	8,173	1,202,074	コミュニケーション・サービス		
WELLS FARGO & CO	1,567.22	1,771.22	7,754	1,140,439	金融		
WASTE MANAGEMENT INC	172	197	3,343	491,784	資本財・サービス		
WILLIAMS COS INC	504	589	2,146	315,658	エネルギー		
TRACTOR SUPPLY COMPANY	46	53	1,061	156,042	一般消費財・サービス		
WHIRLPOOL CORP	24	27	296	43,532	一般消費財・サービス		
WALMART INC	626	716	11,175	1,643,555	生活必需品		
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	87	101	1,150	169,217	ヘルスケア		
WYNN RESORTS LTD	45	50	418	61,526	一般消費財・サービス		
GRAB HOLDINGS CORP CLASS A	559	974	299	44,119	資本財・サービス		
WABTEC CORP	71.11	87.11	1,003	147,585	資本財・サービス		
TJX COMPANIES INC	484	556	4,898	720,401	一般消費財・サービス		
WATERS CORP	25	29	811	119,309	ヘルスケア		
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	22	25	591	86,999	情報技術		
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	304	355	709	104,315	生活必需品		

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘 柄	期 首	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	千アメリカ・ドル	千円		
WILLIS TOWERS WATSON PLC	48.63	50.63	1,219	179,281		金融	
WESTERN DIGITAL CORP	127	155	733	107,869		情報技術	
WEC ENERGY GROUP INC	130	153	1,269	186,696		公益事業	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	204	241	1,525	224,324		公益事業	
VISA INC-CLASS A SHARES	681.5	782.5	19,893	2,925,736		金融	
PPL CORP	304	357	929	136,667		公益事業	
CONSTELLATION ENERGY CORP WHEN ISS	135.24	157.24	1,895	278,844		公益事業	
PULTEGROUP INC	98.5	108.5	954	140,438		一般消費財・サービス	
WARNER BROS. DISCOVERY INC SERIES	954.53	1,118.53	1,205	177,333		コミュニケーション・サービス	
PPG INDUSTRIES INC	98	114	1,590	233,969		素材	
NORTHERN TRUST CORP	82	101	790	116,277		金融	
FERGUSON PLC	—	99	1,669	245,596		資本財・サービス	
NVIDIA CORP	1,035.8	1,194.8	57,517	8,459,124		情報技術	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	171.13	193.13	2,556	376,007		金融	
DRAFTKINGS INC CLASS A	—	216	826	121,572		一般消費財・サービス	
ASPEN TECHNOLOGY CORP	—	14	261	38,416		情報技術	
ZIM INTEGRATED SHIPPING SERVICES L	35	—	—	—		資本財・サービス	
TYSON FOODS INC-CL A	121	138	649	95,572		生活必需品	
NETFLIX INC	183.9	214.9	10,254	1,508,175		コミュニケーション・サービス	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	162	187	9,217	1,355,633		ヘルスケア	
NRG ENERGY INC	98.5	111.5	522	76,826		公益事業	
GLOBE LIFE INC	38.55	42.55	511	75,256		金融	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	74	—	—	—		金融	
TEXTRON INC	89	98	733	107,851		資本財・サービス	
NEWS CORP - CLASS A	152.87	178.87	399	58,768		コミュニケーション・サービス	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	2.5	3.5	578	85,039		エネルギー	
OMNICOM GROUP	83	97	773	113,826		コミュニケーション・サービス	
JACOBS SOLUTIONS INC	52.2	61.2	772	113,588		資本財・サービス	
AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC CLA	209	—	—	—		コミュニケーション・サービス	
ORACLE CORP	662.33	788.33	9,161	1,347,335		情報技術	
MASTERCARD INC - A	359	409	16,761	2,465,134		金融	
ONEOK INC	185	216	1,455	214,078		エネルギー	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	373.52	—	—	—		コミュニケーション・サービス	
ROPER TECHNOLOGIES INC	44	52	2,734	402,135		情報技術	
U HAUL NON VOTING SERIES N	36	46	246	36,295		資本財・サービス	
ARES MANAGEMENT CORP CLASS A	—	78	866	127,505		金融	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	—	55	438	64,520		エネルギー	
HF SINCLAIR CORP	—	73	384	56,611		エネルギー	
OVINTIV INC	—	121	531	78,157		エネルギー	
YUMI BRANDS INC	117	136	1,707	251,059		一般消費財・サービス	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	66	82	1,287	189,349		コミュニケーション・サービス	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	74	92	552	81,317		生活必需品	
BANK OF AMERICA CORP	2,999.01	3,468.01	10,511	1,545,931		金融	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	19	23	917	134,999		情報技術	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	77	91	816	120,102		ヘルスケア	
AMERICAN EXPRESS CO	265	306	5,123	753,492		金融	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES	—	200.35	1,356	199,510		ヘルスケア	
LINDE PLC	—	237.46	9,768	1,436,707		素材	
ANALOG DEVICES INC	214.91	241.91	4,419	650,040		情報技術	
ALBERTSONS COMPANY INC CLASS A	—	154	328	48,241		生活必需品	
MONDAYCOM LTD	—	11	192	28,310		情報技術	
ADVANCED MICRO DEVICES	670.27	779.27	9,651	1,419,410		情報技術	
LIBERTY MEDIA LIBERTY SIRIUSXM COR	—	80.28	216	31,807		コミュニケーション・サービス	

## 外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首 株 数	当期 株 数			業種等	
		期末				
		評価額	外貨建金額	邦貨換算金額		
LIBERTY MEDIA FORMULA ONE CORP SER	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
CONFLUENT INC CLASS A	—	96	608	89,484	コミュニケーション・サービス	
KENVUE INC	—	85	180	26,527	情報技術	
GLOBAL E ONLINE LTD	—	741	1,487	218,829	生活必需品	
VERALTO CORP	—	47	161	23,757	一般消費財・サービス	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	329.72	113.16	839	123,520	資本財・サービス	
BUNGE GLOBAL LTD	349.72	2,267	333,442	金融		
LIBERTY GLOBAL LTD CLASS C	—	73	789	116,057	生活必需品	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	—	129.73	219	32,225	コミュニケーション・サービス	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	66	77	739	108,714	情報技術	
AVERY DENNISON CORP	93	111	1,175	172,895	一般消費財・サービス	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	34.3	39.3	755	111,181	素材	
EMERSON ELECTRIC CO	216	245	1,717	252,657	情報技術	
AON PLC-CLASS A	246	276	2,437	358,461	資本財・サービス	
AMGEN INC	88	99	3,188	468,975	金融	
EATON CORP PLC	226	258	6,878	1,011,588	ヘルスケア	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	165.36	193.36	4,366	642,117	資本財・サービス	
APPLIED MATERIALS INC	67	80	1,903	279,962	生活必需品	
CME GROUP INC	360	406	6,064	891,834	情報技術	
ECOLAB INC	149	174	3,738	549,779	金融	
EQUIFAX INC	106	124	2,339	343,998	素材	
GILEAD SCIENCES INC	51	59	1,277	187,946	資本財・サービス	
KEURIG DR PEPPER INC	519	603	4,536	667,163	ヘルスケア	
HORMEL FOODS CORP	323	441	1,399	205,794	生活必需品	
STATE STREET CORP	124	145	441	64,977	生活必需品	
SCHWAB (CHARLES) CORP	152.13	167.13	1,198	176,335	金融	
BAXTER INTERNATIONAL INC	601.4	727.4	4,336	637,700	金融	
CAMPBELL SOUP CO	208	244	888	130,621	ヘルスケア	
CROWN HOLDINGS INC	86	94	373	54,966	生活必需品	
CARDINAL HEALTH INC	49.8	57.8	485	71,464	素材	
FEDEX CORP	113	123	1,295	190,483	ヘルスケア	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	102	115	2,920	429,473	資本財・サービス	
FMC CORP	167.54	184.54	2,032	298,896	金融	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	51.5	60.5	318	46,873	素材	
INTEL CORP	105.13	123.13	926	136,231	素材	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	1,692	2,017	9,064	1,333,101	情報技術	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	160	187	572	84,266	コミュニケーション・サービス	
WOLFSPEED INC	134.5	150.5	1,158	170,387	金融	
ILLINOIS TOOL WORKS	—	58	210	30,921	情報技術	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	129	147	3,540	520,657	資本財・サービス	
ILLUMINA INC	386	386	181	26,681	コミュニケーション・サービス	
SEALED AIR CORP	65	76	771	113,528	ヘルスケア	
INTUITIVE SURGICAL INC	58	67	222	32,674	素材	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	149	170	5,282	776,959	ヘルスケア	
SNAP-ON INC	43.5	48.5	708	104,261	情報技術	
CARMAX INC	22	26	706	103,946	資本財・サービス	
DUKE ENERGY CORP	318.28	373.28	486	71,524	一般消費財・サービス	
TARGET CORP	194	223	3,386	497,982	公益事業	
DOVER CORP	60	68	2,928	430,685	生活必需品	
VW GRAINGER INC	19	22	957	140,780	資本財・サービス	
JABIL INC	—	68	1,706	250,977	資本財・サービス	
CINTAS CORP	38	44	783	115,248	情報技術	
CONAGRA BRANDS INC	199	231	2,415	355,314	資本財・サービス	
			647	95,192	生活必需品	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首 株 数	当期 評価額				業種等	
		当期 株 数	期末				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
LAMB WESTON HOLDINGS INC	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
CLOROX COMPANY	—	70	682	100,406	生活必需品		
ENTERGY CORP	51	60	854	125,603	生活必需品		
MICROSOFT CORP	84	102	1,026	150,896	公益事業		
INCYTE CORP	2,941	3,416	129,415	19,033,087	情報技術		
CVS HEALTH CORP	76	92	491	72,239	ヘルスケア		
MEDTRONIC PLC	541.69	619.69	4,145	609,711	ヘルスケア		
MICRON TECHNOLOGY INC	549.98	642.98	5,070	745,724	ヘルスケア		
BLACKROCK INC	462	530	4,064	597,776	情報技術		
CENTERPOINT ENERGY INC	63	72	5,380	791,318	金融		
HASBRO INC	260	305	850	125,104	公益事業		
KELLOGG CO	54	64	297	43,702	一般消費財・サービス		
KEYCORP	104	133	687	101,048	生活必需品		
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	386	453	563	82,878	金融		
COOPER COS INC/THE	572.11	659.11	4,642	682,812	生活必需品		
CHUBB LTD	27	29	346	51,001	ヘルスケア		
ALLSTATE CORP	114	127	795	117,040	金融		
EBAY INC	249	259	1,052	154,802	一般消費財・サービス		
PAYPAL HOLDINGS INC	455.5	512.5	2,970	436,939	金融		
EASTMAN CHEMICAL CO	52	58	482	70,961	素材		
DISH NETWORK CORP-A	96	—	—	—	コミュニケーション・サービス		
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	96	112	1,406	206,886	生活必需品		
TRIMBLE INC	102	120	551	81,041	情報技術		
LENNAR CORP-A	106	122	1,547	227,583	一般消費財・サービス		
LEAR CORP	25	29	390	57,496	一般消費財・サービス		
PROGRESSIVE CORP	242	283	4,612	678,419	金融		
PACCAR INC	144.37	252.55	2,306	339,148	資本財・サービス		
BIOGEN INC	61	70	1,624	238,903	ヘルスケア		
IDEXX LABORATORIES INC	35	40	1,866	274,573	ヘルスケア		
STARBUCKS CORP	474	554	5,531	813,545	一般消費財・サービス		
PTC INC	46	54	839	123,486	情報技術		
EVERSOURCE ENERGY	143	169	1,009	148,408	公益事業		
INTUIT INC	110.8	134.8	7,781	1,144,360	情報技術		
BORGWARNER INC	97	114	389	57,272	一般消費財・サービス		
BEST BUY CO INC	88.5	95.5	675	99,411	一般消費財・サービス		
BALL CORP	130.04	152.04	833	122,580	素材		
BOSTON SCIENTIFIC CORP	590.97	694.97	3,852	566,648	ヘルスケア		
ELECTRONIC ARTS INC	116	128	1,757	258,485	コミュニケーション・サービス		
VULCAN MATERIALS CO	55	64	1,361	200,184	素材		
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	106	125	4,387	645,269	ヘルスケア		
VF CORP	134	160	274	40,308	一般消費財・サービス		
PARAMOUNT GLOBAL CLASS B	252.25	271.25	390	57,485	コミュニケーション・サービス		
MOHAWK INDUSTRIES INC	22	25	219	32,281	一般消費財・サービス		
CARNIVAL CORP	409	487	726	106,790	一般消費財・サービス		
CLEVELAND-CLIFFS INC	218	250	422	62,137	素材		
COMCAST CORP-CLASS A	1,847.9	2,009.9	8,367	1,230,566	コミュニケーション・サービス		
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	87	87	343	50,489	資本財・サービス		
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	486	576	183	27,023	不動産		
アメリカ・ドル通貨計	株 数、 金 額	141,212.8	165,154.98	1,905,237	280,203,284		
銘柄 数 < 比率 >	597 銘柄	603 銘柄		<67.4%>			

## 外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘 柄	期 首	当 期 末				業種等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)		百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
ALIMENTATION COUCHE TARD MULTI VOT	335	358	2,729	295,308		生活必需品	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT VOTING	—	161.81	785	84,955		金融	
IMPERIAL OIL LTD	95	95	743	80,420		エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	8	9	2,894	313,175		情報技術	
RESTAURANT BRANDS INTERN	116.87	135.87	1,286	139,217		一般消費財・サービス	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	179	209	1,393	150,802		素材	
INTACT FINANCIAL CORP	71.5	81.5	1,702	184,222		金融	
BCE INC	49.3	49.3	261	28,338		コミュニケーション・サービス	
FRANCO-NEVADA CORP	78	88	1,363	147,588		素材	
SUNCOR ENERGY INC	582.3	606.3	2,718	294,119		エネルギー	
METRO INC/CN	96	107	740	80,099		生活必需品	
NATIONAL BANK OF CANADA	134	155	1,387	150,147		金融	
BANK OF NOVA SCOTIA	482	548	3,272	354,074		金融	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	366	417	2,225	240,779		金融	
TORONTO-DOMINION BANK	737	846	7,047	762,575		金融	
GREAT-WEST LIFECO INC	114	125	538	58,230		金融	
ROYAL BANK OF CANADA	575.5	637.5	7,574	819,597		金融	
TOURMALINE OIL CORP	129	148	966	104,626		エネルギー	
TC ENERGY CORP	397.5	468.5	2,361	255,560		エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	223.29	253.29	1,140	123,447		エネルギー	
BARRICK GOLD CORP	721	807	1,907	206,437		素材	
CAE INC	126	142	375	40,642		資本財・サービス	
THOMSON REUTERS CORP	68.12	72.41	1,369	148,153		資本財・サービス	
EMPIRE CO LTD 'A'	65	71	260	28,211		生活必需品	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	35	35	354	38,343		素材	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	61.5	69.5	390	42,273		素材	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	—	176	378	40,946		金融	
HYDRO ONE LTD	131	152	570	61,745		公益事業	
LOBLAW COMPANIES LTD	67.6	73.6	886	95,937		生活必需品	
STANTEC INC	—	58	562	60,885		資本財・サービス	
NORTHLAND POWER INC	94	112	245	26,517		公益事業	
WSP GLOBAL INC	50	57	1,062	114,989		資本財・サービス	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	33	37	409	44,261		資本財・サービス	
PARKLAND CORP	58	66	288	31,224		エネルギー	
QUEBECOR INC -CL B	60	68	202	21,876		コミュニケーション・サービス	
EMERA INC	104	126	598	64,763		公益事業	
TFI INTERNATIONAL INC	33	35	555	60,109		資本財・サービス	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	48	61	184	19,934		公益事業	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	144	163	935	101,278		コミュニケーション・サービス	
BRP INC/CA- SUB VOTING	16	16	152	16,447		一般消費財・サービス	
IVANHOE MINES LTD-CL A	246	267	294	31,839		素材	
AGNICO EAGLE MINES LTD	185.17	226.17	1,641	177,680		素材	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	267	293	242	26,188		公益事業	
AIR CANADA	65	76	132	14,350		資本財・サービス	
KINROSS GOLD CORP	530	561	444	48,139		素材	
BANK OF MONTREAL	273	328	3,611	390,776		金融	
POWER CORP OF CANADA	222	266	992	107,450		金融	
SHOPIFY INC - CLASS A	463	552	5,504	595,646		情報技術	
NUTRIEN LTD	223.19	231.19	1,744	188,803		素材	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	53	63	227	24,623		公益事業	
CAMECO CORP	158	200	1,201	130,025		エネルギー	
FIRSTSERVICE CORP	15	18	382	41,345		不動産	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首 株数	当期 株数			業種等	
		期末				
		外貨建金額	邦貨換算金額			
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	百株 71	百株 108	千カナダ・ドル 403	千円 43,626	資本財・サービス	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	53	—	—	—	情報技術	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	26	26	73	7,905	金融	
TELUS CORP	108	108	257	27,884	コミュニケーション・サービス	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	194	209	1,053	113,984	素材	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	22	24	337	36,491	一般消費財・サービス	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	466	509	4,590	496,701	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	10	10	1,229	133,027	金融	
MAGNA INTERNATIONAL INC	113	125	921	99,729	一般消費財・サービス	
WESTON (GEORGE) LTD	29.37	31.37	508	55,049	生活必需品	
PAN AMERICAN SILVER CORP	78	170	361	39,146	素材	
BLACKBERRY LTD	224	—	—	—	情報技術	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	—	38	417	45,182	情報技術	
SUN LIFE FINANCIAL INC	238	270	1,846	199,783	金融	
ENBRIDGE INC	821	931	4,368	472,688	エネルギー	
BROOKFIELD CORP	571.25	647.25	3,130	338,708	金融	
MANULIFE FINANCIAL CORP	780	846	2,219	240,215	金融	
BAUSCH HEALTH COS INC	113	—	—	—	ヘルスケア	
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	377.2	428.2	4,151	449,222	資本財・サービス	
IA FINANCIAL CORP INC	44	47	418	45,315	金融	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	75	83	403	43,667	一般消費財・サービス	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	237.5	259.5	4,036	436,735	資本財・サービス	
CGI INC - CLASS A	87	97	1,329	143,852	情報技術	
ONEX CORPORATION	29	32	298	32,265	金融	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	190	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
IGM FINANCIAL INC	31	36	120	13,050	金融	
TMX GROUP LTD	23	125	358	38,820	金融	
OPEN TEXT CORP	110	121	669	72,445	情報技術	
SAPUTO INC	102	117	304	32,980	生活必需品	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	233	271	307	33,313	素材	
FORTIS INC	193	223	1,212	131,175	公益事業	
RB GLOBAL INC	44	84	721	78,061	資本財・サービス	
LUNDIN MINING CORP	246	304	283	30,626	素材	
CENOVUS ENERGY INC	555	659	1,582	171,216	エネルギー	
DOLLARAMA INC	112	128	1,246	134,907	一般消費財・サービス	
ALTAGAS LTD	111	130	351	38,037	公益事業	
KEYERA CORP	88	102	336	36,412	エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	286	286	620	67,095	エネルギー	
カナダ・ドル通貨計	株数、金額 86 銘柄	16,476.16	18,563.26	111,713	12,088,466	
	銘柄数 <比率>	86 銘柄	86 銘柄	<2.9%>		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
THE LOTTERY CORPORATION LTD	849.5	1,006.4	458	44,721	一般消費財・サービス	
TELSTRA GROUP LTD	1,563.94	1,823.47	689	67,169	コミュニケーション・サービス	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	—	1,355.6	3,277	319,425	金融	
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,050.94	1,247.81	426	41,586	金融	
BHP GROUP LTD	1,973.18	2,285.01	10,554	1,028,532	素材	
SOUTH32 LTD	1,770.77	2,056.49	629	61,323	素材	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	740.59	856.46	2,655	258,732	エネルギー	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	660.05	763.85	1,892	184,455	素材	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,250.31	1,416.29	3,979	387,829	金融	
WESTPAC BANKING CORP	1,362.77	1,582.75	3,347	326,215	金融	

## 外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末				業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
SANTOS LTD	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,254.13	1,449.25	1,005	98,013		エネルギー
RIO TINTO LTD	1,168.89	—	—	—		金融
ORIGIN ENERGY LTD	144.67	167.44	2,085	203,277		素材
AURIZON HOLDINGS LTD	688.87	752.81	632	61,623		公益事業
PILBARA MINERALS LTD	676	838.43	297	29,005		資本財・サービス
XERO LTD	—	1,224.21	435	42,470		素材
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	51.35	64.82	661	64,480		情報技術
COLES GROUP LTD	79	103.88	347	33,912		金融
WISETECH GLOBAL LTD	520.8	603.47	917	89,388		生活必需品
IDP EDUCATION LTD	54	73.81	487	47,472		情報技術
IGO LTD	79	111.69	255	24,913		一般消費財・サービス
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	445.84	519.49	658	64,140		素材
EVOLUTION MINING LTD	656	—	—	—		素材
REECE LTD	105	105	197	19,277		資本財・サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	512.6	649.15	317	30,933		生活必需品
SEEK LTD	128.45	162.68	380	37,064		コミュニケーション・サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	275.29	309.76	328	32,057		生活必需品
NEWCREST MINING LTD	340.97	—	—	—		素材
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	665.19	755.26	7,804	760,509		金融
AMPOL LTD	88	104.54	357	34,790		エネルギー
ORICA LTD	177.51	194.99	301	29,395		素材
QBE INSURANCE GROUP LTD	562.69	672.99	1,020	99,489		金融
WOOLWORTHS GROUP LTD	473.31	549.7	1,884	183,632		生活必需品
QANTAS AIRWAYS LTD	354.69	390.82	203	19,804		資本財・サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	174.15	199.14	946	92,276		素材
MACQUARIE GROUP LTD	141.98	165.61	2,742	267,224		金融
ARISTOCRAT LEISURE LTD	229.09	265.26	1,068	104,173		一般消費財・サービス
CSL LTD	187.75	217.58	5,704	555,947		ヘルスケア
WESFARMERS LTD	442.06	511.74	2,697	262,909		一般消費財・サービス
COCHLEAR LTD	25.1	29.68	792	77,224		ヘルスケア
BLUESCOPE STEEL LTD	178	206.66	419	40,902		素材
SUNCORP GROUP LTD	480.15	572.84	780	76,087		金融
ASX LTD	73.65	87.54	508	49,546		金融
COMPUTERSHARE LTD	206.89	251.69	585	57,099		資本財・サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	964.1	1,104.68	636	62,007		金融
SONIC HEALTHCARE LTD	173.28	195.99	566	55,215		ヘルスケア
BRAMBLES LTD	561.58	626.38	818	79,719		資本財・サービス
MINERAL RESOURCES LTD	66.66	76.02	465	45,360		素材
RAMSAY HEALTH CARE LTD	69.73	82.91	406	39,589		ヘルスケア
REA GROUP LTD	20.23	23.95	379	36,978		コミュニケーション・サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	22	—	—	—		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	24,740.7	29,120.04	68,272	6,653,182	
	銘柄数 < 比率 >	49 銘柄	48 銘柄	<1.6%>		
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	580	720	2,869	54,055		公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	940	1,140	4,588	86,447		一般消費財・サービス
MTR CORP	665	810	2,276	42,881		資本財・サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	605	755	5,768	108,672		不動産
SINO LAND CO	1,420	1,820	1,414	26,642		不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,116.69	1,396.69	5,468	103,017		資本財・サービス

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘 柄	期 首	当 期 末				業種等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
SWIRE PACIFIC LTD - CL A		百株	百株	千香港・ドル	千円		
CLP HOLDINGS LTD	215	240	1,224	23,060		不動産	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	700	855	5,164	97,293		公益事業	
HONG KONG & CHINA GAS	595.07	755.07	1,604	30,229		不動産	
HANG SENG BANK LTD	4,824.75	5,824.75	3,087	58,161		公益事業	
NEW WORLD DEVELOPMENT	329	398	3,482	65,610		金融	
WH GROUP LTD	635	795	931	17,553		不動産	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,610	4,335	2,128	40,100		生活必需品	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	511	626	17,502	329,755		金融	
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	870	970	1,028	19,371		不動産	
SWIRE PROPERTIES LTD	780	870	773	14,571		資本財・サービス	
CK ASSET HOLDINGS LTD	450	608	924	17,411		不動産	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	911.69	1,026.69	3,916	73,792		不動産	
AIA GROUP LTD	265	300	1,143	21,534		公益事業	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	5,096	6,006	41,561	783,019		金融	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	540	640	783	14,758		資本財・サービス	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	720	870	2,170	40,895		不動産	
ESR CAYMAN LTD	741	895	1,218	22,965		生活必需品	
SANDS CHINA LTD	862	1,138	1,138	21,439		不動産	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1,044	1,264	2,406	45,341		一般消費財・サービス	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	820	—	—	—		一般消費財・サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	575	715	5,716	107,697		資本財・サービス	
	1,590	1,925	4,052	76,342		金融	
香港・ドル通貨計	株 数、 金 額	32,011.2	37,698.2	124,343	2,342,622		
	銘柄数 < 比率 >	28 銘柄	27 銘柄		<0.6%>		
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポール・ドル	千円		
CAPITALAND INVESTMENT LTD	1,074	1,353	414	45,699		不動産	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	508	657	1,794	198,123		金融	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	779	942	2,991	330,234		金融	
SINGAPORE AIRLINES LTD	539.75	773.75	492	54,403		資本財・サービス	
KEPPEL CORP LTD	627	757	486	53,727		資本財・サービス	
UOL GROUP LTD	200	229	136	15,014		不動産	
CITY DEVELOPMENTS LTD	161	246	153	16,916		不動産	
SEATRIUM	—	23,060.22	246	27,235		資本財・サービス	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	—	51	147	16,325		資本財・サービス	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,457	1,761	2,234	246,667		金融	
GENTING SINGAPORE LTD	2,380	3,144	286	31,580		一般消費財・サービス	
VENTURE CORP LTD	112	—	—	—		情報技術	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	3,553.5	4,293.5	983	108,526		コミュニケーション・サービス	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	627	812	302	33,341		資本財・サービス	
SEMCORP INDUSTRIES LTD	—	465	239	26,484		公益事業	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	357	446	426	47,063		金融	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	800	999	367	40,579		生活必需品	
シンガポール・ドル通貨計	株 数、 金 額	13,175.25	39,989.47	11,704	1,291,923		
	銘柄数 < 比率 >	14 銘柄	16 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	525	671.52	344	31,245		公益事業	
MERCURY NZ LTD	300	341.43	207	18,828		公益事業	
EBOS GROUP LTD	—	76.6	283	25,699		ヘルスケア	
SPARK NEW ZEALAND LTD	805.3	921.47	467	42,373		コミュニケーション・サービス	

## 外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末			業種等	
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	百株	百株	千ニュージーランド・ドル	千円		
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	521.13	650.88	514	46,637	資本財・サービス	
	242	301.25	716	65,029	ヘルスケア	
ニュージーランド・ドル通貨計	株 数、金額	2,393.43	2,963.15	2,533	229,813	
銘柄数 < 比率 >	5 銘柄	6 銘柄		<0.1%>		
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
SHELL PLC	3,052.97	3,164.34	8,080	1,509,693	エネルギー	
HALEON PLC	2,041.62	2,644.82	875	163,615	生活必需品	
WISE PLC CLASS A	—	302.73	236	44,186	金融	
BP PLC	7,881.77	8,188.83	3,864	722,083	エネルギー	
UNILEVER PLC	1,041.21	1,190.31	4,467	834,769	生活必需品	
BARCLAYS PLC	6,832.63	7,366.15	1,033	193,093	金融	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	3,363.9	3,987.38	1,050	196,233	資本財・サービス	
PRUDENTIAL PLC	1,122.04	1,303.55	1,113	208,044	金融	
NATWEST GROUP PLC	2,183.95	2,753.93	568	106,201	金融	
JOHNSON MATTHEY PLC	70.64	83.88	134	25,177	素材	
BAE SYSTEMS PLC	1,288.2	1,443.09	1,493	279,063	資本財・サービス	
AVIVA PLC	1,156.48	1,270.14	527	98,627	金融	
AVEVA GROUP PLC	49.48	—	—	—	情報技術	
GSK	1,659.76	1,938.76	2,716	507,495	ヘルスケア	
INFORMA PLC	600.95	663.43	489	91,478	コミュニケーション・サービス	
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,787.92	702.66	367	68,662	資本財・サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC	380.02	435.78	312	58,476	コミュニケーション・サービス	
DCC PLC	39.64	46.96	251	47,046	資本財・サービス	
OCADO GROUP PLC	238.27	276.77	164	30,696	生活必需品	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	29	35.02	321	60,039	資本財・サービス	
HALMA PLC	152.6	180.19	382	71,508	情報技術	
ENTAIN PLC	240.59	304.69	243	45,554	一般消費財・サービス	
JD SPORTS FASHION PLC	997	1,232.36	193	36,218	一般消費財・サービス	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	301.68	357.03	165	30,932	金融	
M&G PLC	1,045.04	1,045.04	219	41,081	金融	
ENDEAVOUR MINING PLC	—	91.41	167	31,322	素材	
RELX PLC	785.4	896.22	2,729	510,051	資本財・サービス	
DIAGEO PLC	932.76	1,063.61	2,914	544,506	生活必需品	
RIO TINTO PLC	458.86	533.07	2,878	537,833	素材	
STANDARD CHARTERED PLC	1,046.59	1,122.54	718	134,314	金融	
TESCO PLC	3,063.36	3,387.02	963	179,977	生活必需品	
SMITH & NEPHEW PLC	353.11	413.44	422	78,907	ヘルスケア	
GLENCORE PLC	4,022.88	4,978.95	2,210	412,992	素材	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	132.5	169.56	120	22,505	金融	
SMITHS GROUP PLC	153.83	166.14	271	50,799	資本財・サービス	
PEARSON PLC	283.63	306.19	283	53,055	一般消費財・サービス	
SAINSBURY (J) PLC	718.64	782.74	221	41,461	生活必需品	
NEXT PLC	53.11	56.2	445	83,268	一般消費財・サービス	
TAYLOR WIMPEY PLC	1,466.73	1,676.29	216	40,433	一般消費財・サービス	
WHITBREAD PLC	81.27	92.18	286	53,563	一般消費財・サービス	
BUNZL PLC	135.62	159.99	470	87,973	資本財・サービス	
VODAFONE GROUP PLC	10,810.03	11,455.92	811	151,563	コミュニケーション・サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	56.01	66.27	294	55,099	素材	
KINGFISHER PLC	787.11	857.79	188	35,275	一般消費財・サービス	
WPP PLC	458.47	508.89	357	66,841	コミュニケーション・サービス	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	278.81	322.8	363	67,850	公益事業	
SEVERN TRENT PLC	102.32	119.46	324	60,620	公益事業	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首 株数	当期 株数				業種等	
		期末		外貨建金額	邦貨換算金額		
		百株	千円				
RENTOKIL INITIAL PLC	747.06	1,193.17	518	96,886	96,886	資本財・サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	291.82	339.78	1,831	342,181	342,181	生活必需品	
ST JAMES'S PLACE PLC	217.32	260.55	168	31,516	31,516	金融	
SCHRODERS PLC	273.52	398.15	159	29,830	29,830	金融	
SSE PLC	435.75	516.22	944	176,552	176,552	公益事業	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	395	462.6	235	43,924	43,924	一般消費財・サービス	
ASTRAZENECA PLC	632.33	733.82	7,361	1,375,456	1,375,456	ヘルスケア	
FERGUSON PLC	87.77	—	—	—	—	資本財・サービス	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	2,396.89	2,830.52	646	120,843	120,843	金融	
3I GROUP PLC	390.73	460.84	1,028	192,096	192,096	金融	
ASHTEAD GROUP PLC	178.54	207.46	982	183,498	183,498	資本財・サービス	
SAGE GROUP PLC/THE	401.14	485.36	548	102,473	102,473	情報技術	
NATIONAL GRID PLC	1,488.17	1,743.49	1,787	334,060	334,060	公益事業	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	28,500.13	30,160.79	1,310	244,851	244,851	金融	
IMPERIAL BRANDS PLC	381.61	408.12	748	139,886	139,886	生活必需品	
CRH PLC	—	339.42	1,670	312,203	312,203	素材	
CENTRICA PLC	—	2,799.88	412	77,109	77,109	公益事業	
BERKELEY GROUP HOLDINGS (THE) PLC	42.32	49.18	228	42,691	42,691	一般消費財・サービス	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	878.5	1,005.93	2,529	472,595	472,595	生活必需品	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	138	164.69	393	73,480	73,480	生活必需品	
HSBC HOLDINGS PLC	8,199.21	9,349.51	5,561	1,039,033	1,039,033	金融	
ANGLO AMERICAN PLC	518.56	601.64	1,286	240,389	240,389	素材	
MONDI PLC	198.53	229.86	321	60,125	60,125	素材	
COMPASS GROUP PLC	728	820.31	1,654	309,138	309,138	一般消費財・サービス	
PERSIMMON PLC	128.32	151.88	191	35,726	35,726	一般消費財・サービス	
BT GROUP PLC	3,453	3,453	423	79,064	79,064	コミュニケーション・サービス	
COCA-COLA HBC AG-DI	78	101.36	220	41,266	41,266	生活必需品	
BURBERRY GROUP PLC	160.61	178.7	259	48,413	48,413	一般消費財・サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	75.23	80.05	489	91,474	91,474	一般消費財・サービス	
INTERTEK GROUP PLC	64.81	76.6	305	57,018	57,018	資本財・サービス	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	134.5	188.86	1,682	314,403	314,403	金融	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	66	78.66	135	25,315	25,315	ヘルスケア	
ADMIRAL GROUP PLC	75	97.79	264	49,386	49,386	金融	
ANTOFAGASTA PLC	153	187.17	265	49,606	49,606	素材	
ABRDN PLC	843.62	908.62	151	28,384	28,384	金融	
EXPERIAN PLC	375.75	435.65	1,271	237,515	237,515	資本財・サービス	
イギリス・ポンド通貨計	株数、金額	116,867.14	131,644.15	84,931	15,868,602		
	銘柄数 < 比率 >	79 銘柄	81 銘柄	<3.8%>			
(イスラエル)		百株	百株	千イスラエル・シュケル	千円		
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	514.98	643.14	1,191	47,566	47,566	金融	
AZRIELI GROUP LTD	18.26	22.07	489	19,529	19,529	不動産	
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	45.41	—	—	—	—	情報技術	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO	890	—	—	—	—	コミュニケーション・サービス	
ICL GROUP LTD	304.61	380.9	740	29,539	29,539	素材	
ELBIT SYSTEMS LTD	11	13.83	1,049	41,902	41,902	資本財・サービス	
BANK HAPOALIM BM	546.45	660.5	2,113	84,360	84,360	金融	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	664.26	798.01	2,298	91,731	91,731	金融	
NICE LTD	27.31	32.9	2,361	94,257	94,257	情報技術	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	64.07	80.29	1,095	43,711	43,711	金融	
イスラエル・シュケル通貨計	株数、金額	3,086.35	2,631.64	11,339	452,599		
	銘柄数 < 比率 >	10 銘柄	8 銘柄	<0.1%>			

**外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)**

銘柄	期首 株数	当期末			業種等	
		株数	評価額	外貨建金額 邦貨換算金額		
			千円			
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	—		
CS GROUP ANR RIGHTS AG	1,040.49	—	—	—	金融	
SANDOZ GROUP AG	—	189.4	492	82,941	ヘルスケア	
AVOLTA AG	—	48.54	149	25,257	一般消費財・サービス	
UBS GROUP AG-REG	1,404.83	1,526.27	3,647	614,870	金融	
ROCHE HOLDING AG-BR	11.8	14.47	360	60,781	ヘルスケア	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	2.8	3.26	200	33,767	素材	
ADECCO GROUP AG-REG	63.6	74.58	313	52,824	資本財・サービス	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	280.61	325.81	7,702	1,298,274	ヘルスケア	
SIKA AG-REG	58.34	67.89	1,607	270,982	素材	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.04	0.05	537	90,516	生活必需品	
ABB LTD-REG	656.05	743.42	2,534	427,184	資本財・サービス	
SWISS RE AG	120.47	139.88	1,437	242,265	金融	
NESTLE SA-REG	1,124.33	1,233.71	12,229	2,061,449	生活必需品	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	9	10.52	1,203	202,859	金融	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	16.01	18.93	371	62,588	資本財・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,040.49	—	—	—	金融	
JULIUS BAER GROUP LTD	87.08	95.36	413	69,760	金融	
SGS SA-REG	2.52	69.25	515	86,938	資本財・サービス	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	9.34	10.91	203	34,315	資本財・サービス	
TEMENOS AG - REG	25	29.73	216	36,542	情報技術	
HELVETIA HOLDING AG-REG	—	18.28	215	36,389	金融	
VAT GROUP AG	10.5	12.55	488	82,290	資本財・サービス	
BKW AG	—	9.42	142	23,960	公益事業	
ALCON INC	199.59	231.73	1,515	255,533	ヘルスケア	
SIG GROUP N AG	130	141.78	287	48,418	素材	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	11.59	13.42	308	51,982	一般消費財・サービス	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	60.1	69.77	3,038	512,166	金融	
BALOISE HOLDING AG - REG	18	21.34	276	46,689	金融	
CLARIANT AG-REG	86.78	96.78	126	21,321	素材	
NOVARTIS AG-REG	863.2	947.01	8,034	1,354,283	ヘルスケア	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1.41	1.59	231	38,941	生活必需品	
BACHEM HOLDING AG-REG B	12.5	15.75	103	17,468	ヘルスケア	
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	208.49	242.07	2,650	446,796	一般消費財・サービス	
SWISSCOM AG-REG	10.36	12.01	614	103,528	コミュニケーション・サービス	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	13.44	142	24,036	金融	
GEBERIT AG-REG	14.33	15.59	758	127,818	資本財・サービス	
GIVAUDAN-REG	3.69	4.28	1,388	234,106	素材	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	43.89	51.76	631	106,440	ヘルスケア	
SONOVA HOLDING AG-REG	21.1	24.15	608	102,500	ヘルスケア	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	69.29	76.19	571	96,396	情報技術	
LONZA GROUP AG-REG	29.74	34.53	1,180	198,940	ヘルスケア	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	19	22.69	99	16,770	一般消費財・サービス	
HOLCIM LTD	218.29	246.69	1,576	265,709	素材	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	12.37	13.72	769	129,739	金融	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	21.35	25.19	645	108,783	資本財・サービス	
SWISS PRIME SITE-REG	30.25	35.75	312	52,607	不動産	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.42	0.44	478	80,693	生活必需品	
スイス・フラン通貨計	株数、金額	8,049.04	6,999.9	61,333	10,338,437	
	銘柄数 < 比率 >	42 銘柄	45 銘柄	<2.5%>		
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円		
NOVO NORDISK A/S-B	701.05	1,647.16	113,555	2,459,605	ヘルスケア	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額	
DANSKE BANK A/S	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	296.78	358.61	6,306	136,591	金融
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1.31	1.53	1,638	35,492	資本財・サービス
GN STORE NORD A/S	430.42	525.05	9,584	207,595	資本財・サービス
CARLSBERG AS-B	54.65	—	—	—	一般消費財・サービス
NOVOZYMES A/S-B SHARES	41.8	51.2	4,236	91,757	生活必需品
COLOPLAST-B	88	106.34	3,716	80,501	素材
DSV PANALPINA A/S	51.12	61.77	4,961	107,463	ヘルスケア
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	82.8	96.78	10,195	220,840	資本財・サービス
DEMANT A/S	3.7	4.26	777	16,839	資本財・サービス
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	42.75	52.39	1,522	32,987	ヘルスケア
TRYG A/S	2.3	2.52	2,739	59,331	資本財・サービス
PANDORA A/S	149.9	177.29	2,587	56,046	金融
CHR HANSEN HOLDING A/S	40	43.41	3,956	85,695	一般消費財・サービス
GENMAB A/S	43	54.84	2,931	63,501	素材
ORSTED A/S	28.29	34.33	7,353	159,276	ヘルスケア
	81.4	98.35	3,107	67,316	公益事業
デンマーク・クローネ通貨計	株数、金額	2,139.27	3,315.83	179,170	3,880,843
	銘柄数 <比率>	17 銘柄	16 銘柄	<0.9%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円	
DNB BANK	400.25	481.22	9,855	136,102	金融
NORSK HYDRO ASA	578.66	689.82	4,350	60,073	素材
ORKLA ASA	323.17	390.5	3,120	43,099	生活必需品
TELENOR ASA	291.31	363.8	4,207	58,103	コミュニケーション・サービス
EQUINOR ASA	420.51	469.08	16,054	221,709	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	71.24	86.08	3,115	43,021	素材
MOWI ASA	178	228.53	4,393	60,674	生活必需品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	80.5	103.98	1,892	26,134	金融
AKER BP ASA	135.97	164.3	5,004	69,113	エネルギー
KONGSBERG GRUPPEN ASA	37.23	45.73	2,124	29,340	資本財・サービス
SALMAR ASA	24.52	35.73	2,088	28,845	生活必需品
ADEVINTA ASA	120	139.44	1,553	21,451	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	2,661.36	3,198.21	57,760	797,670
	銘柄数 <比率>	12 銘柄	12 銘柄	<0.2%>	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クローネ	千円	
SAGAX CLASS B	79.24	102.55	2,454	34,871	不動産
INVESTOR CLASS A	214.58	—	—	—	金融
VOLVO CAR CLASS B	248.08	285.14	980	13,930	一般消費財・サービス
ERICSSON LM-B SHS	1,255.88	1,522.46	8,005	113,752	情報技術
VOLVO AB-B SHS	649.3	784.58	19,002	270,025	資本財・サービス
SKF AB-B SHARES	164.95	177.19	3,464	49,224	資本財・サービス
ELECTROLUX AB-SER B	86	—	—	—	一般消費財・サービス
SWEDISH MATCH AB	657.78	—	—	—	生活必需品
TELE2 AB-B SHS	244.23	263.33	2,156	30,646	コミュニケーション・サービス
GETINGE AB-B SHS	92	118.92	2,686	38,173	ヘルスケア
SKANDINAViska ENSKILDA BAN-A	700.28	825.04	10,461	148,658	金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	627.59	758.34	7,525	106,941	金融
SWEDBANK AB - A SHARES	389.66	433.33	8,374	118,995	金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	314.25	349.46	6,116	86,921	一般消費財・サービス
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	260.69	315	5,021	71,349	素材
SKANSKA AB-B SHS	146.38	176.89	2,975	42,278	資本財・サービス

**外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)**

銘 柄	期 首	当 期 末			業種等
		株 数	株 数	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額
SANDVIK AB	百株	百株	千円		
INVESTOR AB-B SHS	457	554.35	11,330	161,012	資本財・サービス
ATLAS COPCO AB-A SHS	783.94	899.89	19,392	275,569	金融
VOLVO AB-A SHS	1,155.75	1,396.53	22,588	320,987	資本財・サービス
HOLMEN AB-B SHARES	80	104.11	2,554	36,304	資本財・サービス
SECURITAS AB-B SHS	39.06	48.77	2,148	30,534	素材
TELIA CO AB	119.5	255.7	2,373	33,733	資本財・サービス
ALFA LAVAL AB	1,106.67	1,228.66	3,061	43,508	コミュニケーション・サービス
ATLAS COPCO AB-B SHS	127	150.43	5,863	83,324	資本財・サービス
ASSA ABLOY AB-B	671.61	811.53	11,251	159,888	資本財・サービス
SAAB AB-B	431.26	521.11	14,049	199,638	資本財・サービス
INDSTRIVARDEN AB-A SHS	—	39.43	2,159	30,682	資本財・サービス
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	52.43	67.68	2,131	30,284	金融
INDUTRADE AB	262.68	301.92	1,896	26,951	不動産
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	113.71	134.54	3,098	44,029	資本財・サービス
LUNDBERGS AB-B SHS	70.32	101.25	2,555	36,314	ヘルスケア
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	30	39.51	1,967	27,965	金融
LIFCO AB-B SHS	57	68.43	1,593	22,646	資本財・サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	95	121.2	2,777	39,474	資本財・サービス
BEIJER REF AB	652.08	787.93	4,930	70,067	資本財・サービス
ESSITY AKTIEBOLAG-B	—	200.12	2,343	33,299	資本財・サービス
EMBRACER GROUP AB	262.04	316.69	8,341	118,534	生活必需品
BOLIDEN AB	265.94	—	—	—	コミュニケーション・サービス
EPIROC AB-A	113.87	142.2	4,043	57,457	素材
EPIROC AB-B	274.36	342.63	6,647	94,454	資本財・サービス
HUSQVARNA AB-B SHS	167.8	192.02	3,166	44,994	資本財・サービス
NORDEA BANK ABP	170.5	193.95	1,557	22,130	資本財・サービス
EQT AB	1,467.48	1,674.88	19,579	278,222	金融
EVOLUTION AB	123.18	184.89	4,600	65,366	金融
KINNEVIK AB - B	78.67	95.28	10,497	149,175	一般消費財・サービス
HEXAGON AB-B SHS	104.31	—	—	—	金融
INDSTRIVARDEN AB-C SHS	837.5	1,079.44	11,280	160,290	情報技術
	62	80.28	2,526	35,900	金融
スウェーデン・クローネ通貨計	株 数、 金 額	16,363.55	18,247.58	271,535	3,858,515
	銘柄 数 < 比率 >	46 銘柄	43 銘柄	<0.9%>	
ユーロ (アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	99.48	121.88	404	65,255	素材
AIB GROUP PLC	—	679.31	281	45,509	金融
BANK OF IRELAND GROUP PLC	—	495.16	424	68,569	金融
KINGSPAN GROUP PLC	60.76	72.49	516	83,477	資本財・サービス
KERRY GROUP PLC-A	62.72	74.71	551	89,025	生活必需品
CRH PLC	306.32	—	—	—	素材
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	67.04	82.75	1,189	192,121	一般消費財・サービス
国 小 計	株 数、 金 額	596.32	1,526.3	3,367	543,958
	銘柄 数 < 比率 >	5 銘柄	6 銘柄	<0.1%>	
ユーロ (オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	291.69	383.6	927	149,869	コミュニケーション・サービス
EXOR NV	45	50.95	450	72,743	金融
FERROVIAL	—	246.4	777	125,516	資本財・サービス
QIAGEN N.V.	91.05	106.9	402	64,969	ヘルスケア

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
KONINKLIJKE PHILIPS NV	百株 349	百株 435.15	千ユーロ 819	千円 132,325		ヘルスケア	
NN GROUP NV	112.92	120.86	383	61,976		金融	
HEINEKEN NV	104.07	136.49	1,129	182,352		生活必需品	
KONINKLIJKE AHOOLD DELHAIZE N	419.83	460.15	1,212	195,755		生活必需品	
AKZO NOBEL N.V.	71	78.41	550	88,875		素材	
KONINKLIJKE DSM NV	70.17	—	—	—		素材	
WOLTERS KLUWER	105.4	120.73	1,520	245,591		資本財・サービス	
ING GROEP NV	1,568.62	1,695.86	2,165	349,713		金融	
KONINKLIJKE KPN NV	1,327.81	1,516.71	480	77,653		コミュニケーション・サービス	
ASML HOLDING NV	163.2	188.99	11,891	1,920,555		情報技術	
ABN AMRO BANK NV-CVA	167	189.75	237	38,384		金融	
IMCD NV	22.46	26.78	367	59,428		資本財・サービス	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	—	40.08	515	83,214		情報技術	
ASR NEDERLAND NV	—	83.11	310	50,229		金融	
ADYEN NV	8.7	10.18	1,107	178,853		金融	
JUST EAT TAKEAWAY	72.2	—	—	—		一般消費財・サービス	
PROSUS NV	354.8	785.72	2,363	381,656		一般消費財・サービス	
JDE PEET'S NV	37	57.85	141	22,816		生活必需品	
ASM INTERNATIONAL NV	18.83	22.01	1,033	166,863		情報技術	
RANDSTAD NV	47.2	52.75	289	46,755		資本財・サービス	
HEINEKEN HOLDING NV	42.5	61.43	433	69,996		生活必需品	
OCI NV	43.86	49.87	104	16,874		素材	
EURONEXT NV	33	38.76	294	47,639		金融	
STMICROELECTRONICS NV	274.39	320.41	1,378	222,703		情報技術	
AIRBUS SE	237.36	277.9	3,767	608,442		資本財・サービス	
ARGENIX SE	22.29	26.24	1,055	170,453		ヘルスケア	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	210.64	246.06	244	39,486		生活必需品	
CNH INDUSTRIAL NV	402.65	479.63	464	75,063		資本財・サービス	
STELLANTIS NV	883.5	1,035.31	2,041	329,643		一般消費財・サービス	
FERRARI NV	50.61	59.09	1,981	320,093		一般消費財・サービス	
国小計	株数、金額	7,648.75	9,404.13	40,842	6,596,499		
	銘柄数 <比率>	31 銘柄	32 銘柄	<1.6%>			
ユーロ(ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円			
LOTUS BAKERIES NV	—	0.21	167	27,065		生活必需品	
UCB SA	49.76	59.4	399	64,565		ヘルスケア	
KBC GROUP NV	98.43	117.34	615	99,457		金融	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	42	43.83	316	51,181		金融	
SOLVAY SA	29.84	34.89	367	59,421		素材	
UMICORE	82.69	98.4	240	38,825		素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	348.72	407.2	2,328	376,054		生活必需品	
AGEAS	62.9	74.99	295	47,731		金融	
D'IERETEREN GROUP	10.36	10.36	162	26,269		一般消費財・サービス	
PROXIMUS	60.35	—	—	—		コミュニケーション・サービス	
ELIA GROUP SA/NV	13.33	14.62	144	23,258		公益事業	
SOFINA	6	6.7	135	21,923		金融	
国小計	株数、金額	804.38	867.94	5,174	835,757		
	銘柄数 <比率>	11 銘柄	11 銘柄	<0.2%>			
ユーロ(ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
AROUNDOWN SA	380	—	—	—		不動産	

## 外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額	
ARCELORMITTAL	百株 257	百株 257	千ユーロ 586	千円 94,762	素材
EUROFINS SCIENTIFIC	52.96	63.42	334	54,103	ヘルスケア
TENARIS SA	186.08	221.87	340	54,951	エネルギー
国小計	株数、金額 876.04	542.29	1,261	203,818	
銘柄数 < 比率 >	4 銘柄	3 銘柄	<0.0%>		
ユーロ(フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TOTALENERGIES SE	995.42	1,094.87	6,753	1,090,702	エネルギー
MICHELIN (CGDE)	267.4	318.04	980	158,414	一般消費財・サービス
AIR LIQUIDE SA	209.95	245.54	4,266	689,082	素材
KERING	30.04	34.9	1,364	220,394	一般消費財・サービス
SCHNEIDER ELECTRIC SE	217.87	255.2	4,266	689,154	資本財・サービス
BOUYGUES SA	90.62	95.72	336	54,325	資本財・サービス
BNP PARIBAS	446.02	500.23	2,847	459,868	金融
THALES SA	42.91	49.27	683	110,332	資本財・サービス
DANONE	257.08	301.95	1,786	288,462	生活必需品
CARREFOUR SA	244.54	280.25	486	78,554	生活必需品
VIVENDI	295.91	311.66	272	44,064	コミュニケーション・サービス
L'OREAL	96.88	113.09	4,883	788,781	生活必需品
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	199.87	220.86	1,312	211,957	資本財・サービス
LEGRAND SA	107.37	125.08	1,102	178,097	資本財・サービス
PERNOD RICARD SA	84.11	95.78	1,491	240,936	生活必需品
EURAZEO SE	17.24	19.81	124	20,076	金融
SOCIETE GENERALE SA	319.64	355.28	807	130,485	金融
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	111.46	129.45	8,938	1,443,660	一般消費財・サービス
ACCOR SA	67.17	83.55	264	42,682	一般消費財・サービス
CAPGEMINI SE	65.74	77.3	1,457	235,399	情報技術
VALEO SA	84	91.48	123	19,997	一般消費財・サービス
PUBLICIS GROUPE	91.79	107.3	829	133,926	コミュニケーション・サービス
BUREAU VERITAS SA	116.05	138.62	311	50,306	資本財・サービス
EIFFAGE	32.85	36.75	340	55,057	資本財・サービス
SODEXO SA	34.91	41.57	412	66,696	一般消費財・サービス
IPSEN	14	17.06	175	28,352	ヘルスケア
AMUNDI SA	22.5	28.88	162	26,167	金融
TELEPERFORMANCE	23.15	27.71	361	58,315	資本財・サービス
UBISOFT ENTERTAINMENT	36	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	11	13.02	270	43,634	ヘルスケア
SEB SA	9.97	11.82	123	19,968	一般消費財・サービス
ESSILORLUXOTTICA	115.49	138.42	2,453	396,241	ヘルスケア
DASSAULT AVIATION SA	10	11.08	204	33,106	資本財・サービス
WORLDLINE SA	96.06	112.65	157	25,380	金融
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	41.63	49.44	163	26,446	一般消費財・サービス
AXA SA	762.06	860.16	2,446	395,101	金融
EDENRED	100.44	116.99	585	94,513	金融
RENAULT SA	77.55	90.48	324	52,352	一般消費財・サービス
HERMES INTERNATIONAL	12.72	14.85	2,817	454,980	一般消費財・サービス
REMY COINTREAU	9	10.09	109	17,689	生活必需品
DASSAULT SYSTEMES SE	267.58	314.2	1,354	218,844	情報技術
WENDEL	9.3	11.24	88	14,250	金融
ORANGE	800.96	877.88	988	159,623	コミュニケーション・サービス
ALSTOM	125.25	141.07	162	26,190	資本財・サービス
SANOFI	457.21	532.73	4,521	730,231	ヘルスケア

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
VINCI SA	百株	214.23	249.19	千ユーロ 2,793	千円 451,245	資本財・サービス	
VEOLIA ENVIRONNEMENT		261.79	318.58	913	147,569	公益事業	
CREDIT AGRICOLE SA		491.28	567.33	669	108,122	金融	
BIOMERIEUX		16.91	18.52	183	29,564	ヘルスケア	
ENGIE		733.28	856.25	1,359	219,498	公益事業	
EDF		221.2	—	—	—	公益事業	
SAFRAN SA		137.22	160.24	2,566	414,448	資本財・サービス	
ARKEMA		23.95	28.29	264	42,730	素材	
ADP		11.1	13.43	151	24,510	資本財・サービス	
GETLINK SE		173.45	194.11	325	52,496	資本財・サービス	
BOLLORÉ		356.75	391.41	209	33,757	コミュニケーション・サービス	
国小計	株数、金額	10,169.87	11,300.67	73,349	11,846,755		
	銘柄数 <比率>	56 銘柄	54 銘柄	<2.8%>			
ユーロ(ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	179.02	231.24	689	111,407	資本財・サービス		
DR ING HC F PORSCHE PRF (PROPOSED)	46	53.38	453	73,178	一般消費財・サービス		
BAYER AG-REG	394.42	460.56	1,412	228,138	ヘルスケア		
EVONIK INDUSTRIES AG	80	94.86	165	26,673	素材		
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	813.28	909.46	1,025	165,570	金融		
COMMERZBANK AG	420.31	498.95	564	91,101	金融		
VOLKSWAGEN AG	12	13.04	155	25,157	一般消費財・サービス		
VOLKSWAGEN AG-PREF	74.51	96.57	1,032	166,700	一般消費財・サービス		
SIEMENS AG-REG	307.42	356.31	5,447	879,788	資本財・サービス		
E.ON SE	901.36	1,052.52	1,260	203,566	公益事業		
UNIPER SE	66.5	—	—	—	公益事業		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	132.93	149.09	1,432	231,332	一般消費財・サービス		
GEA GROUP AG	58	72.18	243	39,286	資本財・サービス		
CONTINENTAL AG	43.42	51.68	370	59,763	一般消費財・サービス		
BASF SE	368.75	418.85	1,800	290,719	素材		
ALLIANZ SE-REG	164.11	189.07	4,367	705,397	金融		
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	71.68	79.26	565	91,375	生活必需品		
RHEINMETALL AG	18.13	20.42	561	90,761	資本財・サービス		
RWE AG	257.91	296.64	1,164	188,095	公益事業		
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	219.5	270.29	216	35,010	資本財・サービス		
BRENTAG SE	60.9	69.69	538	86,961	資本財・サービス		
FRESENIUS SE & CO KGAA	164.83	198	565	91,363	ヘルスケア		
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	38.39	—	—	—	コミュニケーション・サービス		
SAP SE	419.6	489.54	7,075	1,142,814	情報技術		
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	56.25	63.79	2,471	399,230	金融		
ZALANDO SE	87.83	105.53	233	37,633	一般消費財・サービス		
HEIDELBERG MATERIALS AG	57.08	68.04	504	81,429	素材		
KION GROUP AG	27	—	—	—	資本財・サービス		
COVESTRO AG	73	90.78	441	71,256	素材		
RATIONAL AG	1.9	2.42	142	23,060	資本財・サービス		
SARTORIUS AG-VORZUG	12.1	12.1	356	57,553	ヘルスケア		
TALANX AG	—	31.19	204	33,096	金融		
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	60.35	71.94	325	52,529	一般消費財・サービス		
DELIVERY HERO SE	64.43	82.46	250	40,520	一般消費財・サービス		
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	15.92	18.94	159	25,689	ヘルスケア		
BECHTLE AG	32.38	36.26	165	26,804	情報技術		
NEMETSCHEK SE	22.84	25.57	207	33,467	情報技術		

**外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)**

銘 柄	期 首	当 期 末				業種等	
		株 数	株 数	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
SCOUT24 AG		百株	百株	千ユーロ	千円		
	36	36	227	36,816	36,816	コミュニケーション・サービス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	110.97	132.18	692	111,908	111,908	ヘルスケア	
KNORR-BREMSE AG	28	34.13	197	31,894	31,894	資本財・サービス	
HELLOFRESH SE	65.16	71.77	103	16,715	16,715	生活必需品	
SIEMENS ENERGY AG	172.9	237.42	255	41,279	41,279	資本財・サービス	
BEIERSDORF AG	39.8	47.25	610	98,558	98,558	生活必需品	
MERCK KGAA	51.89	60.59	971	156,965	156,965	ヘルスケア	
ADIDAS AG	72	75.75	1,459	235,781	235,781	一般消費財・サービス	
PUMA SE	41.63	49.69	290	46,932	46,932	一般消費財・サービス	
HENKEL AG & CO KGAA	41.01	48.83	306	49,448	49,448	生活必需品	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,301.22	1,519.48	3,332	538,309	538,309	コミュニケーション・サービス	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	80.7	96.5	359	58,103	58,103	ヘルスケア	
MERCEDES-BENZ GROUP N AG	325	387.64	2,298	371,201	371,201	一般消費財・サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	524.3	612.22	2,185	353,000	353,000	情報技術	
HANNOVER RUECK SE	23.78	28.26	614	99,272	99,272	金融	
DHL GROUP	397.96	463.85	1,990	321,466	321,466	資本財・サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	76.28	89.07	1,550	250,383	250,383	金融	
MTU AERO ENGINES AG	21.04	25.24	474	76,577	76,577	資本財・サービス	
WACKER CHEMIE AG	—	8.99	101	16,392	16,392	素材	
SYMRISE AG	52.28	62.24	631	101,931	101,931	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING	413.12	413.12	97	15,679	15,679	コミュニケーション・サービス	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	22	26.86	234	37,850	37,850	一般消費財・サービス	
VONOVIA SE	287.7	345.42	896	144,771	144,771	不動産	
LEG IMMOBILIEN SE	28	35.01	251	40,655	40,655	不動産	
国 小 計	株 数 、 金 額	10,036.79	11,588.13	56,704	9,158,335		
	銘柄数 < 比率 >	59 銘柄	58 銘柄		<2.2%>		
ユーロ(ポルトガル)		百株	百株	千ユーロ	千円		
JERONIMO MARTINS	114.16	133.3	300	48,483	48,483	生活必需品	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,094	1,480.83	652	105,329	105,329	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA	201.96	231.18	314	50,854	50,854	エネルギー	
国 小 計	株 数 、 金 額	1,410.12	1,845.31	1,267	204,668		
	銘柄数 < 比率 >	3 銘柄	3 銘柄		<0.0%>		
ユーロ(スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円		
CORPORACION ACCIONA ENERGIAS RENOV	—	29.38	78	12,688	12,688	公益事業	
TELEFONICA SA	2,104.78	2,425.11	942	152,284	152,284	コミュニケーション・サービス	
ENDESA SA	121	143.67	274	44,319	44,319	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTIA	2,677	2,793.58	2,429	392,355	392,355	金融	
IBERDROLA SA	2,395.38	2,858.48	3,231	521,921	521,921	公益事業	
REPSOL SA	572.01	606	849	137,269	137,269	エネルギー	
GRIFOLS SA	118.3	140.39	177	28,705	28,705	ヘルスケア	
BANCO SANTANDER SA	6,823.35	7,575.56	2,877	464,696	464,696	金融	
AMADEUS IT GROUP SA	180.86	211.19	1,347	217,685	217,685	一般消費財・サービス	
NATURGY ENERGY GROUP SA	103	103	280	45,248	45,248	公益事業	
CAIXABANK SA	1,749.27	1,950.84	818	132,239	132,239	金融	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	88.76	103.06	378	61,187	61,187	資本財・サービス	
AENA SME SA	29	35.15	550	88,846	88,846	資本財・サービス	
CELLNEX TELECOM SA	214.6	264.97	930	150,211	150,211	コミュニケーション・サービス	
ACCIONA SA	10.28	11.17	143	23,236	23,236	公益事業	
INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL	437.94	511.38	1,919	310,054	310,054	一般消費財・サービス	

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄		期首	当期末			業種等	
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額		
				外貨建金額			
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		百株 94.14	百株 —	千ユーロ —	千円 —	資本財・サービス	
ENAGAS SA		98.84	117.14	196	31,680	公益事業	
RED ELECTRICA CORPORACION SA		157	190.67	292	47,208	公益事業	
FERROVIAL SA		190.18	—	—	—	資本財・サービス	
EDP RENOVAVEIS SA		115.94	145.54	237	38,420	公益事業	
国小計	株数、金額	18,281.63	20,216.28	17,957	2,900,261		
	銘柄数 <比率>	20 銘柄	19 銘柄	<0.7%>			
ユーロ(イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円		
PRYSMIAN SPA		100.4	123.78	436	70,510	資本財・サービス	
ASSICURAZIONI GENERALI		446	488.78	927	149,754	金融	
MEDIOBANCA SPA		244.07	262.3	281	45,456	金融	
UNICREDIT SPA		832.17	862.65	2,184	352,844	金融	
TELECOM ITALIA SPA		3,787.82	4,343.74	114	18,479	コミュニケーション・サービス	
INTESA SANPAOLO		6,630.75	7,214.38	1,909	308,368	金融	
ATLANTIA SPA		195.31	—	—	—	資本財・サービス	
POSTE ITALIANE SPA		210.74	245.93	241	38,981	金融	
MONCLER SPA		82.61	96.54	492	79,551	一般消費財・サービス	
RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA		42.17	49.12	217	35,160	ヘルスケア	
ENI SPA		1,013.29	1,100.08	1,662	268,429	エネルギー	
DIASORIN SPA		10	11.44	98	15,919	ヘルスケア	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		128	158.1	178	28,854	コミュニケーション・サービス	
NEXI SPA		199	278.66	197	31,963	金融	
AMPLIFON SPA		47	56.32	159	25,687	ヘルスケア	
ENEL SPA		3,265.35	3,812.94	2,452	396,162	公益事業	
SNAM SPA		793.5	947.44	431	69,762	公益事業	
TERNA SPA		554.64	659.48	488	78,904	公益事業	
FINECOBANK SPA		232	286.93	351	56,699	金融	
国小計	株数、金額	18,814.82	20,998.61	12,825	2,071,491		
	銘柄数 <比率>	19 銘柄	18 銘柄	<0.5%>			
ユーロ(フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円		
UPM-KYMMENE OYJ		214.28	250.22	800	129,321	素材	
NOKIA OYJ		2,172.54	2,511.61	815	131,714	情報技術	
WARTSILA OYJ ABP		191.24	222.36	282	45,609	資本財・サービス	
STORA ENSO OYJ-R SHS		214	263.2	315	50,947	素材	
ELISA OYJ		57.25	64.14	264	42,721	コミュニケーション・サービス	
SAMPO OYJ-A SHS		196.22	215.14	845	136,608	金融	
FORTUM OYJ		169	210.78	273	44,119	公益事業	
KESKO OYJ-B SHS		104	123.55	216	34,890	生活必需品	
KONE OYJ-B		133.75	159.31	649	104,876	資本財・サービス	
NESTE OYJ		169.85	198.34	678	109,555	エネルギー	
ORION OYJ-CLASS B		40	48.46	176	28,567	ヘルスケア	
METSO CORPORATION		—	313.51	285	46,087	資本財・サービス	
国小計	株数、金額	3,662.13	4,580.62	5,603	905,022		
	銘柄数 <比率>	11 銘柄	12 銘柄	<0.2%>			
ユーロ(オーストリア)		百株	百株	千ユーロ	千円		
VERBUND AG		27.4	32.05	271	43,844	公益事業	
OMV AG		56.5	69.2	272	44,001	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG		135.46	161.16	591	95,604	金融	

**外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)**

銘柄		期首	当期末			業種等	
		株数	株数	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
VOESTALPINE AG		百株 42.5	百株 54.8	千ユーロ 142	千円 23,047	素材	
国小計	株数、金額	261.86	317.21	1,278	206,497		
	銘柄数 <比率>	4 銘柄	4 銘柄		<0.0%>		
ユーロ(その他) DSM FIRMENICH AG AEGON LTD		百株 — 720.59	百株 87.74 774.29	千ユーロ 764 382	千円 123,527 61,802	素材 金融	
国小計	株数、金額	720.59	862.03	1,147	185,330		
	銘柄数 <比率>	1 銘柄	2 銘柄		<0.0%>		
ユ一口通貨計	株数、金額	73,283.3	84,049.52	220,781	35,658,394		
	銘柄数 <比率>	224 銘柄	222 銘柄		<8.6%>		
ファンド合計	株数、金額	452,459.55	543,575.93	—	373,664,357		
	銘柄数 <比率>	1,209 銘柄	1,213 銘柄		<89.9%>		

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

(注2) <>内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (2) 外国投資証券

銘柄	期首	当期末		
	□数	□数	評価額	邦貨換算金額
			外貨建金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカ・ドル	千円
AVALONBAY COMMUNITIES INC	5.837	6.937	1,185	174,284
SIMON PROPERTY GROUP INC	13.607	15.807	1,940	285,384
BOSTON PROPERTIES INC	6.2	7.2	410	60,357
VORNADO REALTY TRUST	6.297	—	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	4.5	5.2	1,275	187,520
EQUITY RESIDENTIAL	14.8	17.4	984	144,789
EQUINIX INC	3.808	4.508	3,643	535,902
AMERICAN TOWER CORP	18.9	22.5	4,639	682,265
HOST HOTELS & RESORTS INC	29.043	34.443	600	88,342
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	13	15.7	561	82,639
KIMCO REALTY CORP	25	30	570	83,918
HEALTHCARE REALTY TRUST INC CLASS	15.5	18.5	279	41,165
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11	12.7	582	85,694
INVITATION HOMES INC	25.2	29.6	975	143,483
VICI PROPERTIES INC	39.8	48.6	1,439	211,711
VENTAS INC	16.5	19.4	880	129,561
WEYERHAEUSER CO	30.814	35.414	1,122	165,104
CROWN CASTLE INTL CORP	17.9	21	2,435	358,200
IRON MOUNTAIN INC	11.8	14.1	892	131,222
SUN COMMUNITIES INC	5	6	768	112,949
PROLOGIS INC	38.154	44.654	5,047	742,363
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6.4	7.9	861	126,653
CAMDEN PROPERTY TRUST	4.2	5.2	466	68,637
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2.7	3.1	657	96,759
WELLTOWER INC	18.8	24	2,116	311,317

外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末			
		口数	千円	評価額	外貨建金額
				邦貨換算金額	千円
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	千口	21.9	26.5	454	66,800
MID-AMERICA APARTMENT COMM		4.8	5.6	693	102,010
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		7.2	8.6	602	88,649
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		17.9	23.9	432	63,621
REALTY INCOME CORP	24.895		32.595	1,749	257,280
PUBLIC STORAGE		6.5	7.7	1,985	292,056
REGENCY CENTERS CORP		6.3	8.1	497	73,227
UDR INC		12.9	15.1	502	73,929
WP CAREY INC		8	10.3	640	94,206
DIGITAL REALTY TRUST INC		11.8	14.1	1,948	286,583
EXTRA SPACE STORAGE INC		5.6	10.5	1,360	200,024
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		24.2	—	—	—
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額	536.755	612.858	45,207	6,648,620
	銘柄数 < 比率 >	37 銘柄	35 銘柄		<1.6%>
(カナダ)	千口	千円	千カナダ・ドル	千円	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		3.4	3.8	174	18,841
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		5.8	6.9	120	13,014
カナダ・ドル通貨計	口数、金額	9.2	10.7	294	31,855
	銘柄数 < 比率 >	2 銘柄	2 銘柄		<0.0%>
(オーストラリア)	千口	千円	千オーストラリア・ドル	千円	
DEXUS/AU		40.978	48.731	341	33,241
LENDELEASE GROUP		25.3	31,401	209	20,410
TRANSURBAN GROUP		119.689	138,948	1,782	173,724
APA GROUP		45.041	53.35	449	43,775
SCENTRE GROUP		203.007	235,284	618	60,301
GPT GROUP		73.031	86,791	354	34,507
MIRVAC GROUP		144.9	173.08	340	33,227
STOCKLAND		91.123	104,777	426	41,556
GOODMAN GROUP		65.537	76,496	1,783	173,839
VICINITY CENTRES		151.865	175,417	318	31,026
オーストラリア・ドル通貨計	口数、金額	960.471	1,124.275	6,625	645,611
	銘柄数 < 比率 >	10 銘柄	10 銘柄		<0.2%>
(香港)	千口	千円	千香港・ドル	千円	
LINK REIT		90.8	131.5	5,115	96,373
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		107	—	—	—
HKT TRUST AND HKT LTD-SS		163	197	1,654	31,176
香港・ドル通貨計	口数、金額	360.8	328.5	6,770	127,549
	銘柄数 < 比率 >	3 銘柄	2 銘柄		<0.0%>
(シンガポール)	千口	千円	千シンガポール・ドル	千円	
CAPITALAND ASCENDAS REIT		144.5	194	550	60,814
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		220.07	276.67	511	56,496
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		140.8	170.2	275	30,434
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIAL TRUS		101.3	112.7	154	17,042
シンガポール・ドル通貨計	口数、金額	606.67	753.57	1,492	164,788
	銘柄数 < 比率 >	4 銘柄	4 銘柄		<0.0%>

**外国株式インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)**

銘柄	期首		当期末		
	口数	口数	評価額		邦貨換算金額 千円
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス) LAND SECURITIES GROUP PLC SEGRO PLC BRITISH LAND CO PLC	千口	千口	千円	千円	千円
	28.317	33.482	210	39,323	
	48.274	55.182	452	84,584	
	35.395	—	—	—	
イギリス・ポンド通貨計	□数、金額	111,986	88,664	663	123,908
	銘柄数 <比率>	3銘柄	2銘柄		<0.0%>
ユーロ(ベルギー) WAREHOUSES DE PAUW SCA	千口	千口	千円	千円	千円
	6.192	7.389	188	30,455	
国小計	□数、金額	6.192	7.389	188	30,455
	銘柄数 <比率>	1銘柄	1銘柄		<0.0%>
ユーロ(フランス) UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD GECINA SA KLEPIERRE COVIVIO	千口	千口	千円	千円	千円
	4.6	5.554	318	51,363	
	1.817	2.164	218	35,370	
	8.527	10.126	233	37,778	
	2	2.399	106	17,187	
国小計	□数、金額	16.944	20.243	877	141,700
	銘柄数 <比率>	4銘柄	4銘柄		<0.0%>
ユ一口通貨計	□数、金額	23.136	27.632	1,065	172,156
	銘柄数 <比率>	5銘柄	5銘柄		<0.0%>
合計	□数、金額	2,609,018	2,946,199	—	7,914,490
	銘柄数 <比率>	64銘柄	60銘柄		<1.9%>

(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。

# 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)

## (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	S&P500 EMINI FUT (アメリカ)	百万円 24,004	百万円 —
	S&P/TSX 60 IX FUT (カナダ)	1,783	—
	SPI 200 FUTURES (オーストラリア)	1,202	—
	FTSE 100 IDX FUT (イギリス)	1,738	—
	SWISS MKT IX FUTR (ドイツ)	1,366	—
	EURO STOXX 50 (ドイツ)	4,102	—

(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のです。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年11月30日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 373,664,357	% 89.7
投資証券	7,914,490	1.9
コール・ローン等、その他	34,833,809	8.4
投資信託財産総額	416,412,657	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

(注2) 外貨建資産は、期末の時価を対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートで邦貨換算したものです。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=147.07円、1カナダ・ドル=108.21円、1オーストラリア・ドル=97.45円、1香港・ドル=18.84円、1シンガポール・ドル=110.38円、1ニュージーランド・ドル=90.70円、1イギリス・ポンド=186.84円、1イスラエル・シユケル=39.913円、1イスイス・フラン=168.56円、1デンマーク・クローネ=21.66円、1ノルウェー・クローネ=13.81円、1スウェーデン・クローネ=14.21円、1ユーロ=161.51円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産(394,774,332千円)の投資信託財産総額(416,412,657千円)に対する比率は、94.8%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年11月30日現在

項目	当期末
(A)資産	437,391,983,390円
コール・ローン等	25,889,333,630
株式(評価額)	373,664,357,535
投資証券(評価額)	7,914,490,575
未収入金	21,749,483,507
未収配当金	501,157,490
差入委託証拠金	7,673,160,653
(B)負債	21,521,967,015
未払金	21,409,528,115
未払解約金	112,438,900
(C)純資産総額(A-B)	415,870,016,375
元本	78,806,686,628
次期繰越損益金	337,063,329,747
(D)受益権総口数	78,806,686,628□
1万口当たり基準価額(C/D)	52,771円

\*期首における元本額は69,133,888,947円、当造成期間中における追加設定元本額は14,051,097,197円、同解約元本額は4,378,299,516円です。

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額:

ダイワ外国株式インデックスV A	253,960,411円
ダイワ国内重視バランスファンド3 0 V A (一般投資家私募)	2,398,033円
ダイワ国内重視バランスファンド5 0 V A (一般投資家私募)	27,113,381円
ダイワ国際分散バランスファンド3 0 V A (一般投資家私募)	4,173,336円
ダイワ国際分散バランスファンド5 0 V A (一般投資家私募)	132,412,472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)	99,283,243円
ダイワバランスファンド2023-01 (適格機関投資家専用)	90,561,111円
ダイワバランスファンド(外貨建インデックスエマージングプラス(為替ヘッジなし))	751,588,780円
ダイワバランスファンドラップ(外貨建インデックスエマージングプラス(為替ヘッジなし))	4,575,264,354円
ダイワアンドラップオンライン(外貨建インデックスエマージングプラス(為替ヘッジなし))	565,403,560円
D - I's 外国株式インデックス	20,741,287円
D C ダイワ・ターゲットイヤー2050	52,732,027円
i F r e e 外国株式インデックス(為替ヘッジなし)	7,602,914,266円
i F r e e 8 資産バランス	1,483,695,864円
i F r e e 年金バランス	320,411,034円
DC ダイワ・ターゲットイヤー2060	3,052,677円
DC ダイワ外国株式インデックス	47,516,377,923円
ダイワ・ライフ・バランス3 0	507,111,516円
ダイワ・ライフ・バランス5 0	1,075,299,438円
ダイワ・ライフ・バランス7 0	1,029,409,746円
大和DC 海外株式インデックスファンド	2,012,098,874円
DC ダイワ・ターゲットイヤー2030	12,430,841円
DC ダイワ・ターゲットイヤー2040	12,894,554円
ダイワつみたてインデックス外国株式	2,126,545,615円
ダイワつみたてインデックスバランス3 0	2,059,357円
ダイワつみたてインデックスバランス5 0	2,504,278円
ダイワつみたてインデックスバランス7 0	5,293,680円
ダイワ先進国株式インデックス(為替ヘッジなし)(投資一任専用)	11,365,941円
ダイワ世界バランスファンド4 0 V A	54,089,276円
ダイワ世界バランスファンド6 0 V A	34,472,185円
ダイワ・バランスファンド3 5 V A	912,121,494円
ダイワ・バランスファンド2 5 V A (適格機関投資家専用)	48,039,078円
ダイワバランスファンド2021-02 (適格機関投資家専用)	140,584,660円
ダイワ・インデックスセレクト 外国株式	1,397,074,322円
ダイワ・ノーロード 外国株式ファンド	429,662,271円
ダイワ外国株式インデックス(為替ヘッジなし)(ダイワSMA専用)	2,299,488,278円
ダイワ投信俱楽部外国株式インデックス	3,021,971,653円
ダイワライフスタイル2 5	8,689,227円
ダイワライフスタイル5 0	39,113,782円
ダイワライフスタイル7 5	32,628,804円
ダイワバランスファンド2023-08 (適格機関投資家専用)	89,653,999円

\*当期末の計算口数当りの純資産額は52,771円です。

## ■損益の状況

当期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日

項目	当期
(A)配当等収益	6,771,854,280円
受取配当金	6,504,570,354
受取利息	44,080,104
その他収益金	227,504,113
支払利息	△ 4,300,291
(B)有価証券売買損益	62,831,381,001
売買益	84,924,975,155
売買損	△ 22,093,594,154
(C)先物取引等損益	2,566,038,828
取引益	3,359,283,660
取引損	△ 793,244,832
(D)その他費用	△ 59,415,452
(E)当期損益金 (A+B+C+D)	72,109,858,657
(F)前期繰越損益金	229,239,375,441
(G)解約差損益金	△ 16,142,416,184
(H)追加信託差損益金	51,856,511,833
(I)合計 (E+F+G+H)	337,063,329,747
次期繰越損益金 (I)	337,063,329,747

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

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

## 《お知らせ》

## ■ベンチマークの変更について

ベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。

変更前：MSCIコクサイ指数（円ベース）

変更後：MSCIコクサイ指数（配当込み、円ベース）

# 外国債券インデックス ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

## 運用報告書 (全体版) 第6期

(決算日 2023年11月30日)

(作成対象期間 2022年12月1日～2023年11月30日)

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあざ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運用を行なっています。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

### 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	無期限（設定日：2018年9月18日）	
運用方針	投資成果を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っています。	
主要投資対象	ベビーファンド	外国債券インデックスマザーファンドの受益証券
	外 国 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ フ ア ン ド	外国の公社債
組入制限	ベビーファンドの マザーファンド 組入上限比率	無制限
	マザーファンド の 株 式 組 入 上 限 比 率	純資産総額の30%以下
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。	

## 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) (ベンチマーク)	期中騰落率	公社債組入比率	債券先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率					
2期末(2019年12月2日)	円 10,401	円 0	% 4.2	10,442	% 4.5	% 98.3	% —	百万円 90
3期末(2020年11月30日)	10,853	0	4.3	10,929	4.7	98.4	—	272
4期末(2021年11月30日)	11,291	0	4.0	11,363	4.0	98.5	—	663
5期末(2022年11月30日)	11,362	0	0.6	11,440	0.7	98.0	—	1,100
6期末(2023年11月30日)	12,309	0	8.3	12,484	9.1	96.9	—	1,944

(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、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したもので、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



### 基準価額・騰落率

期 首：11,362円

期 末：12,309円（分配金0円）

騰落率：8.3%（分配金込み）

### 基準価額の主な変動要因

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

外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

年 月 日	基 準 価 額	F T S E 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		公 組 入 比	債 券 先 債 率	債 券 先 物 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)			
(期首) 2022年11月30日	円 11,362	% —	11,440	% —	% 98.0	% —
12月末	10,805	△4.9	10,955	△4.2	98.0	—
2023年 1月末	10,931	△3.8	11,044	△3.5	97.8	—
2月末	11,063	△2.6	11,154	△2.5	97.8	—
3月末	11,200	△1.4	11,249	△1.7	97.6	—
4月末	11,281	△0.7	11,389	△0.4	97.5	—
5月末	11,571	1.8	11,697	2.3	97.6	—
6月末	12,033	5.9	12,144	6.2	97.4	—
7月末	11,771	3.6	11,850	3.6	97.4	—
8月末	12,090	6.4	12,197	6.6	97.4	—
9月末	11,910	4.8	12,030	5.2	97.4	—
10月末	11,894	4.7	11,997	4.9	97.2	—
(期末) 2023年11月30日	12,309	8.3	12,484	9.1	96.9	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2022.12.1～2023.11.30)

### ■ 海外債券市況

#### 主要国の国債金利はやや上昇しました。

当作成期首より、米国金利はさほど変化はないものの、欧州圏、英國国債の金利などは上昇しました。

2023年1月以降は、長期のインフレ期待の低下などから米国金利が低下（債券価格は上昇）する中、その他主要国の金利も低下基調で推移しました。しかし5月には、F R B（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め観測から米国金利が上昇し、その他主要国の金利も上昇しました。7月から10月にかけては、底堅い経済指標を背景に利上げの継続スタンスが意識されたことなどを受けて米国金利は上昇しました。その後当作成期末にかけては、雇用およびインフレ関連指標が市場予想を下回ったことなどから、米国金利は低下しました。その他欧州等主要国の国債金利も低下しました。

### ■ 為替相場

#### 為替相場は、ノルウェー・クローネなど一部の通貨を除き大きく円安が進みました。

対円為替相場は、当作成期首より、米国金利が低下したことなどから日米金利差の縮小により円高が進行し、主要国の通貨は下落（円高）しました。2023年1月以降の主要国通貨は強弱まちまちで推移しましたが、3月には、米国地方銀行の経営破綻により市場のリスク回避姿勢が強まることなどから、主要国通貨は対円で下落しました。4月以降は、F R B（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め観測から米国金利が上昇する中、日米金利差の拡大により円安米ドル高が進行したことなどから、主要国通貨も円に対して上昇（円安）基調で推移しました。9月以降も、中国の過度な景気減速懸念が後退したことなどから対円で上昇し、当作成期末を迎えるました。

## 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スマザーファンド

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

## ポートフォリオについて

(2022.12.1～2023.11.30)

## ■当ファンド

「外国債券インデックススマザーファンド」を高位に組み入れました。

## ■外国債券インデックススマザーファンド

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

\*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

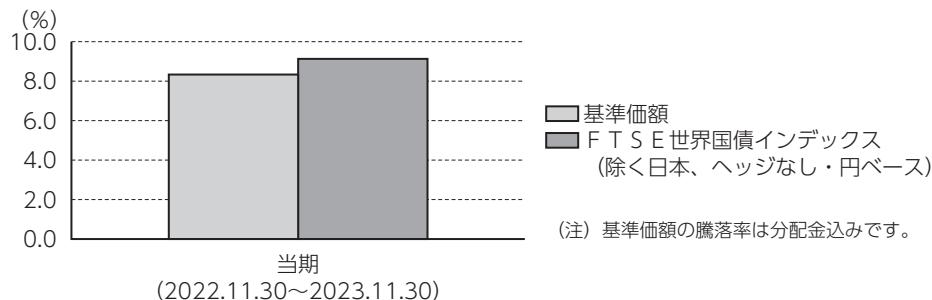
組入ファンド	ベンチマーク
外国債券インデックススマザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

## 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9.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は8.3%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。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。

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

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期
	2022年12月1日 ～2023年11月30日
<b>当期分配金（税込み）（円）</b>	—
対基準価額比率 (%)	—
当期の収益 (円)	—
当期の収益以外 (円)	—
<b>翌期繰越分配対象額 (円)</b>	2,308

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

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

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

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

「外国債券インデックススマザーファンド」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。

## 1万口当たりの費用の明細

項目	当期 (2022.12.1～2023.11.30)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	16円	0.143%	信託報酬＝当成期中の平均基準価額×信託報酬率 当成期中の平均基準価額は11,542円です。
(投信会社)	(13)	(0.110)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(1)	(0.011)	販売会社分は、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	－	－	売買委託手数料＝当成期中の売買委託手数料／当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＝当成期中の有価証券取引税／当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	3	0.022	その他費用＝当成期中のその他費用／当成期中の平均受益権口数
(保管費用)	(2)	(0.014)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管および資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監査費用)	(1)	(0.008)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	19	0.164	

(注1) 当成期中の費用（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1万口当たりのそれぞれの費用金額を当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「1万口当たりの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

## ■売買および取引の状況

### 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千 口	千円	千 口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	222,025	712,324	3,545	11,592

(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
	千 口	千 口	千円
外国債券インデックススマザーファンド	347,889	566,369	1,942,872

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックススマザーファンド	1,942,872	99.8
コール・ローン等、その他	3,215	0.2
投資信託財産総額	1,946,088	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あります。なお、11月30日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=147.07円、1カナダ・ドル=108.21円、1オーストラリア・ドル=97.45円、1シンガポール・ドル=110.38円、1ニュージーランド・ドル=90.70円、1イギリス・ポンド=186.84円、1イスラエル・シェケル=39.913円、1デンマーク・クローネ=21.66円、1ノルウェー・クローネ=13.81円、1スウェーデン・クローネ=14.21円、1メキシコ・ペソ=8.51円、1オフショア人民元=20.60円、1マレーシア・リンギット=31.591円、1ポーランド・ズロチ=37.184円、1ユーロ=161.51円です。

(注3) 外国債券インデックススマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（281,210,137千円）の投資信託財産総額（283,408,201千円）に対する比率は、99.2%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,946,088,912円
コール・ローン等	3,215,916
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	1,942,872,996
(B) 負債	1,291,848
未払信託報酬	1,221,470
その他未払費用	70,378
(C) 純資産総額(A-B)	1,944,797,064
元本	1,579,992,181
次期繰越損益金	364,804,883
(D) 受益権総口数	1,579,992,181口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,309円

\*期首における元本額は968,932,462円、当作成期間中における追加設定元本額は622,611,264円、同解約元本額は11,551,545円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は12,309円です。

## ■損益の状況

当期 自2022年12月1日 至2023年11月30日

項 目	当 期 末
(A) 配当等収益	△ 541円
受取利息	1
支払利息	△ 542
(B) 有価証券売買損益	141,862,887
売買益	142,424,413
売買損	△ 561,526
(C) 信託報酬等	△ 2,235,391
(D) 当期損益金(A+B+C)	139,626,955
(E) 前期繰越損益金	27,590,486
(F) 追加信託差損益金	197,587,442
(配当等相当額)	( 102,269,286)
(売買損益相当額)	( 95,318,156)
(G) 合計(D+E+F)	364,804,883
次期繰越損益金(G)	364,804,883
追加信託差損益金	197,587,442
(配当等相当額)	( 102,269,286)
(売買損益相当額)	( 95,318,156)
分配準備積立金	167,217,982
繰越損益金	△ 541

(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	139,627,496
(c) 収益調整金	197,587,442
(d) 分配準備積立金	27,590,486
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	364,805,424
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	364,805,424
(h) 受益権総口数	1,579,992,181□

外国債券インデックススマザーファンド  
運用報告書 第24期（決算日 2023年11月30日）  
(作成対象期間 2022年12月1日～2023年11月30日)

外国債券インデックス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

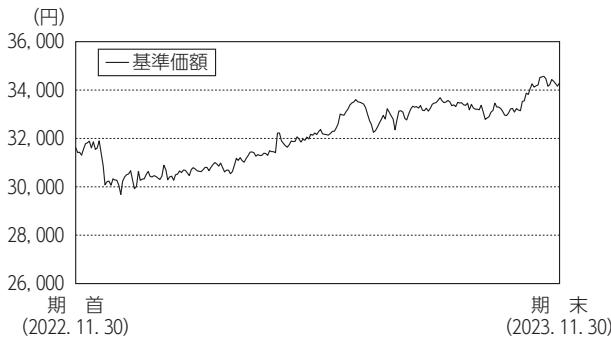
大和アセットマネジメント

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/>

## ■当成期中の基準価額と市況等の推移



## 《運用経過》

## ◆基準価額等の推移について

## 【基準価額・騰落率】

期首：31,615円 期末：34,304円 謄落率：8.5%

## 【基準価額の主な変動要因】

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

## ◆投資環境について

## ○海外債券市況

主要国の国債金利は上昇しました。

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

## ○為替相場

為替相場は円安となりました。

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

## ◆前成期末における「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

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

当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（両者の月次收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世界債券インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。

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

(注1) 謄落率は期首比。

(注2) FTSE世界債券インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、同指数の原データをもとに、当ファンドの設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。FTSE世界債券インデックス（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。

## 《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。

## ■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	一円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用)	4 ( 4)
(その他)	( 0)
合計	4

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■ 売買および取引の状況

## 公社債

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

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

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

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

# 外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

## ■主要な売買銘柄

### 公社債

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

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

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

### (1) 外国(外貨建) 公社債(通貨別)

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

**外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)**

作成期		当期				末			
区分		額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	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年末満
ユ	アイルランド	千ユーロ 11,546	千ユーロ 10,187	千円 1,645,306	% 0.6	—	% 0.4	% 0.1	% 0.1
	オランダ	千ユーロ 28,349	千ユーロ 26,097	千円 4,214,970	1.5	—	1.0	0.4	0.1
	ベルギー	千ユーロ 33,793	千ユーロ 30,648	千円 4,950,081	1.7	—	1.2	0.4	0.1
	フランス	千ユーロ 159,178	千ユーロ 144,699	千円 23,370,409	8.2	—	4.7	2.4	1.1
	ドイツ	千ユーロ 119,095	千ユーロ 111,086	千円 17,941,500	6.3	—	3.6	2.0	0.7
□	スペイン	千ユーロ 92,350	千ユーロ 86,007	千円 13,891,150	4.9	—	2.8	1.5	0.7
	イタリア	千ユーロ 138,576	千ユーロ 129,521	千円 20,918,985	7.4	—	4.2	2.4	0.9
	フィンランド	千ユーロ 11,177	千ユーロ 9,729	千円 1,571,376	0.6	—	0.3	0.2	0.1
	オーストリア	千ユーロ 23,038	千ユーロ 20,415	千円 3,297,356	1.2	—	0.7	0.3	0.1
	小計	617,102	568,392	91,801,136	32.4	—	18.9	9.8	3.8
合計		—	—	274,718,308	97.0	—	49.2	32.1	15.7

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

## (2) 外国(外貨建)公社債(銘柄別)

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.0000	千アメリカ・ドル 855	千アメリカ・ドル 880	千円 129,448	2026/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.1250	709	755	111,078	2027/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.2500	738	769	113,226	2028/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	6.2500	714	791	116,439	2030/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.3750	2,391	2,559	376,382	2031/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,176	1,204	177,148	2036/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	5.0000	847	905	133,136	2037/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	548	547	80,496	2038/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	519	523	76,984	2038/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.5000	1,049	936	137,745	2039/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,121	1,090	160,336	2039/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.5000	1,060	1,058	155,738	2039/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,210	1,189	174,915	2039/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.6250	1,010	1,020	150,136	2040/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,678	1,643	241,642	2040/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.8750	1,091	1,001	147,312	2040/08/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.2500	1,469	1,411	207,587	2040/11/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.7500	1,254	1,279	188,210	2041/02/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	4.3750	1,365	1,329	195,535	2041/05/15
	United States Treasury Note/Bond	国債証券	3.7500	1,517	1,361	200,174	2041/08/15

外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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

## 外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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

## 外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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

## 外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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

## 外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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

## 外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

		当 期			末		
区 分		銘 柄	種 類	年利 率	額 面 金 額	評 価 額	
				%	千アメリカ・ドル	外 貨 建 金 額	邦貨換算金額
		UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND	国債証券	4.8750	2,000	千アメリカ・ドル	千円
通貨小計	銘柄数	275銘柄			2,055	302,296	2028/10/31
	金 額				1,018,352	898,347	132,119,911
カナダ					千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	
		Canada Government International Bond	国債証券	2.7500	605	528	57,195
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	983	1,092	118,167
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7500	1,117	1,315	142,354
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	5.0000	1,012	1,168	126,493
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	913	977	105,807
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	961	974	105,405
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,337	1,198	129,644
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,156	1,121	121,408
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	969	914	98,925
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,240	1,131	122,490
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	650	608	65,839
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	3,710	2,797	302,708
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,220	1,144	123,887
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	3,450	2,997	324,306
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	700	673	72,835
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,890	2,711	293,403
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,000	1,627	176,083
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,100	1,932	209,138
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	300	277	30,073
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	3,400	2,945	318,712
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	2,650	1,856	200,867
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,200	2,029	219,652
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,100	1,803	195,106
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	200	192	20,821
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	1,500	1,331	144,070
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	100	93	10,109
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	386	41,820
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,000	978	105,913
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,270	2,089	226,098
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	360	354	38,357
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	200	198	21,509
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	300	297	32,174
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	600	586	63,490
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	600	562	60,916
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	300	297	32,181
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	352	38,136
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,200	1,182	127,905
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	500	493	53,417
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,000	978	105,859
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,000	2,012	217,725
		CANADIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.0000	300	306	33,134
通貨小計	銘柄数	41銘柄					
	金 額				50,893	46,522	5,034,152
オーストラリア		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	1,989	2,034	198,307
		AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,354	1,299	126,610

外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	期末		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	%			千円	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	1,798	1,774	172,951	2025/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	2,258	2,283	222,574	2033/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	1,748	1,756	171,184	2026/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.7500	1,113	1,031	100,537	2037/04/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,307	1,112	108,395	2035/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.2500	792	676	65,946	2039/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,672	1,594	155,387	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	1,178	1,092	106,459	2028/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	1,252	956	93,200	2047/03/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,500	1,412	137,632	2028/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,900	1,762	171,716	2029/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,870	2,600	253,374	2030/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	1,390	1,079	105,238	2041/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	2,840	2,338	227,871	2031/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,700	2,117	206,340	2032/05/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	2,400	2,308	224,931	2024/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,000	1,610	156,910	2030/12/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,400	771	75,222	2051/06/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	1,600	1,484	144,654	2025/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	2,500	1,949	189,978	2031/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,200	1,089	106,146	2026/09/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	1,600	1,294	126,140	2032/11/21	
	AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.0000	1,300	1,158	112,856	2033/11/21	
	AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.7500	1,200	1,137	110,883	2034/05/21	
	AUSTRALIA (COMMONWEALTH OF)	国債証券	3.5000	1,100	1,015	98,912	2034/12/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	900	917	89,414	2054/06/21	
通貨小計	銘柄数	28銘柄						
	金額				46,861	41,660	4,059,779	
シンガポール	SINGAPORE GOVERNMENT	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル					
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.5000	772	781	86,210	2027/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	809	806	88,984	2030/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	400	386	42,633	2042/04/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.3750	568	587	64,856	2033/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	625	623	68,815	2029/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	524	515	56,899	2025/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.7500	688	661	72,979	2046/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.1250	450	437	48,329	2026/06/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.2500	750	695	76,741	2036/08/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	550	543	59,944	2028/05/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.3750	350	323	35,757	2039/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	540	430	47,505	2050/03/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	0.5000	750	709	78,331	2025/11/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.6250	600	546	60,333	2031/07/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.8750	500	398	43,955	2051/10/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	1.2500	200	189	20,917	2026/11/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.6250	240	234	25,881	2032/08/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	3.0000	620	635	70,112	2072/08/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	100	99	11,010	2027/09/01	
	SINGAPORE GOVERNMENT	国債証券	2.8750	400	398	44,026	2028/08/01	
通貨小計	銘柄数	20銘柄						
	金額				10,436	10,003	1,104,228	

## 外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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

外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	当期		償還年月日
					評価額	外貨建金額	
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	3.7500	2,500	千イギリス・ポンド 2,150	401,706	2053/10/22
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.0000	800	728	136,124	2063/10/22
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.5000	700	711	132,994	2028/06/07
	UNITED KINGDOM GILT	国債証券	4.6250	1,000	1,037	193,794	2034/01/31
	United Kingdom Gilt	国債証券	6.0000	949	1,033	193,184	2028/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	2,240	2,280	426,092	2032/06/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	5.0000	1,472	1,477	275,963	2025/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,362	1,362	254,476	2036/03/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,357	1,406	262,841	2038/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,708	1,621	302,975	2055/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,366	1,298	242,543	2046/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,232	1,240	231,851	2027/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	2,116	2,103	393,005	2042/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.7500	1,600	1,677	313,418	2030/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,343	1,272	237,777	2049/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,446	1,410	263,570	2039/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.5000	1,560	1,602	299,485	2034/09/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.0000	1,174	1,072	200,464	2060/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	4.2500	1,577	1,528	285,630	2040/12/07
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.7500	1,552	1,349	252,162	2052/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.2500	1,866	1,539	287,665	2044/01/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,386	1,142	213,486	2068/07/22
	United Kingdom Gilt	国債証券	3.5000	1,524	1,298	242,602	2045/01/22
通貨小計	銘柄数	58銘柄					
	金額				90,238	73,673	13,765,099
イスラエル	Israel Government Bond - Fixed	国債証券	6.2500	1,800	千イスラエル・ジュケル 1,921	76,690	2026/10/30
		国債証券	5.5000	1,600	1,796	71,703	2042/01/31
		国債証券	1.7500	2,300	2,219	88,582	2025/08/31
		国債証券	2.0000	1,800	1,699	67,826	2027/03/31
		国債証券	3.7500	2,400	2,107	84,127	2047/03/31
		国債証券	2.2500	1,200	1,115	44,542	2028/09/28
		国債証券	1.0000	2,400	1,999	79,814	2030/03/31
		国債証券	0.5000	1,600	1,527	60,980	2025/04/30
		国債証券	1.5000	1,700	1,201	47,964	2037/05/31
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	0.5000	200	185	7,416	2026/02/27
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	0.4000	900	872	34,815	2024/10/31
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	1.3000	300	240	9,604	2032/04/30
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	2.8000	600	422	16,867	2052/11/29
		ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED	3.7500	3,000	2,981	118,985	2029/02/28
通貨小計	銘柄数	14銘柄					
	金額				21,800	20,291	809,921
デンマーク	DANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	13,662	千デンマーク・クローネ 16,570	358,908	2039/11/15
		国債証券	1.7500	6,013	5,892	127,628	2025/11/15
		国債証券	0.5000	5,100	4,720	102,242	2027/11/15
		国債証券	0.5000	8,590	7,659	165,896	2029/11/15
		国債証券	0.2500	3,500	1,770	38,353	2052/11/15
		国債証券	—	500	409	8,868	2031/11/15
		国債証券	—	1,000	968	20,986	2024/11/15

## 外国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

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

外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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

## 外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

		当 期			末		
区 分	銘 柄	種 類	年利 率	額 面 金 額	評 価 額		償還月日
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	%	千オフショア・人民元	千オフショア・人民元	千円		
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.3000	7,000	6,973	143,666	2026/05/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.6700	40,000	39,894	821,832	2033/05/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.0000	9,000	8,938	184,141	2025/06/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.6200	33,000	32,888	677,515	2030/06/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.4000	35,000	34,750	715,865	2028/07/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.5200	40,000	39,384	811,334	2023/08/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.1800	30,000	29,766	613,191	2026/08/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.4800	25,000	24,885	512,656	2028/09/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.2200	30,000	29,883	615,620	2025/09/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.6000	20,000	19,916	410,277	2030/09/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.5500	20,000	19,985	411,711	2028/10/15	
通貨小計	銘柄数	64銘柄					
	金 額			894,500	904,995	18,643,275	
マレーシア	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	2,373	2,358	74,525	2027/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4980	1,178	1,220	38,544	2030/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.3920	1,514	1,540	48,681	2026/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2320	1,300	1,325	41,880	2031/06/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8920	731	736	23,263	2027/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8440	1,427	1,414	44,701	2023/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	1,886	1,885	59,563	2028/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9350	1,300	1,419	44,843	2043/09/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	1,737	1,750	55,316	2025/09/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	1,220	1,239	39,172	2035/05/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7360	930	981	30,992	2046/03/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	1,550	1,563	49,388	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	1,190	1,198	37,872	2027/11/16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	1,950	2,079	65,696	2037/04/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	1,200	1,208	38,174	2025/03/14
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	1,200	1,278	40,401	2033/11/07
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	2,000	2,187	69,096	2038/06/08
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	650	656	20,741	2026/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	2,310	2,310	72,978	2029/08/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	1,200	1,303	41,176	2048/07/06
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	1,300	1,279	40,427	2034/07/05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	1,750	1,651	52,165	2040/05/22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	2,650	2,528	79,878	2050/06/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	1,800	1,650	52,156	2031/04/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	1,400	1,363	43,066	2032/07/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	1,900	2,021	63,874	2042/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5040	500	516	16,301	2029/04/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4570	700	715	22,614	2053/03/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5190	1,000	995	31,437	2028/04/20
通貨小計	銘柄数	29銘柄					
	金 額			41,846	42,382	1,338,933	
ポーランド	Poland Government Bond	国債証券	2.5000	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ		
	Poland Government Bond	2.5000	4,377	4,083	151,845	2026/07/25	
	Poland Government Bond	2.7500	3,170	2,886	107,341	2027/07/25	
	Poland Government Bond	0.7500	4,840	4,237	157,559	2029/10/25	
	Poland Government Bond	0.7500	2,000	1,880	69,911	2025/04/25	

外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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

## 外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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

外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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

## 外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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

外国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,800	2,605	420,852
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	92	14,877
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	3,000	2,881	465,361
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	430	413	66,834
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2000	100	99	16,036
		GERMAN GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	100	100	16,183
国小計	銘柄数 金額	61銘柄			119,095	111,086	17,941,500
ヨーロ(スペイン)		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	6.0000	千ユーロ	千ユーロ	2029/01/31
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.6000	2,652	3,027	488,988
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,045	1,997	322,585
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1500	2,052	1,910	308,563
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9500	2,192	2,155	348,163
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	2,733	2,664	430,270
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	1,952	1,642	265,316
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,550	1,335	215,730
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3000	2,630	2,507	404,972
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	1,900	1,809	292,258
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	1,750	1,603	258,974
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	2,050	1,936	312,736
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,400	2,244	362,583
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7000	2,200	1,754	283,355
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4000	2,900	2,703	436,599
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	1,600	1,476	238,388
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	2,250	1,888	304,988
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.6000	2,800	2,432	392,859
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	2,560	2,178	351,917
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,404	388,366
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	1,400	718	116,073
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	2,400	2,220	358,668
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	2,400	2,121	342,698
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2000	1,300	873	141,107
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	500	468	75,611
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1000	2,200	1,759	284,143
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.4500	650	296	47,835
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	2,500	2,212	357,336
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8500	1,900	1,321	213,513
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	1,900	1,543	249,306
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.0000	600	372	60,174
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	900	819	132,368
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	2,100	1,709	276,125
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	1.9000	600	381	61,562
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	—	100	95	15,390
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	0.8000	1,100	972	157,032
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	1,700	1,601	258,584
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.4500	1,000	931	150,453
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1500	1,500	1,473	237,921
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	2,300	2,285	369,169
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.9000	800	805	130,027
		SPANISH GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5500	1,500	1,515	244,808

## 外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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

## 外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

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

## 外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	当期			償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	評価額	
		Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	国債証券	% 3.5000	千ユーロ 2,318	千ユーロ 2,300	千円 371,576	2030/03/01	
国小計	銘柄数 金額	89銘柄			138,576	129,521	20,918,985		
ユーロ(フィンランド)		Finland Government Bond	国債証券	0.7500	千ユーロ 364	千ユーロ 314	50,820	2031/04/15	
		Finland Government Bond	国債証券	0.8750	279	268	43,442	2025/09/15	
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	811	768	124,195	2026/04/15	
		Finland Government Bond	国債証券	1.3750	360	254	41,044	2047/04/15	
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	800	738	119,255	2027/09/15	
		Finland Government Bond	国債証券	1.1250	470	391	63,299	2034/04/15	
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	451	72,856	2028/09/15	
		Finland Government Bond	国債証券	0.5000	500	441	71,285	2029/09/15	
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	310	214	34,705	2036/04/15	
		Finland Government Bond	国債証券	0.2500	400	247	39,971	2040/09/15	
		Finland Government Bond	国債証券	—	500	414	67,006	2030/09/15	
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	400	177	28,717	2052/04/15	
		Finland Government Bond	国債証券	0.1250	600	486	78,646	2031/09/15	
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	—	200	185	29,913	2026/09/15	
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.5000	450	274	44,255	2043/04/15	
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.5000	800	713	115,252	2032/09/15	
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	1.3750	270	258	41,726	2027/04/15	
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	400	377	61,029	2038/04/15	
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	300	300	48,553	2033/09/15	
		FINLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8750	1,000	1,007	162,743	2029/04/15	
		Finland Government Bond	国債証券	4.0000	667	676	109,250	2025/07/04	
		Finland Government Bond	国債証券	2.7500	389	390	63,062	2028/07/04	
		Finland Government Bond	国債証券	2.6250	407	373	60,342	2042/07/04	
国小計	銘柄数 金額	23銘柄			11,177	9,729	1,571,376		
ユーロ(オーストリア)		Austria Government Bond	国債証券	1.2000	千ユーロ 1,373	千ユーロ 1,329	214,783	2025/10/20	
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,126	1,062	171,656	2026/10/20	
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	784	559	90,389	2047/02/20	
		Austria Government Bond	国債証券	1.5000	240	135	21,940	2086/11/02	
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,187	191,831	2027/04/20	
		Austria Government Bond	国債証券	2.1000	540	378	61,078	2117/09/20	
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	1,106	178,760	2028/02/20	
		Austria Government Bond	国債証券	0.5000	1,280	1,141	184,374	2029/02/20	
		Austria Government Bond	国債証券	—	980	824	133,184	2030/02/20	
		Austria Government Bond	国債証券	0.7500	1,200	664	107,342	2051/03/20	
		Austria Government Bond	国債証券	—	400	234	37,866	2040/10/20	
		Austria Government Bond	国債証券	0.8500	350	150	24,252	2120/06/30	
		Austria Government Bond	国債証券	—	1,200	978	157,972	2031/02/20	
		Austria Government Bond	国債証券	—	480	460	74,302	2025/04/20	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.2500	600	416	67,293	2036/10/20	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.7000	300	128	20,701	2071/04/20	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	—	300	262	42,433	2028/10/20	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	0.9000	1,500	1,280	206,775	2032/02/20	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	300	226	36,660	2049/05/23	
		AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0000	300	293	47,473	2026/07/15	

# 外国債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	期末		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
AUSTRIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9000	%	千ユーロ 300	千ユーロ 298	48,149	2033/02/20
	国債証券	3.1500		300	290	46,995	2053/10/20
	国債証券	2.9000		1,000	1,009	162,976	2029/05/23
	国債証券	3.4500		800	829	134,014	2030/10/20
	Austria Government Bond	6.2500		825	923	149,125	2027/07/15
	Austria Government Bond	4.1500		1,373	1,514	244,538	2037/03/15
	Austria Government Bond	4.8500		875	912	147,378	2026/03/15
	Austria Government Bond	3.8000		338	374	60,493	2062/01/26
	Austria Government Bond	3.1500		723	712	114,996	2044/06/20
	Austria Government Bond	2.4000		771	728	117,613	2034/05/23
国小計	銘柄数	30銘柄					
	金額			23,038	20,415	3,297,356	
通貨小計	銘柄数	375銘柄					
	金額			617,102	568,392	91,801,136	
合計	銘柄数	974銘柄					
	金額					274,718,308	

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

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年11月30日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
公社債	千円 274,718,308	% 96.9
コール・ローン等、その他	8,669,892	3.1
投資信託財産総額	283,408,201	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨て。

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

(注3) 当期末における外貨建純資産(281,210,137千円)の投資信託財産総額(283,408,201千円)に対する比率は、99.2%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2023年11月30日現在

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

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

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

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

ダイワライフスタイル25

ダイワライフスタイル50

ダイワライフスタイル75

26,830,233円

59,333,757円

16,514,057円

\*当期末の計算口数当りの純資産額は34,304円です。

## ■損益の状況

当期 自 2022年12月1日 至 2023年11月30日

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

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

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

# 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)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／株式／インデックス型	
信託期間	無期限（設定日：2018年9月18日）	
運用方針	投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンドの受益証券
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	1. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。） 2. 新興国の企業の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）
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、分配を行なわないことがあります。	

## 運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2024年7月5日)

(作成対象期間 2023年7月6日～2024年7月5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、新興国の株式に投資し、投資成果をFTSE RAFI エマージング インデックス（円換算）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

### 大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

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

## 最近5期の運用実績

決算期 (分配落)	基準価額			FTSE RAFI エマージング インデックス (税引後配当込み、円換算) (ベンチマーク)	株式組入比率	株式先物比率	投資証券組入比率	純資産額 百万円
	税込み分配金	期中騰落率	期中騰落率					
2期末(2020年7月6日)	円 9,097	円 0	% △ 13.9	% 9,155	% △ 14.0	% 82.6	% 3.0	% 13.7 28
3期末(2021年7月5日)	12,539	0	37.8	12,600	37.6	88.1	8.7	2.9 57
4期末(2022年7月5日)	12,633	0	0.7	12,750	1.2	81.5	7.5	10.5 103
5期末(2023年7月5日)	14,744	0	16.7	15,101	18.4	82.9	7.5	8.9 188
6期末(2024年7月5日)	18,780	0	27.4	19,575	29.6	82.3	5.8	11.2 310

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

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

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

(注6) 株式組入比率は新株予約権証券を含みます。

(注7) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



# 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指数化したものです。

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

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

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

## ■ 基準価額・騰落率

期首：14,744円

期末：18,780円（分配金0円）

騰落率：27.4%（分配金込み）

## ■ 基準価額の主な変動要因

ベンチマークへの連動をめざした運用を行いました。米国における追加利上げへの警戒感の後退を受けた世界的な株高や、中国の景気支援策への期待を背景に、新興国株式市況が上昇したこと、また新興国為替相場が対円で上昇（円安）したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

年 月 日	基 準 価 額		FTSE RAFI エマージング インデックス (税引後配当込み、円換算)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資証券 組入比率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率	%			
円 (期首) 2023年7月5日	14,744	—	15,101	—	82.9	7.5	8.9
7月末	14,938	1.3	15,277	1.2	81.1	9.2	8.9
8月末	14,697	△ 0.3	15,081	△ 0.1	80.2	9.0	8.8
9月末	14,566	△ 1.2	14,961	△ 0.9	81.8	8.9	8.5
10月末	14,209	△ 3.6	14,623	△ 3.2	81.0	8.7	8.4
11月末	14,852	0.7	15,302	1.3	90.8	4.8	3.9
12月末	14,985	1.6	15,459	2.4	89.4	4.8	4.7
2024年1月末	15,296	3.7	15,788	4.6	88.5	5.4	5.6
2月末	16,067	9.0	16,628	10.1	87.5	6.9	5.5
3月末	16,290	10.5	16,889	11.8	85.7	7.0	7.2
4月末	17,430	18.2	18,135	20.1	84.4	6.7	8.6
5月末	17,807	20.8	18,550	22.8	85.3	5.3	8.5
6月末	18,297	24.1	19,058	26.2	83.2	5.3	10.4
(期末) 2024年7月5日	18,780	27.4	19,575	29.6	82.3	5.8	11.2

(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

(2023.7.6～2024.7.5)

### ■新興国株式市況

#### 新興国株式市況は上昇しました。

新興国株式市況は、当成期首より、中国の景気対策への期待から上昇して始まつたものの、米国国債の増発やF R B（米国連邦準備制度理事会）の政策金利見通しの引き上げ、米国政府機関の閉鎖懸念などによる長期金利の大幅な上昇、パレスチナ情勢の悪化などが嫌気され、2023年10月末にかけて下落しました。11月以降は、F R Bの利上げ見送りによる追加利上げへの警戒感の後退や、約1年ぶりに実施された米中首脳会談による地政学リスクの後退などを背景に上昇しました。2024年1月以降も、中国の経済指標の悪化や、イランとイスラエルの紛争などを背景とした中東情勢の悪化から一時的に下落する局面も見られたものの、A I（人工知能）関連の半導体関連企業のけん引、中国の全国人民代表大会で強気な経済成長目標が打ち出され景気刺激策への期待が強まつたこと、米国で雇用者数の増加ペースが落ち着き年内の利下げ期待が回復したことなどを背景に、上昇基調で推移しました。

### ■為替相場

#### 新興国為替相場は対円で上昇しました。

新興国為替相場は、米ドルから大きな影響を受けて推移しました。当成期首より、米国の雇用や物価などの経済指標が市場予想を下振れたことや、日銀の金融緩和策の修正観測などを受け、米ドルは対円で下落（円高）しました。2023年8月以降は、米国金利が上昇した一方で日銀は緩和的な金融政策の維持を発表したことから、米ドルは対円で上昇しました。この期間、新興国通貨は米ドルに対して一進一退で推移したため、新興国通貨対円為替相場は米ドル対円為替相場と同じ推移となりました。その後は、日銀による政策修正や米国金利の大幅な低下を受け、米ドルは対円で下落しました。しかし2024年に入ってからは、日銀がマイナス金利を早期に解除するとの期待が後退したことや、米国金利の上昇を背景に円安米ドル高に転じました。その後は、日銀がマイナス金利の解除など大規模な金融緩和の終了を発表したものの、他国・地域に比べて緩和的な環境が続く見通しや、各国の相対感から新興国の為替相場についても円安が進行しました。当成期末にかけても、日本の円買い為替介入の観測で一時的に円高に振れる場面もありましたが、日銀が緩和的な金融政策を継続していることから円安基調が継続しました。

## 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、主として「ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド」の受益証券に投資します。

### ■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

(2023.7.6～2024.7.5)

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

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

\*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

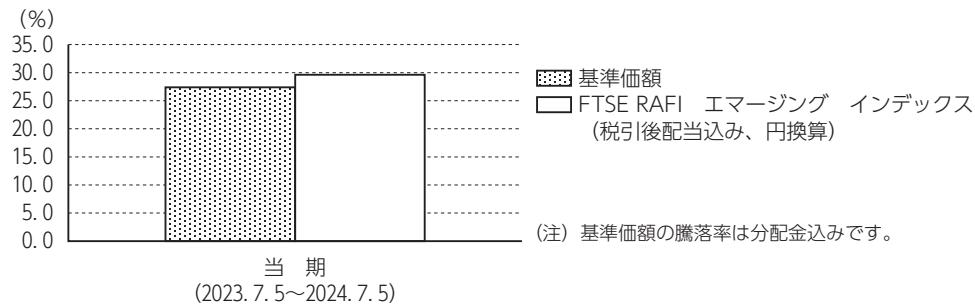
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	FTSE RAFI エマージング インデックス（税引後配当込み、円換算）

## ベンチマークとの差異について

当成期のベンチマークの騰落率は29.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は27.4%となりました。

売買手数料・保管費用等のコスト負担が、マイナス要因となりました。なお、組み入れている株式ポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、株価指数先物とベンチマークとの騰落率の差異、ファンドとベンチマークの為替評価基準のずれも、かい離要因としてあげられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



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

## 分配金について

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

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2023年7月6日 ～2024年7月5日	
<b>当期分配金（税込み）（円）</b>	—	
対基準価額比率（%）	—	
当期の収益（円）	—	
当期の収益以外（円）	—	
<b>翌期繰越分配対象額（円）</b>	9,093	

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

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

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

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項目	当期 (2023.7.6～2024.7.5)		項目の概要
	金額	比率	
信託報酬	22円	0.143%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は15,667円です。
(投信会社)	(17)	(0.110)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販売会社)	(2)	(0.011)	販売会社分は、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.022)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売買委託手数料	9	0.058	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)	(7)	(0.043)	
(先物・オプション)	(1)	(0.007)	
(投資証券)	(1)	(0.008)	
有価証券取引税	6	0.036	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)	(6)	(0.036)	
(投資証券)	(0)	(0.000)	
その他費用	62	0.393	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)	(16)	(0.100)	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)	(45)	(0.288)	インドキャピタルゲイン課税、信託事務の処理等に関するその他の費用
合計	99	0.630	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

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

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

# 新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

## ■売買および取引の状況

### 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2023年7月6日から2024年7月5日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
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	千口 25,749	千円 58,100	千口 1,353	千円 3,374

(注) 単位未満は切捨て。

## ■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2023年7月6日から2024年7月5日まで)

項 目	当 期
	ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	11,402,056千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	26,659,981千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.42

(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

当生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
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	千口 83,781	千口 108,177	千円 310,318

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2024年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド	310,318	99.9
コール・ローン等、その他	289	0.1
投資信託財産総額	310,607	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=161.17円、1香港・ドル=20.64円、台湾・ドル=4.958円、1トルコ・リラ=4.938円、1メキシコ・ペソ=8.919円、100チリ・ペソ=17.217円、1サウジアラビア・リアル=43.04円、1インド・ルピー=1.94円、100インドネシア・ルピア=0.99円、1ブラジル・リアル=29.358円、1オフショア・人民元=22.096円、1マレーシア・リンギット=34.219円、1南アフリカ・ランド=8.83円、1タイ・バーツ=4.40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(38,774,854千円)の投資信託財産総額(39,408,461千円)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

2024年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	310,607,927円
コール・ローン等	287,062
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)	310,318,165
未収入金	2,700
(B)負債	200,881
未払信託報酬	193,525
その他未払費用	7,356
(C)純資産総額 (A - B)	310,407,046
元本	165,287,373
次期繰越損益金	145,119,673
(D)受益権総口数	165,287,373口
1万口当り基準価額 (C / D)	18,780円

\*期首における元本額は127,800,995円、当生成期間中ににおける追加設定元本額は39,363,191円、同解約元本額は1,876,813円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は18,780円です。

## ■損益の状況

当期 自 2023年7月6日 至 2024年7月5日

項目	当期
(A) 有価証券売買損益	66,908,989円
売買益	67,218,080
売買損	△ 309,091
(B) 信託報酬等	△ 357,093
(C) 当期損益金 (A + B)	66,551,896
(D) 前期繰越損益金	36,198,002
(E) 追加信託差損益金	42,369,775
(配当等相当額)	(47,550,188)
(売買損益相当額)	△ 5,180,413
(F) 合計 (C + D + E)	145,119,673
次期繰越損益金 (F)	145,119,673
追加信託差損益金	42,369,775
(配当等相当額)	(47,550,188)
(売買損益相当額)	△ 5,180,413
分配準備積立金	102,749,898

(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	66,551,896
(c) 収益調整金	47,550,188
(d) 分配準備積立金	36,198,002
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	150,300,086
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	150,300,086
(h) 受益権総口数	165,287,373□

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

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

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

## ダイワ新興国株式ファンダメンタル・インデックス・マザーファンド

### 運用報告書 第14期（決算日 2024年7月5日）

（作成対象期間 2023年7月6日～2024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ないます。
主要投資対象	1. 新興国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および店頭登録予定を含みます。） 2. 新興国の企業の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

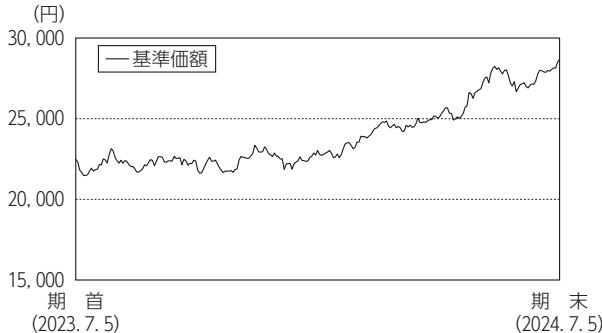
## 大和アセットマネジメント

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/>

## ■当成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基 準 価 額	FTSE RAFI エマージング インデックス（税引後配当込み、円換算）		株 式 組 入 比	株 式 先 比	投 証 物 率	資 券 組 入 率
		騰 落 率 (%)	ペ チ マーク				
(期首) 2023年7月5日	22,484	—	24,752	—	82.9	7.5	8.9
7月末	22,779	1.3	25,041	1.2	81.2	9.2	8.9
8月末	22,410	△ 0.3	24,719	△ 0.1	80.2	9.0	8.8
9月末	22,213	△ 1.2	24,523	△ 0.9	81.9	8.9	8.5
10月末	21,674	△ 3.6	23,969	△ 3.2	81.0	8.7	8.4
11月末	22,657	0.8	25,081	1.3	90.8	4.8	3.9
12月末	22,871	1.7	25,338	2.4	89.5	4.8	4.7
2024年1月末	23,347	3.8	25,879	4.6	88.6	5.5	5.6
2月末	24,528	9.1	27,255	10.1	87.5	6.9	5.5
3月末	24,872	10.6	27,683	11.8	85.7	7.0	7.2
4月末	26,617	18.4	29,724	20.1	84.4	6.7	8.6
5月末	27,196	21.0	30,405	22.8	85.3	5.3	8.5
6月末	27,948	24.3	31,238	26.2	83.2	5.3	10.4
(期末) 2024年7月5日	28,686	27.6	32,085	29.6	82.3	5.8	11.2

(注1) 謙落率は期首比。

(注2) FTSE RAFI エマージング インデックス（税引後配当込み、円換算）は、FTSE International Limited の承諾を得て、FTSE RAFI エマージング インデックス（税引後配当込み、米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。同指數に関する著作権、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、同指數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) 海外の指數は、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) 指數値は、指數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。上記の指數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・謙落率】

期首：22,484円 期末：28,686円 謙落率：27.6%

## 【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークへの運動をめざした運用を行いました。米国における追加利上げへの警戒感の後退を受けた世界的な株高や、中国の景気支援策への期待を背景に、新興国株式市況が上昇したこと、また新興国為替相場が対円で上昇（円安）したことがプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

## ◆投資環境について

## ○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、当成期首より、中国の景気対策への期待から上昇して始まつものの、米国国債の増発やF R B（米国連邦準備制度理事会）の政策金利見通しの引き上げ、米国政府機関の閉鎖懸念などによる長期金利の大幅な上昇、パレスチナ情勢の悪化などが嫌気され、2023年10月末にかけて下落しました。11月以降は、F R B の利上げ見送りによる追加利上げへの警戒感の後退や、約1年ぶりに実施された米中首脳会談による地政学リスクの後退などを背景に上昇しました。2024年1月以降も、中国の経済指標の悪化や、イランとイスラエルの紛争などを背景とした中東情勢の悪化から一時的に下落する局面も見られたものの、A I（人工知能）関連の半導体関連企業のけん引、中国の全国人民代表大会で強気な経済成長目標が打ち出され景気刺激策への期待が強まつたこと、米国で雇用者数の増加ペースが落ちきり年内の下下げ期待が回復したことなどを背景に、上昇基調で推移しました。

## ○為替相場

## 新興国為替相場は対円で上昇しました。

新興国為替相場は、米ドルから大きな影響を受けて推移しました。当成期首より、米国の雇用や物価などの経済指標が市場予想を下振れたことや、日銀の金融緩和策の修正観測などを受け、米ドルは対円で下落（円高）しました。2023年8月以降は、米国金利が上昇した一方で日銀は緩和的な金融政策の維持を発表したことから、米ドルは対円で上昇しました。この期間、新興国通貨は米ドルに対して一進一退で推移したため、新興国通貨対円為替相場は米ドル対円為替相場と同じ推移となりました。その後は、日銀による政策修正や米国金利の大幅な低下を受け、米ドルは対円で下落しました。しかし2024年に入ってからは、日銀がマイナス金利を早期に解除すると期待が後退したことや、米国金利の上昇を背景に円安米ドル高に転じました。その後は、日銀がマイナス金利の解除など大規模な金融緩和の終了を発表したものの、他国・地域に比べて緩和的な環境が続く見通しや、各国の相対感から新興国の為替相場についても円安が進行しました。当成期末にかけても、日本の円買い為替介入の観測で一時的に円高に振れる場面もありましたが、日銀が緩和的な金融政策を継続していることから円安基調が継続しました。

## ◆前作成期末における「今後の運用方針」

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

## ◆ポートフォリオについて

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

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

# 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)

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。

## ◆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29.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は27.6%となりました。

売買手数料・保管費用等のコスト負担が、マイナス要因となりました。なお、組み入れている株式ポートフォリオとベンチマークとの騰落率の差異、株価指数先物とベンチマークとの騰落率の差異、ファンドとベンチマークの為替評価基準のズレも、かい離要因としてあげられます。

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

## 《今後の運用方針》

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

## ■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料 (株式)	13円 ( 10)
(先物・オプション)	2)
(投資証券)	2)
有価証券取引税 (株式)	8
(投資証券)	8)
その他費用 (保管費用)	92
(その他)	( 24)
合計	113

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■売買および取引の状況

### (1) 株式

(2023年7月6日から2024年7月5日まで)

	買付		売付		
	株数	金額	株数	金額	
外 国	アメリカ	百株 1,310 ( 899.42)	千アメリカ・ドル 934 ( —)	百株 442	千アメリカ・ドル 535
	香港	百株 139,950.5 ( 1,115)	千香港・ドル 139,127 (△ 19)	百株 105,580.2	千香港・ドル 43,723
	台湾	百株 32,750 ( 562.23)	千台湾・ドル 229,437 (△ 310)	百株 33,589.48	千台湾・ドル 206,168
	トルコ	百株 3,437.64 ( 5,519.57)	千トルコ・リラ 18,384 ( —)	百株 5,890.27	千トルコ・リラ 21,414
	メキシコ	百株 1,791 ( 140.8)	千メキシコ・ペソ 5,560 ( —)	百株 7,796.8	千メキシコ・ペソ 26,905
	チリ	百株 4,783.99 ( —)	千チリ・ペソ 283,241 ( —)	百株 24,305.26	千チリ・ペソ 355,901
	サウジアラビア	百株 1,387.68 ( 113.22)	千サウジアラビア・リアル 5,383 ( —)	百株 288.87	千サウジアラビア・リアル 1,993
	インド	百株 12,537.69 ( 4,198.48)	千インド・ルピー 358,873 ( —)	百株 10,946.73	千インド・ルピー 645,480
	インドネシア	百株 1,911 ( 3,311)	千インドネシア・ルピア 942,560 ( —)	百株 26,638	千インドネシア・ルピア 13,057,814
	ブラジル	百株 9,193 (△1,782.5)	千ブラジル・レアル 20,569 (△ 25)	百株 18,226.38	千ブラジル・レアル 30,448
外 国	中国	百株 18,324 ( 25)	千オフショア・人民元 15,461 ( 2)	百株 3,517	千オフショア・人民元 2,734
	マレーシア	百株 587 ( —)	千マレーシア・リンギット 682 ( —)	百株 3,300	千マレーシア・リンギット 1,424
	南アフリカ	百株 5,104.36 ( —)	千南アフリカ・ランド 36,116 ( —)	百株 3,539.85	千南アフリカ・ランド 24,179
	タイ	百株 21,536 ( —)	千タイ・バーツ 36,855 (△ 207)	百株 32,268	千タイ・バーツ 26,224

(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。

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）

(2) 投資証券

(2023年7月6日から2024年7月5日まで)

銘柄	買付 □数	付		売付 □数	金額
		千口	千アメリカ・ドル		
アメリカ INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	900	17,906		576.1	10,651
メキシコ FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	113.1	3,157		—	—
南アフリカ GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	301.81	3,499		—	—

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(3) 先物取引の種類別取引状況

(2023年7月6日から2024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 11,677	百万円 11,969	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

(2023年7月6日から2024年7月5日まで)

銘柄	当期			銘柄	当期		
	買付 株数	金額	平均単価		売付 株数	金額	平均単価
ALIBABA GROUP HOLDING LTD (ケイマン諸島)	千株 344.3	千円 484,753	円 1,407	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC (台湾)	千株 81	千円 287,191	円 3,545
VALE SA (ブラジル)	139.5	254,630	1,825	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE (インド)	39,674	187,483	4,725
TENCENT HOLDINGS LTD (ケイマン諸島)	39.9	230,869	5,786	TATA MOTORS LTD (インド)	102,176	176,001	1,722
HDFC BANK LIMITED (インド)	86,136	226,944	2,634	PETROCHINA CO LTD-H (中国)	1,202	149,471	124
PING AN INSURANCE GROUP CO-H (中国)	268	192,562	718	RELIANCE INDUSTRIES LTD (インド)	25,345	131,915	5,204
JD. COM INC - CL A (ケイマン諸島)	90.15	186,751	2,071	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF (ブラジル)	124.8	129,792	1,040
BANK OF CHINA LTD-H (中国)	2,558	160,528	62	REC LTD (インド)	123,584	99,015	801
IND & COMM BK OF CHINA-H (中国)	2,053	159,815	77	HON HAI PRECISION INDUSTRY (台湾)	148	91,987	621
MEITUAN-CLASS B (ケイマン諸島)	59.3	112,271	1,893	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H (中国)	1,177	73,181	62
CHINA CONSTRUCTION BANK-H (中国)	1,097	105,254	95	POWER FINANCE CORPORATION (インド)	104,312	72,168	691

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

# 新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

## ■組入資産明細表

### (1)外国株式

銘柄	期首	当期末				業種等	
		株数	株数	評価額	邦貨換算金額		
				外貨建金額			
	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
(アメリカ)							
SURGUTNEfteGAZ-SP ADR PREF	290	290	—	—	エネルギー		
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	259	213	292	47,099	一般消費財・サービス		
TAL EDUCATION GROUP- ADR	172	—	—	—	一般消費財・サービス		
CANADIAN SOLAR INC	43	74	116	18,748	情報技術		
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	156	129	192	31,061	コミュニケーション・サービス		
NIO INC - ADR	153	—	—	—	一般消費財・サービス		
PINDUODUO INC-ADR	15	25	343	55,337	一般消費財・サービス		
KE HOLDINGS INC-ADR	118	166	262	42,298	不動産		
LUFAX HOLDING LTD-ADR	1,215	638.75	188	30,369	金融		
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	—	91	144	23,217	情報技術		
SBERBANK ROSSI	6,987.08	6,987.08	—	—	金融		
JINKOSOLAR HOLDING ADR REP LTD	35	76	168	27,192	情報技術		
BANK VTB	3,824,340	3,824,340	—	—	金融		
NK LUKOIL	230.88	230.88	—	—	エネルギー		
MOBILNYE TELESISTEMY	707	707	—	—	コミュニケーション・サービス		
NK ROSNEFT	974.99	974.99	—	—	エネルギー		
MAGNIT	46.78	46.78	—	—	生活必需品		
SURGUTNEfteGAZ	3,607.5	3,607.5	—	—	エネルギー		
TATNEFT	576.48	576.48	—	—	エネルギー		
GAZPROM	8,534.78	8,534.78	—	—	エネルギー		
GMK NORILSKIY NIKEI	18.29	1,829	—	—	素材		
NOVATEK	269.8	269.8	—	—	エネルギー		
360 DIGITECH ADR INC	79	102	207	33,503	金融		
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	72.9	72.9	—	—	素材		
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	0.03	0.03	—	—	素材		
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	0.04	—	—	—	生活必需品		
SEVERSTAL - GDR REG S	134.6	134.6	—	—	素材		
TATNEFT PJSC - PREF	210.09	210.09	—	—	エネルギー		
SISTEMA PJSFC	3,192	3,192	—	—	コミュニケーション・サービス		
INTER RAO UES PJSC	27,261	27,261	—	—	公益事業		
ALROSA PJSC	1,803.1	1,803.1	—	—	素材		
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	566.19	566.19	—	—	金融		
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	—	687	123	19,897	エネルギー		
AEROFLOT PJSC	1,649.1	1,649.1	—	—	資本財・サービス		
アメリカ・ドル通貨計	株数、金額	3,883,717.63	3,885,485.05	2,039	328,725		
	銘柄数 < 比率 >	32 銘柄	31 銘柄		<0.8%>		
(香港)		百株	百株	千香港・ドル	千円		
TRIP.COM GROUP LTD	137.5	116	4,588	94,716	一般消費財・サービス		
YUM CHINA HOLDINGS INC	79.5	121.5	2,976	61,440	一般消費財・サービス		
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	7,650	8,380	3,737	77,141	資本財・サービス		
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	2,980	4,280	3,723	76,855	一般消費財・サービス		
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT	—	3,810	1,524	31,455	資本財・サービス		
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	180	405	1,069	22,068	生活必需品		
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	1,160	—	—	—	生活必需品		
JIANGXI COPPER CO LTD-H	1,470	2,020	3,232	66,708	素材		
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,500	—	—	—	公益事業		
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	35,218	38,438	20,756	428,414	エネルギー		
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	655	—	—	—	資本財・サービス		

## 新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

銘 柏	期 首	当 期 末				業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額	外貨建金額 邦貨換算金額		
				千香港・ドル 千円			
TENCENT HOLDINGS LTD	百株	百株	百株	48,794	1,007,113	コミュニケーション・サービス	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	877	1,276	—	—	—	不動産	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	5,440	—	—	—	—	公益事業	
PETROCHINA CO LTD-H	1,580	1,660	4,150	85,656	325,386	エネルギー	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	28,740	18,460	15,764	—	—	一般消費財・サービス	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	375	—	—	—	—	不動産	
HUANENG POWER INTL INC-H	15,931.2	—	—	—	—	不動産	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	3,560	3,860	2,258	46,607	—	公益事業	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,200	1,775	3,454	71,293	—	素材	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	900	—	—	—	—	公益事業	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	55,000	65,970	36,547	754,337	—	金融	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,140	—	—	—	—	金融	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	8,160	12,510	6,054	124,971	—	金融	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	1,075	—	—	—	—	不動産	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	996	834	673	13,908	—	金融	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	375	—	—	—	—	生活必需品	
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	9,220	10,530	4,580	94,542	—	金融	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	2,400	1,905	7,181	148,233	—	エネルギー	
SINOPHARM GROUP CO-H	2,111.2	3,431.2	2,110	43,554	—	ヘルスケア	
CHINA RESOURCES LAND LTD	696	776	1,606	33,154	—	ヘルスケア	
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LTD	1,900	1,525	4,262	87,975	—	不動産	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,180	2,275	2,634	54,375	—	エネルギー	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	2,955	5,045	1,377	28,427	—	ヘルスケア	
BYD CO LTD-H	403	604	1,727	35,654	—	公益事業	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	70	175	4,105	84,737	—	一般消費財・サービス	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	42,240	33,120	11,525	237,891	—	金融	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	936	828	1,303	26,899	—	金融	
CITIC LTD	7,330	8,320	2,279	47,052	—	金融	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,840	1,680	1,226	25,312	—	資本財・サービス	
IND & COMM BK OF CHINA-H	2,415	3,225	3,799	78,412	—	素材	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	69,560	90,090	43,513	898,118	—	金融	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	240	915	1,022	21,114	—	ヘルスケア	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	1,705	—	—	—	—	ヘルスケア	
CHINA TOWER CORP LTD-H	620	2,450	1,212	25,031	—	不動産	
XIAOMI CORP-CLASS B	20,480	18,060	1,878	38,766	—	コミュニケーション・サービス	
MEITUAN-CLASS B	5,904	6,078	10,235	211,257	—	情報技術	
SEAZEN GROUP LTD	311.9	904.9	10,831	223,565	—	一般消費財・サービス	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	5,460	—	—	—	—	不動産	
CHINA FEIHE LTD	4,562	8,005	58,556	1,208,607	—	一般消費財・サービス	
CHINA ENERGY ENGINEERING C-H	1,870	—	—	—	—	生活必需品	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	5,180	7,080	615	12,713	—	資本財・サービス	
JD. COM INC - CL A	1,340	2,020	900	18,594	—	公益事業	
NETEASE INC	912.45	1,813.95	18,756	387,128	—	一般消費財・サービス	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	384	321	4,737	97,791	—	コミュニケーション・サービス	
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	69.5	—	—	—	—	資本財・サービス	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	351	195	1,253	25,879	—	一般消費財・サービス	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	4,200	6,160	1,016	20,978	—	資本財・サービス	
KUAISHOU TECHNOLOGY	732	1,006	2,525	52,117	—	一般消費財・サービス	
BAIDU INC-CLASS A	188	392	1,756	36,247	—	コミュニケーション・サービス	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	761.5	1,053.5	9,197	189,827	—	コミュニケーション・サービス	
CRRC CORP LTD - H	3,370	2,590	3,553	73,343	—	不動産	
CGN POWER CO LTD-H	2,990	3,050	1,570	32,420	—	資本財・サービス	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	7,100	5,400	1,895	39,121	—	公益事業	
	5,415	8,095	29,668	612,351	—	金融	

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	外貨建金額	
				邦貨換算額	千円	
CHINA COAL ENERGY CO-H	百株	百株	千香港・ドル			
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	1,630	1,440	1,293	26,689		エネルギー
YUEXIU PROPERTY CO LTD	2,400.5	4,655.5	6,461	133,372		資本財・サービス
CHINA MINSHENG BANKING COR-H	950	—	—	—		不動産
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	9,130.8	14,310.8	4,035	83,295		金融
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	35,840	27,840	1,350	27,868		不動産
CHINA VANKE CO LTD-H	156	254	1,836	37,903		一般消費財・サービス
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	2,480	6,062	2,927	60,432		不動産
CHINA MENNIU DAIRY CO	185	235	1,740	35,917		一般消費財・サービス
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	790	1,690	2,474	51,066		金融
LI NING CO LTD	5,000	4,320	4,246	87,648		生活必需品
WEICHAI POWER CO LTD-H	165	815	1,279	26,409		一般消費財・サービス
CHINA POWER INTERNATIONAL	1,590	1,270	1,635	33,762		資本財・サービス
SUNNY OPTICAL TECH	4,180	5,060	2,145	44,281		公益事業
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	134	290	1,328	27,414		情報技術
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,700	3,360	1,841	38,004		素材
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2,116	2,440	4,870	100,521		金融
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	696	965	1,127	23,263		ヘルスケア
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	3,270	3,620	3,924	80,993		金融
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	252	483	3,067	63,303		公益事業
KUNLUN ENERGY CO LTD	2,050	—	—	—		素材
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	—	1,340	1,191	24,587		公益事業
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	1,360	1,600	2,771	57,197		素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	1,100	—	—	—		資本財・サービス
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	3,180	—	—	—		素材
CHINA EVERGRANDE GROUP	11,091	10,111	5,904	121,875		金融
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	1,420	—	—	—		不動産
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	5,180	—	—	—		不動産
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	3,570	3,850	1,536	31,706		金融
SINOTRUK HONG KONG LTD	9,170	14,570	1,617	33,380		情報技術
CHINA MERCHANTS BANK-H	700	—	—	—		資本財・サービス
BANK OF CHINA LTD-H	2,210	3,015	10,296	212,514		金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	53,100	78,680	30,527	630,094		金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	765	1,035	1,155	23,840		金融
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	4,990	5,760	1,393	28,770		金融
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	2,312	2,680	967	19,968		金融
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	1,810	2,595	2,947	60,845		不動産
	1,240	2,800	1,027	21,209		情報技術
香港・ドル通貨計	株数、金額	574,695.05	610,180.35	522,646	10,787,414	
	銘柄数 < 比率 >	99 銘柄	80 銘柄	<27.6%>		
(台湾)	百株	百株	千台湾・ドル	千円		
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANUFACTUR	—	1,960	5,282	26,193		情報技術
WT MICROELECTRONICS LTD	—	270	3,240	16,066		情報技術
WINBOND ELECTRONICS CORP	—	102.88	16	83		情報技術
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	470	330	6,055	30,028		情報技術
GLOBALWAFERS CO LTD	90	100	5,810	28,810		情報技術
SINO-AMERICAN SILICON PRODUC	270	270	5,994	29,723		情報技術
TAIWAN CEMENT	3,812.47	2,662.47	9,092	45,087		素材
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	2,390	2,180	36,188	179,449		情報技術
WIVYNN CORP	—	20	5,460	27,075		情報技術
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	740	—	—	—		金融
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	1,171.12	1,021.12	8,597	42,634		生活必需品
FORMOSA PLASTICS CORP	1,176	976	5,621	27,877		素材

## 新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末				業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
NAN YA PLASTICS CORP	百株	百株	千台湾・ドル	千円		
WALSIN LIHWA CORP	1,311.4	821.4	4,061	20,141	素材	
CHINA STEEL CORP	1,330	1,590	5,692	28,226	資本財・サービス	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	4,526.86	3,706.86	8,711	43,196	素材	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	—	870	4,158	20,621	一般消費財・サービス	
DELTA ELECTRONICS INC	1,176.16	886.16	9,880	48,996	情報技術	
YAGEO CORPORATION	550	640	24,448	121,232	情報技術	
WINBOND ELECTRONICS CORP	167.34	187.34	14,106	69,952	情報技術	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	1,730	1,679.99	4,418	21,909	情報技術	
QISDA CORP	740	—	—	—	情報技術	
ACER INC	—	980	3,841	19,049	情報技術	
INVENTEC CORP	—	1,790	8,430	41,807	情報技術	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	170	160	8,800	43,637	情報技術	
QUANTA COMPUTER INC	1,100	1,060	32,754	162,420	情報技術	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	—	280	4,718	23,395	情報技術	
NANYA TECHNOLOGY CORP	—	750	5,557	27,558	情報技術	
AUO CORP	6,516	7,196	12,952	64,230	情報技術	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	1,624	1,174	13,911	68,986	コミュニケーション・サービス	
MEDIATEK INC	410.03	550.03	75,629	375,029	情報技術	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	400	300	6,810	33,769	情報技術	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	1,078	1,998	37,662	186,759	資本財・サービス	
YANG MING MARINE TRANSPORT	1,880	4,030	29,741	147,481	資本財・サービス	
CHINA AIRLINES LTD	1,710	2,020	4,989	24,741	資本財・サービス	
WAN HAI LINES LTD	580	1,260	10,886	53,983	資本財・サービス	
EVA AIRWAYS CORP	1,200	1,430	5,426	26,910	資本財・サービス	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	2,261.55	1,774.62	14,853	73,655	金融	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	4,198.38	2,328.38	14,133	70,084	金融	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	5,190	4,550	7,280	36,100	金融	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	3,836.1	2,141.4	6,263	31,059	金融	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	2,616.82	2,196.07	7,268	36,045	金融	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,865.17	2,138.24	8,969	44,480	金融	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	2,415.83	—	—	—	金融	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	4,332.31	—	—	—	金融	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	3,841.8	2,158.63	5,741	28,473	金融	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	5,790.28	6,040.28	24,010	119,061	金融	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	2,166.58	1,541.57	4,408	21,862	金融	
LARGAN PRECISION CO LTD	40	40	11,360	56,331	情報技術	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	260	220	13,640	67,638	情報技術	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	370	370	6,715	33,300	情報技術	
TRIPOD TECHNOLOGY CORP	—	200	4,460	22,116	情報技術	
TAIWAN MOBILE CO LTD	490	430	4,773	23,668	コミュニケーション・サービス	
WISTRON CORP	2,021.1	1,911.1	20,830	103,296	情報技術	
INNOLUX CORP	6,713.75	9,648.06	14,375	71,285	情報技術	
WPG HOLDINGS LTD	—	1,140	10,681	52,968	情報技術	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	770	540	4,919	24,394	コミュニケーション・サービス	
PEGATRON CORP	650	1,160	12,354	61,261	情報技術	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	430	530	7,367	36,531	情報技術	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	340.33	537.13	8,486	42,083	金融	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,685.6	—	—	—	金融	
SIMPLIO TECHNOLOGY CO LTD	—	110	4,317	21,409	情報技術	
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	—	300	5,640	27,967	情報技術	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	—	440	8,272	41,019	情報技術	
POU CHEN	1,300	—	—	—	一般消費財・サービス	

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額	
COMPAL ELECTRONICS	百株	百株	千台湾・ドル	千円	情報技術
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	1,720	6,730	23,083	114,468	情報技術
HON HAI PRECISION INDUSTRY	4,640	4,110	413,055	2,048,257	情報技術
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	5,419.02	4,279.02	91,784	455,143	情報技術
ASUSTEK COMPUTER INC	200	—	—	—	生活必需品
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	397.6	467.6	22,538	111,763	情報技術
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,520	—	—	—	資本財・サービス
台湾・ドル通貨計	4,740	6,230	33,642	166,823	情報技術
株数、金額	111,541.6	111,264.35	1,253,993	6,218,303	
銘柄数 <比率>	57 銘柄	64 銘柄	<15.9%>		
(トルコ)	百株	百株	千トルコ・リラ	千円	
AKBANK T. A. S.	3,857.43	2,847.64	19,150	94,581	金融
TURKIYE IS BANKASI-C	3,679.78	6,654.3	10,926	53,964	金融
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	1,260.32	847.88	9,114	45,016	コミュニケーション・サービス
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	579.46	522.58	9,098	44,934	エネルギー
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	1,121.8	2,617.15	14,381	71,027	素材
HACI OMER SABANCI HOLDING	1,006.94	1,634.02	16,699	82,478	金融
YAPI VE KREDI BANKASI	4,529.61	3,404.9	11,699	57,781	金融
KOC HOLDING AS	827.1	772.55	18,154	89,665	資本財・サービス
TURK HAVA YOLLARI AO	416.97	416.97	12,967	64,046	資本財・サービス
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	—	760.21	3,899	19,261	資本財・サービス
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	317.99	186.14	10,153	50,149	生活必需品
トルコ・リラ通貨計	17,597.4	20,664.34	136,246	672,906	
銘柄数 <比率>	10 銘柄	11 銘柄	<1.7%>		
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコ・ペソ	千円	
AMERICA MOVIL L	13,821	12,489	19,907	177,560	コミュニケーション・サービス
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	216.15	165.15	2,537	22,634	生活必需品
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	2,816	2,816	2,731	24,363	コミュニケーション・サービス
CEMEX SAB-CPO	12,061.19	8,456.19	9,411	83,946	素材
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	808	576	11,098	98,994	生活必需品
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	157	134	2,378	21,215	生活必需品
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	374	335	2,119	18,907	生活必需品
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	1,274	940	9,999	89,190	素材
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	1,536	1,467	9,014	80,404	生活必需品
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	1,093	913	13,472	120,162	金融
メキシコ・ペソ通貨計	34,156.34	28,291.34	82,672	737,381	
銘柄数 <比率>	10 銘柄	10 銘柄	<1.9%>		
(チリ)	百株	百株	千チリ・ペソ	千円	
BANCO SANTANDER CHILE	43,014.81	33,597.21	152,867	26,319	金融
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	24.72	75.71	302,317	52,050	資本財・サービス
FALABELLA SA	652.41	—	—	—	一般消費財・サービス
BANCO DE CHILE	23,452.13	13,949.88	151,746	26,126	金融
チリ・ペソ通貨計	67,144.07	47,622.8	606,931	104,497	
銘柄数 <比率>	4 銘柄	3 銘柄	<0.3%>		
(サウジアラビア)	百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
SAUDI ARABIAN MINING	184.18	199.64	842	36,260	素材
SABIC AGRI-NUTRIENTS	45.65	73.67	854	36,780	素材

## 新興国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

銘柄	期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額	
SAUDI AWWAL BANK	百株	百株	千サウジアラビア・リアル	千円	
ARAB NATIONAL BANK	—	158.5	596	25,684	金融
BANQUE SAUDI FRANSI	—	301.58	607	26,167	金融
SAHARA INTERNATIONAL PETROCHEMICAL	—	120.01	418	18,000	金融
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	305.37	206.17	594	25,600	素材
SAUDI TELECOM CO	500.96	186.97	1,383	59,549	素材
AL RAJHI BANK	376.78	556.72	2,112	90,932	コミュニケーション・サービス
RIYAD BANK	211.55	330.04	2,627	113,071	金融
ETIHAD ETISALAT CO	—	330.95	837	36,037	金融
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	—	110.98	571	24,599	コミュニケーション・サービス
ALINMA BANK	260.79	143	541	23,295	素材
THE SAUDI NATIONAL BANK	798.03	218.16	674	29,013	金融
SAUDI ARABIAN OIL CO	812.99	839.05	2,961	127,477	金融
		932.89	2,630	113,227	エネルギー
サウジアラビア・リアル通貨計	株数、金額	3,496.3	4,708.33	18,255	785,699
	銘柄数 < 比率 >	9 銘柄	15 銘柄		<2.0%>
(インド)	百株	百株	千インド・ルピー	千円	
Bharti Airtel Partly Paid LTD	86.18	38.6	3,974	7,710	コミュニケーション・サービス
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	—	631.51	22,156	42,983	金融
TATA STEEL LTD	6,648.91	5,385.42	94,939	184,182	素材
AXIS BANK LTD	580.79	519.59	66,554	129,115	金融
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	26.3	20.11	24,312	47,165	一般消費財・サービス
TATA POWER CO LTD	532.41	318.25	13,883	26,934	公益事業
BANK OF BARODA	802.31	476.22	12,865	24,958	金融
HINDUSTAN UNILEVER LTD	110.45	116.73	29,135	56,522	生活必需品
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	632.16	997.74	32,900	63,826	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	871.1	640.87	53,788	104,349	金融
NTPC LTD	1,791.61	1,799.99	67,130	130,233	公益事業
POWER FINANCE CORPORATION	1,371.08	707.73	37,768	73,269	金融
JSW STEEL LTD	377.61	280.79	26,516	51,441	素材
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,589.91	1,395.11	46,736	90,668	公益事業
INDIAN OIL CORP LTD	2,051.09	3,291.71	56,015	108,669	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	490.66	1,726.88	52,324	101,509	エネルギー
PUNJAB NATIONAL BANK	—	932.72	11,335	21,990	金融
STEEL AUTHORITY OF INDIA	1,723.76	1,234.61	18,648	36,178	素材
JINDAL STEEL & POWER LTD	167.22	141.8	14,966	29,034	素材
CANARA BANK	—	929.9	10,904	21,155	金融
UNION BANK OF INDIA	—	714.77	9,715	18,848	金融
ULTRATECH CEMENT LTD	16.94	16.01	18,827	36,526	素材
PETRONET LNG LTD	—	425.78	14,140	27,431	エネルギー
SHIRAM FINANCE LTD	87.66	72.46	20,533	39,834	金融
TECH MAHINDRA LTD	202.08	186.54	27,218	52,804	情報技術
YES BANK LTD	—	5,282.87	12,652	24,545	金融
TATA MOTORS LTD-A-DVR	291.97	122.1	8,258	16,022	一般消費財・サービス
REC LTD	1,677	441.16	25,395	49,267	金融
COAL INDIA LTD	1,244.08	915.01	44,794	86,900	エネルギー
BAJAJ FINANCE LTD	20.52	23.52	16,715	32,428	金融
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	1,016.11	680.58	11,647	22,596	金融
GAIL INDIA LTD	2,125.51	1,331.39	29,178	56,606	公益事業
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,009.66	917.96	63,509	123,207	素材
GRASIM INDUSTRIES LTD	89.16	137.48	37,598	72,941	素材
WIPRO LTD	315.77	253.24	13,439	26,072	情報技術

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末		業種等
		株数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
	千円	千円	千円	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	百株	チンドルピー		
INFOSYS LTD	169.75	180.98	141,176	情報技術
LARSEN & TOUBRO LTD	672.87	631.37	202,181	情報技術
TATA MOTORS LTD	190.69	128.98	89,411	資本財・サービス
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,506.26	502.5	97,309	一般消費財・サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	—	17.24	21,670	ヘルスケア
HDFC BANK LIMITED	396.74	—	—	金融
ICICI BANK LTD	—	861.36	288,613	金融
RELIANCE INDUSTRIES LTD	291.01	253.26	60,580	金融
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	874.77	642.32	387,294	エネルギー
ITC LTD	2,139.69	3,076.05	165,330	エネルギー
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	650.64	687.64	57,236	生活必需品
HERO MOTOCORP LTD	278.1	216.03	121,655	一般消費財・サービス
BHARTI AIRTEL LTD	63.97	32.43	34,969	一般消費財・サービス
UPL LTD	407.59	317.37	87,616	コミュニケーション・サービス
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	198.76	364.65	40,354	素材
HCL TECHNOLOGIES LTD	163.62	107.76	32,568	ヘルスケア
VEDANTA LTD	162.58	232.12	68,553	情報技術
	1,215.75	1,763.03	160,445	素材
インド・ルピー通貨計	株数、金額	37,332.8	43,122.24	4,094,903
	銘柄数 <比率>	45 銘柄	52 銘柄	<10.5%>
(インドネシア)	百株	百株	千円	
GOTO GOJEK TOKOPEDIA	254,670	254,670	12,606	一般消費財・サービス
UNITED TRACTORS TBK PT	833	—	—	エネルギー
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	7,610	8,218	37,017	資本財・サービス
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	20,746	13,304	38,986	コミュニケーション・サービス
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	3,311	6,085	28,373	金融
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	8,487	8,487	82,550	金融
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	13,780	12,111	74,936	金融
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	23,682	18,326	86,903	金融
ADARO ENERGY TBK PT	9,498	—	—	エネルギー
インドネシア・ルピア通貨計	株数、金額	342,617	321,201	361,375
	銘柄数 <比率>	9 銘柄	7 銘柄	<0.9%>
(ブラジル)	百株	百株	千円	
LOCALIZA RENT A CAR RIGHTS SA	—	1.71	56	資本財・サービス
CIA PARANAENSE DE ENERGIA	310	648	16,379	公益事業
ENERGISA SA-UNITS	190	124	16,840	公益事業
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	353	—	—	金融
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	—	239	22,719	金融
VIBRA ENERGIA SA	1,724	1,362	85,929	一般消費財・サービス
GRUPO CASAS BAHIA SA	4,040	—	—	一般消費財・サービス
NATURA & CO HOLDING SA	710	547	24,489	生活必需品
TIM SA	567.26	409.26	19,091	コミュニケーション・サービス
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	358	799	25,873	生活必需品
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	—	2,532	29,510	ヘルスケア
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	6,654	6,636	727,069	エネルギー
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	787	516	12,346	素材
BANCO BRADESCO SA-PREF	5,699.59	5,021.59	181,626	金融
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	3,683.36	2,588.36	250,080	金融
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	658	599	23,371	素材
VALE SA	2,482.9	3,877.9	727,031	素材

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	外貨建金額	
				邦貨換算額	千円	
GERDAU SA-PREF	百株	百株	千ブラジル・レアル			
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	873.6	1,580.92	2,883	84,656		素材
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	4,725	4,409	17,455	512,452		エネルギー
ITAU SA	914.73	1,269.74	1,316	38,656		公益事業
BRASKEM SA-PREF A	1,523.42	1,384.09	1,384	40,634		金融
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	484	484	883	25,932		素材
BANCO DO BRASIL S.A.	134	137	577	16,944		公益事業
COSAN SA	1,014	1,468	3,941	115,717		金融
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIEN	660	516	729	21,420		エネルギー
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	710	686	2,620	76,933		公益事業
EMBRAER SA	1,460	905	878	25,798		公益事業
METALURGICA GERDAU SA-PREF	462	287	1,076	31,605		資本財・サービス
CCR SA	1,390	1,363	1,455	42,736		素材
BRF SA	779	669	812	23,843		資本財・サービス
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,069	705	1,614	47,397		生活必需品
LOJAS RENNER S.A.	205	117	955	28,063		公益事業
JBS SA	435.75	525.75	695	20,420		一般消費財・サービス
USINAS SIDERURGICAS DE MINAS	1,466	1,260	3,951	116,004		生活必需品
SUZANO SA	282	178	136	4,013		素材
LOCALIZA RENT A CAR	249.45	335.45	1,912	56,134		素材
MARFRIG GLOBAL FOODS SA	—	170	741	21,760		資本財・サービス
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,434	1,046	1,260	37,003		生活必需品
CIELO SA	1,972	1,598	1,690	49,635		金融
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,769.28	—	—	—		金融
CIA ENERGETICA DE MINAS GER	375	369	1,199	35,207		公益事業
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	318.3	51.09	65	1,921		公益事業
TELEFONICA BRASIL S.A.	450	394	1,086	31,902		金融
KLABIN SA - UNIT	406	280	1,292	37,936		コミュニケーション・サービス
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	396	449.9	965	28,331		素材
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1,304	673	1,471	43,210		エネルギー
COGNA EDUCACAO	597	333	949	27,862		金融
BANCO BRADESCO S.A.	3,091	—	—	—		一般消費財・サービス
AMBEV SA	1,540.21	1,476.21	1,659	48,712		金融
	2,063	1,933	2,213	64,977		生活必需品
	株数、金額	63,769.85	52,953.97	133,531	3,920,244	
	銘柄数 < 比率 >	46 銘柄	46 銘柄	<10.0%>		
(中国)	百株	百株	千オフショア・人民元		千円	
CHINA ENERGY ENGINEERING CORP LTD	2,281	2,812	596	13,172		資本財・サービス
INDUSTRIAL BANK CO LTD-A	1,676	1,952	3,439	75,998		金融
BANK OF BEIJING CO LTD-A	2,163	2,163	1,280	28,294		金融
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	718	974	4,088	90,348		金融
IND & COMM BK OF CHINA-A	4,746	6,347	3,782	83,586		金融
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	160	238	445	9,839		ヘルスケア
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	8	11	1,634	36,112		生活必需品
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	318	392	938	20,736		素材
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	681	1,171	1,036	22,899		不動産
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	3,429	3,983	3,385	74,808		金融
CITIC SECURITIES CO-A	296	350	631	13,951		金融
CHINA MERCHANTS BANK-A	895	1,191	4,133	91,345		金融
PING AN BANK CO LTD-A	1,146	1,841	1,888	41,737		金融
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	5,832	7,173	3,894	86,064		資本財・サービス
HAIER SMART HOME CO LTD-A	222	222	593	13,121		一般消費財・サービス
SAIC MOTOR CORP LTD-A	1,082	942	1,290	28,516		一般消費財・サービス

新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額	
		外貨建金額	邦貨換算金額	千円	
SHaanxi Coal Industry Co L-A	百株	百株	千オフショア・人民元		
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	—	356	935	20,672	エネルギー
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	439	439	224	4,956	金融
CHINA COAL ENERGY CO-A	—	2,004	1,126	24,886	資本財・サービス
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	481	236	301	6,659	エネルギー
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	616.6	1,288.6	2,001	44,219	資本財・サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	1,557	2,013	634	14,011	資本財・サービス
JIANGXI COPPER CO LTD-A	622	622	472	10,431	素材
YANKUANG ENERGY GROUP LTD A	178	230	541	11,958	素材
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	50	75	176	3,889	エネルギー
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	306	466	358	7,918	金融
BANK OF CHINA LTD-A	9,186	7,319	3,315	73,260	金融
PETROCHINA CO LTD-A	2,832	3,134	1,485	32,824	金融
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	—	1,642	1,747	38,604	エネルギー
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	3,493	3,711	2,415	53,381	エネルギー
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	581	468	1,375	30,392	公益事業
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	3,786	3,988	3,098	68,469	金融
CHINA VANKE CO LTD -A	421	311	1,411	31,198	エネルギー
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	989	1,715	1,190	26,299	不動産
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	434	434	1,241	27,436	金融
CHINA MINSHENG BANKING-A	932	932	638	14,106	金融
PICC HOLDING CO-A	3,547	5,812	2,237	49,443	金融
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	677	677	356	7,883	金融
CRRC CORP LTD-A	5,132	5,455	1,789	39,535	金融
CHINA UNITED NETWORK-A	1,541	1,283	986	21,800	資本財・サービス
CGN POWER CO LTD-A	2,303	2,609	1,231	27,210	コミュニケーション・サービス
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	189	189	90	2,000	公益事業
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	305	305	372	8,235	金融
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	463	628	525	11,600	金融
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	2,913	2,913	1,890	41,774	資本財・サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	—	1,553	1,144	25,290	金融
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,880	1,682	1,175	25,979	素材
HUAXIA BANK CO LTD-A	142	186	576	12,728	金融
BYD CO LTD -A	1,943	2,150	1,410	31,164	金融
WEICHAI POWER CO LTD-A	20	20	489	10,810	一般消費財・サービス
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	335	335	477	10,540	資本財・サービス
HUANENG POWER INTL INC-A	475	547	993	21,961	素材
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	625	389	378	8,363	公益事業
	1,802	1,802	931	20,585	金融
オフショア・人民元通貨計	株数、金額	76,848.6	91,680.6	74,809	1,653,022
銘柄数 < 比率 >	50 銘柄	54 銘柄		<4.2%>	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYAN BANKING BHD	1,338	1,338	1,351	46,244	金融
PUBLIC BANK BERHAD	3,096	2,308	934	31,986	金融
TOP GLOVE CORP BHD	8,244	7,209	857	29,356	ヘルスケア
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	1,104	—	—	—	素材
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	2,997	2,624	1,836	62,855	金融
TENAGA NASIONAL BHD	—	587	835	28,604	公益事業
マレーシア・リンギット通貨計	株数、金額	16,779	14,066	5,816	199,046
銘柄数 < 比率 >	5 銘柄	5 銘柄		<0.5%>	

## 新興国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

銘柄	期首	当期末			業種等
		株数	株数	評価額	
				外貨建金額	
(南アフリカ)		百株	百株	千南アフリカ・ランド	千円
AngloGold Ashanti Plc	—	192.38	9,508	83,962	素材
NEPI ROCKCASTLE NV	—	219.15	2,891	25,533	不動産
NORTHAM PLATINUM HLDGS LTD	—	245.87	3,121	27,565	素材
GOLD FIELDS LTD	321.82	255.47	7,298	64,443	素材
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	20.41	17.55	4,659	41,143	金融
OLD MUTUAL LTD	1,817.77	—	—	—	金融
VODACOM GROUP LTD	262.91	—	—	—	コミュニケーション・サービス
SHOPRITE HOLDINGS LTD	234.99	173.76	5,012	44,258	生活必需品
NEDBANK GROUP LTD	196.67	173.16	4,536	40,059	金融
BIDVEST GROUP LTD	116.04	147.04	4,161	36,743	資本財・サービス
BID CORP LTD	141.23	118.07	5,098	45,016	生活必需品
STANDARD BANK GROUP LTD	528.79	421.51	8,967	79,184	金融
SASOL LTD	375.33	547.88	8,120	71,700	素材
REMNGRO LTD	—	156.93	2,181	19,261	金融
DISCOVERY LTD	207.81	190.08	2,651	23,417	金融
EXXARO RESOURCES LTD	137.92	—	—	—	エネルギー
KUMBA IRON ORE LTD	62	—	—	—	素材
SANLAM LTD	764.9	602.81	5,025	44,376	金融
FIRSTRAND LTD	1,834.84	2,106.73	16,263	143,610	金融
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	439.25	497.25	3,162	27,924	一般消費財・サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	226.27	239.21	3,097	27,353	一般消費財・サービス
ABSA GROUP LTD	420.12	377.92	6,013	53,095	金融
NASPERS LTD-N SHS	21.51	45.83	16,198	143,031	一般消費財・サービス
MTN GROUP LTD	784.02	784.02	6,554	57,875	コミュニケーション・サービス
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	333.74	847.11	8,138	71,860	素材
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	171.38	—	—	—	素材
SPAR GROUP LIMITED/THE	234.78	—	—	—	生活必需品
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	35.72	48.57	3,093	27,317	素材
SIBANYE STILLWATER LTD	2,538.4	5,384.83	11,458	101,182	素材
南アフリカ・ランド通貨計	12,228.62	13,793.13	147,216	1,299,918	
銘柄数、金額	25 銘柄	23 銘柄	<3.3%>		
(タイ)		百株	百株	千タイ・バーツ	千円
SCB X PUBLIC COMPANY LIMITED NON-V	1,569	1,620	16,929	74,487	金融
TRUE CORPORATION NON-VOTING DR PCL	6,849	7,769	6,953	30,594	コミュニケーション・サービス
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	271	—	—	—	金融
SIAM CEMENT PCL-NVDR	605	535	12,091	53,200	素材
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	385	385	4,908	21,598	金融
KASIKORN BANK PCL-NVDR	979	1,522	19,405	85,384	金融
TMBTHANACHART BANK PCL-NVDR	31,551	26,967	4,692	20,645	金融
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	1,327	2,691	5,085	22,378	素材
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	465	465	9,765	42,966	コミュニケーション・サービス
KRUNG THAI BANK - NVDR	5,817	6,716	11,820	52,008	金融
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	5,773	15,165	7,582	33,363	エネルギー
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,587	2,365	6,267	27,575	ヘルスケア
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	711	867	13,178	57,984	エネルギー
IRPC PCL - NVDR	14,741	—	—	—	エネルギー
BANGCHAK CORP PCL-NVDR	1,200	1,263	4,830	21,256	エネルギー
PTT PCL-NVDR	15,115	13,671	44,772	196,999	エネルギー
THAI OIL PCL-NVDR	1,127	1,281	7,045	31,000	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	2,206	2,721	14,897	65,548	生活必需品
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	711	711	9,634	42,389	金融

# 新興国株式インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

銘柄	期首	当期末		業種等
		株数	株数	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
LAND & HOUSES PUB - NVDR CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	百株 4,447 4,599 2,418	百株 — 4,097 2,910	千タイ・バーツ — 9,627 8,802	千円 — 42,362 38,732
タイ・バーツ通貨計	株数、金額 銘柄数 <比率>	104,453 22 銘柄	93,721 19 銘柄	218,290 <2.5%>
ファンド合計	株数、金額 銘柄数 <比率>	5,346,377.26 423 銘柄	5,338,754.5 420 銘柄	32,123,916 <82.3%>

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

(注2) <>内は純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

## (2) 外国投資証券

銘柄	期首	当期末		業種等
		口数	口数	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) INVESCO FTSE RAFI EMERGING M	千口 971.6	千口 1,295.5	千アメリカ・ドル 26,823	千円 4,323,115
アメリカ・ドル通貨計	口数、金額 銘柄数 <比率>	971.6 1 銘柄	1,295.5 1 銘柄	26,823 <11.1%>
(メキシコ) FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	千口 —	千口 113.1	千メキシコ・ペソ 2,551	千円 22,757
メキシコ・ペソ通貨計	口数、金額 銘柄数 <比率>	— —	113.1 1 銘柄	2,551 <0.1%>
(南アフリカ) GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	千口 —	千口 301.81	千南アフリカ・ランド 3,727	千円 32,912
南アフリカ・ランド通貨計	口数、金額 銘柄数 <比率>	— —	301.81 1 銘柄	3,727 <0.1%>
合計	口数、金額 銘柄数 <比率>	971.6 1 銘柄	1,710.41 3 銘柄	4,378,786 <11.2%>

(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		業種等
	買建額	売建額	
外国 MSCI EMGMKT (アメリカ)	百万円 2,267	百万円 —	

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

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2024年7月5日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 32,123,916	% 81.5
投資証券	4,378,786	11.1
コール・ローン等、その他	2,905,759	7.4
投資信託財産総額	39,408,461	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=161.17円、1香港・ドル=20.64円、1台湾・ドル=4.958円、1トルコ・リラ=4.938円、1メキシコ・ペソ=8.919円、100チリ・ペソ=17.217円、1サウジアラビア・リアル=43.04円、1インド・ルピー=1.94円、100インドネシア・ルピア=0.99円、1ブラジル・レアル=29.358円、1オフショア・人民元=22.096円、1マレーシア・リンギット=34.219円、1南アフリカ・ランド=8.83円、1タイ・バーツ=4.40円です。

(注3) 当期末における外貨建純資産（38,774,854千円）の投資信託財産総額（39,408,461千円）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

2024年7月5日現在

項目	当期末
(A)資産	39,453,354,175円
コール・ローン等	1,816,394,563
株式（評価額）	32,123,916,007
投資証券（評価額）	4,378,786,139
未収入金	101,878,210
未収配当金	338,279,684
差入委託証拠金	694,099,572
(B)負債	435,745,969
未払金	377,903,410
未払解約金	57,717,700
その他未払費用	124,859
(C)純資産総額（A-B）	39,017,608,206
元本	13,601,496,638
次期繰越損益金	25,416,111,568
(D)受益権総口数	13,601,496,638口
1万口当たり基準価額（C/D）	28,686円

\*期首における元本額は13,257,532,975円、当作成期間中における追加設定元本額は2,620,368,540円、同解約元本額は2,276,404,877円です。

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

新興国株式インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	108,177,566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）	461,810,865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）	339,209,536円
D—I's 新興国株式インデックス	120,251,334円
i Free 新興国株式インデックス	6,961,799,554円
i Free 8 資産バランス	3,522,125,045円
ダイワ新興国株式インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	8,840,084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）	656,144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	1,662,378,853円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国株式	310,223,199円
ダイワ・ノーロード 新興国株式ファンド	106,024,458円

\*当期末の計算口数当りの純資産額は28,686円です。

## ■損益の状況

当期 自 2023年7月6日 至 2024年7月5日

項目	当期
(A)配当等収益	1,521,540,127円
受取配当金	1,459,367,114
受取利息	40,243,818
その他収益金	22,060,453
支払利息	△ 131,258
(B)有価証券売買損益	6,617,154,467
売買益	8,912,295,086
売買損	△ 2,295,140,619
(C)先物取引等損益	90,648,495
取引益	237,245,866
取引損	△ 146,597,371
(D)その他費用	△ 120,032,240
(E)当期損益金 (A+B+C+D)	8,109,310,849
(F)前期繰越損益金	16,550,630,086
(G)解約差損益金	△ 2,984,712,910
(H)追加信託差損益金	3,740,883,543
(I)合計 (E+F+G+H)	25,416,111,568
次期繰越損益金 (I)	25,416,111,568

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

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

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

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

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

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

# 新興国債券インデックス ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

## 運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2024年7月5日)

(作成対象期間 2023年7月6日～2024年7月5日)

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

### 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、新興国通貨建ての債券に投資し、投資成果をJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざしております。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/>

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円換算)	公社債組入比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)		
2期末(2020年7月6日)	円 10,595	円 0	% △ 3.7	10,698	% △ 3.4	% 95.4 百万円 75
3期末(2021年7月5日)	11,502	0	8.6	11,659	9.0	97.0 203
4期末(2022年7月5日)	11,335	0	△ 1.5	11,563	△ 0.8	96.6 341
5期末(2023年7月5日)	13,417	0	18.4	13,767	19.1	96.7 640
6期末(2024年7月5日)	15,239	0	13.6	15,485	12.5	97.7 1,104

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

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

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

(注4) 指数值は、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。上記の指數は直近で知り得るデータを使用しております。

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

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



# 運用経過

## 基準価額等の推移について



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

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

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

## ■基準価額・騰落率

期首：13,417円

期末：15,239円（分配金0円）

騰落率：13.6%（分配金込み）

## ■基準価額の主な変動要因

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

新興国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

年　月　日	基　準　価　額		JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算） (ベンチマーク)	騰　落　率	公　社　債 組入比率
	円	%			
(期首) 2023年7月5日	13,417	—	13,767	—	96.7
7月末	13,369	△ 0.4	13,712	△ 0.4	96.7
8月末	13,547	1.0	13,931	1.2	95.9
9月末	13,238	△ 1.3	13,573	△ 1.4	96.1
10月末	13,239	△ 1.3	13,626	△ 1.0	96.5
11月末	13,982	4.2	14,230	3.4	96.8
12月末	13,845	3.2	14,057	2.1	96.2
2024年1月末	14,164	5.6	14,293	3.8	96.7
2月末	14,400	7.3	14,562	5.8	95.8
3月末	14,425	7.5	14,668	6.5	96.5
4月末	14,720	9.7	14,935	8.5	95.8
5月末	14,882	10.9	15,121	9.8	94.7
6月末	15,043	12.1	15,301	11.1	94.9
(期末) 2024年7月5日	15,239	13.6	15,485	12.5	97.7

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2023.7.6～2024.7.5)

### ■新興国債券市況

#### 新興国債券市場では、金利は国によってまちまちの動きとなりました。

新興国債券市況は、当座成期首より、米国金利の上昇（債券価格は下落）が金利上昇圧力となりましたが、国によってまちまちな動きとなりました。2023年10月は、ブラジルでは、ルラ大統領が財政健全化を軽視する発言をしたことから財政悪化懸念が高まり、金利は上昇しました。年末にかけては、米国の早期利下げ観測の高まりから米国金利が低下（債券価格は上昇）したことなどを受け、多くの国で金利は低下しました。2024年に入り、米国の早期利下げ期待の後退を受けた米国金利の上昇が新興国の金利上昇圧力となりましたが、国ごとの個別要因などから、金利は国によってまちまちな動きとなりました。その後は、当座成期末にかけて米国金利低下の影響を受け、新興国全体では金利が低下しました。

### ■為替相場

#### 新興国為替相場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

当座成期首より、F R B（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め観測から米国金利が上昇する中、日米金利差の拡大により円安米ドル高が進行したことなどから、多くの新興国通貨が対円で上昇しました。2023年8月には、米国の金融引き締めの長期化観測から米国金利が上昇し、多くの新興国通貨が対円で上昇しました。10月から年末にかけても、米国の金融引き締め観測の後退が通貨への上昇圧力となり、続伸しました。2024年に入り、日銀がマイナス金利を早期に解除するとの期待が後退したことで円安が進行し、ポーランド・ズロチや南アフリカ・ランドなどを筆頭に、対円で上昇しました。3月以降も、日銀が大規模な金融緩和を終了した後も緩和的な環境が継続すると見込まれたことなどを受け、新興国通貨は対円で上昇基調が継続しました。しかし当座成期末にかけては、財政悪化懸念などから主要な中南米通貨などが対円で下落（円高）しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

## ポートフォリオについて

(2023.7.6～2024.7.5)

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

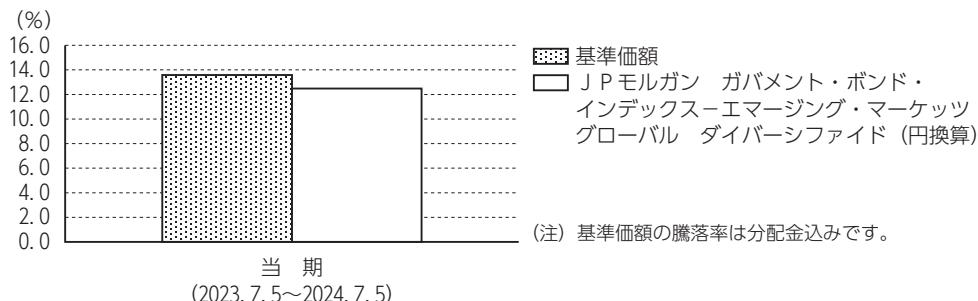
\*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス－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

当成期のベンチマークの騰落率は12.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は13.6%となり、ベンチマークの騰落率を上回りました。マザーファンドが保有するロシア国債の評価額を0としていましたが、当成期中に時価で売却できることなどがプラスに寄与しました。

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

## 分配金について

当成績期は、経費控除後の配当等収益が少額だったため、収益分配を見送させていただきました。  
なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2023年7月6日	～2024年7月5日
<b>当期分配金（税込み）(円)</b>	—	—
対基準価額比率 (%)	—	—
当期の収益 (円)	—	—
当期の収益以外 (円)	—	—
<b>翌期繰越分配対象額 (円)</b>		5,239

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

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

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

(注4) 投資信託の計算上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

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

### ■ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド

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

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2023.7.6～2024.7.5)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	20円	0.143%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は14,019円です。
(投 信 会 社)	(15)	(0.110)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(2)	(0.011)	販売会社分は、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(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	13	0.095	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)	(11)	(0.078)	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)	(0.009)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	33	0.238	

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

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(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います。

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

## ■売買および取引の状況

### 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2023年7月6日から2024年7月5日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ダイワ新興国債券 インデックス・マザーファンド	千口 197,893	千円 353,240	千口 4,982	千円 9,143

(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
ダイワ新興国債券 インデックス・マザーファンド	千口 373,663	千口 566,573	千円 1,103,912

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2024年7月5日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
千円		%
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド	1,103,912	99.8
コール・ローン等、その他	1,782	0.2
投資信託財産総額	1,105,695	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あります。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=161.17円、1エジプト・ポンド=3.352円、1トルコ・リラ=4.938円、1メキシコ・ペソ=8.919円、1アルゼンチン・ペソ=0.176円、100チリ・ペソ=17.217円、100コロンビア・ペソ=3.937円、1インド・ルピー=1.94円、100インドネシア・ルピア=0.99円、1ブラジル・レアル=29.358円、1チェコ・コルナ=6.934円、1ルーマニア・レイ=35.024円、1オフショア・人民元=22.096円、1マレーシア・リンギット=34.219円、1南アフリカ・ランド=8.83円、1タイ・バーツ=4.40円、1ペルー・ソル=42.457円、1ポーランド・ズロチ=40.693円、100ハンガリー・フォリント=44.35円、1ウルグアイ・ペソ=4.016円、1ドミニカ・ペソ=2.726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(49,724,916千円)の投資信託財産総額(50,994,603千円)に対する比率は、97.5%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年7月5日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	1,105,695,223円
コール・ローン等	1,782,872
ダイワ新興国債券インデックス・マザーファンド(評価額)	1,103,912,351
(B)負債	732,547
未払信託報酬	692,673
その他未払費用	39,874
(C)純資産総額(A-B)	1,104,962,676
元本	725,082,726
次期繰越損益金	379,879,950
(D)受益権総口数	725,082,726口
1万口当り基準価額(C/D)	15,239円

\*期首における元本額は477,423,131円、当作成期間中ににおける追加設定元本額は253,953,576円、同解約元本額は6,293,981円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は15,239円です。

## ■損益の状況

当期 自 2023年7月6日 至 2024年7月5日

項 目	当 期
(A)配当等収益	228円
受取利息	296
支払利息	△ 68
(B)有価証券売買損益	119,360,457
売買益	119,878,726
売買損	△ 518,269
(C)信託報酬等	△ 1,280,652
(D)当期損益(A+B+C)	118,080,033
(E)前期繰越損益金	100,900,265
(F)追加信託差損益金	160,899,652
(配当等相当額)	( 107,718,097)
(売買損益相当額)	( 53,181,555)
(G)合計(D+E+F)	379,879,950
次期繰越損益金(G)	379,879,950
追加信託差損益金	160,899,652
(配当等相当額)	( 107,718,097)
(売買損益相当額)	( 53,181,555)
分配準備積立金	218,980,298

(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	228円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	118,079,676
(c) 収益調整金	160,899,652
(d) 分配準備積立金	100,900,394
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	379,879,950
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	379,879,950
(h) 受益権総口数	725,082,726□

## 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14期（決算日 2024年7月5日）

（作成対象期間 2023年7月6日～2024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JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケットグローバル・ダイバーシファイド（円換算）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	新興国通貨建ての債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 大和アセットマネジメント

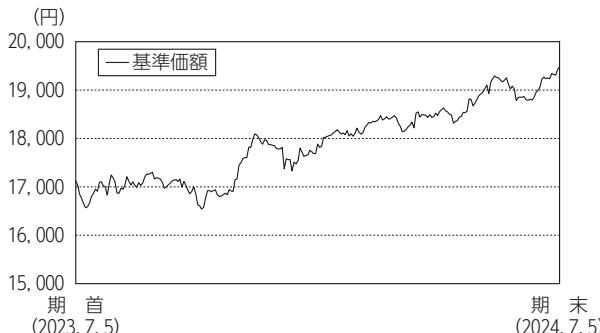
Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社  
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

# 新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

## ■当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：17,126円 期末：19,484円 謄落率：13.8%

#### 【基準価額の主な変動要因】

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

### ◆投資環境について

#### ○新興国債券市況

新興国債券市場では、金利は国によってまちまちの動きとなりました。

新興国債券市況は、当作成期首より、米国金利の上昇（債券価格は下落）が金利上昇圧力となりましたが、国によってまちまちの動きとなりました。2023年10月は、ブラジルでは、ルラ大統領が財政健全化を軽視する発言をしたことから財政悪化懸念が高まり、金利は上昇しました。年末にかけては、米国の早期利下げ観測の高まりから米国金利が低下（債券価格は上昇）したことなどを受け、多くの国で金利は低下しました。2024年に入り、米国の早期利下げ期待の後退を受けた米国金利の上昇が新興国の金利上昇圧力となりましたが、国ごとの個別要因などから、金利は国によってまちまちの動きとなりました。その後は、当作成期末にかけて米国金利低下の影響を受け、新興国全体では金利が低下しました。

#### ○為替相場

新興国為替相場は、多くの通貨が対円で上昇しました。

当作成期首より、F R B（米国連邦準備制度理事会）の金融引き締め観測から米国金利が上昇する中、日米金利差の拡大により円安米ドル高が進行したことなどから、多くの新興国通貨が対円で上昇しました。2023年8月には、米国の金融引き締めの長期化観測から米国金利が上昇し、多くの新興国通貨が対円で上昇しました。10月から年末にかけても、米国の金融引き締め観測の後退が通貨への上昇圧力となり、続伸しました。2024年に入り、日銀がマイナス金利を早期に解除するとの期待が後退することで円安が進行し、ポーランド・ズロチや南アフリカ・ランドなどを筆頭に、対円で上昇しました。3月以降も、日銀が大規模な金融緩和を終了した後も緩和的な環境が継続すると見込まれたことなどを受け、新興国通貨は対円で上昇基調が継続しました。しかし当作成期末にかけては、財政悪化懸念などから主要な中南米通貨などが対円で下落（円高）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12.5%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、ベンチマークの騰落率を上回りました。当ファンドが保有するロシア国債の評価額を0としていましたが、当作成期中に時価で売却できることなどがプラスに寄与しました。

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

年 月 日	基 準 価 額		J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド(円換算) (ベンチマーク)	公社債組入比率
	円	%		
(期首) 2023年 7月 5日	17,126	—	18,554	% 96.8
7月末	17,067	△ 0.3	18,480	△ 0.4 96.8
8月末	17,297	1.0	18,775	1.2 96.0
9月末	16,904	△ 1.3	18,293	△ 1.4 96.2
10月末	16,907	△ 1.3	18,364	△ 1.0 96.6
11月末	17,859	4.3	19,177	3.4 96.9
12月末	17,686	3.3	18,944	2.1 96.3
2024年 1月末	18,096	5.7	19,263	3.8 96.8
2月末	18,401	7.4	19,625	5.8 95.9
3月末	18,435	7.6	19,768	6.5 96.6
4月末	18,814	9.9	20,128	8.5 95.8
5月末	19,024	11.1	20,378	9.8 94.8
6月末	19,232	12.3	20,622	11.1 94.9
(期末) 2024年 7月 5日	19,484	13.8	20,870	12.5 97.8

(注1) 謄落率は期首比。

(注2) J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円換算）は、J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（米ドルベース）をもとに円換算し、当ファンド設定日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。J P モルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（米ドルベース）は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J. P. Morgan はその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J. P. Morgan 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。

## ■1万口当たりの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	一円
有価証券取引税	—
その他費用 (保管費用) (その他)	15 ( 14) ( 1)
合計	15

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

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

## ■売買および取引の状況

## 公社債

(2023年7月6日から2024年7月5日まで)

		買付額	売付額
外 国	エジプト トルコ メキシコ フィリピン チリ	千エジプト・ポンド 26,271 千トルコ・リラ 114,613 千メキシコ・ペソ 235,031 千フィリピン・ペソ — 千チリ・ペソ 1,069,595	千エジプト・ポンド 77,570 ( —) 千トルコ・リラ 1,407 ( —) 千メキシコ・ペソ 78,584 ( —) 千フィリピン・ペソ 9,310 ( —) 千チリ・ペソ 217,205 ( —)
	コロンビア インド インドネシア ブラジル	千コロンビア・ペソ 12,195,367 千インド・ルピー 250,348 千インドネシア・ルピア 177,819,828 千ブラジル・レアル 71,473	千コロンビア・ペソ 5,204,464 ( —) 千インド・ルピー — ( —) 千インドネシア・ルピア 25,406,325 ( —) 千ブラジル・レアル 42,777 ( —)

		買付額	売付額
外 国	チェコ ルーマニア 中国 ロシア マレーシア	千チェコ・コルナ 154,238 千ルーマニア・レイ 19,760 千オフショア・人民元 55,565 千ロシア・ルーブル — 千マレーシア・リンギット 38,169	千チェコ・コルナ 17,014 ( —) 千ルーマニア・レイ 6,222 ( —) 千オフショア・人民元 20,581 ( —) 千ロシア・ルーブル 314,682 ( —) 千マレーシア・リンギット 11,777 ( —)
	南アフリカ タイ ペルー ポーランド ハンガリー	千南アフリカ・ランド 123,287 千タイ・バーツ 293,278 千ペルー・ソル 7,105 千ポーランド・ズロチ 29,506 千ハンガリー・フォリント 724,731	千南アフリカ・ランド 45,297 ( —) 千タイ・バーツ 143,105 ( —) 千ペルー・ソル 3,851 ( —) 千ポーランド・ズロチ 12,123 ( —) 千ハンガリー・フォリント 309,925 ( —)
	ウルグアイ ドミニカ	千ウルグアイ・ペソ 16,146 千ドミニカ・ペソ 12,879	千ウルグアイ・ペソ — ( —) 千ドミニカ・ペソ 10,798 ( —)

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

# 新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

## ■主要な売買銘柄 公社債

(2023年7月6日から2024年7月5日まで)

買 銘 柄	付 金 額	当 期 売 付	
		銘 柄	金 額
BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL (ブラジル) 2027/7/1	335,554	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2025/1/1	480,906
POLAND GOVERNMENT BOND (ポーランド) 6% 2033/10/25	319,054	Brazil Letras do Tesouro Nacional (ブラジル) 2024/7/1	414,654
MEXICAN BONOS (メキシコ) 7% 2026/9/3	313,690	Mexican Bonos (メキシコ) 8% 2024/9/5	345,850
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2027/1/1	274,848	Mexican Bonos (メキシコ) 10% 2024/12/5	268,656
MEXICAN BONOS (メキシコ) 7.5% 2033/5/26	266,269	Poland Government Bond (ポーランド) 2.25% 2024/10/25	250,170
MEXICAN BONOS (メキシコ) 5.5% 2027/3/4	264,642	Poland Government Bond (ポーランド) 2.5% 2024/4/25	197,143
MEXICAN BONOS (メキシコ) 8.5% 2029/3/1	257,259	Thailand Government Bond (タイ) 1.45% 2024/12/17	178,016
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F (ブラジル) 10% 2029/1/1	239,547	THAILAND GOVERNMENT BOND (タイ) 0.75% 2024/9/17	176,568
BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F (ブラジル) 10% 2035/1/1	232,872	Indonesia Treasury Bond (インドネシア) 8.375% 2024/3/15	148,644
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA (南アフリカ) 8.875% 2035/2/28	228,890	ARAB REP EGYPT (エジプト) 14.06% 2026/1/12	144,467

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

## ■組入資産明細表

### (1) 外国(外貨建) 公社債(通貨別)

作成期	区分	当 期		末		残存期間別組入比率		
		額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入率	5年以上	2年以上	2年未満
	トルコ	千トルコ・リラ 180,230	千トルコ・リラ 154,349	千円 762,318	% 1.5	% 1.5	% 0.6	% 0.8
	メキシコ	千メキシコ・ペソ 623,950	千メキシコ・ペソ 553,665	4,938,307	9.9	—	4.9	3.7
	チリ	千チリ・ペソ 5,555,000	千チリ・ペソ 5,387,353	927,556	1.9	—	1.3	0.1
	コロンビア	千コロンビア・ペソ 62,640,000	千コロンビア・ペソ 53,549,290	2,108,289	4.2	—	2.9	1.2
	インド	千インド・ルピー 250,000	千インド・ルピー 250,436	485,846	1.0	—	0.8	0.1
	インドネシア	千インドネシア・ルピア 488,969,000	千インドネシア・ルピア 495,964,825	4,910,051	9.8	—	6.3	2.6
	ブラジル	千ブラジル・レアル 179,650	千ブラジル・レアル 152,187	4,467,944	8.9	—	1.5	3.5
	チェコ	千チェコ・コルナ 467,100	千チェコ・コルナ 435,080	3,016,847	6.0	—	3.6	1.3
	ルーマニア	千ルーマニア・レイ 58,300	千ルーマニア・レイ 56,761	1,988,036	4.0	—	2.0	1.1
	中国	千オフショア・人民元 212,300	千オフショア・人民元 221,406	4,892,292	9.8	—	4.5	3.7
	マレーシア	千マレーシア・リンギット 141,570	千マレーシア・リンギット 143,898	4,924,200	9.8	—	5.8	2.9
	南アフリカ	千南アフリカ・ランド 575,710	千南アフリカ・ランド 487,914	4,308,281	8.6	—	7.4	1.2
	タイ	千タイ・バーツ 1,035,660	千タイ・バーツ 1,038,378	4,568,866	9.1	—	5.0	3.1
	ペルー	千ペニー・ソル 26,330	千ペニー・ソル 25,739	1,092,820	2.2	—	1.6	0.6

**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)**

作成期		当期						末		
区分	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	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		
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 104,180	千ポーランド・ズロチ 96,204	千円 3,914,876	% 7.8	% —	% 3.1	% 3.5	% 1.3		
ハンガリー	千ハンガリー・フォリント 3,718,500	千ハンガリー・フォリント 3,200,150	千円 1,419,273	% 2.8	% —	% 1.1	% 1.1	% 0.7		
ウルグアイ	千ウルグアイ・ペソ 25,800	千ウルグアイ・ペソ 24,884	千円 99,942	% 0.2	% —	% 0.2	% 0.0	% —		
ドミニカ共和国	千ドミニカ・ペソ 23,900	千ドミニカ・ペソ 26,733	千円 72,895	% 0.1	% 0.1	% 0.1	% —	% —		
合計	—	—	48,898,647	97.8	1.7	52.7	30.3	14.8		

(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		当期			末			評価額		
区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	外貨建金額		邦貨換算金額	償還年月日		
					千トルコ・リラ	千円		千トルコ・リラ	千円	
トルコ	Turkey Government Bond	国債証券	8.0000	千トルコ・リラ 2,690	千トルコ・リラ 2,219	千円 10,963	千トルコ・リラ 3,991	千円 19,711	千円 9,812	2025/03/12
	Turkey Government Bond	国債証券	10.6000	千トルコ・リラ 5,570	千トルコ・リラ 1,986	千円 29,611	千トルコ・リラ 9,000	千円 29,611	千円 2027/02/24	2027/08/11
	Turkey Government Bond	国債証券	11.0000	千トルコ・リラ 2,970	千トルコ・リラ 13,718	千円 67,753	千トルコ・リラ 9,100	千円 34,779	千円 67,753	2028/03/08
	Turkey Government Bond	国債証券	10.5000	千トルコ・リラ 9,000	千トルコ・リラ 6,552	千円 32,362	千トルコ・リラ 8,618	千円 42,563	千円 32,362	2026/09/02
	Turkey Government Bond	国債証券	12.4000	千トルコ・リラ 20,500	千トルコ・リラ 11,500	千円 42,788	千トルコ・リラ 13,900	千円 8,663	千円 42,788	2030/11/13
	Turkey Government Bond	国債証券	12.6000	千トルコ・リラ 9,100	千トルコ・リラ 8,663	千円 68,295	千トルコ・リラ 7,041	千円 13,828	千円 68,295	2025/10/01
	Turkey Government Bond	国債証券	11.7000	千トルコ・リラ 13,900	千トルコ・リラ 8,630	千円 211,997	千トルコ・リラ 11,500	千円 42,924	千円 211,997	2033/10/05
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	16.9000	千トルコ・リラ 8,500	千トルコ・リラ 6,552	千円 191,679	千トルコ・リラ 8,500	千円 42,924	千円 191,679	2028/11/08
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	17.8000	千トルコ・リラ 11,500	千トルコ・リラ 8,630	千円 191,679	千トルコ・リラ 11,500	千円 38,810	千円 38,810	2028/07/13
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	17.3000	千トルコ・リラ 18,000	千トルコ・リラ 13,828	千円 2028/07/19	千トルコ・リラ 18,000	千円 38,810	千円 38,810	2028/07/19
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	26.2000	千トルコ・リラ 42,000	千トルコ・リラ 42,924	千円 2023/10/05	千トルコ・リラ 42,000	千円 154,349	千円 154,349	2033/10/05
	TURKEY GOVERNMENT BOND	国債証券	31.0800	千トルコ・リラ 36,500	千トルコ・リラ 38,810	千円 2028/11/08	千トルコ・リラ 36,500	千円 762,318	千円 762,318	2028/11/08
通貨小計	銘柄数 金額	12銘柄								
メキシコ	Mexican Bonos	国債証券	5.7500	千メキシコ・ペソ 56,400	千メキシコ・ペソ 52,281	千円 466,315	千メキシコ・ペソ 40,400	千円 292,743	千円 461,479	2026/03/05
	Mexican Bonos	国債証券	8.0000	千メキシコ・ペソ 58,000	千メキシコ・ペソ 51,739	千円 304,268	千メキシコ・ペソ 20,200	千円 19,536	千円 174,249	2027/03/04
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.5000	千メキシコ・ペソ 8,0000	千メキシコ・ペソ 42,500	千円 2053/07/31	千メキシコ・ペソ 7,5000	千円 49,900	千円 42,703	2033/05/26
	MEXICAN BONOS	国債証券	5.0000	千メキシコ・ペソ 8,0000	千メキシコ・ペソ 34,113	千円 304,268	千メキシコ・ペソ 20,200	千円 19,536	千円 304,268	2025/03/06
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.0000	千メキシコ・ペソ 7,5000	千メキシコ・ペソ 38,500	千円 319,489	千メキシコ・ペソ 42,500	千円 38,500	千円 319,489	2026/09/03
	MEXICAN BONOS	国債証券	7.0000	千メキシコ・ペソ 8,5000	千メキシコ・ペソ 30,500	千円 255,368	千メキシコ・ペソ 7,5000	千円 28,630	千円 255,368	2029/03/01
	MEXICAN BONOS	国債証券	8.5000	千メキシコ・ペソ 7,5000	千メキシコ・ペソ 51,030	千円 424,201	千メキシコ・ペソ 12,890	千円 47,559	千円 424,201	2027/06/03
	Mexican Bonos	国債証券	10.0000	千メキシコ・ペソ 8,5000	千メキシコ・ペソ 42,924	千円 2036/11/20	千メキシコ・ペソ 45,730	千円 12,941	千円 115,427	2047/11/07
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	千メキシコ・ペソ 8,5000	千メキシコ・ペソ 42,924	千円 383,455	千メキシコ・ペソ 33,100	千円 42,924	千円 383,455	2029/05/31
	Mexican Bonos	国債証券	8.5000	千メキシコ・ペソ 7.7500	千メキシコ・ペソ 61,850	千円 2038/11/18	千メキシコ・ペソ 55,071	千円 491,196	千円 491,196	2031/05/29
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	千メキシコ・ペソ 7.7500	千メキシコ・ペソ 55,120	千円 2042/11/13	千メキシコ・ペソ 27,830	千円 44,298	千円 395,109	2034/11/23
	Mexican Bonos	国債証券	7.7500	千メキシコ・ペソ 7.7500	千メキシコ・ペソ 23,941	千円 4,938,307	千メキシコ・ペソ 23,941	千円 213,537	千円 213,537	2034/11/23
通貨小計	銘柄数 金額	15銘柄								

新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	当期末		償還年月日
						外貨建金額	邦貨換算金額	
チリ		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	%	千チリ・ペソ	千チリ・ペソ	千円	2026/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.5000	500,000	498,405	85,811	2035/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	970,000	884,746	152,329	2043/01/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	630,000	622,269	107,138	2043/01/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	4.7000	915,000	855,845	147,353	2030/09/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	2.5000	1,000,000	986,070	169,774	2025/03/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	5.0000	270,000	262,726	45,234	2028/10/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	7.0000	220,000	234,176	40,318	2034/05/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.0000	850,000	841,763	144,928	2033/04/01
		BONOS TESORERIA PESOS	国債証券	6.2000	200,000	201,350	34,667	2040/10/01
通貨小計	銘柄数 金額	9銘柄			5,555,000	5,387,353	927,556	
コロンビア		Colombian TES	国債証券	6.0000	千コロンビア・ペソ	千コロンビア・ペソ	千円	2028/04/28
		Colombian TES	国債証券	7.5000	6,320,000	5,541,818	218,186	2026/08/26
		Colombian TES	国債証券	7.7500	5,410,000	5,219,622	205,501	2030/09/18
		Colombian TES	国債証券	7.0000	4,900,000	4,352,082	171,345	2032/06/30
		Colombian TES	国債証券	6.2500	5,300,000	4,320,295	170,094	2025/11/26
		Colombian TES	国債証券	7.2500	2,400,000	2,331,408	91,789	2034/10/18
		Colombian TES	国債証券	7.2500	5,900,000	4,643,182	182,806	2027/11/03
		Colombian TES	国債証券	5.7500	4,400,000	3,898,576	153,490	2050/10/26
		Colombian TES	国債証券	7.2500	6,410,000	4,156,564	163,648	2031/03/26
		Colombian TES	国債証券	6.2500	3,000,000	2,064,540	81,283	2042/05/28
		COLOMBIAN TES	国債証券	7.0000	5,400,000	4,544,910	178,937	2030/07/09
		COLOMBIAN TES	国債証券	9.2500	8,400,000	6,995,604	275,423	2023/02/09
通貨小計	銘柄数 金額	12銘柄			62,640,000	53,549,290	2,108,289	
インド		India Government Bond	国債証券	5.8500	千インド・ルピー	千インド・ルピー	千円	2030/12/01
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2600	14,000	13,153	25,516	2032/08/22
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1800	18,000	18,231	35,368	2023/08/14
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2600	25,000	25,229	48,944	2029/01/14
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1600	14,000	14,147	27,447	2050/09/20
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	5.7700	14,000	14,140	27,431	2030/08/03
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.1000	18,000	13,142	25,495	2031/07/12
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.9900	18,000	17,073	33,121	2051/12/15
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.5400	18,000	17,874	34,675	2036/05/23
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.4100	18,000	18,727	36,331	2036/12/19
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.0600	13,000	18,556	35,999	2028/04/10
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1700	14,000	13,031	25,282	2030/04/17
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3000	25,000	25,757	49,970	2053/06/19
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1800	22,000	22,269	43,201	2037/07/24
		INDIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.0400	5,000	5,011	9,723	2029/06/03
通貨小計	銘柄数 金額	15銘柄			250,000	250,436	485,846	
インドネシア		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	千インドネシア・ルピア	千インドネシア・ルピア	千円	2036/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.7500	15,250,000	16,667,030	165,003	2031/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	10,000,000	10,918,000	108,088	2032/08/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	7,000,000	7,179,550	71,077	2038/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	10,800,000	11,159,100	110,475	2039/04/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	7,700,000	8,577,569	84,917	2029/05/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	17,000,000	17,873,970	176,952	2030/09/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	24,300,000	24,357,105	241,135	2025/06/15
		Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	19,700,000	19,676,360	194,795	

## 新興国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	当期		償還年月日	
					末			
					評価額	外貨建金額		
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	千インドネシア・ルピア 22,000,000	千インドネシア・ルピア 22,700,040	224,730	2035/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.5000	20,500,000	21,258,910	210,463	2040/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	5.5000	18,100,000	17,746,145	175,686	2026/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.5000	26,300,000	25,592,004	253,360	2031/02/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.2500	7,300,000	6,849,371	67,808	2036/06/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	36,300,000	34,932,579	345,832	2032/04/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	5.1250	15,700,000	15,071,843	149,211	2027/04/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	15,000,000	15,002,100	148,520	2042/06/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	2,700,000	2,545,182	25,197	2037/07/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.0000	19,800,000	19,783,566	195,857	2033/02/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.3750	16,100,000	15,878,947	157,201	2028/08/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	11,300,000	11,308,588	111,955	2043/06/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	7.1250	11,000,000	11,050,930	109,404	2038/06/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.6250	14,500,000	14,057,025	139,164	2034/02/15	
	INDONESIA TREASURY BOND	国債証券	6.8750	16,500,000	16,456,935	162,923	2029/04/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	11.0000	6,400,000	6,715,392	66,482	2025/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	10.5000	3,480,000	4,079,116	40,383	2030/08/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.5000	2,970,000	3,380,483	33,466	2031/07/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	20,024,000	20,722,437	205,152	2026/09/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.2500	4,750,000	5,085,112	50,342	2032/06/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	7.0000	16,030,000	16,154,873	159,933	2027/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.1250	16,450,000	16,080,533	159,197	2028/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	6.6250	14,075,000	13,684,559	135,477	2033/05/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	8.3750	26,920,000	29,361,644	290,680	2034/03/15	
	Indonesia Treasury Bond	国債証券	9.0000	13,020,000	14,057,824	139,172	2029/03/15	
通貨小計	銘柄数	33銘柄						
	金額			488,969,000	495,964,825	4,910,051		
ブラジル	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	千ブラジル・レアル 21,650	千ブラジル・レアル 20,950	615,053	2027/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	22,400	21,025	617,256	2029/01/01	
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F	国債証券	10.0000	11,100	10,124	297,250	2031/01/01	
	BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F	国債証券	10.0000	10,400	9,338	274,147	2033/01/01	
	BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F	国債証券	10.0000	3,100	2,755	80,895	2035/01/01	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	17,300	15,588	457,649	2025/07/01	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	29,700	25,215	740,290	2026/01/01	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	33,500	26,863	788,675	2026/07/01	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	15,900	11,335	332,795	2027/07/01	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	5,600	2,956	86,797	2030/01/01	
	BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL	国債証券	—	9,000	6,033	177,132	2028/01/01	
通貨小計	銘柄数	11銘柄						
	金額			179,650	152,187	4,467,944		
チェコ	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.5000	千チェコ・クロナ 26,600	千チェコ・クロナ 25,119	174,178	2028/08/25	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.4000	24,100	23,631	163,857	2025/09/17	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.0000	27,400	25,851	179,251	2026/06/26	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.9500	27,500	23,187	160,781	2030/05/15	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.2500	31,500	28,649	198,653	2027/02/10	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.7500	29,500	27,883	193,345	2029/07/23	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	2.0000	29,500	24,766	171,728	2033/10/13	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	1.2000	28,700	24,010	166,488	2031/03/13	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	0.0500	15,500	12,605	87,408	2029/11/29	
	Czech Republic Government Bond	国債証券	4.2000	15,300	15,318	106,215	2036/12/04	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.7500	29,500	24,898	172,644	2032/06/23	
	CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	1.2500	17,500	17,196	119,238	2025/02/14	

新興国債券インデックスファンド (FOFs 用) (適格機関投資家専用)

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	当期末		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND	国債証券	%	1.5000	千チェコ・コルナ 16,500	千チェコ・コルナ 11,318	78,481	2040/04/24
	国債証券		3.5000	15,700	14,769	102,412	2035/05/30
	国債証券		6.0000	19,500	20,132	139,600	2026/02/26
	国債証券		5.0000	26,000	27,414	190,095	2030/09/30
	国債証券		5.5000	20,500	21,778	151,011	2028/12/12
	国債証券		1.9500	14,000	10,829	75,093	2037/07/30
	国債証券		4.9000	16,000	16,927	117,374	2034/04/14
	国債証券		5.7500	14,000	15,071	104,509	2029/03/29
	国債証券		6.2000	8,000	9,036	62,658	2031/06/16
	国債証券		4.5000	14,300	14,683	101,818	2032/11/11
通貨小計	銘柄数	22銘柄					
	金額			467,100	435,080	3,016,847	
ルーマニア	Romania Government Bond	国債証券	4.7500	千ルーマニア・レイ 2,450	千ルーマニア・レイ 2,431	85,156	2025/02/24
	Romania Government Bond	国債証券	5.8000	2,800	2,771	97,076	2027/07/26
	Romania Government Bond	国債証券	5.0000	2,600	2,451	85,861	2029/02/12
	Romania Government Bond	国債証券	4.8500	2,500	2,451	85,855	2026/04/22
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,900	2,407	84,317	2031/09/24
	Romania Government Bond	国債証券	3.6500	2,300	2,248	78,747	2025/07/28
	Romania Government Bond	国債証券	4.1500	2,600	2,439	85,440	2028/01/26
	Romania Government Bond	国債証券	3.2500	2,750	2,611	91,478	2026/06/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.1500	2,500	2,192	76,783	2030/10/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	2,700	2,300	80,577	2034/10/11
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	2,300	2,053	71,905	2027/10/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.8500	2,300	2,148	75,259	2029/07/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.7000	3,000	2,988	104,678	2032/02/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	4.2500	2,300	1,833	64,226	2036/04/28
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5000	2,000	1,937	67,857	2025/11/25
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.2500	3,100	3,375	118,207	2032/09/29
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.7500	2,700	2,928	102,585	2028/10/30
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	8.0000	2,700	2,877	100,795	2030/04/29
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.9000	2,600	2,847	99,734	2038/02/24
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2000	1,400	1,429	50,083	2026/10/28
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2000	2,300	2,370	83,013	2033/10/30
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.3500	2,500	2,602	91,138	2031/04/28
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.2000	1,800	1,844	64,613	2027/05/31
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	7.1000	1,000	1,018	35,666	2034/07/31
	ROMANIA GOVERNMENT BOND	国債証券	6.3000	200	199	6,975	2029/04/25
通貨小計	銘柄数	25銘柄					
	金額			58,300	56,761	1,988,036	
中国	China Government Bond	国債証券	3.2200	千オフショア・人民元 3,700	千オフショア・人民元 3,785	83,655	2025/12/06
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	5,078	112,223	2028/11/22
	China Government Bond	国債証券	3.2900	5,900	6,275	138,662	2029/05/23
	China Government Bond	国債証券	3.2500	4,800	4,952	109,432	2026/06/06
	China Government Bond	国債証券	3.1200	4,200	4,342	95,955	2026/12/05
	China Government Bond	国債証券	3.1300	5,700	6,021	133,060	2029/11/21
	China Government Bond	国債証券	2.8500	4,800	4,941	109,187	2027/06/04
	China Government Bond	国債証券	2.6800	4,000	4,123	91,106	2030/05/21
	China Government Bond	国債証券	1.9900	6,500	6,521	144,110	2025/04/09
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,129	157,536	2025/10/22
	China Government Bond	国債証券	3.2800	5,000	5,250	116,024	2027/12/03
	China Government Bond	国債証券	3.2700	6,300	6,761	149,400	2030/11/19
	China Government Bond	国債証券	3.0300	3,900	3,992	88,224	2026/03/11

## 新興国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	期末		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
	China Government Bond	国債証券	3.8100	千オフショア・人民元 5,800	千オフショア・人民元 7,171	158,461	2050/09/14
	China Government Bond	国債証券	3.0100	5,000	5,206	115,036	2028/05/13
	China Government Bond	国債証券	3.7200	2,000	2,447	54,073	2051/04/12
	China Government Bond	国債証券	3.0200	7,000	7,391	163,335	2031/05/27
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	4,500	4,591	101,456	2026/08/12
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.9100	1,800	1,867	41,265	2028/10/14
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.5300	2,000	2,379	52,569	2051/10/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8900	3,500	3,668	81,057	2031/11/18
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3700	2,800	2,838	62,728	2027/01/20
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,000	3,114	68,809	2032/02/17
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,500	3,623	80,071	2029/03/24
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4800	2,200	2,239	49,479	2027/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.3200	2,000	2,302	50,877	2052/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7600	2,500	2,593	57,303	2032/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7500	3,600	3,723	82,265	2029/06/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5000	3,700	3,770	83,313	2027/07/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6900	3,000	3,095	68,401	2032/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	3,900	3,923	86,699	2025/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	1,600	1,640	36,245	2032/09/01
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,300	3,396	75,041	2029/09/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4400	3,200	3,254	71,921	2027/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1200	1,200	1,334	29,484	2052/10/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,700	3,855	85,183	2032/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2800	3,000	3,026	66,876	2025/11/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.7900	3,000	3,112	68,773	2029/12/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6400	3,200	3,278	72,450	2028/01/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4600	2,600	2,631	58,146	2026/02/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8800	2,500	2,620	57,894	2033/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.8000	3,700	3,836	84,776	2030/03/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,300	3,378	74,652	2028/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.1900	2,200	2,509	55,441	2053/04/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	3,200	3,309	73,123	2033/05/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6200	3,000	3,082	68,122	2030/06/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.4000	3,000	3,046	67,326	2028/07/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5200	1,000	1,017	22,483	2033/08/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.1800	4,500	4,543	100,389	2026/08/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6000	4,700	4,824	106,594	2030/09/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	2,000	2,222	49,102	2053/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5500	4,000	4,088	90,351	2028/10/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3900	3,000	3,043	67,247	2026/11/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.6700	2,400	2,472	54,641	2033/11/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.5400	4,300	4,403	97,311	2030/12/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.0400	4,000	4,025	88,945	2027/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.3500	5,500	5,519	121,962	2034/02/25
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	1.8500	1,500	1,502	33,206	2027/05/15
	CHINA GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2700	1,300	1,303	28,808	2034/05/25
通貨小計	銘柄数	59銘柄					
	金額			212,300	221,406	4,892,292	
マレーシア				千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット		
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.0700	4,650	4,712	161,253	2026/09/30
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.2580	1,800	1,837	62,886	2027/07/26
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.3690	4,400	4,527	154,918	2028/10/31
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1280	1,900	1,916	65,598	2025/08/15
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	4.1300	3,700	3,778	129,285	2029/07/09
	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.7260	4,200	4,221	144,463	2026/03/31

新興国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

区分		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	
マレーシア	マレーシア	Malaysia Government Investment Issue	国債証券	%	千マレーシア・リンギット	千円	
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4650	5,100	5,013	171,554
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4220	4,450	4,435	151,769
		Malaysia Government Investment Issue	国債証券	3.4470	3,700	3,521	120,513
		MALAYSIA T-BILL	国債証券	4.4170	3,300	3,443	117,849
		MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE	国債証券	3.9900	3,800	3,832	131,140
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5020	3,650	3,648	124,837
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7330	3,850	3,868	132,396
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9550	4,350	4,383	150,008
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2540	3,100	3,185	109,018
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9000	4,300	4,347	148,781
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8990	3,820	3,864	132,242
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.7620	4,300	4,633	158,565
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8820	2,800	2,811	96,219
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6420	4,200	4,454	152,430
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.8930	4,450	4,874	166,821
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.9060	3,500	3,534	120,935
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8850	4,350	4,397	150,486
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.9210	2,750	3,045	104,230
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.8280	3,000	2,990	102,325
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.7570	4,400	4,246	145,308
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.0650	4,300	4,193	143,508
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	2.6320	4,400	4,097	140,203
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5820	3,100	3,044	104,178
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1930	3,400	3,481	119,141
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6960	4,100	4,406	150,794
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.5040	1,000	1,037	35,498
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5990	3,900	3,897	133,384
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2910	3,500	3,579	122,487
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.6620	1,400	1,501	51,379
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.2450	3,600	3,697	126,522
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4570	3,150	3,273	112,017
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	3.5190	2,300	2,294	78,516
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.4670	4,900	5,159	176,572
		MALAYSIAN GOVERNMENT	国債証券	4.1800	700	705	24,154
通貨小計	銘柄数	40銘柄					
	金額				141,570	143,898	4,924,200
南アフリカ		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	10.5000	66,150	68,875	608,169
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.2500	17,720	12,023	106,171
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	6.5000	16,280	10,163	89,744
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	7.0000	35,040	29,686	262,132
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	82,020	62,433	551,288
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.5000	58,800	47,072	415,648
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.0000	67,200	62,228	549,478
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.7500	47,700	36,542	322,674
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.2500	64,200	56,605	499,823
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	8.8750	61,700	53,160	469,409
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	9.0000	49,400	39,707	350,619
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	国債証券	11.6250	9,500	9,413	83,121
通貨小計	銘柄数	12銘柄					
	金額				575,710	487,914	4,308,281
タイ		Thailand Government Bond	国債証券	4.8750	48,050	53,383	234,885
		Thailand Government Bond	国債証券	3.8500	37,610	38,393	168,931

## 新興国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

区分		銘柄	種類	年利率	額面金額	当期末		償還年月日					
						外貨建金額	邦貨換算金額						
THAILAND GOVERNMENT BOND	Thailand Government Bond	国債証券	%	千タイ・バーツ	千円	千タイ・バーツ	千円	2031/06/20					
						3.6500	41,807	183,955					
						3.4000	36,508	160,636					
						2.1250	48,400	211,769					
						3.7750	48,500	230,499					
						2.8750	34,900	141,344					
						2.8750	44,500	199,428					
						3.3000	56,500	259,051					
						1.6000	38,500	161,780					
						1.6000	20,500	80,318					
						0.9500	43,000	186,738					
						1.5850	40,900	159,341					
						2.0000	66,500	280,776					
						2.0000	29,000	107,615					
						1.0000	61,000	257,918					
						2.6500	56,000	248,647					
						3.3900	48,500	225,077					
						2.3500	43,500	191,363					
						3.4500	39,000	176,857					
						3.3500	49,000	204/06/17					
						2.2500	50,000	227,093					
						2.4000	37,000	203/03/17					
						2.8000	21,000	162,272					
							21,202	2029/03/17					
通貨小計	銘柄数	24銘柄											
		金額			1,035,660	1,038,378	4,568,866						
ペルー		Peru Government Bond	国債証券	6.3500	千ペニー・ソル	千ペニー・ソル	千ペニー・ソル	2028/08/12					
						2,270	2,334	99,108					
						6,1500	3,231	137,222					
						5,9400	3,400	145,208					
						5,4000	2,850	2029/02/12					
						5,3500	1,500	51,436					
						PERU GOVERNMENT BOND	7,3000	169,874					
						Peru Government Bond	8,2000	2033/08/12					
						Peru Government Bond	8,725	32,589					
						Peru Government Bond	6,9000	2026/08/12					
						Peru Government Bond	4,465	2037/08/12					
						Peru Government Bond	6,9500	2031/08/12					
通貨小計	銘柄数	9銘柄											
		金額			26,330	25,739	1,092,820						
ポーランド		Poland Government Bond	国債証券	2.5000	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	2026/07/25					
						9,190	8,712	354,522					
						2,5000	6,016	244,825					
						2,7500	9,468	385,321					
						0,7500	5,550	218,944					
						Poland Government Bond	1,2500	2025/04/25					
						Poland Government Bond	0,2500	2030/10/25					
						POLAND GOVERNMENT BOND	1,7500	229,003					
						POLAND GOVERNMENT BOND	8,150	2026/10/25					
						POLAND GOVERNMENT BOND	6,150	250,917					
						POLAND GOVERNMENT BOND	3,7500	2032/04/25					
						POLAND GOVERNMENT BOND	5,885	2027/05/25					
						POLAND GOVERNMENT BOND	7,5000	409,141					
						POLAND GOVERNMENT BOND	—	2028/07/25					
						POLAND GOVERNMENT BOND	4,350	2025/10/25					
						POLAND GOVERNMENT BOND	6,0000	2033/10/25					
						POLAND GOVERNMENT BOND	4,7500	2029/07/25					
						POLAND GOVERNMENT BOND	5,0000	2034/10/25					
						Poland Government Bond	2,7500	2028/04/25					
						Poland Government Bond	3,2500	2025/07/25					
通貨小計	銘柄数	15銘柄											
		金額			104,180	96,204	3,914,876						

新興国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

区分	銘柄	種類	年利率	額面金額	当期		償還月日
					評価額	外貨建金額	
ハンガリー	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	千ハンガリー・フォント 270,000	千ハンガリー・フォント 240,985	106,877	2027/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	2.7500	130,000	118,800	52,688	2026/12/22
	Hungary Government Bond	国債証券	6.7500	443,000	443,208	196,563	2028/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	225,000	183,640	81,444	2030/08/21
	Hungary Government Bond	国債証券	3.2500	272,000	218,105	96,730	2031/10/22
	Hungary Government Bond	国債証券	1.0000	270,000	250,857	111,255	2025/11/26
	Hungary Government Bond	国債証券	3.0000	202,000	132,697	58,851	2038/10/27
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	224,000	205,266	91,036	2026/04/22
	Hungary Government Bond	国債証券	2.0000	135,000	109,119	48,394	2029/05/23
	Hungary Government Bond	国債証券	2.2500	315,000	222,226	98,557	2033/04/20
	Hungary Government Bond	国債証券	1.5000	100,000	90,149	39,981	2026/08/26
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	3.0000	240,000	149,834	66,451	2041/04/25
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	2.2500	75,000	50,716	22,492	2034/06/22
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	4.5000	100,000	92,834	41,172	2028/03/23
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	4.7500	235,000	204,482	90,688	2032/11/24
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	9.5000	110,000	116,367	51,609	2026/10/21
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	国債証券	7.0000	90,000	90,852	40,293	2035/10/24
	Hungary Government Bond	国債証券	5.5000	282,500	280,005	124,183	2025/06/24
通貨小計	銘柄数	18銘柄					
	金額			3,718,500	3,200,150	1,419,273	
ウルグアイ	Uruguay Government International Bond Uruguay Government International Bond 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 2,744	11,021	2028/03/15
		国債証券	8.2500	12,000	11,124	44,676	2031/05/21
		国債証券	9.7500	11,000	11,016	44,244	2033/07/20
通貨小計	銘柄数	3銘柄					
	金額			25,800	24,884	99,942	
ドミニカ共和国	DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND	国債証券	13.6250	千ドミニカ・ペソ 11,400	千ドミニカ・ペソ 13,503	36,820	2033/02/03
		国債証券	11.2500	12,500	13,230	36,074	2035/09/15
通貨小計	銘柄数	2銘柄					
	金額			23,900	26,733	72,895	
合計	銘柄数	336銘柄					
	金額					48,898,647	

(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て。

## ■投資信託財産の構成

2024年7月5日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
千円		%
公社債	48,898,647	95.9
コール・ローン等、その他	2,095,956	4.1
投資信託財産総額	50,994,603	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=161.17円、1エジプト・ポンド=3.352円、1トルコ・リラ=4.938円、  
1メキシコ・ペソ=8.919円、1アルゼンチン・ペソ=0.176円、100チリ・  
ペソ=17.217円、100コロンビア・ペソ=3.937円、1インド・ルピー=1.94円、100インドネシア・ルピア=0.99円、1ブラジル・レアル=29.358  
円、1チェコ・コルナ=6.934円、1ルーマニア・レイ=35.024円、1オフ  
ショア・人民元=22.096円、1マレーシア・リンギット=34.219円、1南  
アフリカ・ランド=8.83円、1タイ・バーツ=4.40円、1ペルー・ソル=  
42.457円、1ポーランド・ズロチ=40.693円、100ハンガリー・フォリント  
=44.35円、1ウルグアイ・ペソ=4.016円、1ドミニカ・ペソ=2.726円で  
す。

(注3) 当期末における外貨建純資産(49,724,916千円)の投資信託財産総額  
(50,994,603千円)に対する比率は、97.5%です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年7月5日現在

項目	当期末
(A) 資産	51,284,109,571円
コール・ローン等	1,283,056,398
公社債（評価額）	48,898,647,009
未収入金	305,801,413
未収利息	718,836,181
前払費用	77,768,570
(B) 負債	1,260,233,684
未払金	1,211,701,319
未払解約金	48,526,425
その他未払費用	5,940
(C) 純資産総額（A-B）	50,023,875,887
元本	25,673,892,724
次期繰越損益金	24,349,983,163
(D) 受益権総口数	25,673,892,724□
1万口当たり基準価額（C/D）	19,484円

\*期首における元本額は21,584,689,967円、当造成期間中における追加設定元本額  
は4,952,885,960円、同解約元本額は863,683,203円です。

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

新興国債券インデックスファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）	566,573,779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）	471,719,952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）	554,580,579円
D—I's 新興国債券インデックス	68,244,463円
i Free 新興国債券インデックス	9,163,794,594円
i Free 8 資産バランス	4,957,148,762円
ダイワ新興国債券インデックス（為替ヘッジなし）（投資一任専用）	5,424,061円
DCダイワ新興国債券インデックスファンド	9,723,288,730円
スタイル9（8資産分散・保守型）	34,302円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	757,476円
スタイル9（8資産分散・積極型）	905,888円
ダイワ・インデックスセレクト 新興国債券	122,575,478円
ダイワ・ノーロード 新興国債券ファンド	38,844,660円

\*当期末の計算口数当りの純資産額は19,484円です。

# 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)

## ■損益の状況

当期 自 2023年 7月 6日 至 2024年 7月 5日

項目	当期
(A)配当等収益	2,535,809,448円
受取利息	2,535,873,185
その他収益金	6,746
支払利息	△ 70,483
(B)有価証券売買損益	3,178,756,572
売買益	4,353,709,694
売買損	△ 1,174,953,122
(C)その他費用	△ 35,631,088
(D)当期損益金 (A + B + C)	5,678,934,932
(E)前期繰越損益金	15,380,943,998
(F)解約差損益金	△ 683,369,721
(G)追加信託差損益金	3,973,473,954
(H)合計 (D + E + F + G)	24,349,983,163
次期繰越損益金 (H)	24,349,983,163

(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。